



LDB
EMPRESAS

LINHARES
JANEIRO 2020



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 20.03.2020.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 90,02%

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

| Emissor | Título Público | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira |
|--|--------------------------|---------------------|-----------------|-----------------|---------------------|-------------|
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150535 (3,200000%) | 3,14 | 1,43 | 1,43 | 957.916,35 | 0,33 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150535 (4,410000%) | 20,93 | 1,53 | 1,53 | 1.021.195,15 | 0,35 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea a | | 14,25 | 1,48 | 1,48 | 1.979.111,50 | 0,68 |

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--|----------|--|---------------------|-----------------|-----------------|-----------------------|--------------|-------------------|---------|
| BANESTES | BANESTES | BANESTES PREVIDENCIARIO FI RENDA FIXA IMA-B | 7,90 | 0,55 | 0,55 | 35.133.834,47 | 12,16 | 304.786.097,11 | 11,53 |
| BB | BB | BB PREVID RF IRF-M1 | 0,26 | 0,42 | 0,42 | 13.799.047,39 | 4,78 | 7.374.284.212,96 | 0,19 |
| BB | BB | BB PREV IMAB TPB | 4,90 | 0,26 | 0,26 | 16.835.270,63 | 5,83 | 6.477.324.446,92 | 0,26 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO | 4,91 | 0,25 | 0,25 | 17.135.606,69 | 5,93 | 6.604.088.892,56 | 0,26 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF | 0,25 | 0,42 | 0,42 | 26.101.717,66 | 9,03 | 10.529.932.746,92 | 0,25 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO | 1,97 | 0,54 | 0,54 | 9.158.160,62 | 3,17 | 9.706.276.068,00 | 0,09 |
| BB | BB | BB PREV RF IDKA2 | 1,49 | 0,38 | 0,38 | 6.012.102,85 | 2,08 | 6.900.045.813,02 | 0,09 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP | 2,93 | 1,08 | 1,08 | 2.143.497,11 | 0,74 | 2.361.861.808,09 | 0,09 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP | 1,50 | 0,46 | 0,46 | 8.909.037,21 | 3,08 | 8.791.015.868,25 | 0,10 |
| BB | BB | BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI | 1,97 | 0,56 | 0,56 | 6.169.777,03 | 2,14 | 4.489.872.848,79 | 0,14 |
| BANESTES | BANESTES | Banestes Referencial FI Renda Fixa IRF-M 1 | 1,37 | 0,72 | 0,72 | 14.759.127,24 | 5,11 | 197.821.718,73 | 7,46 |
| BB | BB | BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI | 2,21 | 0,53 | 0,53 | 4.001.563,19 | 1,38 | 561.150.881,50 | 0,71 |
| BB | BB | BB PREV ALOC FIC | 2,35 | 0,49 | 0,49 | 11.848.016,83 | 4,10 | 10.446.730.359,40 | 0,11 |
| CEF | CEF | FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF | 3,67 | 0,82 | 0,82 | 1.315.065,10 | 0,46 | 10.136.705.212,45 | 0,01 |
| CEF | CEF | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | 0,83 | -0,03 | -0,03 | 838.618,41 | 0,29 | 1.019.720.781,29 | 0,08 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b | | | 2,41 | 0,45 | 0,45 | 174.160.442,43 | 60,27 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|---|----------|---|---------------------|-----------------|-----------------|-----------------------|--------------|------------------|---------|
| BANESTES | BANESTES | FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP | 0,36 | 0,34 | 0,34 | 18.790.200,53 | 6,50 | 512.423.860,26 | 3,67 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP | 0,09 | 0,39 | 0,39 | 1.118.600,46 | 0,39 | 3.449.563.810,54 | 0,03 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,06 | 0,37 | 0,37 | 11.827.465,49 | 4,09 | 5.345.385.558,02 | 0,22 |
| BANESTES | BANESTES | Banestes Institucional FI Renda Fixa | 7,51 | 0,74 | 0,74 | 16.506.861,16 | 5,71 | 354.602.133,24 | 4,66 |
| BB | BB | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,05 | 0,35 | 0,35 | 28.865.446,43 | 9,99 | 2.903.514.199,57 | 0,99 |
| BANESTES | BANESTES | BANESTES ESTRATEGIA FIC DE FI RF | 2,59 | 0,62 | 0,62 | 6.872.227,46 | 2,38 | 216.119.068,94 | 3,18 |
| Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a | | | 0,96 | 0,45 | 0,45 | 83.980.801,53 | 29,06 | | |
| Renda Fixa | | | 1,99 | 0,46 | 0,46 | 260.120.355,46 | 90,02 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

9,98%

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|---|----------|--|---------------------|-----------------|-----------------|----------------------|-------------|----------------|---------|
| CEF | CEF | FI ACOES CAIXA DIVIDENDOS | 14,74 | 1,50 | 1,50 | 1.991.706,81 | 0,69 | 339.946.954,65 | 0,59 |
| VINCI | CEF | FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS | 15,73 | 1,53 | 1,53 | 17.531.577,79 | 6,07 | 943.947.729,59 | 1,86 |
| BANESTES | BANESTES | Banestes FIC de FI Acoes BTG Pactual Absoluto Inst | 16,45 | 2,03 | 3,36 | 6.580.788,34 | 2,28 | 132.732.358,95 | 4,96 |
| Sub-total Artigo 8º II, Alínea a | | | 15,26 | 1,71 | 1,71 | 26.104.072,94 | 9,03 | | |

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--------------------------------|--------|---|---------------------|-----------------|-----------------|---------------------|-------------|------------------|---------|
| CEF | CEF | FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO | 5,38 | -0,25 | -0,25 | 2.735.149,15 | 0,95 | 3.249.056.142,28 | 0,08 |
| Sub-total Artigo 8º III | | | 5,38 | -0,25 | -0,25 | 2.735.149,15 | 0,95 | | |

| | | | | | | | | | |
|--|--|--|--------------|-------------|-------------|-----------------------|---------------|--|--|
| Renda Variável e Investimentos Estruturados | | | 14,08 | 1,43 | 1,43 | 28.839.222,09 | 9,98 | | |
| Total | | | | | | 288.959.577,55 | 100,00 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

| Artigo | Tipo de Ativo | Valor(R\$) | % Carteira | Política de Investimentos | | | |
|--|--|-----------------------|--------------|---------------------------|----------|--------|--------------|
| | | | | Mínimo | Objetivo | Máximo | Limite Legal |
| Renda Fixa | | | | | | | |
| Artigo 7º I, Alínea a | Títulos do Tesouro Nacional | 1.979.111,50 | 0,68 | | | | 100,00 |
| Artigo 7º I, Alínea b | Fundos 100% Títulos Públicos | 174.160.442,43 | 60,27 | | | | 100,00 |
| Artigo 7º IV, Alínea a | Fundos de Renda Fixa | 83.980.801,53 | 29,06 | | | | 40,00 |
| | Total Renda Fixa | 260.120.355,46 | 90,02 | | | | |
| Renda Variável e Investimentos Estruturados | | | | | | | |
| Artigo 8º II, Alínea a | Fundos de Ações | 26.104.072,94 | 9,03 | | | | 20,00 |
| Artigo 8º III | Fundos Multimercados | 2.735.149,15 | 0,95 | | | | 10,00 |
| | Total Renda Variável e Investimentos Estruturados | 28.839.222,09 | 9,98 | | | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

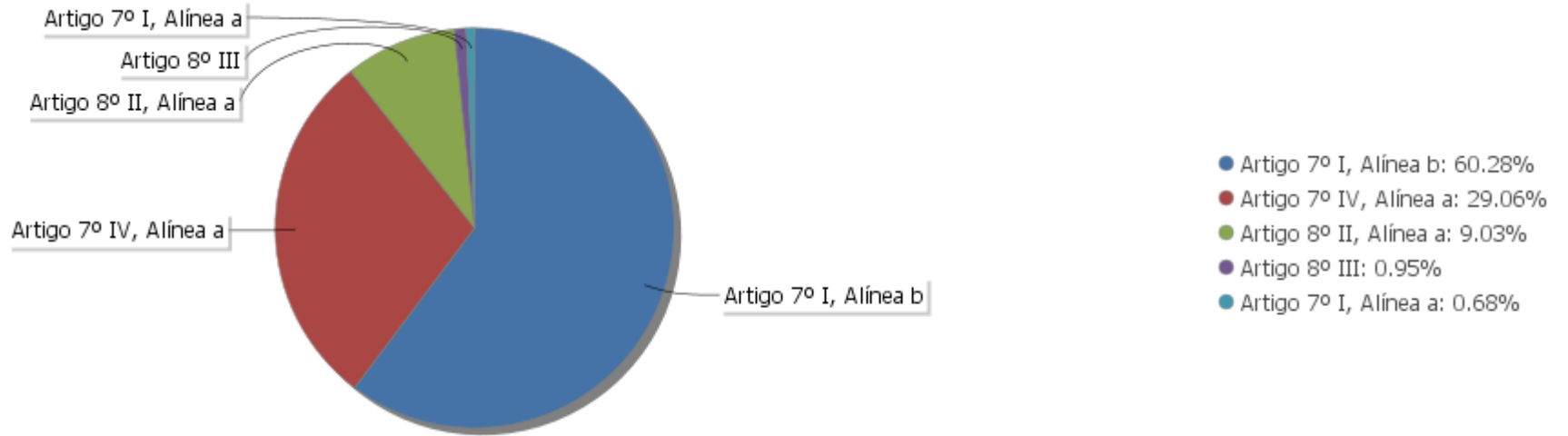
| Estratégia Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | No Mês(R\$) | No Ano(R\$) |
|--|----------------|----------------|----------------|----------------|-----------------|--------------|--------------|
| Artigo 7º I, Alínea a % do CDI | 1,48 393,46 | 1,48 393,46 | 3,10 273,04 | 8,95 343,54 | | 28.899,15 | 28.899,15 |
| Artigo 7º I, Alínea b % do CDI | 0,45 118,93 | 0,45 118,93 | 0,32 28,41 | 4,68 179,81 | 13,88 239,87 | 766.194,88 | 766.194,88 |
| Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI | 0,45 119,11 | 0,45 119,11 | 0,56 49,70 | 3,10 119,11 | 6,50 112,41 | 374.990,65 | 374.990,65 |
| Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p. | 1,71 3,34 | 1,71 3,34 | 11,31 5,21 | 17,45 5,71 | 30,12 13,32 | 267.893,69 | 267.893,69 |
| Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p. | -0,25 1,38 | -0,25 1,38 | 3,09 -3,01 | 6,01 -5,73 | 9,71 -7,09 | -6.852,27 | -6.852,27 |
| | | | | | | 1.431.126,10 | 1.431.126,10 |

Análise de Liquidez

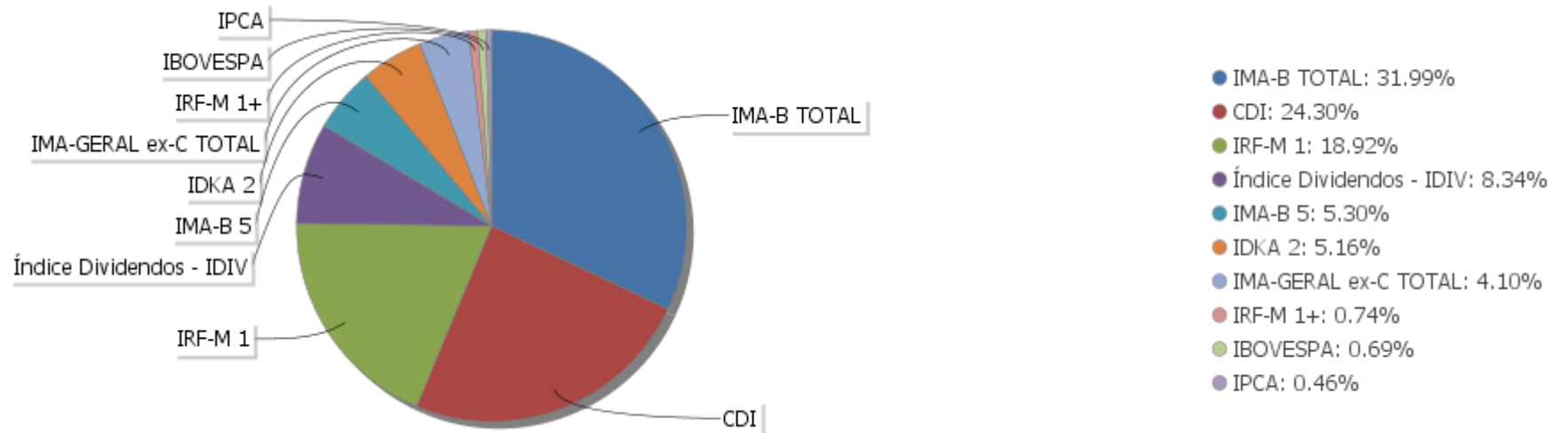
| Período | Valor (R\$) | (%) | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|----------------|-------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias | 258.027.918,32 | 89,30 | 258.027.918,32 | 89,30 |
| de 31 a 364 dias | 24.950.984,54 | 8,63 | 282.978.902,86 | 97,93 |
| acima de 365 dias | 5.980.674,69 | 2,07 | 288.959.577,55 | 100,00 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

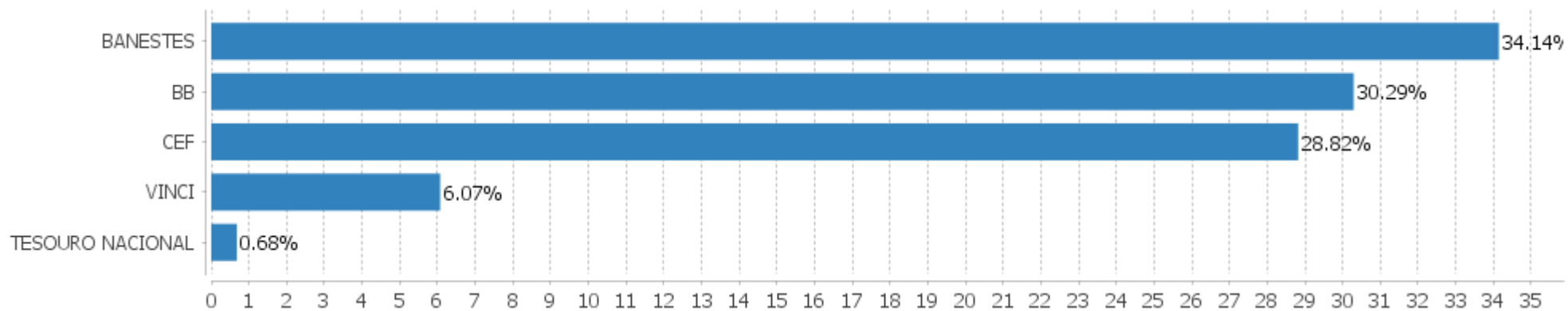


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

| Ano | Jan | Fev | Mar | Abr | Mai | Jun | Jul | Ago | Set | Out | Nov | Dez | Rent.Ano |
|----------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|------|-------|-------|------|-------|-------|----------|
| 2020 | 0,49 | | | | | | | | | | | | 0,49 |
| INPC + 6% | 0,70 | | | | | | | | | | | | 0,70 |
| p.p. indexador | -0,21 | | | | | | | | | | | | -0,21 |
| 2019 | 2,03 | 0,57 | 0,45 | 0,98 | 2,17 | 2,28 | 1,23 | -0,12 | 1,94 | 2,06 | -1,14 | 1,47 | 14,79 |
| INPC + 6% | 0,87 | 1,01 | 1,21 | 1,09 | 0,66 | 0,45 | 0,63 | 0,63 | 0,44 | 0,57 | 1,01 | 1,71 | 10,78 |
| p.p. indexador | 1,15 | -0,43 | -0,77 | -0,11 | 1,51 | 1,83 | 0,60 | -0,75 | 1,50 | 1,49 | -2,14 | -0,25 | 4,02 |
| 2018 | 3,06 | 0,59 | 0,52 | 0,09 | -2,34 | -0,08 | 1,29 | 0,01 | 0,40 | 3,08 | 0,67 | 1,06 | 8,56 |
| INPC + 6% | 0,74 | 0,60 | 0,56 | 0,70 | 0,92 | 1,92 | 0,76 | 0,53 | 0,74 | 0,91 | 0,21 | 0,60 | 9,59 |
| p.p. indexador | 2,32 | -0,01 | -0,04 | -0,60 | -3,25 | -2,00 | 0,53 | -0,53 | -0,34 | 2,17 | 0,46 | 0,46 | -1,03 |

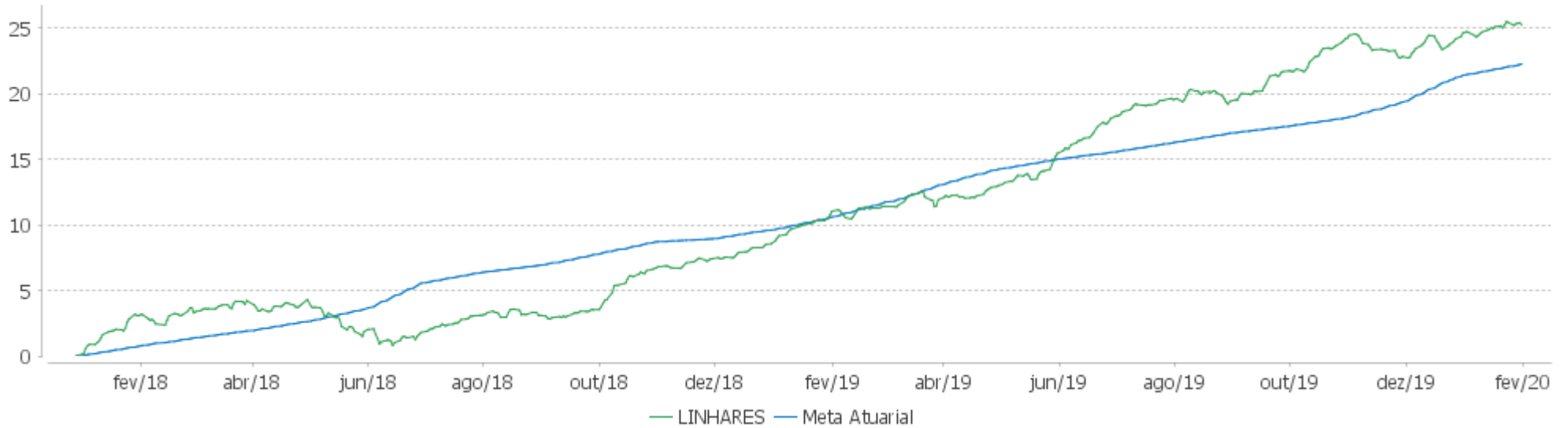
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

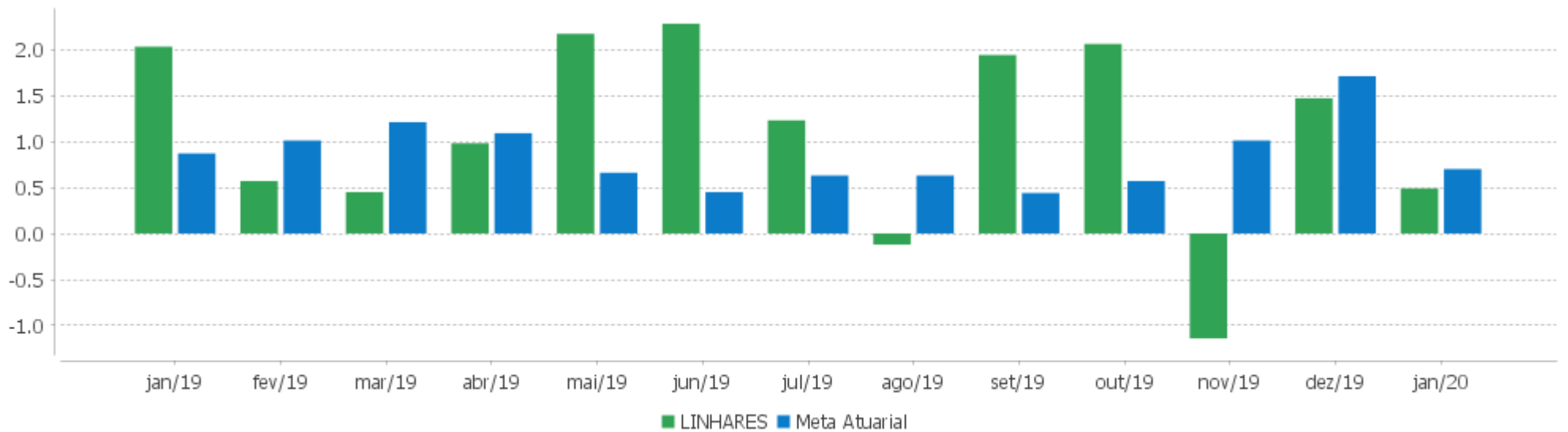
| | Quantidade | Perc. (%) | Período | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima da Meta Atuarial | 11 | 44,00 | 03 meses | 0,80 | 3,46 | -2,65 | 2,20 |
| Meses abaixo da Meta Atuarial | 14 | 56,00 | 06 meses | 4,76 | 5,16 | -0,41 | 2,17 |
| | | | 12 meses | 13,06 | 10,59 | 2,47 | 2,12 |
| | | | 24 meses | 21,51 | 21,35 | 0,16 | 2,29 |
| | | | 36 meses | | | | |
| Maior rentabilidade da Carteira | 3,08 | 2018-10 | Desde 29/12/2017 | 25,23 | 22,25 | 2,98 | 2,31 |
| Menor rentabilidade da Carteira | -2,34 | 2018-05 | | | | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

| Fundo Variação da Estratégia | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|---|----------------|----------------|----------------|---------------|----------------|-----------------|-----------------|
| FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B TOTAL p.p. | 0,25 -0,01 | 0,25 -0,01 | -0,36 -0,12 | 5,44 -0,20 | 17,72 -0,40 | 34,14 -0,64 | 53,25 -1,07 |
| FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B 5 p.p. | 0,54 -0,01 | 0,54 -0,01 | 1,41 -0,10 | 4,89 -0,15 | 11,76 -0,30 | 22,83 -0,53 | 38,27 -0,85 |
| BB PREVID RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p. | 0,42 -0,02 | 0,42 -0,02 | 1,13 -0,07 | 2,89 -0,15 | 6,33 -0,29 | 13,50 -0,54 | 24,99 -0,85 |
| BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p. | 0,56 -0,00 | 0,56 -0,00 | 1,44 -0,07 | 4,92 -0,12 | 11,82 -0,24 | 22,86 -0,50 | 38,36 -0,77 |
| BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI Var. IMA-B TOTAL p.p. | 0,53 0,27 | 0,53 0,27 | 1,43 1,67 | 4,95 -0,69 | 12,36 -5,76 | 24,12 -10,67 | 41,82 -12,50 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p. | -0,03 -0,30 | -0,03 -0,30 | 1,62 1,86 | 3,33 -2,31 | 7,50 -10,62 | 17,30 -17,48 | 25,73 -28,59 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP Var. IRF-M 1+ p.p. | 1,08 -0,04 | 1,08 -0,04 | 0,92 -0,07 | 5,12 -0,15 | 13,23 -0,34 | 27,17 -0,54 | 46,21 -1,16 |
| BANESTES PREVIDENCIARIO FI RENDA FIXA IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p. | 0,55 0,29 | 0,55 0,29 | -1,35 -1,11 | 6,31 0,67 | 25,06 6,94 | 42,79 8,00 | 64,13 9,81 |
| Banestes Referencial FI Renda Fixa IRF-M 1 Var. IRF-M 1 p.p. | 0,72 0,28 | 0,72 0,28 | 1,29 0,10 | 3,71 0,66 | 10,08 3,46 | 19,31 5,27 | 32,09 6,25 |
| BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p. | 0,38 -0,15 | 0,38 -0,15 | 1,75 -0,01 | 4,52 -0,22 | 10,29 -0,73 | 20,76 -1,68 | 35,58 -3,10 |
| BB PREV ALOC FIC Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p. | 0,49 -0,01 | 0,49 -0,01 | 0,50 -0,21 | 3,93 -0,15 | 11,38 0,31 | 22,76 0,53 | 37,70 -0,16 |
| FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF Var. IPCA p.p. | 0,82 0,61 | 0,82 0,61 | 0,91 -0,97 | 4,67 2,62 | 14,10 9,91 | 25,30 17,17 | 39,15 27,94 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP Var. IDKA 2 p.p. | 0,46 -0,08 | 0,46 -0,08 | 1,57 -0,19 | 4,44 -0,31 | 10,30 -0,72 | 20,93 -1,51 | 35,71 -2,96 |
| BB PREV IMAB TPB Var. IMA-B TOTAL p.p. | 0,26 -0,00 | 0,26 -0,00 | -0,30 -0,06 | 5,54 -0,10 | 17,83 -0,29 | 34,11 -0,67 | 53,19 -1,13 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF Var. IRF-M 1 p.p. | 0,42 -0,02 | 0,42 -0,02 | 1,14 -0,05 | 2,93 -0,11 | 6,40 -0,22 | 13,64 -0,40 | 25,20 -0,64 |
| Banestes Institucional FI Renda Fixa Var. IMA-B TOTAL p.p. | 0,74 0,47 | 0,74 0,47 | -1,49 -1,25 | 5,41 -0,23 | 23,76 5,65 | 38,46 3,67 | 58,97 4,65 |
| FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP | 0,34 | 0,34 | 0,91 | 2,48 | 5,57 | 12,15 | 22,67 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo Variação da Estratégia | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|---|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|---------------|
| % do CDI | 90,31 | 90,31 | 79,98 | 95,28 | 96,36 | 96,92 | 98,20 |
| BANESTES ESTRATEGIA FIC DE FI RF | 0,62 | 0,62 | 1,76 | 6,99 | 16,65 | | |
| % do CDI | 163,34 | 163,34 | 154,64 | 268,43 | 287,81 | | |
| BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,35 | 0,35 | 1,05 | 2,45 | 5,55 | 12,19 | 22,86 |
| % do CDI | 92,89 | 92,89 | 92,35 | 94,13 | 95,98 | 97,29 | 99,00 |
| FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP | 0,39 | 0,39 | 1,09 | 2,59 | 5,76 | 12,25 | 22,73 |
| % do CDI | 102,58 | 102,58 | 96,25 | 99,45 | 99,65 | 97,76 | 98,44 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,37 | 0,37 | 1,03 | 2,44 | 5,55 | 12,08 | 22,61 |
| % do CDI | 98,46 | 98,46 | 91,06 | 93,73 | 95,93 | 96,40 | 97,91 |
| NTN-B 150535 (4,410000%) | 1,53 | 1,53 | 7,78 | 13,89 | 18,82 | | |
| Var. IMA-B TOTAL p.p. | 1,27 | 1,27 | 8,02 | 8,25 | 0,71 | | |
| NTN-B 150535 (3,200000%) | 1,43 | 1,43 | 0,46 | 1,48 | 3,00 | | |
| Var. IMA-B TOTAL p.p. | 1,17 | 1,17 | 0,69 | -4,16 | -15,12 | | |
| FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO | -0,25 | -0,25 | 3,09 | 6,01 | 9,71 | 18,68 | 36,05 |
| % do CDI | -66,35 | -66,35 | 271,80 | 230,62 | 167,94 | 149,08 | 156,13 |
| Banestes FIC de FI Acoes BTG Pactual Absoluto Inst | 3,36 | 3,36 | 11,05 | 17,28 | 33,66 | 61,45 | 108,30 |
| Var. Índice Dividendos - IDIV p.p. | 4,95 | 4,95 | 0,26 | 0,13 | 6,65 | 10,69 | 17,15 |
| FI ACOES CAIXA DIVIDENDOS | 1,50 | 1,50 | 18,04 | 22,35 | 26,94 | 49,81 | 86,00 |
| Var. IBOVESPA p.p. | 3,13 | 3,13 | 11,93 | 10,62 | 10,13 | 15,83 | 10,09 |
| FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS | 1,53 | 1,53 | 10,76 | 17,94 | 28,52 | 51,11 | 95,52 |
| Var. Índice Dividendos - IDIV p.p. | 3,11 | 3,11 | -0,03 | 0,79 | 1,51 | 0,35 | 4,37 |
| CDI | 0,38 | 0,38 | 1,14 | 2,60 | 5,78 | 12,53 | 23,09 |
| IBOVESPA | -1,63 | -1,63 | 6,10 | 11,74 | 16,80 | 33,97 | 75,91 |
| INPC + 6% | 0,70 | 0,70 | 3,46 | 5,16 | 10,59 | 21,35 | 30,95 |
| IPCA + 6% | 0,72 | 0,72 | 3,37 | 5,14 | 10,47 | 21,46 | 32,33 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|-------------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|
| Renda Fixa | | | | | | | |
| IRF-M 1 | 0,44 | 0,44 | 1,20 | 3,05 | 6,61 | 14,04 | 25,84 |
| IRF-M 1+ | 1,11 | 1,11 | 0,99 | 5,27 | 13,57 | 27,70 | 47,38 |
| IRF-M TOTAL | 0,88 | 0,88 | 1,04 | 4,50 | 11,47 | 23,54 | 40,94 |
| IMA-B 5 | 0,56 | 0,56 | 1,51 | 5,04 | 12,06 | 23,36 | 39,12 |
| IMA-B 5+ | 0,03 | 0,03 | -1,54 | 6,07 | 22,33 | 43,41 | 65,98 |
| IMA-B TOTAL | 0,26 | 0,26 | -0,24 | 5,64 | 18,11 | 34,79 | 54,32 |
| IMA-C TOTAL | 2,54 | 2,54 | 1,76 | 6,14 | 20,05 | 38,88 | 56,63 |
| IMA-GERAL ex-C TOTAL | 0,50 | 0,50 | 0,70 | 4,08 | 11,07 | 22,22 | 37,86 |
| IMA-GERAL TOTAL | 0,56 | 0,56 | 0,73 | 4,13 | 11,32 | 22,68 | 38,34 |
| IDKA 2 | 0,54 | 0,54 | 1,76 | 4,74 | 11,02 | 22,45 | 38,67 |
| IDKA 20 | -1,37 | -1,37 | -3,65 | 5,34 | 28,11 | 57,81 | 85,76 |
| CDI | 0,38 | 0,38 | 1,14 | 2,60 | 5,78 | 12,53 | 23,09 |
| Renda Variável | | | | | | | |
| IBOVESPA | -1,63 | -1,63 | 6,10 | 11,74 | 16,80 | 33,97 | 75,91 |
| IBRX 100 | -1,25 | -1,25 | 6,95 | 12,64 | 18,97 | 37,28 | 80,87 |
| IBRX 50 | -1,88 | -1,88 | 5,44 | 10,57 | 14,75 | 29,92 | 71,82 |
| SMALL CAP | 0,45 | 0,45 | 18,98 | 24,82 | 45,25 | 64,69 | 130,34 |
| IFIX | -3,76 | -3,76 | 10,22 | 15,71 | 27,70 | 34,66 | 59,06 |
| Índice Consumo - ICON | | | 15,32 | 21,23 | 43,29 | 43,57 | 87,57 |
| Índice Dividendos - IDIV | -1,58 | -1,58 | 10,79 | 17,15 | 27,01 | 50,76 | 91,15 |
| Indicadores Econômicos | | | | | | | |
| IPCA | 0,21 | 0,21 | 1,88 | 2,05 | 4,19 | 8,13 | 11,21 |
| INPC | 0,19 | 0,19 | 1,96 | 2,07 | 4,30 | 8,03 | 10,05 |
| IGPM | 0,48 | 0,48 | 2,89 | 2,88 | 7,82 | 15,10 | 14,63 |
| SELIC | 0,38 | 0,38 | 1,14 | 2,60 | 5,78 | 12,54 | 23,11 |
| Meta Atuarial | | | | | | | |
| IPCA + 4% | 0,55 | 0,55 | 2,88 | 4,12 | 8,38 | 16,93 | 25,02 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|--------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|
| IPCA + 5% | 0,64 | 0,64 | 3,13 | 4,63 | 9,42 | 19,19 | 28,64 |
| IPCA + 5,5% | 0,68 | 0,68 | 3,25 | 4,89 | 9,95 | 20,32 | 30,48 |
| IPCA + 5,89% | 0,71 | 0,71 | 3,35 | 5,09 | 10,35 | 21,21 | 31,93 |
| IPCA + 6% | 0,72 | 0,72 | 3,37 | 5,14 | 10,47 | 21,46 | 32,33 |
| INPC + 4% | 0,53 | 0,53 | 2,96 | 4,14 | 8,49 | 16,82 | 23,71 |
| INPC + 6% | 0,70 | 0,70 | 3,46 | 5,16 | 10,59 | 21,35 | 30,95 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

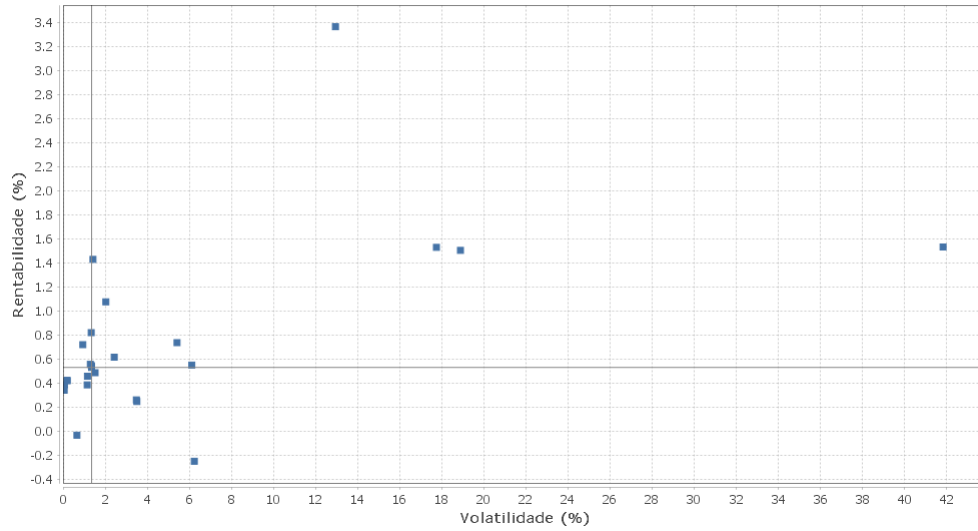
Movimentações

| Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|------------|---|---------------|---------------|--------------------|--------------|
| 03/01/2020 | FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO | 0,00 | 13.944.563,85 | 4.015.998,79098672 | 3,4722530000 |
| 06/01/2020 | FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS | 13.973.567,40 | 0,00 | 6.491.028,17743436 | 2,1527510000 |
| 07/01/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00 | 29.003,55 | 7.938,21594286 | 3,6536610000 |
| 20/01/2020 | BANESTES PREVIDENCIARIO FI RENDA FIXA IMA-B | 0,00 | 57.558,20 | 13.896,09568195 | 4,1420411400 |
| 23/01/2020 | BANESTES PREVIDENCIARIO FI RENDA FIXA IMA-B | 0,00 | 65.729,22 | 15.840,49866337 | 4,1494413400 |
| 30/01/2020 | BB PREV ALOC FIC | 148.956,80 | 0,00 | 101.912,70104723 | 1,4616117370 |
| 31/01/2020 | BANESTES PREVIDENCIARIO FI RENDA FIXA IMA-B | 0,00 | 8.752,00 | 2.099,00292660 | 4,1695987600 |

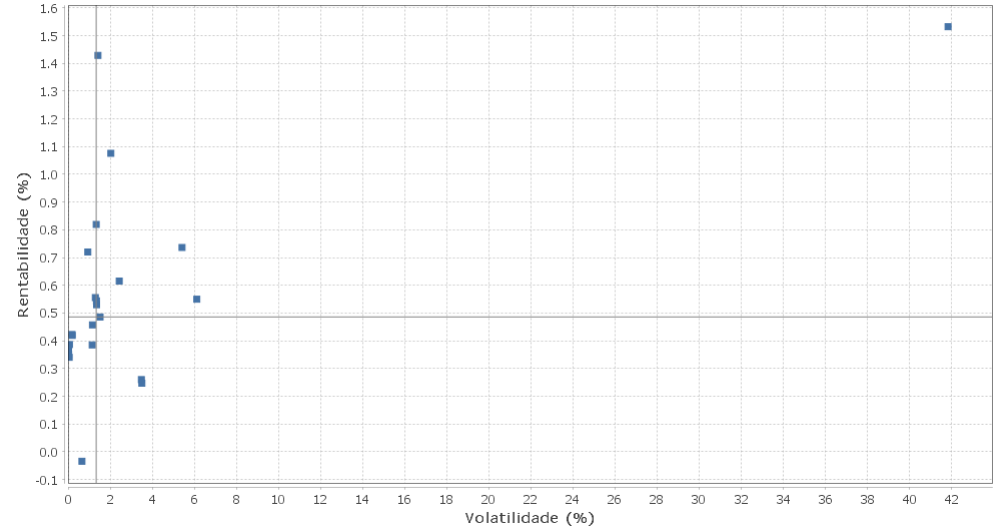
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

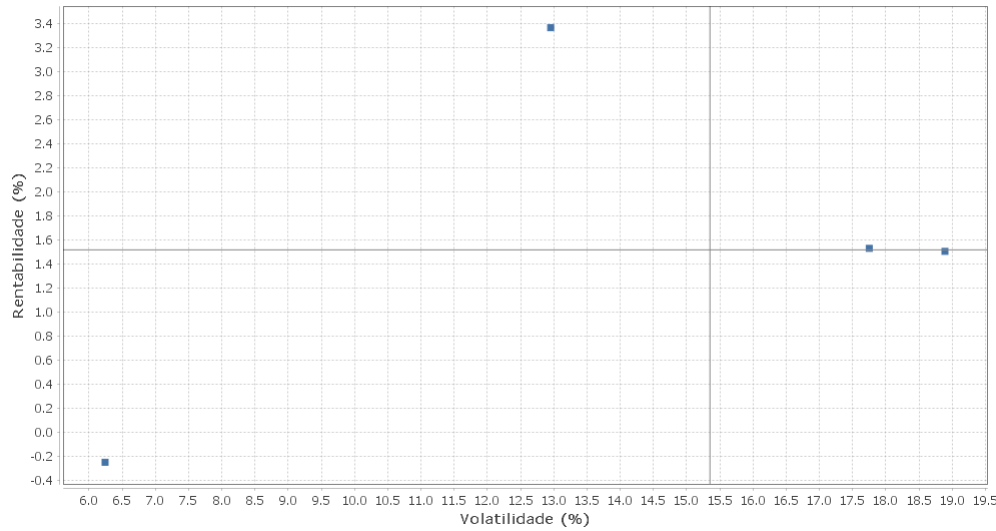
LINHARES - No Mês



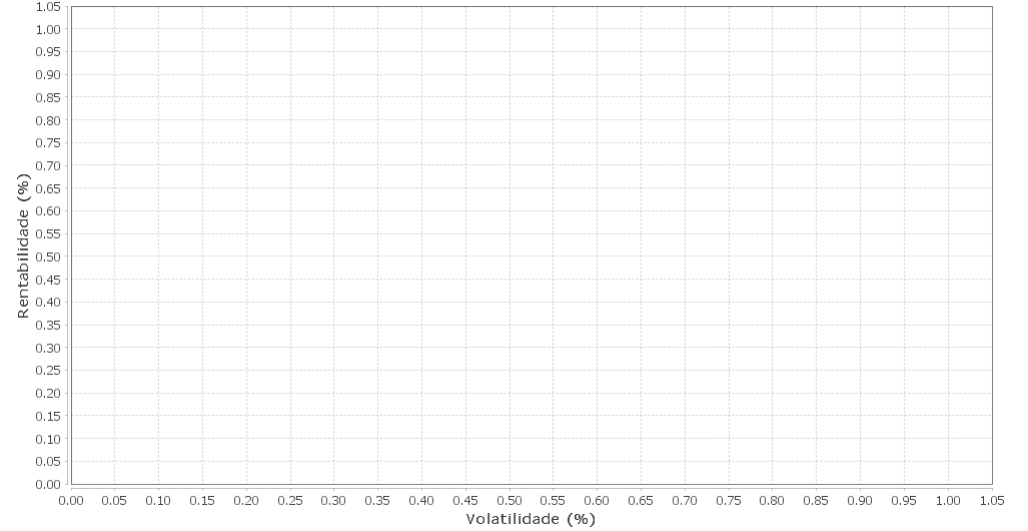
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Estratégia | Volatilidade | VaR | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|------------------------|--------------|------|-------|---------------|------------|
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,03 | 0,02 | 0,37 | 11.827.465,49 | 4,09 |
| BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,03 | 0,02 | 0,35 | 28.865.446,43 | 9,99 |
| FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,05 | 0,02 | 0,34 | 18.790.200,53 | 6,50 |
| FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,07 | 0,02 | 0,39 | 1.118.600,46 | 0,39 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF | Artigo 7º I, Alínea b | 0,19 | 0,04 | 0,42 | 26.101.717,66 | 9,03 |
| BB PREVID RF IRF-M1 | Artigo 7º I, Alínea b | 0,19 | 0,04 | 0,42 | 13.799.047,39 | 4,78 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | Artigo 7º I, Alínea b | 0,66 | 0,07 | -0,03 | 838.618,41 | 0,29 |
| Banestes Referencial FI Renda Fixa IRF-M 1 | Artigo 7º I, Alínea b | 0,94 | 0,13 | 0,72 | 14.759.127,24 | 5,11 |
| BB PREV RF IDKA2 | Artigo 7º I, Alínea b | 1,15 | 0,14 | 0,38 | 6.012.102,85 | 2,08 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 1,16 | 0,14 | 0,46 | 8.909.037,21 | 3,08 |
| BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI | Artigo 7º I, Alínea b | 1,30 | 0,16 | 0,56 | 6.169.777,03 | 2,14 |
| FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF | Artigo 7º I, Alínea b | 1,34 | 0,18 | 0,82 | 1.315.065,10 | 0,46 |
| FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO | Artigo 7º I, Alínea b | 1,35 | 0,16 | 0,54 | 9.158.160,62 | 3,17 |
| BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI | Artigo 7º I, Alínea b | 1,36 | 0,16 | 0,53 | 4.001.563,19 | 1,38 |
| NTN-B 150535 (3,200000%) | Artigo 7º I, Alínea a | 1,42 | 0,21 | 1,43 | 957.916,35 | 0,33 |
| BB PREV ALOC FIC | Artigo 7º I, Alínea b | 1,52 | 0,18 | 0,49 | 11.848.016,83 | 4,10 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 2,03 | 0,26 | 1,08 | 2.143.497,11 | 0,74 |
| BANESTES ESTRATEGIA FIC DE FI RF | Artigo 7º IV, Alínea a | 2,43 | 0,28 | 0,62 | 6.872.227,46 | 2,38 |
| BB PREV IMAB TPB | Artigo 7º I, Alínea b | 3,48 | 0,37 | 0,26 | 16.835.270,63 | 5,83 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO | Artigo 7º I, Alínea b | 3,51 | 0,37 | 0,25 | 17.135.606,69 | 5,93 |
| Banestes Institucional FI Renda Fixa | Artigo 7º IV, Alínea a | 5,42 | 0,60 | 0,74 | 16.506.861,16 | 5,71 |
| BANESTES PREVIDENCIARIO FI RENDA FIXA IMA-B | Artigo 7º I, Alínea b | 6,12 | 0,66 | 0,55 | 35.133.834,47 | 12,16 |
| FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO | Artigo 8º III | 6,24 | 0,64 | -0,25 | 2.735.149,15 | 0,95 |
| Banestes FIC de FI Acoes BTG Pactual Absoluto Inst | Artigo 8º II, Alínea a | 12,95 | 1,49 | 3,36 | 6.580.788,34 | 2,28 |
| FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS | Artigo 8º II, Alínea a | 17,75 | 1,91 | 1,53 | 17.531.577,79 | 6,07 |
| FI ACOES CAIXA DIVIDENDOS | Artigo 8º II, Alínea a | 18,89 | 2,03 | 1,50 | 1.991.706,81 | 0,69 |
| NTN-B 150535 (4,410000%) | Artigo 7º I, Alínea a | 41,83 | 4,40 | 1,53 | 1.021.195,15 | 0,35 |