



**CAJAMAR**  
DEZEMBRO 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 19.01.2021.

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

|                   |               |
|-------------------|---------------|
| <b>RENTA FIXA</b> | <b>74,86%</b> |
|-------------------|---------------|

#### 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 |
|----------------------------------------|-------------|-------------------------------------------------|---------------------|-----------------|-----------------|-----------------------|--------------|-------------------|---------|
| CEF                                    | CEF         | FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP    | 12,80               | 4,84            | 6,06            | 57.116.897,61         | 16,45        | 6.193.173.925,17  | 0,92    |
| CEF                                    | CEF         | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF     | 0,55                | 0,28            | 3,63            | 11.125.767,45         | 3,20         | 16.753.976.831,37 | 0,07    |
| CEF                                    | CEF         | FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP  | 5,02                | 1,82            | 7,75            | 39.074.057,93         | 11,25        | 20.761.505.098,56 | 0,19    |
| CEF                                    | CEF         | FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 19,80               | 7,56            | 5,23            | 23.684.487,94         | 6,82         | 1.733.830.686,04  | 1,37    |
| WESTERN                                | BNP PARIBAS | WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF                | 9,23                | 3,24            | 10,18           | 21.088.922,54         | 6,07         | 941.494.565,53    | 2,24    |
| <b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b> |             |                                                 | <b>10,44</b>        | <b>3,89</b>     | <b>6,27</b>     | <b>152.090.133,47</b> | <b>43,81</b> |                   |         |

#### Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa Referenciados)

| Gestor                                   | Admin. | Ativo                                             | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$)          | % Carteira   | PL do Fundo      | % Fundo |
|------------------------------------------|--------|---------------------------------------------------|---------------------|-----------------|-----------------|----------------------|--------------|------------------|---------|
| CEF                                      | CEF    | FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP | 12,72               | 4,85            | 6,05            | 59.672.809,83        | 17,19        | 2.989.829.287,39 | 2,00    |
| <b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b> |        |                                                   | <b>12,72</b>        | <b>4,85</b>     | <b>6,05</b>     | <b>59.672.809,83</b> | <b>17,19</b> |                  |         |

#### 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 |
|-----------------------------------------|-------------|-----------------------------------------------|---------------------|-----------------|-----------------|----------------------|--------------|------------------|---------|
| CEF                                     | CEF         | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,37                | 0,36            | 2,42            | 9.084.613,11         | 2,62         | 4.230.515.183,84 | 0,21    |
| WESTERN                                 | BNP PARIBAS | WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF               | 16,78               | 6,48            | 8,59            | 18.292.903,88        | 5,27         | 615.393.709,47   | 2,97    |
| ITAU                                    | ITAU        | ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI | 1,66                | 0,20            | 2,86            | 18.509.055,34        | 5,33         | 3.882.685.363,65 | 0,48    |
| <b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b> |             |                                               | <b>6,09</b>         | <b>2,49</b>     | <b>4,45</b>     | <b>45.886.572,33</b> | <b>13,22</b> |                  |         |

#### Artigo 7º VII, Alínea b (Fundos Renda Fixa "Crédito Privado")

| Gestor                                   | Admin. | Ativo                                    | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$)         | % Carteira  | PL do Fundo    | % Fundo |
|------------------------------------------|--------|------------------------------------------|---------------------|-----------------|-----------------|---------------------|-------------|----------------|---------|
| ICATU                                    | BEM    | ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV | 6,08                | 2,37            | 7,60            | 2.251.801,01        | 0,65        | 825.779.381,34 | 0,27    |
| <b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b</b> |        |                                          | <b>6,08</b>         | <b>2,37</b>     | <b>7,60</b>     | <b>2.251.801,01</b> | <b>0,65</b> |                |         |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

9,88

3,83

5,82

259.901.316,64

74,86

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

21,60%

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

| Gestor                                  | Admin. | Ativo                                  | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentab.<br>Mês (%) | Rentab.<br>Ano (%) | Valor (R\$)          | % Carteira   | PL do Fundo      | % Fundo |
|-----------------------------------------|--------|----------------------------------------|------------------------|--------------------|--------------------|----------------------|--------------|------------------|---------|
| AZ QUEST                                | BEM    | AZ QUEST ACOES FIC FIA                 | 45,64                  | 7,67               | -3,87              | 10.705.723,34        | 3,08         | 812.622.043,38   | 1,32    |
| XP                                      | XP     | XP INVESTOR FI DE ACOES                | 49,68                  | 6,96               | -4,49              | 12.175.585,50        | 3,51         | 382.685.561,31   | 3,18    |
| ICATU                                   | BEM    | ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA         | 40,19                  | 7,96               | -9,45              | 5.679.357,52         | 1,64         | 1.793.128.513,73 | 0,32    |
| AZ QUEST                                | BEM    | AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA     | 46,24                  | 6,93               | -3,16              | 6.646.233,32         | 1,91         | 1.356.738.390,13 | 0,49    |
| XP                                      | XP     | XP DIVIDENDOS FI DE ACOES              | 41,12                  | 8,22               | -15,40             | 7.919.463,14         | 2,28         | 252.724.482,67   | 3,13    |
| VINCI                                   | BEM    | VINCI SELECTION EQUITIES FIA           | 38,86                  | 7,88               | 9,26               | 3.956.681,50         | 1,14         | 567.847.062,72   | 0,70    |
| ITAU                                    | ITAU   | ITAU ACOES DUNAMIS FIC                 | 44,19                  | 6,30               | -4,87              | 5.434.565,00         | 1,57         | 3.595.641.284,57 | 0,15    |
| ITAU                                    | ITAU   | ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI | 52,63                  | 7,97               | -21,23             | 1.348.918,73         | 0,39         | 1.462.115.658,32 | 0,09    |
| VINCI                                   | BEM    | VINCI MOSAICO FIA                      | 42,62                  | 9,20               | 3,48               | 6.269.989,30         | 1,81         | 1.706.184.417,35 | 0,37    |
| <b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b> |        |                                        | <b>43,66</b>           | <b>7,59</b>        | <b>-5,28</b>       | <b>60.136.517,35</b> | <b>17,32</b> |                  |         |

#### Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

| Gestor                         | Admin.      | Ativo                                      | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentab.<br>Mês (%) | Rentab.<br>Ano (%) | Valor (R\$)          | % Carteira  | PL do Fundo      | % Fundo |
|--------------------------------|-------------|--------------------------------------------|------------------------|--------------------|--------------------|----------------------|-------------|------------------|---------|
| WESTERN                        | BNP PARIBAS | WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO | 33,38                  | 3,19               | 12,17              | 10.914.916,83        | 3,14        | 1.201.804.027,43 | 0,91    |
| XP                             | BNY MELLON  | XP LONG SHORT 60 FC FI MULTIMERCADO        | 7,74                   | 0,59               | -0,49              | 3.938.184,41         | 1,13        | 110.835.474,76   | 3,55    |
| <b>Sub-total Artigo 8º III</b> |             |                                            | <b>23,30</b>           | <b>2,49</b>        | <b>8,49</b>        | <b>14.853.101,24</b> | <b>4,28</b> |                  |         |

|                                                    |  |  |              |             |              |                      |              |  |  |
|----------------------------------------------------|--|--|--------------|-------------|--------------|----------------------|--------------|--|--|
| <b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b> |  |  | <b>38,55</b> | <b>6,54</b> | <b>-2,79</b> | <b>74.989.618,59</b> | <b>21,60</b> |  |  |
|----------------------------------------------------|--|--|--------------|-------------|--------------|----------------------|--------------|--|--|

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,54%

Artigo 9º A, III (Ações - BDR Nível I)

| Gestor                            | Admin.      | Ativo                                      | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentab.<br>Mês (%) | Rentab.<br>Ano (%) | Valor (R\$)           | % Carteira    | PL do Fundo      | % Fundo |
|-----------------------------------|-------------|--------------------------------------------|------------------------|--------------------|--------------------|-----------------------|---------------|------------------|---------|
| SAFRA                             | SAFRA       | SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB | 33,07                  | 0,35               | 44,45              | 5.051.736,03          | 1,46          | 1.875.936.369,20 | 0,27    |
| WESTERN                           | BNP PARIBAS | WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I              | 29,74                  | -0,22              | 66,02              | 7.233.871,31          | 2,08          | 2.312.094.734,72 | 0,31    |
| <b>Sub-total Artigo 9º A, III</b> |             |                                            | <b>30,42</b>           | <b>0,01</b>        | <b>56,41</b>       | <b>12.285.607,34</b>  | <b>3,54</b>   |                  |         |
| <b>Investimentos no Exterior</b>  |             |                                            | <b>30,42</b>           | <b>0,01</b>        | <b>56,41</b>       | <b>12.285.607,34</b>  | <b>3,54</b>   |                  |         |
| <b>Total</b>                      |             |                                            | <b>14,94</b>           | <b>4,26</b>        | <b>4,70</b>        | <b>347.176.542,57</b> | <b>100,00</b> |                  |         |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Enquadramento da Carteira

| Política de Investimentos                   |                                                   |                |            |        |          |        |              |
|---------------------------------------------|---------------------------------------------------|----------------|------------|--------|----------|--------|--------------|
| Artigo                                      | Tipo de Ativo                                     | Valor(R\$)     | % Carteira | Mínimo | Objetivo | Máximo | Limite Legal |
| Renda Fixa                                  |                                                   |                |            |        |          |        |              |
| Artigo 7º I, Alínea b                       | Fundos 100% Títulos Públicos                      | 152.090.133,47 | 43,81      | 0,00   | 45,00    | 100,00 | 100,00       |
| Artigo 7º III, Alínea a                     | Fundos Renda Fixa Referenciados                   | 59.672.809,83  | 17,19      | 0,00   | 14,00    | 60,00  | 60,00        |
| Artigo 7º IV, Alínea a                      | Fundos de Renda Fixa                              | 45.886.572,33  | 13,22      | 0,00   | 14,00    | 40,00  | 40,00        |
| Artigo 7º VII, Alínea b                     | Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"               | 2.251.801,01   | 0,65       | 0,00   | 1,00     | 5,00   | 5,00         |
|                                             | Total Renda Fixa                                  | 259.901.316,64 | 74,86      |        |          |        | 100,00       |
| Renda Variável e Investimentos Estruturados |                                                   |                |            |        |          |        |              |
| Artigo 8º II, Alínea a                      | Fundos de Ações                                   | 60.136.517,35  | 17,32      | 0,00   | 19,00    | 20,00  | 20,00        |
| Artigo 8º III                               | Fundos Multimercados                              | 14.853.101,24  | 4,28       | 0,00   | 5,00     | 10,00  | 10,00        |
|                                             | Total Renda Variável e Investimentos Estruturados | 74.989.618,59  | 21,60      |        |          |        | 30,00        |
| Investimentos no Exterior                   |                                                   |                |            |        |          |        |              |
| Artigo 9º A, III                            | Ações - BDR Nível I                               | 12.285.607,34  | 3,54       | 0,00   | 2,00     | 10,00  | 10,00        |
|                                             | Total Investimentos no Exterior                   | 12.285.607,34  | 3,54       |        |          |        | 10,00        |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Rentabilidades por Artigo

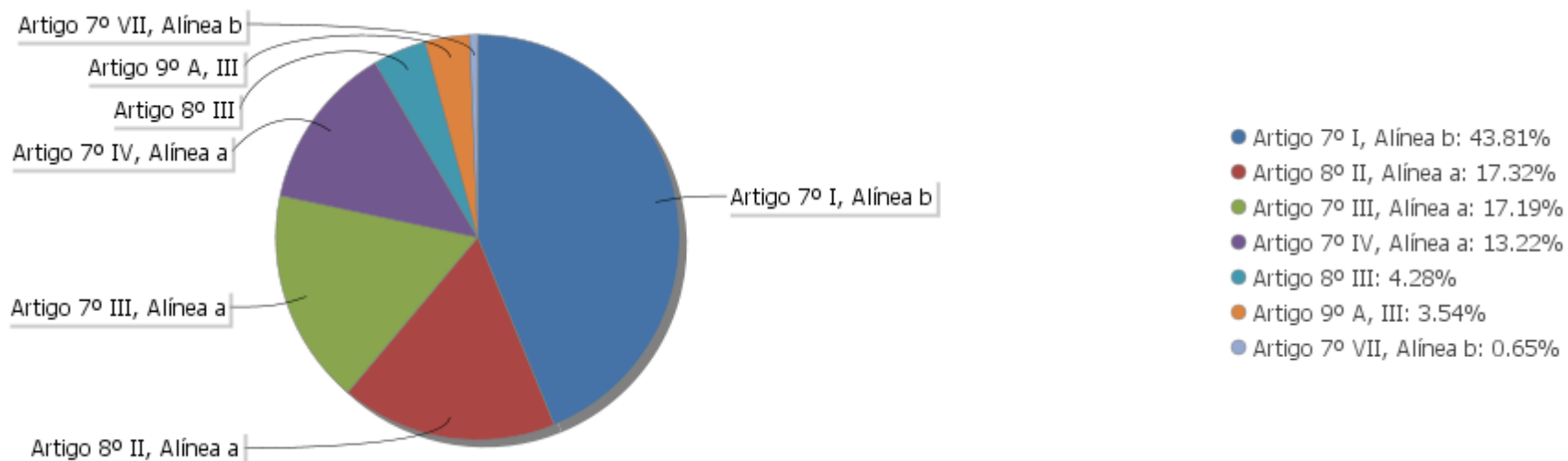
| Estratégia Indexador                         | No Mês           | No Ano            | 3 meses          | 6 meses           | 12 meses          | No Mês(R\$)          | No Ano(R\$)          |
|----------------------------------------------|------------------|-------------------|------------------|-------------------|-------------------|----------------------|----------------------|
| Artigo 7º I, Alínea b<br>% do CDI            | 3,89<br>2.367,09 | 6,27<br>227,51    | 5,78<br>1.224,62 | 6,59<br>668,67    | 6,27<br>227,51    | 5.691.773,92         | 8.923.224,91         |
| Artigo 7º III, Alínea a<br>% do CDI          | 4,85<br>2.951,47 | 6,05<br>219,39    | 7,10<br>1.506,28 | 8,06<br>816,90    | 6,05<br>219,39    | 2.762.297,76         | 3.232.656,74         |
| Artigo 7º IV, Alínea a<br>% do CDI           | 2,49<br>1.513,21 | 4,45<br>161,30    | 3,28<br>695,94   | 3,45<br>349,95    | 4,45<br>161,30    | 1.194.373,47         | 2.297.547,54         |
| Artigo 7º VII, Alínea b<br>% do CDI          | 2,37<br>1.441,57 | 7,60<br>275,52    | 3,88<br>822,61   | 6,26<br>634,93    | 7,60<br>275,52    | 52.147,05            | 159.019,06           |
| Artigo 8º II, Alínea a<br>Var. IBOVESPA p.p. | 7,59<br>-1,70    | -5,28<br>-8,19    | 17,21<br>-8,59   | 17,04<br>-8,17    | -5,28<br>-8,19    | 4.244.872,42         | -3.350.065,06        |
| Artigo 8º III<br>Var. IBOVESPA p.p.          | 2,49<br>-6,81    | 8,49<br>5,58      | 7,78<br>-18,02   | 14,04<br>-11,17   | 8,49<br>5,58      | 360.618,37           | 1.142.062,94         |
| Artigo 9º A, III<br>% do CDI                 | 0,01<br>6,58     | 56,41<br>2.045,60 | 0,80<br>170,18   | 17,60<br>1.784,66 | 56,41<br>2.045,60 | 1.328,33             | 4.431.051,21         |
| <b>CAJAMAR (Total)</b>                       |                  |                   |                  |                   |                   | <b>14.307.411,32</b> | <b>16.835.497,34</b> |

### Análise de Liquidez

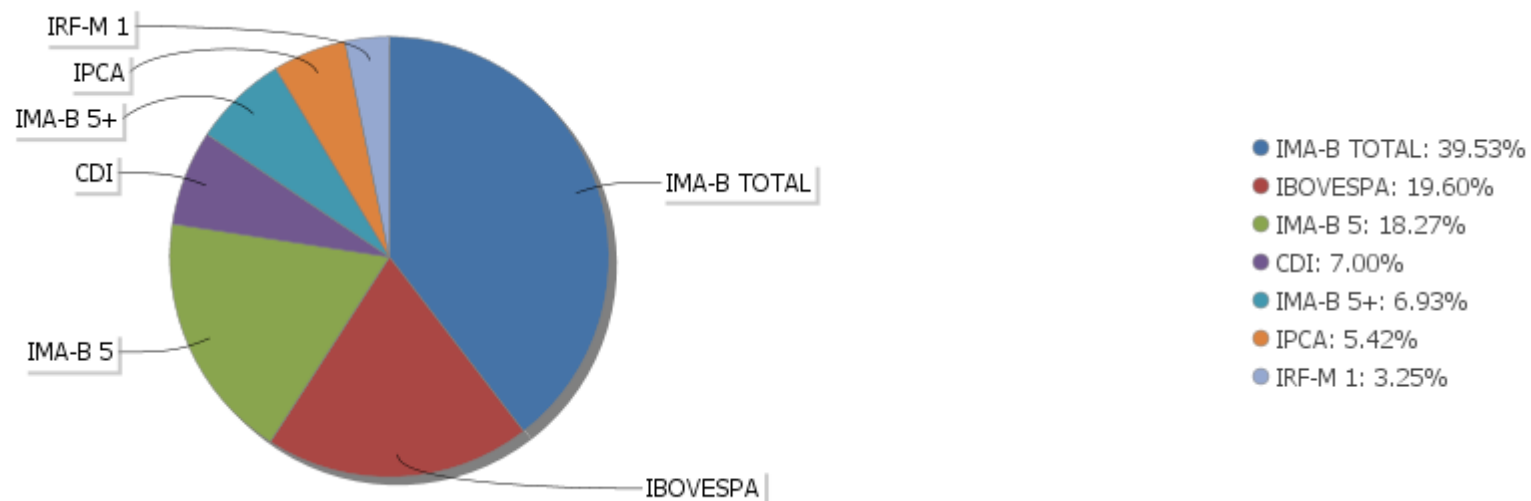
| Período           | Valor (R\$)    | (%)   | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|----------------|-------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias    | 327.577.122,36 | 94,35 | 327.577.122,36        | 94,35     |
| de 31 a 364 dias  | 19.599.420,21  | 5,65  | 347.176.542,57        | 100,00    |
| acima de 365 dias | 0,00           | 0,00  | 347.176.542,57        | 100,00    |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

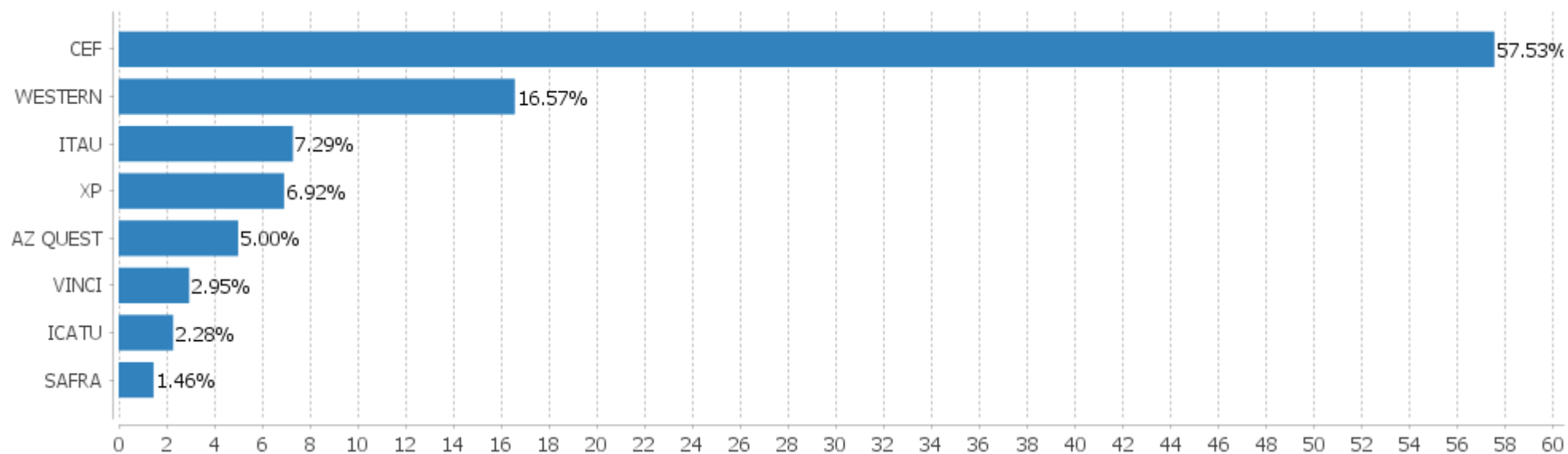


### Alocação Por Estratégia



## 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           | 1,00 | -1,46 | -10,90 | 3,19  | 2,53  | 2,70  | 4,05 | -0,62 | -2,07 | -0,39 | 3,34  | 4,26 | 4,70      |
| IPCA + 5,87%   | 0,71 | 0,66  | 0,57   | 0,14  | 0,07  | 0,74  | 0,88 | 0,72  | 1,12  | 1,34  | 1,35  | 1,86 | 10,63     |
| p.p. indexador | 0,29 | -2,12 | -11,47 | 3,04  | 2,46  | 1,96  | 3,17 | -1,34 | -3,19 | -1,73 | 1,99  | 2,41 | -5,92     |
| 2019           | 4,19 | 0,21  | 0,36   | 1,47  | 2,28  | 3,19  | 1,44 | 0,20  | 2,25  | 2,68  | -0,74 | 3,06 | 22,49     |
| IPCA + 6%      | 0,83 | 0,90  | 1,19   | 1,06  | 0,64  | 0,45  | 0,72 | 0,62  | 0,45  | 0,63  | 0,98  | 1,64 | 10,59     |
| p.p. indexador | 3,36 | -0,69 | -0,83  | 0,41  | 1,64  | 2,74  | 0,71 | -0,42 | 1,80  | 2,04  | -1,72 | 1,41 | 11,90     |
| 2018           | 3,34 | 0,46  | 1,09   | 0,43  | -3,02 | -0,50 | 2,42 | -0,90 | 0,38  | 4,81  | 1,09  | 1,08 | 10,97     |
| IPCA + 6%      | 0,80 | 0,74  | 0,58   | 0,71  | 0,89  | 1,75  | 0,84 | 0,44  | 0,92  | 0,96  | 0,25  | 0,61 | 9,92      |
| p.p. indexador | 2,54 | -0,28 | 0,52   | -0,28 | -3,91 | -2,25 | 1,58 | -1,34 | -0,54 | 3,84  | 0,84  | 0,46 | 1,05      |
| 2017           | 2,27 | 2,88  | 0,63   | -0,03 | -0,79 | 0,52  | 3,42 | 1,67  | 1,92  | -0,16 | -0,68 | 1,47 | 13,82     |
| IPCA + 6%      | 0,89 | 0,75  | 0,78   | 0,56  | 0,82  | 0,26  | 0,73 | 0,72  | 0,62  | 0,91  | 0,74  | 0,91 | 9,05      |
| p.p. indexador | 1,38 | 2,13  | -0,16  | -0,58 | -1,61 | 0,26  | 2,69 | 0,94  | 1,30  | -1,07 | -1,42 | 0,57 | 4,78      |

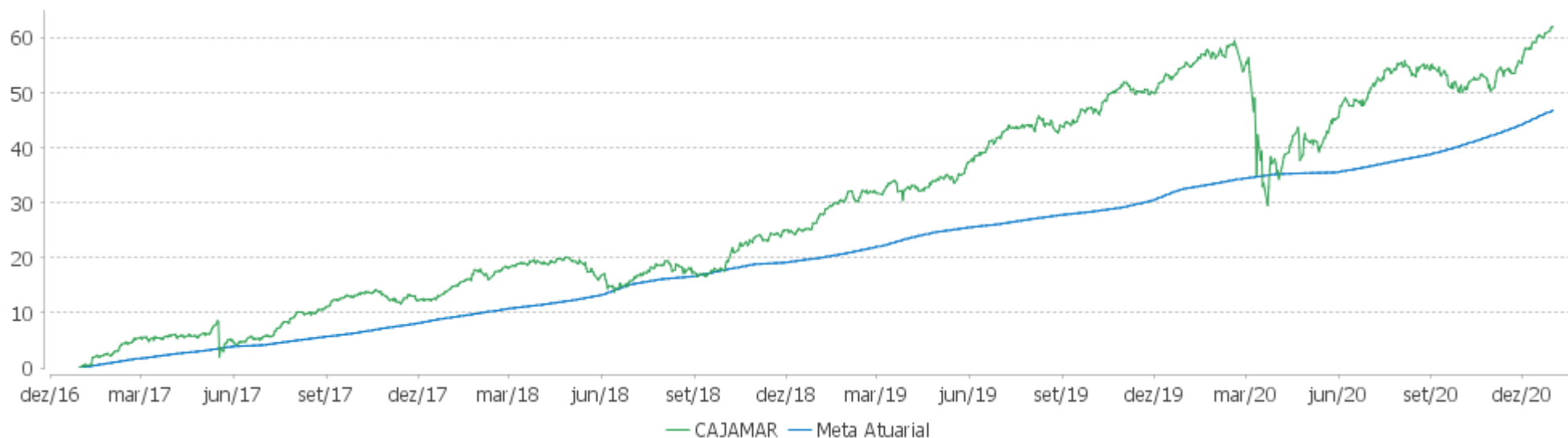
### PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

#### RELATÓRIO TRIMESTRAL

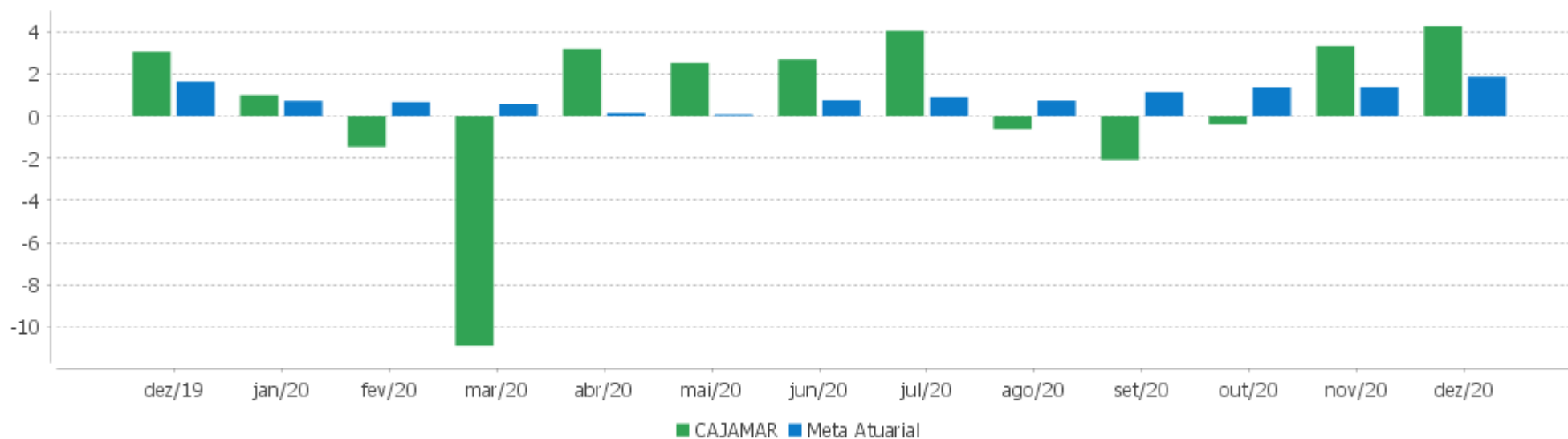
|                                 | Quantidade | Perc. (%) | Período          | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima da Meta Atuarial    | 28         | 58,33     | 03 meses         | 7,32     | 4,61          | 2,71       | 5,68               |
| Meses abaixo da Meta Atuarial   | 20         | 41,67     | 06 meses         | 8,68     | 7,48          | 1,19       | 6,49               |
|                                 |            |           | 12 meses         | 4,70     | 10,63         | -5,92      | 14,94              |
|                                 |            |           | 24 meses         | 28,26    | 22,34         | 5,91       | 11,14              |
|                                 |            |           | 36 meses         | 42,33    | 34,48         | 7,85       | 9,61               |
| Maior rentabilidade da Carteira | 4,81       | 2018-10   | Desde 30/12/2016 | 62,00    | 46,65         | 15,35      | 9,11               |
| Menor rentabilidade da Carteira | -10,90     | 2020-03   |                  |          |               |            |                    |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Evolução



### Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Performance dos Fundos

| Fundo<br>Variação da Estratégia                                            | No Mês           | No Ano           | 3 meses           | 6 meses           | 12 meses         | 24 meses        | 36 meses        |
|----------------------------------------------------------------------------|------------------|------------------|-------------------|-------------------|------------------|-----------------|-----------------|
| ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV<br>Var. IMA-B 5 p.p.              | 2,37<br>0,54     | 7,60<br>-0,44    | 3,88<br>0,50      | 6,26<br>1,54      | 7,60<br>-0,44    | 20,61<br>-1,64  | 33,32<br>-0,99  |
| WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF<br>Var. IMA-B 5 p.p.                      | 3,24<br>1,41     | 10,18<br>2,15    | 4,43<br>1,05      | 5,13<br>0,41      | 10,18<br>2,15    | 27,76<br>5,51   | 42,78<br>8,47   |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.      | 4,84<br>-0,01    | 6,06<br>-0,34    | 7,13<br>-0,04     | 8,09<br>-0,12     | 6,06<br>-0,34    | 30,02<br>-0,81  | 46,71<br>-1,20  |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-B 5 p.p.        | 1,82<br>-0,01    | 7,75<br>-0,29    | 3,32<br>-0,06     | 4,57<br>-0,15     | 7,75<br>-0,29    | 21,60<br>-0,65  | 33,35<br>-0,96  |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF<br>Var. IRF-M 1 p.p.           | 0,28<br>-0,03    | 3,63<br>-0,21    | 0,64<br>-0,06     | 1,12<br>-0,09     | 3,63<br>-0,21    | 10,42<br>-0,44  | 17,94<br>-0,66  |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-B 5+ p.p.      | 7,56<br>0,05     | 5,23<br>-0,26    | 10,56<br>0,03     | 11,28<br>-0,08    | 5,23<br>-0,26    | 36,52<br>-1,01  | 56,97<br>-1,75  |
| FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP<br>Var. IMA-B TOTAL p.p. | 4,85<br>0,00     | 6,05<br>-0,36    | 7,10<br>-0,07     | 8,06<br>-0,15     | 6,05<br>-0,36    | 29,87<br>-0,95  | 46,68<br>-1,23  |
| WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.                   | 6,48<br>1,62     | 8,59<br>2,18     | 8,48<br>1,30      | 8,63<br>0,43      | 8,59<br>2,18     | 36,64<br>5,81   | 56,55<br>8,64   |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP<br>% do CDI                  | 0,36<br>220,55   | 2,42<br>87,59    | 0,64<br>135,47    | 1,03<br>104,71    | 2,42<br>87,59    | 8,27<br>93,10   | 15,01<br>94,59  |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI<br>Var. IPCA p.p.            | 0,20<br>-1,15    | 2,86<br>-1,66    | 0,38<br>-2,75     | 0,58<br>-3,83     | 2,86<br>-1,66    | 15,12<br>6,10   | 24,58<br>11,47  |
| XP LONG SHORT 60 FC FI MULTIMERCADO<br>% do CDI                            | 0,59<br>361,41   | -0,49<br>-17,63  | -1,45<br>-307,02  | 0,53<br>53,28     | -0,49<br>-17,63  | 2,39<br>26,93   | 13,76<br>86,70  |
| WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO<br>% do CDI                     | 3,19<br>1.939,35 | 12,17<br>441,42  | 11,55<br>2.449,51 | 19,85<br>2.012,61 | 12,17<br>441,42  | 48,40<br>544,90 | 44,80<br>282,22 |
| AZ QUEST ACOES FIC FIA<br>Var. IBOVESPA p.p.                               | 7,67<br>-1,63    | -3,87<br>-6,78   | 16,78<br>-9,02    | 16,90<br>-8,31    | -3,87<br>-6,78   | 23,63<br>-11,79 | 55,92<br>0,14   |
| XP INVESTOR FI DE ACOES<br>Var. IBOVESPA p.p.                              | 6,96<br>-2,33    | -4,49<br>-7,41   | 13,49<br>-12,32   | 15,56<br>-9,65    | -4,49<br>-7,41   | 44,07<br>8,65   | 73,85<br>18,07  |
| VINCI MOSAICO FIA<br>Var. IBOVESPA p.p.                                    | 9,20<br>-0,10    | 3,48<br>0,56     | 21,18<br>-4,63    | 22,19<br>-3,01    | 3,48<br>0,56     | 54,75<br>19,33  | 77,64<br>21,86  |
| ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI<br>Var. IBOVESPA p.p.               | 7,97<br>-1,33    | -21,23<br>-24,15 | 17,87<br>-7,94    | 10,19<br>-15,02   | -21,23<br>-24,15 | 10,15<br>-25,27 | 38,81<br>-16,97 |
| VINCI SELECTION EQUITIES FIA                                               | 7,88             | 9,26             | 18,34             | 19,95             | 9,26             | 46,62           | 75,00           |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo<br>Variação da Estratégia            | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|--------------------------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|
| Var. IBOVESPA p.p.                         | -1,42  | 6,34   | -7,47   | -5,26   | 6,34     | 11,20    | 19,22    |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA         | 6,93   | -3,16  | 16,94   | 21,44   | -3,16    | 44,95    | 83,27    |
| Var. IBOVESPA p.p.                         | -2,37  | -6,07  | -8,86   | -3,77   | -6,07    | 9,53     | 27,49    |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC                     | 6,30   | -4,87  | 19,94   | 22,34   | -4,87    | 38,19    | 69,25    |
| ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA             | 7,96   | -9,45  | 20,15   | 13,27   | -9,45    | 29,14    | 57,09    |
| Var. IBOVESPA p.p.                         | -1,33  | -12,36 | -5,66   | -11,93  | -12,36   | -6,28    | 1,31     |
| XP DIVIDENDOS FI DE ACOES                  | 8,22   | -15,40 | 16,37   | 11,48   | -15,40   | 29,55    | 51,74    |
| Var. IBOVESPA p.p.                         | -1,08  | -18,32 | -9,44   | -13,73  | -18,32   | -5,87    | -4,04    |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB | 0,35   | 44,45  | 1,33    | 16,88   | 44,45    | 98,40    |          |
| Var. IBOVESPA p.p.                         | -8,95  | 41,53  | -24,48  | -8,33   | 41,53    | 62,98    |          |
| WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I              | -0,22  | 66,02  | 0,44    | 18,11   | 66,02    | 125,04   | 147,14   |
| Var. IBOVESPA p.p.                         | -9,52  | 63,10  | -25,37  | -7,10   | 63,10    | 89,62    | 91,36    |
| CAJAMAR                                    | 4,26   | 4,70   | 7,32    | 8,68    | 4,70     | 28,26    | 42,33    |
| Var. IPCA + 6% p.p.                        | 2,39   | -6,06  | 2,67    | 1,12    | -6,06    | 5,76     | 7,68     |
| CDI                                        | 0,16   | 2,76   | 0,47    | 0,99    | 2,76     | 8,88     | 15,87    |
| IBOVESPA                                   | 9,30   | 2,92   | 25,81   | 25,21   | 2,92     | 35,42    | 55,78    |
| INPC + 6%                                  | 1,98   | 11,75  | 4,85    | 8,23    | 11,75    | 23,79    | 35,66    |
| IPCA + 6%                                  | 1,87   | 10,76  | 4,64    | 7,55    | 10,76    | 22,49    | 34,64    |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Indexadores

| Indexador                     | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|-------------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|
| <b>Renda Fixa</b>             |        |        |         |         |          |          |          |
| IRF-M 1                       | 0,31   | 3,84   | 0,70    | 1,21    | 3,84     | 10,86    | 18,59    |
| IRF-M 1+                      | 3,05   | 8,45   | 2,90    | 2,29    | 8,45     | 23,90    | 39,09    |
| IRF-M TOTAL                   | 1,95   | 6,69   | 1,99    | 1,75    | 6,69     | 19,53    | 32,36    |
| IMA-B 5                       | 1,83   | 8,04   | 3,38    | 4,72    | 8,04     | 22,25    | 34,31    |
| IMA-B 5+                      | 7,51   | 5,50   | 10,53   | 11,36   | 5,50     | 37,54    | 58,72    |
| IMA-B TOTAL                   | 4,85   | 6,41   | 7,18    | 8,21    | 6,41     | 30,83    | 47,91    |
| IMA-C TOTAL                   | -1,12  | 22,07  | 3,64    | 13,59   | 22,07    | 45,76    | 72,56    |
| IMA-GERAL ex-C TOTAL          | 2,12   | 4,85   | 2,83    | 3,09    | 4,85     | 18,09    | 29,65    |
| IMA-GERAL TOTAL               | 2,02   | 5,34   | 2,86    | 3,40    | 5,34     | 18,84    | 30,77    |
| IDKA 2                        | 1,73   | 8,62   | 3,05    | 5,10    | 8,62     | 21,46    | 33,31    |
| IDKA 20                       | 11,36  | 2,20   | 15,90   | 16,58   | 2,20     | 47,44    | 77,53    |
| CDI                           | 0,16   | 2,76   | 0,47    | 0,99    | 2,76     | 8,88     | 15,87    |
| <b>Renda Variável</b>         |        |        |         |         |          |          |          |
| IBOVESPA                      | 9,30   | 2,92   | 25,81   | 25,21   | 2,92     | 35,42    | 55,78    |
| IBRX 100                      | 9,15   | 3,50   | 25,34   | 25,28   | 3,50     | 38,06    | 59,35    |
| IBRX 50                       | 9,42   | 3,62   | 26,47   | 26,00   | 3,62     | 33,83    | 53,28    |
| SMALL CAP                     | 7,52   | -0,65  | 22,54   | 25,33   | -0,65    | 57,16    | 69,94    |
| IFIX                          | 2,19   | -10,24 | 2,69    | 2,28    | -10,24   | 22,05    | 28,91    |
| Índice Consumo - ICON         |        |        |         |         |          |          |          |
| Índice Dividendos - IDIV      | 8,94   | -1,00  | 25,44   | 21,29   | -1,00    | 43,71    | 66,63    |
| <b>Indicadores Econômicos</b> |        |        |         |         |          |          |          |
| IPCA                          | 1,35   | 4,52   | 3,13    | 4,42    | 4,52     | 9,02     | 13,10    |
| INPC                          | 1,46   | 5,45   | 3,34    | 5,07    | 5,45     | 10,17    | 13,96    |
| IGPM                          | 0,96   | 23,14  | 7,64    | 17,96   | 23,14    | 32,13    | 42,09    |
| SELIC                         | 0,16   | 2,76   | 0,47    | 0,99    | 2,76     | 8,88     | 15,88    |
| <b>Meta Atuarial</b>          |        |        |         |         |          |          |          |

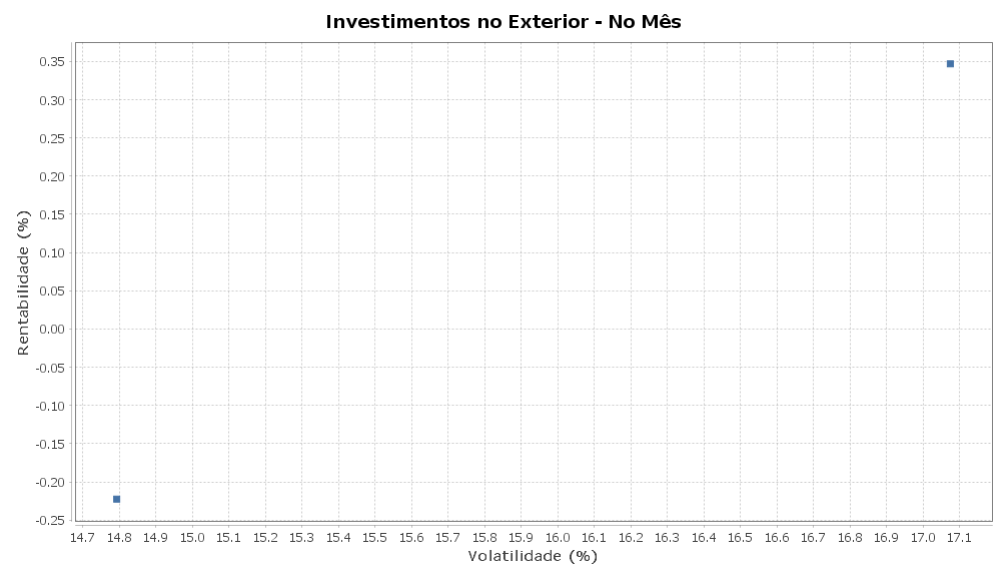
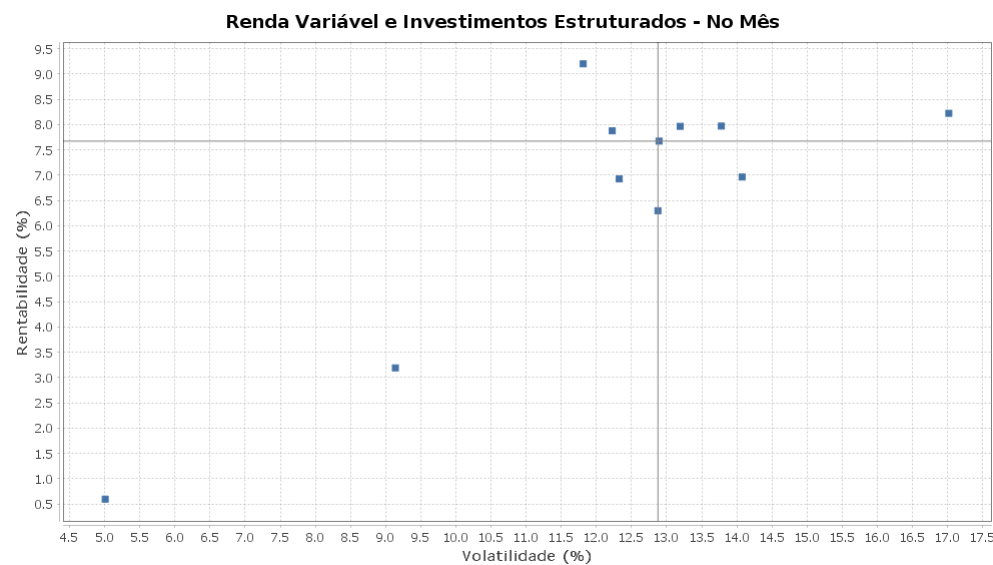
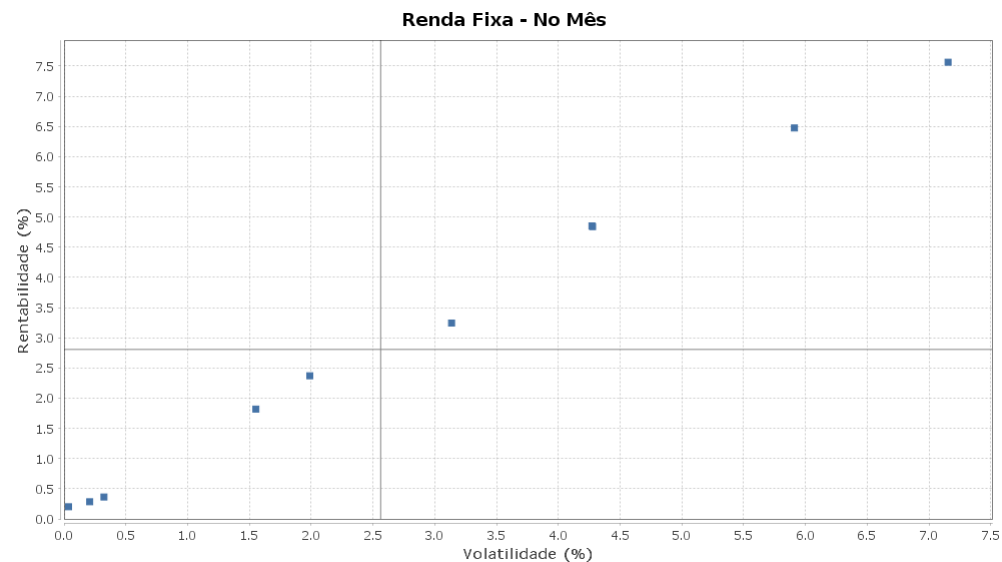
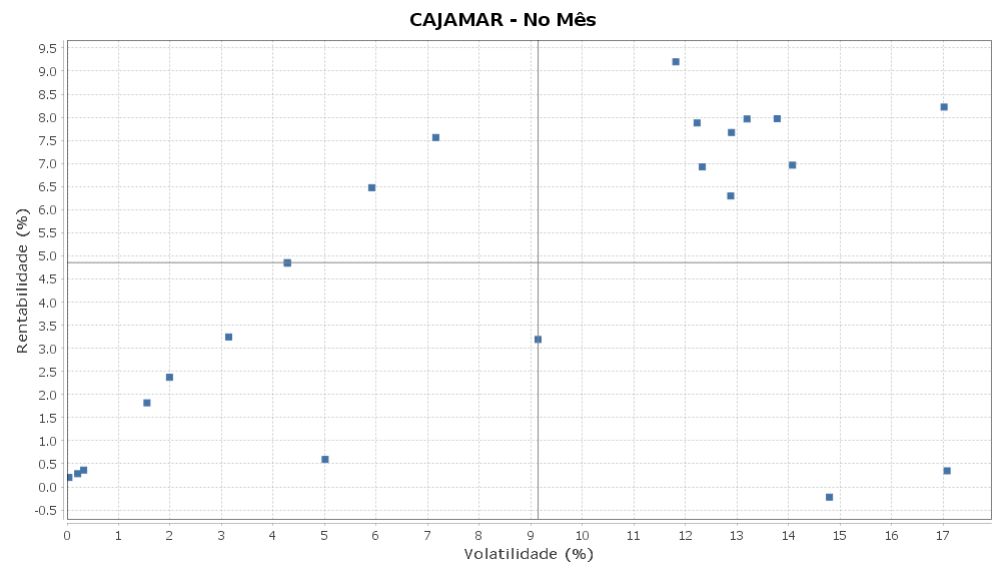
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

| APR          | Data       | Ativo                                          | Aplicação  | Resgate      | Quantidade       | Valor Cota   |
|--------------|------------|------------------------------------------------|------------|--------------|------------------|--------------|
| 115          | 09/12/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP  | 0,00       | 32.900,80    | 8.814,27798200   | 3,7326710000 |
| 112          | 14/12/2020 | FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 169.928,14 | 0,00         | 53.059,05190800  | 3,2026230000 |
| 116          | 14/12/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP  | 0,00       | 2.784.120,27 | 745.615,55099300 | 3,7339890000 |
| 117          | 16/12/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP  | 0,00       | 6.000,00     | 1.606,51294500   | 3,7347970000 |
| 113          | 18/12/2020 | FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 82.481,33  | 0,00         | 25.687,53215500  | 3,2109480000 |
| 118          | 18/12/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP  | 0,00       | 7.000,00     | 1.873,80655100   | 3,7357110000 |
| 114          | 22/12/2020 | WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF               | 13.806,44  | 0,00         | 5.675,07945920   | 2,4328188000 |
| 119          | 24/12/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP  | 0,00       | 1.738.395,63 | 465.090,71994200 | 3,7377560000 |
| <b>Total</b> |            |                                                |            |              |                  |              |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Risco - Dispersão



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 11.325.777,36

Value-At-Risk: 3,26%

| Ativo                                             | Estratégia              | Volatilidade | VaR   | CVaR | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)    | % Carteira |
|---------------------------------------------------|-------------------------|--------------|-------|------|--------|-------|---------------|------------|
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI     | Artigo 7º IV, Alínea a  | 0,04         | 0,26  | 0,01 | 1,02   | 0,20  | 18.509.055,34 | 5,33       |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF       | Artigo 7º I, Alínea b   | 0,21         | 0,15  | 0,00 | 0,58   | 0,28  | 11.125.767,45 | 3,20       |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP     | Artigo 7º IV, Alínea a  | 0,32         | 0,13  | 0,00 | 0,61   | 0,36  | 9.084.613,11  | 2,62       |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP    | Artigo 7º I, Alínea b   | 1,55         | 1,06  | 0,09 | 1,07   | 1,82  | 39.074.057,93 | 11,25      |
| ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV          | Artigo 7º VII, Alínea b | 1,99         | 1,24  | 0,01 | 1,11   | 2,37  | 2.251.801,01  | 0,65       |
| WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF                  | Artigo 7º I, Alínea b   | 3,14         | 1,87  | 0,09 | 0,98   | 3,24  | 21.088.922,54 | 6,07       |
| FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP | Artigo 7º III, Alínea a | 4,27         | 2,56  | 0,37 | 1,10   | 4,85  | 59.672.809,83 | 17,19      |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP      | Artigo 7º I, Alínea b   | 4,28         | 2,57  | 0,35 | 1,09   | 4,84  | 57.116.897,61 | 16,45      |
| XP LONG SHORT 60 FC FI MULTIMERCADO               | Artigo 8º III           | 5,01         | 3,31  | 0,00 | 0,09   | 0,59  | 3.938.184,41  | 1,13       |
| WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF                   | Artigo 7º IV, Alínea a  | 5,91         | 3,40  | 0,15 | 1,07   | 6,48  | 18.292.903,88 | 5,27       |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP   | Artigo 7º I, Alínea b   | 7,15         | 4,57  | 0,26 | 1,03   | 7,56  | 23.684.487,94 | 6,82       |
| WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO        | Artigo 8º III           | 9,14         | 8,26  | 0,16 | 0,33   | 3,19  | 10.914.916,83 | 3,14       |
| VINCI MOSAICO FIA                                 | Artigo 8º II, Alínea a  | 11,81        | 12,14 | 0,20 | 0,76   | 9,20  | 6.269.989,30  | 1,81       |
| VINCI SELECTION EQUITIES FIA                      | Artigo 8º II, Alínea a  | 12,22        | 9,46  | 0,10 | 0,63   | 7,88  | 3.956.681,50  | 1,14       |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA                | Artigo 8º II, Alínea a  | 12,32        | 11,32 | 0,19 | 0,55   | 6,93  | 6.646.233,32  | 1,91       |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC                            | Artigo 8º II, Alínea a  | 12,88        | 10,36 | 0,15 | 0,48   | 6,30  | 5.434.565,00  | 1,57       |
| AZ QUEST ACOES FIC FIA                            | Artigo 8º II, Alínea a  | 12,89        | 11,33 | 0,31 | 0,58   | 7,67  | 10.705.723,34 | 3,08       |
| ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA                    | Artigo 8º II, Alínea a  | 13,19        | 10,14 | 0,15 | 0,59   | 7,96  | 5.679.357,52  | 1,64       |
| ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI            | Artigo 8º II, Alínea a  | 13,78        | 11,63 | 0,04 | 0,57   | 7,97  | 1.348.918,73  | 0,39       |
| XP INVESTOR FI DE ACOES                           | Artigo 8º II, Alínea a  | 14,08        | 11,01 | 0,35 | 0,48   | 6,96  | 12.175.585,50 | 3,51       |
| WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I                     | Artigo 9º A, III        | 14,79        | 11,31 | 0,05 | -0,03  | -0,22 | 7.233.871,31  | 2,08       |
| XP DIVIDENDOS FI DE ACOES                         | Artigo 8º II, Alínea a  | 17,02        | 11,84 | 0,23 | 0,47   | 8,22  | 7.919.463,14  | 2,28       |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB        | Artigo 9º A, III        | 17,07        | 11,15 | 0,03 | 0,01   | 0,35  | 5.051.736,03  | 1,46       |