



**LDB**  
EMPRESAS

**CAJAMAR**  
JULHO 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 17.08.2020.

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** 75,29%

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    | 12,54               | 4,38            | 2,42            | 55.154.198,52         | 17,03        | 6.313.416.954,01  | 0,87    |
| CEF                                    | CEF         | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF     | 0,53                | 0,24            | 2,73            | 9.936.293,95          | 3,07         | 10.907.406.871,77 | 0,09    |
| CEF                                    | CEF         | FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP  | 4,95                | 0,97            | 4,05            | 23.814.057,98         | 7,35         | 12.027.903.790,65 | 0,20    |
| CEF                                    | CEF         | FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 19,32               | 7,29            | 1,46            | 22.835.283,21         | 7,05         | 2.059.270.796,72  | 1,11    |
| WESTERN                                | BNP PARIBAS | WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF                | 8,98                | 1,80            | 6,69            | 20.406.428,87         | 6,30         | 640.279.975,43    | 3,19    |
| CEF                                    | CEF         | FI CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS RF      | 1,19                | 0,07            | 0,80            | 5.244.136,00          | 1,62         | 257.824.754,60    | 2,03    |
| <b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b> |             |                                                 | <b>10,23</b>        | <b>3,38</b>     | <b>3,07</b>     | <b>137.390.398,53</b> | <b>42,43</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 | 12,47               | 4,40            | 2,46            | 47.563.886,11        | 14,69        | 2.998.036.270,63 | 1,59    |
| <b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b> |        |                                                   | <b>12,47</b>        | <b>4,40</b>     | <b>2,46</b>     | <b>47.563.886,11</b> | <b>14,69</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 | 0,29                | 0,25            | 1,62            | 20.470.413,53        | 6,32         | 4.665.137.027,34 | 0,44    |
| WESTERN                                 | BNP PARIBAS | WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF               | 16,34               | 5,13            | 5,09            | 17.702.911,51        | 5,47         | 450.077.855,96   | 3,93    |
| ITAU                                    | ITAU        | ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI | 1,64                | 0,55            | 2,83            | 18.503.550,70        | 5,71         | 5.186.154.771,17 | 0,36    |
| <b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b> |             |                                               | <b>6,03</b>         | <b>1,76</b>     | <b>2,74</b>     | <b>56.676.875,74</b> | <b>17,50</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 | 5,93                | 1,93            | 3,21            | 2.160.021,74 | 0,67       | 628.743.407,57 | 0,34    |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Gestor | Admin. | Ativo                                    | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentab.<br>Mês (%) | Rentab.<br>Ano (%) | Valor (R\$)         | % Carteira  | PL do Fundo | % Fundo |
|--------|--------|------------------------------------------|------------------------|--------------------|--------------------|---------------------|-------------|-------------|---------|
|        |        | <b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b</b> | <b>5,93</b>            | <b>1,93</b>        | <b>3,21</b>        | <b>2.160.021,74</b> | <b>0,67</b> |             |         |
|        |        | Renda Fixa                               | 9,69                   | 3,14               | 2,77               | 243.791.182,12      | 75,29       |             |         |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

21,40%

#### 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                 | 44,85                  | 8,86               | -10,48             | 9.969.331,06         | 3,08         | 879.154.088,57   | 1,13    |
| XP                                      | XP     | XP INVESTOR FI DE ACOES                | 48,84                  | 8,64               | -10,21             | 11.446.722,41        | 3,54         | 385.028.290,49   | 2,97    |
| ICATU                                   | BEM    | ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA         | 38,76                  | 4,36               | -16,57             | 5.232.553,53         | 1,62         | 1.602.131.208,86 | 0,33    |
| AZ QUEST                                | BEM    | AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA     | 45,92                  | 14,10              | -9,01              | 6.244.638,80         | 1,93         | 1.311.663.407,89 | 0,48    |
| XP                                      | XP     | XP DIVIDENDOS FI DE ACOES              | 39,63                  | 6,35               | -19,30             | 7.554.705,30         | 2,33         | 283.152.832,28   | 2,67    |
| VINCI                                   | BEM    | VINCI SELECTION EQUITIES FIA           | 38,14                  | 8,97               | -0,74              | 3.594.689,59         | 1,11         | 462.292.573,62   | 0,78    |
| ITAU                                    | ITAU   | ITAU ACOES DUNAMIS FIC                 | 43,06                  | 7,54               | -16,38             | 4.776.950,71         | 1,48         | 3.482.474.100,00 | 0,14    |
| ITAU                                    | ITAU   | ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI | 51,34                  | 5,80               | -24,37             | 1.295.206,36         | 0,40         | 1.851.616.977,67 | 0,07    |
| VINCI                                   | BEM    | VINCI MOSAICO FIA                      | 41,72                  | 9,03               | -7,67              | 5.594.499,82         | 1,73         | 1.618.519.950,92 | 0,35    |
| <b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b> |        |                                        | <b>42,79</b>           | <b>8,42</b>        | <b>-12,25</b>      | <b>55.709.297,58</b> | <b>17,21</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 | 32,72                  | 5,63               | -1,13              | 9.620.381,84         | 2,97        | 934.074.693,62 | 1,03    |
| XP                             | BNY MELLON  | XP LONG SHORT 60 FC FI MULTIMERCADO        | 7,36                   | 1,40               | 0,38               | 3.972.577,07         | 1,23        | 138.458.746,62 | 2,87    |
| <b>Sub-total Artigo 8º III</b> |             |                                            | <b>22,63</b>           | <b>4,36</b>        | <b>-0,71</b>       | <b>13.592.958,91</b> | <b>4,20</b> |                |         |

|                                                    |  |  |              |             |               |                      |              |  |  |
|----------------------------------------------------|--|--|--------------|-------------|---------------|----------------------|--------------|--|--|
| <b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b> |  |  | <b>37,83</b> | <b>7,60</b> | <b>-10,17</b> | <b>69.302.256,49</b> | <b>21,40</b> |  |  |
|----------------------------------------------------|--|--|--------------|-------------|---------------|----------------------|--------------|--|--|

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,30%

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 CONS AMERICANO PB FI ACOES | 30,40                  | 2,02               | 26,09              | 4.409.556,69         | 1,36        | 1.193.916.889,93 | 0,37    |
| WESTERN                           | BNP PARIBAS | WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I    | 27,18                  | 2,56               | 44,17              | 6.281.935,92         | 1,94        | 1.181.976.193,58 | 0,53    |
| <b>Sub-total Artigo 9º A, III</b> |             |                                  | <b>27,75</b>           | <b>2,34</b>        | <b>36,12</b>       | <b>10.691.492,61</b> | <b>3,30</b> |                  |         |
| Investimentos no Exterior         |             |                                  | 27,75                  | 2,34               | 36,12              | 10.691.492,61        | 3,30        |                  |         |
| Total                             |             |                                  |                        |                    |                    | 323.784.931,22       | 100,00      |                  |         |

## 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                      | 137.390.398,53 | 42,43      | 0,00   | 45,00    | 100,00 | 100,00       |
| Artigo 7º III, Alínea a                     | Fundos Renda Fixa Referenciados                   | 47.563.886,11  | 14,69      | 0,00   | 14,00    | 60,00  | 60,00        |
| Artigo 7º IV, Alínea a                      | Fundos de Renda Fixa                              | 56.676.875,74  | 17,50      | 0,00   | 14,00    | 40,00  | 40,00        |
| Artigo 7º VII, Alínea b                     | Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"               | 2.160.021,74   | 0,67       | 0,00   | 1,00     | 5,00   | 5,00         |
|                                             | Total Renda Fixa                                  | 243.791.182,12 | 75,29      |        |          |        |              |
| Renda Variável e Investimentos Estruturados |                                                   |                |            |        |          |        |              |
| Artigo 8º II, Alínea a                      | Fundos de Ações                                   | 55.709.297,58  | 17,21      | 0,00   | 19,00    | 20,00  | 20,00        |
| Artigo 8º III                               | Fundos Multimercados                              | 13.592.958,91  | 4,20       | 0,00   | 5,00     | 10,00  | 10,00        |
|                                             | Total Renda Variável e Investimentos Estruturados | 69.302.256,49  | 21,40      |        |          |        |              |
| Investimentos no Exterior                   |                                                   |                |            |        |          |        |              |
| Artigo 9º A, III                            | Ações - BDR Nível I                               | 10.691.492,61  | 3,30       | 0,00   | 2,00     | 10,00  | 10,00        |
|                                             | Total Investimentos no Exterior                   | 10.691.492,61  | 3,30       |        |          |        |              |

## 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            | 3,38<br>1.737,41 | 3,07<br>157,09    | 6,87<br>1.067,35 | 2,71<br>172,88    | 8,09<br>191,93    | 4.480.274,80  | 4.107.720,88  |
| Artigo 7º III, Alínea a<br>% do CDI          | 4,40<br>2.262,18 | 2,46<br>125,96    | 8,09<br>1.256,98 | 2,22<br>141,71    | 7,80<br>185,00    | 1.849.544,61  | 1.069.985,08  |
| Artigo 7º IV, Alínea a<br>% do CDI           | 1,76<br>904,12   | 2,74<br>140,26    | 3,74<br>580,87   | 2,29<br>145,89    | 6,59<br>156,35    | 1.021.628,21  | 1.584.281,01  |
| Artigo 7º VII, Alínea b<br>% do CDI          | 1,93<br>993,26   | 3,21<br>164,59    | 5,68<br>882,55   | 2,24<br>142,87    | 6,89<br>163,45    | 40.905,20     | 67.239,79     |
| Artigo 8º II, Alínea a<br>Var. IBOVESPA p.p. | 8,42<br>0,16     | -12,25<br>-1,24   | 26,29<br>-1,54   | -14,40<br>-4,87   | 4,04<br>2,96      | 4.327.893,36  | -7.777.284,83 |
| Artigo 8º III<br>Var. IBOVESPA p.p.          | 4,36<br>-3,90    | -0,71<br>10,30    | 8,82<br>-19,01   | -1,37<br>8,17     | 5,85<br>4,77      | 567.989,60    | -118.079,39   |
| Artigo 9º A, III<br>% do CDI                 | 2,34<br>1.204,15 | 36,12<br>1.850,21 | 9,39<br>1.458,83 | 26,98<br>1.718,68 | 53,35<br>1.265,87 | 244.473,35    | 2.836.936,48  |
|                                              |                  |                   |                  |                   |                   | 12.532.709,13 | 1.770.799,02  |

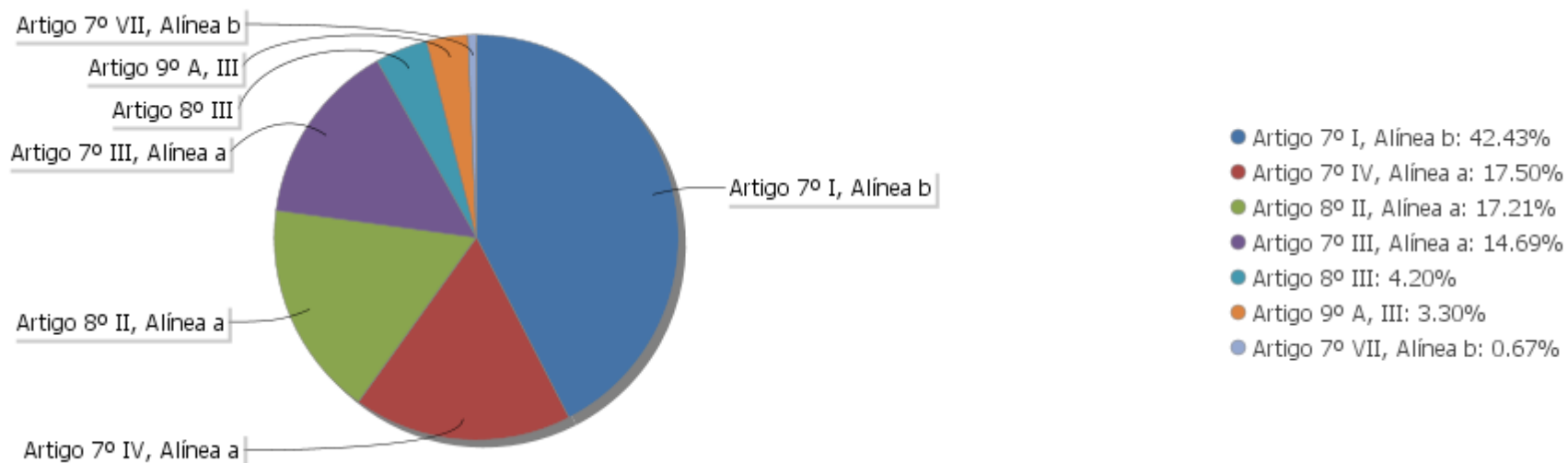
### Análise de Liquidez

| Período           | Valor (R\$)    | (%)   | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|----------------|-------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias    | 305.846.214,03 | 94,46 | 305.846.214,03        | 94,46     |
| de 31 a 364 dias  | 17.938.717,19  | 5,54  | 323.784.931,22        | 100,00    |
| acima de 365 dias | 0,00           | 0,00  | 323.784.931,22        | 100,00    |

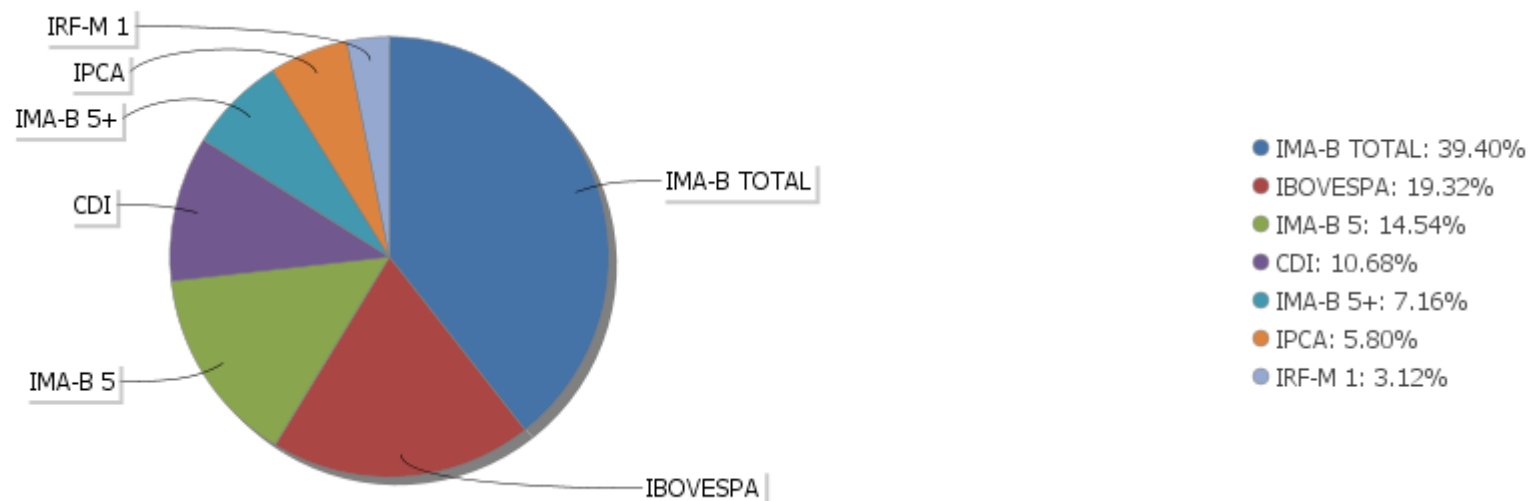


## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

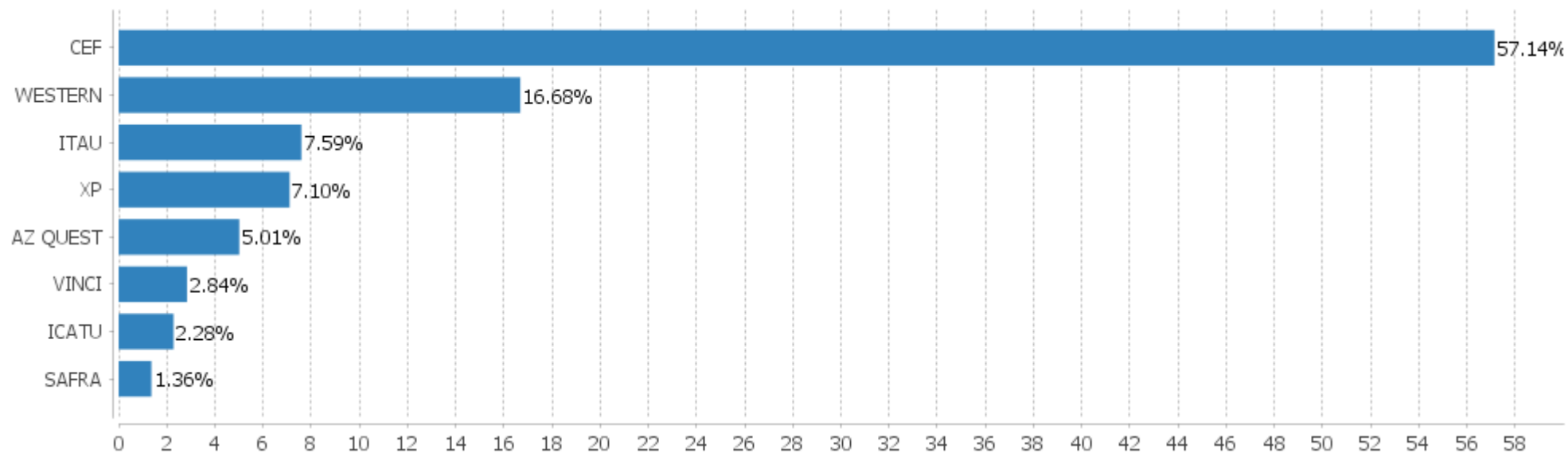


### Alocação Por Estratégia



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 |       |       |       |       |      | 0,25     |
| IPCA + 5,87%   | 0,71 | 0,66  | 0,57   | 0,14  | 0,07  | 0,74  | 0,88 |       |       |       |       |      | 3,83     |
| p.p. indexador | 0,29 | -2,12 | -11,47 | 3,04  | 2,46  | 1,96  | 3,17 |       |       |       |       |      | -3,59    |
| 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

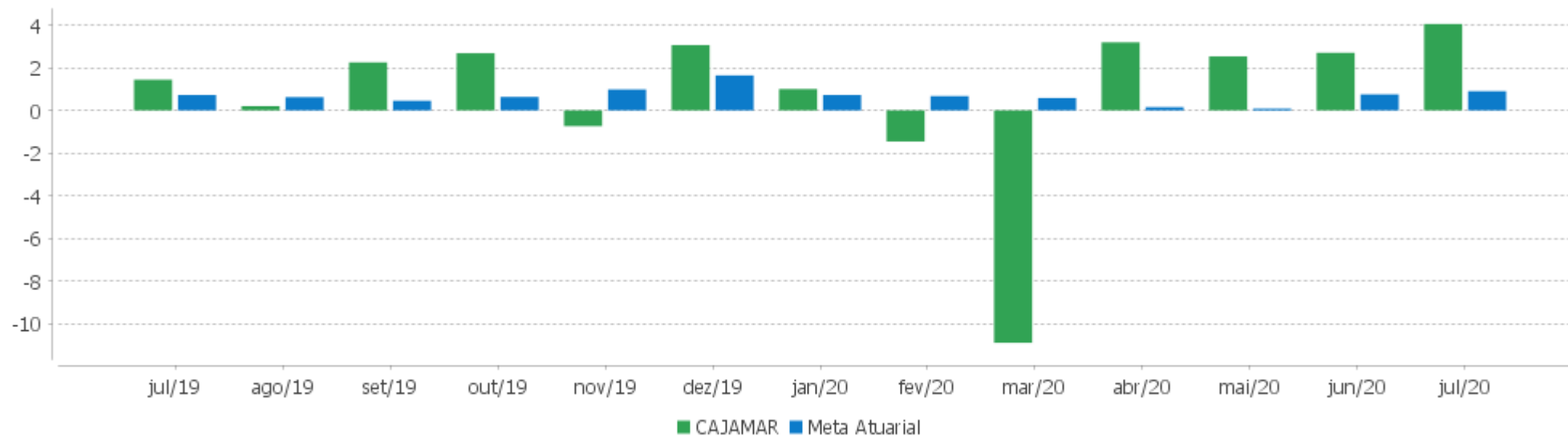
|                                 | Quantidade    | Perc. (%) | Período          | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|---------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima da Meta Atuarial    | 26            | 60,47     | 03 meses         | 9,56     | 1,70          | 7,86       | 7,17               |
| Meses abaixo da Meta Atuarial   | 17            | 39,53     | 06 meses         | -0,75    | 3,10          | -3,85      | 20,28              |
|                                 |               |           | 12 meses         | 7,88     | 8,39          | -0,52      | 14,65              |
|                                 |               |           | 24 meses         | 30,83    | 18,54         | 12,28      | 11,07              |
|                                 |               |           | 36 meses         | 42,08    | 31,23         | 10,85      | 9,38               |
|                                 |               |           | Desde 30/12/2016 | 55,11    | 37,64         | 17,46      | 9,36               |
|                                 | Rentabilidade | Mês       |                  |          |               |            |                    |
| Maior rentabilidade da Carteira | 4,81          | 2018-10   |                  |          |               |            |                    |
| 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        |
|----------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|----------------|------------------|------------------|-----------------|-----------------|
| WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.                   | 5,13<br>0,74   | 5,09<br>2,44     | 10,01<br>1,87  | 4,51<br>2,13     | 10,97<br>2,81    | 47,13<br>9,27   | 55,47<br>8,72   |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP<br>% do CDI                  | 0,25<br>127,85 | 1,62<br>83,02    | 0,82<br>127,63 | 1,25<br>79,33    | 3,72<br>88,18    | 10,14<br>93,65  | 17,77<br>95,15  |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI<br>Var. IPCA p.p.            | 0,55<br>0,19   | 2,83<br>2,37     | 1,54<br>1,30   | 2,48<br>2,23     | 5,21<br>2,90     | 19,22<br>13,62  | 29,15<br>18,81  |
| ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV<br>Var. IMA-B 5 p.p.              | 1,93<br>0,94   | 3,21<br>-0,98    | 5,68<br>1,40   | 2,24<br>-1,37    | 6,89<br>-1,94    | 21,94<br>-2,21  | 33,31<br>-1,12  |
| WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF<br>Var. IMA-B 5 p.p.                      | 1,80<br>0,81   | 6,69<br>2,50     | 6,22<br>1,94   | 5,74<br>2,12     | 11,82<br>2,99    | 32,54<br>8,38   | 43,15<br>8,72   |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.      | 4,38<br>-0,01  | 2,42<br>-0,23    | 8,09<br>-0,05  | 2,17<br>-0,22    | 7,72<br>-0,43    | 37,07<br>-0,79  | 45,56<br>-1,19  |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-B 5 p.p.        | 0,97<br>-0,02  | 4,05<br>-0,15    | 4,23<br>-0,05  | 3,48<br>-0,13    | 8,54<br>-0,29    | 23,61<br>-0,55  | 33,54<br>-0,89  |
| FI CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS RF<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.        | 0,07<br>-4,32  | 0,80<br>-1,85    | 1,77<br>-6,38  | 0,83<br>-1,55    | 4,18<br>-3,97    | 14,08<br>-23,78 | 20,75<br>-26,00 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF<br>Var. IRF-M 1 p.p.           | 0,24<br>0,00   | 2,73<br>-0,11    | 0,90<br>-0,04  | 2,30<br>-0,09    | 5,30<br>-0,21    | 12,79<br>-0,41  | 20,92<br>-0,64  |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-B 5+ p.p.      | 7,29<br>-0,03  | 1,46<br>-0,22    | 11,43<br>-0,08 | 1,50<br>-0,14    | 7,35<br>-0,46    | 47,92<br>-1,45  | 54,33<br>-1,86  |
| FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP<br>Var. IMA-B TOTAL p.p. | 4,40<br>0,01   | 2,46<br>-0,19    | 8,09<br>-0,05  | 2,22<br>-0,16    | 7,80<br>-0,36    | 36,97<br>-0,90  | 45,75<br>-1,00  |
| AZ QUEST ACOES FIC FIA<br>Var. IBOVESPA p.p.                               | 8,86<br>0,59   | -10,48<br>0,53   | 30,77<br>2,94  | -13,77<br>-4,23  | 0,82<br>-0,26    | 29,12<br>-0,78  | 68,56<br>12,44  |
| XP INVESTOR FI DE ACOES<br>Var. IBOVESPA p.p.                              | 8,64<br>0,37   | -10,21<br>0,80   | 30,36<br>2,52  | -12,98<br>-3,44  | 8,65<br>7,57     | 46,69<br>16,79  | 84,67<br>28,55  |
| ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI<br>Var. IBOVESPA p.p.               | 5,80<br>-2,47  | -24,37<br>-13,36 | 29,49<br>1,65  | -25,46<br>-15,92 | -12,43<br>-13,51 | 22,51<br>-7,40  | 52,70<br>-3,42  |
| VINCI MOSAICO FIA<br>Var. IBOVESPA p.p.                                    | 9,03<br>0,76   | -7,67<br>3,34    | 27,67<br>-0,16 | -9,25<br>0,28    | 12,89<br>11,80   | 62,12<br>32,21  | 83,30<br>27,18  |
| VINCI SELECTION EQUITIES FIA<br>Var. IBOVESPA p.p.                         | 8,97<br>0,71   | -0,74<br>10,27   | 27,03<br>-0,80 | -1,12<br>8,41    | 13,69<br>12,61   | 49,44<br>19,54  | 79,93<br>23,81  |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA                                         | 14,10          | -9,01            | 31,13          | -14,70           | 11,76            | 63,00           | 99,63           |

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.                         | 5,84     | 2,00   | 3,30     | -5,17   | 10,68    | 33,09    | 43,51    |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC                     | 7,54     | -16,38 | 23,81    | -16,23  | -0,92    | 38,66    | 71,08    |
| ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA             | 4,36     | -16,57 | 19,15    | -17,09  | -4,41    | 43,60    | 57,70    |
| Var. IBOVESPA p.p.                         | -3,90    | -5,56  | -8,68    | -7,55   | -5,49    | 13,69    | 1,58     |
| XP DIVIDENDOS FI DE ACOES                  | 6,35     | -19,30 | 16,55    | -20,45  | -1,02    | 46,79    | 53,08    |
| Var. IBOVESPA p.p.                         | -1,92    | -8,29  | -11,29   | -10,92  | -2,10    | 16,89    | -3,03    |
| XP LONG SHORT 60 FC FI MULTIMERCADO        | 1,40     | 0,38   | 1,32     | -1,06   | 0,83     | 3,39     | 14,58    |
| % do CDI                                   | 722,09   | 19,61  | 205,33   | -67,79  | 19,65    | 31,31    | 78,06    |
| WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO | 5,63     | -1,13  | 12,25    | -1,49   | 8,42     | 19,09    | 42,14    |
| % do CDI                                   | 2.898,52 | -57,91 | 1.902,60 | -95,06  | 199,67   | 176,32   | 225,65   |
| SAFRA CONS AMERICANO PB FI ACOES           | 2,02     | 26,09  | 6,36     | 17,87   | 40,24    | 67,08    |          |
| Var. IBOVESPA p.p.                         | -6,24    | 37,10  | -21,47   | 27,41   | 39,16    | 37,17    |          |
| WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I              | 2,56     | 44,17  | 11,62    | 34,25   | 63,36    | 81,57    | 147,31   |
| Var. IBOVESPA p.p.                         | -5,70    | 55,18  | -16,21   | 43,79   | 62,28    | 51,66    | 91,20    |
| CDI                                        | 0,19     | 1,95   | 0,64     | 1,57    | 4,21     | 10,83    | 18,68    |
| IBOVESPA                                   | 8,27     | -11,01 | 27,83    | -9,54   | 1,08     | 29,91    | 56,12    |
| INPC + 6%                                  | 0,98     | 4,26   | 1,99     | 3,54    | 8,88     | 19,01    | 30,64    |
| IPCA + 6%                                  | 0,90     | 3,91   | 1,73     | 3,16    | 8,47     | 18,63    | 31,32    |

## 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                       | 0,24   | 2,84   | 0,94    | 2,39    | 5,51     | 13,20    | 21,56    |
| IRF-M 1+                      | 1,47   | 7,59   | 4,50    | 6,40    | 12,02    | 32,81    | 43,78    |
| IRF-M TOTAL                   | 1,08   | 6,00   | 3,32    | 5,08    | 9,81     | 26,59    | 36,79    |
| IMA-B 5                       | 0,99   | 4,19   | 4,28    | 3,61    | 8,83     | 24,16    | 34,43    |
| IMA-B 5+                      | 7,32   | 1,68   | 11,51   | 1,64    | 7,81     | 49,37    | 56,19    |
| IMA-B TOTAL                   | 4,39   | 2,65   | 8,14    | 2,38    | 8,16     | 37,86    | 46,75    |
| IMA-C TOTAL                   | 4,26   | 12,04  | 11,01   | 9,27    | 15,97    | 43,97    | 64,91    |
| IMA-GERAL ex-C TOTAL          | 1,66   | 3,39   | 3,57    | 2,88    | 7,07     | 23,27    | 32,25    |
| IMA-GERAL TOTAL               | 1,74   | 3,64   | 3,79    | 3,07    | 7,33     | 23,84    | 33,11    |
| IDKA 2                        | 0,94   | 4,31   | 3,72    | 3,76    | 8,68     | 22,37    | 33,35    |
| IDKA 20                       | 12,08  | -1,74  | 17,28   | -0,38   | 4,95     | 69,37    | 71,28    |
| CDI                           | 0,19   | 1,95   | 0,64    | 1,57    | 4,21     | 10,83    | 18,68    |
| <b>Renda Variável</b>         |        |        |         |         |          |          |          |
| IBOVESPA                      | 8,27   | -11,01 | 27,83   | -9,54   | 1,08     | 29,91    | 56,12    |
| IBRX 100                      | 8,41   | -10,43 | 28,20   | -9,30   | 2,17     | 33,69    | 59,04    |
| IBRX 50                       | 8,15   | -11,06 | 29,00   | -9,35   | 0,23     | 26,69    | 52,24    |
| SMALL CAP                     | 9,50   | -13,20 | 31,66   | -13,59  | 7,86     | 55,28    | 71,97    |
| IFIX                          | -2,61  | -14,53 | 4,97    | -11,18  | 2,77     | 26,86    | 32,28    |
| Índice Consumo - ICON         | 7,62   | -4,11  | 27,54   | -7,49   | 12,15    | 54,44    | 58,02    |
| Índice Dividendos - IDIV      | 6,53   | -13,05 | 21,87   | -11,65  | 3,50     | 46,49    | 63,19    |
| <b>Indicadores Econômicos</b> |        |        |         |         |          |          |          |
| IPCA                          | 0,36   | 0,46   | 0,24    | 0,25    | 2,31     | 5,60     | 10,34    |
| INPC                          | 0,44   | 0,80   | 0,49    | 0,61    | 2,69     | 5,94     | 9,76     |
| IGPM                          | 2,23   | 6,71   | 4,11    | 6,21    | 9,27     | 16,26    | 25,84    |
| SELIC                         | 0,19   | 1,95   | 0,64    | 1,57    | 4,21     | 10,83    | 18,69    |
| <b>Meta Atuarial</b>          |        |        |         |         |          |          |          |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Movimentações

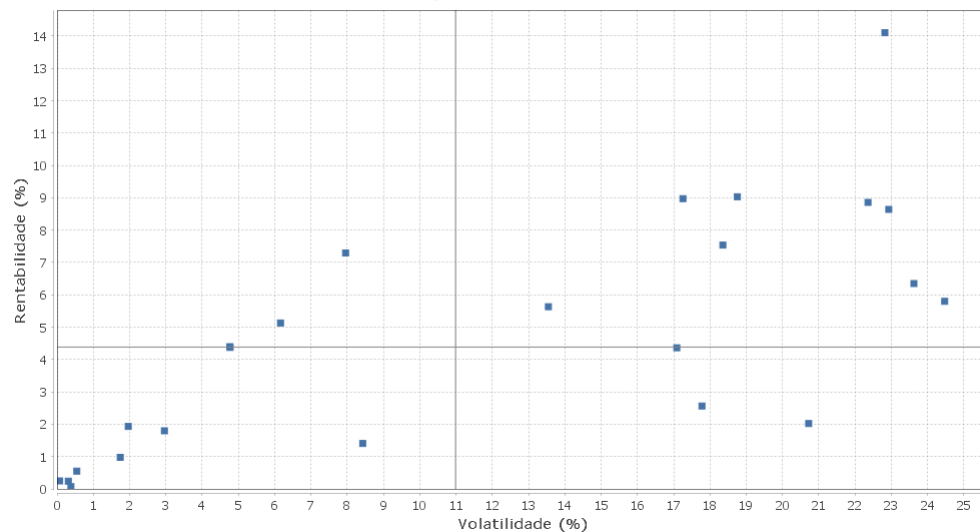
| APR | Data       | Ativo                                             | Aplicação    | Resgate      | Quantidade         | Valor Cota   |
|-----|------------|---------------------------------------------------|--------------|--------------|--------------------|--------------|
| 67  | 08/07/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP     | 7.204,42     | 0,00         | 1.945,34188795     | 3,7034210000 |
| 68  | 08/07/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP     | 0,00         | 32.000,00    | 8.640,65954154     | 3,7034210000 |
| 69  | 15/07/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP     | 96.000,00    | 0,00         | 25.910,56751700    | 3,7050520000 |
| 70  | 15/07/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP     | 0,00         | 19.000,00    | 5.128,13315441     | 3,7050520000 |
| 60  | 29/07/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF       | 271.032,44   | 0,00         | 104.664,11666914   | 2,5895450000 |
| 66  | 29/07/2020 | FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP | 4.487.705,56 | 0,00         | 1.190.560,72775411 | 3,7694050000 |
| 71  | 30/07/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP     | 0,00         | 2.560.000,00 | 690.082,75601801   | 3,7097000000 |



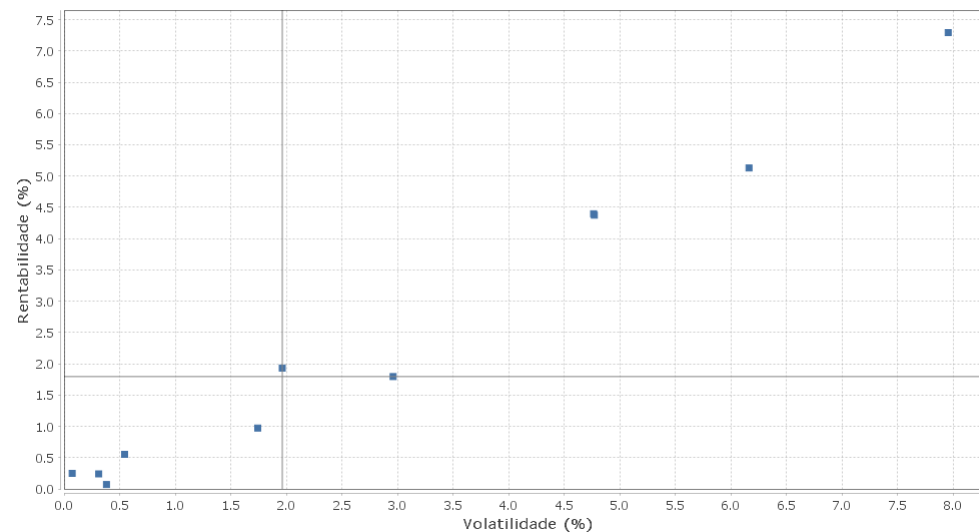
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Risco - Dispersão

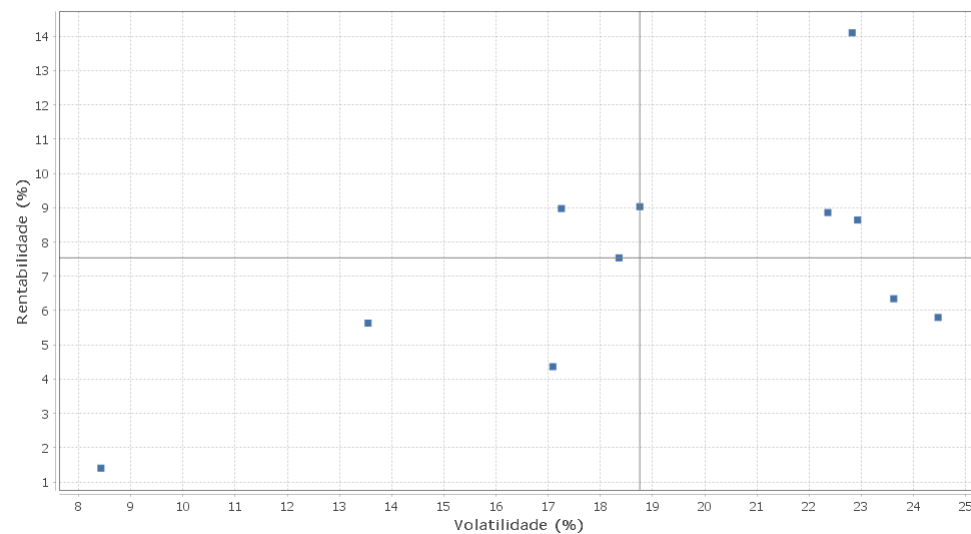
CAJAMAR - No Mês



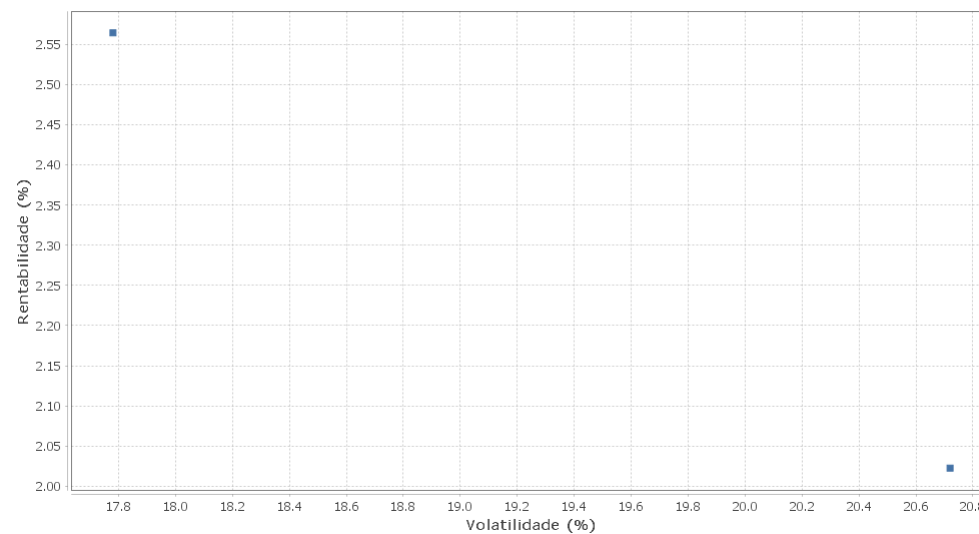
Renda Fixa - No Mês



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  | 0,07         | 0,02 | 0,25  | 20.470.413,53 | 6,32       |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF       | Artigo 7º I, Alínea b   | 0,31         | 0,04 | 0,24  | 9.936.293,95  | 3,07       |
| FI CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS RF        | Artigo 7º I, Alínea b   | 0,38         | 0,04 | 0,07  | 5.244.136,00  | 1,62       |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI     | Artigo 7º IV, Alínea a  | 0,54         | 0,08 | 0,55  | 18.503.550,70 | 5,71       |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP    | Artigo 7º I, Alínea b   | 1,74         | 0,22 | 0,97  | 23.814.057,98 | 7,35       |
| ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV          | Artigo 7º VII, Alínea b | 1,96         | 0,29 | 1,93  | 2.160.021,74  | 0,67       |
| WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF                  | Artigo 7º I, Alínea b   | 2,96         | 0,38 | 1,80  | 20.406.428,87 | 6,30       |
| FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP | Artigo 7º III, Alínea a | 4,76         | 0,68 | 4,40  | 47.563.886,11 | 14,69      |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP      | Artigo 7º I, Alínea b   | 4,77         | 0,68 | 4,38  | 55.154.198,52 | 17,03      |
| WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF                   | Artigo 7º IV, Alínea a  | 6,16         | 0,86 | 5,13  | 17.702.911,51 | 5,47       |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP   | Artigo 7º I, Alínea b   | 7,95         | 1,13 | 7,29  | 22.835.283,21 | 7,05       |
| XP LONG SHORT 60 FC FI MULTIMERCADO               | Artigo 8º III           | 8,43         | 0,93 | 1,40  | 3.972.577,07  | 1,23       |
| WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO        | Artigo 8º III           | 13,55        | 1,64 | 5,63  | 9.620.381,84  | 2,97       |
| ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA                    | Artigo 8º II, Alínea a  | 17,09        | 1,96 | 4,36  | 5.232.553,53  | 1,62       |
| VINCI SELECTION EQUITIES FIA                      | Artigo 8º II, Alínea a  | 17,25        | 2,16 | 8,97  | 3.594.689,59  | 1,11       |
| WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I                     | Artigo 9º A, III        | 17,78        | 1,95 | 2,56  | 6.281.935,92  | 1,94       |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC                            | Artigo 8º II, Alínea a  | 18,35        | 2,22 | 7,54  | 4.776.950,71  | 1,48       |
| VINCI MOSAICO FIA                                 | Artigo 8º II, Alínea a  | 18,75        | 2,32 | 9,03  | 5.594.499,82  | 1,73       |
| SAFRA CONS AMERICANO PB FI ACOES                  | Artigo 9º A, III        | 20,72        | 2,23 | 2,02  | 4.409.556,69  | 1,36       |
| AZ QUEST ACOES FIC FIA                            | Artigo 8º II, Alínea a  | 22,36        | 2,69 | 8,86  | 9.969.331,06  | 3,08       |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA                | Artigo 8º II, Alínea a  | 22,82        | 2,94 | 14,10 | 6.244.638,80  | 1,93       |
| XP INVESTOR FI DE ACOES                           | Artigo 8º II, Alínea a  | 22,93        | 2,74 | 8,64  | 11.446.722,41 | 3,54       |
| XP DIVIDENDOS FI DE ACOES                         | Artigo 8º II, Alínea a  | 23,62        | 2,72 | 6,35  | 7.554.705,30  | 2,33       |
| ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI            | Artigo 8º II, Alínea a  | 24,47        | 2,78 | 5,80  | 1.295.206,36  | 0,40       |