



**LDB**  
EMPRESAS

**CAJAMAR**  
MAIO 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 15.06.2020.

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** 76,34%

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         | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS P | 12,48               | 1,50            | -3,82           | 51.793.421,45         | 17,40        | 5.962.762.833,75  | 0,87    |
| CEF                                    | CEF         | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS                    | 0,54                | 0,39            | 2,22            | 9.076.872,73          | 3,05         | 10.824.772.393,85 | 0,08    |
| CEF                                    | CEF         | FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP     | 5,00                | 2,11            | 1,92            | 23.328.154,97         | 7,84         | 8.882.233.150,63  | 0,26    |
| CEF                                    | CEF         | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA B 5+ TITULO | 19,11               | 1,00            | -8,04           | 20.698.158,21         | 6,95         | 1.931.164.845,98  | 1,07    |
| WESTERN                                | BNP PARIBAS | WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF                   | 9,00                | 2,90            | 3,35            | 19.767.229,67         | 6,64         | 568.107.043,95    | 3,48    |
| CEF                                    | CEF         | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS  | 1,22                | 0,80            | -0,16           | 5.194.320,00          | 1,75         | 255.375.409,38    | 2,03    |
| <b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b> |             |                                                    | <b>10,19</b>        | <b>1,63</b>     | <b>-1,99</b>    | <b>129.858.157,03</b> | <b>43,63</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 | 12,40               | 1,49            | -3,80           | 40.408.369,68        | 13,58        | 2.853.203.781,55 | 1,42    |
| <b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b> |        |                                                   | <b>12,40</b>        | <b>1,49</b>     | <b>-3,80</b>    | <b>40.408.369,68</b> | <b>13,58</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 | 0,30                | 0,33            | 1,12            | 20.090.999,83        | 6,75         | 4.656.011.205,04 | 0,43    |
| WESTERN                                 | BNP PARIBAS | WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF               | 16,25               | 2,22            | -2,36           | 16.448.791,13        | 5,53         | 549.970.506,89   | 2,99    |
| ITAU                                    | ITAU        | ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI | 1,92                | 0,54            | 1,82            | 18.322.209,94        | 6,16         | 5.202.369.354,06 | 0,35    |
| <b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b> |             |                                               | <b>6,00</b>         | <b>1,00</b>     | <b>0,02</b>     | <b>54.862.000,90</b> | <b>18,43</b> |                  |         |

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Gestor                                   | Admin. | Ativo                                    | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentab.<br>Mês (%) | Rentab.<br>Ano (%) | Valor (R\$)         | % Carteira  | PL do Fundo    | % Fundo |
|------------------------------------------|--------|------------------------------------------|------------------------|--------------------|--------------------|---------------------|-------------|----------------|---------|
| ICATU                                    | BEM    | ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV | 5,95                   | 2,19               | -0,20              | 2.088.673,80        | 0,70        | 553.692.031,39 | 0,38    |
| <b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b</b> |        |                                          | <b>5,95</b>            | <b>2,19</b>        | <b>-0,20</b>       | <b>2.088.673,80</b> | <b>0,70</b> |                |         |
| Renda Fixa                               |        |                                          | 9,65                   | 1,46               | -1,92              | 227.217.201,41      | 76,34       |                |         |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

20,25%

#### 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                 | 44,35                  | 9,33               | -25,16             | 8.334.906,18         | 2,80         | 752.971.612,41   | 1,11    |
| XP                                      | XP     | XP INVESTOR FI DE ACOES                | 48,26                  | 9,82               | -24,35             | 9.643.365,67         | 3,24         | 340.807.654,76   | 2,83    |
| ICATU                                   | BEM    | ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA         | 38,20                  | 5,82               | -25,90             | 4.647.128,11         | 1,56         | 1.455.929.520,62 | 0,32    |
| AZ QUEST                                | BEM    | AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA     | 45,23                  | 5,79               | -26,59             | 5.037.902,53         | 1,69         | 1.070.014.738,46 | 0,47    |
| XP                                      | XP     | XP DIVIDENDOS FI DE ACOES              | 38,39                  | 2,95               | -28,71             | 6.673.672,21         | 2,24         | 262.008.557,90   | 2,55    |
| VINCI                                   | BEM    | VINCI SELECTION EQUITIES FIA           | 37,62                  | 7,60               | -15,92             | 3.044.756,39         | 1,02         | 386.565.782,75   | 0,79    |
| ITAU                                    | ITAU   | ITAU ACOES DUNAMIS FIC                 | 42,55                  | 5,36               | -28,85             | 4.064.901,67         | 1,37         | 3.016.388.876,97 | 0,13    |
| ITAU                                    | ITAU   | ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI | 50,53                  | 9,18               | -36,23             | 1.092.106,37         | 0,37         | 1.596.760.931,95 | 0,07    |
| VINCI                                   | BEM    | VINCI MOSAICO FIA                      | 41,15                  | 7,08               | -22,56             | 4.692.245,82         | 1,58         | 1.359.447.428,89 | 0,35    |
| <b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b> |        |                                        | <b>42,18</b>           | <b>7,07</b>        | <b>-25,60</b>      | <b>47.230.984,95</b> | <b>15,87</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 | 31,91                  | 5,37               | -7,19              | 9.030.882,25         | 3,03         | 867.265.875,78 | 1,04    |
| XP                                                 | BNY MELLON  | XP LONG SHORT 60 FC FI MULTIMERCADO        | 6,67                   | 2,06               | 1,11               | 4.001.528,07         | 1,34         | 153.752.095,97 | 2,60    |
| <b>Sub-total Artigo 8º III</b>                     |             |                                            | <b>22,10</b>           | <b>4,33</b>        | <b>-4,81</b>       | <b>13.032.410,32</b> | <b>4,38</b>  |                |         |
| <b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b> |             |                                            | <b>37,28</b>           | <b>6,47</b>        | <b>-21,88</b>      | <b>60.263.395,27</b> | <b>20,25</b> |                |         |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,41%

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 | 29,50                  | 3,31               | 22,46              | 4.282.803,15          | 1,44          | 1.079.247.594,50 | 0,40    |
| WESTERN                           | BNP PARIBAS | WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I    | 26,38                  | 4,34               | 34,76              | 5.872.035,67          | 1,97          | 767.145.511,78   | 0,77    |
| <b>Sub-total Artigo 9º A, III</b> |             |                                  | <b>27,07</b>           | <b>3,90</b>        | <b>29,29</b>       | <b>10.154.838,82</b>  | <b>3,41</b>   |                  |         |
| <b>Investimentos no Exterior</b>  |             |                                  | <b>27,07</b>           | <b>3,90</b>        | <b>29,29</b>       | <b>10.154.838,82</b>  | <b>3,41</b>   |                  |         |
| <b>Total</b>                      |             |                                  |                        |                    |                    | <b>297.635.435,50</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                      | 129.858.157,03 | 43,63      | 0,00                      | 45,00    | 100,00 | 100,00       |
| Artigo 7º III, Alínea a                     | Fundos Renda Fixa Referenciados                   | 40.408.369,68  | 13,58      | 0,00                      | 14,00    | 60,00  | 60,00        |
| Artigo 7º IV, Alínea a                      | Fundos de Renda Fixa                              | 54.862.000,90  | 18,43      | 0,00                      | 14,00    | 40,00  | 40,00        |
| Artigo 7º VII, Alínea b                     | Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"               | 2.088.673,80   | 0,70       | 0,00                      | 1,00     | 5,00   | 5,00         |
|                                             | Total Renda Fixa                                  | 227.217.201,41 | 76,34      |                           |          |        |              |
| Renda Variável e Investimentos Estruturados |                                                   |                |            |                           |          |        |              |
| Artigo 8º II, Alínea a                      | Fundos de Ações                                   | 47.230.984,95  | 15,87      | 0,00                      | 19,00    | 20,00  | 20,00        |
| Artigo 8º III                               | Fundos Multimercados                              | 13.032.410,32  | 4,38       | 0,00                      | 5,00     | 10,00  | 10,00        |
|                                             | Total Renda Variável e Investimentos Estruturados | 60.263.395,27  | 20,25      |                           |          |        |              |
| Investimentos no Exterior                   |                                                   |                |            |                           |          |        |              |
| Artigo 9º A, III                            | Ações - BDR Nível I                               | 10.154.838,82  | 3,41       | 0,00                      | 2,00     | 10,00  | 10,00        |
|                                             | Total Investimentos no Exterior                   | 10.154.838,82  | 3,41       |                           |          |        |              |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Rentabilidades por Artigo

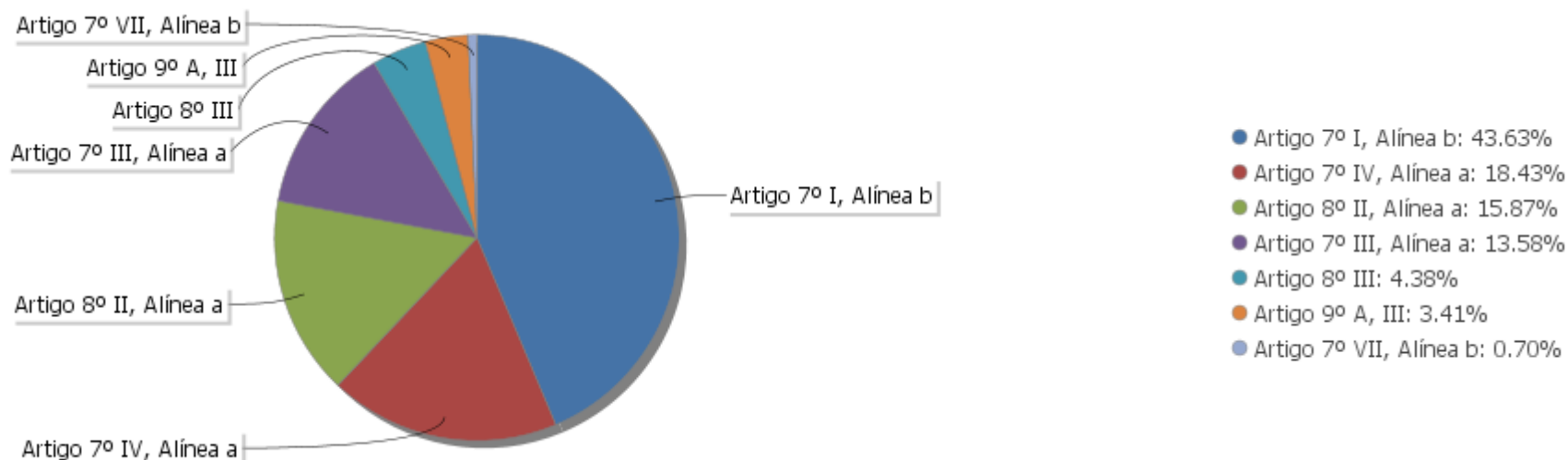
| Estratégia Indexador                         | No Mês           | No Ano            | 3 meses           | 6 meses           | 12 meses          | No Mês(R\$)  | No Ano(R\$)    |
|----------------------------------------------|------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|--------------|----------------|
| Artigo 7º I, Alínea b<br>% do CDI            | 1,63<br>692,28   | -1,99<br>-129,10  | -2,83<br>-328,14  | -0,30<br>-15,37   | 7,19<br>147,72    | 2.084.318,16 | -2.612.651,38  |
| Artigo 7º III, Alínea a<br>% do CDI          | 1,49<br>630,18   | -3,80<br>-247,19  | -4,44<br>-515,37  | -1,89<br>-98,36   | 6,26<br>128,45    | 591.676,64   | -1.597.825,79  |
| Artigo 7º IV, Alínea a<br>% do CDI           | 1,00<br>423,40   | 0,02<br>1,49      | -0,88<br>-102,49  | 1,12<br>58,20     | 6,24<br>128,16    | 511.826,73   | 43.242,21      |
| Artigo 7º VII, Alínea b<br>% do CDI          | 2,19<br>929,35   | -0,20<br>-12,76   | -1,71<br>-198,04  | 0,97<br>50,33     |                   | 44.791,05    | -4.108,15      |
| Artigo 8º II, Alínea a<br>Var. IBOVESPA p.p. | 7,07<br>-1,49    | -25,60<br>-1,18   | -21,98<br>-5,88   | -18,97<br>0,28    | -4,45<br>5,47     | 3.120.285,89 | -16.255.597,46 |
| Artigo 8º III<br>Var. IBOVESPA p.p.          | 4,33<br>-4,23    | -4,81<br>19,61    | -0,20<br>15,90    | -3,23<br>16,02    | 7,38<br>17,30     | 541.158,72   | -678.627,98    |
| Artigo 9º A, III<br>% do CDI                 | 3,90<br>1.654,63 | 29,29<br>1.903,19 | 24,87<br>2.887,19 | 27,44<br>1.429,52 | 52,45<br>1.076,85 | 381.337,36   | 2.300.282,69   |
|                                              |                  |                   |                   |                   |                   | 7.275.394,55 | -18.805.285,86 |

### Análise de Liquidez

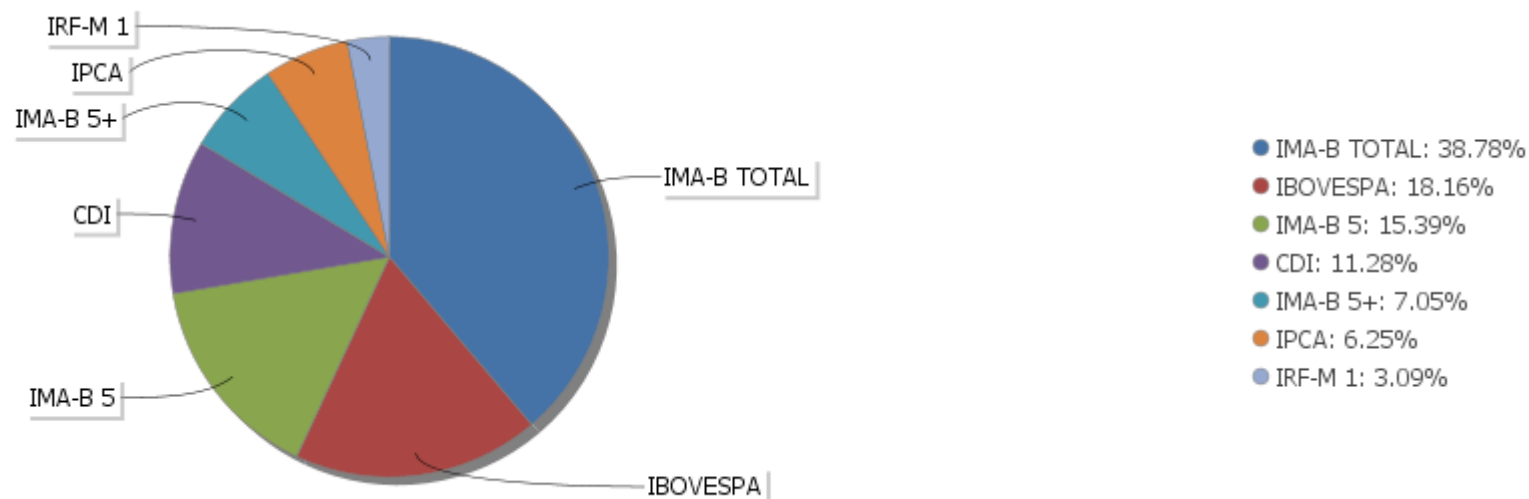
| Período           | Valor (R\$)    | (%)   | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|----------------|-------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias    | 276.637.683,55 | 92,95 | 276.637.683,55        | 92,95     |
| de 31 a 364 dias  | 20.997.751,95  | 7,05  | 297.635.435,50        | 100,00    |
| acima de 365 dias | 0,00           | 0,00  | 297.635.435,50        | 100,00    |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

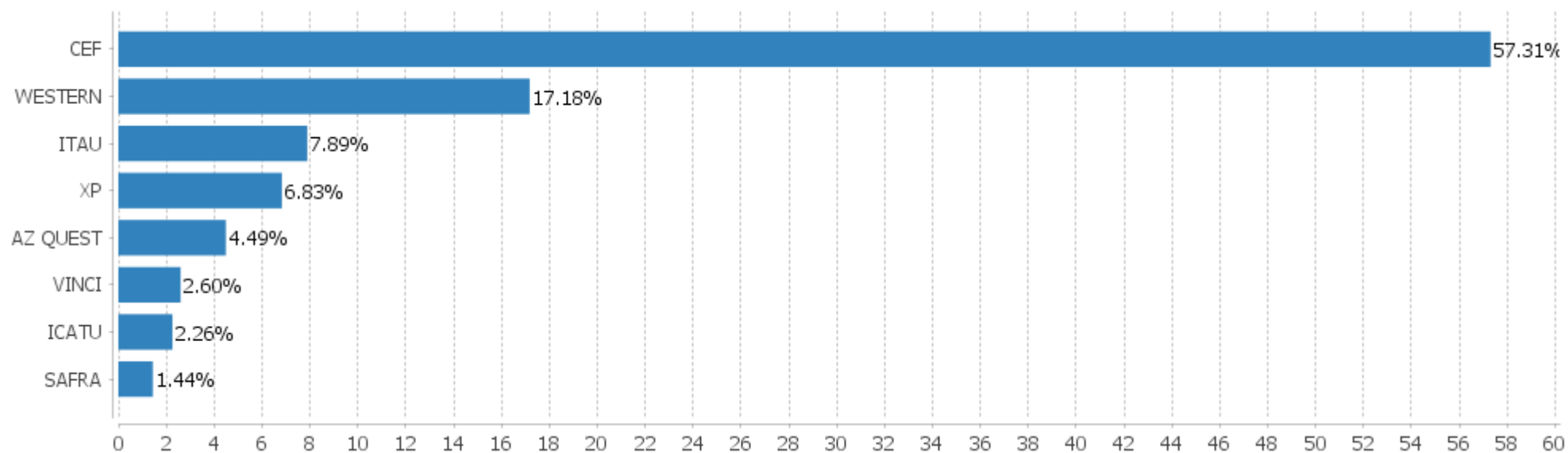


### Alocação Por Estratégia



## 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  |       |      |       |       |       |       |      | -6,19    |
| IPCA + 5,87%   | 0,71 | 0,66  | 0,57   | 0,14  | 0,07  |       |      |       |       |       |       |      | 2,17     |
| p.p. indexador | 0,29 | -2,12 | -11,47 | 3,04  | 2,46  |       |      |       |       |       |       |      | -8,36    |
| 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     |

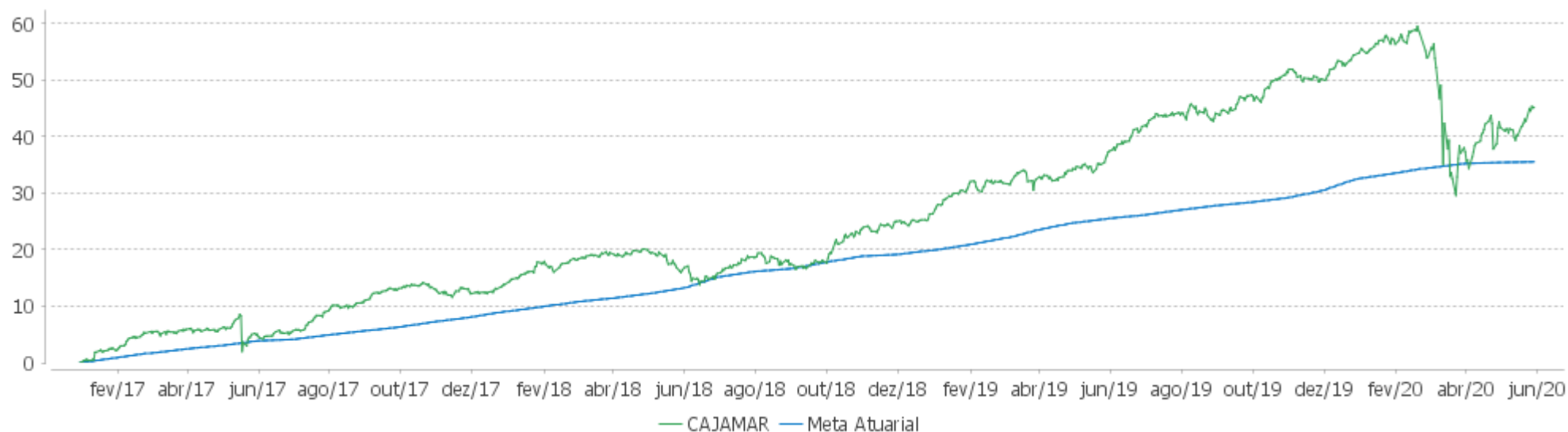
### PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

#### RELATÓRIO TRIMESTRAL

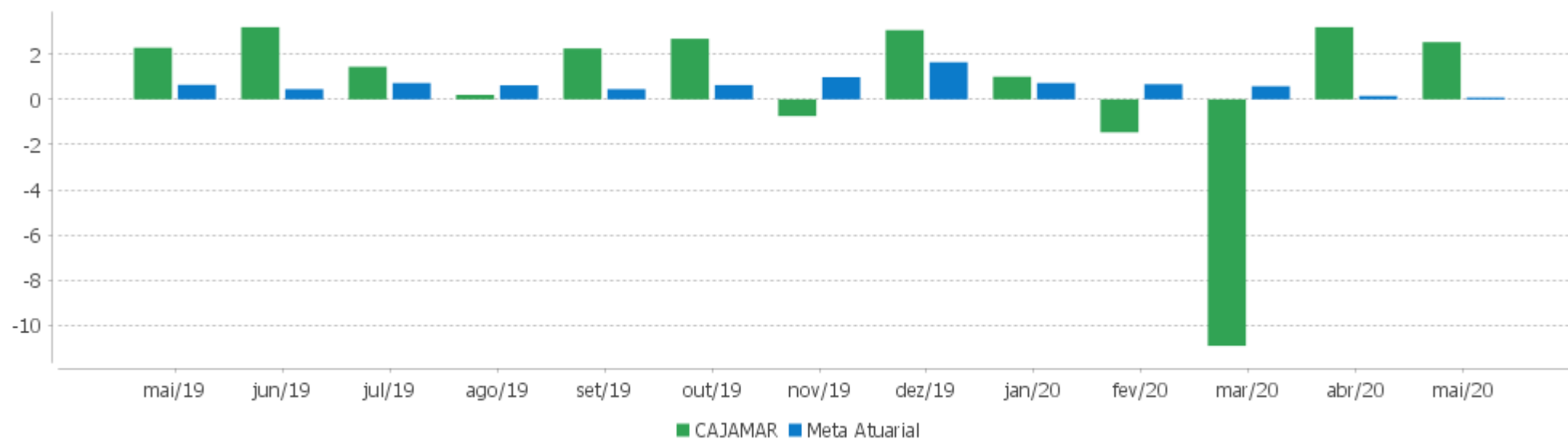
|                                 | Quantidade    | Perc. (%) | Período          | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|---------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima da Meta Atuarial    | 24            | 58,54     | 03 meses         | -5,74    | 0,79          | -6,52      | 27,68              |
| Meses abaixo da Meta Atuarial   | 17            | 41,46     | 06 meses         | -3,32    | 3,85          | -7,17      | 20,16              |
|                                 |               |           | 12 meses         | 5,67     | 7,91          | -2,24      | 14,55              |
|                                 |               |           | 24 meses         | 24,76    | 19,69         | 5,08       | 11,05              |
|                                 |               |           | 36 meses         | 38,22    | 30,40         | 7,82       | 9,31               |
|                                 |               |           | Desde 30/12/2016 | 45,15    | 35,44         | 9,72       | 9,48               |
|                                 | 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        |
|-----------------------------------------------------------------------------|------------------|------------------|-----------------|------------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV<br>Var. IMA-B 5 p.p.               | 2,19<br>0,07     | -0,20<br>-2,23   | -1,71<br>-2,52  | 0,97<br>-2,32    | 6,00<br>-3,46   | 20,26<br>-3,67  | 33,25<br>-2,85  |
| FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.  | 1,49<br>-0,03    | -3,80<br>-0,17   | -4,44<br>-0,12  | -1,89<br>-0,18   | 6,26<br>-0,42   | 31,07<br>-0,92  | 42,17<br>-1,34  |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS P<br>Var. IMA-B TOTAL p.p. | 1,50<br>-0,02    | -3,82<br>-0,19   | -4,48<br>-0,16  | -1,91<br>-0,20   | 6,23<br>-0,45   | 31,21<br>-0,78  | 42,33<br>-1,17  |
| WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF<br>Var. IMA-B 5 p.p.                       | 2,90<br>0,78     | 3,35<br>1,32     | 1,38<br>0,57    | 4,80<br>1,51     | 12,21<br>2,75   | 30,60<br>6,67   | 44,37<br>8,27   |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-B 5 p.p.         | 2,11<br>-0,02    | 1,92<br>-0,11    | 0,74<br>-0,08   | 3,15<br>-0,14    | 9,15<br>-0,31   | 23,37<br>-0,56  | 35,19<br>-0,90  |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.  | 0,80<br>-0,72    | -0,16<br>3,48    | -0,37<br>3,95   | 0,62<br>2,33     | 4,59<br>-2,09   | 14,35<br>-17,64 | 23,83<br>-19,68 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS<br>Var. IRF-M 1 p.p.                        | 0,39<br>-0,02    | 2,22<br>-0,09    | 1,42<br>-0,05   | 2,63<br>-0,11    | 6,11<br>-0,21   | 13,55<br>-0,42  | 22,63<br>-0,66  |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA B 5+ TITULO<br>Var. IMA-B 5+ p.p.    | 1,00<br>-0,02    | -8,04<br>-0,15   | -8,27<br>-0,06  | -5,68<br>-0,20   | 3,72<br>-0,45   | 36,70<br>-1,38  | 46,24<br>-1,80  |
| WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.                    | 2,22<br>0,70     | -2,36<br>1,28    | -3,68<br>0,64   | -0,25<br>1,46    | 9,24<br>2,56    | 38,94<br>6,95   | 51,17<br>7,67   |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP<br>% do CDI                   | 0,33<br>139,24   | 1,12<br>73,00    | 0,47<br>55,08   | 1,48<br>77,07    | 4,25<br>87,22   | 10,73<br>92,88  | 19,09<br>94,97  |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI<br>Var. IPCA p.p.             | 0,54<br>0,92     | 1,82<br>1,99     | 1,22<br>1,84    | 2,17<br>1,19     | 7,84<br>5,96    | 19,42<br>12,80  | 32,39<br>22,72  |
| XP LONG SHORT 60 FC FI MULTIMERCADO<br>% do CDI                             | 2,06<br>873,77   | 1,11<br>72,41    | -0,58<br>-67,07 | 0,71<br>37,06    | 1,99<br>40,89   | 5,82<br>50,38   | 17,97<br>89,41  |
| WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO<br>% do CDI                      | 5,37<br>2.277,97 | -7,19<br>-467,17 | -0,03<br>-3,14  | -4,76<br>-248,03 | 10,60<br>217,68 | 16,29<br>140,98 | 38,45<br>191,27 |
| AZ QUEST ACOES FIC FIA<br>Var. IBOVESPA p.p.                                | 9,33<br>0,76     | -25,16<br>-0,73  | -21,39<br>-5,30 | -19,52<br>-0,27  | -9,51<br>0,41   | 10,88<br>-2,99  | 50,55<br>11,18  |
| XP INVESTOR FI DE ACOES<br>Var. IBOVESPA p.p.                               | 9,82<br>1,25     | -24,35<br>0,07   | -22,11<br>-6,01 | -16,77<br>2,48   | 1,16<br>11,08   | 28,48<br>14,61  | 67,10<br>27,73  |
| VINCI MOSAICO FIA<br>Var. IBOVESPA p.p.                                     | 7,08<br>-1,48    | -22,56<br>1,86   | -19,53<br>-3,43 | -13,01<br>6,24   | 3,13<br>13,06   | 36,40<br>22,53  | 65,21<br>25,83  |
| ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI                                      | 9,18             | -36,23           | -30,73          | -29,72           | -18,72          | 6,36            | 36,83           |

## 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.                 | 0,62   | -11,80 | -14,63  | -10,47  | -8,80    | -7,52    | -2,54    |
| VINCI SELECTION EQUITIES FIA       | 7,60   | -15,92 | -10,94  | -9,45   | 2,67     | 30,45    | 60,38    |
| Var. IBOVESPA p.p.                 | -0,97  | 8,50   | 5,15    | 9,80    | 12,60    | 16,57    | 21,01    |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA | 5,79   | -26,59 | -26,64  | -18,65  | 4,15     | 30,60    | 76,97    |
| Var. IBOVESPA p.p.                 | -2,78  | -2,17  | -10,55  | 0,60    | 14,07    | 16,72    | 37,60    |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC             | 5,36   | -28,85 | -20,97  | -23,06  | -6,21    | 20,72    |          |
| ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA     | 5,82   | -25,90 | -20,82  | -20,34  | -8,74    | 28,96    | 46,25    |
| Var. IBOVESPA p.p.                 | -2,75  | -1,48  | -4,72   | -1,09   | 1,18     | 15,08    | 6,88     |
| XP DIVIDENDOS FI DE ACOES          | 2,95   | -28,71 | -24,53  | -23,52  | -7,86    | 32,28    | 46,61    |
| Var. IBOVESPA p.p.                 | -5,61  | -4,29  | -8,43   | -4,27   | 2,07     | 18,41    | 7,24     |
| SAFRA CONS AMERICANO PB FI ACOES   | 3,31   | 22,46  | 20,81   | 20,97   | 45,88    | 72,10    |          |
| Var. IBOVESPA p.p.                 | -5,26  | 46,88  | 36,91   | 40,21   | 55,80    | 58,23    |          |
| WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I      | 4,34   | 34,76  | 28,01   | 32,63   | 59,83    | 77,95    | 126,28   |
| Var. IBOVESPA p.p.                 | -4,23  | 59,18  | 44,11   | 51,88   | 69,75    | 64,07    | 86,91    |
| CDI                                | 0,24   | 1,54   | 0,86    | 1,92    | 4,87     | 11,55    | 20,10    |
| IBOVESPA                           | 8,57   | -24,42 | -16,10  | -19,25  | -9,92    | 13,87    | 39,37    |
| INPC + 6%                          | 0,21   | 2,45   | 1,14    | 4,20    | 8,15     | 20,09    | 29,45    |
| IPCA + 6%                          | 0,08   | 2,22   | 0,82    | 3,90    | 7,97     | 19,75    | 30,46    |

## 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                       | 0,42   | 2,31   | 1,47    | 2,74    | 6,33     | 13,97    | 23,28    |
| IRF-M 1+                      | 1,92   | 4,94   | 2,96    | 5,70    | 13,65    | 31,67    | 46,28    |
| IRF-M TOTAL                   | 1,42   | 4,05   | 2,47    | 4,69    | 11,31    | 26,14    | 39,22    |
| IMA-B 5                       | 2,12   | 2,03   | 0,82    | 3,29    | 9,46     | 23,93    | 36,10    |
| IMA-B 5+                      | 1,02   | -7,88  | -8,21   | -5,48   | 4,17     | 38,08    | 48,04    |
| IMA-B TOTAL                   | 1,52   | -3,64  | -4,32   | -1,70   | 6,68     | 31,99    | 43,51    |
| IMA-C TOTAL                   | 2,63   | 3,59   | 0,39    | 4,00    | 13,32    | 37,08    | 56,72    |
| IMA-GERAL ex-C TOTAL          | 0,97   | 0,80   | -0,15   | 1,71    | 7,42     | 21,97    | 33,05    |
| IMA-GERAL TOTAL               | 1,02   | 0,88   | -0,13   | 1,78    | 7,59     | 22,39    | 33,68    |
| IDKA 2                        | 1,75   | 2,33   | 1,10    | 3,57    | 9,03     | 22,17    | 35,19    |
| IDKA 20                       | 0,44   | -15,84 | -14,60  | -12,53  | -2,27    | 47,87    | 55,09    |
| CDI                           | 0,24   | 1,54   | 0,86    | 1,92    | 4,87     | 11,55    | 20,10    |
| <b>Renda Variável</b>         |        |        |         |         |          |          |          |
| IBOVESPA                      | 8,57   | -24,42 | -16,10  | -19,25  | -9,92    | 13,87    | 39,37    |
| IBRX 100                      | 8,52   | -24,19 | -16,35  | -18,67  | -8,92    | 16,77    | 41,65    |
| IBRX 50                       | 9,10   | -24,78 | -16,07  | -19,84  | -11,37   | 10,51    | 35,55    |
| SMALL CAP                     | 5,07   | -30,73 | -24,82  | -21,96  | -1,69    | 25,45    | 48,98    |
| IFIX                          | 2,08   | -16,88 | -10,33  | -8,05   | 4,11     | 20,03    | 29,22    |
| Índice Consumo - ICON         | 7,65   | -19,06 | -13,24  | -12,56  | 7,69     | 32,60    | 36,80    |
| Índice Dividendos - IDIV      | 5,00   | -25,08 | -18,87  | -17,60  | -5,50    | 29,54    | 45,59    |
| <b>Indicadores Econômicos</b> |        |        |         |         |          |          |          |
| IPCA                          | -0,38  | -0,16  | -0,62   | 0,99    | 1,88     | 6,62     | 9,67     |
| INPC                          | -0,25  | 0,06   | -0,30   | 1,28    | 2,05     | 6,93     | 8,81     |
| IGPM                          | 0,28   | 2,79   | 2,34    | 4,93    | 6,51     | 14,67    | 19,57    |
| SELIC                         | 0,24   | 1,54   | 0,86    | 1,92    | 4,87     | 11,55    | 20,11    |
| <b>Meta Atuarial</b>          |        |        |         |         |          |          |          |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Movimentações

| Data       | Ativo                                         | Aplicação    | Resgate      | Quantidade         | Valor Cota   |
|------------|-----------------------------------------------|--------------|--------------|--------------------|--------------|
| 06/05/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 112.000,00   | 0,00         | 30.418,50705400    | 3,6819690000 |
| 08/05/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00         | 34.000,00    | 9.228,49254500     | 3,6842420000 |
| 15/05/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00         | 14.000,00    | 3.798,70340900     | 3,6854680000 |
| 19/05/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00         | 9.700,00     | 2.631,12276700     | 3,6866390000 |
| 20/05/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00         | 270.080,15   | 73.244,14022300    | 3,6873960000 |
| 20/05/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS               | 270.080,15   | 0,00         | 104.946,05819100   | 2,5735140000 |
| 22/05/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00         | 1.900,00     | 515,13866100       | 3,6883270000 |
| 28/05/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00         | 1.648.977,56 | 446.664,82748600   | 3,6917560000 |
| 29/05/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 4.710.972,42 | 0,00         | 1.275.913,13773000 | 3,6922360000 |

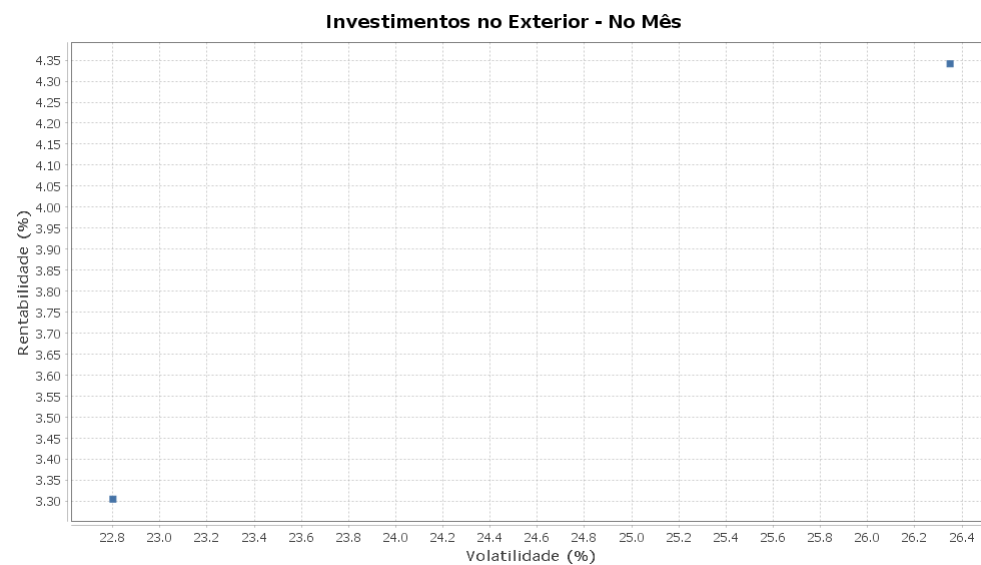
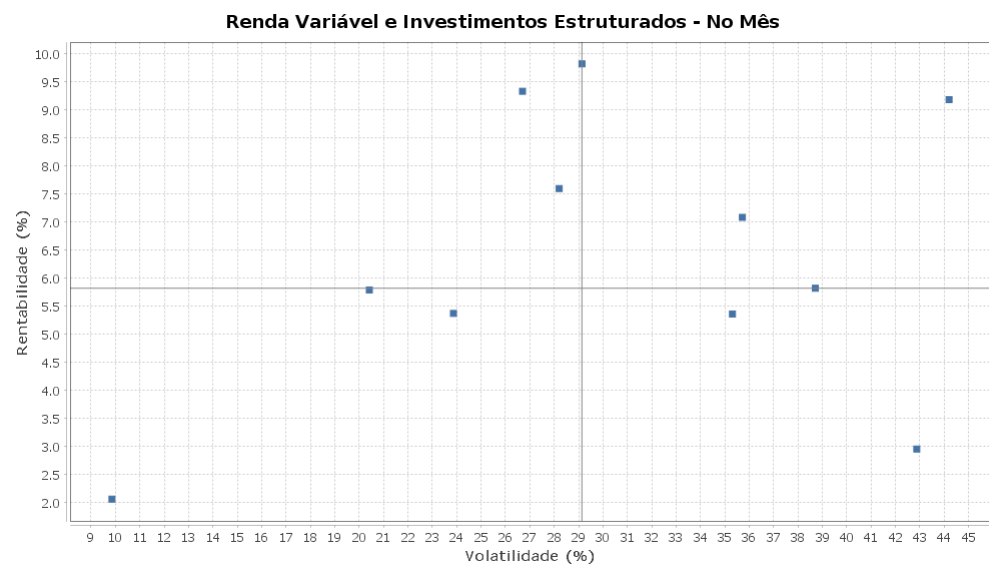
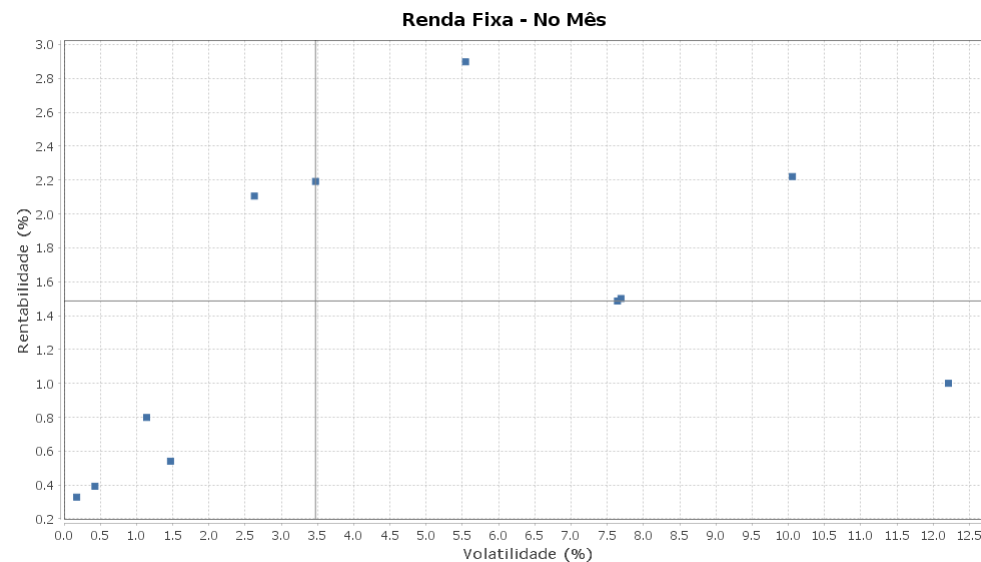
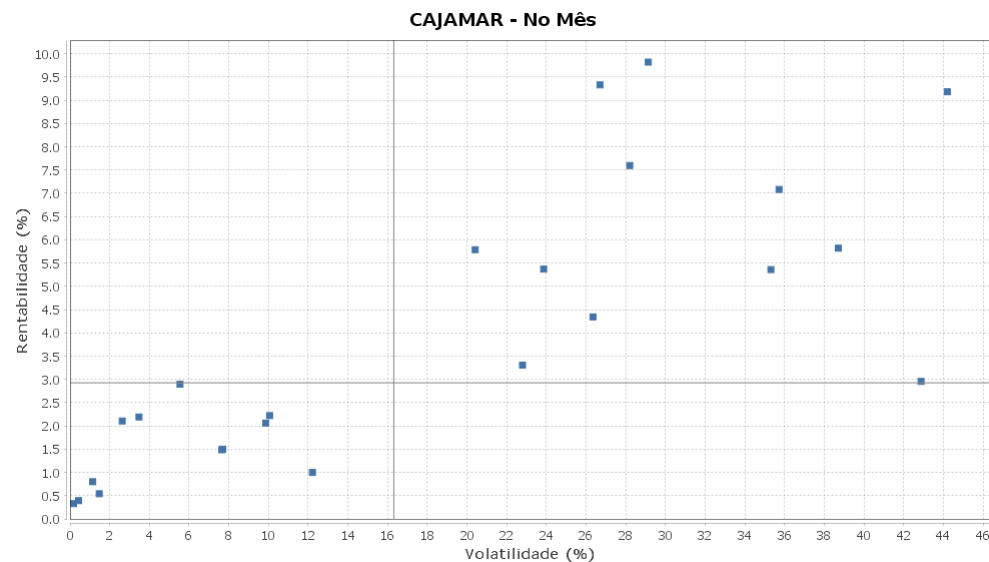
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Rendimentos Realizados

| Artigo | Ativo | Quantidade | Valor Aplicação | Valor Resgate | Rendimento |
|--------|-------|------------|-----------------|---------------|------------|
|--------|-------|------------|-----------------|---------------|------------|

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Risco - Dispersão



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  | 0,18         | 0,03 | 0,33  | 20.090.999,83 | 6,75       |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS                    | Artigo 7º I, Alínea b   | 0,43         | 0,06 | 0,39  | 9.076.872,73  | 3,05       |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS  | Artigo 7º I, Alínea b   | 1,14         | 0,16 | 0,80  | 5.194.320,00  | 1,75       |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI      | Artigo 7º IV, Alínea a  | 1,47         | 0,18 | 0,54  | 18.322.209,94 | 6,16       |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP     | Artigo 7º I, Alínea b   | 2,63         | 0,38 | 2,11  | 23.328.154,97 | 7,84       |
| ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV           | Artigo 7º VII, Alínea b | 3,47         | 0,47 | 2,19  | 2.088.673,80  | 0,70       |
| WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF                   | Artigo 7º I, Alínea b   | 5,54         | 0,72 | 2,90  | 19.767.229,67 | 6,64       |
| FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP  | Artigo 7º III, Alínea a | 7,64         | 0,87 | 1,49  | 40.408.369,68 | 13,58      |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS P | Artigo 7º I, Alínea b   | 7,69         | 0,87 | 1,50  | 51.793.421,45 | 17,40      |
| XP LONG SHORT 60 FC FI MULTIMERCADO                | Artigo 8º III           | 9,86         | 1,12 | 2,06  | 4.001.528,07  | 1,34       |
| WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF                    | Artigo 7º IV, Alínea a  | 10,06        | 1,15 | 2,22  | 16.448.791,13 | 5,53       |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA B 5+ TITULO | Artigo 7º I, Alínea b   | 12,21        | 1,31 | 1,00  | 20.698.158,21 | 6,95       |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA                 | Artigo 8º II, Alínea a  | 20,42        | 2,40 | 5,79  | 5.037.902,53  | 1,69       |
| SAFRA CONS AMERICANO PB FI ACOES                   | Artigo 9º A, III        | 22,80        | 2,53 | 3,31  | 4.282.803,15  | 1,44       |
| WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO         | Artigo 8º III           | 23,86        | 2,73 | 5,37  | 9.030.882,25  | 3,03       |
| WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I                      | Artigo 9º A, III        | 26,35        | 2,94 | 4,34  | 5.872.035,67  | 1,97       |
| AZ QUEST ACOES FIC FIA                             | Artigo 8º II, Alínea a  | 26,70        | 3,21 | 9,33  | 8.334.906,18  | 2,80       |
| VINCI SELECTION EQUITIES FIA                       | Artigo 8º II, Alínea a  | 28,20        | 3,29 | 7,60  | 3.044.756,39  | 1,02       |
| XP INVESTOR FI DE ACOES                            | Artigo 8º II, Alínea a  | 29,14        | 3,49 | 9,82  | 9.643.365,67  | 3,24       |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC                             | Artigo 8º II, Alínea a  | 35,31        | 3,92 | 5,36  | 4.064.901,67  | 1,37       |
| VINCI MOSAICO FIA                                  | Artigo 8º II, Alínea a  | 35,72        | 4,04 | 7,08  | 4.692.245,82  | 1,58       |
| ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA                     | Artigo 8º II, Alínea a  | 38,71        | 4,29 | 5,82  | 4.647.128,11  | 1,56       |
| XP DIVIDENDOS FI DE ACOES                          | Artigo 8º II, Alínea a  | 42,88        | 4,59 | 2,95  | 6.673.672,21  | 2,24       |
| ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI             | Artigo 8º II, Alínea a  | 44,20        | 5,02 | 9,18  | 1.092.106,37  | 0,37       |