



LDB
EMPRESAS

CAJAMAR
ABRIL 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 18.05.2020.

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

RENTA FIXA **76,89%**

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 TP RF LONGO PRAZO	12,33	1,30	-5,25	51.027.687,71	17,76	5.880.207.997,15	0,87
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,52	0,43	1,82	8.771.908,06	3,05	10.765.141.210,50	0,08
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	4,95	0,47	-0,18	22.847.163,11	7,95	9.104.032.681,09	0,25
CEF	CEF	FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP	18,85	1,95	-8,95	20.493.212,60	7,13	1.937.305.372,80	1,06
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RENDA FIXA	8,86	0,90	0,44	19.210.631,24	6,69	572.988.052,24	3,35
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS	1,19	-0,03	-0,95	5.153.156,00	1,79	253.351.612,75	2,03
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			10,07	1,08	-3,56	127.503.758,72	44,39		

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 NOVO BRASIL IMAB RF LP	12,25	1,25	-5,21	39.816.693,04	13,86	2.806.802.535,15	1,42
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			12,25	1,25	-5,21	39.816.693,04	13,86		

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	0,00	0,79	17.190.616,21	5,98	4.876.604.207,95	0,35
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	16,04	1,69	-4,48	16.091.527,34	5,60	536.049.443,15	3,00
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,98	0,14	1,28	18.223.715,91	6,34	5.079.848.328,78	0,36
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			5,90	0,62	-0,97	51.505.859,46	17,93		

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	5,85	0,62	-2,34	2.043.882,75	0,71	537.999.931,36	0,38

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
		Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b	5,85	0,62	-2,34	2.043.882,75	0,71		
		Renda Fixa	9,54	1,01	-3,33	220.870.193,97	76,89		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

19,71%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST ACOES FIC FIA	43,86	11,36	-31,54	7.623.582,74	2,65	699.654.427,07	1,09
XP	XP	XP INVESTOR FI DE ACOES	47,73	14,71	-31,12	8.781.099,08	3,06	311.923.889,29	2,82
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	36,92	6,08	-29,98	4.391.561,07	1,53	1.392.329.916,92	0,32
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	44,95	11,39	-30,61	4.762.219,99	1,66	1.013.500.715,68	0,47
XP	XP	XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	36,76	4,84	-30,76	6.482.143,77	2,26	255.702.458,86	2,54
VINCI	BEM	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	36,97	10,98	-21,86	2.829.812,83	0,99	354.320.822,33	0,80
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	41,69	11,03	-32,47	3.858.137,02	1,34	2.886.370.474,18	0,13
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	49,14	9,17	-41,59	1.000.264,74	0,35	1.465.473.198,75	0,07
VINCI	BEM	VINCI MOSAICO FUNDO DE INVESTIMENTO DE ACOES	40,16	10,08	-27,68	4.381.877,82	1,53	1.293.542.664,90	0,34
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			41,50	10,22	-30,52	44.110.699,06	15,36		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	31,44	11,77	-11,92	8.570.507,05	2,98	773.176.553,31	1,11
XP	BNY MELLON	XP LONG SHORT 60 FC FI MULTIMERCADO	6,23	1,59	-0,93	3.920.744,55	1,36	159.936.125,97	2,45
Sub-total Artigo 8º III			21,82	8,37	-8,76	12.491.251,60	4,35		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			36,71	9,81	-26,63	56.601.950,66	19,71		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,40%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONS AMERICANO PB FI ACOES	29,08	16,94	18,54	4.145.783,13	1,44	949.289.216,91	0,44
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES BDR N	25,76	19,81	29,16	5.627.718,33	1,96	583.127.592,58	0,97
Sub-total Artigo 9º A, III			26,64	18,57	24,43	9.773.501,46	3,40		
Investimentos no Exterior			26,64	18,57	24,43	9.773.501,46	3,40		
Total						287.245.646,09	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	127.503.758,72	44,39	0,00	45,00	100,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	39.816.693,04	13,86	0,00	14,00	60,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	51.505.859,46	17,93	0,00	14,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	2.043.882,75	0,71	0,00	1,00	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	220.870.193,97	76,89				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	44.110.699,06	15,36	0,00	19,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	12.491.251,60	4,35	0,00	5,00	10,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	56.601.950,66	19,71				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	9.773.501,46	3,40	0,00	2,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	9.773.501,46	3,40				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

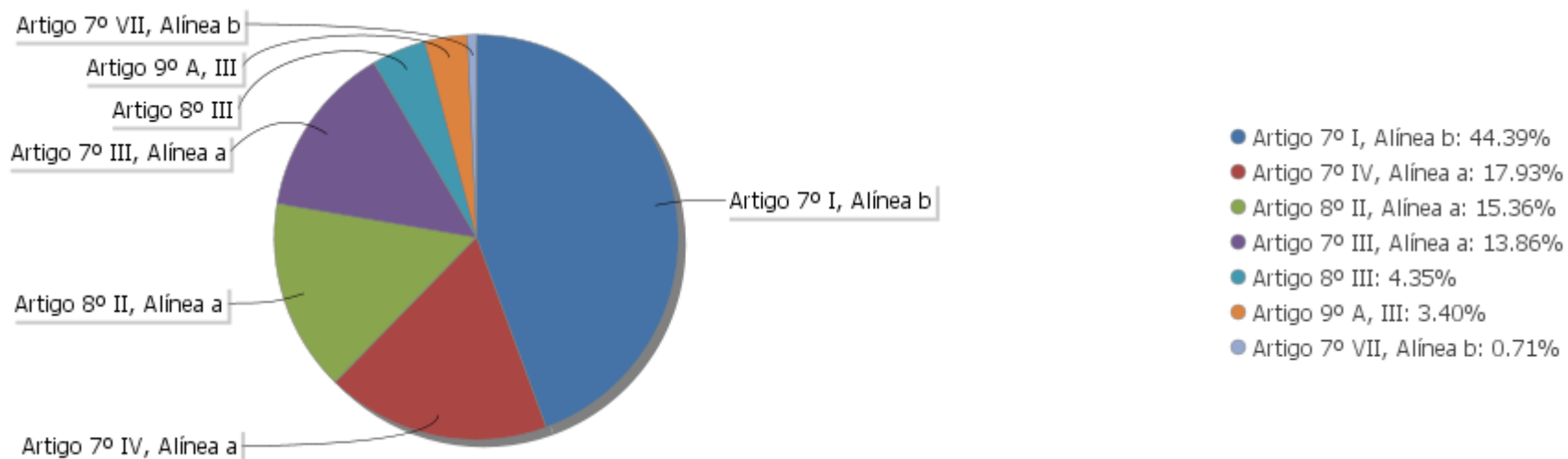
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,08 378,54	-3,56 -273,93	-3,89 -423,03	-3,80 -183,70	8,63 166,27	1.360.526,07	-4.696.969,54
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,25 437,96	-5,21 -400,98	-5,43 -590,26	-5,77 -279,27	8,45 162,65	490.730,94	-2.189.502,43
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,62 219,05	-0,97 -74,29	-1,40 -151,96	-1,09 -52,77	6,57 126,51	294.318,35	-468.584,52
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,62 219,24	-2,34 -179,75	-3,25 -353,86	-2,04 -98,82		12.688,54	-48.899,20
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	10,22 -0,03	-30,52 -0,13	-32,23 -2,99	-22,74 2,18	-8,87 7,58	4.090.090,77	-19.375.883,35
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	8,37 -1,89	-8,76 21,63	-9,36 19,87	-4,78 20,13	-1,45 15,00	964.278,40	-1.219.786,70
Artigo 9º A, III % do CDI	18,57 6.519,09	24,43 1.879,44	16,07 1.747,49	32,17 1.556,84	39,01 751,29	1.531.009,91	1.918.945,33
						8.743.642,98	-26.080.680,41

Análise de Liquidez

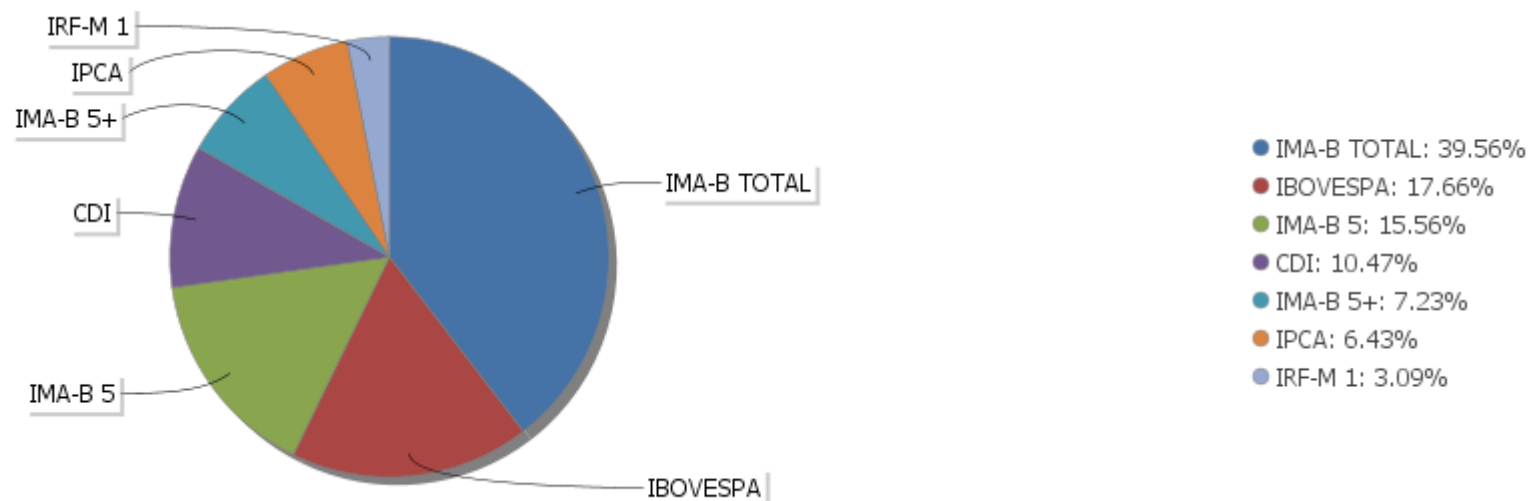
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	267.101.917,87	92,99	267.101.917,87	92,99
de 31 a 364 dias	20.143.728,22	7,01	287.245.646,09	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	287.245.646,09	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

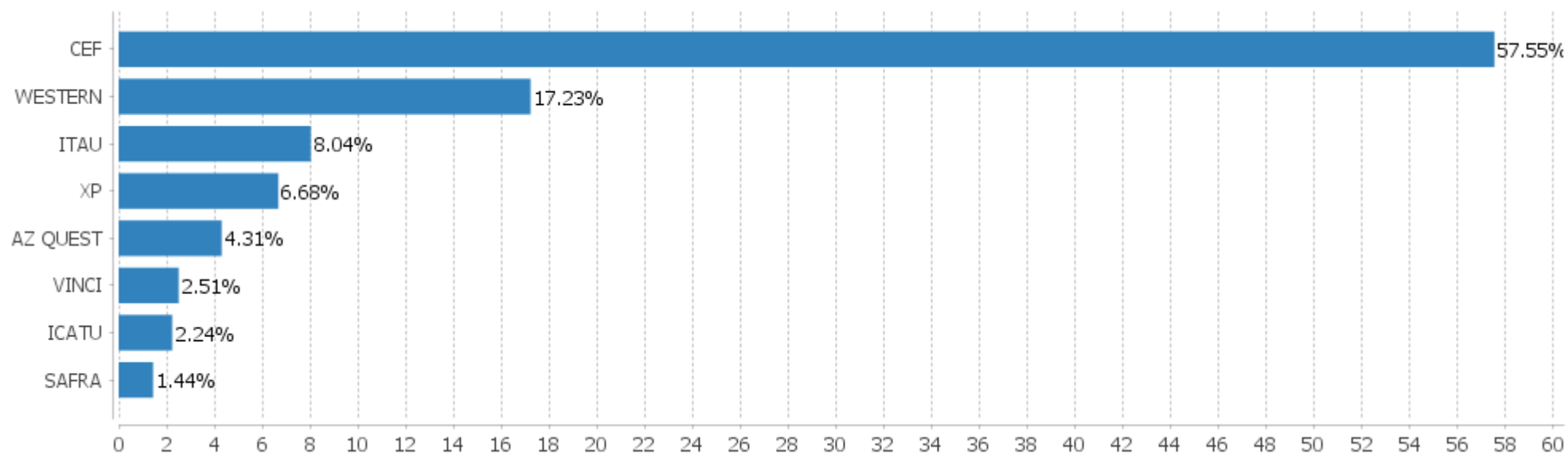


Alocação Por Estratégia



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									-8,50
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14									2,10
p.p. indexador	0,29	-2,12	-11,47	3,04									-10,60
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

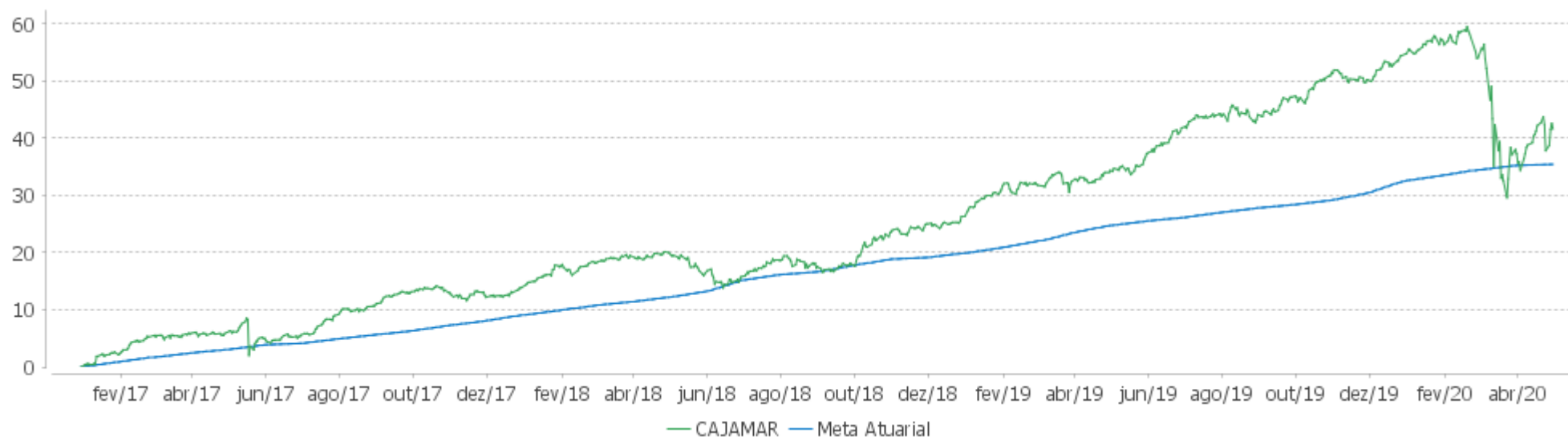
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

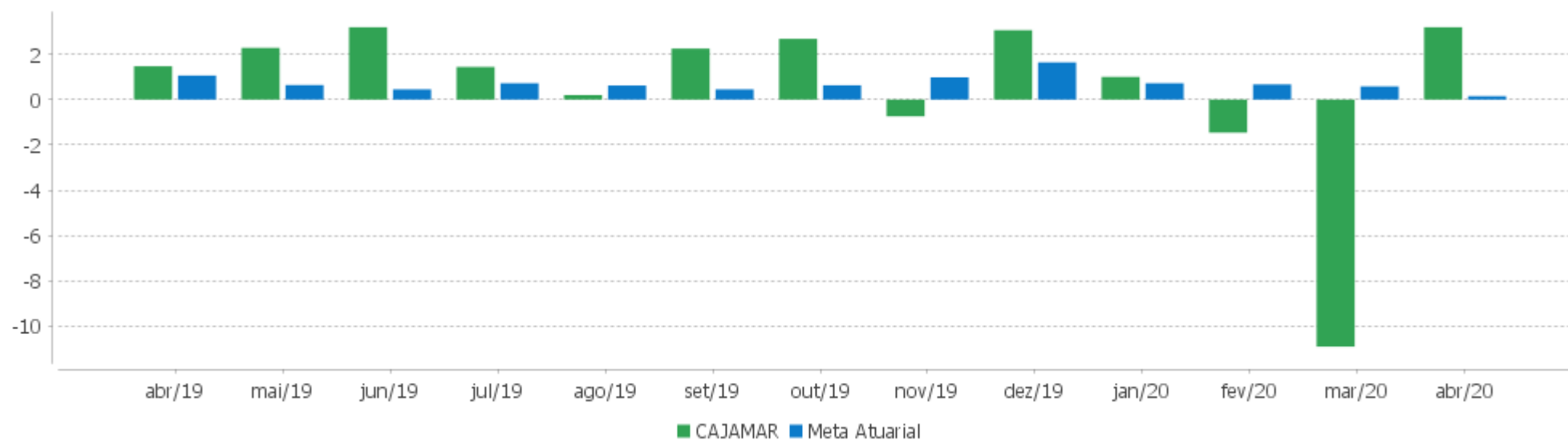
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	23	57,50	03 meses	-9,41	1,38	-10,79	28,10
Meses abaixo da Meta Atuarial	17	42,50	06 meses	-6,41	4,79	-11,19	19,91
			12 meses	5,41	8,52	-3,11	14,36
			24 meses	18,01	20,66	-2,66	10,97
			36 meses	33,74	31,38	2,36	9,90
Maior rentabilidade da Carteira	4,81	2018-10	Desde 30/12/2016	41,57	35,34	6,23	9,50
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 Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,30 -0,01	-5,25 -0,17	-5,48 -0,15	-5,82 -0,27	8,47 -0,47	25,17 -0,75	38,56 -1,12
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RENDA FIXA Var. IMA-B 5 p.p.	0,90 0,41	0,44 0,53	-0,46 0,18	0,82 -0,04	11,43 2,76	23,76 4,30	40,15 6,77
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B 5 p.p.	0,47 -0,02	-0,18 -0,09	-0,72 -0,08	0,68 -0,18	8,37 -0,30	18,91 -0,56	32,52 -0,86
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03 -1,34	-0,95 4,13	-0,91 4,41	0,69 6,24	4,32 -4,61	12,53 -13,39	22,90 -16,78
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,43 -0,01	1,82 -0,07	1,39 -0,04	2,55 -0,10	6,39 -0,21	13,32 -0,40	23,25 -0,64
FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	1,95 -0,07	-8,95 -0,13	-8,91 -0,06	-10,50 -0,25	7,94 -0,53	29,14 -1,18	42,37 -1,57
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV Var. IMA-B 5 p.p.	0,62 0,14	-2,34 -2,25	-3,25 -2,61	-2,04 -2,90	5,19 -3,48	16,17 -3,29	31,03 -2,36
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,69 0,38	-4,48 0,60	-5,00 0,32	-5,47 0,08	11,61 2,68	30,30 4,39	45,92 6,24
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,00 1,22	0,79 60,96	0,42 45,66	1,46 70,60	4,46 85,97	10,92 92,02	19,81 94,64
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,14 0,45	1,28 1,06	0,93 0,92	1,98 0,09	9,19 6,79	18,37 10,91	30,21 19,78
FIC NOVO BRASIL IMAB RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,25 -0,07	-5,21 -0,13	-5,43 -0,10	-5,77 -0,22	8,45 -0,49	25,19 -0,73	38,73 -0,95
XP LONG SHORT 60 FC FI MULTIMERCADO % do CDI	1,59 559,32	-0,93 -71,31	-2,35 -256,02	-1,11 -53,67	0,08 1,45	3,89 32,82	16,96 81,03
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	11,77 4.132,19	-11,92 -916,99	-12,24 -1.330,94	-6,15 -297,51	-1,79 -34,38	14,06 118,49	34,29 163,86
AZ QUEST ACOES FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	11,36 1,11	-31,54 -1,16	-34,06 -4,83	-26,84 -1,93	-16,84 -0,39	-7,32 -0,80	29,80 6,71
XP INVESTOR FI DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	14,71 4,46	-31,12 -0,73	-33,24 -4,01	-21,42 3,49	-4,80 11,65	5,90 12,41	50,92 27,83
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	9,17 -1,08	-41,59 -11,20	-42,43 -13,20	-33,70 -8,78	-23,73 -7,28	-10,30 -3,79	19,90 -3,20
VINCI MOSAICO FUNDO DE INVESTIMENTO DE ACOES	10,08	-27,68	-28,92	-16,75	-1,73	11,71	51,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-0,17	2,70	0,31	8,17	14,72	18,23	28,59
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	10,98	-21,86	-22,16	-14,67	-3,27	13,38	45,43
Var. IBOVESPA p.p.	0,73	8,53	7,07	10,24	13,18	19,89	22,34
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	11,39	-30,61	-34,95	-19,91	-0,36	13,81	59,50
Var. IBOVESPA p.p.	1,13	-0,23	-5,72	5,00	16,09	20,32	36,41
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	11,03	-32,47	-32,34	-25,59	-9,53	3,07	
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	6,08	-29,98	-30,41	-24,37	-11,75	9,04	36,68
Var. IBOVESPA p.p.	-4,18	0,41	-1,18	0,54	4,69	15,56	13,59
XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	4,84	-30,76	-31,75	-23,47	-7,31	14,24	43,46
Var. IBOVESPA p.p.	-5,41	-0,37	-2,51	1,45	9,13	20,75	20,37
SAFRA CONS AMERICANO PB FI ACOES	16,94	18,54	10,82	24,77	33,82	80,10	
Var. IBOVESPA p.p.	6,69	48,93	40,06	49,68	50,27	86,61	
WESTERN ASSET FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES BDR N	19,81	29,16	20,27	38,14	45,12	85,39	124,48
Var. IBOVESPA p.p.	9,56	59,54	49,50	63,06	61,57	91,90	101,39
CDI	0,28	1,30	0,92	2,07	5,19	11,87	20,93
IBOVESPA	10,25	-30,39	-29,23	-24,92	-16,45	-6,51	23,09
INPC + 6%	0,23	2,23	1,52	5,03	8,63	20,94	30,30
IPCA + 6%	0,15	2,14	1,41	4,83	8,57	20,71	31,43

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Renda Fixa							
IRF-M 1	0,45	1,88	1,44	2,65	6,60	13,72	23,89
IRF-M 1+	1,50	2,96	1,83	2,84	13,92	25,80	43,65
IRF-M TOTAL	1,15	2,59	1,70	2,75	11,69	22,07	37,69
IMA-B 5	0,49	-0,09	-0,64	0,86	8,67	19,47	33,38
IMA-B 5+	2,01	-8,82	-8,85	-10,25	8,47	30,32	43,94
IMA-B TOTAL	1,31	-5,08	-5,33	-5,55	8,94	25,91	39,68
IMA-C TOTAL	1,39	0,93	-1,57	0,17	12,99	32,94	49,94
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,84	-0,17	-0,67	0,03	8,34	19,04	31,87
IMA-GERAL TOTAL	0,86	-0,14	-0,69	0,03	8,47	19,43	32,35
IDKA 2	0,57	0,57	0,03	1,79	8,62	18,84	33,46
IDKA 20	1,77	-16,22	-15,05	-18,15	5,61	37,31	48,42
CDI	0,28	1,30	0,92	2,07	5,19	11,87	20,93
Renda Variável							
IBOVESPA	10,25	-30,39	-29,23	-24,92	-16,45	-6,51	23,09
IBRX 100	10,27	-30,14	-29,25	-24,33	-15,12	-4,14	25,76
IBRX 50	10,48	-31,05	-29,73	-25,91	-18,39	-9,72	19,28
SMALL CAP	10,19	-34,07	-34,37	-21,91	-4,59	5,90	40,30
IFIX	4,39	-18,58	-15,39	-6,75	3,79	11,40	27,89
Índice Consumo - ICON	17,67	-24,81	-27,47	-16,35	1,02	9,88	26,19
Índice Dividendos - IDIV	3,76	-28,65	-27,50	-19,68	-7,18	10,38	30,76
Indicadores Econômicos							
IPCA	-0,31	0,22	0,01	1,89	2,40	7,46	10,43
INPC	-0,23	0,31	0,12	2,08	2,46	7,66	9,48
IGPM	0,80	2,50	2,01	4,95	6,69	15,93	18,12
SELIC	0,28	1,30	0,92	2,07	5,19	11,87	20,94
Meta Atuarial							
IPCA + 4%	0,00	1,51	0,95	3,86	6,51	16,21	24,16

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IPCA + 5%	0,08	1,82	1,18	4,34	7,54	18,45	27,76
IPCA + 5,5%	0,11	1,98	1,29	4,59	8,05	19,58	29,59
IPCA + 5,89%	0,14	2,10	1,38	4,78	8,45	20,46	31,02
IPCA + 6%	0,15	2,14	1,41	4,83	8,57	20,71	31,43
INPC + 4%	0,08	1,60	1,06	4,05	6,57	16,43	23,09
INPC + 6%	0,23	2,23	1,52	5,03	8,63	20,94	30,30

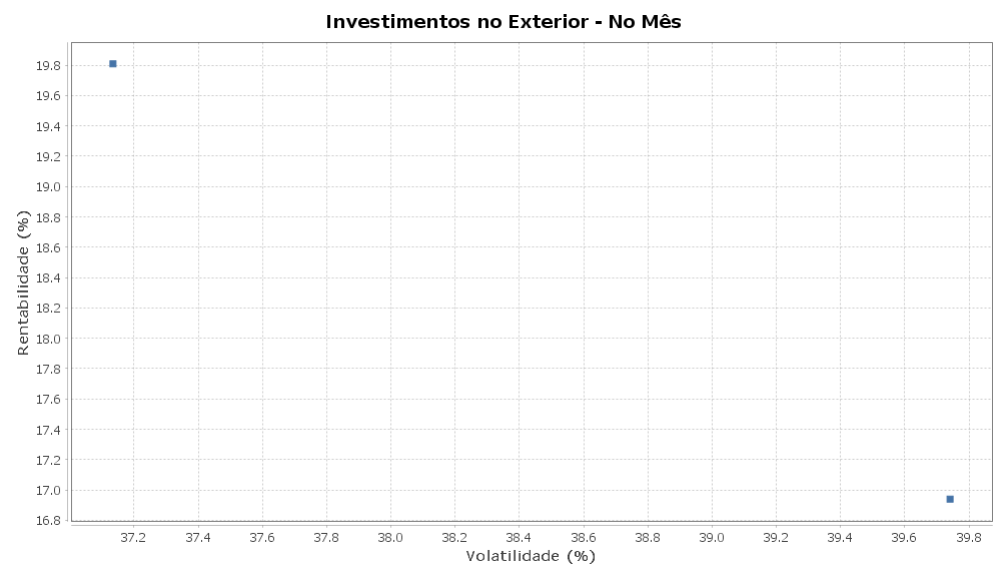
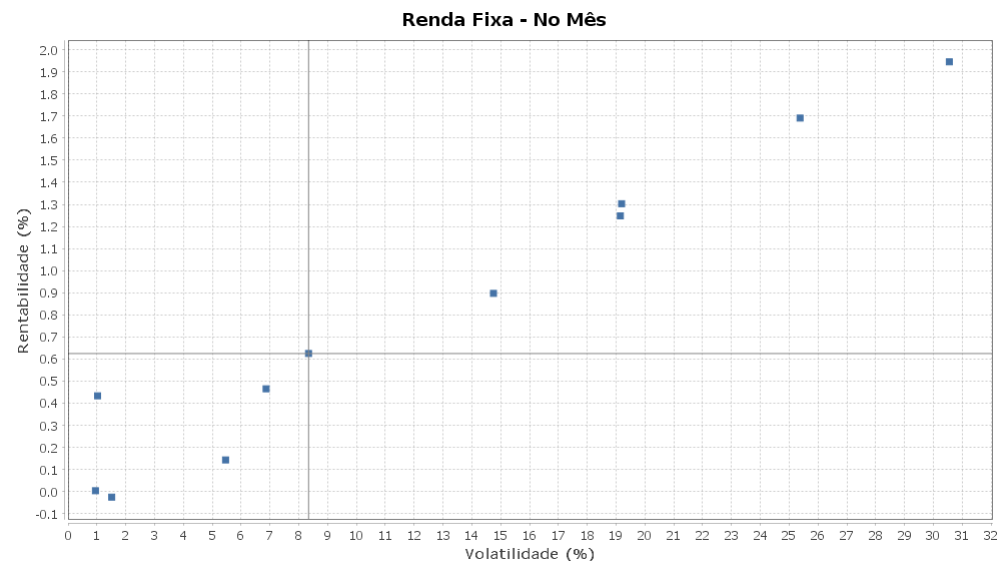
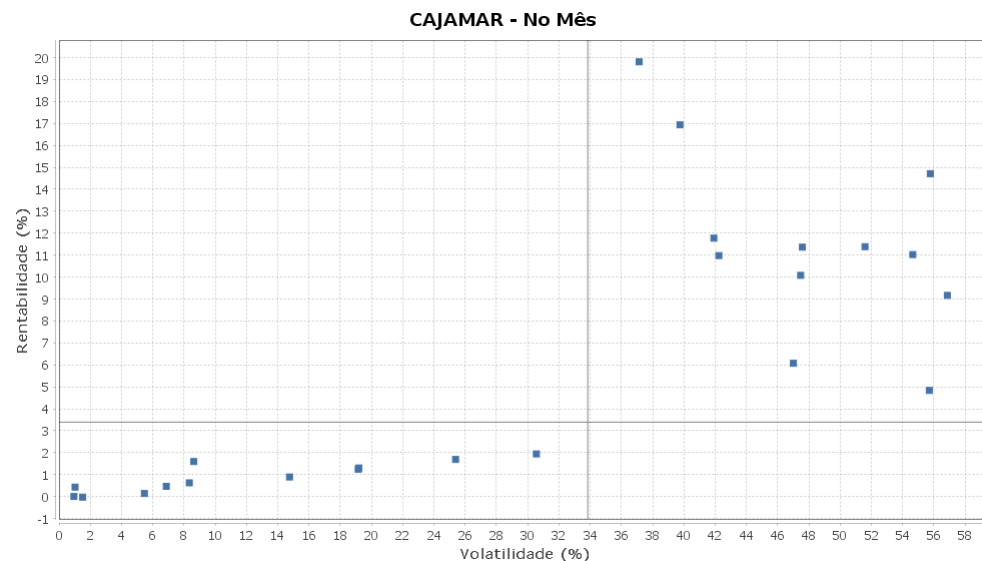
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
08/04/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	50.000,00	13.625,97197465	3,6694630000
16/04/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	62.000,00	16.876,43347609	3,6737620000
28/04/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	86.000,00	0,00	23.373,31256913	3,6794100000
28/04/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.640.000,00	445.723,63503931	3,6794100000
29/04/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.691.300,57	0,00	1.274.981,43636168	3,6795050000
29/04/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	7.204,42	0,00	1.957,98619651	3,6795050000

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	0,95	0,10	0,00	17.190.616,21	5,98
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,02	0,13	0,43	8.771.908,06	3,05
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS	Artigo 7º I, Alínea b	1,52	0,16	-0,03	5.153.156,00	1,79
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	5,46	0,57	0,14	18.223.715,91	6,34
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	6,87	0,73	0,47	22.847.163,11	7,95
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	Artigo 7º VII, Alínea b	8,34	0,90	0,62	2.043.882,75	0,71
XP LONG SHORT 60 FC FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	8,63	0,97	1,59	3.920.744,55	1,36
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	14,75	1,57	0,90	19.210.631,24	6,69
FIC NOVO BRASIL IMAB RF LP	Artigo 7º III, Alínea a	19,15	2,05	1,25	39.816.693,04	13,86
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	19,19	2,05	1,30	51.027.687,71	17,76
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	Artigo 7º IV, Alínea a	25,38	2,71	1,69	16.091.527,34	5,60
FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	30,55	3,26	1,95	20.493.212,60	7,13
WESTERN ASSET FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES BDR N	Artigo 9º A, III	37,13	4,75	19,81	5.627.718,33	1,96
SAFRA CONS AMERICANO PB FI ACOES	Artigo 9º A, III	39,74	4,90	16,94	4.145.783,13	1,44
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	41,91	4,90	11,77	8.570.507,05	2,98
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	Artigo 8º II, Alínea a	42,24	4,90	10,98	2.829.812,83	0,99
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	47,00	5,17	6,08	4.391.561,07	1,53
VINCI MOSAICO FUNDO DE INVESTIMENTO DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	47,47	5,40	10,08	4.381.877,82	1,53
AZ QUEST ACOES FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	47,59	5,47	11,36	7.623.582,74	2,65
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	51,59	5,88	11,39	4.762.219,99	1,66
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	54,64	6,18	11,03	3.858.137,02	1,34
XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	55,71	6,01	4,84	6.482.143,77	2,26
XP INVESTOR FI DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	55,77	6,46	14,71	8.781.099,08	3,06
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	56,86	6,33	9,17	1.000.264,74	0,35