



CAJAMAR
FEVEREIRO 2021



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 26.02.2021.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENTA 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	12,90	-1,54	-2,40	55.746.326,35	15,84	6.061.546.612,54	0,92
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,56	0,02	0,04	21.443.211,03	6,09	9.935.744.303,82	0,22
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,09	-0,62	-0,54	38.864.228,29	11,04	13.590.487.322,92	0,29
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,97	-2,35	-4,01	22.735.678,49	6,46	1.625.335.228,61	1,40
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	9,37	-1,51	-2,16	25.443.645,66	7,23	1.154.939.152,90	2,20
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			10,52	-1,23	-1,89	164.233.089,82	46,66		

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	12,82	-1,55	-2,42	58.229.102,79	16,54	2.938.131.383,90	1,98
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			12,82	-1,55	-2,42	58.229.102,79	16,54		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,37	0,08	0,24	6.251.321,05	1,78	5.566.337.148,97	0,11
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	16,98	-2,46	-4,15	17.533.832,80	4,98	505.633.773,09	3,47
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,67	0,06	0,19	16.541.977,70	4,70	3.571.923.057,61	0,46
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			6,18	-1,05	-1,61	40.327.131,55	11,46		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	6,16	-0,53	-0,18	2.247.689,74	0,64	870.229.950,57	0,26
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			6,16	-0,53	-0,18	2.247.689,74	0,64		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

9,97

-1,27

-1,94

265.037.013,90

75,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

20,40%

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	45,41	-2,40	-4,98	10.173.080,53	2,89	733.433.088,41	1,39
XP	XP	XP INVESTOR FI DE ACOES	49,45	-0,93	-5,37	11.522.098,31	3,27	354.535.570,23	3,25
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	40,15	-3,81	-7,57	5.249.256,86	1,49	1.494.264.626,94	0,35
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	46,15	0,81	-1,12	6.571.814,82	1,87	1.438.962.044,80	0,46
XP	XP	XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	41,31	-4,00	-11,99	6.969.580,42	1,98	180.020.806,74	3,87
VINCI	BEM	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	38,93	-3,90	-7,10	3.675.923,02	1,04	552.083.388,65	0,67
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	43,99	0,47	-1,00	5.380.348,94	1,53	3.416.632.575,89	0,16
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	52,67	-4,30	-7,08	1.253.406,69	0,36	1.154.784.976,21	0,11
VINCI	BEM	VINCI MOSAICO FIA	42,59	-3,17	-6,08	5.888.608,19	1,67	1.563.110.185,19	0,38
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			43,50	-2,03	-5,74	56.684.117,78	16,10		

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	32,74	2,67	2,50	11.188.181,23	3,18	1.303.746.939,74	0,86
XP	BNY MELLON	XP LONG SHORT 60 FC FI MULTIMERCADO	7,69	2,41	0,41	3.954.192,93	1,12	100.861.886,64	3,92
Sub-total Artigo 8º III			22,83	2,60	1,95	15.142.374,16	4,30		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			38,29	-1,09	-4,22	71.826.491,94	20,40		
--	--	--	--------------	--------------	--------------	----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,30%

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 CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	32,94	4,47	8,39	5.475.382,01	1,56	2.288.705.798,61	0,24
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	29,68	2,03	4,99	9.666.042,25	2,75	2.755.511.369,98	0,35
Sub-total Artigo 9º A, III			30,32	2,90	6,24	15.141.424,26	4,30		
Investimentos no Exterior			30,32	2,90	6,24	15.141.424,26	4,30		
Total			14,85	-1,06	-2,11	352.004.930,10	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	164.233.089,82	46,66	0,00	40,00	80,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	58.229.102,79	16,54	0,00	17,00	60,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	40.327.131,55	11,46	0,00	14,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	2.247.689,74	0,64	0,00	1,00	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	265.037.013,90	75,29				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	56.684.117,78	16,10	0,00	18,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	15.142.374,16	4,30	0,00	4,00	10,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	71.826.491,94	20,40				30,00
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	15.141.424,26	4,30	0,00	5,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	15.141.424,26	4,30				10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

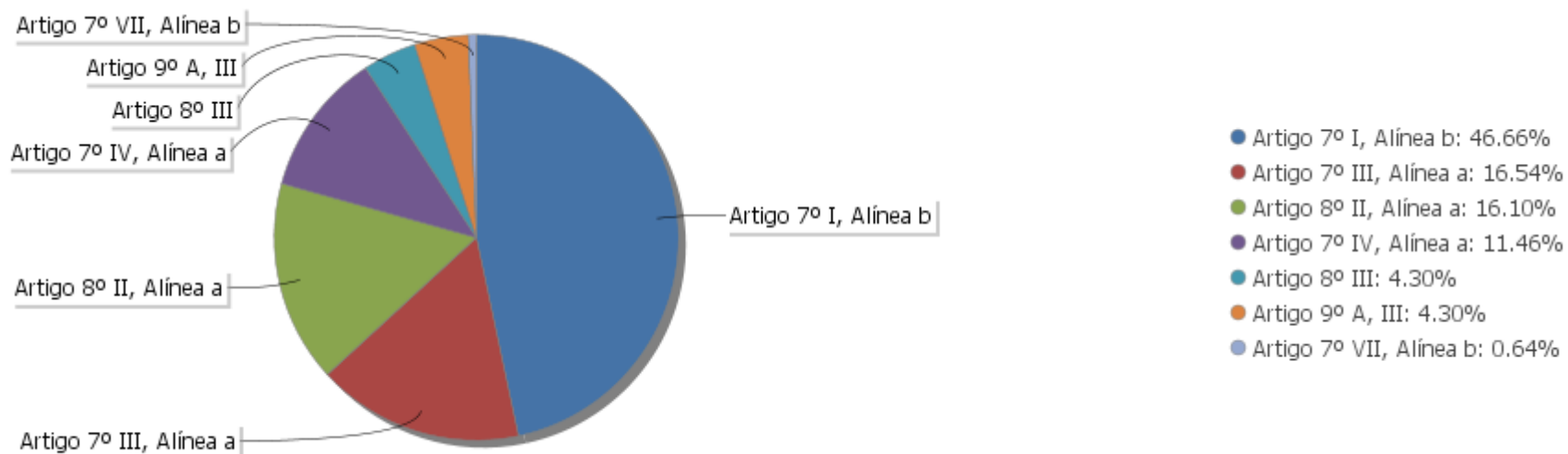
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-1,23 -917,26	-1,89 -663,75	1,93 430,32	2,50 272,98	3,38 142,87	-2.047.808,32	-3.040.062,23
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-1,55 -1.152,99	-2,42 -851,22	2,32 515,86	2,90 317,34	2,80 118,52	-917.438,80	-1.443.707,04
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-1,05 -781,16	-1,61 -565,18	0,84 187,50	0,85 92,81	1,84 77,86	-428.250,48	-707.166,57
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	-0,53 -391,29	-0,18 -64,24	2,18 486,21	3,49 380,80	5,78 244,53	-11.894,71	-4.111,27
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-2,03 2,34	-5,74 1,81	1,42 0,37	4,32 -6,41	-6,36 -11,99	-1.176.621,76	-3.452.399,57
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	2,60 6,97	1,95 9,49	4,48 3,44	5,64 -5,09	15,96 10,33	383.814,21	289.272,92
Artigo 9º A, III % do CDI	2,90 2.156,52	6,24 2.194,15	6,25 1.391,04	5,10 556,70	60,50 2.560,70	426.897,82	855.816,92
CAJAMAR (Total)						-3.771.302,04	-7.502.356,84

Análise de Liquidez

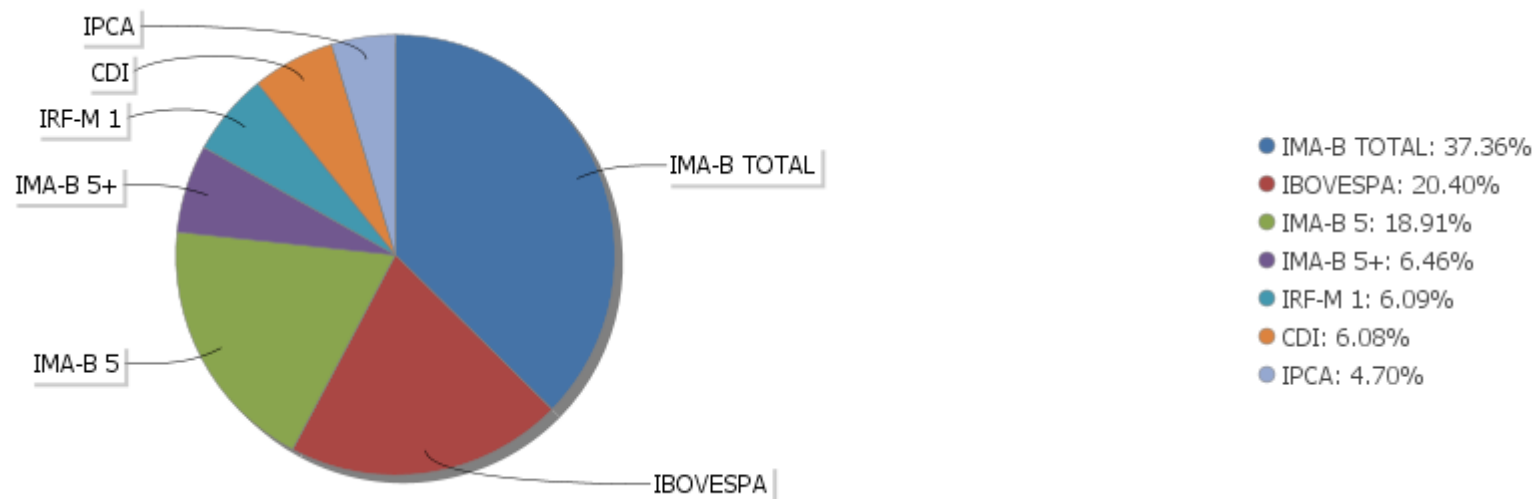
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	333.105.857,02	94,63	333.105.857,02	94,63
de 31 a 365 dias	18.899.073,08	5,37	352.004.930,10	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	352.004.930,10	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

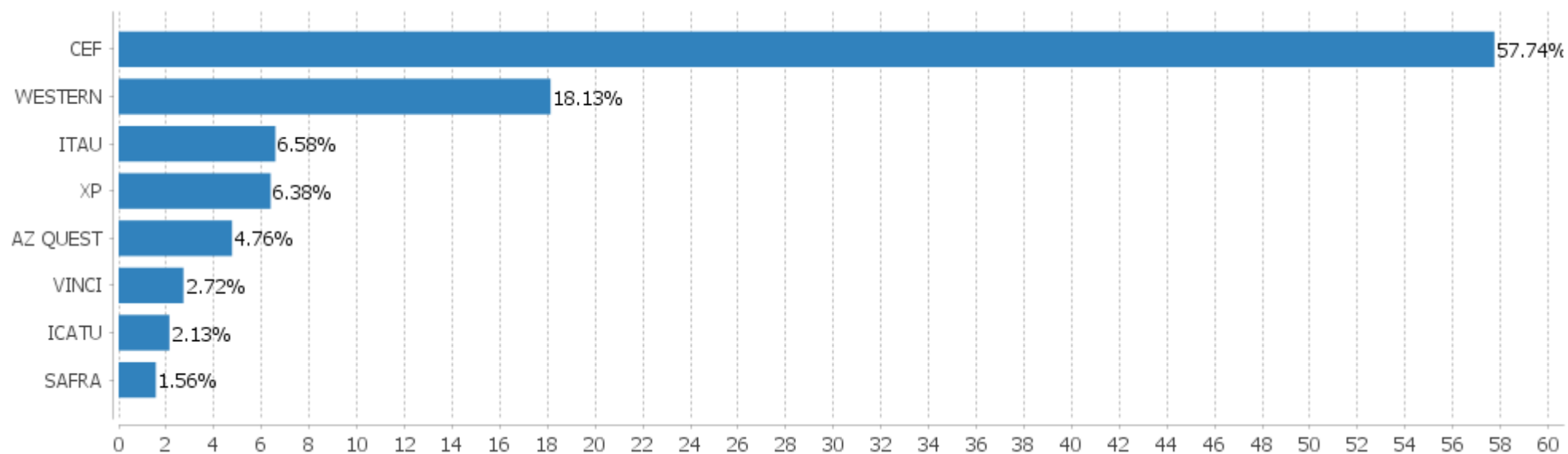


Alocação Por Estratégia



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
2021	-1,06	-1,06											-2,11
IPCA + 5,43%	0,67	0,85											1,53
p.p. indexador	-1,73	-1,91											-3,64
2020	1,00	-1,46	-10,90	3,19	2,53	2,70	4,05	-0,62	-2,07	-0,39	3,34	4,26	4,70
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,63
p.p. indexador	0,29	-2,12	-11,47	3,04	2,46	1,96	3,17	-1,34	-3,19	-1,73	1,99	2,41	-5,92
2019	4,19	0,21	0,36	1,47	2,28	3,19	1,44	0,20	2,25	2,68	-0,74	3,06	22,49
IPCA + 6,00%	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 + 6,00%	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 + 6,00%	0,89	0,75	0,78	0,56	0,82	0,26	0,73	0,72	0,62	0,91	0,74	0,91	9,05
p.p. indexador	1,38	2,13	-0,16	-0,58	-1,61	0,26	2,69	0,94	1,30	-1,07	-1,42	0,57	4,78

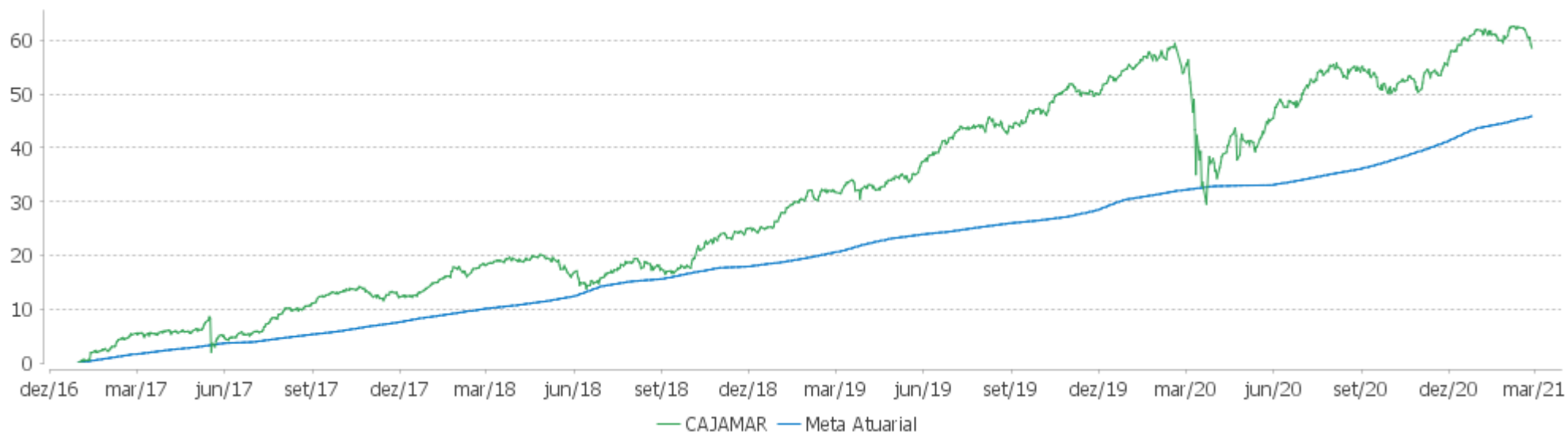
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

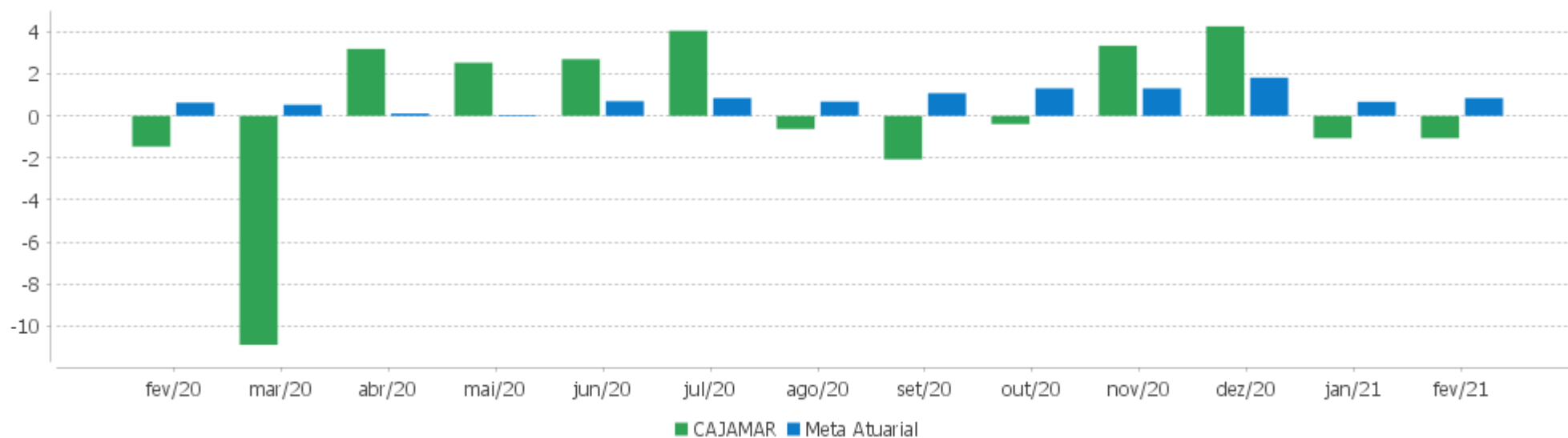
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	28	56,00	03 meses	2,06	3,41	-1,35	5,44
Meses abaixo da Meta Atuarial	22	44,00	06 meses	2,88	7,40	-4,52	6,39
			12 meses	2,98	10,79	-7,81	14,85
			24 meses	20,24	22,09	-1,85	11,23
			36 meses	34,20	34,45	-0,25	9,66
			Desde 30/12/2016	58,58	48,89	9,69	9,01
	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 Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV Var. IMA-B 5 p.p.	-0,53 0,07	-0,18 0,31	2,18 0,85	3,49 0,74	5,78 -0,45	17,85 -1,31	30,56 -0,62
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	-1,51 -0,91	-2,16 -1,67	1,01 -0,32	1,35 -1,40	5,76 -0,47	21,87 2,72	36,22 5,04
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,54 -0,02	-2,40 -0,04	2,32 -0,06	2,96 -0,11	2,81 -0,35	20,93 -0,80	37,77 -1,14
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	-0,62 -0,02	-0,54 -0,05	1,27 -0,06	2,60 -0,15	5,92 -0,31	18,50 -0,66	30,23 -0,95
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,02 -0,02	0,04 -0,04	0,33 -0,06	0,82 -0,11	2,87 -0,21	9,36 -0,44	16,69 -0,66
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-2,35 -0,02	-4,01 -0,03	3,25 0,02	3,33 -0,05	0,76 -0,18	22,39 -0,81	42,85 -1,57
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,55 -0,03	-2,42 -0,06	2,32 -0,07	2,90 -0,17	2,80 -0,36	20,82 -0,91	37,74 -1,18
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,46 -0,95	-4,15 -1,79	2,06 -0,33	1,71 -1,36	2,68 -0,49	24,20 2,46	43,72 4,80
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,08 57,89	0,24 84,32	0,60 134,31	0,88 95,86	2,00 84,75	7,44 92,19	14,14 94,27
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,06 -0,41	0,19 -0,53	0,40 -1,68	0,35 -4,19	2,45 -2,34	12,28 3,30	22,09 8,86
AZ QUEST ACOES FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,40 1,97	-4,98 2,57	2,31 1,27	4,10 -6,63	-4,06 -9,69	12,03 -3,09	27,68 -1,24
XP INVESTOR FI DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-0,93 3,44	-5,37 2,18	1,22 0,17	0,21 -10,52	-6,93 -12,56	25,53 10,41	47,87 18,96
VINCI MOSAICO FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,17 1,20	-6,08 1,46	2,56 1,51	10,60 -0,13	0,99 -4,64	31,29 16,17	54,79 25,88
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	-4,30 0,07	-7,08 0,47	0,32 -0,72	0,73 -10,01	-20,50 -26,13	-4,05 -19,17	17,50 -11,42
VINCI SELECTION EQUITIES FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,90 0,48	-7,10 0,45	0,22 -0,83	4,91 -5,83	7,52 1,89	25,70 10,58	48,32 19,41
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,81 5,18	-1,12 6,43	5,73 4,68	8,73 -2,00	-4,31 -9,94	38,63 23,51	63,50 34,58
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	0,47	-1,00	5,23	12,85	4,60	25,63	48,93

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.	4,85	6,55	4,19	2,12	-1,03	10,51	20,01
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,81 0,57	-7,57 -0,03	-0,21 -1,26	5,04 -5,69	-10,56 -16,19	8,40 -6,71	34,12 5,20
XP DIVIDENDOS FI DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-4,00 0,38	-11,99 -4,45	-4,76 -5,81	-3,01 -13,74	-21,19 -26,81	2,63 -12,48	27,51 -1,41
XP LONG SHORT 60 FC FI MULTIMERCADO % do CDI	2,41 1.793,80	0,41 143,02	1,00 223,37	-2,31 -252,83	-1,75 -74,24	0,91 11,34	9,48 63,22
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	2,67 1.982,45	2,50 880,85	5,77 1.285,28	8,77 958,18	23,85 1.009,69	36,61 453,78	45,63 304,31
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	4,47 8,84	8,39 15,93	8,76 7,71	7,04 -3,69	54,45 48,82	100,15 85,03	
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	2,03 6,41	4,99 12,53	4,75 3,70	3,98 -6,75	65,57 59,94	121,93 106,81	163,41 134,50
CAJAMAR Var. IPCA + 5,43% p.p.	-1,06 -1,91	-2,11 -3,64	2,06 -1,32	2,88 -4,37	2,98 -7,43	20,24 -0,80	34,20 1,62
CDI	0,13	0,28	0,45	0,92	2,36	8,07	14,99
IBOVESPA	-4,37	-7,55	1,05	10,73	5,63	15,12	28,92
INPC + 6,00%	0,95	1,69	3,70	8,08	12,19	23,55	36,13
IPCA + 6,00%	0,89	1,61	3,51	7,53	11,00	22,34	34,73

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	0,04	0,08	0,39	0,94	3,08	9,80	17,36
IRF-M 1+	-2,01	-3,37	-0,43	-1,48	2,82	17,44	30,64
IRF-M TOTAL	-1,18	-1,97	-0,06	-0,58	3,01	15,23	26,69
IMA-B 5	-0,60	-0,49	1,33	2,75	6,23	19,15	31,19
IMA-B 5+	-2,33	-3,98	3,24	3,38	0,95	23,20	44,42
IMA-B TOTAL	-1,52	-2,36	2,38	3,07	3,16	21,74	38,91
IMA-C TOTAL	3,72	10,42	9,19	17,82	30,63	54,91	81,60
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,83	-1,26	0,83	0,82	2,55	13,91	25,00
IMA-GERAL TOTAL	-0,69	-0,93	1,07	1,29	3,31	14,97	26,40
IDKA 2	-0,48	-0,33	1,40	2,72	6,95	18,92	31,03
IDKA 20	-2,69	-5,42	5,32	4,90	-1,91	24,76	54,08
CDI	0,13	0,28	0,45	0,92	2,36	8,07	14,99
Renda Variável							
IBOVESPA	-4,37	-7,55	1,05	10,73	5,63	15,12	28,92
IBRX 100	-3,45	-6,38	2,19	11,97	6,92	18,84	34,16
IBRX 50	-3,80	-6,48	2,33	12,81	8,13	15,27	27,76
SMALL CAP	-1,84	-5,21	1,92	9,84	2,20	38,68	54,97
IFIX	0,25	0,57	2,78	3,75	-2,61	18,56	24,88
Índice Consumo - ICON	-5,29		-1,83	-0,23	1,03	36,15	35,39
Índice Dividendos - IDIV	-5,21	-10,02	-1,98	7,65	-3,53	17,34	37,29
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,47	0,72	2,08	4,54	4,79	8,99	13,23
INPC	0,53	0,80	2,27	5,07	5,91	10,06	14,40
IGPM	2,53	5,17	6,18	18,11	28,94	37,73	48,21
SELIC	0,13	0,28	0,45	0,92	2,36	8,07	15,00
Meta Atuarial							

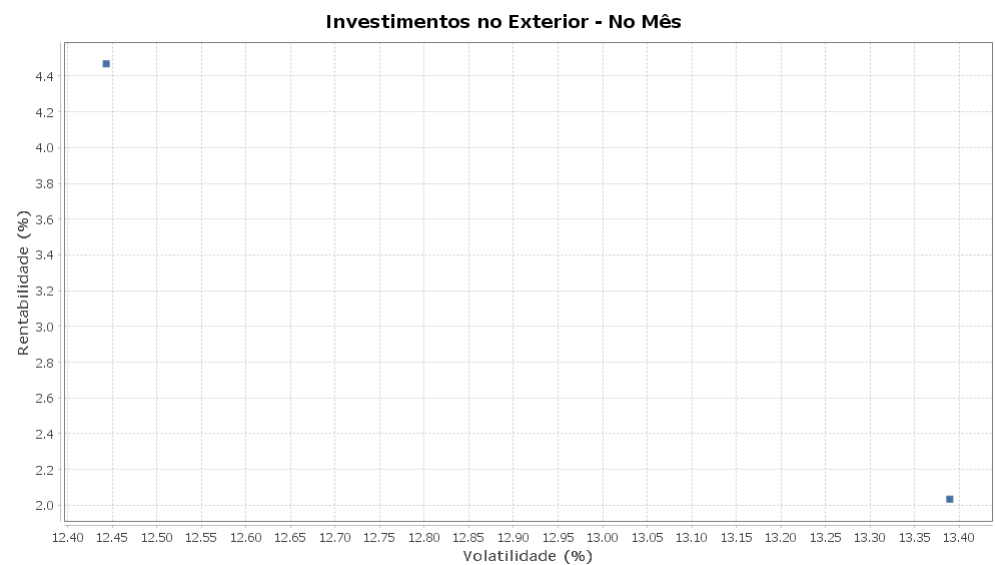
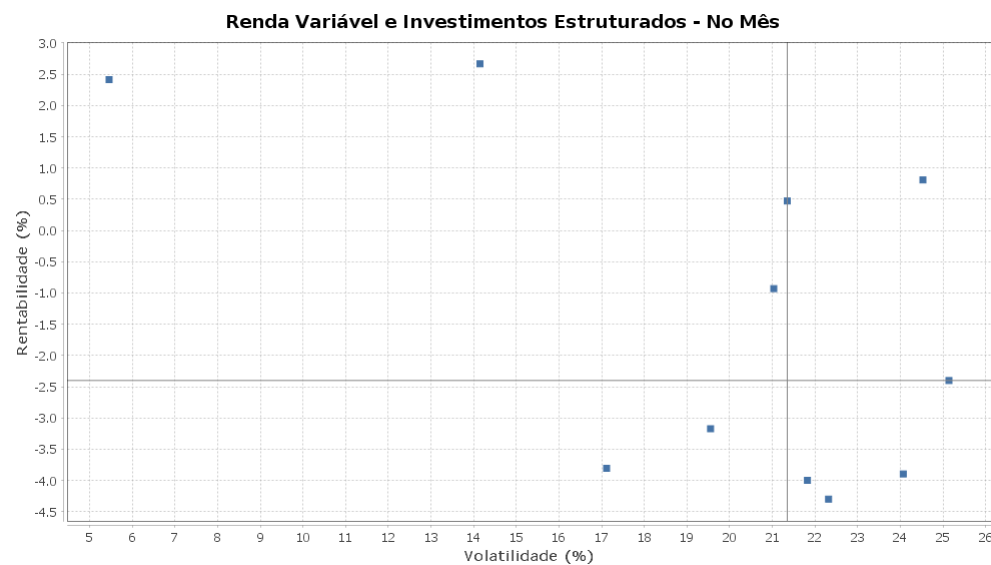
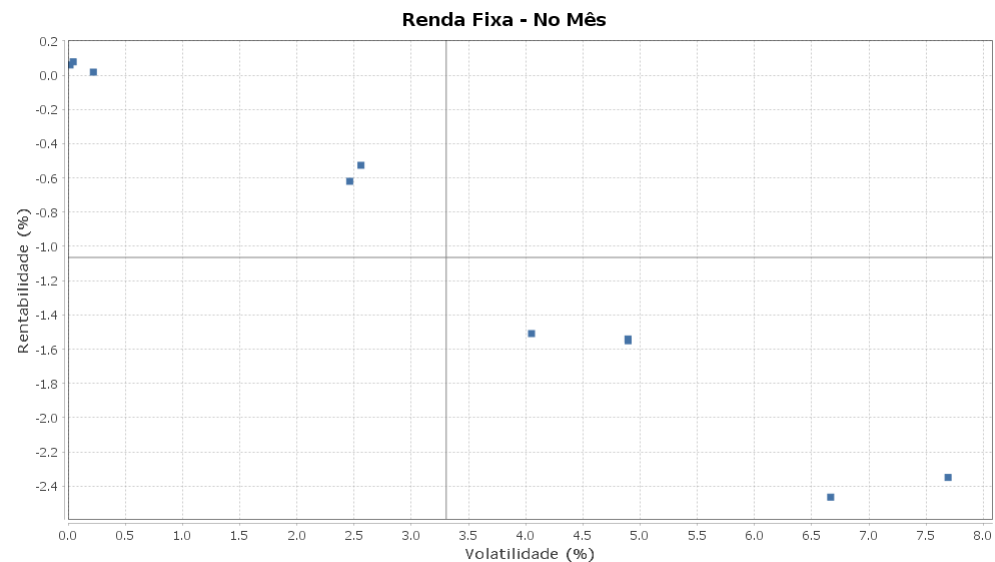
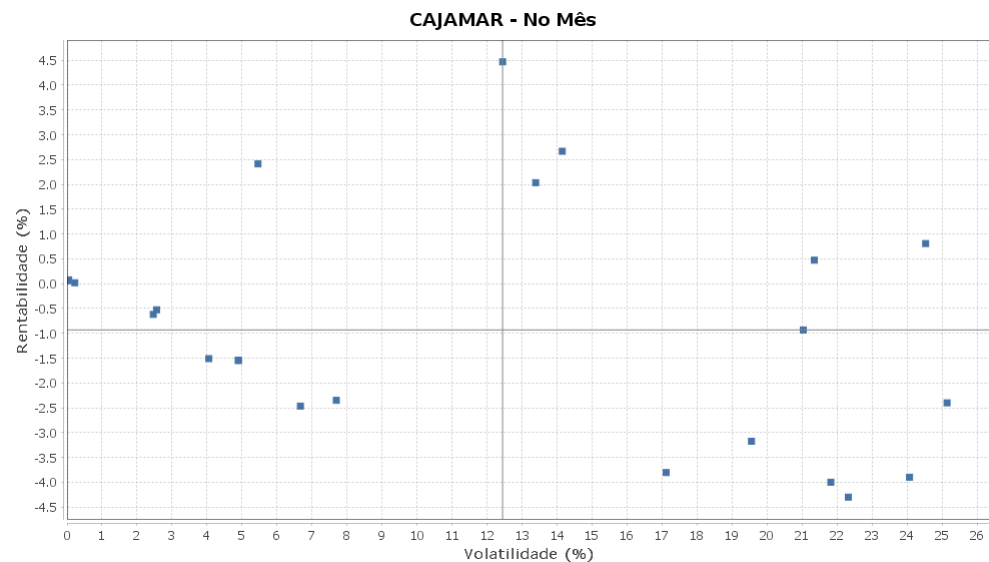
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
16	02/02/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	738,80	197,22109300	3,7460490000
17	03/02/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	7.641,18	2.039,66372400	3,7462940000
22	03/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.473.149,35	0,00	3.241.253,72299600	2,6141580000
25	03/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.473.149,35	3.241.253,72831700	2,6141579957
18	09/02/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	32.685,64	8.722,89306100	3,7471100000
23	10/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.946,45	0,00	744,32127300	2,6150670000
19	17/02/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	20.243,41	5.401,29180700	3,7478830000
20	17/02/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.904,68	1.041,83610700	3,7478830000
21	23/02/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	6.000,23	1.600,80324300	3,7482620000
24	23/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	101.615,65	0,00	38.849,14516300	2,6156470000
26	26/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	296.906,91	0,00	113.576,93214000	2,6141480000
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 10.068.869,59

Value-At-Risk: 2,86%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,04	0,00	-4,19	0,06	16.541.977,70	4,70
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,05	0,05	0,00	-1,25	0,08	6.251.321,05	1,78
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,22	0,15	0,01	-0,53	0,02	21.443.211,03	6,09
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,46	1,23	0,09	-0,31	-0,62	38.864.228,29	11,04
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	Artigo 7º VII, Alínea b	2,56	1,42	0,01	-0,26	-0,53	2.247.689,74	0,64
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	4,05	2,17	0,11	-0,41	-1,51	25.443.645,66	7,23
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,89	2,29	0,27	-0,34	-1,54	55.746.326,35	15,84
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	Artigo 7º III, Alínea a	4,90	2,31	0,28	-0,34	-1,55	58.229.102,79	16,54
XP LONG SHORT 60 FC FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	5,46	2,56	-0,00	0,42	2,41	3.954.192,93	1,12
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	6,67	3,36	0,12	-0,39	-2,46	17.533.832,80	4,98
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	7,69	3,93	0,18	-0,32	-2,35	22.735.678,49	6,46
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	Artigo 9º A, III	12,44	11,43	0,04	0,35	4,47	5.475.382,01	1,56
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	13,39	10,30	0,06	0,14	2,03	9.666.042,25	2,75
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	14,15	8,13	0,18	0,18	2,67	11.188.181,23	3,18
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	17,12	9,58	0,13	-0,23	-3,81	5.249.256,86	1,49
VINCI MOSAICO FIA	Artigo 8º II, Alínea a	19,55	9,88	0,15	-0,17	-3,17	5.888.608,19	1,67
XP INVESTOR FI DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	21,03	10,83	0,31	-0,05	-0,93	11.522.098,31	3,27
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	21,35	10,05	0,13	0,02	0,47	5.380.348,94	1,53
XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	21,82	10,50	0,18	-0,19	-4,00	6.969.580,42	1,98
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	22,32	10,29	0,03	-0,20	-4,30	1.253.406,69	0,36
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	Artigo 8º II, Alínea a	24,07	9,32	0,09	-0,17	-3,90	3.675.923,02	1,04
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	24,53	12,27	0,19	0,03	0,81	6.571.814,82	1,87
AZ QUEST ACOES FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	25,14	12,13	0,30	-0,10	-2,40	10.173.080,53	2,89