



CAJAMAR
JANEIRO 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 29.01.2021.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENTA FIXA **75,43%**

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	-0,87	-0,87	56.618.561,45	15,93	6.185.705.380,20	0,92
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,56	0,03	0,03	21.039.001,51	5,92	10.435.150.283,00	0,20
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,06	0,08	0,08	39.106.587,06	11,00	13.518.203.391,91	0,29
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,97	-1,70	-1,70	23.282.674,64	6,55	1.699.071.109,60	1,37
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	9,34	-0,66	-0,66	25.833.604,47	7,27	1.071.755.183,33	2,41
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			10,53	-0,66	-0,66	165.880.429,13	46,67		

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	-0,88	-0,88	59.146.541,59	16,64	2.989.640.382,47	1,98
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			12,82	-0,88	-0,88	59.146.541,59	16,64		

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	0,16	0,16	6.317.633,92	1,78	5.006.506.249,23	0,13
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	16,96	-1,73	-1,73	17.976.871,42	5,06	520.963.267,43	3,45
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,67	0,13	0,13	16.532.090,63	4,65	3.621.561.522,63	0,46
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			6,16	-0,56	-0,56	40.826.595,97	11,49		

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	6,14	0,35	0,35	2.259.584,45	0,64	833.854.391,71	0,27
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			6,14	0,35	0,35	2.259.584,45	0,64		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

9,96

-0,68

-0,68

268.113.151,14

75,43

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

20,43%

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	45,86	-2,64	-2,64	10.423.288,16	2,93	756.617.943,05	1,38
XP	XP	XP INVESTOR FI DE ACOES	49,91	-4,48	-4,48	11.630.414,37	3,27	361.162.198,09	3,22
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	40,50	-3,92	-3,92	5.456.906,04	1,54	1.645.559.797,71	0,33
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	46,73	-1,91	-1,91	6.519.052,43	1,83	1.364.096.457,43	0,48
XP	XP	XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	41,55	-8,33	-8,33	7.259.798,80	2,04	214.299.142,25	3,39
VINCI	BEM	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	39,07	-3,33	-3,33	3.824.976,16	1,08	553.098.805,56	0,69
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	44,50	-1,46	-1,46	5.355.002,96	1,51	3.479.599.111,95	0,15
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	53,08	-2,91	-2,91	1.309.716,99	0,37	1.335.473.423,07	0,10
VINCI	BEM	VINCI MOSAICO FIA	43,05	-3,00	-3,00	6.081.583,63	1,71	1.633.030.346,93	0,37
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			43,92	-3,78	-3,78	57.860.739,54	16,28		

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	33,64	-0,16	-0,16	10.897.542,27	3,07	1.233.747.922,53	0,88
XP	BNY MELLON	XP LONG SHORT 60 FC FI MULTIMERCADO	7,65	-1,96	-1,96	3.861.017,68	1,09	104.753.372,91	3,69
Sub-total Artigo 8º III			23,47	-0,64	-0,64	14.758.559,95	4,15		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			38,75	-3,16	-3,16	72.619.299,49	20,43		
--	--	--	--------------	--------------	--------------	----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,14%

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	33,77	3,75	3,75	5.241.194,02	1,47	2.019.764.027,29	0,26
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	30,49	2,89	2,89	9.473.332,42	2,67	2.553.021.534,73	0,37
Sub-total Artigo 9º A, III			31,15	3,24	3,24	14.714.526,44	4,14		
Investimentos no Exterior			31,15	3,24	3,24	14.714.526,44	4,14		
Total			15,00	-1,06	-1,06	355.446.977,07	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	165.880.429,13	46,67	0,00	40,00	80,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	59.146.541,59	16,64	0,00	17,00	60,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	40.826.595,97	11,49	0,00	14,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	2.259.584,45	0,64	0,00	1,00	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	268.113.151,14	75,43				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	57.860.739,54	16,28	0,00	18,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	14.758.559,95	4,15	0,00	4,00	10,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	72.619.299,49	20,43				30,00
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	14.714.526,44	4,14	0,00	5,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	14.714.526,44	4,14				10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

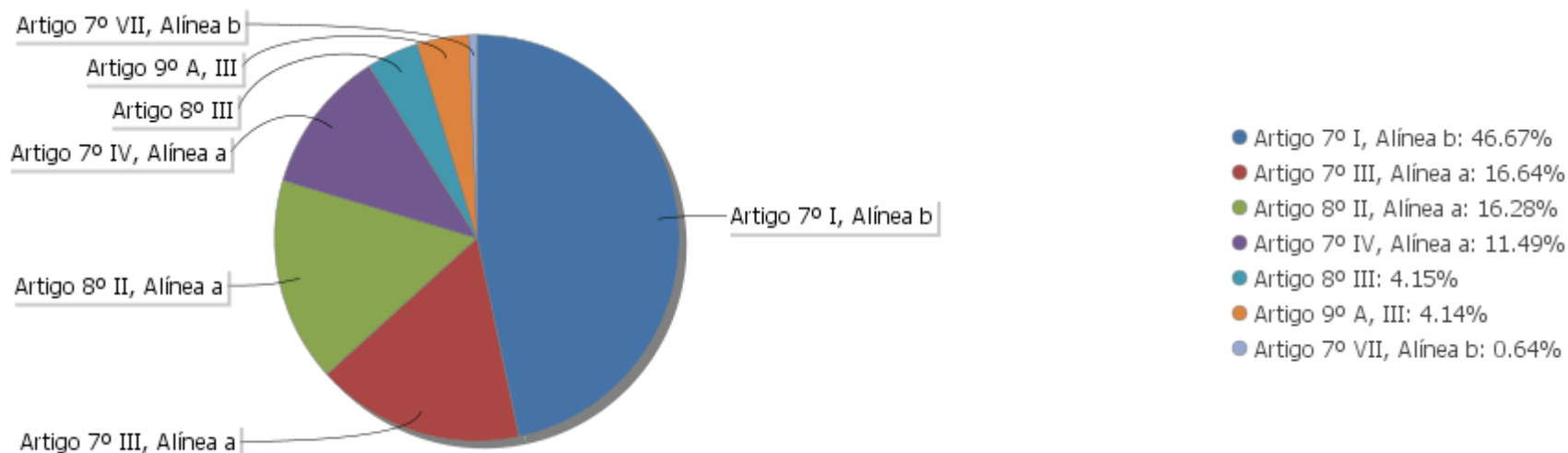
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,66 -441,96	-0,66 -441,96	4,95 1.066,96	2,43 258,38	5,21 206,34	-992.253,91	-992.253,91
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-0,88 -589,95	-0,88 -589,95	5,95 1.282,51	2,59 275,53	4,87 193,03	-526.268,24	-526.268,24
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,56 -375,52	-0,56 -375,52	2,73 588,43	1,09 116,26	3,41 134,99	-278.916,09	-278.916,09
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,35 231,22	0,35 231,22	4,13 889,61	4,61 489,87	6,96 275,42	7.783,44	7.783,44
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-3,78 -0,47	-3,78 -0,47	15,11 -7,36	3,86 -7,95	-11,10 -12,25	-2.275.777,81	-2.275.777,81
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-0,64 2,68	-0,64 2,68	8,97 -13,51	8,58 -3,24	7,09 5,94	-94.541,29	-94.541,29
Artigo 9º A, III % do CDI	3,24 2.168,06	3,24 2.168,06	6,09 1.311,27	18,63 1.980,41	50,64 2.005,21	428.919,10	428.919,10
CAJAMAR (Total)						-3.731.054,80	-3.731.054,80

Análise de Liquidez

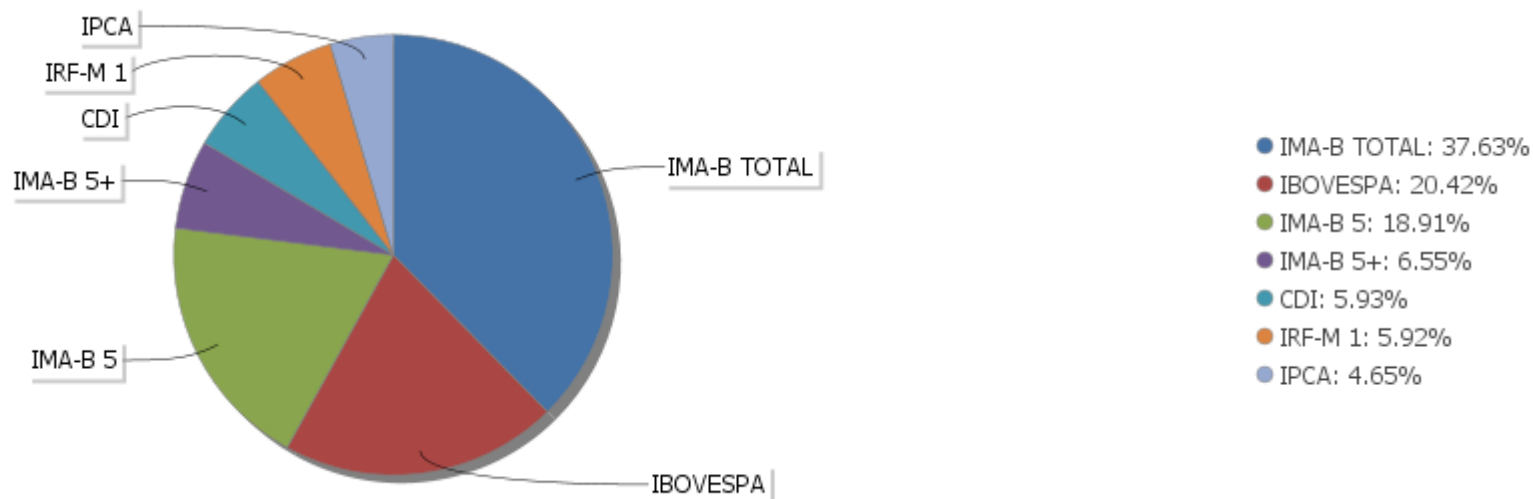
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	336.324.396,64	94,62	336.324.396,64	94,62
de 31 a 365 dias	19.122.580,43	5,38	355.446.977,07	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	355.446.977,07	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

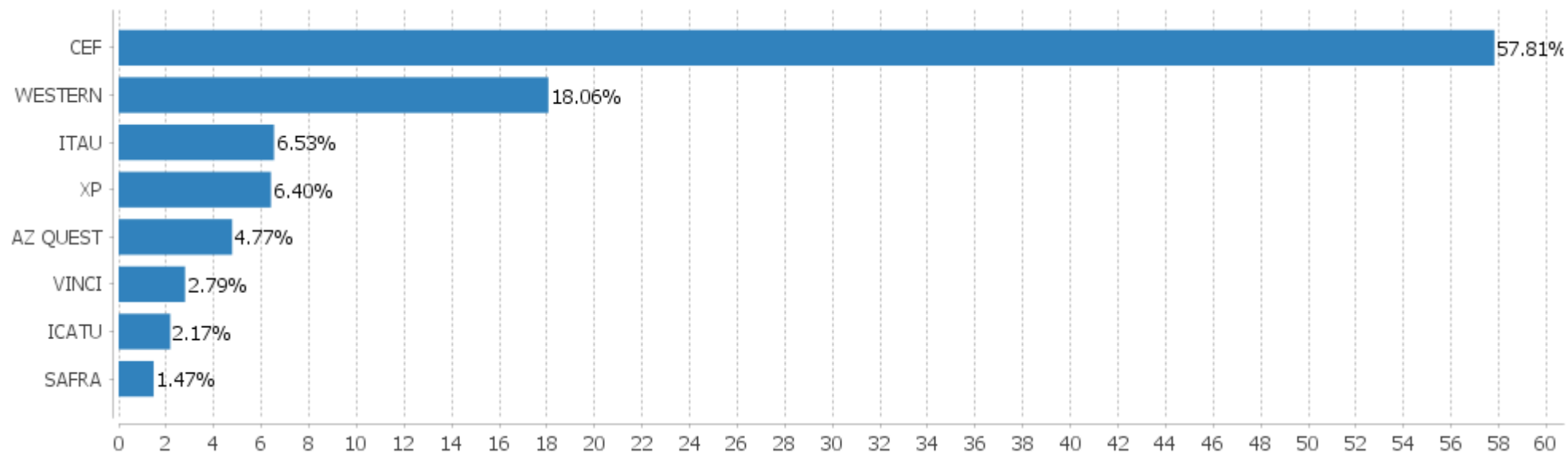


Alocação Por Estratégia



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
IPCA + 5,43%	0,67												0,67
p.p. indexador	-1,73												-1,73
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

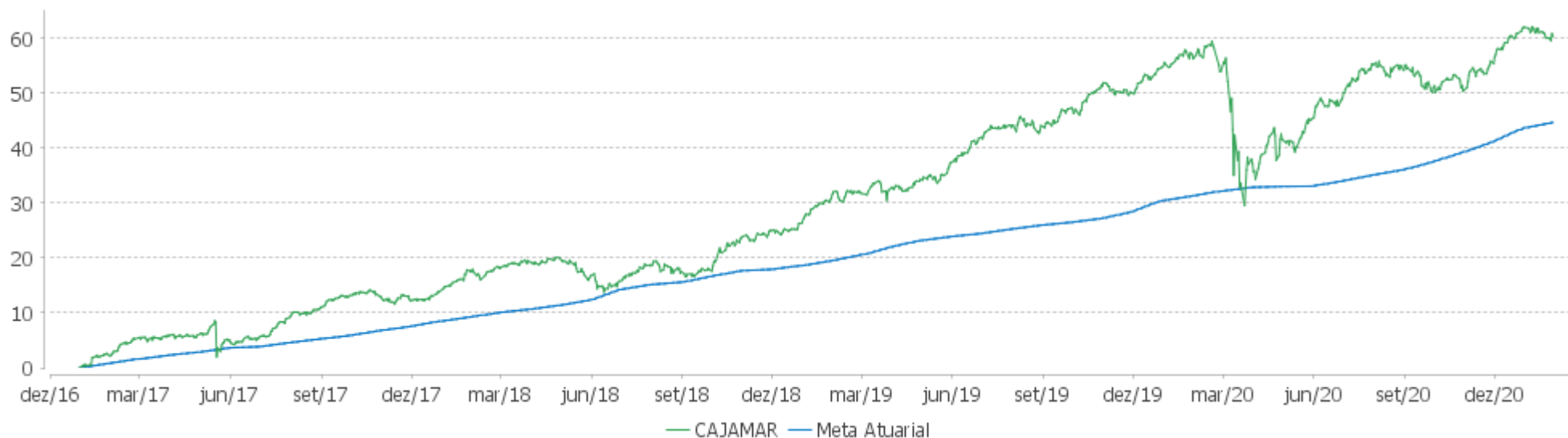
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

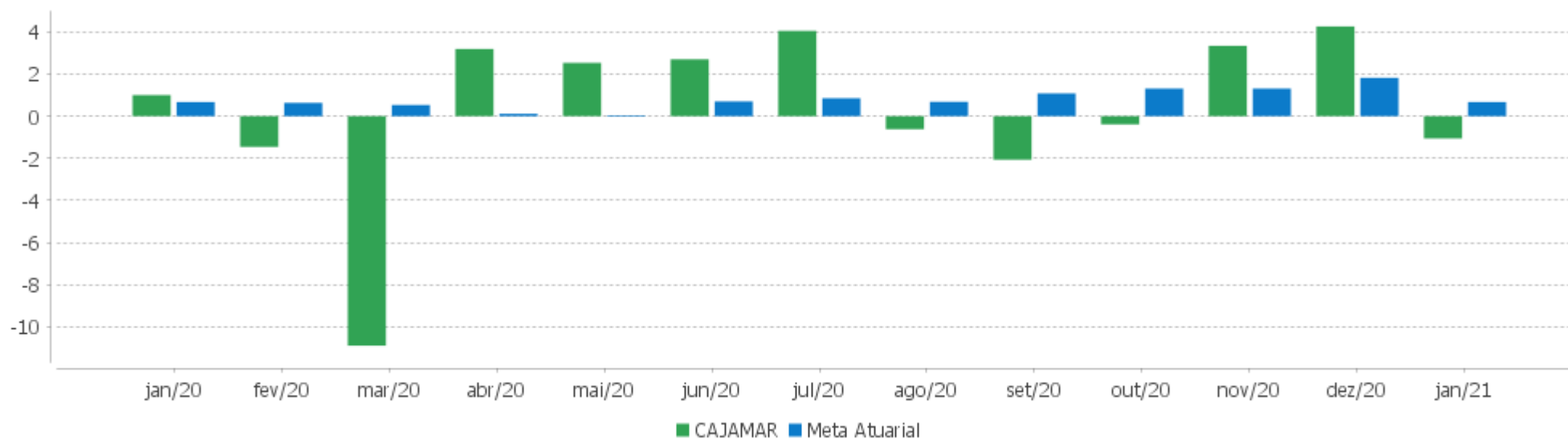
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	28	57,14	03 meses	6,59	3,92	2,67	5,47
Meses abaixo da Meta Atuarial	21	42,86	06 meses	3,34	7,26	-3,92	6,49
			12 meses	2,56	10,58	-8,02	15,00
			24 meses	21,79	22,15	-0,36	11,19
			36 meses	36,26	34,31	1,96	9,64
			Desde 30/12/2016	60,28	47,63	12,65	9,05
	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
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,87 -0,02	-0,87 -0,02	5,99 -0,05	2,66 -0,12	4,88 -0,35	23,46 -0,82	40,68 -1,14
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	-0,66 -0,77	-0,66 -0,77	4,04 0,76	2,59 -1,21	8,48 0,92	24,20 3,67	39,61 6,92
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,08 -0,02	0,08 -0,02	3,22 -0,07	3,64 -0,16	7,25 -0,30	19,86 -0,66	31,74 -0,94
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,03 -0,02	0,03 -0,02	0,53 -0,05	0,90 -0,12	3,22 -0,21	9,83 -0,44	17,30 -0,65
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,70 -0,01	-1,70 -0,01	8,45 0,02	1,96 -0,05	3,49 -0,19	25,98 -0,85	47,09 -1,60
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,73 -0,88	-1,73 -0,88	6,90 0,86	1,55 -1,23	6,13 0,90	27,83 3,54	48,53 6,70
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,16 108,14	0,16 108,14	0,68 146,62	0,95 100,44	2,20 87,20	7,87 93,11	14,55 94,64
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,13 -0,12	0,13 -0,12	0,44 -2,07	0,16 -4,14	2,65 -1,91	12,60 3,66	22,91 9,86
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV Var. IMA-B 5 p.p.	0,35 0,24	0,35 0,24	4,13 0,85	4,61 0,81	6,96 -0,60	19,20 -1,32	31,98 -0,71
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,88 -0,03	-0,88 -0,03	5,95 -0,09	2,59 -0,18	4,87 -0,35	23,40 -0,89	40,74 -1,09
XP LONG SHORT 60 FC FI MULTIMERCADO % do CDI	-1,96 -1.310,75	-1,96 -1.310,75	-3,20 -690,18	-2,81 -298,45	-3,84 -152,16	-0,24 -2,87	8,68 56,48
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	-0,16 -106,48	-0,16 -106,48	14,05 3.026,34	13,28 1.410,89	11,59 458,78	37,59 444,52	37,18 241,86
AZ QUEST ACOES FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,64 0,68	-2,64 0,68	14,42 -8,06	4,55 -7,26	-9,84 -10,99	12,05 -6,09	33,40 -2,11
XP INVESTOR FI DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-4,48 -1,16	-4,48 -1,16	12,59 -9,88	1,60 -10,21	-11,58 -12,73	24,86 6,72	52,32 16,81
VINCI MOSAICO FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,00 0,31	-3,00 0,31	19,70 -2,78	8,71 -3,10	-1,35 -2,50	32,08 13,94	62,14 26,63
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	-2,91 0,41	-2,91 0,41	19,42 -3,05	1,12 -10,69	-24,63 -25,77	-1,24 -19,38	25,09 -10,42
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	-3,33	-3,33	15,71	6,41	5,21	28,34	56,01

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.	-0,01	-0,01	-6,76	-5,41	4,06	10,19	20,49
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-1,91 1,41	-1,91 1,41	17,05 -5,42	4,39 -7,42	-10,95 -12,10	33,55 15,40	64,60 29,08
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	-1,46 1,85	-1,46 1,85	17,60 -4,88	12,10 0,29	-6,09 -7,24	23,46 5,31	49,45 13,93
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,92 -0,60	-3,92 -0,60	17,82 -4,65	4,29 -7,52	-13,53 -14,68	10,48 -7,67	38,67 3,16
XP DIVIDENDOS FI DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-8,33 -5,01	-8,33 -5,01	10,21 -12,26	-3,90 -15,71	-23,56 -24,71	5,06 -13,09	31,87 -3,64
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	3,75 7,07	3,75 7,07	6,65 -15,82	18,86 7,05	40,11 38,96	102,40 84,25	
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	2,89 6,21	2,89 6,21	5,70 -16,78	18,48 6,67	59,07 57,92	128,83 110,68	150,87 115,36
CAJAMAR Var. IPCA + 5,43% p.p.	-1,06 -1,73	-1,06 -1,73	6,59 2,74	3,34 -3,74	2,56 -7,60	21,79 0,74	36,26 3,88
CDI	0,15	0,15	0,46	0,94	2,53	8,46	15,37
IBOVESPA	-3,32	-3,32	22,47	11,81	1,15	18,15	35,51
INPC + 6,00%	0,73	0,73	4,18	7,97	11,79	23,62	35,65
IPCA + 6,00%	0,71	0,71	3,99	7,36	10,76	22,35	34,53

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	0,04	0,58	1,02	3,43	10,27	17,95
IRF-M 1+	-1,39	-1,39	2,09	-0,60	5,77	20,12	35,07
IRF-M TOTAL	-0,80	-0,80	1,50	-0,15	4,92	16,95	29,61
IMA-B 5	0,11	0,11	3,28	3,80	7,55	20,52	32,68
IMA-B 5+	-1,69	-1,69	8,43	2,01	3,68	26,83	48,69
IMA-B TOTAL	-0,85	-0,85	6,04	2,78	5,22	24,29	41,83
IMA-C TOTAL	6,46	6,46	7,31	15,99	26,73	52,15	76,01
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,44	-0,44	2,38	0,96	3,87	15,36	26,95
IMA-GERAL TOTAL	-0,24	-0,24	2,52	1,39	4,50	16,33	28,20
IDKA 2	0,15	0,15	3,16	4,28	8,20	20,12	32,49
IDKA 20	-2,81	-2,81	11,88	1,09	0,71	29,02	58,93
CDI	0,15	0,15	0,46	0,94	2,53	8,46	15,37
Renda Variável							
IBOVESPA	-3,32	-3,32	22,47	11,81	1,15	18,15	35,51
IBRX 100	-3,03	-3,03	22,21	12,06	1,64	20,92	39,53
IBRX 50	-2,78	-2,78	23,61	13,27	2,67	17,81	33,39
SMALL CAP	-3,43	-3,43	21,10	10,52	-4,50	38,71	57,28
IFIX	0,32	0,32	4,07	5,35	-6,43	19,49	26,00
Índice Consumo - ICON			12,91	3,78	-3,99	37,57	37,84
Índice Dividendos - IDIV	-5,08	-5,08	18,30	8,08	-4,52	21,27	43,95
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,25	0,25	2,51	4,30	4,56	8,94	13,06
INPC	0,27	0,27	2,70	4,89	5,53	10,07	14,00
IGPM	2,58	2,58	6,95	18,36	25,71	35,53	44,66
SELIC	0,15	0,15	0,46	0,94	2,53	8,46	15,38
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

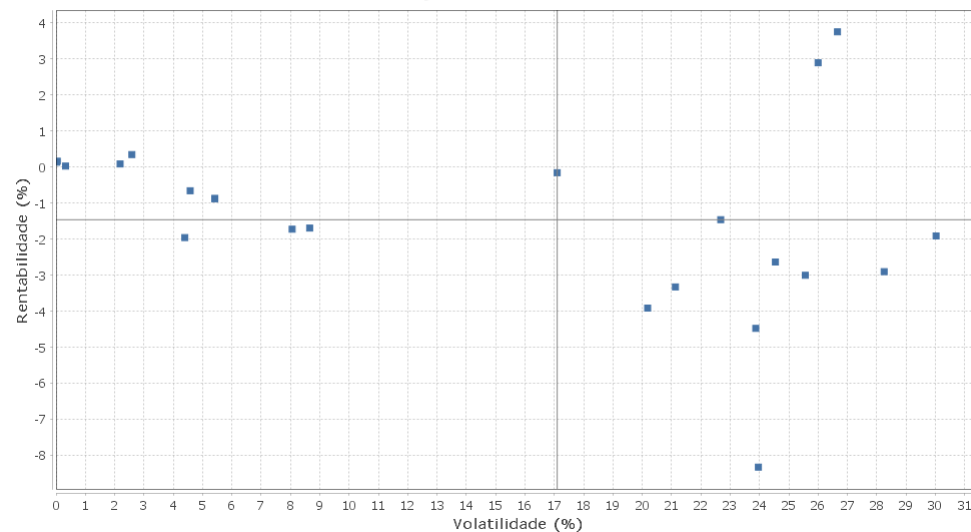
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
127	06/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	277.791,92	0,00	106.317,18500000	2,6128600000
120	11/01/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	32.845,70	8.779,57781100	3,7411480000
132	11/01/2021	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	2.000.000,00	110.899,06593598	18,0344170000
133	12/01/2021	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	4.872.808,00	0,00	2.005.720,04667540	2,4294557000
134	13/01/2021	WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	2.000.000,00	0,00	330,82484210	6.045,4952146000
121	14/01/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	8.885,07	2.374,41298000	3,7420070000
122	15/01/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	726,00	193,99766400	3,7423130000
123	19/01/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	16.461,55	4.397,89036400	3,7430560000
124	22/01/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.437,13	383,87722500	3,7437230000
125	25/01/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	878.746,41	234.707,78272200	3,7440020000
128	26/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	878.746,41	0,00	336.417,50549600	2,6120710000
126	28/01/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.841.958,41	491.838,52953200	3,7450470000
129	28/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	280.053,89	0,00	107.172,35010900	2,6131170000
130	29/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.261.253,38	0,00	3.160.779,44626600	2,6136760000
131	29/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	211.895,97	0,00	81.072,01122000	2,6136760000
Total						

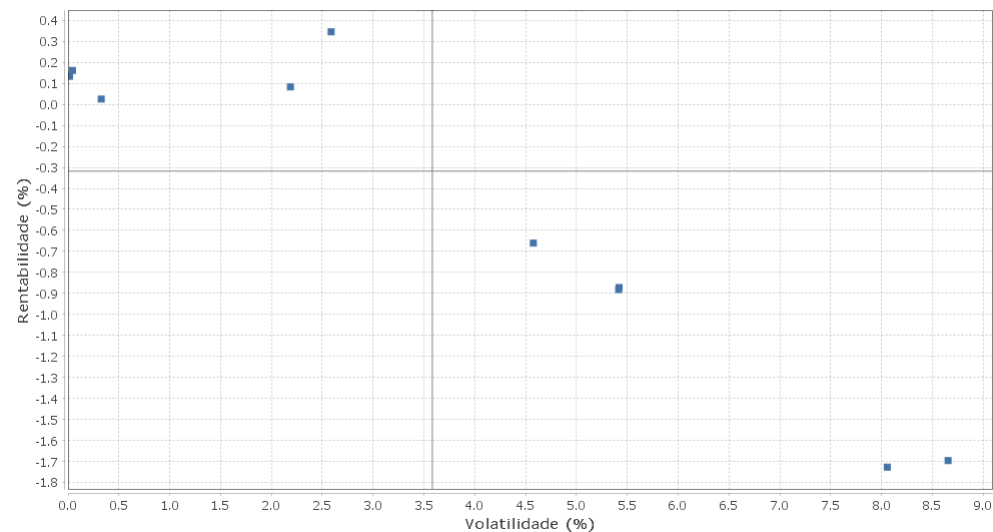
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

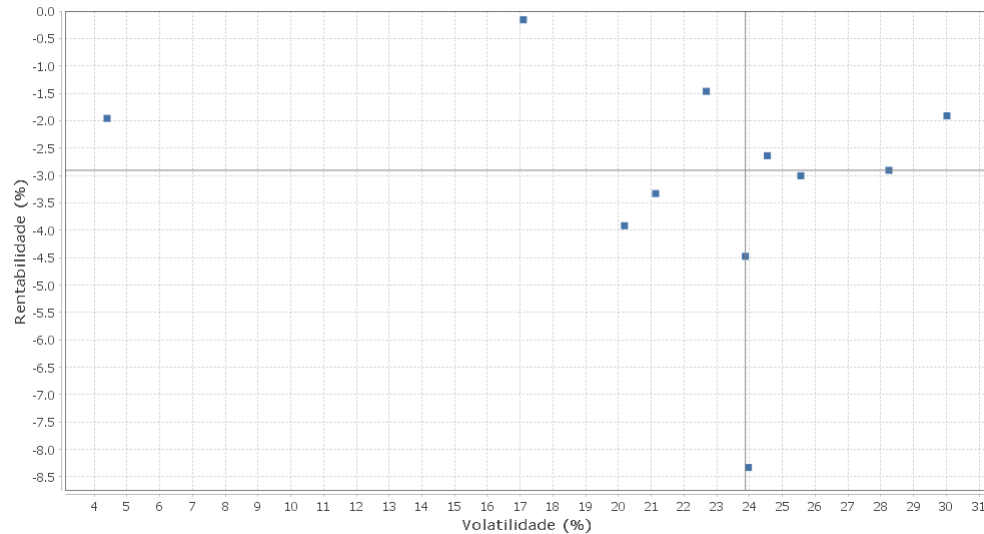
CAJAMAR - No Mês



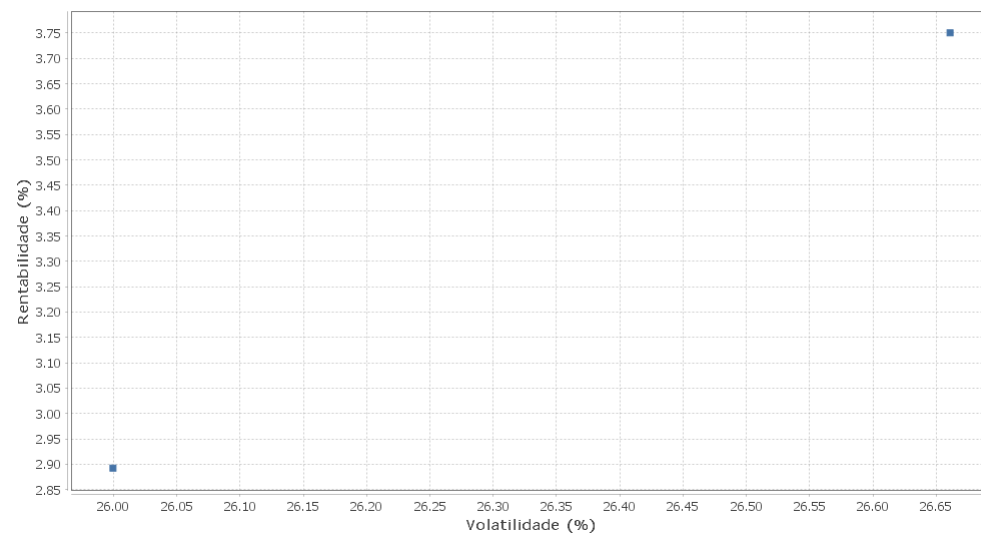
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 10.830.798,05

Value-At-Risk: 3,05%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,23	0,01	-1,01	0,13	16.532.090,63	4,65
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,13	0,00	0,28	0,16	6.317.633,92	1,78
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,15	0,01	-0,38	0,03	21.039.001,51	5,92
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,19	1,23	0,10	-0,03	0,08	39.106.587,06	11,00
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	Artigo 7º VII, Alínea b	2,59	1,25	0,01	0,08	0,35	2.259.584,45	0,64
XP LONG SHORT 60 FC FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	4,39	3,13	0,00	-0,48	-1,96	3.861.017,68	1,09
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	4,58	2,16	0,12	-0,18	-0,66	25.833.604,47	7,27
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REFERENCIADO IMA-B LP	Artigo 7º III, Alínea a	5,41	2,56	0,34	-0,19	-0,88	59.146.541,59	16,64
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,42	2,57	0,33	-0,19	-0,87	56.618.561,45	15,93
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	Artigo 7º IV, Alínea a	8,06	3,43	0,14	-0,23	-1,73	17.976.871,42	5,06
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	8,65	4,24	0,22	-0,21	-1,70	23.282.674,64	6,55
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	17,10	8,38	0,16	-0,02	-0,16	10.897.542,27	3,07
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	20,18	9,82	0,13	-0,20	-3,92	5.456.906,04	1,54
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	Artigo 8º II, Alínea a	21,13	9,23	0,09	-0,16	-3,33	3.824.976,16	1,08
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	22,68	9,86	0,13	-0,07	-1,46	5.355.002,96	1,51
XP INVESTOR FI DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	23,87	10,69	0,31	-0,19	-4,48	11.630.414,37	3,27
XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	23,96	10,89	0,19	-0,35	-8,33	7.259.798,80	2,04
AZ QUEST ACOES FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	24,54	11,98	0,30	-0,11	-2,64	10.423.288,16	2,93
VINCI MOSAICO FIA	Artigo 8º II, Alínea a	25,56	10,03	0,15	-0,12	-3,00	6.081.583,63	1,71
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	26,00	11,33	0,07	0,11	2,89	9.473.332,42	2,67
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	Artigo 9º A, III	26,66	11,45	0,04	0,14	3,75	5.241.194,02	1,47
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	28,25	11,71	0,04	-0,11	-2,91	1.309.716,99	0,37
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	30,02	12,02	0,18	-0,07	-1,91	6.519.052,43	1,83