



**CAJAMAR**  
FEVEREIRO 2020



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 17.03.2020.

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** **73,35%**

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           | 4,91                | 0,44            | 0,69            | 54.222.218,67         | 17,68        | 6.609.422.706,56  | 0,82    |
| CEF                                    | CEF         | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF                     | 0,25                | 0,36            | 0,79            | 8.397.315,20          | 2,74         | 10.513.960.188,40 | 0,08    |
| CEF                                    | CEF         | FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO          | 1,98                | 0,63            | 1,18            | 23.157.526,05         | 7,55         | 9.698.235.388,71  | 0,24    |
| CEF                                    | CEF         | FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP                  | 7,29                | 0,29            | 0,25            | 22.563.541,40         | 7,36         | 2.293.876.669,47  | 0,98    |
| WESTERN                                | BNP PARIBAS | WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RENDA FIXA          | 3,15                | 1,03            | 1,94            | 19.497.414,69         | 6,36         | 533.375.496,94    | 3,66    |
| CEF                                    | CEF         | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS | 0,80                | 0,25            | 0,21            | 5.213.580,00          | 1,70         | 256.322.456,81    | 2,03    |
| <b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b> |             |                                                   | <b>4,02</b>         | <b>0,52</b>     | <b>0,86</b>     | <b>133.051.596,01</b> | <b>43,39</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 NOVO BRASIL IMAB RF LP | 4,88                | 0,44            | 0,67            | 42.285.896,48        | 13,79        | 3.035.883.583,88 | 1,39    |
| <b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b> |        |                            | <b>4,88</b>         | <b>0,44</b>     | <b>0,67</b>     | <b>42.285.896,48</b> | <b>13,79</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 | 0,06                | 0,27            | 0,65            | 12.292.224,53        | 4,01         | 5.421.482.050,58 | 0,23    |
| WESTERN                                 | BNP PARIBAS | WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA       | 6,13                | 0,81            | 1,37            | 17.076.807,09        | 5,57         | 339.113.628,23   | 5,04    |
| ITAU                                    | ITAU        | ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI | 1,69                | 0,26            | 0,60            | 18.101.935,26        | 5,90         | 5.092.614.949,01 | 0,36    |
| <b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b> |             |                                               | <b>2,14</b>         | <b>0,47</b>     | <b>0,91</b>     | <b>47.470.966,88</b> | <b>15,48</b> |                  |         |

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

| Gestor | Admin. | Ativo                                    | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$)  | % Carteira | PL do Fundo    | % Fundo |
|--------|--------|------------------------------------------|---------------------|-----------------|-----------------|--------------|------------|----------------|---------|
| ICATU  | BEM    | ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV | 1,96                | 0,58            | 1,54            | 2.124.929,85 | 0,69       | 535.880.895,76 | 0,40    |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Gestor | Admin. | Ativo                                    | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentab.<br>Mês (%) | Rentab.<br>Ano (%) | Valor (R\$)         | % Carteira  | PL do Fundo | % Fundo |
|--------|--------|------------------------------------------|------------------------|--------------------|--------------------|---------------------|-------------|-------------|---------|
|        |        | <b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b</b> | <b>1,96</b>            | <b>0,58</b>        | <b>1,54</b>        | <b>2.124.929,85</b> | <b>0,69</b> |             |         |
|        |        | Renda Fixa                               | 3,73                   | 0,49               | 0,84               | 224.933.389,22      | 73,35       |             |         |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

24,00%

#### 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                       | 20,27                  | -8,29              | -4,78              | 10.603.483,43        | 3,46         | 986.212.666,18   | 1,08    |
| XP                                      | XP     | XP INVESTOR FI DE ACOES                      | 19,38                  | -5,88              | -2,88              | 12.380.428,23        | 4,04         | 449.232.932,50   | 2,76    |
| ICATU                                   | BEM    | ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA               | 15,61                  | -7,00              | -6,42              | 5.868.939,24         | 1,91         | 1.963.717.198,95 | 0,30    |
| AZ QUEST                                | BEM    | AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA           | 20,19                  | -6,19              | 0,07               | 6.867.687,44         | 2,24         | 1.484.406.611,62 | 0,46    |
| XP                                      | XP     | XP DIVIDENDOS FI DE ACOES                    | 17,53                  | -6,89              | -5,54              | 8.842.973,04         | 2,88         | 364.694.286,11   | 2,42    |
| VINCI                                   | BEM    | VINCI SELECTION EQUITIES FIA                 | 16,55                  | -5,96              | -5,59              | 3.418.932,65         | 1,11         | 405.593.691,50   | 0,84    |
| ITAU                                    | ITAU   | ITAU ACOES DUNAMIS FIC                       | 18,26                  | -9,79              | -9,96              | 5.143.814,71         | 1,68         | 4.106.559.997,95 | 0,13    |
| ITAU                                    | ITAU   | ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI       | 19,26                  | -9,27              | -7,93              | 1.576.593,77         | 0,51         | 2.262.526.519,52 | 0,07    |
| VINCI                                   | BEM    | VINCI MOSAICO FUNDO DE INVESTIMENTO DE ACOES | 17,97                  | -5,42              | -3,77              | 5.830.907,26         | 1,90         | 1.674.749.361,15 | 0,35    |
| <b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b> |        |                                              | <b>18,02</b>           | <b>-6,99</b>       | <b>-4,65</b>       | <b>60.533.759,77</b> | <b>19,74</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 | 15,04                  | -7,50              | -7,16              | 9.033.323,72         | 2,95        | 814.886.135,28 | 1,11    |
| XP                             | BNY MELLON  | XP LONG SHORT 60 FC FI MULTIMERCADO        | 4,81                   | 0,24               | 1,70               | 4.024.784,88         | 1,31        | 223.533.019,92 | 1,80    |
| <b>Sub-total Artigo 8º III</b> |             |                                            | <b>10,54</b>           | <b>-5,25</b>       | <b>-4,62</b>       | <b>13.058.108,60</b> | <b>4,26</b> |                |         |

|                                                    |  |  |              |              |              |                      |              |  |  |
|----------------------------------------------------|--|--|--------------|--------------|--------------|----------------------|--------------|--|--|
| <b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b> |  |  | <b>15,75</b> | <b>-6,69</b> | <b>-4,61</b> | <b>73.591.868,37</b> | <b>24,00</b> |  |  |
|----------------------------------------------------|--|--|--------------|--------------|--------------|----------------------|--------------|--|--|

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,65%

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                   | 14,55                  | -5,24              | 1,37               | 3.545.053,18          | 1,16          | 849.143.050,83 | 0,42    |
| WESTERN                           | BNP PARIBAS | WESTERN ASSET FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES BDR N | 15,37                  | -1,97              | 5,27               | 4.586.994,85          | 1,50          | 461.830.097,53 | 0,99    |
| <b>Sub-total Artigo 9º A, III</b> |             |                                                    | <b>15,00</b>           | <b>-3,42</b>       | <b>3,53</b>        | <b>8.132.048,03</b>   | <b>2,65</b>   |                |         |
| <b>Investimentos no Exterior</b>  |             |                                                    | <b>15,00</b>           | <b>-3,42</b>       | <b>3,53</b>        | <b>8.132.048,03</b>   | <b>2,65</b>   |                |         |
| <b>Total</b>                      |             |                                                    |                        |                    |                    | <b>306.657.305,62</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                      | 133.051.596,01 | 43,39      | 0,00   | 45,00    | 100,00 | 100,00       |
| Artigo 7º III, Alínea a                     | Fundos Renda Fixa Referenciados                   | 42.285.896,48  | 13,79      | 0,00   | 14,00    | 60,00  | 60,00        |
| Artigo 7º IV, Alínea a                      | Fundos de Renda Fixa                              | 47.470.966,88  | 15,48      | 0,00   | 14,00    | 40,00  | 40,00        |
| Artigo 7º VII, Alínea b                     | Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"               | 2.124.929,85   | 0,69       | 0,00   | 1,00     | 5,00   | 5,00         |
|                                             | Total Renda Fixa                                  | 224.933.389,22 | 73,35      |        |          |        |              |
| Renda Variável e Investimentos Estruturados |                                                   |                |            |        |          |        |              |
| Artigo 8º II, Alínea a                      | Fundos de Ações                                   | 60.533.759,77  | 19,74      | 0,00   | 19,00    | 20,00  | 20,00        |
| Artigo 8º III                               | Fundos Multimercados                              | 13.058.108,60  | 4,26       | 0,00   | 5,00     | 10,00  | 10,00        |
|                                             | Total Renda Variável e Investimentos Estruturados | 73.591.868,37  | 24,00      |        |          |        |              |
| Investimentos no Exterior                   |                                                   |                |            |        |          |        |              |
| Artigo 9º A, III                            | Ações - BDR Nível I                               | 8.132.048,03   | 2,65       | 0,00   | 2,00     | 10,00  | 10,00        |
|                                             | Total Investimentos no Exterior                   | 8.132.048,03   | 2,65       |        |          |        |              |

## 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            | 0,52<br>176,86     | 0,86<br>128,81 | 2,61<br>248,47 | 6,11<br>255,29 | 15,84<br>284,23 | 687.816,44    | 1.138.119,64  |
| Artigo 7º III, Alínea a<br>% do CDI          | 0,44<br>148,23     | 0,67<br>99,17  | 2,67<br>254,69 | 6,36<br>266,11 | 17,53<br>314,53 | 183.307,86    | 279.701,01    |
| Artigo 7º IV, Alínea a<br>% do CDI           | 0,47<br>161,33     | 0,91<br>136,13 | 2,02<br>192,41 | 4,65<br>194,40 | 9,82<br>176,15  | 205.963,73    | 377.447,67    |
| Artigo 7º VII, Alínea b<br>% do CDI          | 0,58<br>197,95     | 1,54<br>228,78 | 2,72<br>259,23 | 5,03<br>210,30 |                 | 12.283,50     | 32.147,90     |
| Artigo 8º II, Alínea a<br>Var. IBOVESPA p.p. | -6,99<br>1,44      | -4,65<br>5,27  | 3,85<br>7,61   | 11,06<br>8,06  | 26,41<br>17,42  | -4.550.369,12 | -2.952.822,64 |
| Artigo 8º III<br>Var. IBOVESPA p.p.          | -5,25<br>3,18      | -4,62<br>5,30  | -3,04<br>0,72  | 2,39<br>-0,61  | 7,42<br>-1,56   | -723.287,53   | -652.929,70   |
| Artigo 9º A, III<br>% do CDI                 | -3,42<br>-1.164,60 | 3,53<br>526,15 | 2,05<br>195,62 | 9,41<br>393,52 | 31,07<br>557,37 | -288.029,53   | 277.491,90    |
|                                              |                    |                |                |                |                 | -4.472.314,65 | -1.500.844,22 |

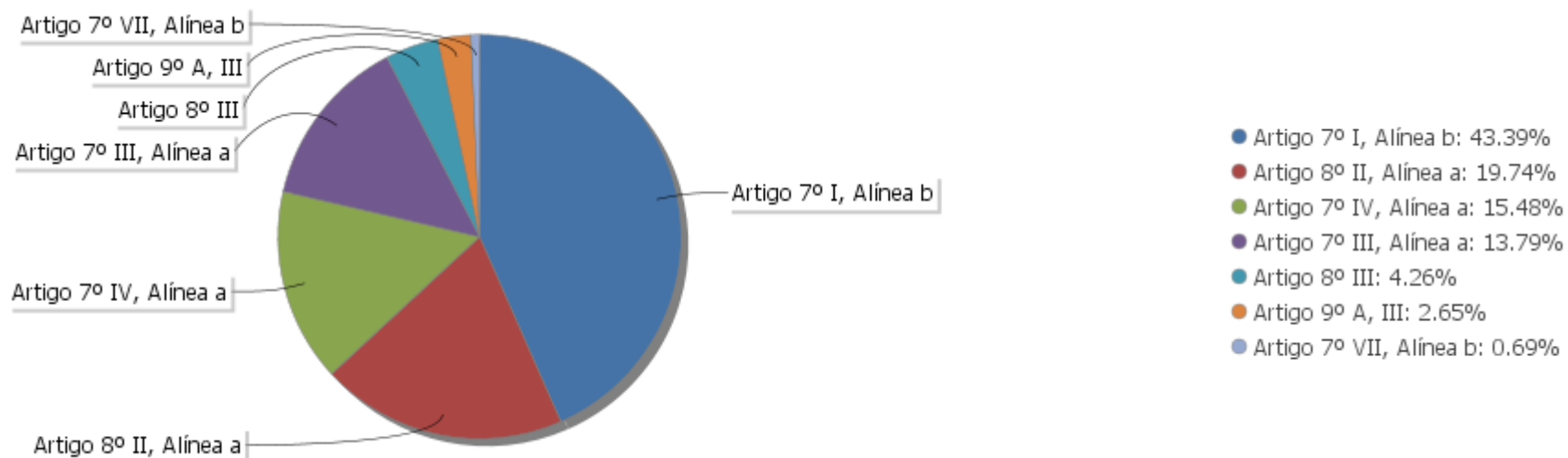
### Análise de Liquidez

| Período           | Valor (R\$)    | (%)   | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|----------------|-------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias    | 283.025.286,12 | 92,29 | 283.025.286,12        | 92,29     |
| de 31 a 364 dias  | 23.632.019,50  | 7,71  | 306.657.305,62        | 100,00    |
| acima de 365 dias | 0,00           | 0,00  | 306.657.305,62        | 100,00    |

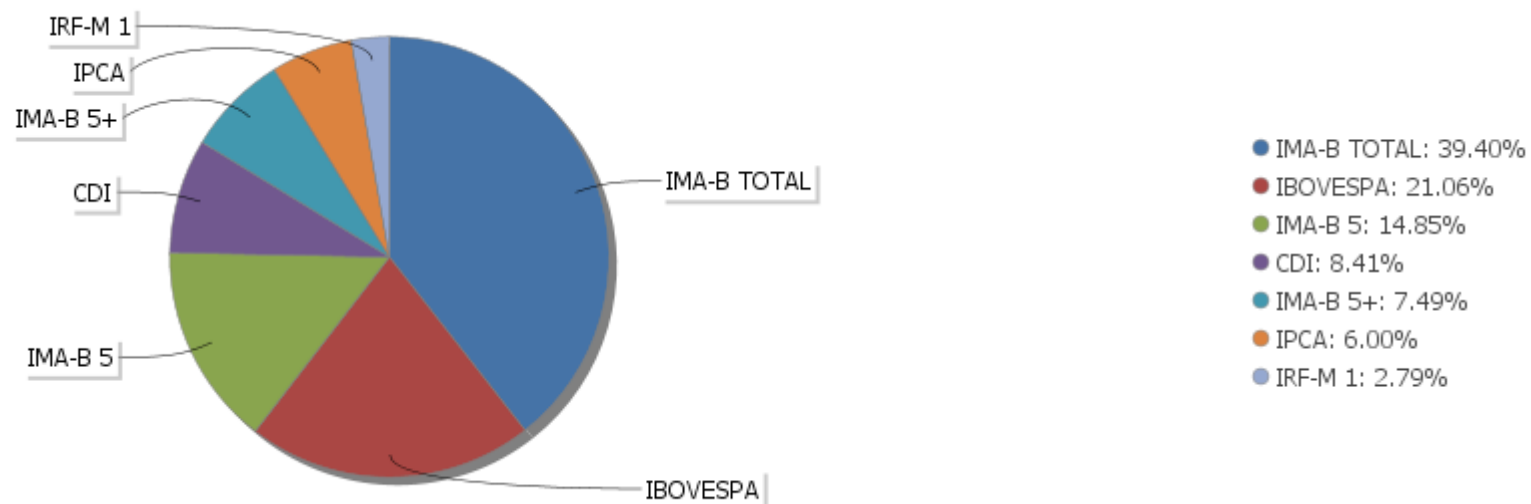


## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

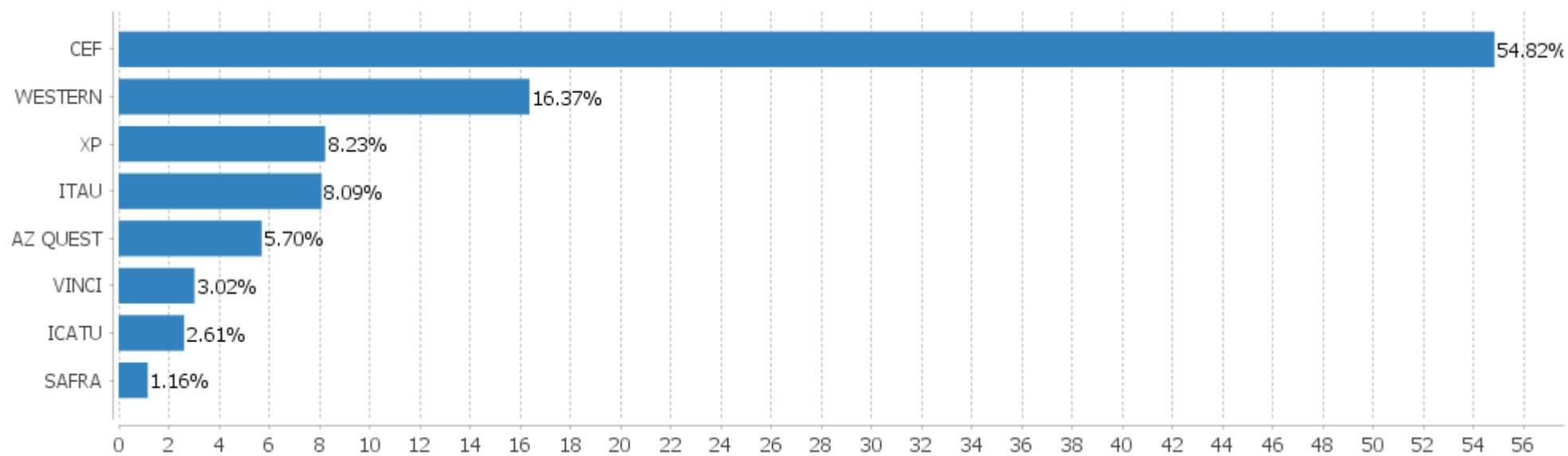


### Alocação Por Estratégia



## 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 |       |       |       |       |      |       |       |       |       |      | -0,48    |
| IPCA + 5,87%   | 0,71 | 0,66  |       |       |       |       |      |       |       |       |       |      | 1,37     |
| p.p. indexador | 0,29 | -2,12 |       |       |       |       |      |       |       |       |       |      | -1,85    |
| 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     |

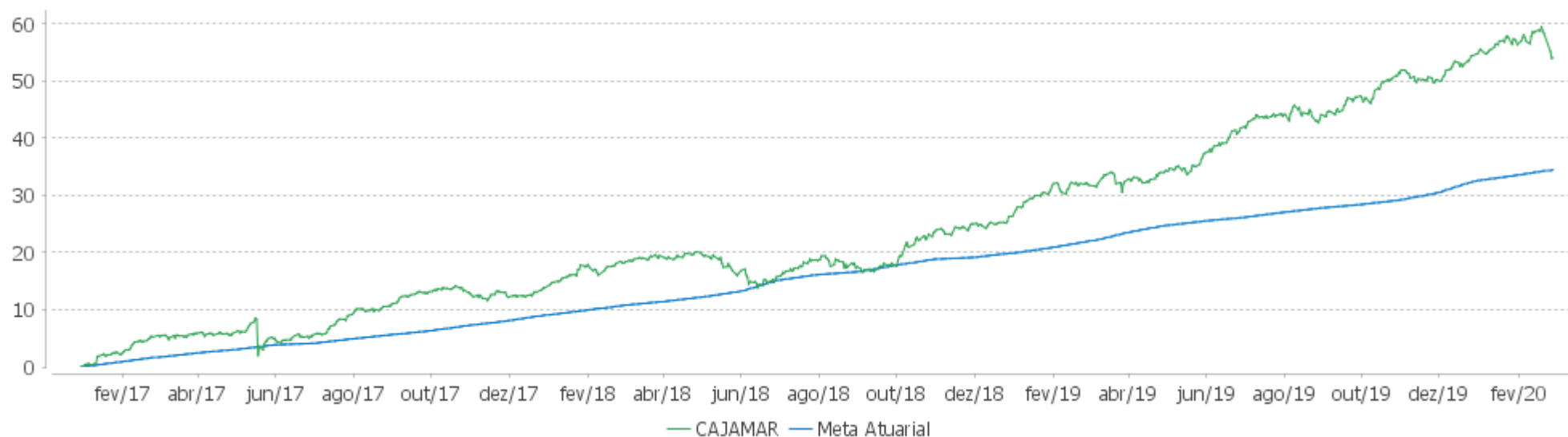
### PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

#### RELATÓRIO TRIMESTRAL

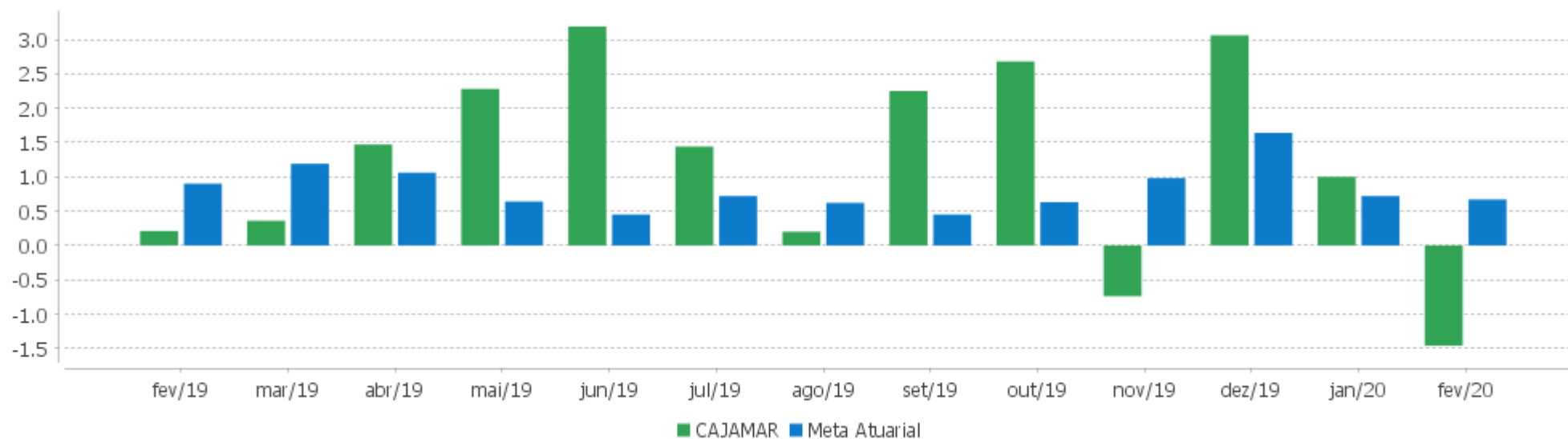
|                                 | Quantidade    | Perc. (%) | Período          | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|---------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima da Meta Atuarial    | 22            | 57,89     | 03 meses         | 2,57     | 3,04          | -0,47      | 6,75               |
| Meses abaixo da Meta Atuarial   | 16            | 42,11     | 06 meses         | 6,88     | 5,17          | 1,71       | 5,76               |
|                                 |               |           | 12 meses         | 16,76    | 10,20         | 6,56       | 5,70               |
|                                 |               |           | 24 meses         | 30,32    | 21,35         | 8,96       | 5,52               |
|                                 |               |           | 36 meses         | 46,35    | 32,20         | 14,15      | 6,20               |
|                                 |               |           | Desde 30/12/2016 | 53,99    | 34,38         | 19,61      | 6,12               |
|                                 | Rentabilidade | Mês       |                  |          |               |            |                    |
| Maior rentabilidade da Carteira | 4,81          | 2018-10   |                  |          |               |            |                    |
| Menor rentabilidade da Carteira | -3,02         | 2018-05   |                  |          |               |            |                    |

## 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.              | 0,58<br>-0,06  | 1,54<br>0,33  | 2,72<br>0,27  | 5,03<br>-0,63  | 11,41<br>-0,76 | 23,43<br>-0,06  | 39,22<br>1,26   |
| FIC NOVO BRASIL IMAB RF LP<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.                        | 0,44<br>-0,01  | 0,67<br>-0,05 | 2,67<br>-0,06 | 6,36<br>-0,18  | 17,53<br>-0,47 | 33,98<br>-0,67  | 47,95<br>-1,32  |
| WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.           | 0,81<br>0,36   | 1,37<br>0,66  | 3,56<br>0,83  | 7,86<br>1,32   | 20,96<br>2,96  | 39,97<br>5,32   | 55,99<br>6,72   |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP<br>% do CDI                  | 0,27<br>93,24  | 0,65<br>96,16 | 1,00<br>95,34 | 2,22<br>92,84  | 5,33<br>95,61  | 11,90<br>96,39  | 21,87<br>97,66  |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI<br>Var. IPCA p.p.            | 0,26<br>0,01   | 0,60<br>0,14  | 0,95<br>-0,67 | 2,60<br>0,40   | 9,60<br>5,60   | 19,17<br>11,12  | 31,31<br>20,19  |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.           | 0,44<br>-0,01  | 0,69<br>-0,03 | 2,69<br>-0,04 | 6,35<br>-0,19  | 17,63<br>-0,37 | 34,00<br>-0,65  | 48,25<br>-1,02  |
| WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RENDA FIXA<br>Var. IMA-B 5 p.p.              | 1,03<br>0,38   | 1,94<br>0,73  | 3,37<br>0,92  | 7,08<br>1,42   | 15,24<br>3,07  | 28,81<br>5,32   | 45,44<br>7,48   |
| FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO<br>Var. IMA-B 5 p.p.              | 0,63<br>-0,01  | 1,18<br>-0,03 | 2,40<br>-0,05 | 5,51<br>-0,15  | 11,87<br>-0,29 | 22,95<br>-0,54  | 37,12<br>-0,84  |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS<br>Var. IMA-B TOTAL p.p. | 0,25<br>-0,20  | 0,21<br>-0,50 | 0,99<br>-1,74 | 3,34<br>-3,21  | 7,17<br>-10,84 | 16,78<br>-17,87 | 27,24<br>-22,02 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF<br>Var. IRF-M 1 p.p.                         | 0,36<br>-0,02  | 0,79<br>-0,04 | 1,19<br>-0,05 | 2,77<br>-0,11  | 6,31<br>-0,21  | 13,44<br>-0,41  | 24,42<br>-0,64  |
| FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP<br>Var. IMA-B 5+ p.p.                     | 0,29<br>-0,03  | 0,25<br>-0,10 | 2,82<br>-0,15 | 6,92<br>-0,32  | 21,46<br>-0,58 | 41,77<br>-1,29  | 56,76<br>-1,73  |
| AZ QUEST ACOES FIC FIA<br>Var. IBOVESPA p.p.                               | -8,29<br>0,14  | -4,78<br>5,14 | 2,39<br>6,14  | 6,09<br>3,09   | 16,76<br>7,78  | 33,08<br>11,03  | 75,24<br>18,97  |
| XP INVESTOR FI DE ACOES<br>Var. IBOVESPA p.p.                              | -5,88<br>2,55  | -2,88<br>7,04 | 6,86<br>10,61 | 15,53<br>12,53 | 34,88<br>25,90 | 58,89<br>36,84  | 103,19<br>46,92 |
| VINCI MOSAICO FUNDO DE INVESTIMENTO DE ACOES<br>Var. IBOVESPA p.p.         | -5,42<br>3,01  | -3,77<br>6,15 | 8,11<br>11,86 | 16,15<br>13,14 | 30,01<br>21,02 | 53,28<br>31,23  | 104,24<br>47,98 |
| ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI<br>Var. IBOVESPA p.p.               | -9,27<br>-0,84 | -7,93<br>1,99 | 1,46<br>5,21  | 4,94<br>1,94   | 20,69<br>11,71 | 47,79<br>25,75  | 88,59<br>32,32  |
| VINCI SELECTION EQUITIES FIA<br>Var. IBOVESPA p.p.                         | -5,96<br>2,47  | -5,59<br>4,33 | 1,68<br>5,43  | 8,02<br>5,02   | 16,91<br>7,92  | 37,95<br>15,91  | 77,13<br>20,86  |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA                                         | -6,19          | 0,07          | 10,90         | 20,59          | 44,87          | 70,86           | 128,55          |

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.                                 | 2,24      | 9,99      | 14,66   | 17,59   | 35,89    | 48,81    | 72,29    |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC                             | -9,79     | -9,96     | -2,64   | 5,05    | 20,11    | 42,38    |          |
| ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA                     | -7,00     | -6,42     | 0,61    | 5,66    | 21,20    | 49,95    | 85,08    |
| Var. IBOVESPA p.p.                                 | 1,43      | 3,50      | 4,36    | 2,66    | 12,22    | 27,91    | 28,81    |
| XP DIVIDENDOS FI DE ACOES                          | -6,89     | -5,54     | 1,35    | 11,32   | 30,22    | 61,78    | 84,29    |
| Var. IBOVESPA p.p.                                 | 1,54      | 4,39      | 5,10    | 8,32    | 21,24    | 39,74    | 28,03    |
| XP LONG SHORT 60 FC FI MULTIMERCADO                | 0,24      | 1,70      | 1,30    | 1,36    | 2,72     | 11,43    | 16,76    |
| % do CDI                                           | 80,42     | 253,47    | 123,64  | 56,67   | 48,73    | 92,66    | 74,86    |
| WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO         | -7,50     | -7,16     | -4,73   | 3,26    | 10,30    | 17,58    | 45,11    |
| % do CDI                                           | -2.554,49 | -1.066,88 | -451,48 | 136,25  | 184,80   | 142,47   | 201,46   |
| SAFRA CONS AMERICANO PB FI ACOES                   | -5,24     | 1,37      | 0,13    | 6,50    | 29,59    |          |          |
| Var. IBOVESPA p.p.                                 | 3,19      | 11,29     | 3,88    | 3,50    | 20,60    |          |          |
| WESTERN ASSET FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES BDR N | -1,97     | 5,27      | 3,61    | 11,67   | 34,04    | 59,10    | 92,09    |
| Var. IBOVESPA p.p.                                 | 6,46      | 15,19     | 7,36    | 8,67    | 25,06    | 37,05    | 35,82    |
| CDI                                                | 0,29      | 0,67      | 1,05    | 2,39    | 5,57     | 12,34    | 22,39    |
| IBOVESPA                                           | -8,43     | -9,92     | -3,75   | 3,00    | 8,98     | 22,05    | 56,27    |
| INPC + 6%                                          | 0,59      | 1,29      | 3,03    | 5,12    | 10,13    | 21,34    | 30,86    |
| IPCA + 6%                                          | 0,67      | 1,39      | 3,06    | 5,19    | 10,22    | 21,38    | 32,23    |

## 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                       | 0,38   | 0,82   | 1,25    | 2,87    | 6,52     | 13,85    | 25,06    |
| IRF-M 1+                      | 0,80   | 1,92   | 2,66    | 6,01    | 14,22    | 27,05    | 45,12    |
| IRF-M TOTAL                   | 0,65   | 1,53   | 2,17    | 4,91    | 11,86    | 22,99    | 39,06    |
| IMA-B 5                       | 0,64   | 1,20   | 2,45    | 5,66    | 12,17    | 23,49    | 37,96    |
| IMA-B 5+                      | 0,32   | 0,35   | 2,96    | 7,23    | 22,04    | 43,07    | 58,49    |
| IMA-B TOTAL                   | 0,45   | 0,71   | 2,73    | 6,54    | 18,00    | 34,65    | 49,27    |
| IMA-C TOTAL                   | 0,63   | 3,18   | 3,59    | 6,91    | 18,59    | 39,02    | 52,96    |
| IMA-GERAL ex-C TOTAL          | 0,44   | 0,95   | 1,87    | 4,36    | 11,07    | 21,89    | 35,44    |
| IMA-GERAL TOTAL               | 0,45   | 1,01   | 1,91    | 4,43    | 11,28    | 22,36    | 35,89    |
| IDKA 2                        | 0,69   | 1,22   | 2,44    | 5,37    | 11,19    | 22,52    | 37,76    |
| IDKA 20                       | -0,09  | -1,46  | 2,43    | 6,69    | 27,19    | 57,08    | 70,16    |
| CDI                           | 0,29   | 0,67   | 1,05    | 2,39    | 5,57     | 12,34    | 22,39    |
| <b>Renda Variável</b>         |        |        |         |         |          |          |          |
| IBOVESPA                      | -8,43  | -9,92  | -3,75   | 3,00    | 8,98     | 22,05    | 56,27    |
| IBRX 100                      | -8,22  | -9,37  | -2,78   | 3,55    | 11,15    | 25,47    | 60,69    |
| IBRX 50                       | -8,66  | -10,38 | -4,50   | 2,05    | 6,61     | 18,16    | 52,61    |
| SMALL CAP                     | -8,27  | -7,86  | 3,80    | 13,95   | 35,70    | 51,63    | 99,83    |
| IFIX                          | -3,69  | -7,31  | 2,54    | 11,56   | 21,74    | 28,23    | 46,08    |
| Índice Consumo - ICON         | -10,00 |        | 0,78    | 4,44    | 34,77    | 34,01    | 67,27    |
| Índice Dividendos - IDIV      | -6,18  | -7,66  | 1,56    | 7,52    | 21,63    | 42,31    | 67,61    |
| <b>Indicadores Econômicos</b> |        |        |         |         |          |          |          |
| IPCA                          | 0,25   | 0,46   | 1,62    | 2,20    | 4,00     | 8,05     | 11,13    |
| INPC                          | 0,17   | 0,36   | 1,58    | 2,12    | 3,92     | 8,02     | 9,97     |
| IGPM                          | -0,04  | 0,44   | 2,54    | 3,54    | 6,84     | 14,98    | 14,49    |
| SELIC                         | 0,29   | 0,67   | 1,05    | 2,39    | 5,57     | 12,34    | 22,41    |
| <b>Meta Atuarial</b>          |        |        |         |         |          |          |          |
| IPCA + 4%                     | 0,53   | 1,09   | 2,59    | 4,20    | 8,15     | 16,85    | 24,92    |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Indexador    | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|--------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|
| IPCA + 5%    | 0,60   | 1,24   | 2,82    | 4,70    | 9,18     | 19,10    | 28,54    |
| IPCA + 5,5%  | 0,63   | 1,32   | 2,94    | 4,95    | 9,70     | 20,24    | 30,38    |
| IPCA + 5,89% | 0,66   | 1,38   | 3,03    | 5,14    | 10,11    | 21,13    | 31,82    |
| IPCA + 6%    | 0,67   | 1,39   | 3,06    | 5,19    | 10,22    | 21,38    | 32,23    |
| INPC + 4%    | 0,45   | 0,99   | 2,55    | 4,13    | 8,06     | 16,81    | 23,63    |
| INPC + 6%    | 0,59   | 1,29   | 3,03    | 5,12    | 10,13    | 21,34    | 30,86    |



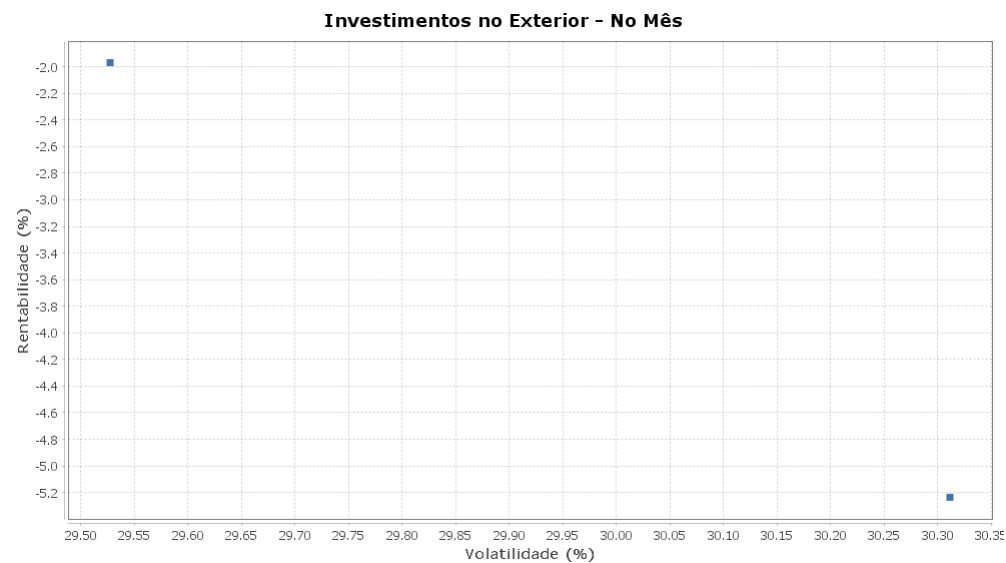
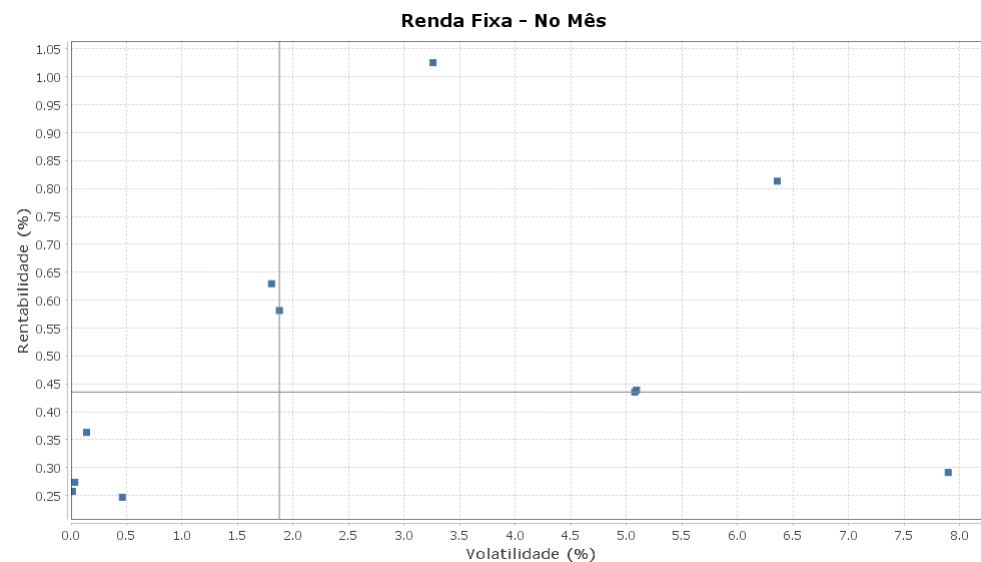
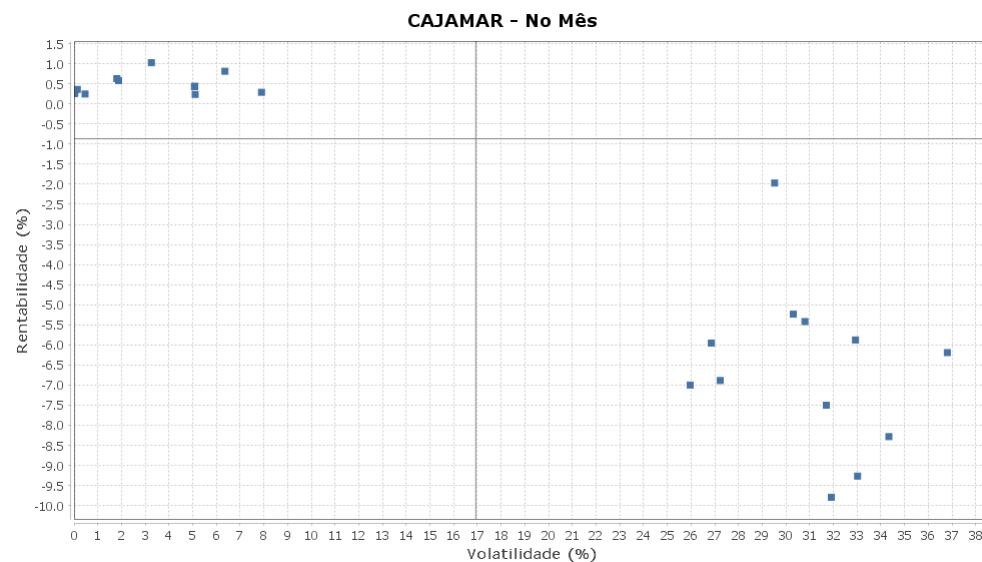
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Movimentações

| Data       | Ativo                                         | Aplicação    | Resgate    | Quantidade         | Valor Cota   |
|------------|-----------------------------------------------|--------------|------------|--------------------|--------------|
| 04/02/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00         | 999.000,00 | 272.503,86928300   | 3,6660030000 |
| 04/02/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00         | 700.000,00 | 190.943,65224600   | 3,6660030000 |
| 05/02/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00         | 20.000,00  | 5.454,60000900     | 3,6666300000 |
| 10/02/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF                 | 72.246,57    | 0,00       | 28.494,38387400    | 2,5354670000 |
| 10/02/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 67.641,26    | 0,00       | 18.440,43297600    | 3,6680950000 |
| 10/02/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00         | 35.000,00  | 9.541,73765200     | 3,6680950000 |
| 10/02/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00         | 72.246,57  | 19.695,93764100    | 3,6680950000 |
| 26/02/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 143.011,02   | 0,00       | 38.927,49672700    | 3,6737790000 |
| 26/02/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 596.460,26   | 0,00       | 162.356,05353500   | 3,6737790000 |
| 28/02/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF                 | 246.744,56   | 0,00       | 97.093,33718400    | 2,5413130000 |
| 28/02/2020 | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 3.909.001,24 | 0,00       | 1.063.732,27589600 | 3,6747980000 |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo                                              | Estratégia              | Volatilidade | VaR  | Rent. | Valor(R\$)    | % Carteira |
|----------------------------------------------------|-------------------------|--------------|------|-------|---------------|------------|
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI      | Artigo 7º IV, Alínea a  | 0,01         | 0,02 | 0,26  | 18.101.935,26 | 5,90       |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP      | Artigo 7º IV, Alínea a  | 0,03         | 0,02 | 0,27  | 12.292.224,53 | 4,01       |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF                      | Artigo 7º I, Alínea b   | 0,14         | 0,03 | 0,36  | 8.397.315,20  | 2,74       |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS  | Artigo 7º I, Alínea b   | 0,46         | 0,06 | 0,25  | 5.213.580,00  | 1,70       |
| FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO           | Artigo 7º I, Alínea b   | 1,80         | 0,22 | 0,63  | 23.157.526,05 | 7,55       |
| ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV           | Artigo 7º VII, Alínea b | 1,88         | 0,23 | 0,58  | 2.124.929,85  | 0,69       |
| WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RENDA FIXA           | Artigo 7º I, Alínea b   | 3,26         | 0,39 | 1,03  | 19.497.414,69 | 6,36       |
| FIC NOVO BRASIL IMAB RF LP                         | Artigo 7º III, Alínea a | 5,07         | 0,55 | 0,44  | 42.285.896,48 | 13,79      |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO            | Artigo 7º I, Alínea b   | 5,09         | 0,55 | 0,44  | 54.222.218,67 | 17,68      |
| XP LONG SHORT 60 FC FI MULTIMERCADO                | Artigo 8º III           | 5,11         | 0,54 | 0,24  | 4.024.784,88  | 1,31       |
| WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA            | Artigo 7º IV, Alínea a  | 6,36         | 0,70 | 0,81  | 17.076.807,09 | 5,57       |
| FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP                   | Artigo 7º I, Alínea b   | 7,90         | 0,83 | 0,29  | 22.563.541,40 | 7,36       |
| ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA                     | Artigo 8º II, Alínea a  | 25,96        | 2,29 | -7,00 | 5.868.939,24  | 1,91       |
| VINCI SELECTION EQUITIES FIA                       | Artigo 8º II, Alínea a  | 26,86        | 2,44 | -5,96 | 3.418.932,65  | 1,11       |
| XP DIVIDENDOS FI DE ACOES                          | Artigo 8º II, Alínea a  | 27,23        | 2,43 | -6,89 | 8.842.973,04  | 2,88       |
| WESTERN ASSET FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES BDR N | Artigo 9º A, III        | 29,53        | 2,95 | -1,97 | 4.586.994,85  | 1,50       |
| SAFRA CONS AMERICANO PB FI ACOES                   | Artigo 9º A, III        | 30,31        | 2,84 | -5,24 | 3.545.053,18  | 1,16       |
| VINCI MOSAICO FUNDO DE INVESTIMENTO DE ACOES       | Artigo 8º II, Alínea a  | 30,80        | 2,88 | -5,42 | 5.830.907,26  | 1,90       |
| WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO         | Artigo 8º III           | 31,70        | 2,85 | -7,50 | 9.033.323,72  | 2,95       |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC                             | Artigo 8º II, Alínea a  | 31,91        | 2,73 | -9,79 | 5.143.814,71  | 1,68       |
| XP INVESTOR FI DE ACOES                            | Artigo 8º II, Alínea a  | 32,93        | 3,08 | -5,88 | 12.380.428,23 | 4,04       |
| ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI             | Artigo 8º II, Alínea a  | 33,02        | 2,88 | -9,27 | 1.576.593,77  | 0,51       |
| AZ QUEST ACOES FIC FIA                             | Artigo 8º II, Alínea a  | 34,34        | 3,08 | -8,29 | 10.603.483,43 | 3,46       |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA                 | Artigo 8º II, Alínea a  | 36,80        | 3,46 | -6,19 | 6.867.687,44  | 2,24       |