



CAJAMAR
JANEIRO 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 14.02.2020.

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 **71,67%**

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	0,25	0,25	53.985.265,49	17,52	6.604.088.892,56	0,82
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,25	0,42	0,42	8.048.919,51	2,61	10.529.932.746,92	0,08
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	1,97	0,54	0,54	23.012.651,80	7,47	9.706.276.068,00	0,24
CEF	CEF	FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP	7,28	-0,04	-0,04	22.497.983,38	7,30	2.270.256.483,13	0,99
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RENDA FIXA	3,15	0,90	0,90	19.299.539,28	6,26	521.981.921,31	3,70
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS	0,83	-0,04	-0,04	5.343.440,00	1,73	262.706.959,14	2,03
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			4,03	0,34	0,34	132.187.799,46	42,91		

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	0,23	0,23	42.102.588,62	13,67	3.029.770.455,34	1,39
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			4,88	0,23	0,23	42.102.588,62	13,67		

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	0,37	0,37	9.380.653,54	3,05	5.345.385.558,02	0,18
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	6,14	0,55	0,55	16.939.062,87	5,50	318.208.107,97	5,32
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,87	0,34	0,34	18.055.419,53	5,86	5.214.674.759,25	0,35
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			2,07	0,44	0,44	44.375.135,94	14,40		

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	1,95	0,95	0,95	2.112.646,35	0,69	533.023.517,39	0,40

Carteira: CAJAMAR

Data Extrato: 31/01/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
VANGUARDA									
		Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b	1,95	0,95	0,95	2.112.646,35	0,69		
		Renda Fixa	3,70	0,34	0,34	220.778.170,37	71,67		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

25,60%

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	18,91	3,82	3,82	11.561.400,63	3,75	1.045.333.627,77	1,11
XP	XP	XP INVESTOR FI DE ACOES	17,82	3,18	3,18	13.153.642,19	4,27	479.111.042,60	2,75
ICATU VANGUARDA	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	14,68	0,62	0,62	6.310.762,30	2,05	2.139.496.712,77	0,29
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	18,34	6,67	6,67	7.321.062,21	2,38	1.587.200.613,63	0,46
XP	XP	XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	16,60	1,45	1,45	9.496.957,16	3,08	393.256.206,91	2,41
VINCI	BEM	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	15,48	0,39	0,39	3.635.472,52	1,18	428.943.748,02	0,85
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	16,69	-0,19	-0,19	5.702.203,73	1,85	4.585.787.416,19	0,12
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	17,86	1,47	1,47	1.737.601,67	0,56	2.499.126.681,70	0,07
VINCI	BEM	VINCI MOSAICO FUNDO DE INVESTIMENTO DE ACOES	16,51	1,74	1,74	6.165.026,48	2,00	1.472.219.660,53	0,42
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			16,68	2,52	2,52	65.084.128,89	21,13		

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	12,58	0,37	0,37	9.766.095,72	3,17	848.907.600,44	1,15
XP	BNY MELLON	XP LONG SHORT 60 FC FI MULTIMERCADO	4,78	1,46	1,46	4.015.300,41	1,30	235.913.976,01	1,70
Sub-total Artigo 8º III			8,73	0,66	0,66	13.781.396,13	4,47		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			14,23	2,23	2,23	78.865.525,02	25,60		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,73%

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
BANCO J SAFRA SA	BANCO J SAFRA SA	SAFRA CONS AMERICANO PB FI ACOES	12,24	6,97	6,97	3.740.903,89	1,21	768.827.860,05	0,49
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES BDR N	13,46	7,39	7,39	4.679.173,67	1,52	394.442.395,30	1,19
Sub-total Artigo 9º A, III			13,03	7,20	7,20	8.420.077,56	2,73		
Investimentos no Exterior			13,03	7,20	7,20	8.420.077,56	2,73		
Total						308.063.772,95	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	132.187.799,46	42,91	0,00	45,00	100,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	42.102.588,62	13,67	0,00	14,00	60,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	44.375.135,94	14,40	0,00	14,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	2.112.646,35	0,69	0,00	1,00	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	220.778.170,37	71,67				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	65.084.128,89	21,13	0,00	19,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	13.781.396,13	4,47	0,00	5,00	10,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	78.865.525,02	25,60				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	8.420.077,56	2,73	0,00	2,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	8.420.077,56	2,73				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

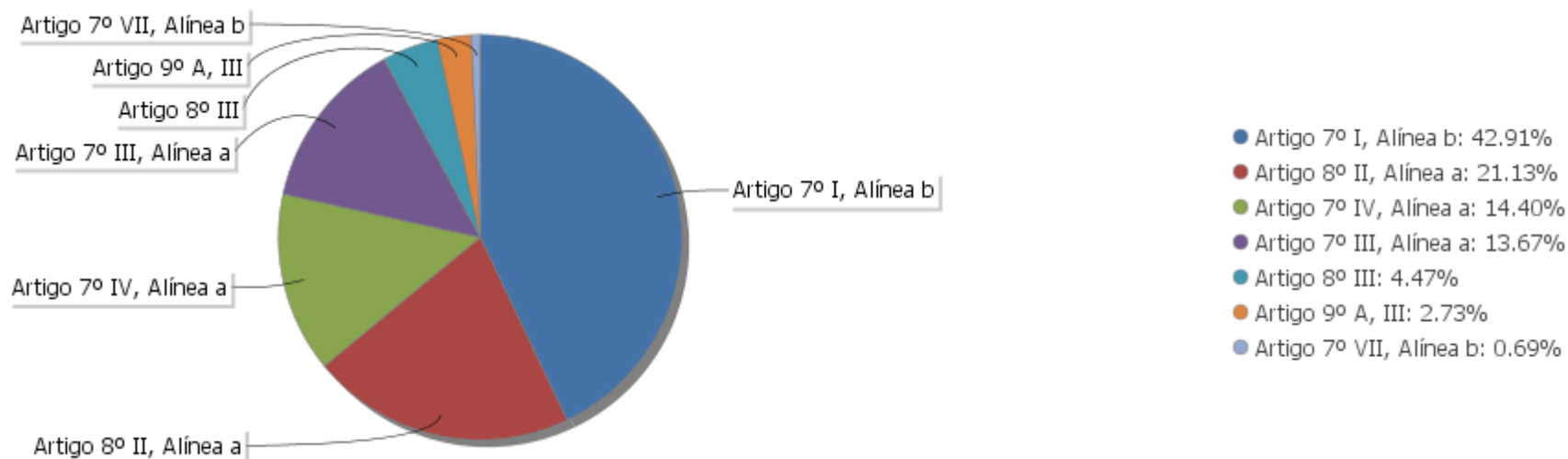
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,34 91,24	0,34 91,24	0,10 8,74	5,23 200,96	15,82 273,56	450.303,20	450.303,20
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,23 60,93	0,23 60,93	-0,36 -31,74	5,45 209,34	17,66 305,34	96.393,15	96.393,15
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,44 116,32	0,44 116,32	0,31 27,44	4,20 161,41	9,74 168,45	171.483,94	171.483,94
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,95 252,03	0,95 252,03	1,25 110,37	4,54 174,50		19.864,40	19.864,40
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	2,52 4,15	2,52 4,15	14,00 7,90	21,55 9,82	33,21 16,40	1.597.546,48	1.597.546,48
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	0,66 2,29	0,66 2,29	5,05 -1,05	7,32 -4,42	16,37 -0,44	70.357,83	70.357,83
Artigo 9º A, III % do CDI	7,20 1.911,70	7,20 1.911,70	13,87 1.220,60	20,77 797,65	42,78 739,56	565.521,43	565.521,43
						2.971.470,43	2.971.470,43

Análise de Liquidez

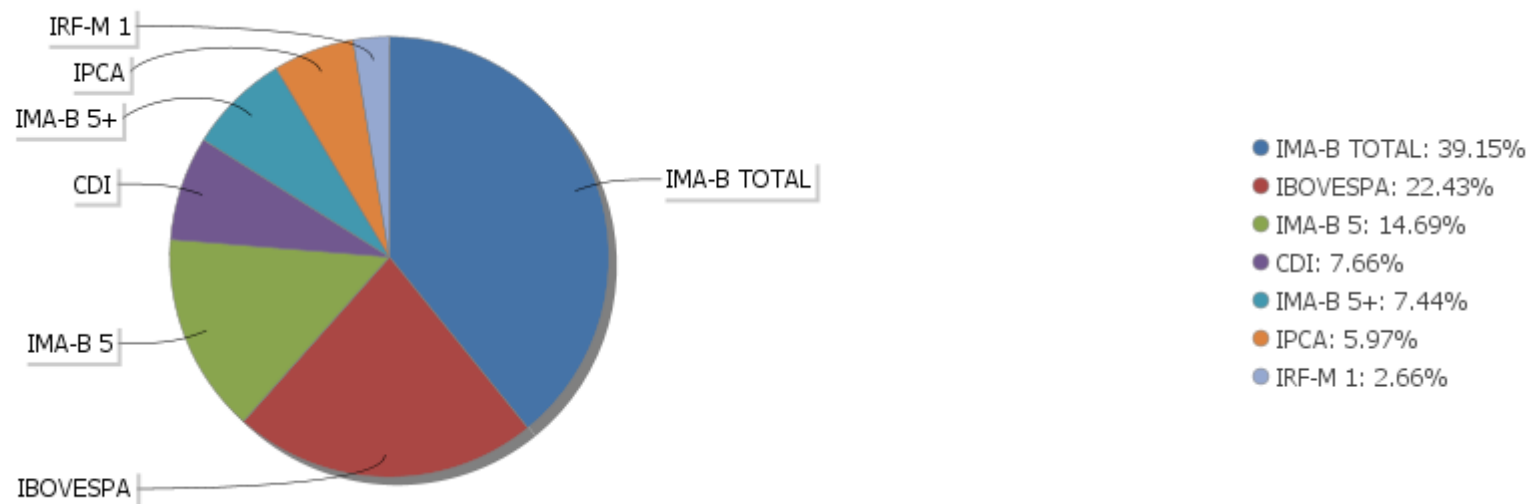
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	283.202.329,81	91,93	283.202.329,81	91,93
de 31 a 364 dias	24.861.443,14	8,07	308.063.772,95	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	308.063.772,95	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

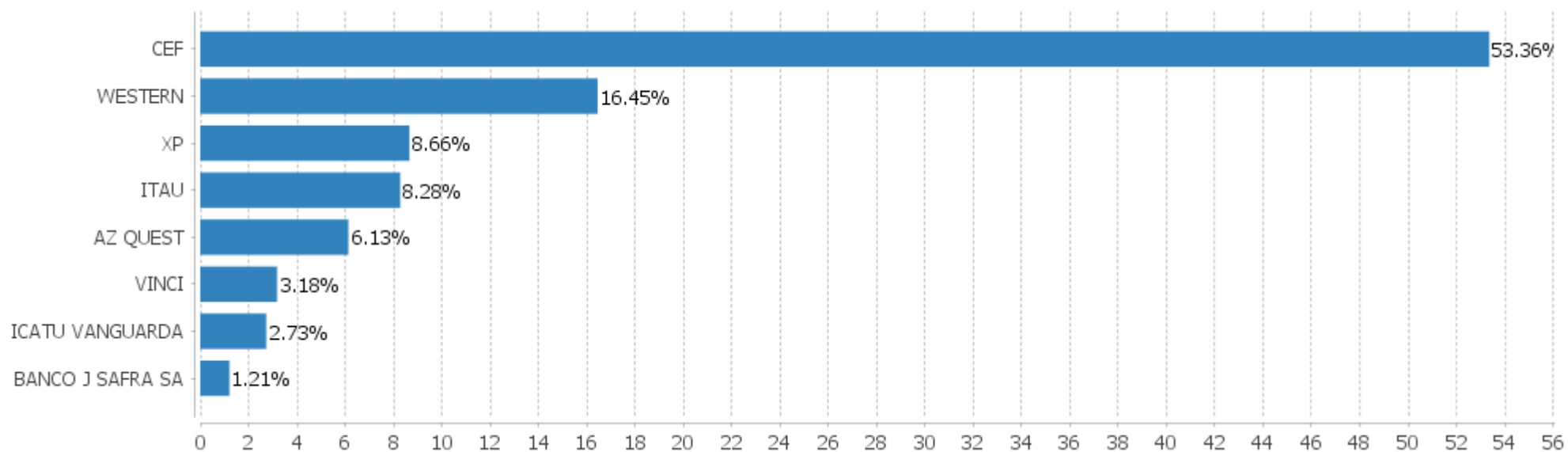


Alocação Por Estratégia



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												1,00
IPCA + 5,87%	0,71												0,71
p.p. indexador	0,29												0,29
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

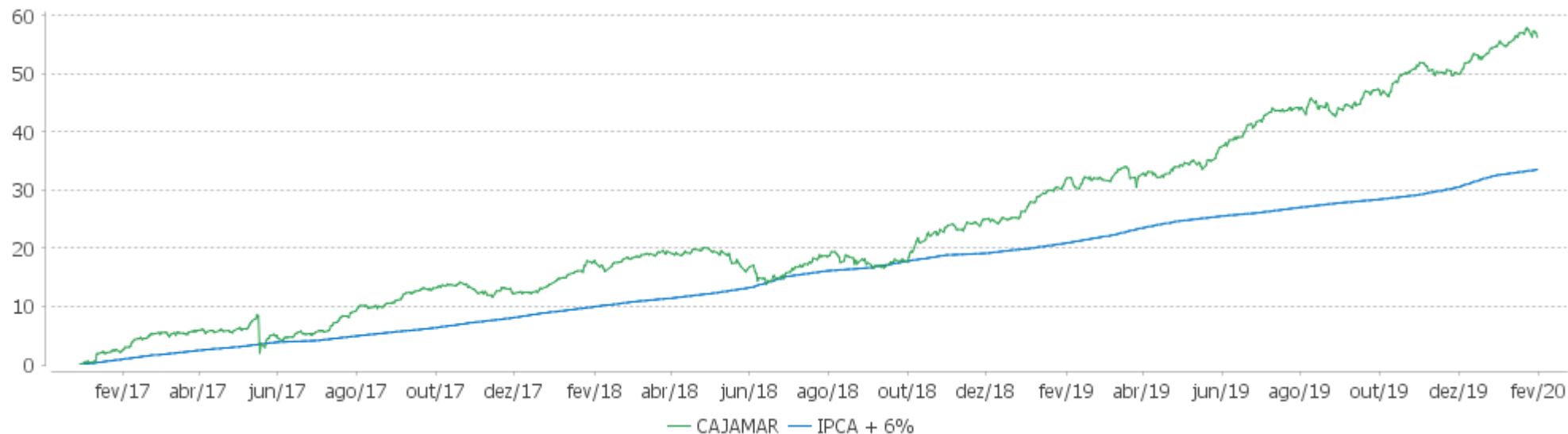
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

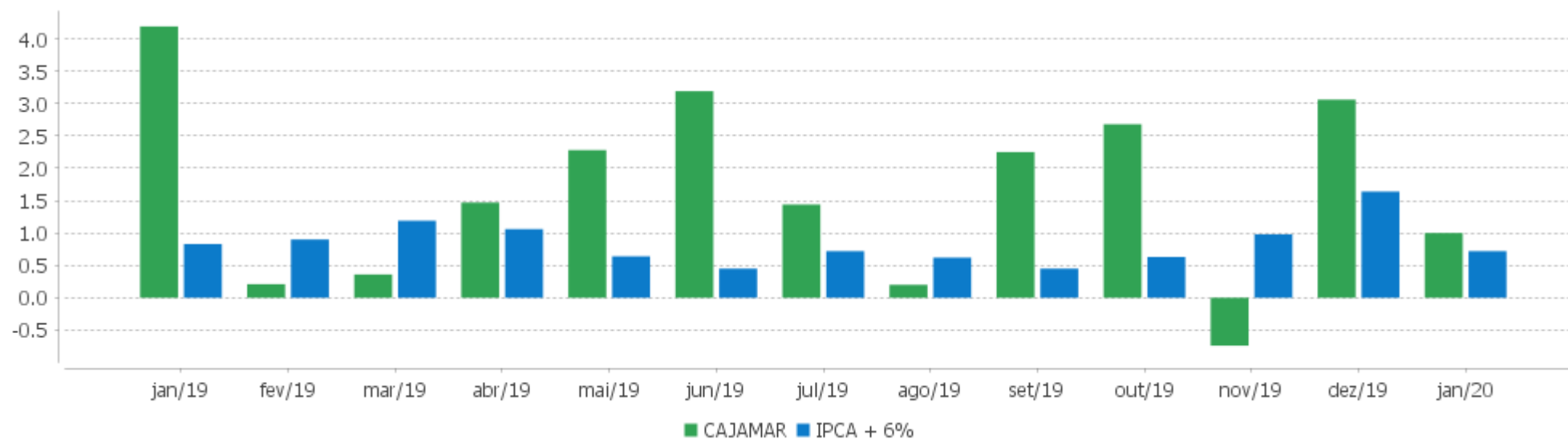
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	22	59,46	03 meses	3,32	3,36	-0,05	4,72
Meses abaixo da Meta Atuarial	15	40,54	06 meses	8,69	5,13	3,56	5,20
			12 meses	18,74	10,46	8,29	5,19
			24 meses	32,86	21,45	11,41	5,27
			36 meses	52,80	32,32	20,48	6,02
			Desde 30/12/2016	56,27	33,50	22,77	6,00
	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 Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FIC NOVO BRASIL IMAB RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,23 -0,03	0,23 -0,03	-0,36 -0,12	5,45 -0,19	17,66 -0,45	34,19 -0,59	52,87 -1,45
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV Var. IMA-B 5 p.p.	0,95 0,39	0,95 0,39	1,25 -0,26	4,54 -0,49	11,45 -0,61	23,39 0,03	40,92 1,80
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,25 -0,01	0,25 -0,01	-0,36 -0,12	5,44 -0,20	17,72 -0,40	34,14 -0,64	53,25 -1,07
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RENDA FIXA Var. IMA-B 5 p.p.	0,90 0,35	0,90 0,35	1,29 -0,22	5,76 0,72	14,49 2,43	28,70 5,33	46,99 7,86
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B 5 p.p.	0,54 -0,01	0,54 -0,01	1,41 -0,10	4,89 -0,15	11,76 -0,30	22,83 -0,53	38,27 -0,85
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,04 -0,30	-0,04 -0,30	1,62 1,86	3,32 -2,32	7,48 -10,64	17,26 -17,52	25,82 -28,50
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,42 -0,02	0,42 -0,02	1,14 -0,05	2,93 -0,11	6,40 -0,22	13,64 -0,40	25,20 -0,64
FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,04 -0,07	-0,04 -0,07	-1,75 -0,21	5,77 -0,31	21,74 -0,59	42,13 -1,28	64,08 -1,90
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,55 0,29	0,55 0,29	-0,49 -0,25	6,18 0,54	20,45 2,34	39,96 5,17	61,21 6,90
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,37 98,46	0,37 98,46	1,03 91,06	2,44 93,73	5,55 95,93	12,08 96,40	22,61 97,91
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,34 0,13	0,34 0,13	1,04 -0,84	2,66 0,60	9,69 5,50	19,74 11,62	34,32 23,11
AZ QUEST ACOES FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,82 5,45	3,82 5,45	10,95 4,85	16,92 5,18	24,29 7,48	47,97 14,00	95,18 19,27
XP INVESTOR FI DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	3,18 4,81	3,18 4,81	17,70 11,60	24,85 13,12	41,22 24,41	72,27 38,29	122,77 46,86
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	1,47 3,10	1,47 3,10	15,18 9,08	17,48 5,75	31,03 14,23	65,96 31,99	116,32 40,41
VINCI MOSAICO FUNDO DE INVESTIMENTO DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	1,74 3,37	1,74 3,37	17,13 11,03	24,40 12,66	33,90 17,09	64,36 30,39	125,38 49,47
VINCI SELECTION EQUITIES FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,39 2,02	0,39 2,02	9,62 3,52	14,98 3,24	21,98 5,18	48,28 14,30	94,38 18,47
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	6,67	6,67	23,12	31,03	49,98	84,85	157,08

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.	8,30	8,30	17,02	19,29	33,18	50,87	81,17
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-0,19	-0,19	9,98	18,27	31,46	59,14	
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	0,62	0,62	8,68	15,29	27,77	60,37	104,20
Var. IBOVESPA p.p.	2,25	2,25	2,58	3,55	10,96	26,40	28,29
XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	1,45	1,45	12,13	24,42	37,43	72,51	107,10
Var. IBOVESPA p.p.	3,08	3,08	6,03	12,69	20,63	38,53	31,19
XP LONG SHORT 60 FC FI MULTIMERCADO	1,46	1,46	1,28	1,91	3,74	13,03	16,73
% do CDI	388,27	388,27	112,33	73,44	64,71	103,94	72,48
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	0,37	0,37	6,95	10,06	23,30	22,94	64,36
% do CDI	97,48	97,48	611,37	386,20	402,85	183,05	278,76
SAFRA CONS AMERICANO PB FI ACOES	6,97	6,97	12,58	18,97	44,46		
Var. IBOVESPA p.p.	8,60	8,60	6,48	7,24	27,66		
WESTERN ASSET FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES BDR N	7,39	7,39	14,86	21,68	43,86	57,71	100,57
Var. IBOVESPA p.p.	9,02	9,02	8,76	9,95	27,05	23,74	24,66
CDI	0,38	0,38	1,14	2,60	5,78	12,53	23,09
IBOVESPA	-1,63	-1,63	6,10	11,74	16,80	33,97	75,91
INPC + 6%	0,70	0,70	3,46	5,16	10,59	21,35	30,95
IPCA + 6%	0,72	0,72	3,37	5,14	10,47	21,46	32,33

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	0,44	0,44	1,20	3,05	6,61	14,04	25,84
IRF-M 1+	1,11	1,11	0,99	5,27	13,57	27,70	47,38
IRF-M TOTAL	0,88	0,88	1,04	4,50	11,47	23,54	40,94
IMA-B 5	0,56	0,56	1,51	5,04	12,06	23,36	39,12
IMA-B 5+	0,03	0,03	-1,54	6,07	22,33	43,41	65,98
IMA-B TOTAL	0,26	0,26	-0,24	5,64	18,11	34,79	54,32
IMA-C TOTAL	2,54	2,54	1,76	6,14	20,05	38,88	56,63
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,50	0,50	0,70	4,08	11,07	22,22	37,86
IMA-GERAL TOTAL	0,56	0,56	0,73	4,13	11,32	22,68	38,34
IDKA 2	0,54	0,54	1,76	4,74	11,02	22,45	38,67
IDKA 20	-1,37	-1,37	-3,65	5,34	28,11	57,81	85,76
CDI	0,38	0,38	1,14	2,60	5,78	12,53	23,09
Renda Variável							
IBOVESPA	-1,63	-1,63	6,10	11,74	16,80	33,97	75,91
IBRX 100	-1,25	-1,25	6,95	12,64	18,97	37,28	80,87
IBRX 50	-1,88	-1,88	5,44	10,57	14,75	29,92	71,82
SMALL CAP	0,45	0,45	18,98	24,82	45,25	64,69	130,34
IFIX	-3,76	-3,76	10,22	15,71	27,70	34,66	59,06
Índice Consumo - ICON			15,32	21,23	43,29	43,57	87,57
Índice Dividendos - IDIV	-1,58	-1,58	10,79	17,15	27,01	50,76	91,15
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,21	0,21	1,88	2,05	4,19	8,13	11,21
INPC	0,19	0,19	1,96	2,07	4,30	8,03	10,05
IGPM	0,48	0,48	2,89	2,88	7,82	15,10	14,63
SELIC	0,38	0,38	1,14	2,60	5,78	12,54	23,11
Meta Atuarial							
IPCA + 4%	0,55	0,55	2,88	4,12	8,38	16,93	25,02

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IPCA + 5%	0,64	0,64	3,13	4,63	9,42	19,19	28,64
IPCA + 5,5%	0,68	0,68	3,25	4,89	9,95	20,32	30,48
IPCA + 5,89%	0,71	0,71	3,35	5,09	10,35	21,21	31,93
IPCA + 6%	0,72	0,72	3,37	5,14	10,47	21,46	32,33
INPC + 4%	0,53	0,53	2,96	4,14	8,49	16,82	23,71
INPC + 6%	0,70	0,70	3,46	5,16	10,59	21,35	30,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

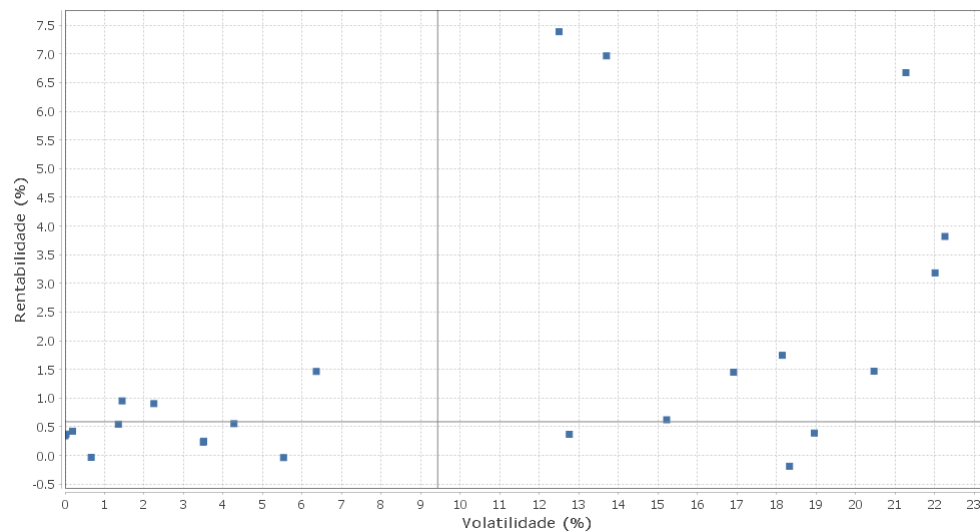
Movimentações

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
02/01/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.540.000,00	421.705,10773700	3,6518410000
09/01/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	38.000,00	10.396,39538800	3,6551130000
17/01/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	150.546,94	0,00	41.146,62435000	3,6587920000
17/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,00	150.546,94	59.560,86684600	2,5276149997
22/01/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.777.832,45	0,00	758.866,32246900	3,6605030000
22/01/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.000.000,00	273.186,49897200	3,6605030000
24/01/2020	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	1.000.000,00	0,00	280.575,30057470	3,5641056000
31/01/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.076.224,65	0,00	1.112.275,71184000	3,6647610000
31/01/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	566.644,17	154.619,67895500	3,6647610000
31/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	566.644,17	0,00	223.782,95219600	2,5321150000
31/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	192.736,41	0,00	76.116,76799800	2,5321150000

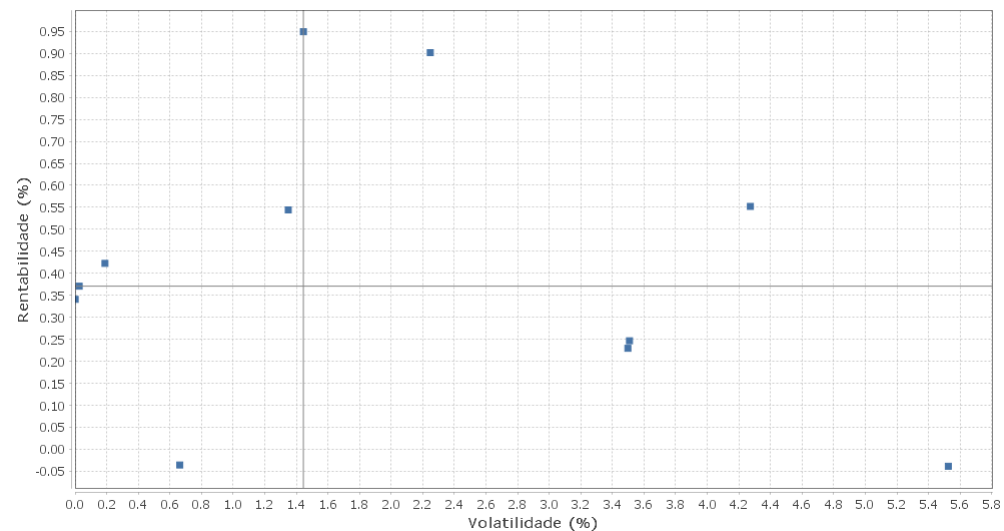
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

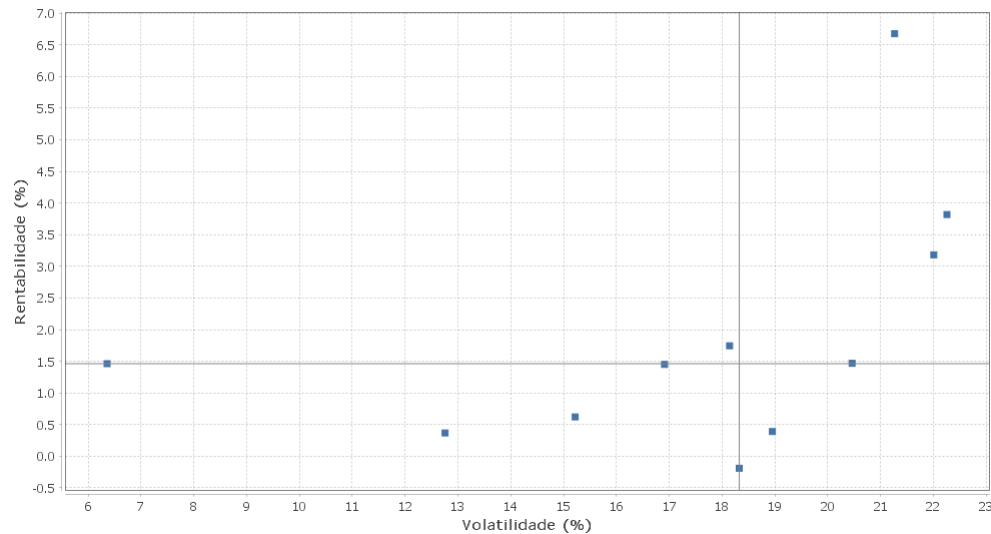
CAJAMAR - No Mês



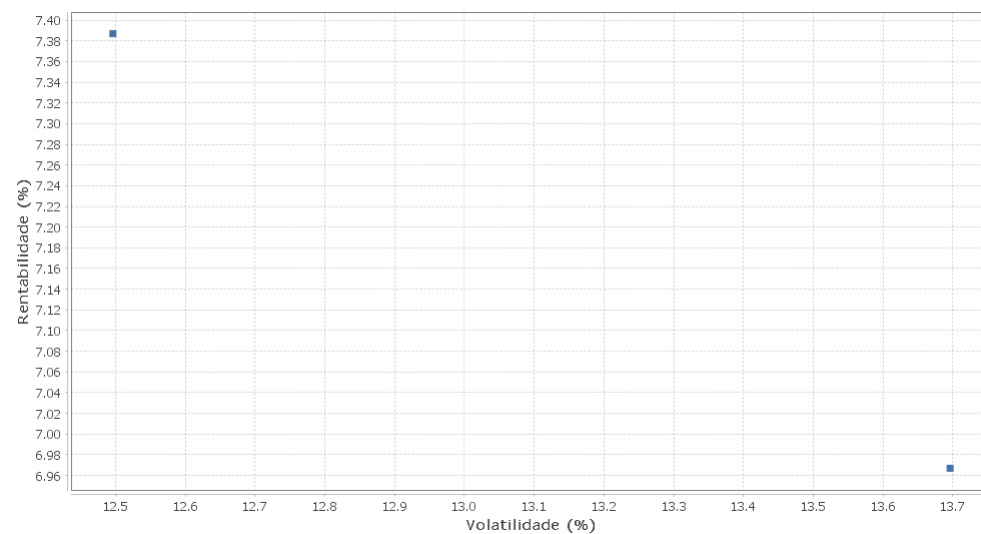
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,02	0,34	18.055.419,53	5,86
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,02	0,37	9.380.653,54	3,05
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,19	0,04	0,42	8.048.919,51	2,61
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS	Artigo 7º I, Alínea b	0,66	0,07	-0,04	5.343.440,00	1,73
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	1,35	0,16	0,54	23.012.651,80	7,47
ICATU VANGUARDA FI RF INFLACAO CRED PRIV	Artigo 7º VII, Alínea b	1,44	0,19	0,95	2.112.646,35	0,69
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	2,25	0,27	0,90	19.299.539,28	6,26
FIC NOVO BRASIL IMAB RF LP	Artigo 7º III, Alínea a	3,50	0,37	0,23	42.102.588,62	13,67
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	3,51	0,37	0,25	53.985.265,49	17,52
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	Artigo 7º IV, Alínea a	4,27	0,47	0,55	16.939.062,87	5,50
FI CAIXA BR IMAB 5 MAIS TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,53	0,57	-0,04	22.497.983,38	7,30
XP LONG SHORT 60 FC FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	6,36	0,72	1,46	4.015.300,41	1,30
WESTERN ASSET FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES BDR N	Artigo 9º A, III	12,50	1,62	7,39	4.679.173,67	1,52
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	12,76	1,34	0,37	9.766.095,72	3,17
SAFRA CONS AMERICANO PB FI ACOES	Artigo 9º A, III	13,70	1,73	6,97	3.740.903,89	1,21
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	15,22	1,61	0,62	6.310.762,30	2,05
XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	16,91	1,82	1,45	9.496.957,16	3,08
VINCI MOSAICO FUNDO DE INVESTIMENTO DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	18,14	1,96	1,74	6.165.026,48	2,00
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	18,33	1,89	-0,19	5.702.203,73	1,85
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	Artigo 8º II, Alínea a	18,95	1,98	0,39	3.635.472,52	1,18
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	20,46	2,19	1,47	1.737.601,67	0,56
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	21,27	2,50	6,67	7.321.062,21	2,38
XP INVESTOR FI DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	22,01	2,42	3,18	13.153.642,19	4,27
AZ QUEST ACOES FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	22,26	2,48	3,82	11.561.400,63	3,75

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

-Referente ao desenquadramento legal apontado no Artigo 8º, Inciso II, Alínea A, vale observar que:

- No mês de novembro de 2019, a alocação no referido Artigo já estava acima dos limites permitidos pela Resolução nº 3.922;
- Atentar ao prazo de 180 dias para readequação conforme estipulado no Artigo 22 da Resolução nº 3.922.

-Com relação a Política de Investimentos observar a superação do limite máximo estipulado.