



**LDB**  
EMPRESAS

**CAMPO MOURÃO**  
DEZEMBRO 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 21.01.2021.

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

RENDA FIXA 69,66%

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
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,57	0,31	3,47	5.140.289,89	3,19	8.522.749.810,66	0,06
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,80	4,84	6,06	5.948.659,34	3,70	6.193.173.925,17	0,10
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,55	0,28	3,63	5.055.079,64	3,14	16.753.976.831,37	0,03
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,02	1,82	7,75	11.925.729,43	7,41	20.761.505.098,56	0,06
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,20	1,53	7,92	13.584.500,75	8,44	8.476.640.994,51	0,16
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,13	1,65	8,03	7.379.730,64	4,58	10.655.087.063,09	0,07
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,99	1,81	7,78	13.957.955,92	8,67	4.987.516.426,31	0,28
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,95	1,32	6,66	24.650.813,52	15,31	14.722.139.597,34	0,17
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>4,88</b>	<b>1,62</b>	<b>6,76</b>	<b>87.642.759,13</b>	<b>54,44</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
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,66	0,20	2,86	3.095.555,31	1,92	3.882.685.363,65	0,08
BRAM	BRDESCO	BRDESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	6,91	2,48	4,66	19.601.282,43	12,18	1.422.915.185,87	1,38
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>5,95</b>	<b>2,16</b>	<b>4,41</b>	<b>22.696.837,74</b>	<b>14,10</b>		

Artigo 7º VII, Alínea a (Cota Sênior de FIDC)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
AURORA	CM CAPITAL	FIDC GGR PRIME I	14,82	3,79	0,54	1.797.278,22	1,12	155.949.732,16	1,15
<b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a</b>			<b>14,82</b>	<b>3,79</b>	<b>0,54</b>	<b>1.797.278,22</b>	<b>1,12</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>4,98</b>	<b>1,76</b>	<b>6,24</b>	<b>112.136.875,09</b>	<b>69,66</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

29,06%

## 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
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	44,35	7,90	-3,67	2.624.788,59	1,63	831.343.765,94	0,32
CONSTÂNCIA	BEM	CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA	42,43	7,12	-7,00	1.497.242,48	0,93	315.811.586,46	0,47
BRAM	BRADESCO	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	44,30	9,43	4,62	4.041.606,08	2,51	258.434.424,73	1,56
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	52,63	7,97	-21,23	1.256.648,37	0,78	1.462.115.658,32	0,09
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	42,17	10,72	5,98	7.295.909,97	4,53	1.169.052.019,30	0,62
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	42,32	6,49	2,72	7.292.726,05	4,53	302.121.773,94	2,41
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>43,04</b>	<b>8,58</b>	<b>0,06</b>	<b>24.008.921,54</b>	<b>14,91</b>		

## Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	7,86	0,72	2,52	0,00	0,00	4.935.289.077,51	0,00
CEF	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	33,34	1,88	1,88	15.562.048,59	9,67	672.183.314,73	2,32
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>8,18</b>	<b>1,94</b>	<b>3,76</b>	<b>15.562.048,59</b>	<b>9,67</b>		

## Artigo 8º IV, Alínea a (Fundos de Participações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
A5	PLANNER	W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	0,60	-0,19	-2,07	3.104.144,63	1,93	134.598.706,26	2,31
LEGATUS	DAYCOVAL	FIP LA SHOPPING CENTERS	9,27	-0,18	7,80	2.527.624,90	1,57	243.530.060,71	1,04
<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a</b>			<b>4,09</b>	<b>-0,19</b>	<b>2,13</b>	<b>5.631.769,53</b>	<b>3,50</b>		

## Artigo 8º IV, Alínea b (Fundos de Investimentos Imobiliários)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
PLANNER	PLANNER	CARE11	49,86	-11,39	-45,74	1.580.644,10	0,98	249.224.558,74	0,63
<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b</b>			<b>49,86</b>	<b>-11,39</b>	<b>-45,74</b>	<b>1.580.644,10</b>	<b>0,98</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável e Investimentos Estruturados	22,14	5,02	-2,82	46.783.383,76	29,06
---	-------	------	-------	---------------	-------

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,28%

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
CEF	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	29,55	2,95	2,95	2.059.016,03	1,28	1.987.917.698,76	0,10
<b>Sub-total Artigo 9º A, III</b>			<b>29,55</b>	<b>2,95</b>	<b>2,95</b>	<b>2.059.016,03</b>	<b>1,28</b>		
Investimentos no Exterior			16,54	2,95	2,95	2.059.016,03	1,28		
Total			8,35	2,64	4,25	160.979.274,88	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			
				Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>							
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	87.642.759,13	54,44	20,00	30,00	90,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	22.696.837,74	14,10	10,00	30,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	1.797.278,22	1,12	0,00	0,00	5,00	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>112.136.875,09</b>	<b>69,66</b>				100,00
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	24.008.921,54	14,91	7,00	12,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	15.562.048,59	9,67	7,00	8,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	5.631.769,53	3,50	0,00	4,30	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.580.644,10	0,98	0,00	2,70	5,00	5,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>46.783.383,76</b>	<b>29,06</b>				30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	2.059.016,03	1,28	0,00	0,00	5,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>2.059.016,03</b>	<b>1,28</b>				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	1,62 982,09	6,76 244,96	2,79 592,47	3,62 367,51	6,76 244,96	1.414.723,75	5.679.265,31
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	2,16 1.315,30	4,41 160,07	2,63 556,67	2,52 255,72	4,41 160,07	480.548,30	881.638,46
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	3,79 2.302,67	0,54 19,68	3,96 838,89	4,34 439,89	0,54 19,68	65.575,75	24.394,49
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,58 -0,71	0,06 -2,86	24,39 -1,42	23,52 -1,69	0,06 -2,86	1.845.246,72	574.774,74
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	1,94 -7,36	3,76 0,84	4,47 -21,33	4,84 -20,37	3,76 0,84	416.592,75	654.841,33
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,19 -9,48	2,13 -0,79	-0,55 -26,36	3,00 -22,21	2,13 -0,79	-10.480,35	117.322,48
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-11,39 -20,69	-45,74 -48,65	-10,26 -36,06	-1,41 -26,62	-45,74 -48,65	-203.225,67	-1.332.257,17
Artigo 9º A, III % do CDI	2,95 2.632,36	2,95 2.632,36				59.016,03	59.016,03
<b>CAMPO MOURÃO (Total)</b>						<b>4.067.997,28</b>	<b>6.658.995,67</b>

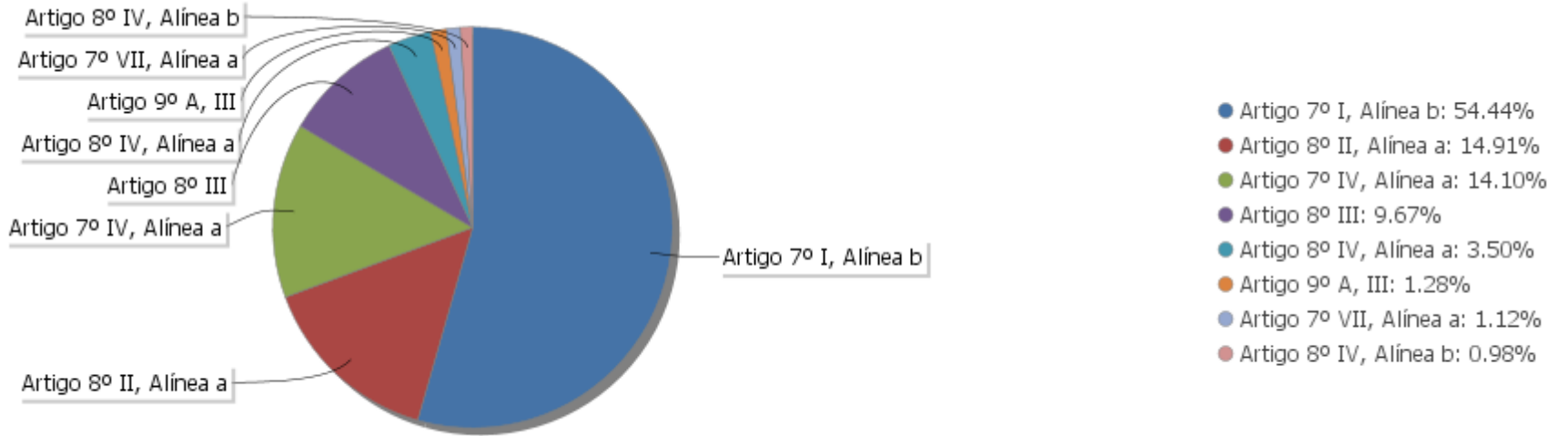
## Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	146.254.317,16	90,85	146.254.317,16	90,85
de 31 a 364 dias	7.295.909,97	4,53	153.550.227,13	95,39
acima de 365 dias	7.429.047,75	4,61	160.979.274,88	100,00

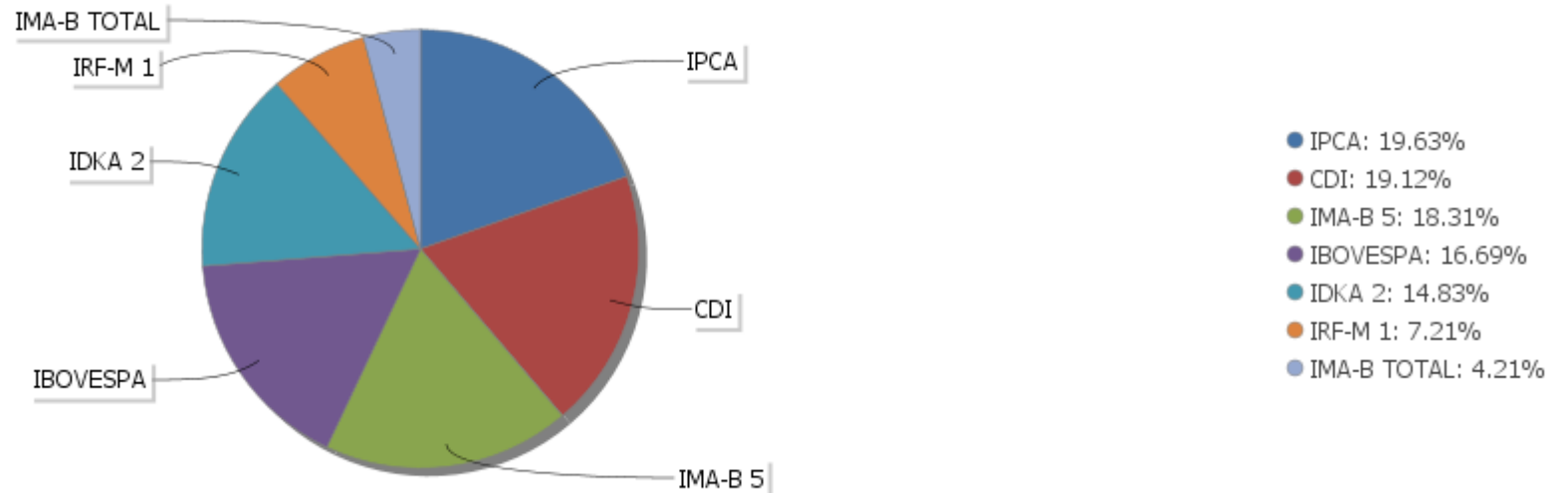


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

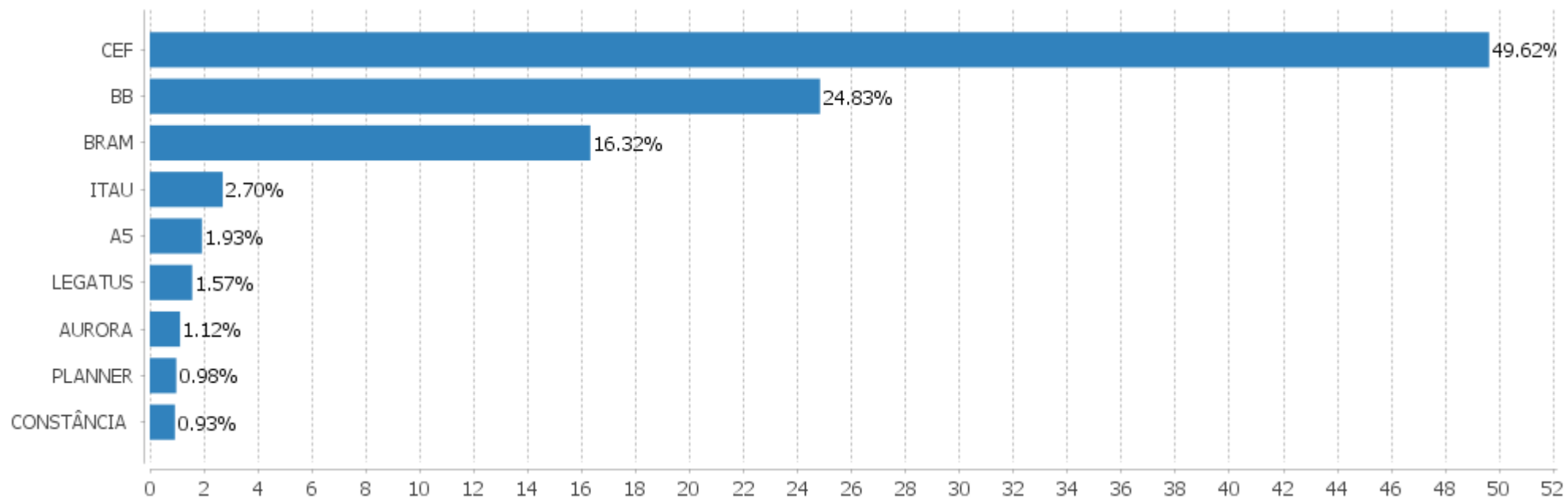


Alocação Por Estratégia



## 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	0,13	-0,88	-5,49	1,11	1,81	1,72	2,31	-0,61	-1,04	0,13	2,62	2,64	4,25
IPCA + 5,88%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,64
p.p. indexador	-0,58	-1,54	-6,06	0,97	1,74	0,98	1,43	-1,33	-2,16	-1,21	1,27	0,79	-6,39

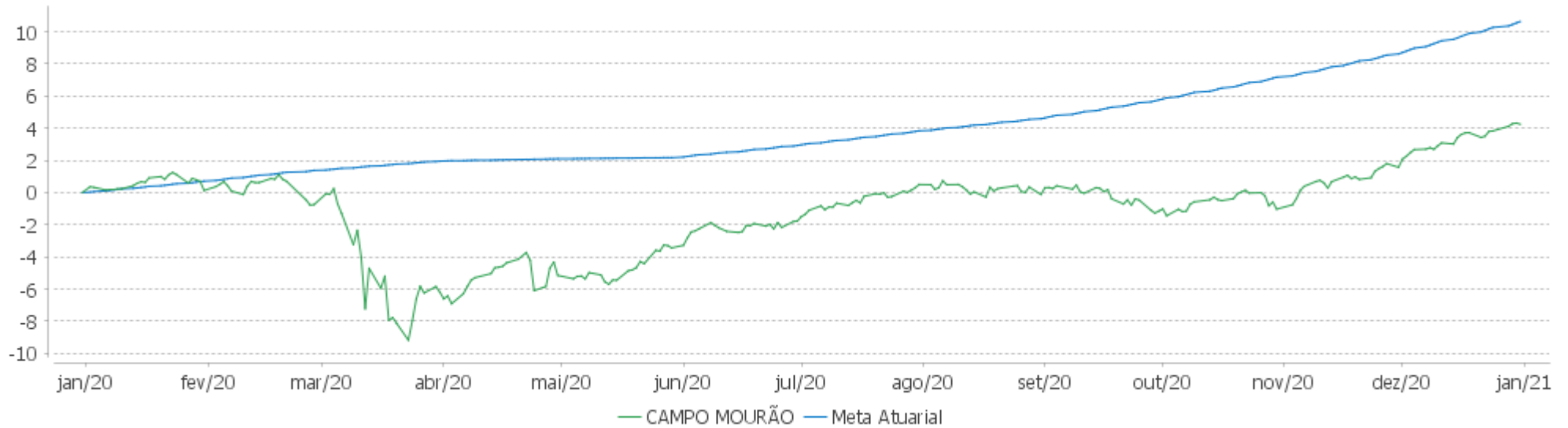
**PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL**

**RELATÓRIO TRIMESTRAL**

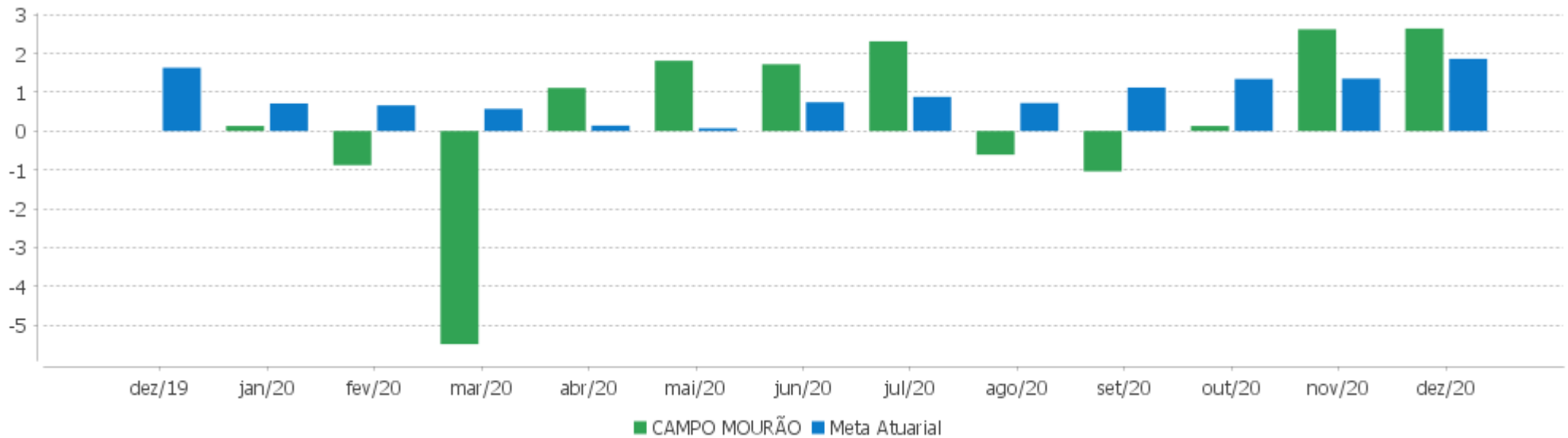
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	6	50,00	03 meses	5,46	4,62	0,85	3,69
Meses abaixo da Meta Atuarial	6	50,00	06 meses	6,13	7,49	-1,36	3,93
			12 meses	4,25	10,64	-6,39	8,35
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,64	2020-12					
Menor rentabilidade da Carteira	-5,49	2020-03	Desde 31/12/2019	4,25	10,64	-6,39	8,35

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.	4,84 -0,01	6,06 -0,34	7,13 -0,04	8,09 -0,12	6,06 -0,34	30,02 -0,81	46,71 -1,20
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,82 -0,01	7,75 -0,29	3,32 -0,06	4,57 -0,15	7,75 -0,29	21,60 -0,65	33,35 -0,96
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,53 -0,21	7,92 -0,70	3,22 0,18	4,89 -0,21	7,92 -0,70	20,01 -1,46	31,07 -2,24
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	1,32 -0,03	6,66 2,15	2,04 -1,09	1,95 -2,47	6,66 2,15	24,19 15,17	33,90 20,80
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,31 0,00	3,47 -0,37	0,63 -0,08	0,99 -0,22	3,47 -0,37	10,19 -0,67	17,63 -0,96
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,65 -0,08	8,03 -0,59	3,05 0,00	4,76 -0,34	8,03 -0,59	20,12 -1,34	31,29 -2,02
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,81 -0,02	7,78 -0,26	3,34 -0,05	4,56 -0,16	7,78 -0,26	21,67 -0,58	33,42 -0,90
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,28 -0,03	3,63 -0,21	0,64 -0,06	1,12 -0,09	3,63 -0,21	10,42 -0,44	17,94 -0,66
FIDC GGR PRIME I % do CDI	3,79 2.302,67	0,54 19,68	3,96 838,89	4,34 439,89	0,54 19,68	-9,39 -105,71	-24,23 -152,65
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,20 -1,15	2,86 -1,66	0,38 -2,75	0,58 -3,83	2,86 -1,66	15,12 6,10	24,58 11,47
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA % do CDI	2,48 1.507,89	4,66 169,05	3,00 635,07	2,83 287,33	4,66 169,05	17,68 199,00	28,85 181,77
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA % do CDI	-0,19 -115,82	-2,07 -75,06	-0,53 -113,27	-1,12 -113,45	-2,07 -75,06	-4,00 -45,02	6,36 40,05
FIP LA SHOPPING CENTERS % do CDI	-0,18 -109,43	7,80 282,91	-0,57 -121,27	-1,02 -103,03	7,80 282,91	20,42 229,89	78,97 497,46
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE Var. IBOVESPA p.p.	6,49 -2,81	2,72 -0,20	19,96 -5,85	19,14 -6,06	2,72 -0,20		
BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	9,43	4,62	24,11	25,02	4,62	39,96	69,09
BRADESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	7,90 -1,39	-3,67 -6,59	20,63 -5,17	27,64 2,43	-3,67 -6,59	22,88 -12,54	54,93 -0,85
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	7,97 -1,33	-21,23 -24,15	17,87 -7,94	10,19 -15,02	-21,23 -24,15	10,15 -25,27	38,81 -16,97

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA Var. IBOVESPA p.p.	7,12 -2,18	-7,00 -9,92	20,98 -4,82	15,84 -9,37	-7,00 -9,92	25,62 -9,80	51,04 -4,74
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	10,72 1,42	5,98 3,06	32,39 6,59	29,35 4,14	5,98 3,06	49,89 14,47	
CARE11 Var. IBOVESPA p.p.	-11,39 -20,69	-45,74 -48,65	-10,26 -36,06	-1,41 -26,62	-45,74 -48,65	-59,30 -94,72	-68,18 -123,96
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP % do CDI	1,70 1.034,09	3,52 127,49	4,23 897,66	4,60 465,96	3,52 127,49	22,23 250,32	33,68 212,20
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3,14	11,19	11,27	19,33	11,19	46,52	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	0,69 -8,60	54,76 51,85	1,31 -24,49	16,49 -8,72	54,76 51,85	108,09 72,67	129,28 73,50
CAMPO MOURÃO Var. IPCA + 5,88% p.p.	2,64 0,79	4,25 -6,39	5,46 0,85	6,13 -1,36	4,25 -6,39		
CDI	0,16	2,76	0,47	0,99	2,76	8,88	15,87
IBOVESPA	9,30	2,92	25,81	25,21	2,92	35,42	55,78
INPC + 6%	1,98	11,75	4,85	8,23	11,75	23,79	35,66
IPCA + 6%	1,87	10,76	4,64	7,55	10,76	22,49	34,64

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	0,31	3,84	0,70	1,21	3,84	10,86	18,59
IRF-M 1+	3,05	8,45	2,90	2,29	8,45	23,90	39,09
IRF-M TOTAL	1,95	6,69	1,99	1,75	6,69	19,53	32,36
IMA-B 5	1,83	8,04	3,38	4,72	8,04	22,25	34,31
IMA-B 5+	7,51	5,50	10,53	11,36	5,50	37,54	58,72
IMA-B TOTAL	4,85	6,41	7,18	8,21	6,41	30,83	47,91
IMA-C TOTAL	-1,12	22,07	3,64	13,59	22,07	45,76	72,56
IMA-GERAL ex-C TOTAL	2,12	4,85	2,83	3,09	4,85	18,09	29,65
IMA-GERAL TOTAL	2,02	5,34	2,86	3,40	5,34	18,84	30,77
IDKA 2	1,73	8,62	3,05	5,10	8,62	21,46	33,31
IDKA 20	11,36	2,20	15,90	16,58	2,20	47,44	77,53
CDI	0,16	2,76	0,47	0,99	2,76	8,88	15,87
<b>Renda Variável</b>							
IBOVESPA	9,30	2,92	25,81	25,21	2,92	35,42	55,78
IBRX 100	9,15	3,50	25,34	25,28	3,50	38,06	59,35
IBRX 50	9,42	3,62	26,47	26,00	3,62	33,83	53,28
SMALL CAP	7,52	-0,65	22,54	25,33	-0,65	57,16	69,94
IFIX	2,19	-10,24	2,69	2,28	-10,24	22,05	28,91
Índice Consumo - ICON							
Índice Dividendos - IDIV	8,94	-1,00	25,44	21,29	-1,00	43,71	66,63
<b>Indicadores Econômicos</b>							
IPCA	1,35	4,52	3,13	4,42	4,52	9,02	13,10
INPC	1,46	5,45	3,34	5,07	5,45	10,17	13,96
IGPM	0,96	23,14	7,64	17,96	23,14	32,13	42,09
SELIC	0,16	2,76	0,47	0,99	2,76	8,88	15,88
<b>Meta Atuarial</b>							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

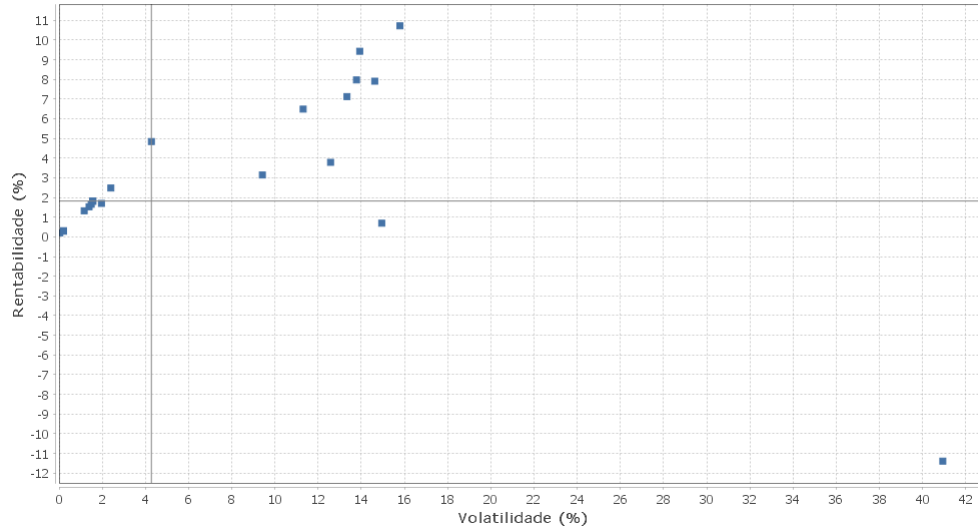
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
90	03/12/2020	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.000.000,00	0,00	1.529.430,83760800	1,3076760000
94	03/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.000.000,00	1.533.624,71811600	2,6082000067
87	04/12/2020	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	0,00	10.000.000,00	2.912.588,55683200	3,4333720000
85	07/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	31.042,07	11.901,53996300	2,6082400000
88	07/12/2020	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	0,00	3.239.771,94	943.584,78688400	3,4334720000
89	09/12/2020	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	2.000.000,00	0,00	392.271,23673118	5,0985130000
91	11/12/2020	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13.239.771,94	0,00	10.151.727,96274100	1,3041890000
83	17/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	800.000,00	306.448,12749800	2,6105560000
95	17/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	90.000,00	34.475,41430600	2,6105560000
82	18/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	69.860,08	0,00	26.757,67175500	2,6108430000
92	18/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	68.484,87	0,00	26.230,94150000	2,6108430000
84	18/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	747.610,19	0,00	286.348,19864600	2,6108430000
93	21/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	257.339,13	0,00	98.555,45342700	2,6111100000
86	21/12/2020	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	1.000.000,00	0,00	855.075,04138500	1,1694880000
<b>Total</b>						



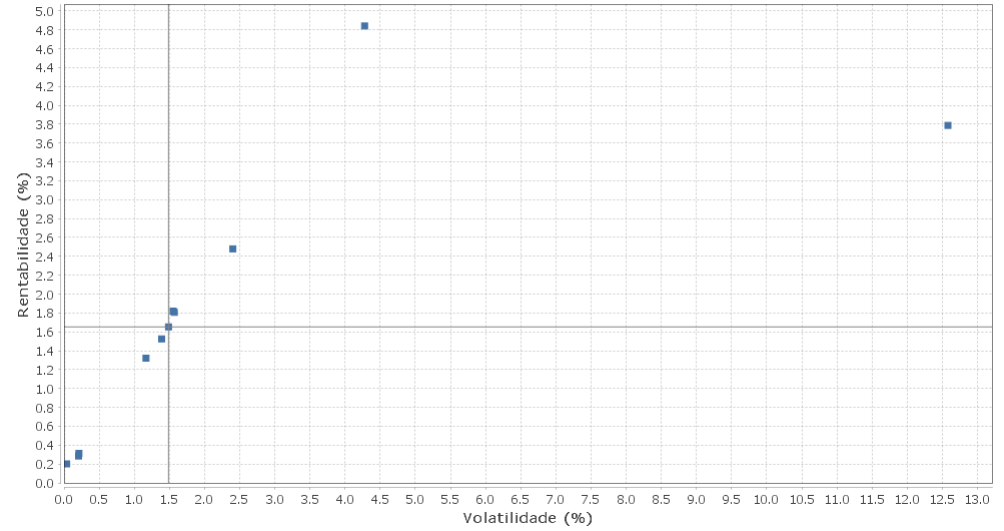
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

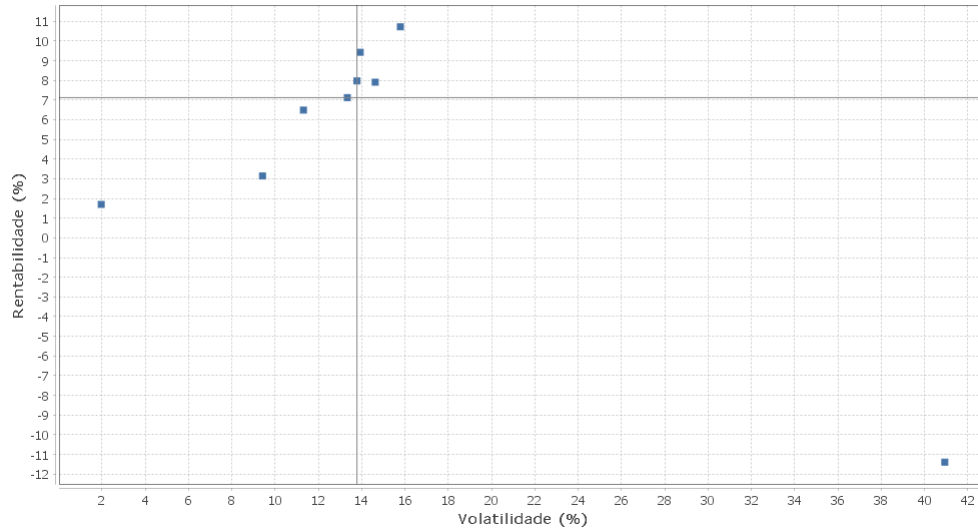
CAMPO MOURÃO - No Mês



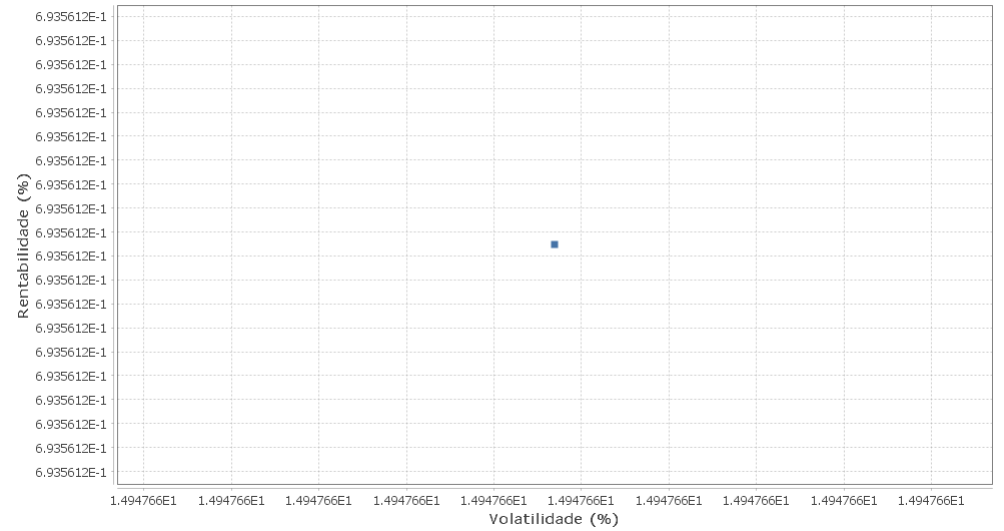
Renda Fixa - No Mês



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\$): 4.115.392,49

Value-At-Risk: 2,56%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,26	0,00	1,02	0,20	3.095.555,31	1,92
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,21	0,15	0,00	0,58	0,28	5.055.079,64	3,14
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,21	0,17	0,00	0,70	0,31	5.140.289,89	3,19
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,17	1,25	0,13	0,99	1,32	24.650.813,52	15,31
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,39	0,94	0,05	0,98	1,53	13.584.500,75	8,44
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,49	1,10	0,03	1,00	1,65	7.379.730,64	4,58
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,55	1,06	0,05	1,07	1,82	11.925.729,43	7,41
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,57	1,05	0,06	1,05	1,81	13.957.955,92	8,67
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	1,96	NaN	0,00	0,78	1,70	0,00	0,00
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	Artigo 7º IV, Alínea a	2,40	1,44	0,12	0,96	2,48	19.601.282,43	12,18
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,28	2,57	0,06	1,09	4,84	5.948.659,34	3,70
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	9,42	8,35	0,62	0,32	3,14	15.562.048,59	9,67
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	Artigo 8º II, Alínea a	11,31	10,40	0,41	0,56	6,49	7.292.726,05	4,53
FIDC GGR PRIME I	Artigo 7º VII, Alínea a	12,58	0,17	-0,00	0,29	3,79	1.797.278,22	1,12
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA	Artigo 8º II, Alínea a	13,34	10,12	0,09	0,52	7,12	1.497.242,48	0,93
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	13,78	11,63	0,08	0,57	7,97	1.256.648,37	0,78
BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	Artigo 8º II, Alínea a	13,93	10,30	0,24	0,67	9,43	4.041.606,08	2,51
BRADESCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	14,62	11,06	0,16	0,53	7,90	2.624.788,59	1,63
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	14,95	12,70	0,04	0,04	0,69	2.059.016,03	1,28
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	15,79	10,09	0,41	0,67	10,72	7.295.909,97	4,53
CARE11	Artigo 8º IV, Alínea b	40,94	1,40	-0,00	-0,28	-11,39	1.580.644,10	0,98