



LDB
EMPRESAS

CAMPO MOURÃO
1º TRIMESTRE 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 31.03.2021.

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 66,71%

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,45	0,02	0,05	5.142.986,11	3,11	7.884.684.396,22	0,07
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7,90	-0,47	-2,86	6.763.997,63	4,09	5.996.206.078,69	0,11
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,43	0,01	0,05	6.662.077,05	4,02	9.801.758.898,12	0,07
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,04	0,31	-0,23	11.898.633,84	7,19	13.551.415.614,90	0,09
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,63	0,37	-0,00	13.584.015,69	8,21	8.957.703.037,59	0,15
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,74	0,37	-0,02	2.500.139,86	1,51	10.861.361.928,62	0,02
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	3,01	0,32	-0,20	13.930.211,30	8,41	5.244.113.078,65	0,27
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	3,78	0,30	-0,18	24.605.756,10	14,86	15.491.489.347,05	0,16
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,96	0,22	-0,33	85.087.817,58	51,40		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,65	0,14	0,34	3.106.038,17	1,88	3.580.849.195,10	0,09
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	4,37	-0,54	-2,07	20.517.197,97	12,39	1.406.629.483,62	1,46
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			3,91	-0,45	-1,74	23.623.236,14	14,27		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
AURORA	CM CAPITAL	FIDC GGR PRIME I	7,32	0,15	-0,07	1.731.773,21	1,05	155.844.626,83	1,11
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a			7,32	0,15	-0,07	1.731.773,21	1,05		
Renda Fixa			3,07	0,07	-0,63	110.442.826,93	66,71		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

28,64%

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	25,49	0,16	-5,50	2.480.514,70	1,50	736.778.248,58	0,34
CONSTÂNCIA	BEM	CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA	24,04	7,57	1,01	1.512.392,36	0,91	326.101.868,13	0,46
BRAM	BRADESCO	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	25,54	4,08	-2,48	3.941.462,32	2,38	279.718.431,71	1,41
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	30,40	3,58	-3,76	1.209.440,39	0,73	1.088.808.596,09	0,11
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	26,38	8,63	-2,59	7.106.603,78	4,29	1.177.292.184,55	0,60
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	27,06	7,41	3,57	7.553.272,54	4,56	323.290.750,89	2,34
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			25,32	6,21	-0,85	23.803.686,09	14,38		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	20,92	4,05	6,80	16.619.754,17	10,04	1.178.826.435,94	1,41
Sub-total Artigo 8º III			20,92	4,05	6,80	16.619.754,17	10,04		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
A5	PLANNER	W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	4,73	-0,14	4,53	3.244.618,62	1,96	139.938.144,50	2,32
LEGATUS	DAYCOVAL	FIP LA SHOPPING CENTERS	9,29	-0,15	-0,38	2.518.141,23	1,52	242.616.334,56	1,04
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			4,79	-0,15	2,33	5.762.759,85	3,48		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
PLANNER	PLANNER	CARE11	51,59	-18,18	-22,86	1.219.354,02	0,74	289.227.548,05	0,42
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			51,59	-18,18	-22,86	1.219.354,02	0,74		

Renda Variável e Investimentos Estruturados

14,20 3,85 1,33 47.405.554,13 28,64

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,65%

Artigo 9º A, III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	24,18	3,43	13,29	7.698.217,63	4,65	2.719.540.696,03	0,28
Sub-total Artigo 9º A, III			24,18	3,43	13,29	7.698.217,63	4,65		
Investimentos no Exterior			20,29	3,43	13,29	7.698.217,63	4,65		
Total			5,17	1,29	0,25	165.546.598,69	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			
				Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	85.087.817,58	51,40	0,00	47,91	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	23.623.236,14	14,27	0,00	13,25	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	1.731.773,21	1,05	0,00	1,17	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	110.442.826,93	66,71				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	23.803.686,09	14,38	0,00	12,64	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	16.619.754,17	10,04	0,00	10,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	5.762.759,85	3,48	0,00	3,82	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.219.354,02	0,74	0,00	1,21	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	47.405.554,13	28,64				30,00
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	7.698.217,63	4,65	0,00	5,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	7.698.217,63	4,65				10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

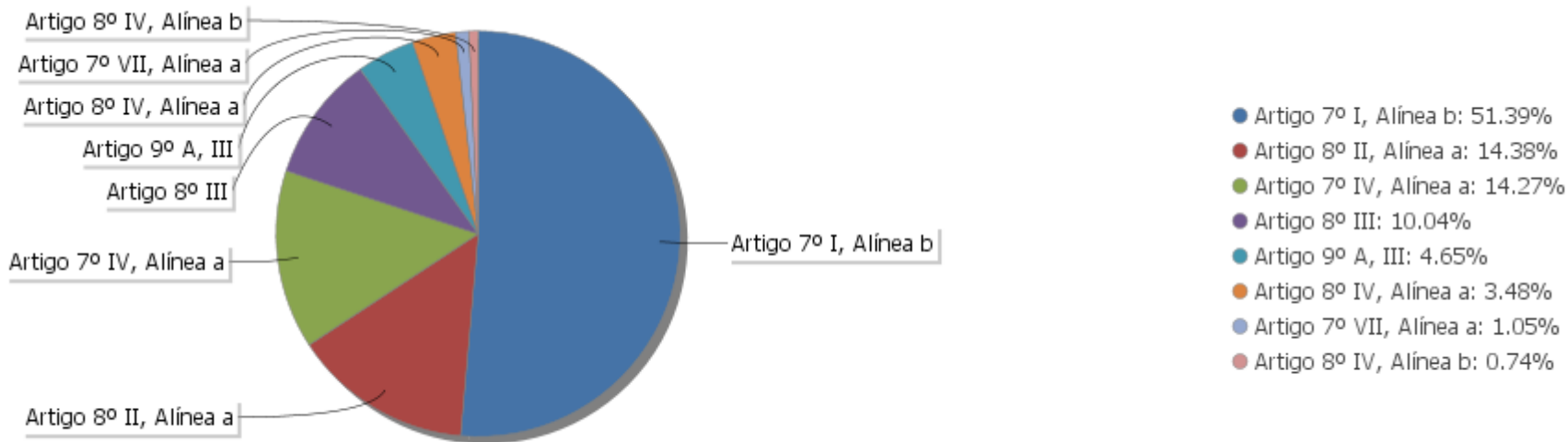
Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,22 108,87	-0,33 -68,32	-0,33 -68,32	2,45 255,58	6,64 298,91	183.723,96	-265.062,78
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,45 -224,91	-1,74 -358,67	-1,74 -358,67	0,84 87,21	3,56 160,21	-107.325,43	-401.543,43
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	0,15 73,49	-0,07 -15,17	-0,07 -15,17	3,88 404,24	1,49 67,27	2.555,47	1.120,40
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	6,21 0,22	-0,85 1,15	-0,85 1,15	23,33 0,04	56,72 -3,01	1.392.274,93	-205.235,45
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	4,05 -1,95	6,80 8,80	6,80 8,80	11,58 -11,71	18,01 -41,72	646.622,24	1.057.705,58
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,15 -6,14	2,33 4,33	2,33 4,33	1,76 -21,53	4,99 -54,74	-8.435,78	130.990,32
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-18,18 -24,18	-22,86 -20,85	-22,86 -20,85	-30,77 -54,06	-49,53 -109,26	-270.967,56	-361.290,08
Artigo 9º A, III % do CDI	3,43 1.704,61	13,29 2.735,98	13,29 2.735,98			255.131,96	472.242,09
CAMPO MOURÃO (Total)						2.093.579,79	428.926,65

Análise de Liquidez

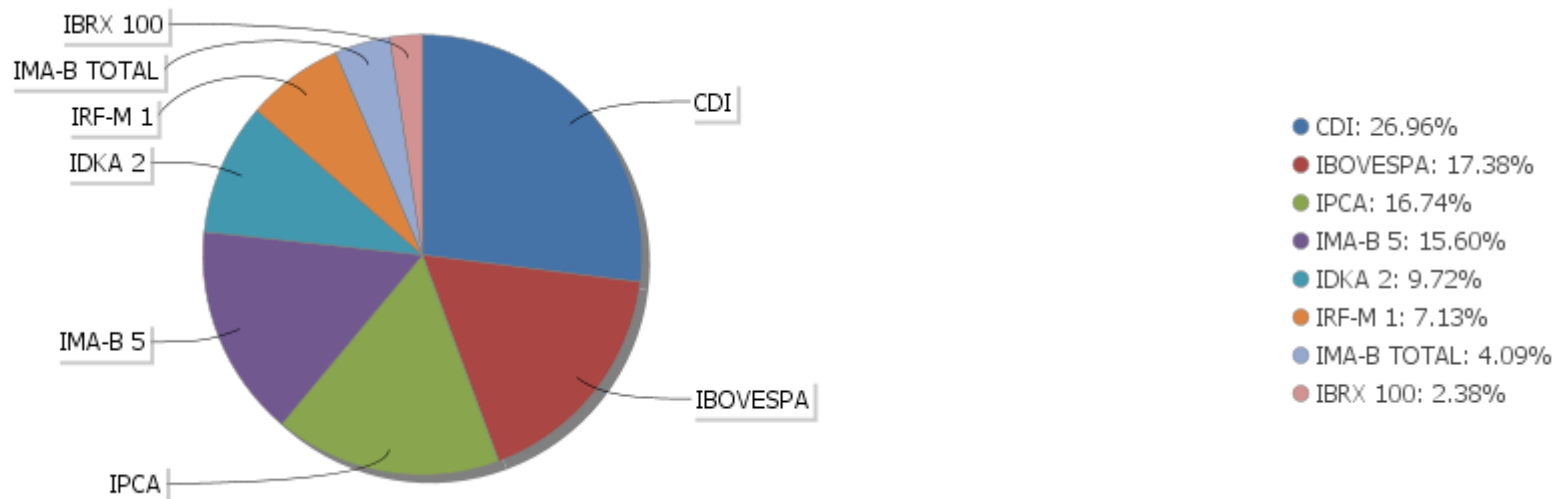
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	149.736.021,46	90,45	149.736.021,46	90,45
de 31 a 365 dias	8.316.044,17	5,02	158.052.065,63	95,47
acima de 365 dias	7.494.533,06	4,53	165.546.598,69	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

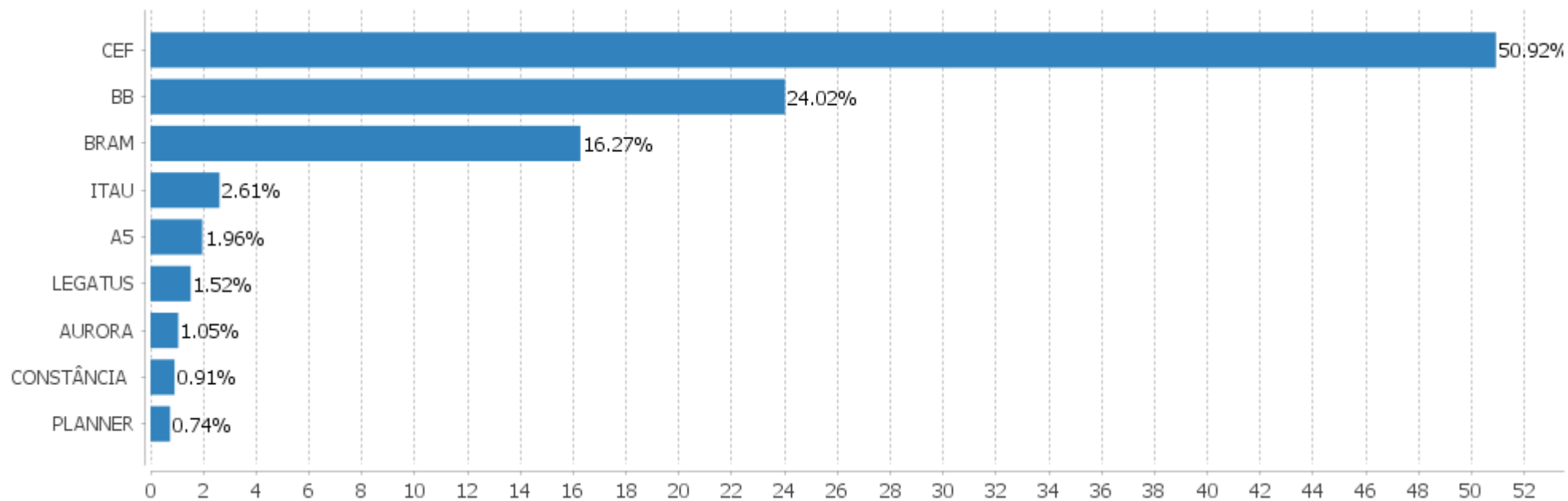


Alocação Por Estratégia



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	-0,51	-0,51	1,29										0,25
IPCA + 5,45% p.p. indexador	0,67	1,24	1,42										3,37
	-1,19	-1,75	-0,13										-3,12
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% p.p. indexador	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
	-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

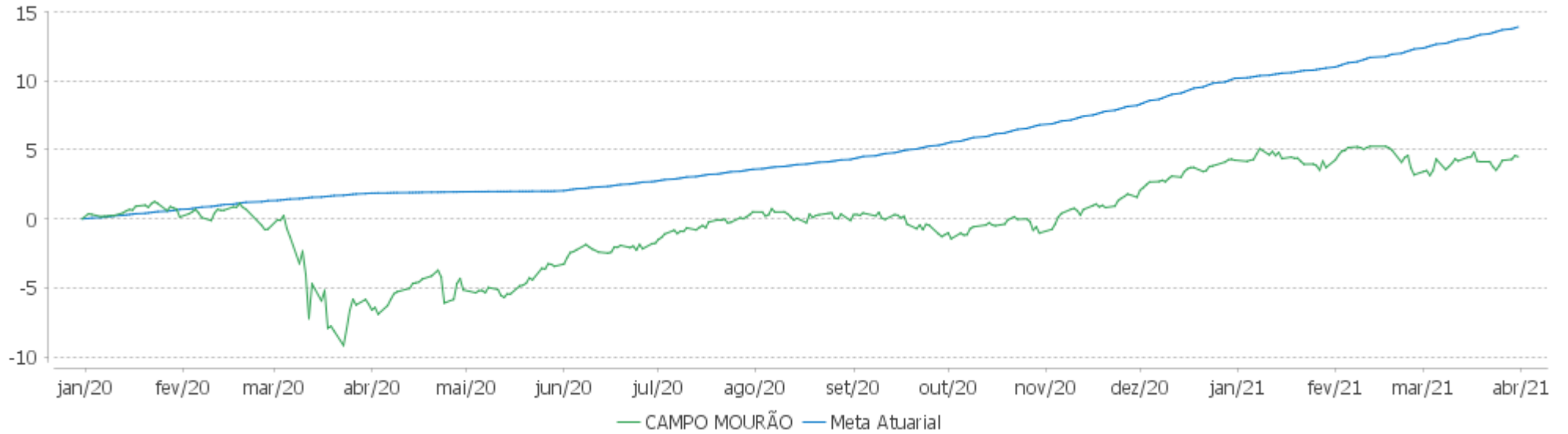
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

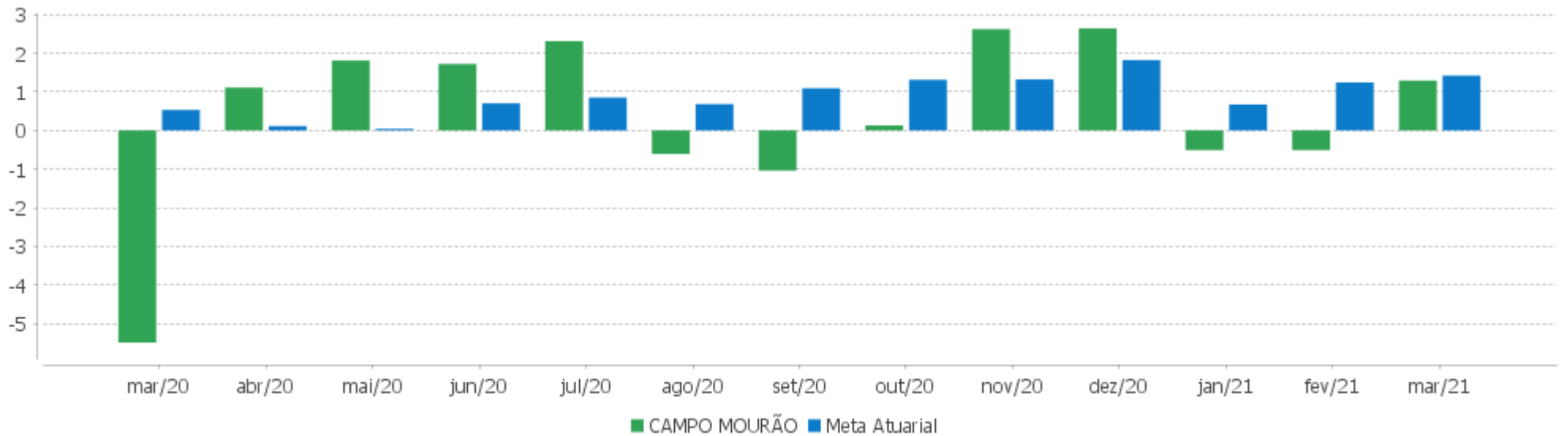
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	6	40,00	03 meses	0,25	3,37	-3,12	5,34
Meses abaixo da Meta Atuarial	9	60,00	06 meses	5,73	8,14	-2,41	4,60
			12 meses	11,41	12,18	-0,76	5,17
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,64	2020-12					
Menor rentabilidade da Carteira	-5,49	2020-03	Desde 31/12/2019	4,51	14,37	-9,85	7,84

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,14 -0,79	0,34 -1,71	0,34 -1,71	0,72 -4,52	2,06 -4,04	12,01 2,41	21,02 6,40
BRANDESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA % do CDI	-0,54 -269,53	-2,07 -425,07	-2,07 -425,07	0,87 90,45	3,86 173,68	12,01 154,33	22,04 150,80
FIDC GGR PRIME I % do CDI	0,15 73,49	-0,07 -15,17	-0,07 -15,17	3,88 404,24	1,49 67,27	-1,41 -18,16	-20,19 -138,13
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,47 -0,01	-2,86 -0,06	-2,86 -0,06	4,06 -0,11	10,15 -0,24	19,69 -0,79	35,87 -1,12
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,31 -0,03	-0,23 -0,08	-0,23 -0,08	3,08 -0,14	8,20 -0,30	17,97 -0,67	28,58 -0,95
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,37 0,08	-0,00 0,04	-0,00 0,04	3,22 0,22	8,63 0,06	17,08 -1,39	27,21 -2,14
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,02 -0,03	0,05 -0,07	0,05 -0,07	0,68 -0,15	2,12 -0,39	8,66 -0,68	15,66 -0,98
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,30 -0,63	-0,18 -2,24	-0,18 -2,24	1,85 -3,39	5,09 -1,01	19,24 9,64	29,94 15,33
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,37 0,08	-0,02 0,02	-0,02 0,02	3,02 0,02	8,45 -0,13	17,15 -1,31	27,36 -2,00
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,32 -0,02	-0,20 -0,05	-0,20 -0,05	3,13 -0,10	8,22 -0,28	18,09 -0,54	28,68 -0,85
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,01 -0,04	0,05 -0,07	0,05 -0,07	0,70 -0,13	2,27 -0,23	8,88 -0,45	15,96 -0,68
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE Var. IBOVESPA p.p.	7,41 1,41	3,57 5,58	3,57 5,58	24,25 0,96	60,43 0,70		
BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA Var. IBRX 100 p.p.	4,08 -1,96	-2,48 -1,75	-2,48 -1,75	21,03 -3,39	60,16 -2,01	27,47 1,31	44,85 2,71
BRANDESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	0,16 -5,84	-5,50 -3,49	-5,50 -3,49	14,00 -9,28	51,45 -8,28	10,58 -11,66	25,01 -11,62
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	3,58 -2,42	-3,76 -1,75	-3,76 -1,75	13,44 -9,84	41,69 -18,04	0,30 -21,93	19,51 -17,12
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA Var. IBOVESPA p.p.	7,57 1,58	1,01 3,01	1,01 3,01	22,21 -1,08	49,27 -10,46	16,12 -6,12	34,36 -2,27
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	8,63	-2,59	-2,59	28,96	57,70	29,30	56,62

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Varição da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	2,63	-0,59	-0,59	5,67	-2,03	7,07	20,00
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA % do CDI	-0,14 -70,20	4,53 931,37	4,53 931,37	3,97 413,30	2,86 128,76	0,83 10,65	-1,20 -8,21
FIP LA SHOPPING CENTERS % do CDI	-0,15 -75,90	-0,38 -77,22	-0,38 -77,22	-0,95 -98,46	7,87 354,13	20,45 262,80	80,13 548,21
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP % do CDI	4,05 2.013,14	6,80 1.398,84	6,80 1.398,84	18,84 1.962,63	51,15 2.301,64	38,08 489,46	
CARE11 Var. IBOVESPA p.p.	-18,18 -24,18	-22,86 -20,85	-22,86 -20,85	-30,77 -54,06	-49,53 -109,26	-63,51 -85,75	-77,02 -113,65
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	3,43 -2,57	13,29 15,30	13,29 15,30	14,78 -8,51	64,18 4,45	108,61 86,37	166,72 130,09
CAMPO MOURÃO Var. IPCA + 5,45% p.p.	1,29 -0,13	0,25 -3,12	0,25 -3,12	5,73 -2,30	11,41 -0,42		
CDI	0,20	0,49	0,49	0,96	2,22	7,78	14,62
IBOVESPA	6,00	-2,00	-2,00	23,29	59,73	22,24	36,63
INPC + 6,00%	1,40	3,41	3,41	8,43	13,30	24,13	37,66
IPCA + 6,00%	1,47	3,50	3,50	8,31	12,41	23,15	36,45

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Renda Fixa							
IRF-M 1	0,04	0,13	0,13	0,83	2,51	9,33	16,64
IRF-M 1+	-1,45	-4,77	-4,77	-2,02	1,81	15,01	26,76
IRF-M TOTAL	-0,84	-2,80	-2,80	-0,87	2,25	13,59	23,98
IMA-B 5	0,34	-0,15	-0,15	3,23	8,50	18,63	29,54
IMA-B 5+	-1,17	-5,10	-5,10	4,90	12,01	21,24	42,19
IMA-B TOTAL	-0,46	-2,81	-2,81	4,17	10,39	20,48	36,99
IMA-C TOTAL	-0,72	9,62	9,62	13,61	34,42	51,98	77,98
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,38	-1,64	-1,64	1,15	4,18	12,86	23,35
IMA-GERAL TOTAL	-0,39	-1,32	-1,32	1,50	4,98	13,88	24,71
IDKA 2	0,29	-0,05	-0,05	3,00	8,57	18,47	29,35
IDKA 20	-1,89	-7,21	-7,21	7,55	15,19	22,04	53,40
CDI	0,20	0,49	0,49	0,96	2,22	7,78	14,62
Renda Variável							
IBOVESPA	6,00	-2,00	-2,00	23,29	59,73	22,24	36,63
IBRX 100	6,04	-0,72	-0,72	24,43	62,17	26,16	42,14
IBRX 50	6,08	-0,80	-0,80	25,46	64,73	22,50	35,45
SMALL CAP	4,56	-0,88	-0,88	21,46	64,58	44,87	61,92
IFIX	-1,38	-0,81	-0,81	1,86	14,14	14,65	20,75
Índice Consumo - ICON	2,32	-4,34	-4,34	6,29	50,94	40,41	39,42
Índice Dividendos - IDIV	7,57	-3,21	-3,21	21,41	39,35	28,51	46,14
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,93	2,05	2,05	5,25	6,10	9,60	14,62
INPC	0,86	1,96	1,96	5,36	6,94	10,48	15,64
IGPM	2,94	8,26	8,26	16,52	31,10	40,02	51,60
SELIC	0,20	0,49	0,49	0,96	2,22	7,78	14,62
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

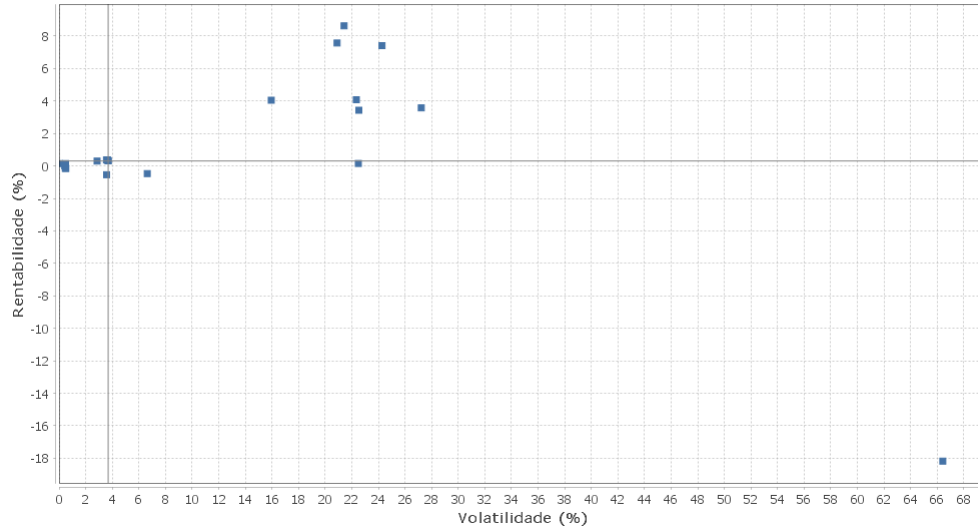
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1	28/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	210.000,00	80.363,79556300	2,6131170000
2	28/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	55.000,00	21.047,66057000	2,6131170000
3	29/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	679.359,74	0,00	259.925,00218000	2,6136760000
4	29/01/2021	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.005.845,01	0,00	274.684,59928900	3,6618180000
5	29/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	41.581,14	0,00	15.909,06447400	2,6136760000
9	03/02/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	9.997,80	4.152,77431060	2,4074990000
8	03/02/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	4.890.000,00	2.031.153,49165254	2,4074990000
7	08/02/2021	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	5.166.959,51	0,00	902.256,34129480	5,7267090000
15	10/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	129.636,85	0,00	49.573,05109200	2,6150670000
11	24/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	233.000,00	89.085,39504211	2,6154680000
16	24/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	90.000,00	34.410,66761283	2,6154680000
12	26/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	680.423,99	0,00	260.285,18278231	2,6141480000
6	26/02/2021	BRDESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	1.327.941,83	0,00	1.046.437,81456073	1,2690117000
17	26/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	39.240,88	0,00	15.010,96341906	2,6141480000
10	26/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	31.910,86	0,00	12.206,98292522	2,6141480000
20	29/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	209.000,00	79.991,11867700	2,6127900000
21	29/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	61.000,00	23.346,69081100	2,6127900000
19	31/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	802.577,91	0,00	306.985,00375600	2,6143880000
18	31/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	57.542,65	0,00	22.009,98857000	2,6143880000
Total						

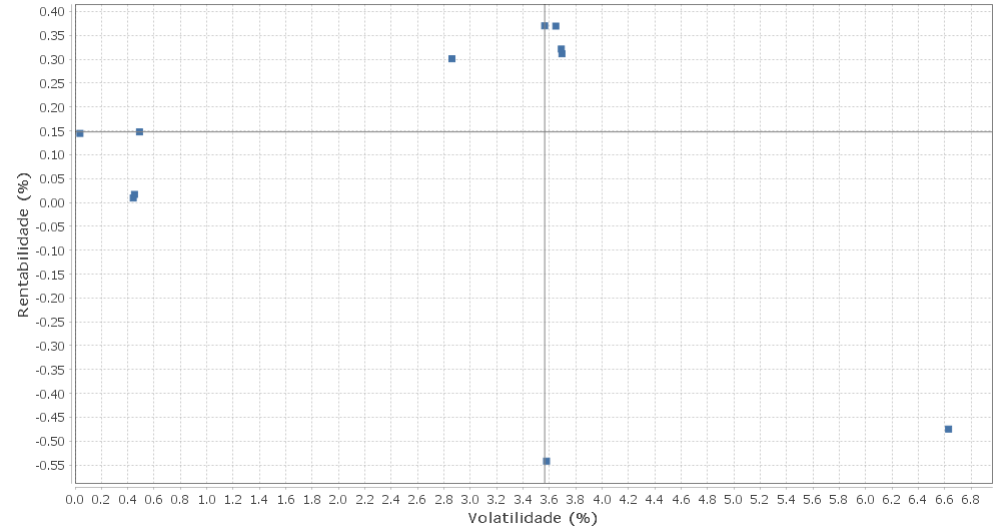
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

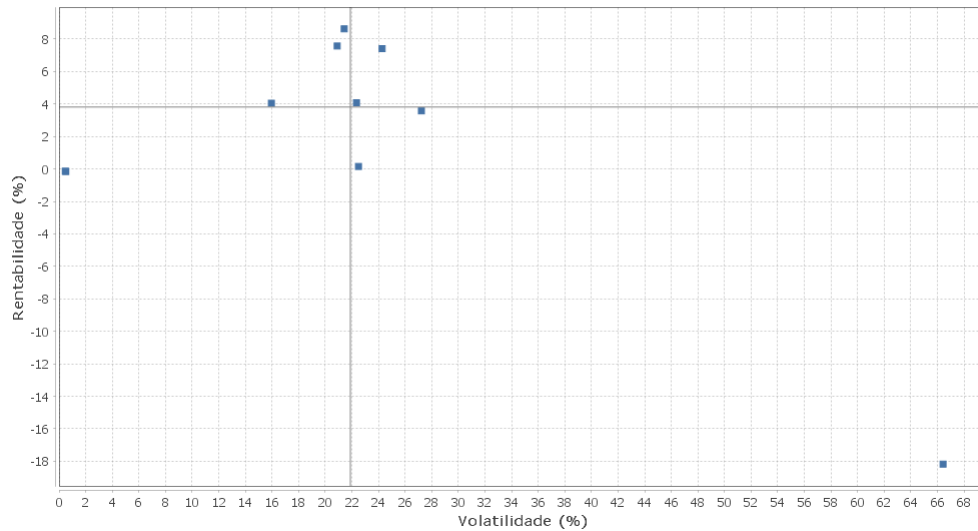
CAMPO MOURÃO - No Mês



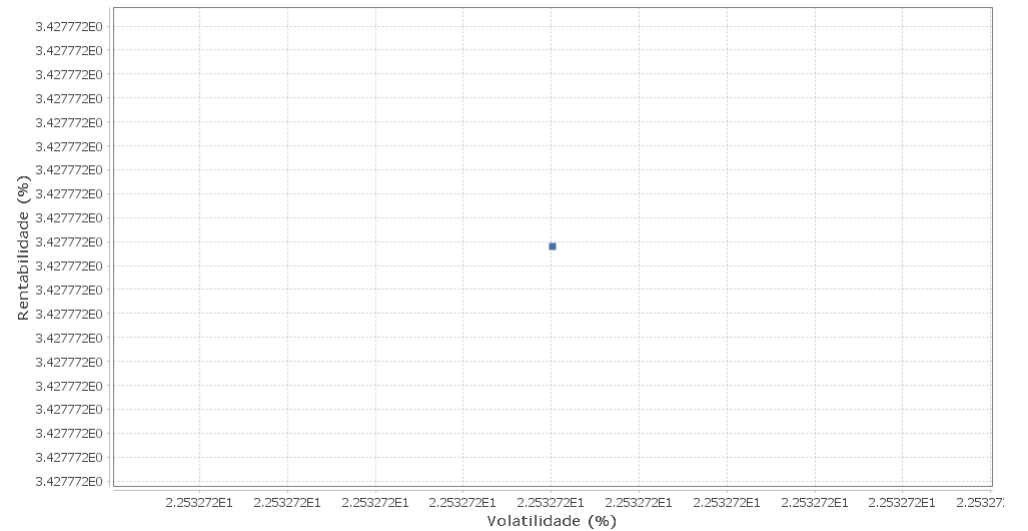
Renda Fixa - No Mês



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\$): 3.942.357,58

Value-At-Risk: 2,38%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,02	0,00	-1,52	0,14	3.106.038,17	1,88
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,44	0,14	0,00	-0,43	0,01	6.662.077,05	4,02
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,45	0,15	0,00	-0,41	0,02	5.142.986,11	3,11
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	Artigo 8º IV, Alínea a	0,47	0,19	-0,00	-0,73	-0,14	3.244.618,62	1,96
FIDC GGR PRIME I	Artigo 7º VII, Alínea a	0,49	0,17	0,00	-0,11	0,15	1.731.773,21	1,05
FIP LA SHOPPING CENTERS	Artigo 8º IV, Alínea a	0,51	0,03	0,00	-0,70	-0,15	2.518.141,23	1,52
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,86	0,94	0,09	0,03	0,30	24.605.756,10	14,86
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	3,56	1,38	0,07	0,05	0,37	13.584.015,69	8,21
BRADERCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	Artigo 7º IV, Alínea a	3,58	1,41	0,09	-0,21	-0,54	20.517.197,97	12,39
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,65	1,45	0,01	0,05	0,37	2.500.139,86	1,51
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,69	1,43	0,07	0,03	0,32	13.930.211,30	8,41
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,70	1,43	0,06	0,03	0,31	11.898.633,84	7,19
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,63	2,82	0,06	-0,10	-0,47	6.763.997,63	4,09
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	15,95	6,77	0,51	0,24	4,05	16.619.754,17	10,04
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA	Artigo 8º II, Alínea a	20,90	10,43	0,09	0,35	7,57	1.512.392,36	0,91
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	21,43	11,47	0,43	0,39	8,63	7.106.603,78	4,29
BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	Artigo 8º II, Alínea a	22,35	10,27	0,22	0,17	4,08	3.941.462,32	2,38
BRADERCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	22,49	11,01	0,14	-0,00	0,16	2.480.514,70	1,50
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	22,53	10,08	0,12	0,14	3,43	7.698.217,63	4,65
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	Artigo 8º II, Alínea a	24,28	9,69	0,36	0,30	7,41	7.553.272,54	4,56
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	27,22	10,22	0,06	0,12	3,58	1.209.440,39	0,73
CARE11	Artigo 8º IV, Alínea b	66,42	1,74	0,00	-0,28	-18,18	1.219.354,02	0,74