



CAMPO MOURÃO
1º TRIMESTRE 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 20.04.2020.

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 77,88%

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 PREVID RF IRF-M1	0,45	0,60	1,38	5.036.363,39	3,80	6.969.533.398,64	0,07
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	11,16	-7,10	-6,46	5.246.111,51	3,96	5.890.819.394,91	0,09
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,44	0,59	1,38	5.432.506,62	4,10	10.517.651.272,61	0,05
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	4,58	-1,80	-0,64	10.997.299,31	8,31	9.363.308.744,85	0,12
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	3,77	-1,66	-0,66	12.504.475,09	9,44	6.723.745.548,10	0,19
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	3,65	-1,45	-0,41	6.803.222,04	5,14	8.199.299.170,30	0,08
BB	BB	BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,56	-1,79	-0,60	12.872.261,61	9,72	4.397.326.460,64	0,29
CEF	CEF	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	5,32	-0,13	1,31	23.413.085,85	17,68	11.020.077.699,37	0,21
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			8,24	-1,36	-0,23	82.305.325,42	62,16		

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	1,32	0,53	1,13	3.043.472,93	2,30	5.019.962.419,71	0,06
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	5,84	-2,11	-1,31	15.821.088,89	11,95	1.169.262.014,09	1,35
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			9,47	-1,70	-0,93	18.864.561,82	14,25		

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	15,37	-0,31	-1,01	1.950.910,27	1,47	176.240.501,19	1,11
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a			15,37	-0,31	-1,01	1.950.910,27	1,47		
Renda Fixa			8,37	-1,41		103.120.797,51	77,88		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

22,12%

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	40,65	-31,54	-39,89	1.637.827,33	1,24	557.582.118,41	0,29
CONSTÂNCIA	BEM	CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA	38,75	-31,14	-37,07	1.013.213,85	0,77	205.028.671,94	0,49
BRAM	BRADESCO	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	40,20	-30,43	-36,29	2.460.963,34	1,86	156.581.962,53	1,57
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	46,64	-41,88	-46,49	853.586,76	0,64	1.314.153.409,58	0,06
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	37,39	-27,05	-34,54	4.506.346,02	3,40	606.513.004,24	0,74
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	43,87	-29,90	-33,69	1.869.083,36	1,41	137.299.176,97	1,36
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			73,04	-30,33	-36,70	12.341.020,66	9,32		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	7,25	-5,31	-6,10	9.036.260,01	6,82	4.401.772.920,54	0,21
Sub-total Artigo 8º III			7,25	-5,31	-6,10	9.036.260,01	6,82		

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	1,20	-0,17	-0,49	3.154.349,81	2,38	136.709.403,75	2,31
LEGATUS	DAYCOVAL	FIP LA SHOPPING CENTERS	12,63	-0,16	-0,44	2.334.412,14	1,76	200.623.541,86	1,16
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			0,54	-0,17	-0,47	5.488.761,95	4,15		

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	60,02	-10,08	-17,05	2.416.127,41	1,82	249.657.925,39	0,97
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			60,02	-10,08	-17,05	2.416.127,41	1,82		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			36,89	-17,38		29.282.170,03	22,12		
---	--	--	-------	--------	--	---------------	-------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Total

132.402.967,54

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	82.305.325,42	62,16	20,00	30,00	90,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	18.864.561,82	14,25	10,00	30,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	1.950.910,27	1,47	0,00	0,00	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	103.120.797,51	77,88				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	12.341.020,66	9,32	7,00	12,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	9.036.260,01	6,82	7,00	8,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	5.488.761,95	4,15	0,00	4,30	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	2.416.127,41	1,82	0,00	2,70	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	29.282.170,03	22,12				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

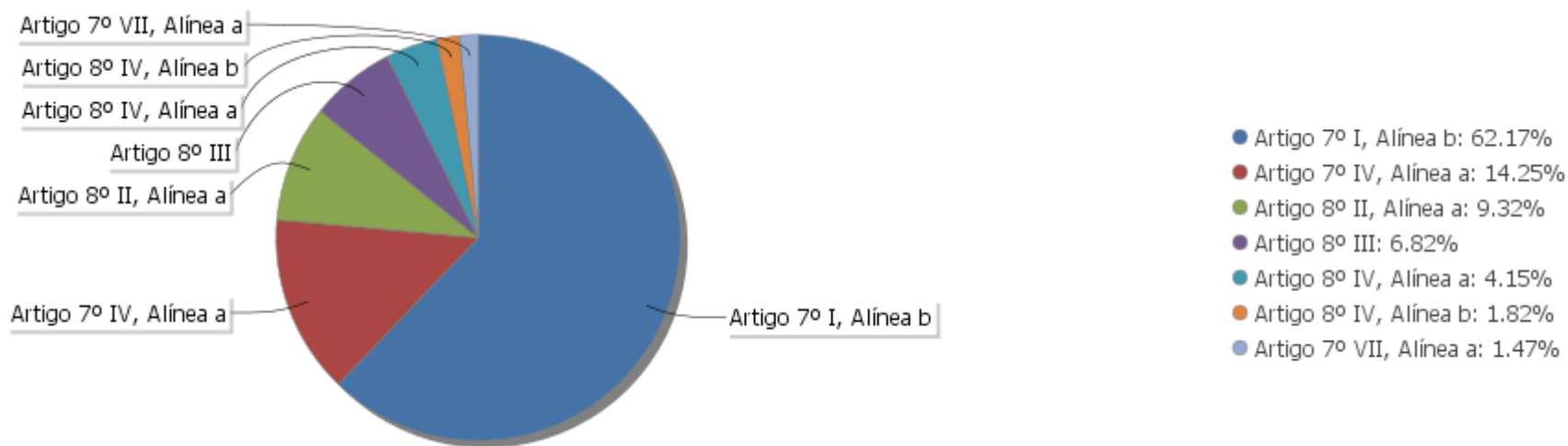
Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-1,36 -403,32	-0,23 -22,43	-0,23 -22,43			-1.125.195,99	-195.394,95
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-1,70 -501,11	-0,93 -92,13	-0,93 -92,13			-325.387,23	-197.824,51
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	-0,31 -92,20	-1,01 -99,91	-1,01 -99,91			-6.105,67	358,78
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-30,33 -0,42	-36,70 0,16	-36,70 0,16			-5.372.008,71	-7.154.930,05
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-5,31 24,59	-6,10 30,76	-6,10 30,76			-506.917,18	-587.382,46
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,17 29,74	-0,47 36,39	-0,47 36,39			-9.184,60	-25.685,10
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-10,08 19,82	-17,05 19,80	-17,05 19,80			-270.967,56	-496.773,86
						-7.615.766,94	-8.657.632,15

Análise de Liquidez

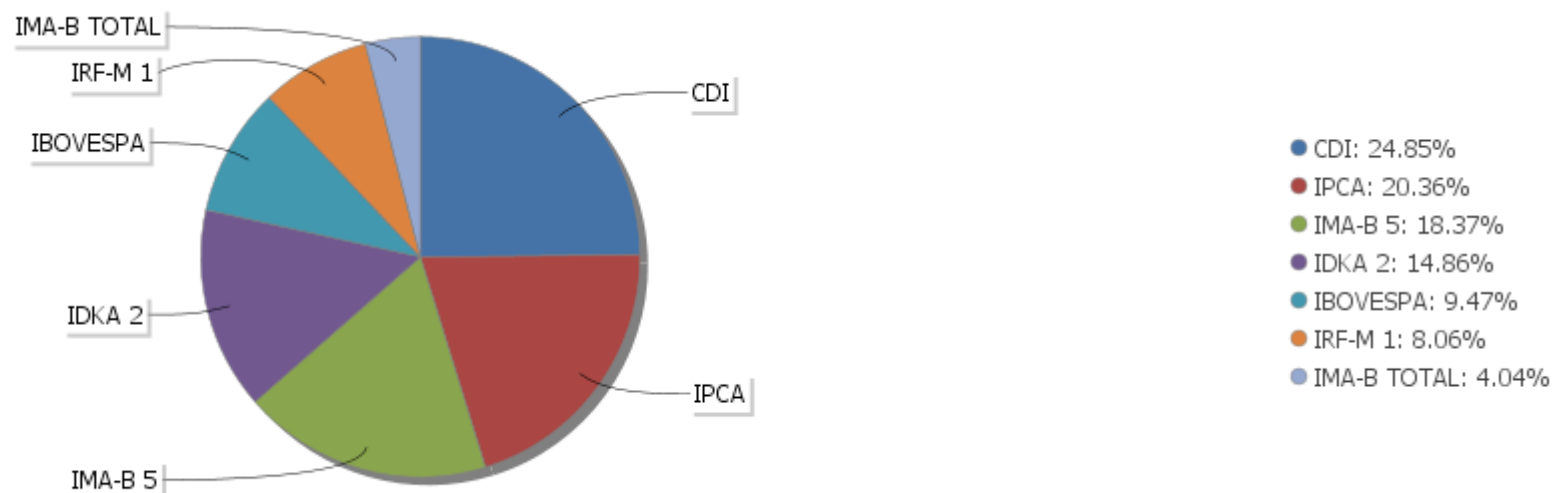
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	120.456.949,30	90,98	120.456.949,30	90,98
de 31 a 364 dias	4.506.346,02	3,40	124.963.295,32	94,38
acima de 365 dias	7.439.672,22	5,62	132.402.967,54	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

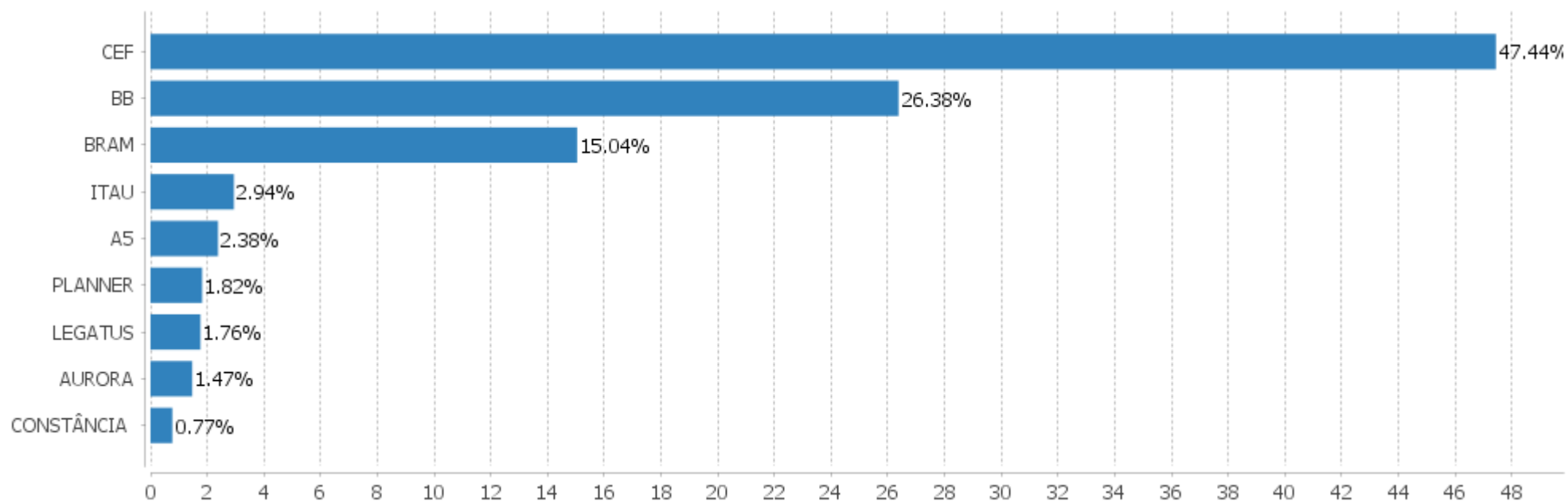


Alocação Por Estratégia



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										-6,19
IPCA + 6%	0,72	0,67	0,58										1,98
p.p. indexador	-0,59	-1,55	-6,07										-8,17

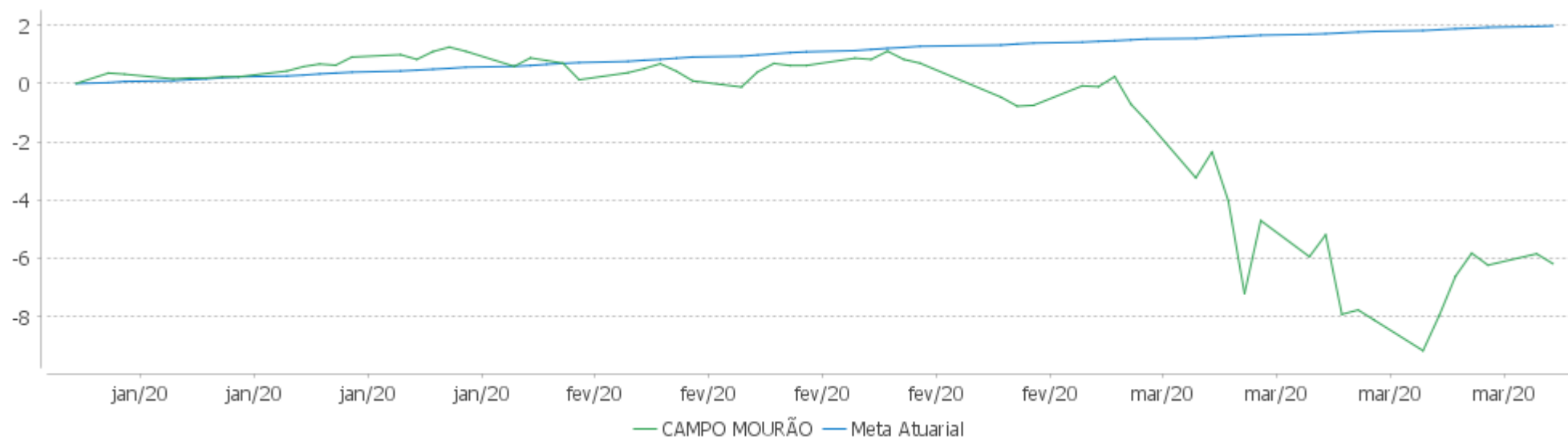
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

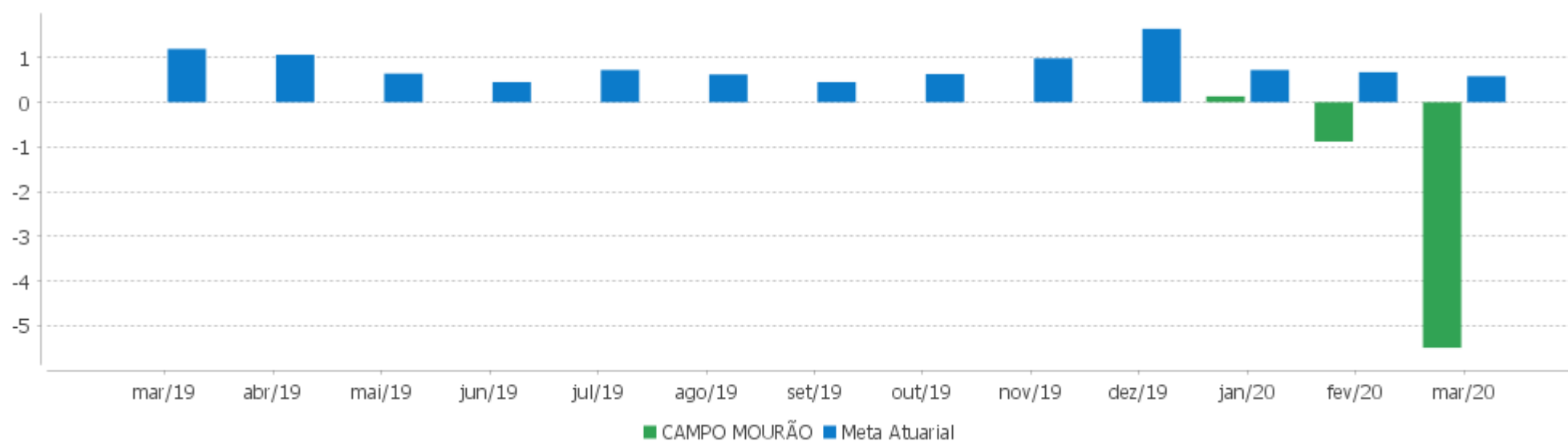
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	0	0,00	03 meses	-6,19	1,98	-8,17	14,15
Meses abaixo da Meta Atuarial	3	100,00	06 meses				
			12 meses				
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	0,13	2020-01	Desde 31/12/2019	-6,19	1,98	-8,17	14,15
Menor rentabilidade da Carteira	-5,49	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B TOTAL p.p.	-7,10 -0,13	-6,46 -0,15	-6,46 -0,15	-3,94 -0,30	8,66 -0,48	23,36 -0,75	36,31 -1,12
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B 5 p.p.	-1,80 -0,04	-0,64 -0,07	-0,64 -0,07	1,86 -0,17	9,03 -0,31	18,84 -0,55	32,82 -0,85
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	-1,66 -0,45	-0,66 -0,66	-0,66 -0,66	1,94 -0,52	7,78 -1,34	17,10 -2,04	30,56 -3,36
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,13 -0,20	1,31 0,78	1,31 0,78	3,13 0,82	13,46 10,16	23,65 15,62	35,73 24,81
BB PREVID RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,60 -0,01	1,38 -0,06	1,38 -0,06	2,70 -0,13	6,40 -0,26	13,27 -0,53	23,59 -0,83
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP Var. IDKA 2 p.p.	-1,45 -0,24	-0,41 -0,41	-0,41 -0,41	1,98 -0,48	8,03 -1,08	17,44 -1,70	30,97 -2,96
BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	-1,79 -0,04	-0,60 -0,03	-0,60 -0,03	1,92 -0,11	9,12 -0,21	18,91 -0,48	32,93 -0,74
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,59 -0,02	1,38 -0,05	1,38 -0,05	2,73 -0,11	6,46 -0,20	13,39 -0,41	23,77 -0,64
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,53 0,46	1,13 0,60	1,13 0,60	2,34 0,03	9,75 6,45	18,58 10,56	30,29 19,37
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA % do CDI	-2,11 -624,25	-1,31 -129,34	-1,31 -129,34	0,48 20,99	7,84 144,28	17,51 144,38	
FIDC GGR PRIME I % do CDI	-0,31 -92,20	-1,01 -99,91	-1,01 -99,91	-0,19 -8,58	-2,87 -52,70	-21,37 -176,21	-24,49 -113,73
CARE11 Var. IBOVESPA p.p.	-10,08 19,82	-17,05 19,80	-17,05 19,80	-30,07 0,22	-27,70 -4,23	-54,47 -40,01	-35,15 -47,52
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE Var. IBOVESPA p.p.	-29,90 0,01	-33,69 3,17	-33,69 3,17	-21,82 8,47			
BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	-30,43	-36,29	-36,29	-29,30	-20,41	-9,56	
BRADESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	-31,54 -1,63	-39,89 -3,03	-39,89 -3,03	-34,30 -4,01	-26,99 -3,52	-17,46 -3,00	19,95 7,59
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	-41,88 -11,98	-46,49 -9,64	-46,49 -9,64	-38,72 -8,43	-29,21 -5,74	-15,65 -1,19	11,25 -1,12
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA Var. IBOVESPA p.p.	-31,14 -1,23	-37,07 -0,21	-37,07 -0,21	-28,49 1,80	-22,21 1,26	-9,99 4,48	16,40 4,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-27,05 2,86	-34,54 2,32	-34,54 2,32	-25,80 4,49	-18,01 5,46	-0,68 13,78	
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA % do CDI	-0,17 -51,05	-0,49 -48,02	-0,49 -48,02	-0,99 -43,52	-1,98 -36,36	-3,95 -32,57	
FIP LA SHOPPING CENTERS % do CDI	-0,16 -47,10	-0,44 -43,31	-0,44 -43,31	-0,88 -39,02	11,66 214,43	66,99 552,49	
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP % do CDI	-5,31 -1.569,83	-6,10 -603,06	-6,10 -603,06	-2,57 -113,42	6,44 118,45	17,36 143,17	30,99 143,93
CDI	0,34	1,01	1,01	2,26	5,44	12,12	21,53
IBOVESPA	-29,90	-36,86	-36,86	-30,29	-23,47	-14,46	12,37
INPC + 6%	0,69	1,99	1,99	5,38	9,56	21,50	30,65
IPCA + 6%	0,58	1,98	1,98	5,33	9,55	21,38	31,96

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	0,60	1,43	1,43	2,83	6,66	13,79	24,42
IRF-M 1+	-0,47	1,44	1,44	3,57	12,96	24,50	42,11
IRF-M TOTAL	-0,11	1,42	1,42	3,31	11,09	21,25	36,85
IMA-B 5	-1,75	-0,57	-0,57	2,03	9,34	19,39	33,68
IMA-B 5+	-10,93	-10,62	-10,62	-7,92	8,24	26,94	39,94
IMA-B TOTAL	-6,97	-6,31	-6,31	-3,64	9,14	24,10	37,42
IMA-C TOTAL	-3,52	-0,45	-0,45	1,38	13,06	32,40	46,04
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-1,93	-1,00	-1,00	0,87	8,34	18,40	31,22
IMA-GERAL TOTAL	-1,98	-0,99	-0,99	0,89	8,47	18,79	31,60
IDKA 2	-1,21	-0,00	-0,00	2,46	9,11	19,14	33,92
IDKA 20	-16,46	-17,67	-17,67	-14,94	5,94	33,16	42,21
CDI	0,34	1,01	1,01	2,26	5,44	12,12	21,53
Renda Variável							
IBOVESPA	-29,90	-36,86	-36,86	-30,29	-23,47	-14,46	12,37
IBRX 100	-30,09	-36,64	-36,64	-29,86	-22,20	-12,35	15,05
IBRX 50	-30,37	-37,60	-37,60	-31,47	-25,64	-17,77	8,61
SMALL CAP	-35,07	-40,17	-40,17	-27,52	-11,98	-1,62	31,66
IFIX	-15,85	-22,00	-22,00	-7,08	0,45	5,79	22,69
Índice Consumo - ICON	-31,51			-30,32	-6,98	-7,63	14,29
Índice Dividendos - IDIV	-25,53	-31,24	-31,24	-21,42	-7,78	4,87	27,17
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,07	0,53	0,53	2,31	3,30	8,03	10,93
INPC	0,18	0,54	0,54	2,36	3,31	8,13	9,82
IGPM	1,24	1,69	1,69	4,83	6,82	15,66	15,90
SELIC	0,34	1,01	1,01	2,26	5,44	12,13	21,55
Meta Atuarial							
IPCA + 4%	0,41	1,51	1,51	4,33	7,47	16,84	24,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IPCA + 5%	0,50	1,74	1,74	4,83	8,51	19,10	28,29
IPCA + 5,5%	0,54	1,86	1,86	5,08	9,03	20,24	30,12
IPCA + 5,89%	0,57	1,96	1,96	5,28	9,44	21,13	31,55
IPCA + 6%	0,58	1,98	1,98	5,33	9,55	21,38	31,96
INPC + 4%	0,52	1,52	1,52	4,39	7,48	16,96	23,44
INPC + 6%	0,69	1,99	1,99	5,38	9,56	21,50	30,65

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

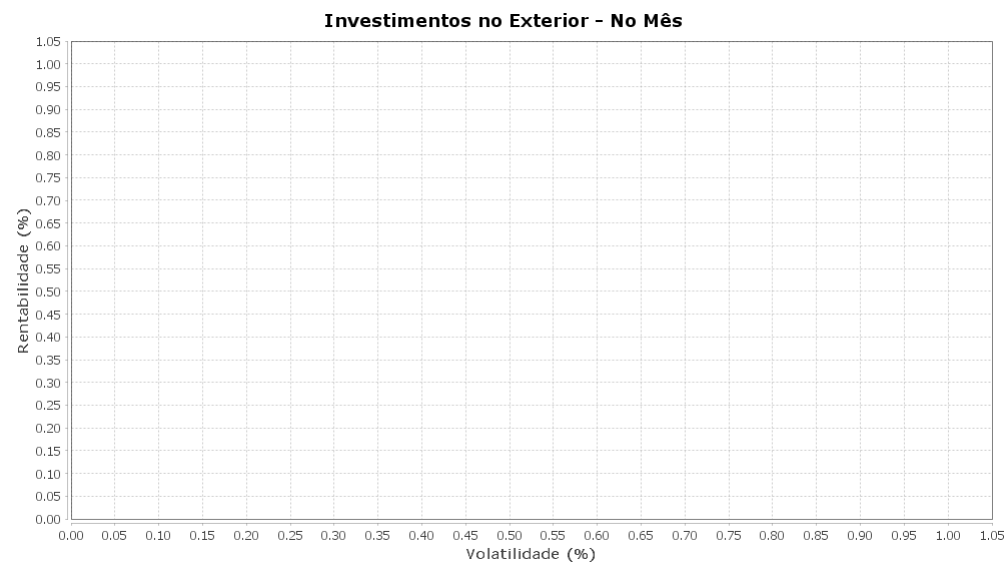
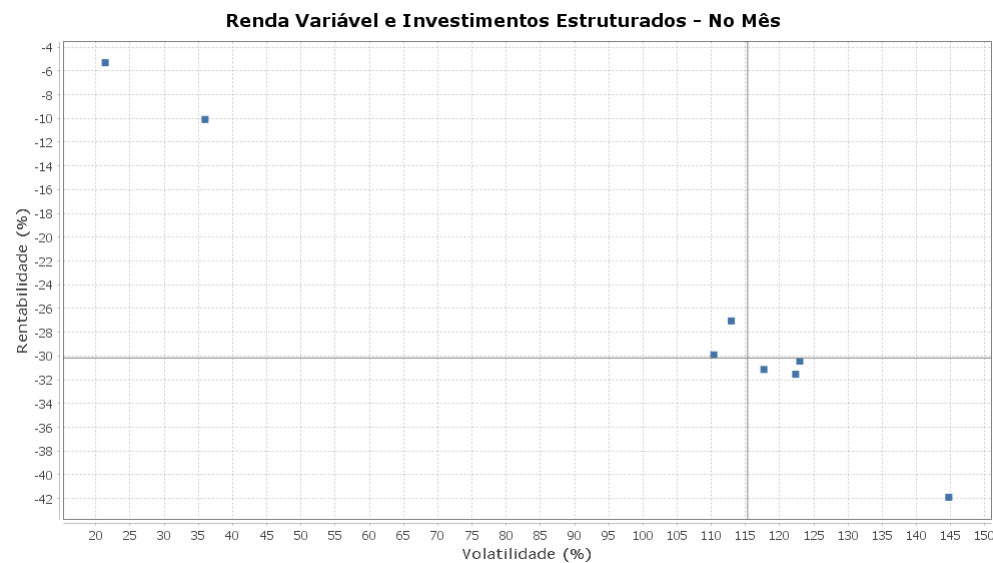
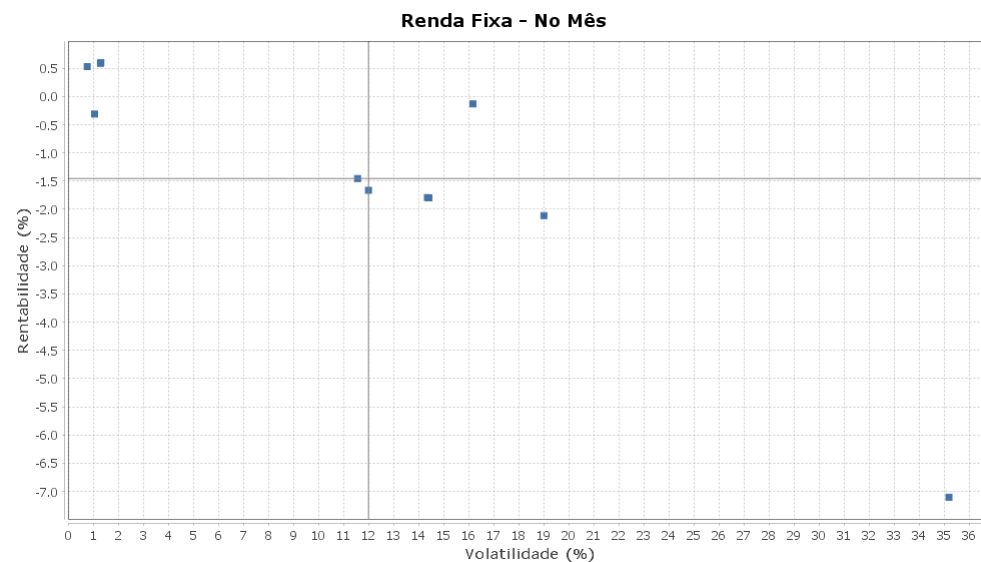
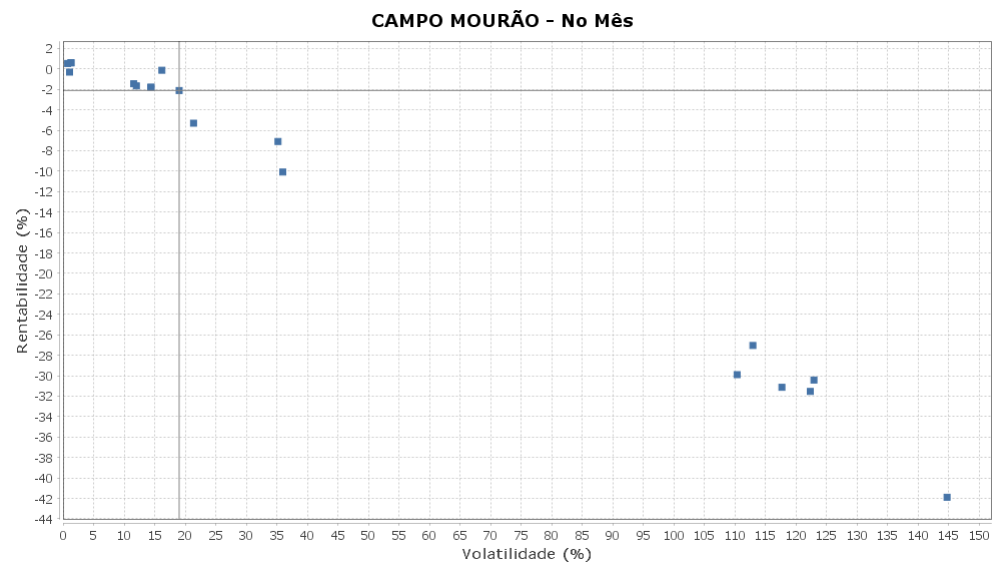
Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
08/01/2020	BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI	503.546,87	0,00	26.266,61729400	19,1706020000
08/01/2020	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	1.000.000,00	0,00	288.361,52692042	3,4678690000
08/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,00	11.515,48	4.561,66829280	2,5244010000
08/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	31.679,61	0,00	12.549,35725346	2,5244010000
09/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	147.816,29	0,00	58.545,34803909	2,5248170000
29/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,00	50.000,00	19.749,47397276	2,5317130000
29/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,00	530.000,00	209.344,42411126	2,5317130000
29/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,00	70.000,00	27.649,26356187	2,5317130000
12/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	111.698,36	0,00	44.037,71449900	2,5364250000
12/02/2020	BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	1.185.795,22	0,00	953.094,14040850	1,2441533000
12/02/2020	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	14.201,66	0,00	4.009,55178100	3,5419570000
12/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	153.455,69	0,00	60.500,77964000	2,5364250000
12/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	603.155,33	0,00	237.797,42353900	2,5364250000
17/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,00	15.000,00	5.911,02934100	2,5376290000
27/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,00	70.000,00	27.554,44437000	2,5404250000
27/02/2020	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	0,00	70.000,00	19.966,38797700	3,5058920000
27/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,00	540.000,00	212.562,85724400	2,5404250000
28/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	126.682,72	0,00	49.849,31804900	2,5413130000
28/02/2020	BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	1.204.132,25	0,00	969.942,61293010	1,2414469000
28/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	8.227,71	0,00	3.237,58230400	2,5413130000
28/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	600.594,51	0,00	236.332,36441100	2,5413130000
28/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	1.849,72	0,00	727,85996800	2,5413130000
10/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,00	12.110,58	4.757,14578638	2,5457660000
10/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	11.111,42	0,00	4.364,66666614	2,5457660000
10/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	23.703,42	0,00	9.310,91859975	2,5457660000
11/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	154.437,05	0,00	60.712,42541023	2,5437470000
27/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,00	540.000,00	211.427,33418713	2,5540690000
27/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,00	70.000,00	27.407,24702426	2,5540690000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
27/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,00	60.000,00	23.491,92602079	2,5540690000
31/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	660.671,36	0,00	258.453,24265888	2,5562510000
31/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	1.031.499,21	0,00	403.520,31549328	2,5562510000
31/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	105.937,60	0,00	41.442,56569484	2,5562510000

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	0,77	0,10	0,53	3.043.472,93	2,30
FIDC GGR PRIME I	Artigo 7º VII, Alínea a	1,06	0,10	-0,31	1.950.910,27	1,47
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,30	0,16	0,59	5.432.506,62	4,10
BB PREVID RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	1,31	0,16	0,60	5.036.363,39	3,80
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	11,57	1,13	-1,45	6.803.222,04	5,14
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	12,01	1,17	-1,66	12.504.475,09	9,44
BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	14,36	1,41	-1,79	12.872.261,61	9,72
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	14,42	1,41	-1,80	10.997.299,31	8,31
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	16,18	1,67	-0,13	23.413.085,85	17,68
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	Artigo 7º IV, Alínea a	19,01	1,87	-2,11	15.821.088,89	11,95
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	21,37	1,97	-5,31	9.036.260,01	6,82
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	35,19	3,31	-7,10	5.246.111,51	3,96
CARE11	Artigo 8º IV, Alínea b	35,97	3,24	-10,08	2.416.127,41	1,82
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	Artigo 8º II, Alínea a	110,36	9,82	-29,90	1.869.083,36	1,41
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	112,93	10,27	-27,05	4.506.346,02	3,40
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA	Artigo 8º II, Alínea a	117,68	10,50	-31,14	1.013.213,85	0,77
BRADESCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	122,33	10,95	-31,54	1.637.827,33	1,24
BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	Artigo 8º II, Alínea a	122,94	11,09	-30,43	2.460.963,34	1,86
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	144,72	12,53	-41,88	853.586,76	0,64