



CAMPO MOURÃO
4º 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 08.01.2021.

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 **73,19%**

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	0,57	0,20	0,31	5.124.253,84	3,29	7.844.641.875,20	0,07
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,85	1,99	2,19	5.674.011,66	3,64	5.938.047.265,27	0,10
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,55	0,22	0,36	8.815.085,61	5,66	13.835.706.591,01	0,06
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,04	1,29	1,47	11.712.584,38	7,52	19.732.912.783,40	0,06
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,21	1,34	1,67	13.380.366,16	8,59	7.802.150.183,83	0,17
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,14	1,22	1,37	7.259.751,41	4,66	10.336.804.140,67	0,07
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	5,01	1,31	1,50	13.710.227,37	8,81	4.474.614.326,56	0,31
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,97	0,82	0,71	24.329.502,75	15,63	14.161.450.965,39	0,17
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			5,09	1,04	1,16	90.005.783,18	57,81		

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	1,67	0,10	0,18	3.089.309,96	1,98	4.356.779.873,38	0,07
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	6,91	0,78	0,50	19.126.979,48	12,29	1.395.017.754,92	1,37
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			6,19	0,68	0,45	22.216.289,44	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	14,38	0,07	0,16	1.731.702,47	1,11	155.949.732,16	1,11
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a			14,38	0,07	0,16	1.731.702,47	1,11		
Renda Fixa			5,19	0,96	1,02	113.953.775,09	73,19		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

26,81%

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	44,33	8,19	11,80	2.432.515,80	1,56	767.879.921,64	0,32
CONSTÂNCIA	BEM	CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA	42,41	14,01	12,94	1.397.712,35	0,90	288.791.292,45	0,48
BRAM	BRADESCO	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	44,27	13,66	13,42	3.693.389,47	2,37	216.730.256,69	1,70
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	52,67	13,92	9,17	1.163.893,52	0,75	1.529.783.249,31	0,08
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	42,06	16,98	19,58	6.589.579,24	4,23	1.030.661.876,76	0,64
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	42,37	11,85	12,65	5.886.584,44	3,78	270.703.494,73	2,17
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			44,86	13,50	14,56	21.163.674,82	13,59		

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	7,89	2,84	2,49	13.145.455,84	8,44	4.976.097.187,78	0,26
Sub-total Artigo 8º III			7,89	2,84	2,49	13.145.455,84	8,44		

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 MULTISTRATÉGIA	1,01	-0,17	-0,34	3.110.068,14	2,00	134.598.706,26	2,31
LEGATUS	DAYCOVAL	FIP LA SHOPPING CENTERS	9,32	-0,15	-0,39	2.532.181,74	1,63	244.931.003,25	1,03
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			4,28	-0,16	-0,37	5.642.249,88	3,62		

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	52,81	0,00	1,28	1.783.869,77	1,15	250.723.762,71	0,71
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			52,81	0,00	1,28	1.783.869,77	1,15		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			23,00	7,34	7,72	41.735.250,31	26,81		
--	--	--	--------------	-------------	-------------	----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Total

8,69

2,62

2,75

155.689.025,40

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	90.005.783,18	57,81	20,00	30,00	90,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	22.216.289,44	14,27	10,00	30,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	1.731.702,47	1,11	0,00	0,00	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	113.953.775,09	73,19				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	21.163.674,82	13,59	7,00	12,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	13.145.455,84	8,44	7,00	8,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	5.642.249,88	3,62	0,00	4,30	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.783.869,77	1,15	0,00	2,70	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	41.735.250,31	26,81				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

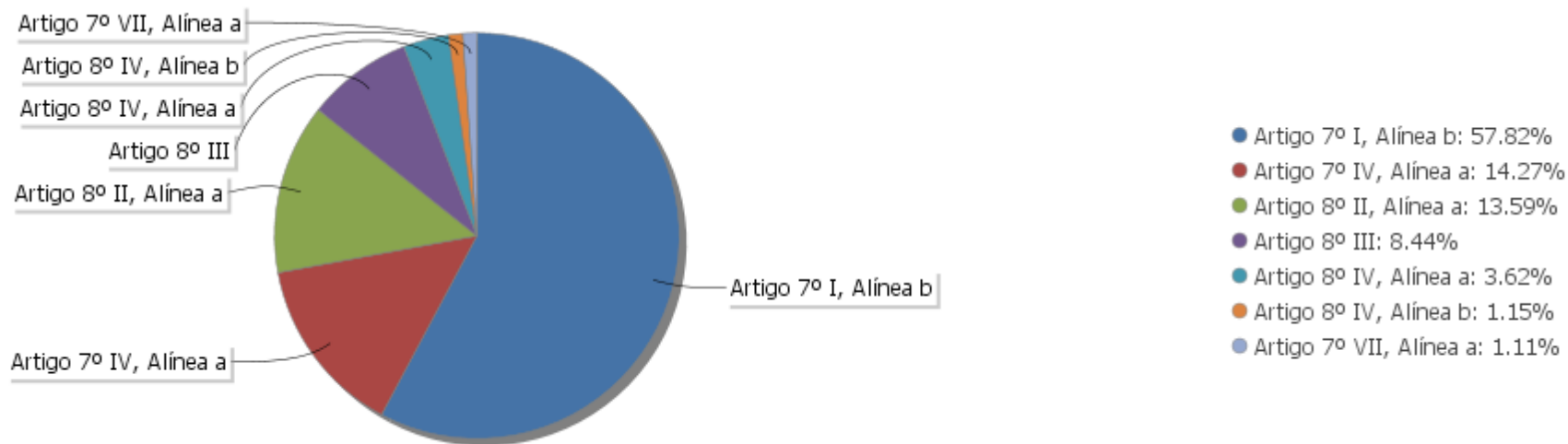
Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,04 698,17	1,16 378,43	0,92 197,23	2,95 284,98		927.828,02	1.031.644,54
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,68 451,80	0,45 147,61	-0,42 -89,45	1,22 118,16		131.437,69	89.407,51
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	0,07 45,11	0,16 53,36	0,04 7,82	0,76 73,86		1.167,12	2.829,28
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	13,50 -2,40	14,56 -0,55	9,73 0,15	23,42 -1,17		2.485.538,95	2.646.260,72
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	2,84 -13,06	2,49 -12,61	1,56 -8,03	4,13 -20,45		362.981,59	317.818,67
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,16 -16,06	-0,37 -15,47	-0,53 -10,12	3,09 -21,49		-9.118,59	-20.733,46
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	0,00 -15,90	1,28 -13,82	-12,22 -21,81	14,49 -10,10		0,00	22.580,63
CAMPO MOURÃO (Total)						3.899.834,78	4.089.807,89

Análise de Liquidez

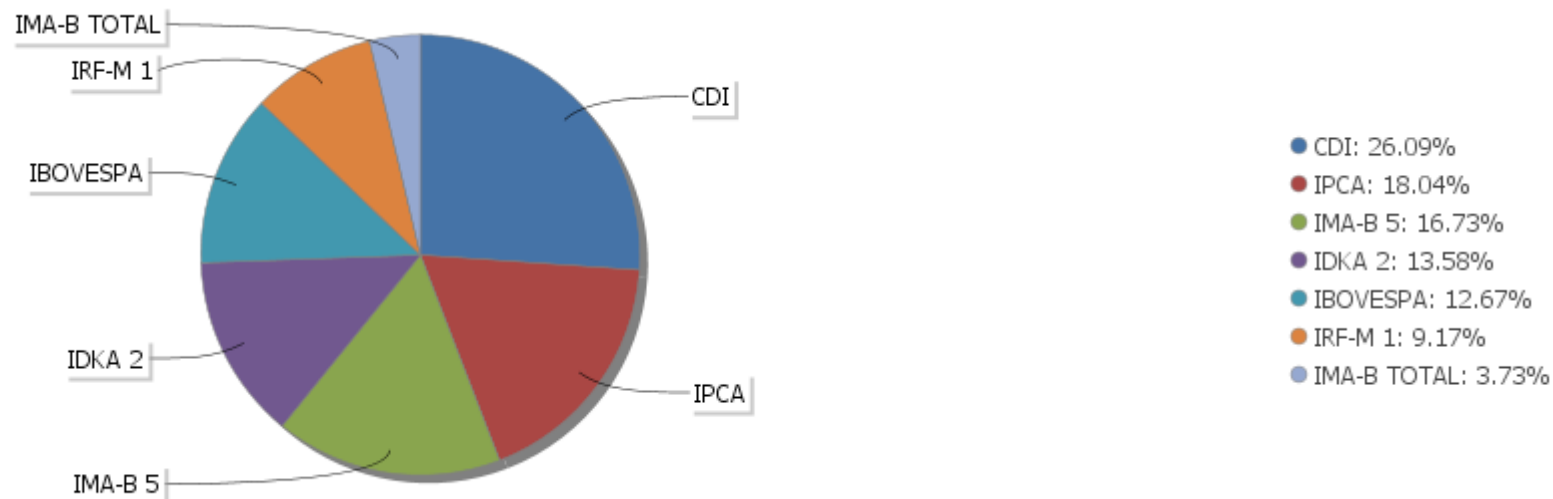
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	141.725.493,81	91,03	141.725.493,81	91,03
de 31 a 364 dias	6.589.579,24	4,23	148.315.073,05	95,26
acima de 365 dias	7.373.952,35	4,74	155.689.025,40	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

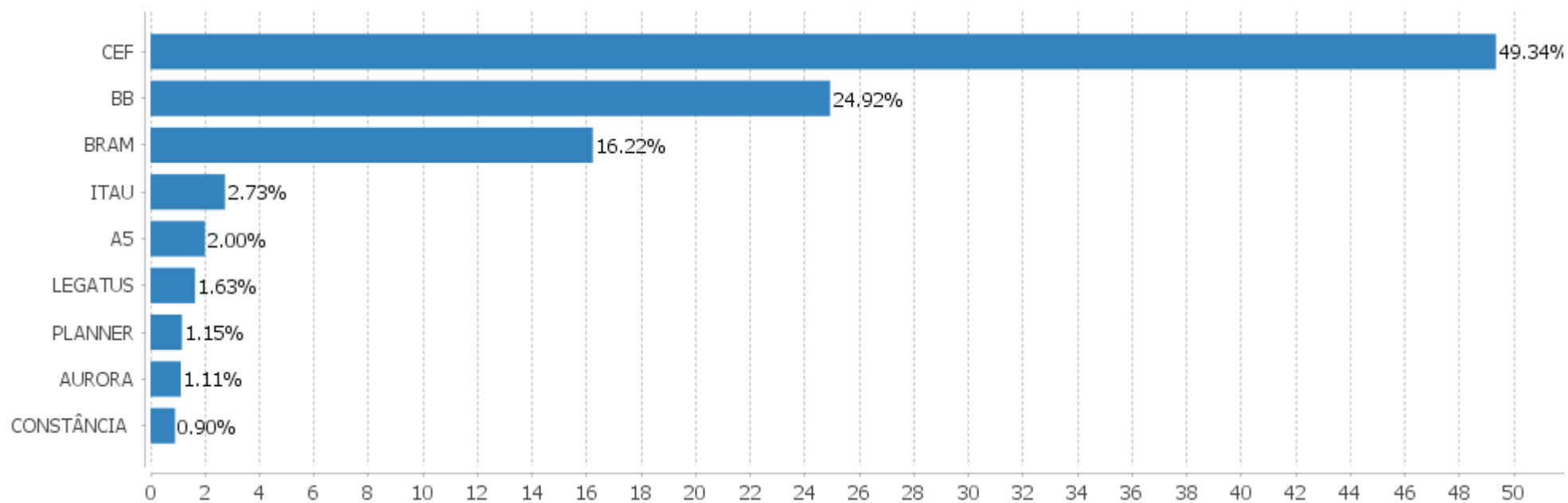


Alocação Por Estratégia



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		1,57
IPCA + 6%	0,72	0,67	0,58	0,15	0,08	0,75	0,90	0,73	1,13	1,35	1,36		8,73
p.p. indexador	-0,59	-1,55	-6,07	0,96	1,73	0,97	1,41	-1,34	-2,17	-1,22	1,26		-7,17

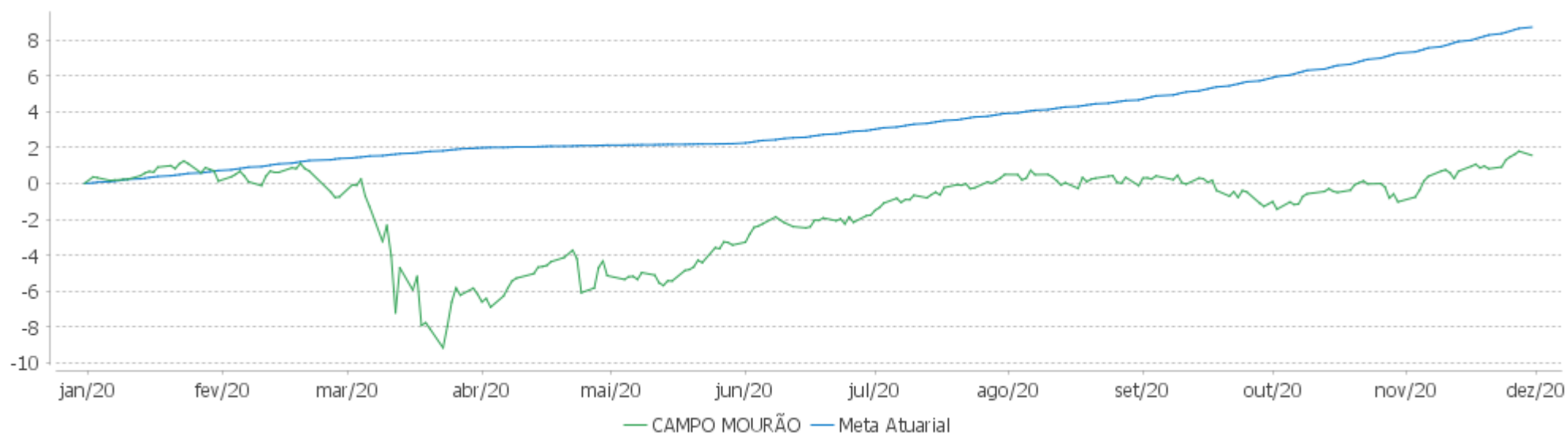
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

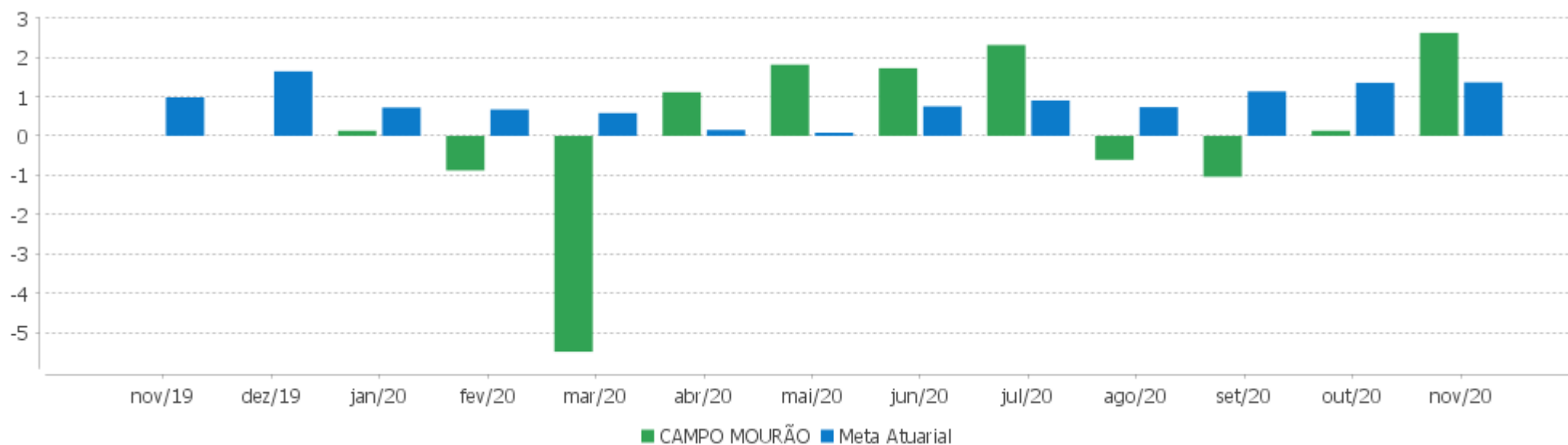
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	5	45,45	03 meses	1,68	3,89	-2,20	4,40
Meses abaixo da Meta Atuarial	6	54,55	06 meses	5,18	6,37	-1,19	4,07
			12 meses				
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,62	2020-11	Desde 31/12/2019	1,57	8,73	-7,17	8,69
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 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,99 -0,01	2,19 -0,03	0,62 -0,05	5,19 -0,12	3,18 -0,34	26,04 -0,79	41,07 -1,17
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,29 -0,03	1,47 -0,05	1,31 -0,09	3,83 -0,16	7,10 -0,31	21,07 -0,62	32,11 -0,96
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,34 0,09	1,67 0,38	1,79 0,48	4,57 0,23	7,52 -0,53	19,65 -1,24	30,22 -2,34
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,20 -0,03	0,31 -0,08	0,35 -0,19	0,93 -0,25	3,56 -0,40	10,43 -0,70	17,92 -0,98
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,82 -0,07	0,71 -1,05	0,20 -2,20	1,37 -1,92	5,90 1,59	24,20 16,47	33,20 21,12
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,31 -0,01	1,50 -0,02	1,35 -0,05	3,81 -0,18	7,13 -0,28	21,12 -0,57	32,19 -0,88
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,22 -0,03	1,37 0,08	1,41 0,10	4,27 -0,06	7,44 -0,61	19,53 -1,35	30,28 -2,28
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,22 -0,01	0,36 -0,03	0,49 -0,05	1,09 -0,09	3,75 -0,20	10,70 -0,43	18,27 -0,63
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,10 -0,79	0,18 -1,58	-0,05 -2,46	0,82 -2,48	3,01 -1,30	16,62 8,89	25,32 13,23
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA % do CDI	0,78 523,92	0,50 164,04	-0,49 -104,51	1,30 125,53	2,99 100,71	16,24 175,81	
FIDC GGR PRIME I % do CDI	0,07 45,11	0,16 53,36	0,04 7,82	0,76 73,86	-2,67 -89,85	-12,02 -130,12	-26,49 -162,45
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA % do CDI	-0,17 -112,52	-0,34 -112,31	-0,52 -112,19	-1,09 -105,70	-2,04 -68,77	-4,12 -44,64	
FIP LA SHOPPING CENTERS % do CDI	-0,15 -102,30	-0,39 -128,05	-0,54 -116,86	8,75 845,90	7,82 262,95	20,25 219,13	
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE Var. IBOVESPA p.p.	11,85 -4,05	12,65 -2,45	9,87 0,28	21,49 -3,10	6,82 6,21		
BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	13,66	13,42	8,55	24,23	2,68	28,19	63,71
BRADESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	8,19 -7,71	11,80 -3,31	8,74 -0,85	28,88 4,29	-4,31 -4,92	14,22 -7,45	51,90 0,60
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	13,92 -1,98	9,17 -5,93	0,40 -9,18	14,40 -10,19	-19,60 -20,21	5,77 -15,90	35,90 -15,40

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA Var. IBOVESPA p.p.	14,01 -1,89	12,94 -2,16	6,00 -3,58	17,48 -7,11	-5,73 -6,34	15,08 -6,59	49,51 -1,79
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	16,98 1,07	19,58 4,47	13,87 4,29	25,52 0,93	4,15 3,54	34,45 12,79	
CARE11 Var. IBOVESPA p.p.	0,00 -15,90	1,28 -13,82	-12,22 -21,81	14,49 -10,10	-24,76 -25,37	-57,07 -78,73	-60,50 -111,80
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP % do CDI	2,84 1.899,57	2,49 812,17	1,56 335,85	4,13 399,72	3,91 131,54	21,35 231,05	33,33 204,42
CAMPO MOURÃO Var. IPCA + 6% p.p.	2,62 1,26	2,75 0,02	1,68 -2,20	5,18 -1,19			
CDI	0,15	0,31	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
IBOVESPA	15,90	15,11	9,58	24,59	0,61	21,66	51,30
INPC + 6%	1,42	2,82	4,22	6,96	11,46	22,12	33,99
IPCA + 6%	1,36	2,73	3,89	6,37	10,52	20,99	33,37

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	0,23	0,39	0,54	1,19	3,95	11,13	18,89
IRF-M 1+	0,46	-0,15	-1,06	0,29	6,00	22,54	36,94
IRF-M TOTAL	0,36	0,03	-0,53	0,58	5,30	19,04	31,44
IMA-B 5	1,32	1,52	1,40	3,99	7,41	21,69	33,06
IMA-B 5+	2,59	2,81	0,14	6,53	0,68	30,33	48,80
IMA-B TOTAL	2,00	2,22	0,67	5,31	3,52	26,83	42,23
IMA-C TOTAL	1,94	4,81	7,90	19,17	23,94	48,54	75,37
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,70	0,69	-0,02	1,86	3,60	17,00	28,09
IMA-GERAL TOTAL	0,73	0,82	0,22	2,35	4,17	17,84	29,30
IDKA 2	1,25	1,29	1,31	4,33	8,05	20,89	32,56
IDKA 20	3,37	4,08	-0,40	9,06	-4,60	35,17	60,63
CDI	0,15	0,31	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
Renda Variável							
IBOVESPA	15,90	15,11	9,58	24,59	0,61	21,66	51,30
IBRX 100	15,46	14,83	9,57	25,07	1,72	24,85	55,25
IBRX 50	16,21	15,58	10,24	25,90	0,92	19,73	48,77
SMALL CAP	16,64	13,98	7,78	33,38	4,09	49,24	69,17
IFIX	1,51	0,49	0,95	5,68	-2,83	22,09	26,91
Índice Consumo - ICON	8,93	5,82	1,63	18,62	3,72	48,84	43,97
Índice Dividendos - IDIV	14,40	15,14	9,82	21,30	-0,05	32,77	60,52
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,89	1,76	2,41	3,29	4,31	7,73	12,09
INPC	0,95	1,85	2,73	3,87	5,20	8,74	12,61
IGPM	3,28	6,61	11,24	18,66	24,52	29,46	41,99
SELIC	0,15	0,31	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

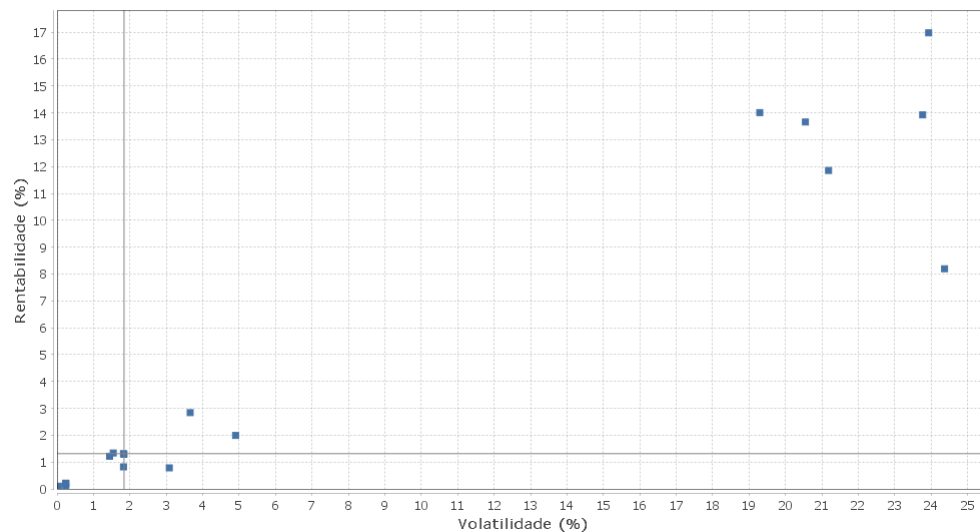
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
68	01/10/2020	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	1.034.961,13	0,00	310.665,07636100	3,3314370000
67	02/10/2020	BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	247.656,46	0,00	199.159,39477060	1,2435088000
64	07/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.256,00	3.566,04710100	2,5955910000
65	08/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	124.996,02	0,00	48.132,72578900	2,5969030000
61	08/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	101.807,28	39.203,34337000	2,5969030000
62	29/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	430.000,00	165.379,97197700	2,6000730000
69	29/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	56.000,00	21.537,85702600	2,6000730000
63	30/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	689.230,31	0,00	265.089,39642800	2,5999920000
66	30/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	42.475,98	0,00	16.336,96565200	2,5999920000
71	03/11/2020	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	1.256.294,18	0,00	1.212.933,03686500	1,0357490000
80	10/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	51.000,00	19.593,25926300	2,6029360000
75	10/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	140.342,42	0,00	53.916,96914500	2,6029360000
76	10/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.740.000,00	668.475,90228700	2,6029360000
73	10/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.204,58	0,00	1.231,14052700	2,6029360000
81	26/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	80.000,00	30.709,19433600	2,6050830000
77	26/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	352.008,51	135.123,72155700	2,6050830000
70	27/11/2020	BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	2.505.156,49	0,00	1.991.296,30537850	1,2580531000
79	30/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.119,44	0,00	11.559,51148200	2,6055980000
78	30/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	35.515,02	0,00	13.630,27604400	2,6055980000
74	30/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.313.289,76	0,00	504.026,23889000	2,6055980000
72	30/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	142.852,92	0,00	54.825,38749200	2,6055980000

Total

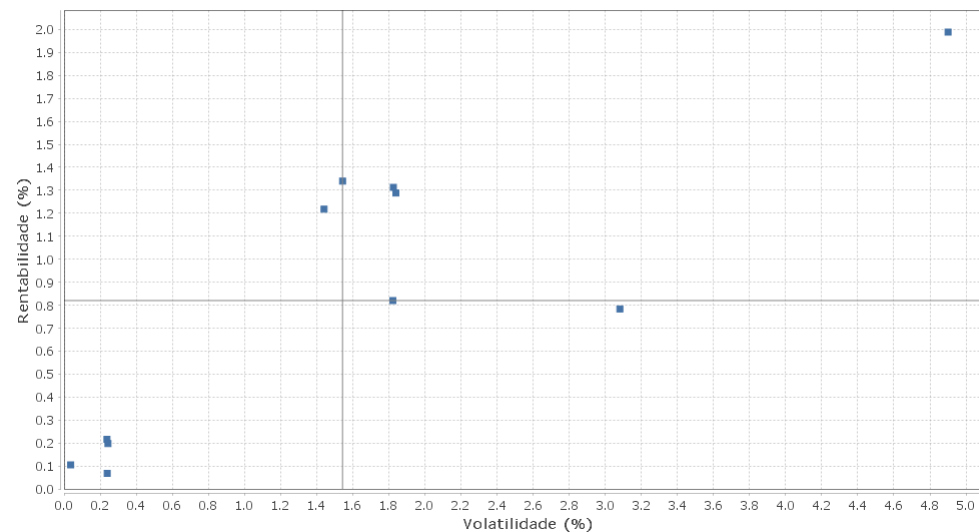
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

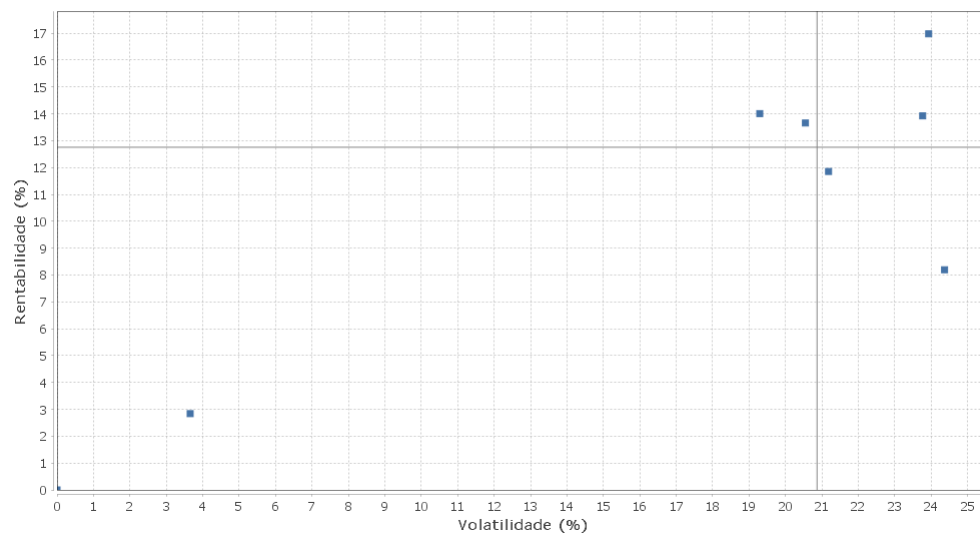
CAMPO MOURÃO - No Mês



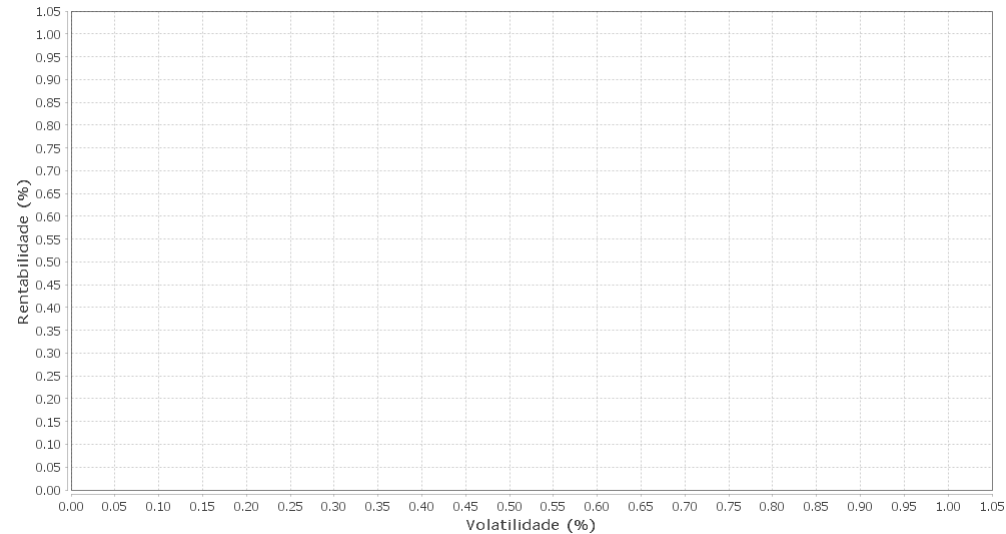
Renda Fixa - No Mês



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\$): 3.113.217,89

Value-At-Risk: 2,00%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CARE11	Artigo 8º IV, Alínea b	0,00	0,49	-0,00	0,00	0,00	1.783.869,77	1,15
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,30	0,00	-1,23	0,10	3.089.309,96	1,98
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,24	0,16	0,01	0,28	0,22	8.815.085,61	5,66
FIDC GGR PRIME I	Artigo 7º VII, Alínea a	0,24	0,02	-0,00	-0,34	0,07	1.731.702,47	1,11
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,24	0,17	0,00	0,20	0,20	5.124.253,84	3,29
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,44	1,07	0,03	0,74	1,22	7.259.751,41	4,66
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,54	0,91	0,05	0,77	1,34	13.380.366,16	8,59
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,82	1,23	0,15	0,37	0,82	24.329.502,75	15,63
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,83	0,99	0,06	0,64	1,31	13.710.227,37	8,81
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,84	1,03	0,06	0,62	1,29	11.712.584,38	7,52
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	Artigo 7º IV, Alínea a	3,08	1,38	0,13	0,21	0,78	19.126.979,48	12,29
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	3,66	1,79	0,15	0,74	2,84	13.145.455,84	8,44
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,90	2,67	0,07	0,38	1,99	5.674.011,66	3,64
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA	Artigo 8º II, Alínea a	19,29	9,90	0,08	0,72	14,01	1.397.712,35	0,90
BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	Artigo 8º II, Alínea a	20,55	10,05	0,22	0,66	13,66	3.693.389,47	2,37
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	Artigo 8º II, Alínea a	21,18	10,57	0,36	0,55	11,85	5.886.584,44	3,78
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	23,76	13,18	0,09	0,58	13,92	1.163.893,52	0,75
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	23,93	9,79	0,38	0,70	16,98	6.589.579,24	4,23
BRADESCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	24,37	10,95	0,14	0,33	8,19	2.432.515,80	1,56