



LDB
EMPRESAS

SÃO VICENTE
NOVEMBRO 2019



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 83,85%

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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	4,70	-1,78	21,13	4.036.225,09	3,09	6.434.387.679,23	0,06
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,70	-1,84	21,07	23.727.866,31	18,19	6.978.131.282,89	0,34
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,24	0,26	6,06	18.983.395,88	14,55	10.982.338.275,44	0,17
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,01	-0,61	11,48	66.029,09	0,05	1.439.024.027,53	0,00
ITAU	ITAU	ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	6,95	-2,99	27,97	3.376.333,79	2,59	91.418.668,19	3,69
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,94	-3,05	27,97	13.414.351,36	10,28	3.101.394.294,25	0,43
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,47	0,12	10,10	9.093.292,27	6,97	8.688.260.006,18	0,10
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,29	-0,75	12,20	12.030.940,89	9,22	9.398.156.149,22	0,13
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	4,93	-2,07	22,56	1.840.681,00	1,41	67.761.475,20	2,72
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,34	-1,27	16,34	86.569.115,68	66,36		

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
BRAM	BRDESCO	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,04	0,26	5,37	743.355,25	0,57	5.404.232.666,95	0,01
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	5,13	-2,05	4,62	1.086.921,20	0,83	293.098.457,05	0,37
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,03	0,29	3,32	645.803,18	0,50	14.764.674.278,80	0,00
BRAM	BRDESCO	BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	6,97	-3,01	28,08	3.396.200,29	2,60	347.365.903,19	0,98
BRAM	BRDESCO	BRDESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,02	-0,23	11,73	14.664.191,08	11,24	830.718.392,08	1,77
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	2,10	0,28	2,21	2.149.833,49	1,65	5.220.119.780,33	0,04
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			2,61	-0,66	13,82	22.686.304,49	17,39		

Artigo 7º VII, Alínea b (Fundos Renda Fixa "Crédito Privado")

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	0,06	0,23	5,30	135.833,64	0,10	1.542.288.386,85	0,01
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			0,06	0,23	5,30	135.833,64	0,10		
Renda Fixa			3,19	-1,14	15,85	109.391.253,81	83,85		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

16,15%

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	BRDESCO	BRDESCO FIA DIVIDENDOS	17,44	0,44	15,83	2.534.752,90	1,94	2.835.112.829,70	0,09
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST ACOES FIC FIA	18,98	-0,33	19,93	285.911,00	0,22	904.003.875,78	0,03
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	16,09	3,71	38,17	5.075.847,22	3,89	200.337.482,31	2,53
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	17,14	0,12	29,74	3.674.567,84	2,82	1.595.055.941,12	0,23
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	14,38	0,94	33,54	3.706.084,19	2,84	306.966.931,93	1,21
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			15,63	1,49	30,54	15.277.163,15	11,71		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SAFRA	SAFRA	SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	0,88	0,15	5,74	2.356.655,99	1,81	1.527.033.684,58	0,15
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	14,24	3,37	28,10	3.432.356,88	2,63	370.641.914,64	0,93
Sub-total Artigo 8º III			5,87	2,04	14,04	5.789.012,87	4,44		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			12,36	1,67	25,84	21.066.176,02	16,15		
Total			3,95	-0,70	17,16	130.457.429,83	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	86.569.115,68	66,36	0,00	60,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	22.686.304,49	17,39	0,00	10,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	135.833,64	0,10	0,00	2,00	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	109.391.253,81	83,85				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	15.277.163,15	11,71	0,00	10,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	5.789.012,87	4,44	0,00	3,00	10,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	21.066.176,02	16,15				30,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

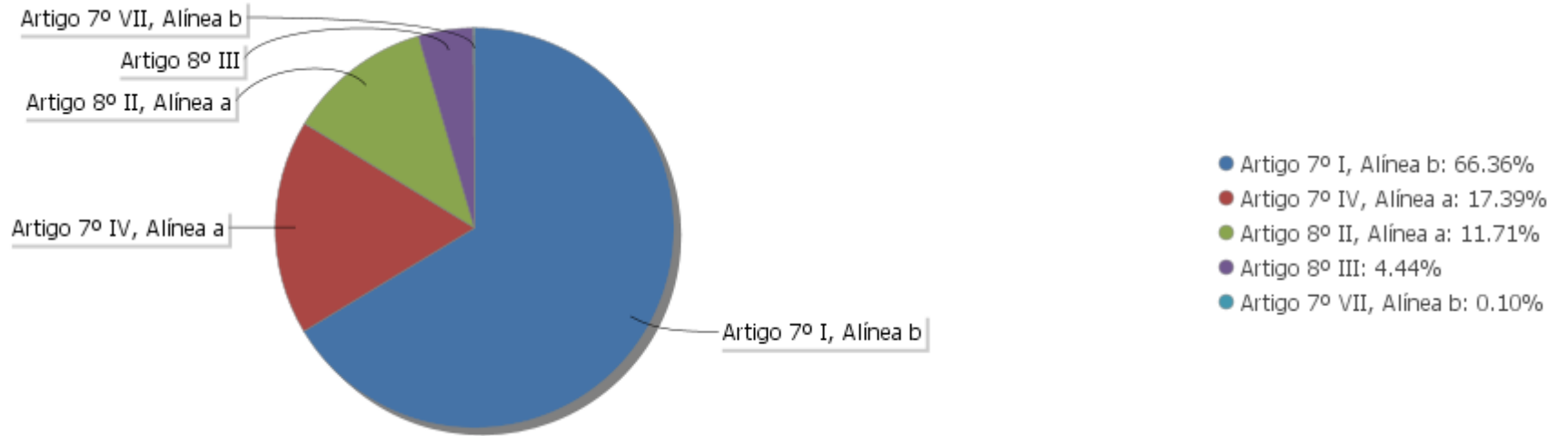
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-1,27 -417,41	16,34 298,01	3,44 274,51	7,29 258,71	17,94 298,69	-1.114.271,43	11.881.786,04
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,66 -218,28	13,82 251,96	3,37 269,40	6,64 235,58	15,40 256,54	-151.518,46	2.358.618,34
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,23 75,57	5,30 96,57	1,15 91,87	2,72 96,42	5,81 96,76	311,52	6.832,31
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	1,49 0,37	30,54 7,18	6,42 -0,79	15,82 4,08	33,07 11,93	230.138,38	2.973.493,22
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	2,04 0,91	14,04 -9,32	4,98 -2,23	9,18 -2,57	11,38 -9,76	115.567,12	551.708,11
SÃO VICENTE - CONSOLIDADO (Total)						-919.772,87	17.772.438,02

Análise de Liquidez

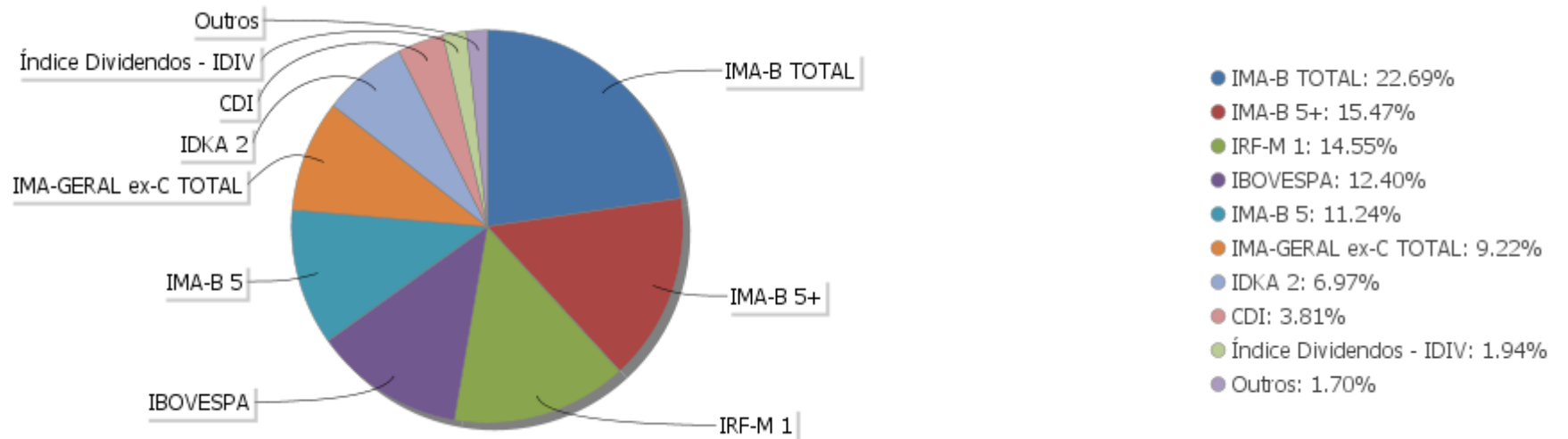
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	126.782.861,99	97,18	126.782.861,99	97,18
de 31 a 364 dias	3.674.567,84	2,82	130.457.429,83	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	130.457.429,83	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

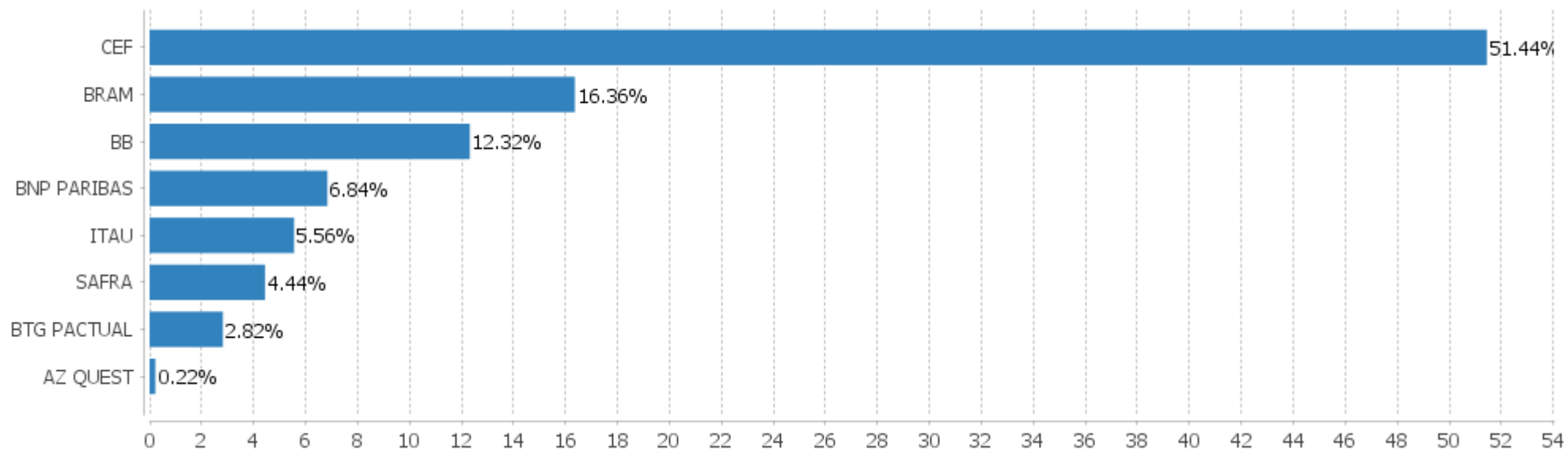


Alocação Por Estratégia



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
2019	3,68	0,35	0,43	1,28	2,33	2,92	1,33	-0,10	2,15	2,38	-0,70		17,16
INPC + 6%	0,87	1,01	1,21	1,09	0,66	0,45	0,63	0,63	0,44	0,57	0,80		8,69
p.p. indexador	2,81	-0,66	-0,78	0,19	1,67	2,47	0,69	-0,73	1,72	1,81	-1,51		8,46
2018	1,94	0,51	0,85	0,19	-2,24	-0,23	1,89	-0,53	0,08	5,08	0,90	1,26	9,96
INPC + 6%	0,74	0,60	0,56	0,70	0,92	1,92	0,76	0,53	0,74	0,91	0,21	0,60	9,59
p.p. indexador	1,20	-0,08	0,29	-0,51	-3,16	-2,15	1,13	-1,07	-0,66	4,16	0,69	0,66	0,37
2017	1,43	2,24	1,15	0,15	-0,53	0,43	2,86	1,21	1,36	0,03	-0,23	0,89	11,50
INPC + 6%	0,93	0,66	0,85	0,50	0,87	0,19	0,66	0,50	0,44	0,86	0,64	0,72	8,12
p.p. indexador	0,50	1,58	0,29	-0,34	-1,40	0,24	2,21	0,71	0,91	-0,83	-0,88	0,16	3,39

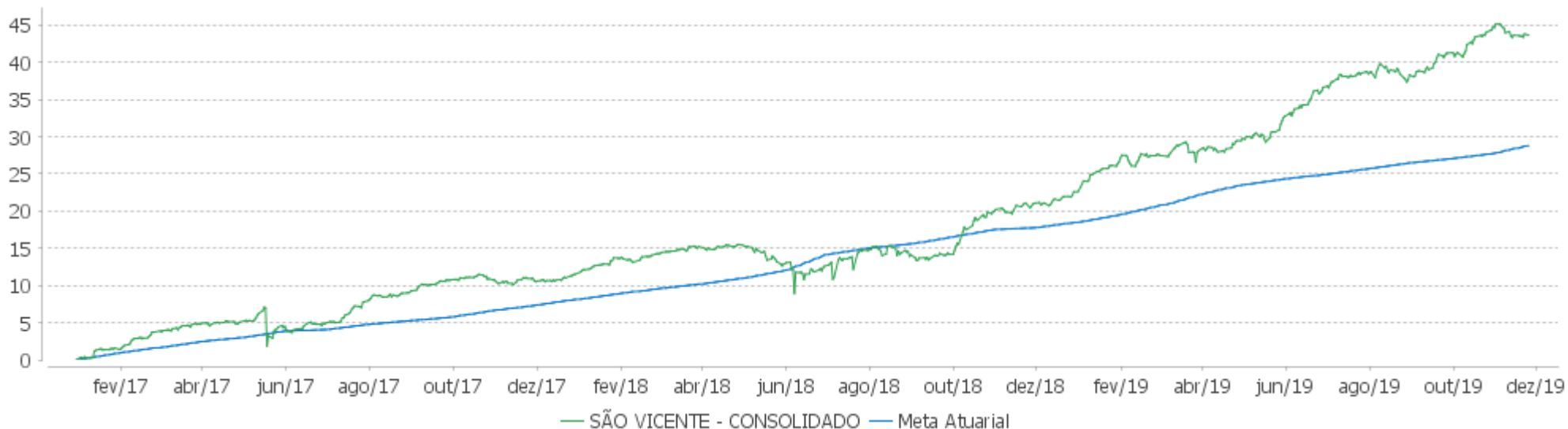
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

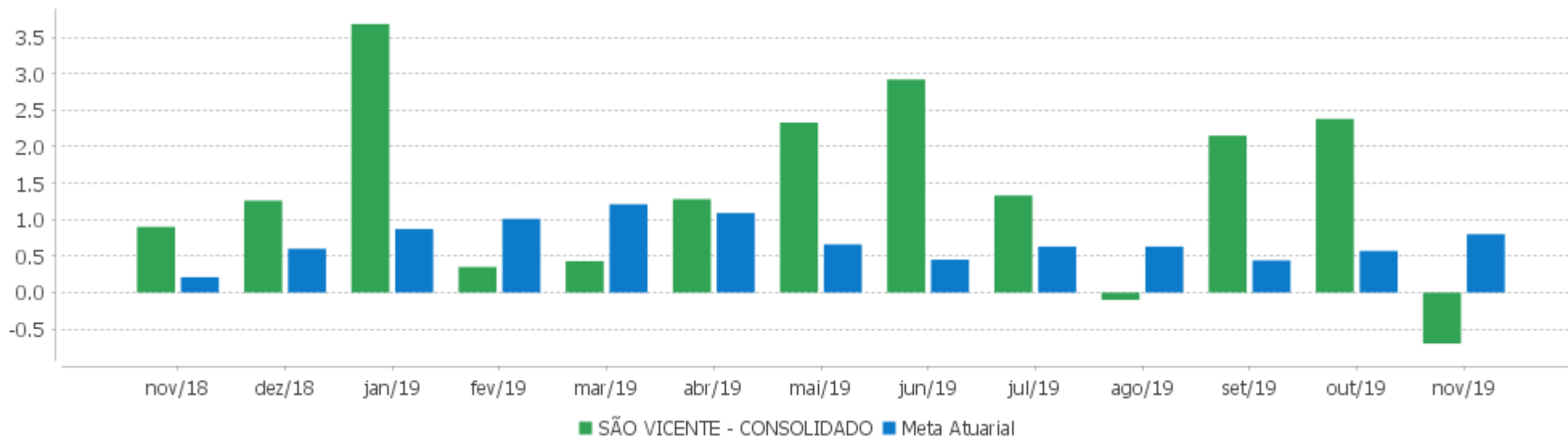
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	21	60,00	03 meses	3,85	1,82	2,02	3,52
Meses abaixo da Meta Atuarial	14	40,00	06 meses	8,19	3,58	4,61	3,82
			12 meses	18,64	9,35	9,29	3,95
			24 meses	29,96	19,98	9,98	5,42
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	5,08	2018-10	Desde 30/12/2016	43,64	28,78	14,85	5,63
Menor rentabilidade da Carteira	-2,24	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
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,84 -0,07	21,07 -0,31	4,32 -0,12	9,09 -0,21	23,04 -0,34	37,71 -0,66	58,18 -1,11
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,07 -0,30	22,56 1,18	4,28 -0,17	9,22 -0,07	24,30 0,92	40,34 1,97	53,25 -6,05
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,75 -0,18	12,20 0,45	2,55 -0,04	5,93 0,18	13,52 0,44	24,43 0,62	41,10 -0,10
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,12 -0,03	10,10 -0,55	2,84 -0,16	5,15 -0,27	11,37 -0,66	21,39 -1,46	36,85 -2,88
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,78 -0,02	21,13 -0,26	4,40 -0,04	9,20 -0,09	23,08 -0,30	37,69 -0,68	58,13 -1,17
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,26 -0,01	6,06 -0,19	1,50 -0,05	3,33 -0,10	6,64 -0,20	13,92 -0,38	27,15 -0,66
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,61 -0,03	11,48 -0,49	2,53 -0,08	5,61 -0,24	12,77 -0,51	23,28 -1,02	40,23 -1,38
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-3,05 -0,06	27,97 -0,53	5,20 -0,13	11,25 -0,21	30,28 -0,64	48,25 -1,22	71,57 -1,85
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI Var. IMA-B 5+ p.p.	-2,99 -0,01	27,97 -0,53	5,24 -0,09	11,24 -0,22	30,31 -0,60	47,89 -1,57	70,70 -2,72
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	-0,23 -0,09	11,73 -0,21	3,24 -0,04	6,04 -0,09	13,26 -0,21	23,55 -0,53	39,95 -0,43
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,26 86,31	5,37 97,93	1,18 94,35	2,74 97,08	5,88 97,96	12,64 98,25	25,02 100,97
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	-2,05 -673,61	22,90 417,53	4,67 372,52	10,23 363,12	25,03 416,84	39,58 307,72	59,91 241,71
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI % do CDI	0,29 96,82	5,35 97,54	1,22 97,44	2,75 97,55	5,86 97,54	12,54 97,49	24,37 98,35
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+ Var. IMA-B 5+ p.p.	-3,01 -0,03	28,08 -0,43	5,29 -0,04	11,29 -0,17	30,45 -0,47	48,47 -0,99	71,81 -1,61
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,28 -0,13	11,45 8,44	1,57 1,10	5,47 4,69	13,14 9,97	21,57 14,23	39,03 28,67
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV % do CDI	0,23 75,57	5,30 96,57	1,15 91,87	2,72 96,42	5,81 96,76	12,43 96,63	24,41 98,49
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	0,44	15,83	4,77	7,10	16,12	48,45	81,57

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-1,68	-15,85	-0,86	-7,32	-16,41	-11,78	-8,05
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,12 -1,00	29,74 6,37	3,75 -3,46	15,97 4,23	33,48 12,34	64,70 14,05	
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	0,94 -0,18	33,54 10,18	9,18 1,98	13,02 1,28	34,98 13,84	43,95 -6,70	65,80 -9,35
AZ QUEST ACOES FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-0,33 -1,46	19,93 -3,43	3,91 -3,30	12,75 1,01	19,90 -1,24	60,71 10,06	85,04 9,89
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	3,71 2,58	38,17 14,81	7,79 0,59	23,59 11,85	43,25 22,11	49,02 -1,63	102,51 27,37
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO % do CDI	0,15 49,78	5,74 104,75	1,40 112,11	3,13 110,99	6,12 101,99	12,90 100,31	26,04 105,08
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	3,37 2,25	28,10 4,73	7,85 0,65	15,46 3,72	17,57 -3,57	26,92 -23,73	67,54 -7,60
SÃO VICENTE - CONSOLIDADO Var. INPC + 6% p.p.	-0,70 -1,51	17,16 8,46	3,85 2,02	8,19 4,61	18,64 9,29	29,96 9,98	
CDI	0,30	5,48	1,25	2,82	6,00	12,86	24,78
IBOVESPA	1,12	23,37	7,21	11,74	21,14	50,65	75,14
INPC + 6%	0,80	8,69	1,82	3,58	9,35	19,98	29,62
IPCA + 6%	0,78	8,59	1,87	3,71	9,26	20,44	31,22

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	0,27	6,25	1,55	3,43	6,84	14,30	27,81
IRF-M 1+	-0,97	13,27	3,13	7,38	15,45	29,02	51,50
IRF-M TOTAL	-0,57	11,21	2,57	6,20	12,92	24,68	44,48
IMA-B 5	-0,13	11,94	3,28	6,13	13,47	24,07	40,39
IMA-B 5+	-2,98	28,50	5,33	11,46	30,92	49,47	73,42
IMA-B TOTAL	-1,77	21,38	4,44	9,30	23,39	38,37	59,29
IMA-C TOTAL	-0,89	19,25	3,47	9,25	20,17	41,87	57,42
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,57	11,76	2,58	5,75	13,08	23,80	41,20
IMA-GERAL TOTAL	-0,58	11,97	2,61	5,85	13,28	24,29	41,62
IDKA 2	0,15	10,64	3,00	5,42	12,03	22,84	39,73
IDKA 20	-4,38	41,21	5,97	13,67	44,16	71,32	104,36
CDI	0,30	5,48	1,25	2,82	6,00	12,86	24,78
Renda Variável							
IBOVESPA	1,12	23,37	7,21	11,74	21,14	50,65	75,14
IBRX 100	1,08	24,49	6,63	12,11	22,88	52,80	78,59
IBRX 50	0,95	21,33	6,97	10,69	18,77	47,57	71,28
SMALL CAP	3,69	38,49	8,26	24,24	41,39	60,27	122,45
IFIX	2,89	22,15	8,13	12,53	24,87	29,80	56,36
Índice Consumo - ICON	2,16	42,56	2,79	22,18	42,34	37,69	68,82
Índice Dividendos - IDIV	2,12	31,68	5,63	14,42	32,53	60,24	89,62
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,41	3,02	0,47	0,78	3,17	7,34	10,35
INPC	0,43	3,11	0,42	0,65	3,26	6,93	9,01
IGPM	0,24	5,04	0,91	1,44	3,91	13,96	12,98
SELIC	0,30	5,48	1,25	2,82	6,00	12,87	24,81
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

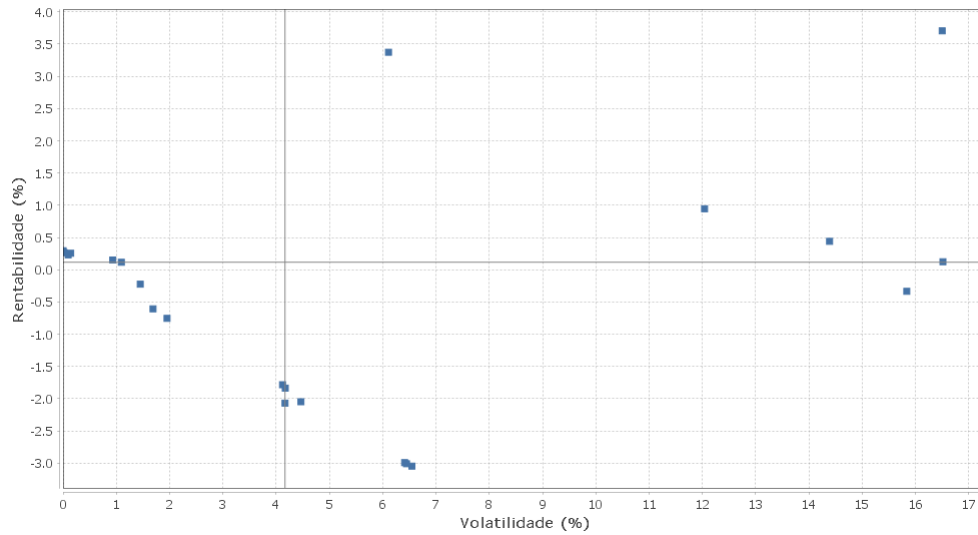
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
55	04/11/2019	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	126.471,04	0,00	2.673,67706766	47,3022870000
56	08/11/2019	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	53.200,00	1.123,85624653	47,3370150000
57	12/11/2019	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	14.637,84	0,00	309,11237468	47,3544290000
58	18/11/2019	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	484.965,02	0,00	1.392,64957800	348,2319082000
59	18/11/2019	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	484.965,02	0,00	1.387,83469200	349,4400470000
60	20/11/2019	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.474,14	2.580,80795800	2,5085710000
61	20/11/2019	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	45.720,00	18.225,51564217	2,5085710000
62	20/11/2019	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	45.718,68	964,56999623	47,3979910000
63	21/11/2019	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	30.194,64	12.036,59455387	2,5085700000
64	21/11/2019	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	45.720,00	0,00	964,42049856	47,4067070000
65	25/11/2019	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	36.668,78	0,00	773,20902479	47,4241490000
Total						

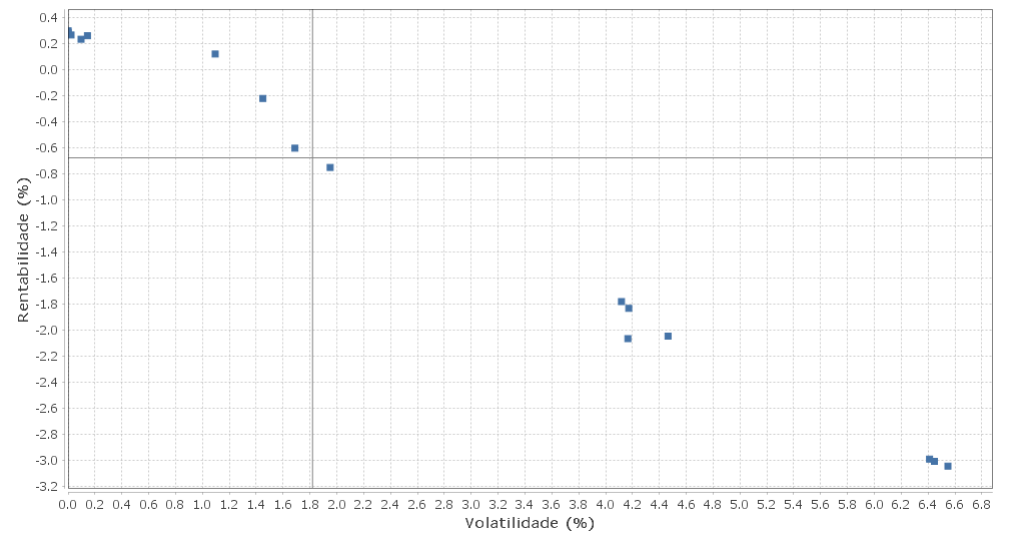
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

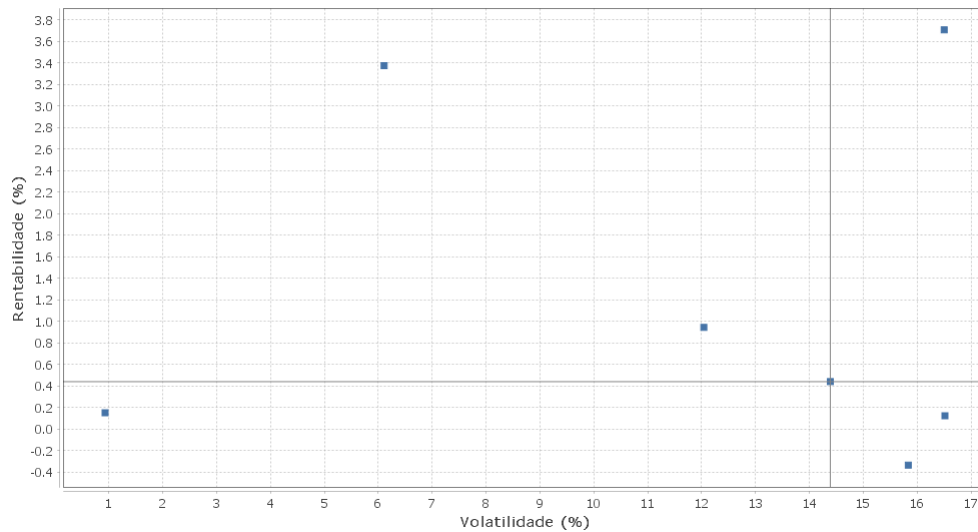
SÃO VICENTE - CONSOLIDADO - No Mês



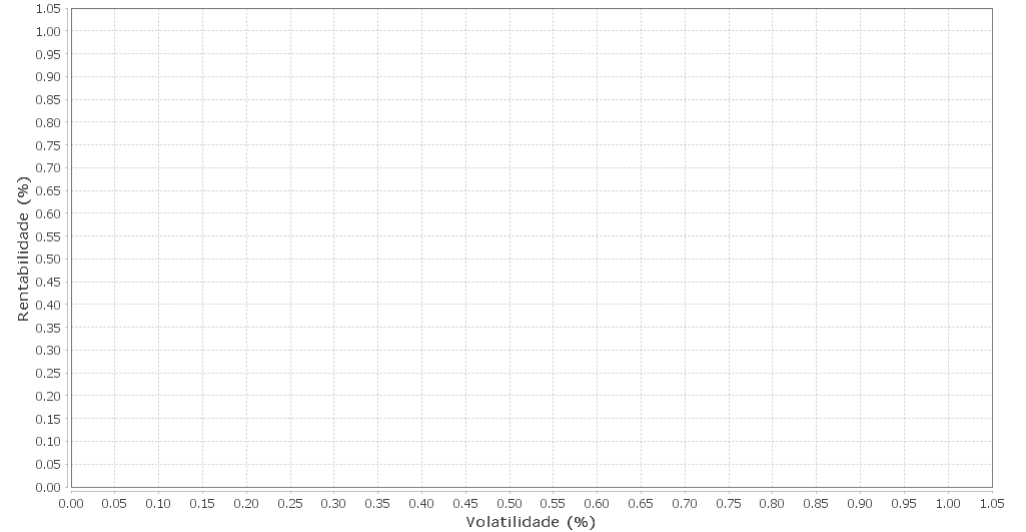
Renda Fixa - No Mês



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\$): 2.589.272,25

Value-At-Risk: 1,98%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,01	0,00	-13,72	0,29	645.803,18	0,50
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,36	0,00	-29,01	0,28	2.149.833,49	1,65
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,02	0,00	-1,85	0,26	743.355,25	0,57
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	Artigo 7º VII, Alínea b	0,10	0,04	0,00	-0,77	0,23	135.833,64	0,10
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,14	0,14	0,01	-0,33	0,26	18.983.395,88	14,55
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	0,93	0,45	0,01	-0,16	0,15	2.356.655,99	1,81
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,09	0,67	0,03	-0,17	0,12	9.093.292,27	6,97
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	Artigo 7º IV, Alínea a	1,45	0,96	0,09	-0,37	-0,23	14.664.191,08	11,24
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,69	0,93	0,00	-0,54	-0,61	66.029,09	0,05
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,95	1,03	0,08	-0,54	-0,75	12.030.940,89	9,22
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,12	2,18	0,06	-0,51	-1,78	4.036.225,09	3,09
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	4,17	1,96	0,02	-0,57	-2,07	1.840.681,00	1,41
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,17	2,22	0,35	-0,51	-1,84	23.727.866,31	18,19
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	4,46	2,34	0,02	-0,53	-2,05	1.086.921,20	0,83
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	6,11	6,70	0,10	0,50	3,37	3.432.356,88	2,63
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	Artigo 7º I, Alínea b	6,41	3,16	0,07	-0,51	-2,99	3.376.333,79	2,59
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	Artigo 7º IV, Alínea a	6,45	3,18	0,07	-0,51	-3,01	3.396.200,29	2,60
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,55	3,16	0,28	-0,51	-3,05	13.414.351,36	10,28
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	12,04	7,34	0,16	0,05	0,94	3.706.084,19	2,84
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	14,39	9,18	0,14	0,01	0,44	2.534.752,90	1,94
AZ QUEST ACOES FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	15,83	8,08	0,01	-0,04	-0,33	285.911,00	0,22
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	16,50	9,15	0,27	0,21	3,71	5.075.847,22	3,89
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	16,51	8,13	0,18	-0,01	0,12	3.674.567,84	2,82