



LDB
EMPRESAS

SÃO VICENTE
NOVEMBRO 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

79,28%

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	12,79	1,99	1,24	4.137.521,81	2,32	5.721.224.105,90	0,07
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,85	1,99	1,17	29.746.425,99	16,67	5.938.047.265,27	0,50
ITAU	ITAU	ITAU RF IMAB5+ FIC DE FI	19,68	2,55	-2,26	6.354.580,52	3,56	82.072.573,20	7,74
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,84	2,57	-2,17	13.835.079,13	7,75	1.749.025.544,15	0,79
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,14	1,22	6,28	23.905.347,07	13,39	10.336.804.140,67	0,23
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,28	0,85	2,65	12.444.878,48	6,97	9.499.641.282,04	0,13
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	13,91	2,42	3,60	1.836.726,00	1,03	67.615.877,17	2,72
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			12,05	1,76	1,38	92.260.559,00	51,69		

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	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,27	0,04	1,91	760.863,74	0,43	3.354.440.184,66	0,02
ITAU	ITAU	ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO	14,60	2,08	2,47	7.583.723,36	4,25	658.698.123,27	1,15
ITAU	ITAU	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,19	0,11	2,25	1.631.392,80	0,91	17.049.030.453,70	0,01
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	19,95	2,50	-2,73	3.350.720,55	1,88	230.826.167,84	1,45
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	5,41	1,30	5,97	15.705.166,74	8,80	896.937.824,58	1,75
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	1,67	0,10	2,65	19.145.864,41	10,73	4.356.779.873,38	0,44
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			5,81	0,96	3,08	48.177.731,60	26,99		

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

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	0,42	0,20	1,38	1.059.964,18	0,59	762.075.754,15	0,14
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			0,42	0,20	1,38	1.059.964,18	0,59		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

9,68

1,48

1,93

141.498.254,78

79,28

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

20,72%

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	BRABESCO	BRABESCO FIA DIVIDENDOS	41,93	16,03	-13,78	3.252.997,06	1,82	1.726.755.470,18	0,19
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST ACOES FIC FIA	45,65	9,14	-10,72	929.114,96	0,52	763.905.483,60	0,12
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	48,01	15,39	-10,28	7.459.507,89	4,18	640.427.378,49	1,16
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	46,03	8,68	2,51	7.180.186,82	4,02	2.456.975.630,65	0,29
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	41,81	14,44	-5,48	4.280.145,30	2,40	296.291.450,61	1,44
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			44,11	12,88	-6,42	23.101.952,03	12,94		

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	1,36	0,57	2,30	2.426.961,13	1,36	912.086.136,05	0,27
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	32,78	10,58	9,23	11.458.171,79	6,42	647.909.280,33	1,77
Sub-total Artigo 8º III			25,23	8,69	8,14	13.885.132,92	7,78		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			34,91	11,27	-1,23	36.987.084,95	20,72		
Total			12,89	3,36	1,49	178.485.339,73	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	92.260.559,00	51,69	0,00	60,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	48.177.731,60	26,99	0,00	10,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	1.059.964,18	0,59	0,00	0,00	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	141.498.254,78	79,28				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	23.101.952,03	12,94	0,00	20,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	13.885.132,92	7,78	0,00	10,00	10,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	36.987.084,95	20,72				30,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

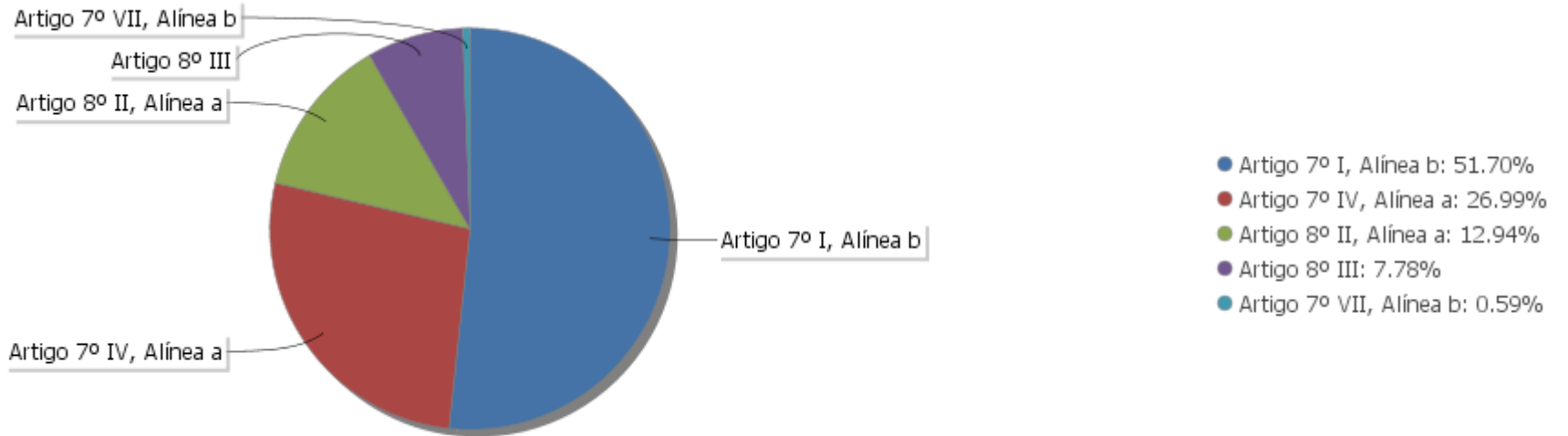
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,76 1.177,42	1,38 53,39	0,58 125,11	4,91 474,21	3,24 109,13	1.609.195,50	1.149.114,32
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,96 643,97	3,08 119,10	0,46 98,17	2,81 271,53	4,57 153,83	459.443,19	1.464.207,85
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,20 130,47	1,38 53,22	0,31 66,67	0,48 46,77	1,67 56,08	2.063,29	19.365,34
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	12,88 -3,02	-6,42 -0,58	6,34 -3,25	23,41 -1,18	1,80 1,19	2.635.863,75	-973.871,78
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	8,69 -7,21	8,14 13,98	2,37 -7,21	13,87 -10,72	10,92 10,31	1.110.592,39	1.095.451,27
SÃO VICENTE - CONSOLIDADO (Total)						5.817.158,12	2.754.267,00

Análise de Liquidez

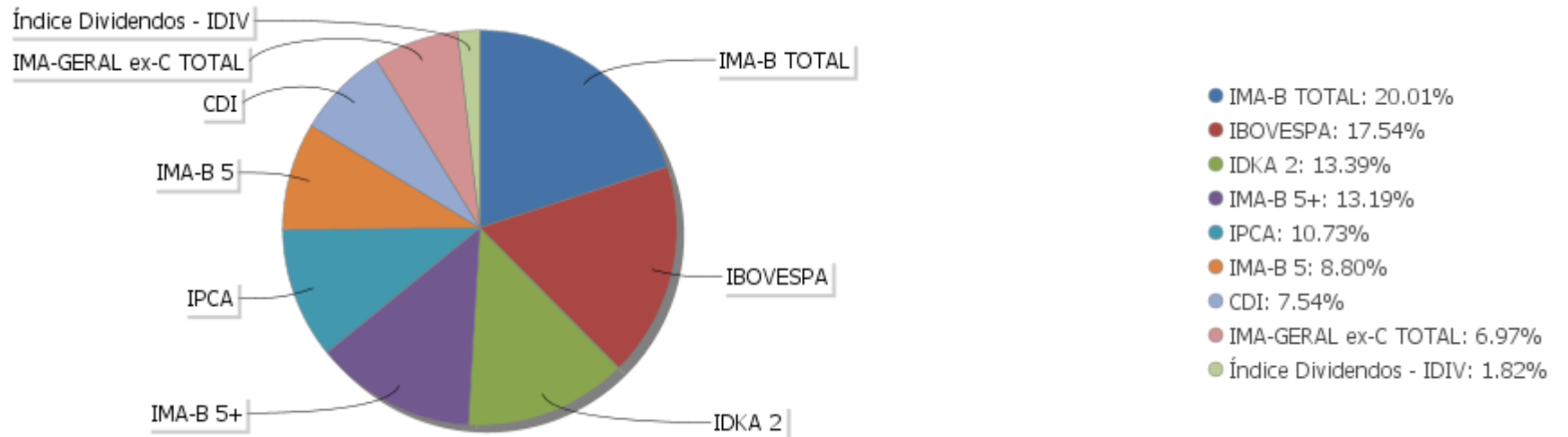
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	171.305.152,91	95,98	171.305.152,91	95,98
de 31 a 364 dias	7.180.186,82	4,02	178.485.339,73	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	178.485.339,73	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

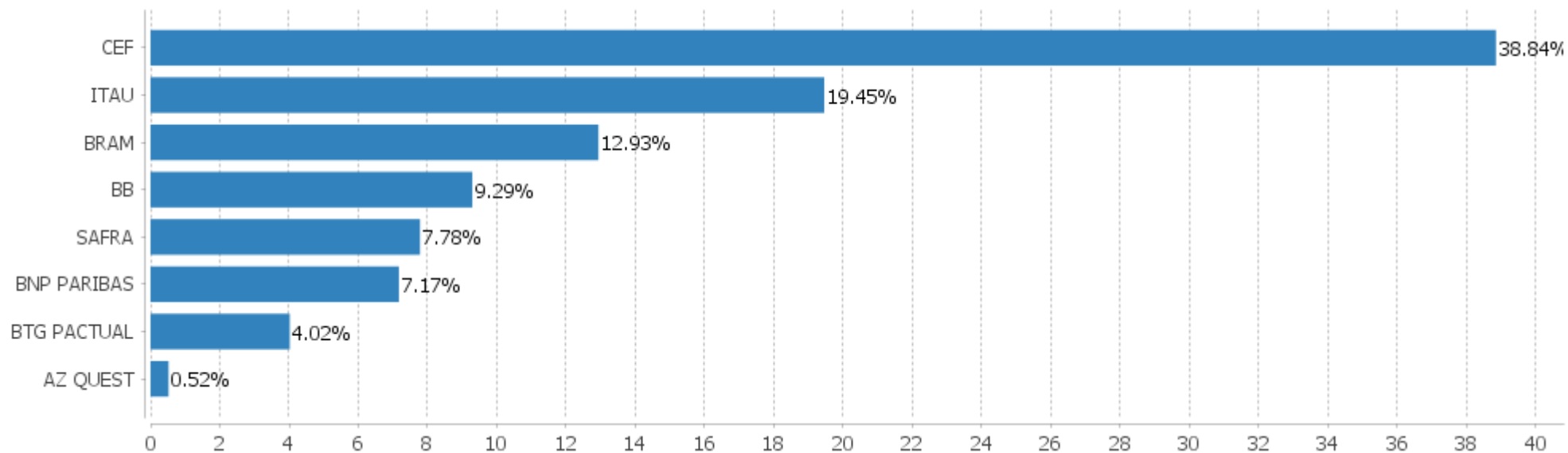


Alocação Por Estratégia



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	0,37	-1,02	-8,71	2,51	2,16	2,34	3,92	-0,89	-1,68	-0,23	3,36		1,49
INPC + 6%	0,70	0,59	0,69	0,23	0,21	0,79	0,98	0,85	1,36	1,38	1,42		9,58
p.p. indexador	-0,34	-1,61	-9,40	2,27	1,94	1,55	2,94	-1,74	-3,04	-1,62	1,94		-8,09
2019	3,68	0,35	0,43	1,28	2,33	2,92	1,33	-0,10	2,15	2,38	-1,05	2,74	19,95
INPC + 6%	0,87	1,01	1,21	1,09	0,66	0,45	0,63	0,63	0,44	0,57	1,01	1,71	10,78
p.p. indexador	2,81	-0,66	-0,78	0,19	1,67	2,47	0,69	-0,73	1,72	1,81	-2,06	1,03	9,17
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

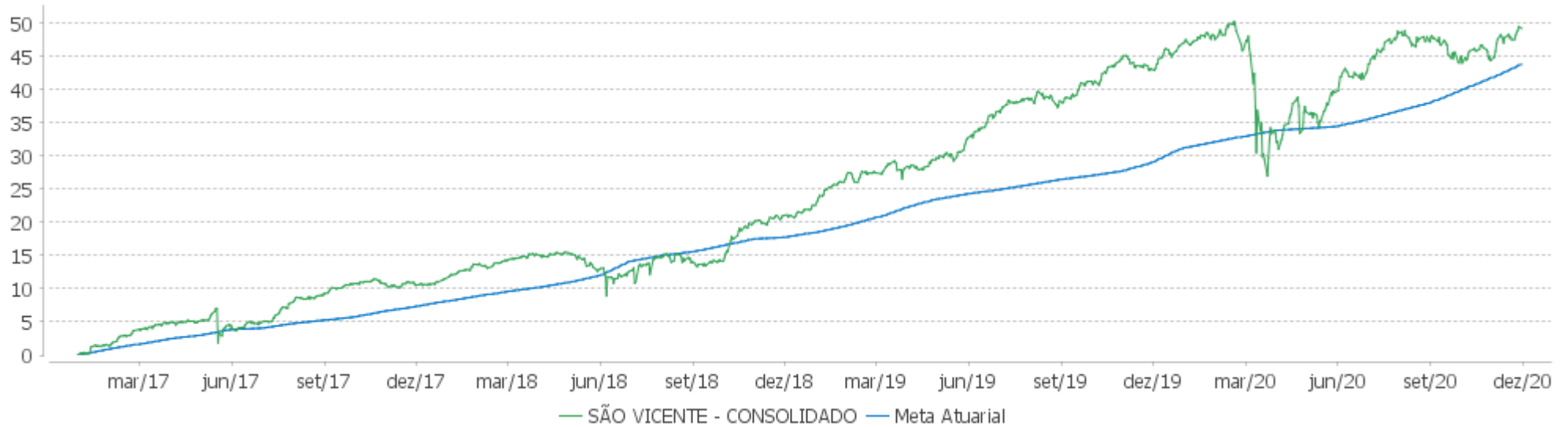
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

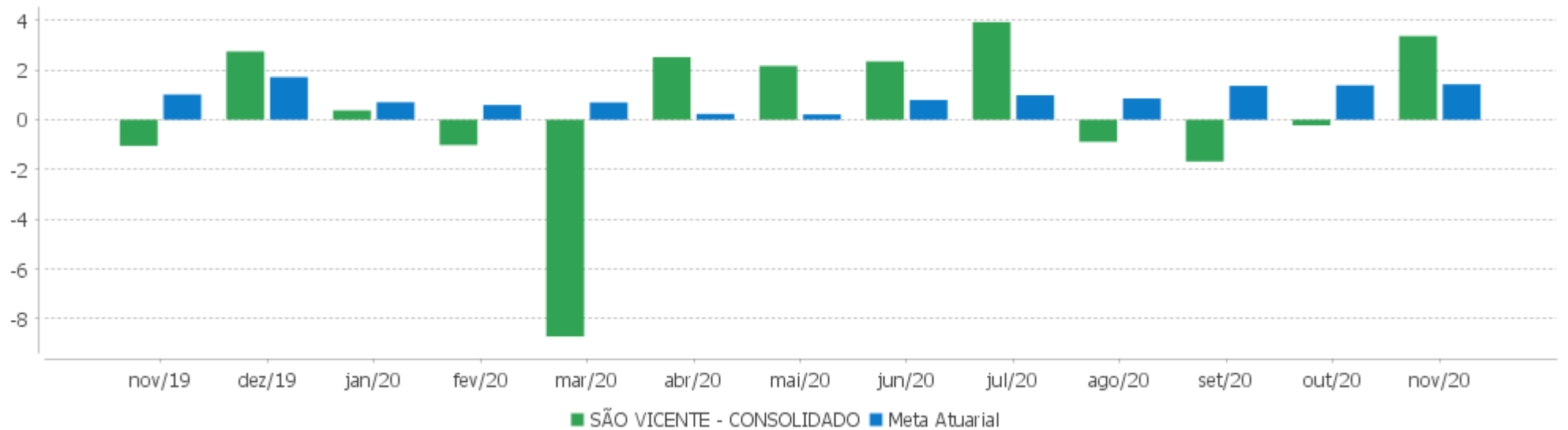
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	27	57,45	03 meses	1,39	4,22	-2,83	6,47
Meses abaixo da Meta Atuarial	20	42,55	06 meses	6,87	6,96	-0,10	6,21
			12 meses	4,28	11,46	-7,18	12,89
			24 meses	23,28	22,12	1,16	9,52
Maior rentabilidade da Carteira	5,08	2018-10	36 meses	35,05	33,99	1,05	8,64
Menor rentabilidade da Carteira	-8,71	2020-03	Desde 30/12/2016	49,25	43,83	5,43	8,12

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.	1,99 -0,01	1,17 -0,32	0,62 -0,05	5,19 -0,12	3,18 -0,34	26,04 -0,79	41,07 -1,17
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,42 0,42	3,60 2,12	0,61 -0,06	5,75 0,44	4,74 1,22	29,45 2,62	46,15 3,92
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,85 0,15	2,65 -0,02	0,02 0,04	1,84 -0,02	3,63 0,03	17,42 0,43	28,71 0,61
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,22 -0,03	6,28 -0,49	1,41 0,10	4,27 -0,06	7,44 -0,61	19,53 -1,35	30,28 -2,28
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,99 -0,01	1,24 -0,24	0,60 -0,07	5,13 -0,18	3,24 -0,27	26,17 -0,66	41,14 -1,09
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	2,57 -0,02	-2,17 -0,29	0,07 -0,07	6,38 -0,14	0,33 -0,35	29,21 -1,12	47,03 -1,76
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI Var. IMA-B 5+ p.p.	2,55 -0,04	-2,26 -0,39	0,08 -0,06	6,37 -0,16	0,26 -0,43	29,18 -1,15	46,61 -2,19
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV % do CDI	0,20 130,47	1,38 53,22	0,31 66,67	0,48 46,77	1,67 56,08	7,65 82,76	14,38 88,19
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	1,30 -0,02	5,97 -0,13	1,24 -0,16	3,77 -0,21	7,27 -0,13	21,30 -0,39	32,32 -0,74
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,04 26,53	1,91 73,71	0,31 66,04	1,01 97,26	2,28 76,75	8,38 90,65	15,29 93,77
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	2,08 1.390,00	2,47 95,35	0,37 80,73	4,87 470,51	4,56 153,51	29,76 322,06	44,85 275,09
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI % do CDI	0,11 71,86	2,25 86,77	0,24 51,29	0,77 74,63	2,62 88,06	8,71 94,25	15,57 95,49
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+ Var. IMA-B 5+ p.p.	2,50 -0,08	-2,73 -0,86	0,05 -0,09	6,22 -0,30	-0,21 -0,89	28,70 -1,63	46,49 -2,31
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,10 -0,79	2,65 -0,47	-0,05 -2,46	0,82 -2,48	3,01 -1,30	16,62 8,89	25,32 13,23
BRADESCO FIA DIVIDENDOS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	16,03 1,63	-13,78 -4,65	9,16 -0,66	16,86 -4,44	-7,54 -7,49	6,84 -25,93	36,59 -23,93
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	8,68 -7,22	2,51 8,35	3,63 -5,95	23,31 -1,27	9,88 9,27	46,84 25,18	81,20 29,90
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	14,44	-5,48	7,84	20,99	0,85	35,57	44,58

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Varição da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-1,46	0,36	-1,75	-3,60	0,24	13,91	-6,72
AZ QUEST ACOES FIC FIA	9,14	-10,72	1,75	19,29	-3,99	14,79	53,86
Var. IBOVESPA p.p.	-6,76	-4,88	-7,84	-5,30	-4,60	-6,88	2,56
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	15,39	-10,28	7,57	30,16	1,51	46,97	52,89
Var. IBOVESPA p.p.	-0,51	-4,44	-2,01	5,57	0,90	25,31	1,58
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	0,57	2,30	0,11	0,96	2,92	9,29	16,27
% do CDI	383,70	88,64	23,64	92,59	98,23	100,55	99,78
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	10,58	9,23	2,87	17,11	12,10	32,33	42,85
Var. IBOVESPA p.p.	-5,32	15,07	-6,72	-7,48	11,49	10,66	-8,45
SÃO VICENTE - CONSOLIDADO	3,36	1,49	1,39	6,87	4,28	23,28	35,05
Var. INPC + 6% p.p.	1,94	-8,09	-2,83	-0,10	-7,18	1,16	1,05
CDI	0,15	2,59	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
IBOVESPA	15,90	-5,84	9,58	24,59	0,61	21,66	51,30
INPC + 6%	1,42	9,58	4,22	6,96	11,46	22,12	33,99
IPCA + 6%	1,36	8,73	3,89	6,37	10,52	20,99	33,37

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	0,23	3,52	0,54	1,19	3,95	11,13	18,89
IRF-M 1+	0,46	5,24	-1,06	0,29	6,00	22,54	36,94
IRF-M TOTAL	0,36	4,65	-0,53	0,58	5,30	19,04	31,44
IMA-B 5	1,32	6,10	1,40	3,99	7,41	21,69	33,06
IMA-B 5+	2,59	-1,87	0,14	6,53	0,68	30,33	48,80
IMA-B TOTAL	2,00	1,48	0,67	5,31	3,52	26,83	42,23
IMA-C TOTAL	1,94	23,44	7,90	19,17	23,94	48,54	75,37
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,70	2,67	-0,02	1,86	3,60	17,00	28,09
IMA-GERAL TOTAL	0,73	3,25	0,22	2,35	4,17	17,84	29,30
IDKA 2	1,25	6,77	1,31	4,33	8,05	20,89	32,56
IDKA 20	3,37	-8,22	-0,40	9,06	-4,60	35,17	60,63
CDI	0,15	2,59	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
Renda Variável							
IBOVESPA	15,90	-5,84	9,58	24,59	0,61	21,66	51,30
IBRX 100	15,46	-5,18	9,57	25,07	1,72	24,85	55,25
IBRX 50	16,21	-5,30	10,24	25,90	0,92	19,73	48,77
SMALL CAP	16,64	-7,60	7,78	33,38	4,09	49,24	69,17
IFIX	1,51	-12,17	0,95	5,68	-2,83	22,09	26,91
Índice Consumo - ICON	8,93	-3,98	1,63	18,62	3,72	48,84	43,97
Índice Dividendos - IDIV	14,40	-9,12	9,82	21,30	-0,05	32,77	60,52
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,89	3,13	2,41	3,29	4,31	7,73	12,09
INPC	0,95	3,93	2,73	3,87	5,20	8,74	12,61
IGPM	3,28	21,97	11,24	18,66	24,52	29,46	41,99
SELIC	0,15	2,59	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

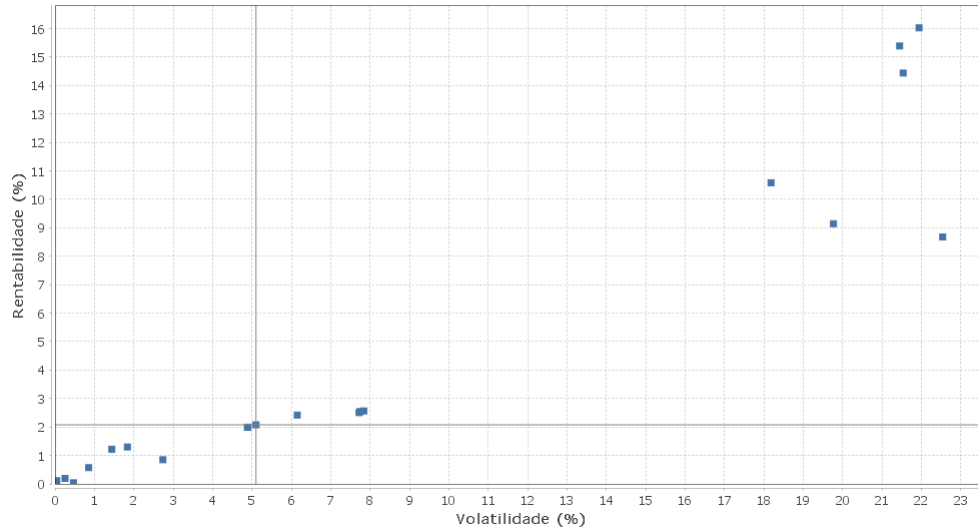
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
237	04/11/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	336.069,87	6.907,34960616	48,6539540000
238	09/11/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	12.030,00	247,21555246	48,6619870000
247	10/11/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	14.185,56	4.047,80125300	3,5045100000
239	10/11/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	77.583,22	1.594,28853296	48,6632240000
250	11/11/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	5.619,25	0,00	312,58970074	17,9764400000
240	11/11/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	188.763,41	0,00	3.878,75039013	48,6660370000
241	13/11/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	24.420,07	501,79769227	48,6651700000
245	17/11/2020	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.424.882,00	0,00	606.224,41946500	2,3504200000
242	18/11/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	16.446,60	0,00	337,88886619	48,6745840000
243	19/11/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	3.000,00	61,63018748	48,6774440000
248	23/11/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	11.021,97	3.173,11030000	3,4735540000
244	24/11/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	610,24	12,53391401	48,6871060000
249	27/11/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	163.266,19	46.370,42618200	3,5209120000
246	30/11/2020	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	1.500.000,00	636.079,99050000	2,3581939731

Total

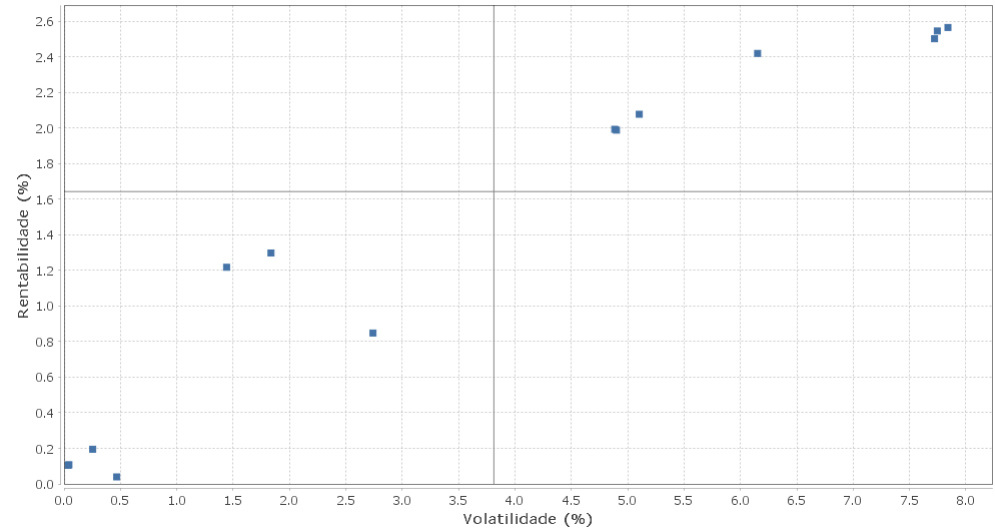
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

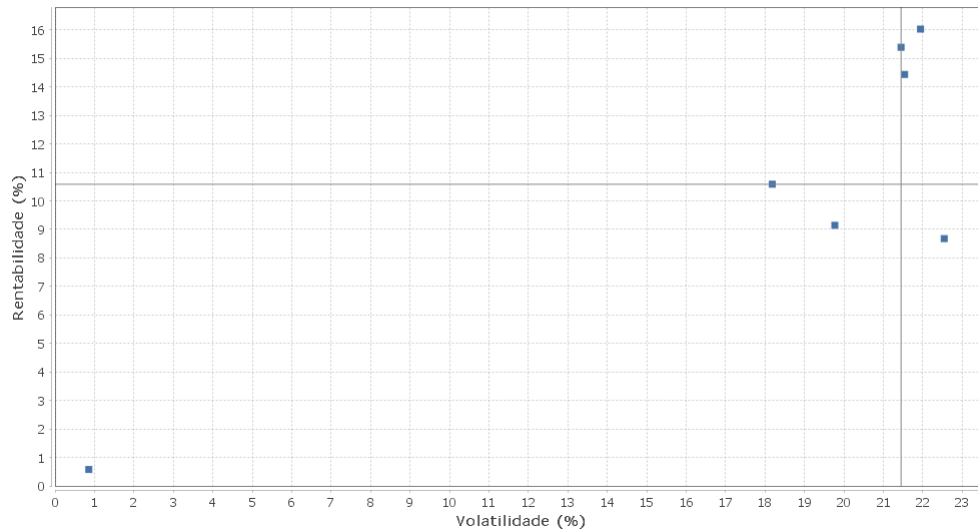
SÃO VICENTE - CONSOLIDADO - No Mês



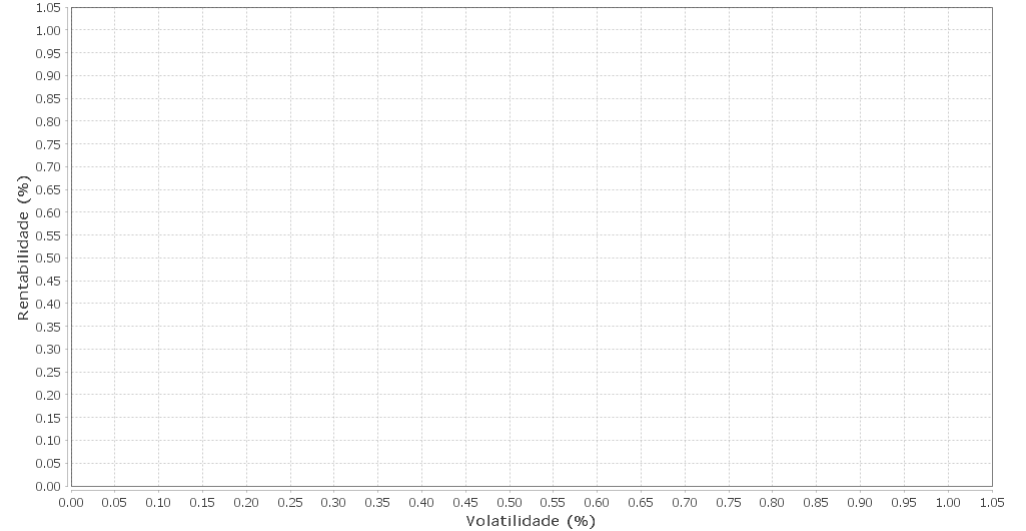
Renda Fixa - No Mês



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\$): 4.996.898,49

Value-At-Risk: 2,80%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,30	0,02	-1,23	0,10	19.145.864,41	10,73
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,08	0,00	-0,97	0,11	1.631.392,80	0,91
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	Artigo 7º VII, Alínea b	0,25	0,20	-0,00	0,18	0,20	1.059.964,18	0,59
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	Artigo 7º IV, Alínea a	0,47	0,06	-0,00	-0,23	0,04	760.863,74	0,43
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	0,86	0,56	0,01	0,50	0,57	2.426.961,13	1,36
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,44	1,07	0,09	0,74	1,22	23.905.347,07	13,39
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	Artigo 7º IV, Alínea a	1,84	1,08	0,07	0,63	1,30	15.705.166,74	8,80
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,74	1,33	0,08	0,25	0,85	12.444.878,48	6,97
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,89	2,66	0,05	0,38	1,99	4.137.521,81	2,32
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,90	2,67	0,38	0,38	1,99	29.746.425,99	16,67
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	5,10	2,86	0,10	0,38	2,08	7.583.723,36	4,25
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	6,15	2,82	0,02	0,37	2,42	1.836.726,00	1,03
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	Artigo 7º IV, Alínea a	7,72	4,13	0,07	0,30	2,50	3.350.720,55	1,88
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	Artigo 7º I, Alínea b	7,75	4,15	0,12	0,31	2,55	6.354.580,52	3,56
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	7,84	4,17	0,27	0,31	2,57	13.835.079,13	7,75
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	18,18	8,25	0,32	0,57	10,58	11.458.171,79	6,42
AZ QUEST ACOES FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	19,77	12,08	0,05	0,46	9,14	929.114,96	0,52
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	21,45	10,52	0,38	0,71	15,39	7.459.507,89	4,18
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	21,54	10,58	0,22	0,66	14,44	4.280.145,30	2,40
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	21,94	10,99	0,17	0,72	16,03	3.252.997,06	1,82
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	22,54	10,22	0,36	0,38	8,68	7.180.186,82	4,02