



LDB
EMPRESAS

ILHA SOLTEIRA
AGOSTO 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 19.01.2021.

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

74,34%

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 IRF-M	5,92	-0,80	5,01	1.560.823,30	0,88	5.055.871.049,38	0,03
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,54	-1,85	0,64	15.123.371,86	8,49	5.638.549.883,16	0,27
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,61	-1,83	0,54	12.678.367,38	7,12	6.019.680.821,86	0,21
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,95	0,39	4,45	7.880.409,80	4,42	12.740.710.327,20	0,06
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	4,97	0,40	4,52	12.029.718,08	6,75	1.118.420.367,90	1,08
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	12,59	-1,82	0,38	18.827.275,30	10,57	1.145.871.824,82	1,64
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,46	-3,64	-2,24	9.866.963,80	5,54	1.873.284.904,48	0,53
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,92	0,37	4,46	11.516.880,70	6,46	4.251.005.212,54	0,27
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			10,31	-1,25	1,60	89.483.810,22	50,22		

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
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,31	0,25	1,42	10.314,50	0,01	1.714.611.822,66	0,00
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,23	0,17	1,60	4.615.677,59	2,59	3.920.225.772,90	0,12
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,29	0,14	1,77	9.005.862,67	5,05	4.687.255.346,64	0,19
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	13,11	-1,83	0,82	7.877.839,68	4,42	1.905.316.965,01	0,41
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,18	1,79	2.319.721,80	1,30	2.572.617.697,19	0,09
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	19,58	-3,73	-2,78	4.399.994,21	2,47	240.076.237,79	1,83
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,07	0,09	1,55	98.197,49	0,06	496.713.163,83	0,02
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	5,32	0,42	4,68	12.399.117,95	6,96	770.238.550,30	1,61
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF ATIVO FIC	1,35	-0,35	2,16	2.244.441,81	1,26	1.131.802.857,33	0,20
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			5,26	-0,56	2,00	42.971.167,70	24,12		
Renda Fixa			8,55	-1,03	1,75	132.454.977,92	74,34		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

25,66%

Artigo 8º I, Alínea a (Fundos de Ações Referenciados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRDESCO	BRDESCO FIA IBOVESPA PLUS	43,94	-3,47	-14,28	9.687.293,42	5,44	373.075.822,94	2,60
CEF	CEF	FIA BRASIL IBX-50	44,80	-3,25	-14,62	9.216.567,17	5,17	1.002.237.416,93	0,92
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	44,14	-3,27	-13,42	2.440.168,29	1,37	942.280.344,59	0,26
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			44,32	-3,35	-14,31	21.344.028,88	11,98		

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
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	42,58	-1,81	-17,46	1.072.722,05	0,60	576.020.291,87	0,19
BRAM	BEM	BRDESCO F I A SELECTION	43,16	-1,14	-17,90	3.892.038,23	2,18	708.000.018,67	0,55
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	38,15	-3,41	-19,86	3.427.325,60	1,92	937.612.766,29	0,37
BRAM	BEM	BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	43,28	-1,58	-10,08	5.791.753,86	3,25	2.138.016.152,06	0,27
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	43,56	-3,01	-12,28	3.158.426,57	1,77	832.932.613,38	0,38
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	47,51	-1,38	-15,36	3.240.404,48	1,82	1.226.260.606,95	0,26
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	42,54	-3,28	-18,00	3.794.402,71	2,13	418.780.536,55	0,91
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			42,40	-2,21	-15,46	24.377.073,50	13,68		

Renda Variável e Investimentos Estruturados

43,15 -2,75 -14,95 45.721.102,38 25,66

Total

15,47 -1,48 -2,93 178.176.080,30 100,00

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	89.483.810,22	50,22	20,00	30,00	60,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	42.971.167,70	24,12	0,00	30,00	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	132.454.977,92	74,34				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	21.344.028,88	11,98	0,00	20,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	24.377.073,50	13,68	0,00	10,00	20,00	20,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	45.721.102,38	25,66				30,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

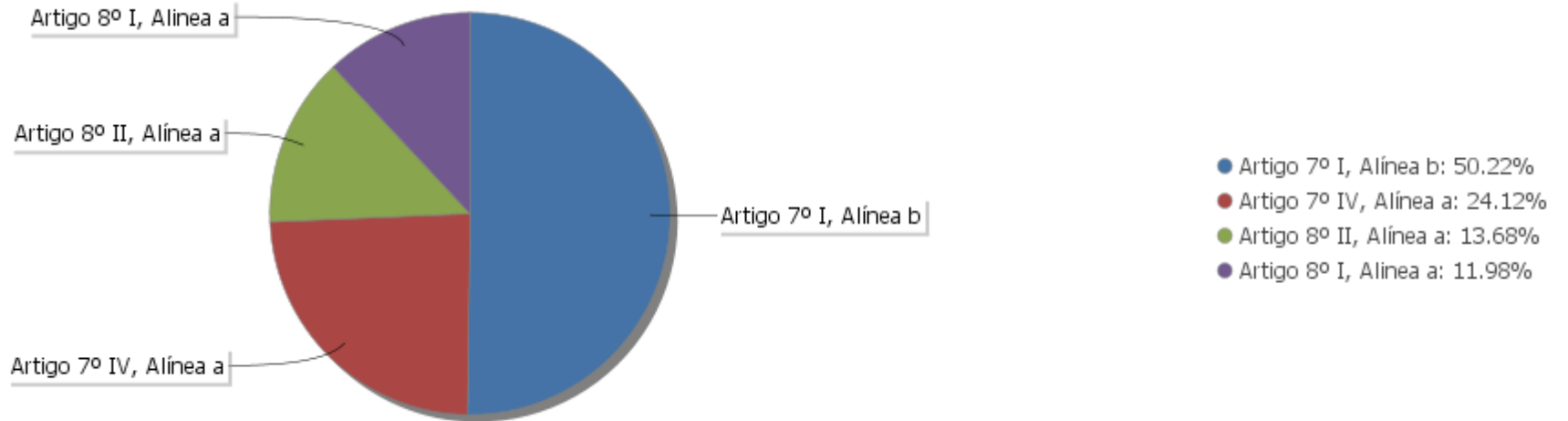
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-1,25 -784,43	1,60 75,71	3,91 689,26	0,79 54,86	7,00 181,34	-1.136.597,94	1.411.959,51
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,56 -351,40	2,00 94,73	2,41 423,72	1,24 86,42	5,63 145,77	-243.977,85	856.371,44
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-3,35 0,09	-14,31 -0,24	14,08 0,39	-4,91 -0,30	-1,94 -0,20	-740.341,48	-3.513.580,46
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-2,21 1,23	-15,46 -1,38	15,50 1,81	-7,26 -2,65	-2,78 -1,03	-551.146,54	-4.415.795,94
ILHA SOLTEIRA (Total)						-2.672.063,81	-5.661.045,45

Análise de Liquidez

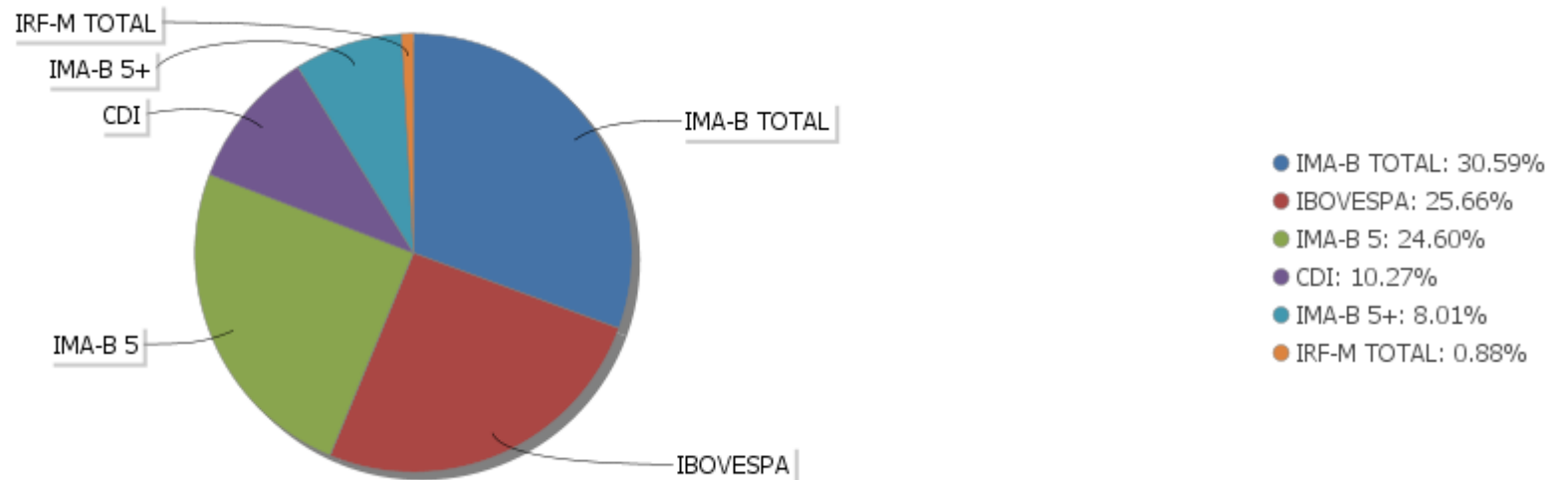
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	178.176.080,30	100,00	178.176.080,30	100,00
de 31 a 364 dias	0,00	0,00	178.176.080,30	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	178.176.080,30	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

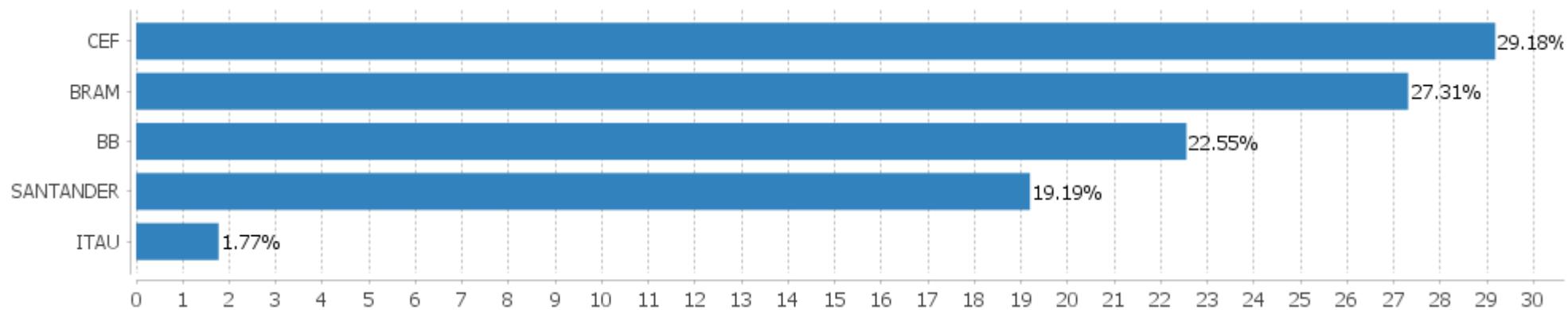


Alocação Por Estratégia



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	0,07	-2,11	-11,70	2,89	2,80	3,28	4,26	-1,48					-2,93
IPCA + 5,89%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,89	0,72					4,59
p.p. indexador	-0,64	-2,77	-12,27	2,74	2,73	2,54	3,38	-2,19					-7,52
2019	4,73	-0,18	0,32	1,16	1,98	3,00	1,22	-0,06	2,34	2,42	-0,78	3,49	21,34
IPCA + 6%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	3,90	-1,08	-0,87	0,10	1,34	2,55	0,50	-0,68	1,90	1,79	-1,75	1,85	10,75
2018	3,56	0,54	0,75	0,28	-3,68	-1,22	3,16	-0,91	0,92	5,90	1,11	0,71	11,33
IPCA + 6%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
p.p. indexador	2,75	-0,20	0,17	-0,43	-4,57	-2,97	2,32	-1,35	-0,00	4,93	0,85	0,09	1,41
2017	1,97	1,97	0,71	0,39	-0,92	0,38	2,98	1,87	1,82	0,02	-0,78	1,65	12,66
IPCA + 6%	0,89	0,75	0,78	0,56	0,82	0,26	0,73	0,72	0,62	0,91	0,74	0,91	9,05
p.p. indexador	1,07	1,22	-0,08	-0,17	-1,75	0,13	2,26	1,15	1,20	-0,89	-1,53	0,75	3,61

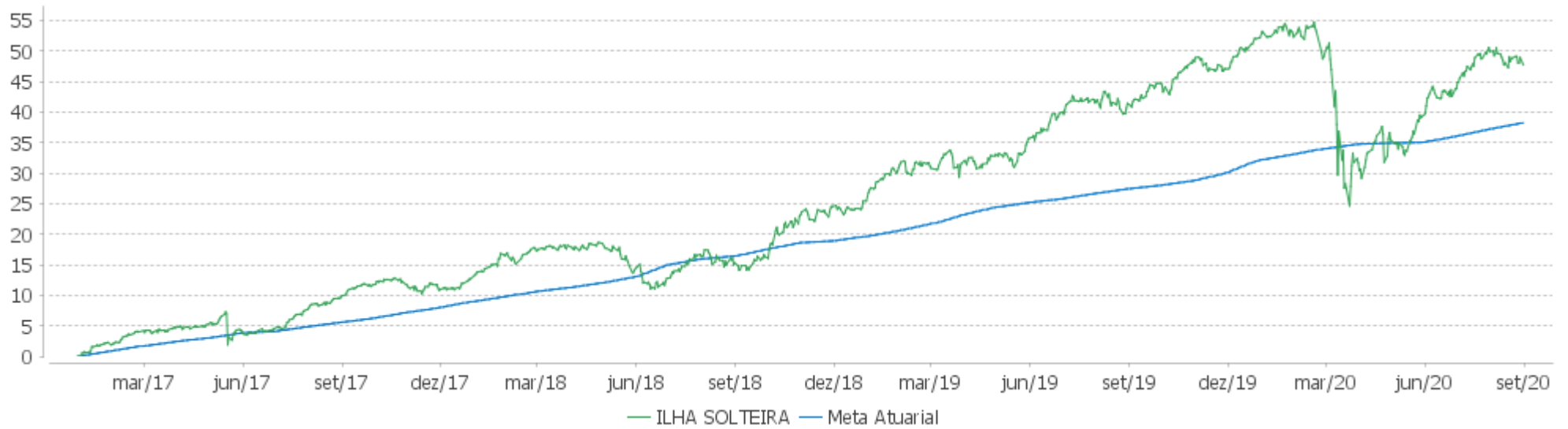
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

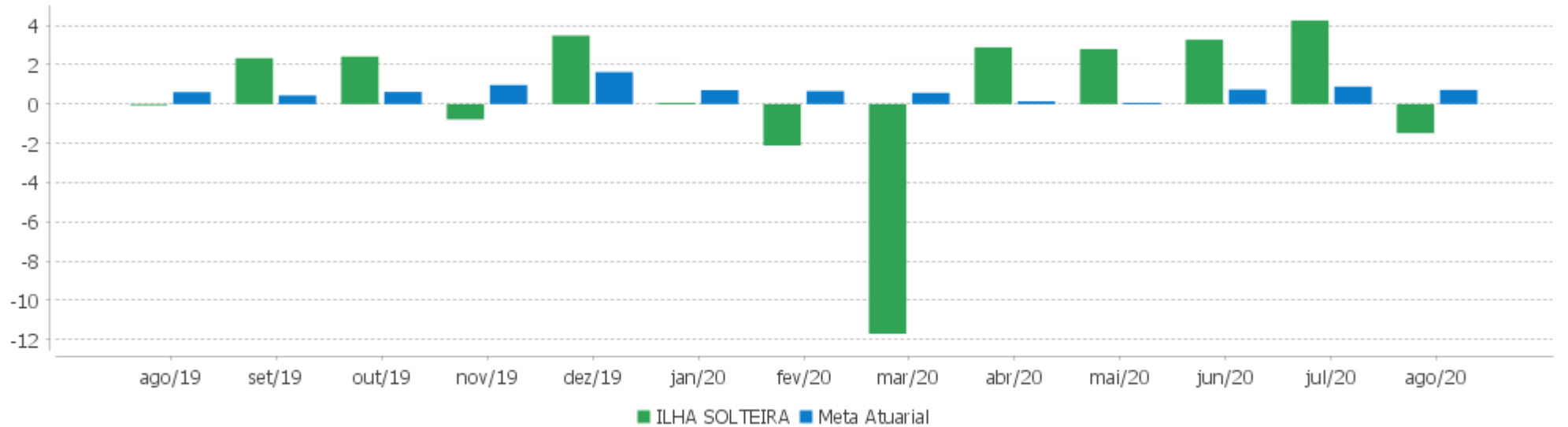
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	25	56,82	03 meses	6,09	2,36	3,73	7,76
Meses abaixo da Meta Atuarial	19	43,18	06 meses	-0,91	3,17	-4,09	20,85
			12 meses	4,48	8,51	-4,03	15,47
			24 meses	28,17	18,88	9,29	12,13
Maior rentabilidade da Carteira	5,90	2018-10	36 meses	34,68	31,24	3,44	10,40
Menor rentabilidade da Carteira	-11,70	2020-03	Desde 30/12/2016	47,72	38,65	9,07	9,87

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.	-1,83 -0,03	0,54 -0,26	4,54 -0,07	-0,14 -0,23	6,20 -0,44	35,19 -0,80	41,02 -1,18
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,39 -0,03	4,45 -0,18	2,48 -0,07	3,24 -0,15	8,93 -0,32	24,43 -0,58	32,42 -0,91
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,40 -0,02	4,52 -0,11	2,47 -0,09	3,32 -0,08	9,04 -0,20	24,52 -0,48	32,57 -0,76
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,37 -0,06	4,46 -0,17	2,43 -0,13	3,21 -0,18	8,95 -0,29	24,42 -0,59	32,44 -0,89
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,85 -0,06	0,64 -0,17	4,50 -0,11	-0,06 -0,15	6,38 -0,26	35,28 -0,71	41,12 -1,08
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,80 -0,05	5,01 -0,20	1,09 -0,03	3,47 -0,15	8,43 -0,28	26,24 -0,58	33,44 -0,90
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-3,64 -0,02	-2,24 -0,23	6,31 -0,07	-2,48 -0,13	4,26 -0,45	43,30 -1,41	46,76 -1,75
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,82 -0,03	0,38 -0,43	4,51 -0,10	-0,29 -0,38	6,10 -0,54	34,96 -1,03	40,74 -1,47
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,83 -0,04	0,82 0,01	4,70 0,09	0,08 -0,01	6,70 0,06	36,30 0,31	41,79 -0,42
SANTANDER RF ATIVO FIC % do CDI	-0,35 -220,59	2,16 102,31	0,52 91,19	1,55 107,80	6,43 166,59	19,40 186,88	23,66 132,04
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	0,42 -0,00	4,68 0,04	2,51 -0,05	3,42 0,03	9,22 -0,02	24,86 -0,14	32,64 -0,69
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,17 107,29	1,60 75,50	0,70 122,86	0,97 67,71	3,25 84,15	9,66 93,06	17,11 95,45
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,18 113,33	1,79 84,85	0,68 119,59	1,16 81,13	3,42 88,51	9,79 94,28	17,31 96,60
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,14 90,67	1,77 83,59	0,64 112,31	1,12 77,76	3,36 87,05	9,69 93,36	17,02 94,95
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+ Var. IMA-B 5+ p.p.	-3,73 -0,11	-2,78 -0,77	6,17 -0,21	-3,03 -0,68	3,83 -0,88	42,79 -1,93	46,18 -2,32
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI % do CDI	0,25 153,78	1,42 67,13	0,55 97,10	0,76 52,90	3,01 78,03	9,48 91,34	16,89 94,22
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,09	1,55	0,35	1,01	3,00	8,56	15,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	56,62	73,25	61,99	70,44	77,62	82,45	83,88
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,28 0,16	-18,00 -3,93	13,36 -0,33	-9,15 -4,54	-5,61 -3,86	21,51 -8,09	37,06 -3,22
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	-1,38 2,06	-15,36 -1,28	21,66 7,96	-7,86 -3,25	3,92 5,67	51,07 21,47	48,05 7,76
BRADESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	-1,14 2,30	-17,90 -3,83	18,52 4,83	-6,49 -1,88	-9,95 -8,21	23,51 -6,08	43,37 3,09
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-1,81 1,63	-17,46 -3,38	16,89 3,20	-8,49 -3,88	-6,17 -4,43	30,43 0,83	40,41 0,13
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI Var. IBOVESPA p.p.	-3,01 0,43	-12,28 1,79	14,26 0,57	-5,52 -0,91	0,98 2,72	39,22 9,62	46,01 5,73
BB AÇÕES DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	-3,41 0,03	-19,86 -5,78	9,92 -3,77	-11,83 -7,22	-10,80 -9,05	22,37 -7,23	23,27 -17,01
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. IBOVESPA p.p.	-1,58 1,86	-10,08 4,00	15,58 1,89	-3,91 0,70	6,20 7,94	58,35 28,76	72,99 32,70
FIA BRASIL IBX-50 Var. IBOVESPA p.p.	-3,25 0,19	-14,62 -0,55	14,57 0,88	-4,97 -0,36	-2,43 -0,69	24,25 -5,35	35,75 -4,54
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IBOVESPA p.p.	-3,27 0,18	-13,42 0,66	14,23 0,54	-5,10 -0,49	-0,39 1,36	35,87 6,27	39,55 -0,73
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS Var. IBOVESPA p.p.	-3,47 -0,03	-14,28 -0,20	13,57 -0,12	-4,80 -0,19	-2,03 -0,29	29,07 -0,52	39,34 -0,94
ILHA SOLTEIRA Var. IPCA + 5,89% p.p.	-1,48 -2,19	-2,93 -7,52	6,09 3,73	-0,91 -4,09	4,48 -3,99	28,17 9,45	34,68 3,76
CDI	0,16	2,12	0,57	1,43	3,86	10,38	17,92
IBOVESPA	-3,44	-14,07	13,69	-4,61	-1,75	29,59	40,28
INPC + 6%	0,85	5,15	2,64	3,80	9,12	19,38	31,09
IPCA + 6%	0,73	4,66	2,39	3,22	8,58	18,96	31,33

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	0,12	2,96	0,64	2,12	5,06	12,83	20,62
IRF-M 1+	-1,13	6,37	1,36	4,37	10,64	33,26	40,58
IRF-M TOTAL	-0,75	5,20	1,11	3,62	8,70	26,82	34,34
IMA-B 5	0,43	4,63	2,55	3,39	9,24	25,01	33,33
IMA-B 5+	-3,62	-2,01	6,38	-2,35	4,71	44,71	48,51
IMA-B TOTAL	-1,80	0,80	4,61	0,09	6,64	36,00	42,20
IMA-C TOTAL	2,11	14,41	10,45	10,88	18,54	46,32	66,00
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,68	2,69	1,88	1,72	6,16	22,72	29,97
IMA-GERAL TOTAL	-0,60	3,02	2,13	1,99	6,51	23,37	30,91
IDKA 2	1,03	5,39	2,99	4,11	9,71	23,52	33,44
IDKA 20	-6,22	-7,86	9,49	-6,50	-0,24	59,80	58,73
CDI	0,16	2,12	0,57	1,43	3,86	10,38	17,92
Renda Variável							
IBOVESPA	-3,44	-14,07	13,69	-4,61	-1,75	29,59	40,28
IBRX 100	-3,38	-13,46	14,15	-4,51	-1,12	33,35	43,15
IBRX 50	-3,42	-14,10	14,20	-4,15	-2,18	26,25	37,06
SMALL CAP	-1,23	-14,27	23,76	-6,96	6,02	60,17	56,43
IFIX	1,79	-12,99	4,68	-6,13	4,72	30,04	33,50
Índice Consumo - ICON	-1,48	-5,53	16,72	1,26	5,75	60,13	42,78
Índice Dividendos - IDIV	-4,83	-17,25	10,46	-10,38	-3,64	44,78	45,20
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,24	0,70	0,86	0,24	2,44	5,95	10,39
INPC	0,36	1,16	1,10	0,80	2,94	6,32	10,19
IGPM	2,74	9,64	6,67	9,17	13,02	18,62	29,16
SELIC	0,16	2,12	0,57	1,43	3,86	10,38	17,93
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

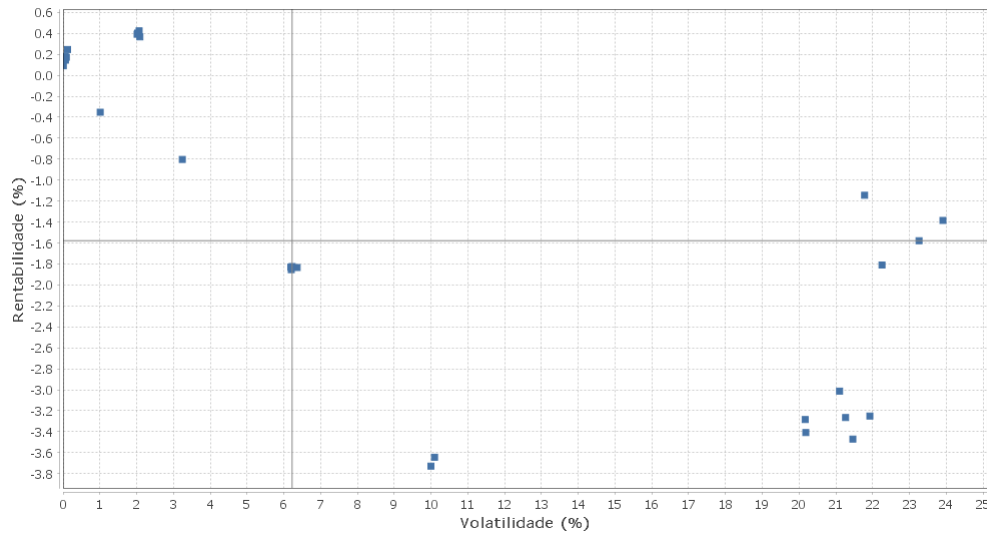
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
68	03/08/2020	SANTANDER RF ATIVO FIC	0,00	50.000,00	3.907,34564500	12,7964108000
67	13/08/2020	SANTANDER RF ATIVO FIC	800.000,00	0,00	62.787,34974000	12,7414201000
65	17/08/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	15.000,00	4.039,98183900	3,7128880000
63	27/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	290.000,00	126.765,94573700	2,2876806410
66	27/08/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	160.000,00	43.067,42331800	3,7151050000
69	27/08/2020	SANTANDER RF ATIVO FIC	0,00	230.000,00	18.046,80936000	12,7446351000
64	31/08/2020	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	480.000,00	39.275,52700000	12,2213511000
Total						

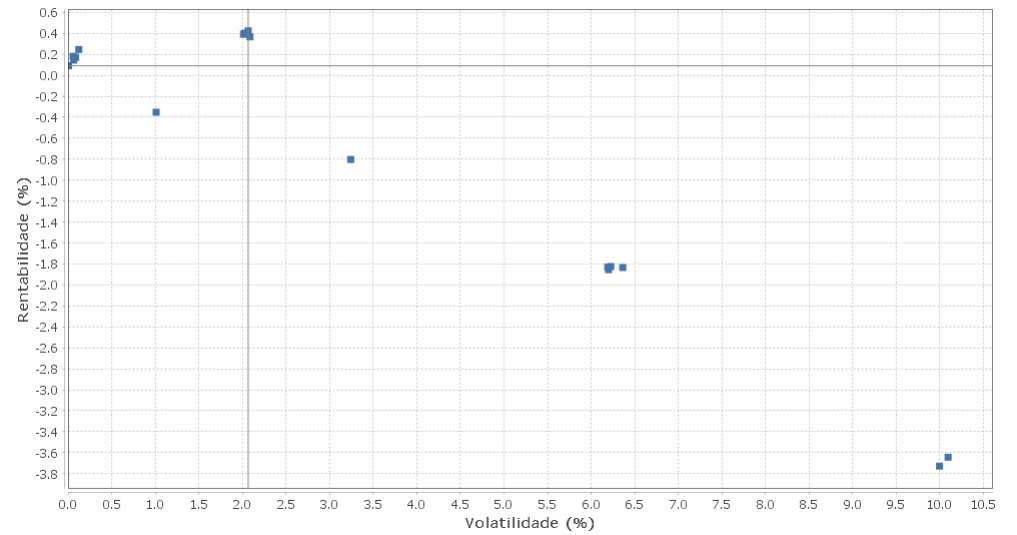
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

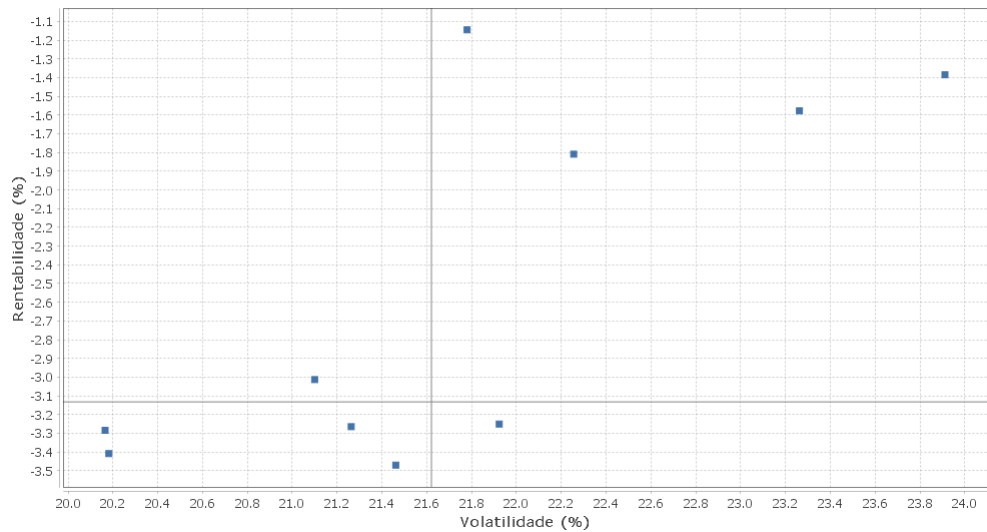
ILHA SOLTEIRA - No Mês



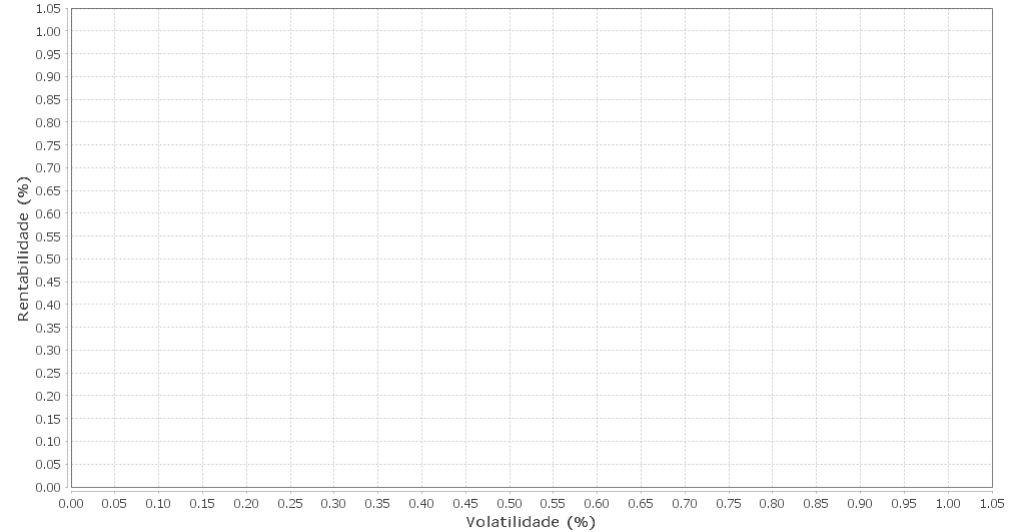
Renda Fixa - No Mês



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\$): 7.806.468,07

Value-At-Risk: 4,38%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,02	0,00	-11,49	0,09	98.197,49	0,06
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,06	0,07	0,00	0,37	0,18	2.319.721,80	1,30
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,07	0,09	0,00	-0,23	0,14	9.005.862,67	5,05
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	Artigo 7º IV, Alínea a	0,09	0,09	-0,00	0,13	0,17	4.615.677,59	2,59
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,12	0,11	-0,00	0,69	0,25	10.314,50	0,01
SANTANDER RF ATIVO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	1,01	0,43	0,00	-0,51	-0,35	2.244.441,81	1,26
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,01	1,06	0,03	0,12	0,39	7.880.409,80	4,42
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,03	1,09	0,05	0,12	0,40	12.029.718,08	6,75
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	Artigo 7º IV, Alínea a	2,07	1,23	0,06	0,13	0,42	12.399.117,95	6,96
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,09	1,10	0,05	0,10	0,37	11.516.880,70	6,46
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	3,24	1,44	0,01	-0,30	-0,80	1.560.823,30	0,88
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,19	3,13	0,19	-0,32	-1,83	12.678.367,38	7,12
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	6,20	3,11	0,22	-0,32	-1,85	15.123.371,86	8,49
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,22	3,11	0,28	-0,32	-1,82	18.827.275,30	10,57
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	6,36	3,22	0,12	-0,31	-1,83	7.877.839,68	4,42
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	Artigo 7º IV, Alínea a	10,00	5,37	0,11	-0,39	-3,73	4.399.994,21	2,47
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	10,09	5,38	0,25	-0,38	-3,64	9.866.963,80	5,54
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	Artigo 8º II, Alínea a	20,16	12,66	0,26	-0,17	-3,28	3.794.402,71	2,13
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	20,18	11,87	0,22	-0,18	-3,41	3.427.325,60	1,92
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	21,10	12,34	0,21	-0,15	-3,01	3.158.426,57	1,77
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	21,26	12,62	0,16	-0,16	-3,27	2.440.168,29	1,37
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	Artigo 8º I, Alínea a	21,46	12,25	0,62	-0,17	-3,47	9.687.293,42	5,44
BRADESCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	21,78	11,24	0,22	-0,06	-1,14	3.892.038,23	2,18
FIA BRASIL IBX-50	Artigo 8º I, Alínea a	21,92	12,38	0,60	-0,16	-3,25	9.216.567,17	5,17
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	22,26	12,34	0,07	-0,09	-1,81	1.072.722,05	0,60
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	23,26	12,67	0,38	-0,07	-1,58	5.791.753,86	3,25
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	23,91	15,55	0,26	-0,06	-1,38	3.240.404,48	1,82