



**LDB**  
EMPRESAS

**ILHA SOLTEIRA**  
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 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

72,83%

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	6,08	0,34	4,35	1.550.984,08	0,86	4.734.232.270,41	0,03
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,79	1,99	1,24	15.214.610,94	8,41	5.721.224.105,90	0,27
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,85	1,99	1,17	12.756.849,18	7,05	5.938.047.265,27	0,21
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,04	1,29	5,82	7.983.626,36	4,41	19.732.912.783,40	0,04
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	5,06	1,30	5,92	12.190.280,96	6,74	1.163.360.094,10	1,05
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	12,83	1,98	0,98	18.939.885,23	10,47	1.200.450.883,37	1,58
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,84	2,57	-2,17	9.874.076,35	5,46	1.749.025.544,15	0,56
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	5,01	1,31	5,87	11.671.863,30	6,45	4.474.614.326,56	0,26
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>10,50</b>	<b>1,78</b>	<b>2,39</b>	<b>90.182.176,40</b>	<b>49,85</b>		

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	0,37	0,16	1,82	10.355,12	0,01	1.764.091.252,64	0,00
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,27	0,04	1,91	2.988.303,46	1,65	3.354.440.184,66	0,09
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,36	0,15	2,05	9.449.231,60	5,22	4.499.544.566,86	0,21
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	13,35	2,01	1,29	7.915.136,24	4,37	2.002.230.156,54	0,40
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,23	0,16	2,14	2.318.953,92	1,28	2.405.684.296,02	0,10
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	19,95	2,50	-2,73	4.402.145,16	2,43	230.826.167,84	1,91
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,06	0,08	1,81	98.449,17	0,05	625.949.083,71	0,02
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	5,41	1,30	5,97	12.552.283,93	6,94	896.937.824,58	1,40
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF ATIVO FIC	0,98	0,14	2,08	1.852.222,04	1,02	970.330.180,33	0,19
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>5,39</b>	<b>1,07</b>	<b>2,62</b>	<b>41.587.080,64</b>	<b>22,99</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>8,73</b>	<b>1,55</b>	<b>2,50</b>	<b>131.769.257,04</b>	<b>72,83</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

27,17%

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	45,14	15,87	-6,13	10.607.295,96	5,86	346.244.753,58	3,06
CEF	CEF	FIA BRASIL IBX-50	46,02	15,69	-6,93	10.046.392,99	5,55	1.211.239.311,26	0,83
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	45,29	15,33	-5,95	2.650.560,27	1,47	1.059.305.047,31	0,25
<b>Sub-total Artigo 8º I, Alínea a</b>			<b>45,53</b>	<b>15,73</b>	<b>-6,44</b>	<b>23.304.249,22</b>	<b>12,88</b>		

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	43,69	12,66	-12,72	1.134.344,31	0,63	567.071.913,36	0,20
BRAM	BEM	BRDESCO F I A SELECTION	44,33	8,19	-10,73	4.232.058,64	2,34	767.879.921,64	0,55
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	39,19	13,62	-14,49	3.657.132,86	2,02	984.415.780,43	0,37
BRAM	BEM	BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	44,16	8,45	-9,67	5.817.821,69	3,22	2.027.456.710,01	0,29
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	44,57	13,75	-5,74	3.393.852,60	1,88	902.308.762,46	0,38
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	48,69	15,73	-10,06	3.443.005,83	1,90	1.328.168.471,54	0,26
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	43,68	15,99	-9,84	4.172.047,76	2,31	425.625.780,02	0,98
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>43,41</b>	<b>12,11</b>	<b>-10,35</b>	<b>25.850.263,69</b>	<b>14,29</b>		

Renda Variável e Investimentos Estruturados

44,25 13,80 -8,56 49.154.512,91 27,17

Total

15,83 4,59 -0,52 180.923.769,95 100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			
				Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>							
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	90.182.176,40	49,85	20,00	30,00	60,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	41.587.080,64	22,99	0,00	30,00	40,00	40,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>131.769.257,04</b>	<b>72,83</b>				100,00
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	23.304.249,22	12,88	0,00	20,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	25.850.263,69	14,29	0,00	10,00	20,00	20,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>49.154.512,91</b>	<b>27,17</b>				30,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

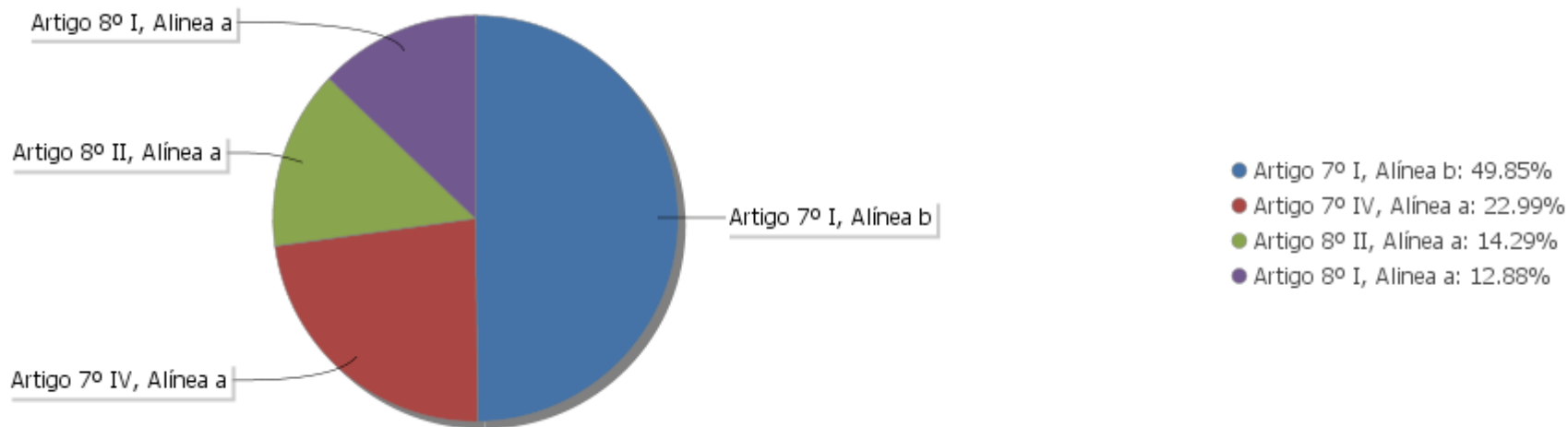
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,78 1.188,85	2,39 92,48	0,78 168,14	4,72 456,63	4,22 141,77	1.574.747,55	2.110.325,69
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	1,07 717,65	2,62 101,17	0,60 130,04	3,02 292,27	3,73 125,35	447.169,45	1.094.485,28
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	15,73 -0,17	-6,44 -0,60	9,18 -0,40	24,56 -0,03	0,16 -0,45	3.167.482,77	-1.553.360,12
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	12,11 -3,79	-10,35 -4,51	6,04 -3,54	22,48 -2,11	-2,25 -2,86	2.792.958,22	-2.942.605,75
<b>ILHA SOLTEIRA (Total)</b>						<b>7.982.357,99</b>	<b>-1.291.154,90</b>

Análise de Liquidez

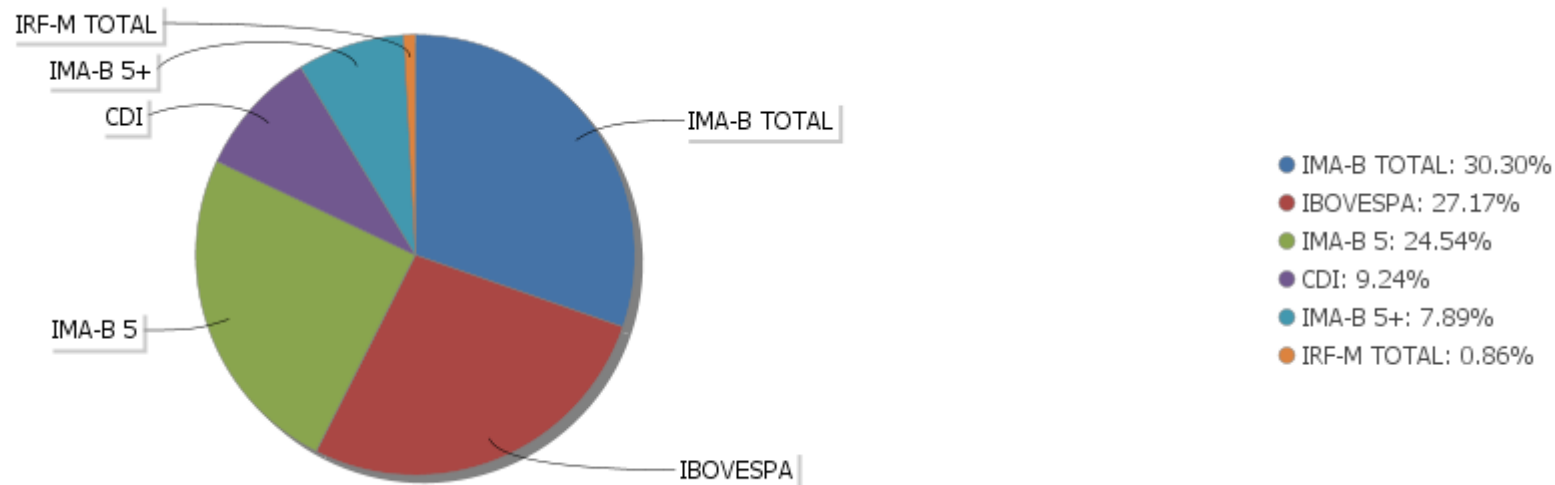
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	180.923.769,95	100,00	180.923.769,95	100,00
de 31 a 364 dias	0,00	0,00	180.923.769,95	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	180.923.769,95	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

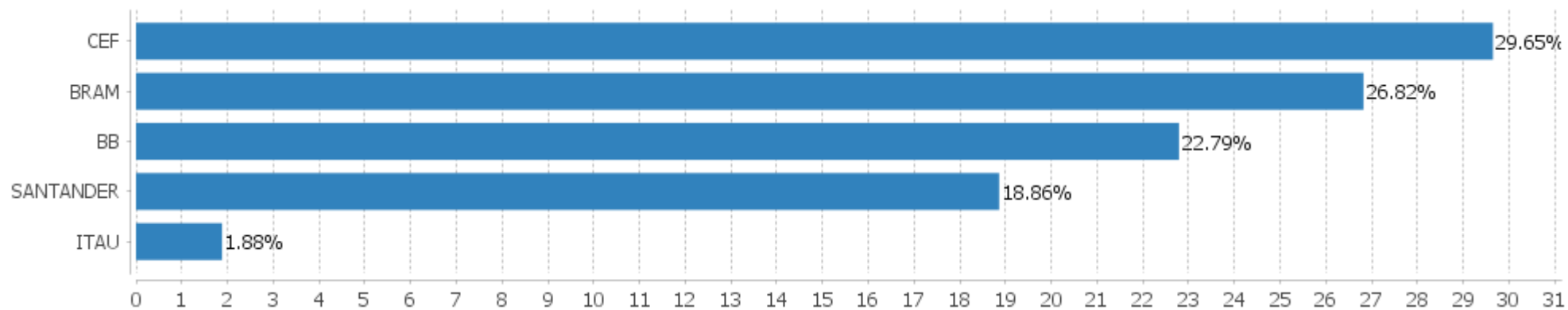


Alocação Por Estratégia



## 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	-1,92	-0,10	4,59		-0,52
IPCA + 5,89%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,89	0,72	1,12	1,34	1,35		8,63
p.p. indexador	-0,64	-2,77	-12,27	2,74	2,73	2,54	3,38	-2,19	-3,04	-1,44	3,24		-9,15
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

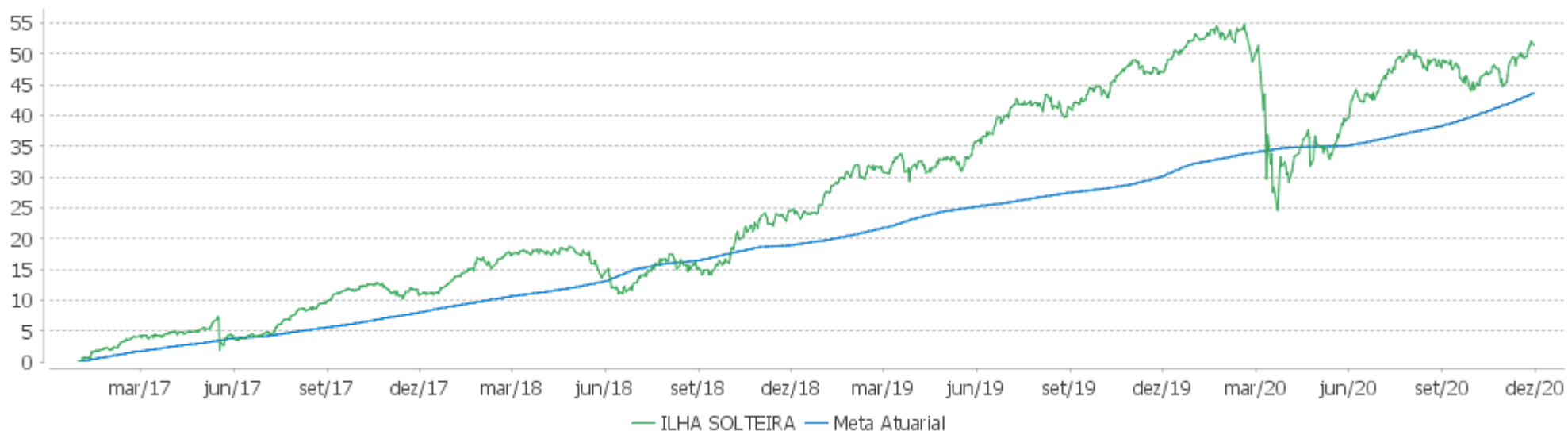
**PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL**

**RELATÓRIO TRIMESTRAL**

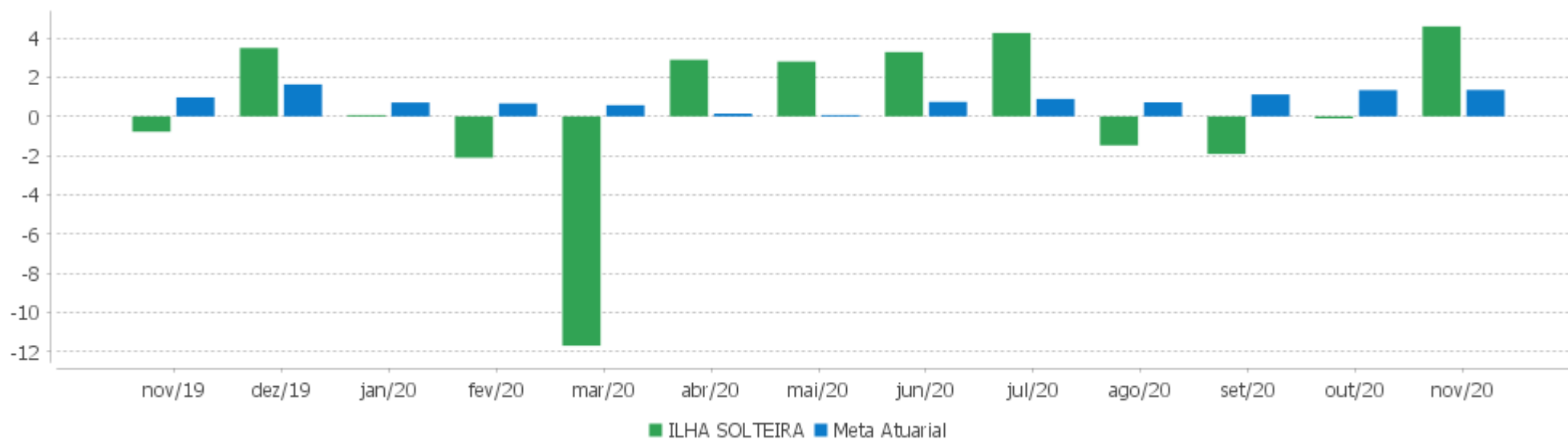
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	26	55,32	03 meses	2,48	3,86	-1,38	8,24
Meses abaixo da Meta Atuarial	21	44,68	06 meses	8,73	6,31	2,41	7,98
			12 meses	2,95	10,41	-7,47	15,83
			24 meses	21,56	20,87	0,69	12,08
Maior rentabilidade da Carteira	5,90	2018-10	36 meses	36,60	33,25	3,36	10,60
Menor rentabilidade da Carteira	-11,70	2020-03	Desde 30/12/2016	51,39	44,00	7,39	9,78

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
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,30 -0,02	5,92 -0,18	1,33 -0,06	3,83 -0,15	7,21 -0,20	21,19 -0,51	32,25 -0,81
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,29 -0,03	5,82 -0,28	1,31 -0,09	3,83 -0,16	7,10 -0,31	21,07 -0,62	32,11 -0,96
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,31 -0,01	5,87 -0,23	1,35 -0,05	3,81 -0,18	7,13 -0,28	21,12 -0,57	32,19 -0,88
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,34 -0,02	4,35 -0,30	-0,63 -0,10	0,45 -0,13	4,98 -0,32	18,41 -0,63	30,51 -0,92
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
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,98 -0,02	0,98 -0,50	0,60 -0,07	5,13 -0,18	2,98 -0,54	25,84 -0,99	40,74 -1,49
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,01 0,01	1,29 -0,19	0,47 -0,20	5,20 -0,12	3,33 -0,19	26,56 -0,26	41,64 -0,59
BRADERCO 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
SANTANDER RF ATIVO FIC % do CDI	0,14 91,67	2,08 80,21	-0,09 -18,42	0,43 41,73	2,49 83,68	17,39 188,17	22,67 139,06
BRADERCO 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
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,16 105,63	2,14 82,75	0,34 73,60	1,02 98,87	2,50 84,20	8,51 92,13	15,52 95,17
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,15 103,54	2,05 79,00	0,27 58,73	0,91 88,15	2,40 80,86	8,40 90,87	15,20 93,21
BRADERCO 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
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI % do CDI	0,16 108,94	1,82 70,26	0,39 84,85	0,95 91,57	2,20 73,83	8,28 89,62	15,18 93,13
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,08	1,81	0,26	0,61	2,12	7,43	13,44

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	55,06	69,89	55,22	58,88	71,33	80,43	82,44
FIA BRASIL IBX-50 Var. IBOVESPA p.p.	15,69 -0,21	-6,93 -1,10	9,00 -0,58	24,89 0,30	-0,34 -0,95	17,81 -3,86	43,90 -7,40
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IBOVESPA p.p.	15,33 -0,57	-5,95 -0,11	8,62 -0,96	24,08 -0,51	1,16 0,55	24,84 3,18	51,42 0,12
BRADERCO FIA IBOVESPA PLUS Var. IBOVESPA p.p.	15,87 -0,03	-6,13 -0,30	9,50 -0,09	24,36 -0,23	0,35 -0,26	21,10 -0,56	50,64 -0,66
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA Var. IBOVESPA p.p.	15,99 0,09	-9,84 -4,00	9,95 0,37	24,64 0,06	-2,45 -3,06	16,74 -4,92	45,64 -5,66
BRADERCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	8,19 -7,71	-10,73 -4,89	8,74 -0,85	28,88 4,29	-4,31 -4,92	14,22 -7,45	51,90 0,60
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	15,73 -0,17	-10,06 -4,23	6,25 -3,33	29,26 4,67	1,22 0,61	41,06 19,39	56,65 5,35
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES Var. IBOVESPA p.p.	12,66 -3,25	-12,72 -6,88	5,74 -3,84	23,61 -0,98	-5,90 -6,51	16,49 -5,17	40,71 -10,59
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI Var. IBOVESPA p.p.	13,75 -2,15	-5,74 0,10	7,45 -2,13	22,78 -1,81	2,05 1,44	27,36 5,70	56,34 5,03
BB AÇÕES DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	13,62 -2,29	-14,49 -8,65	6,71 -2,88	17,29 -7,30	-7,46 -8,07	10,30 -11,36	35,23 -16,08
BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. IBOVESPA p.p.	8,45 -7,45	-9,67 -3,83	0,45 -9,13	16,10 -8,49	-0,25 -0,86	36,82 15,16	73,99 22,69
ILHA SOLTEIRA Var. IPCA + 5,89% p.p.	4,59 3,24	-0,52 -9,15	2,48 -1,38	8,73 2,41	2,95 -7,46	21,56 0,83	36,60 3,64
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
<b>Renda Fixa</b>							
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
<b>Renda Variável</b>							
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
<b>Indicadores Econômicos</b>							
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
<b>Meta Atuarial</b>							

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Movimentações

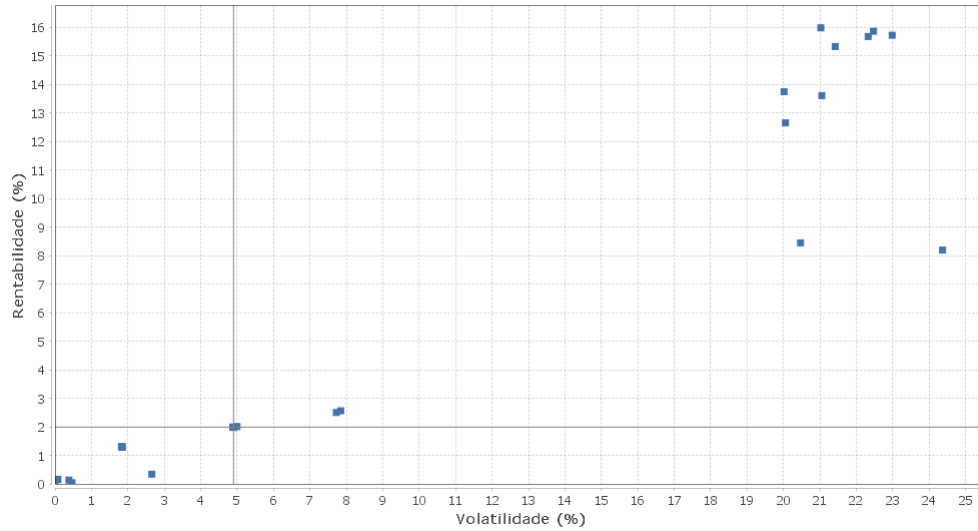
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
86	12/11/2020	SANTANDER RF ATIVO FIC	900.000,00	0,00	70.748,37020800	12,7211411000
84	13/11/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	10.000,00	2.686,32411400	3,7225590000
82	25/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	350.000,00	152.490,23600400	2,2952289220
83	25/11/2020	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	580.000,00	47.330,53400000	12,2542459000
85	25/11/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	180.000,00	48.325,06671500	3,7247750000
87	25/11/2020	SANTANDER RF ATIVO FIC	0,00	420.000,00	33.002,11753400	12,7264561000

**Total**

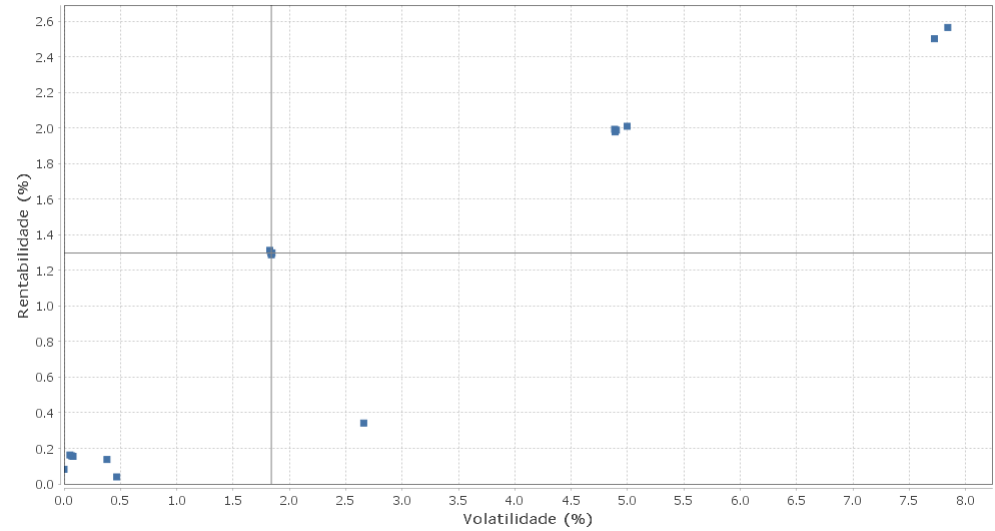
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

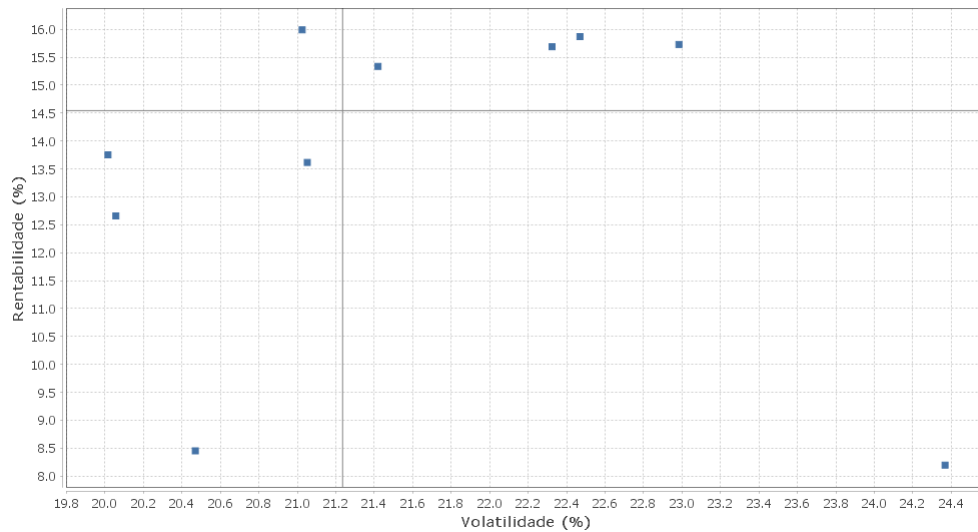
ILHA SOLTEIRA - No Mês



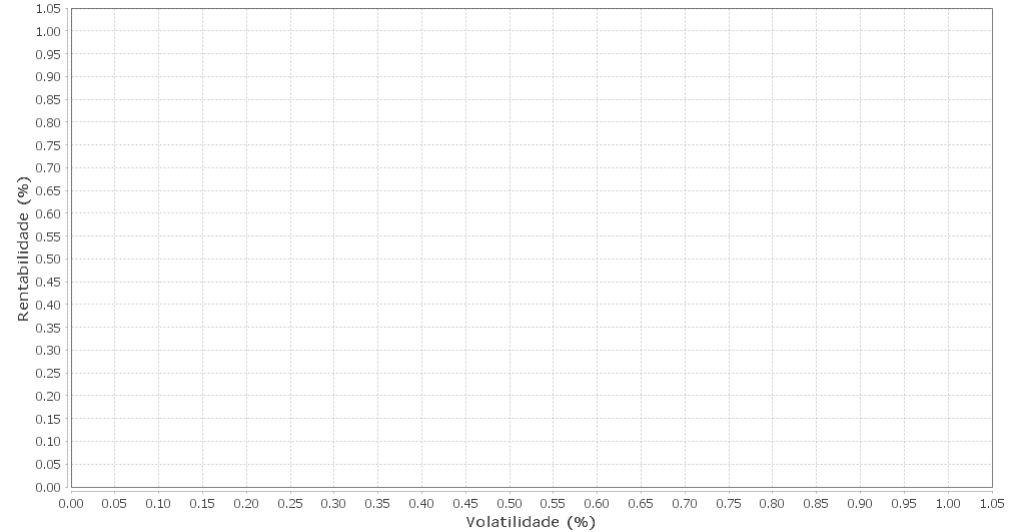
Renda Fixa - No Mês



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\$): 6.771.035,86

Value-At-Risk: 3,74%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,00	0,00	-123,29	0,08	98.449,17	0,05
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,05	0,10	0,00	0,26	0,16	10.355,12	0,01
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,07	0,09	0,00	0,12	0,16	2.318.953,92	1,28
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,08	0,13	0,00	0,07	0,15	9.449.231,60	5,22
SANTANDER RF ATIVO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,38	0,47	0,00	-0,03	0,14	1.852.222,04	1,02
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	Artigo 7º IV, Alínea a	0,47	0,06	-0,00	-0,23	0,04	2.988.303,46	1,65
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,83	0,99	0,04	0,64	1,31	11.671.863,30	6,45
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5	Artigo 7º IV, Alínea a	1,84	1,08	0,05	0,63	1,30	12.552.283,93	6,94
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,84	1,03	0,03	0,62	1,29	7.983.626,36	4,41
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,84	1,02	0,05	0,62	1,30	12.190.280,96	6,74
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	2,66	1,34	0,01	0,07	0,34	1.550.984,08	0,86
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,89	2,66	0,18	0,38	1,99	15.214.610,94	8,41
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,89	2,66	0,22	0,37	1,98	18.939.885,23	10,47
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,90	2,67	0,15	0,38	1,99	12.756.849,18	7,05
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	5,00	2,74	0,09	0,37	2,01	7.915.136,24	4,37
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	Artigo 7º IV, Alínea a	7,72	4,13	0,08	0,30	2,50	4.402.145,16	2,43
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	7,84	4,17	0,18	0,31	2,57	9.874.076,35	5,46
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	20,01	9,78	0,18	0,68	13,75	3.393.852,60	1,88
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	20,06	10,16	0,06	0,62	12,66	1.134.344,31	0,63
BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	20,47	11,01	0,32	0,41	8,45	5.817.821,69	3,22
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	Artigo 8º II, Alínea a	21,02	10,55	0,23	0,75	15,99	4.172.047,76	2,31
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	21,05	9,69	0,19	0,64	13,62	3.657.132,86	2,02
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	21,42	10,42	0,14	0,71	15,33	2.650.560,27	1,47
FIA BRASIL IBX-50	Artigo 8º I, Alínea a	22,32	10,77	0,56	0,70	15,69	10.046.392,99	5,55
BRADERCO FIA IBOVESPA PLUS	Artigo 8º I, Alínea a	22,47	10,62	0,58	0,70	15,87	10.607.295,96	5,86
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	22,98	10,78	0,18	0,68	15,73	3.443.005,83	1,90
BRADERCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	24,37	10,95	0,22	0,33	8,19	4.232.058,64	2,34