



LDB
EMPRESAS

ILHA SOLTEIRA
SETEMBRO 2021



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 30.09.2021.

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

73,52%

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	2,91	-0,38	-3,19	1.849.957,05	1,01	6.207.836.765,86	0,03
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,33	-0,15	-2,46	15.557.201,35	8,53	7.233.196.021,39	0,22
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,31	-0,16	-2,51	13.039.209,15	7,15	5.161.580.539,44	0,25
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,48	0,98	2,30	8.315.695,25	4,56	11.150.255.278,19	0,07
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,48	0,99	2,33	12.699.411,34	6,96	1.170.815.240,32	1,08
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	5,31	-0,15	-2,50	19.357.360,65	10,61	1.141.624.055,64	1,70
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,27	-1,27	-6,87	9.891.258,97	5,42	1.307.235.728,08	0,76
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,49	0,98	2,29	12.154.440,22	6,66	6.090.651.961,96	0,20
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			4,46	0,12	-1,35	92.864.533,98	50,89		

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	0,18	0,49	2,84	791.416,22	0,43	3.692.592.328,71	0,02
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,28	0,53	2,65	12.986.384,17	7,12	7.234.670.708,96	0,18
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	5,55	-0,20	-3,14	8.045.734,83	4,41	1.126.747.978,22	0,71
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,18	0,46	2,64	846.148,15	0,46	5.468.058.659,45	0,02
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	8,23	-1,27	-6,75	4.410.844,77	2,42	191.374.527,85	2,30
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,07	0,33	1,77	100.285,96	0,05	598.538.196,75	0,02
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,64	0,95	1,69	12.991.806,34	7,12	1.161.932.475,65	1,12
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF ATIVO FIC	0,59	0,31	1,63	1.121.591,79	0,61	837.909.050,68	0,13
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			2,66	0,32	0,22	41.294.212,23	22,63		
Renda Fixa			3,89	0,18	-0,85	134.158.746,21	73,52		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

26,48%

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	20,96	-6,62	-7,01	10.780.967,69	5,91	324.690.584,96	3,32
CEF	CEF	FIA BRASIL IBX-50	21,15	-7,25	-6,05	9.284.162,26	5,09	1.130.911.674,08	0,82
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	20,39	-6,75	-5,50	2.553.547,66	1,40	1.120.979.496,53	0,23
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			20,91	-6,89	-6,40	22.618.677,61	12,40		

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	20,51	-7,96	-11,37	1.081.904,68	0,59	265.214.247,07	0,41
BRAM	BEM	BRDESCO F I A SELECTION	20,69	-8,28	-9,84	4.117.067,38	2,26	600.652.318,90	0,69
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	18,73	-6,04	-10,92	3.258.358,74	1,79	745.348.218,75	0,44
BRAM	BEM	BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	20,14	-3,91	2,47	6.474.531,41	3,55	1.995.199.093,32	0,32
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	19,52	-6,60	-8,41	3.368.519,76	1,85	853.399.264,69	0,39
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	22,04	-6,52	-6,24	3.473.463,00	1,90	1.047.084.854,27	0,33
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	19,70	-7,05	-8,20	3.917.487,08	2,15	461.684.635,98	0,85
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			19,24	-6,26	-6,31	25.691.332,05	14,08		

Renda Variável e Investimentos Estruturados

19,80 -6,56 -6,35 48.310.009,66 26,48

Total

7,21 -1,68 -2,26 182.468.755,87 100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	92.864.533,98	50,89	20,00	30,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	41.294.212,23	22,63	0,00	30,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	134.158.746,21	73,52					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	22.618.677,61	12,40	0,00	20,00	30,00	0,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	25.691.332,05	14,08	0,00	10,00	20,00	0,00	20,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	48.310.009,66	26,48					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	0,12 28,26	-1,35 -53,65	-0,98 -80,26	0,88 43,50	4,63 154,85	114.870,05	-1.258.034,11
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,32 72,78	0,22 8,81	0,03 2,22	1,49 73,98	3,89 129,93	132.641,42	65.907,67
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-6,89 -0,33	-6,40 0,35	-13,41 -0,93	-5,13 -0,28	17,27 -0,04	-1.674.889,55	-1.414.477,04
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-6,26 0,31	-6,31 0,44	-13,37 -0,89	-3,81 1,04	12,57 -4,74	-1.715.912,24	-1.678.552,38
ILHA SOLTEIRA (Total)						-3.143.290,32	-4.285.155,86

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	12.036.770,54	0,00	0,00	0,00	12.154.440,22	117.669,68	271.679,34
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	15.581.126,76	0,00	0,00	0,00	15.557.201,35	-23.925,41	-393.162,68
BB PREV RF IRF-M	1.856.935,95	0,00	0,00	0,00	1.849.957,05	-6.978,90	-50.294,16
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	10.018.004,08	0,00	0,00	0,00	9.891.258,97	-126.745,11	-729.591,76
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8.234.905,48	0,00	0,00	0,00	8.315.695,25	80.789,77	186.783,25
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	13.059.552,78	0,00	0,00	0,00	13.039.209,15	-20.343,63	-335.128,89
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	12.575.403,79	0,00	0,00	0,00	12.699.411,34	124.007,55	288.667,62
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	19.386.964,55	0,00	0,00	0,00	19.357.360,65	-29.603,90	-496.986,83
					92.864.533,98	114.870,05	0,06

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.161.040,26	0,00	-320.000,00	0,00	846.148,15	5.107,89	41.823,37
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	1.335.163,22	0,00	-550.000,00	0,00	791.416,22	6.253,00	66.569,58
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5	12.869.500,11	0,00	0,00	0,00	12.991.806,34	122.306,23	216.390,63

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	8.062.101,97	0,00	0,00	0,00	8.045.734,83	-16.367,14	-260.707,74
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	4.467.423,37	0,00	0,00	0,00	4.410.844,77	-56.578,60	-319.368,13
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	99.951,64	0,00	0,00	0,00	100.285,96	334,32	1.748,28
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	13.097.309,29	0,00	-180.000,00	0,00	12.986.384,17	69.074,88	310.112,97
SANTANDER RF ATIVO FIC	369.080,95	1.100.000,00	-350.000,00	0,00	1.121.591,79	2.510,84	9.308,39
					41.294.212,23	132.641,42	0,07

Artigo 8º I, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	2.738.431,62	0,00	0,00	0,00	2.553.547,66	-184.883,96	-128.898,70
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	11.544.865,15	0,00	0,00	0,00	10.780.967,69	-763.897,46	-812.274,22
FIA BRASIL IBX-50	10.010.270,39	0,00	0,00	0,00	9.284.162,26	-726.108,13	-473.304,12
					22.618.677,61	-1.674.889,55	-0,90

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	4.214.710,30	0,00	0,00	0,00	3.917.487,08	-297.223,22	-326.538,05
BB AÇÕES DIVIDENDOS	3.467.711,52	0,00	0,00	0,00	3.258.358,74	-209.352,78	-379.175,42
BRADESCO F I A SELECTION	4.488.970,66	0,00	0,00	0,00	4.117.067,38	-371.903,28	-449.504,87
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	6.737.742,61	0,00	0,00	0,00	6.474.531,41	-263.211,20	155.910,69
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	3.715.918,30	0,00	0,00	0,00	3.473.463,00	-242.455,30	-231.195,54
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	3.606.689,64	0,00	0,00	0,00	3.368.519,76	-238.169,88	-309.248,70
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	1.175.501,26	0,00	0,00	0,00	1.081.904,68	-93.596,58	-138.800,49
					25.691.332,05	-1.715.912,24	-0,92

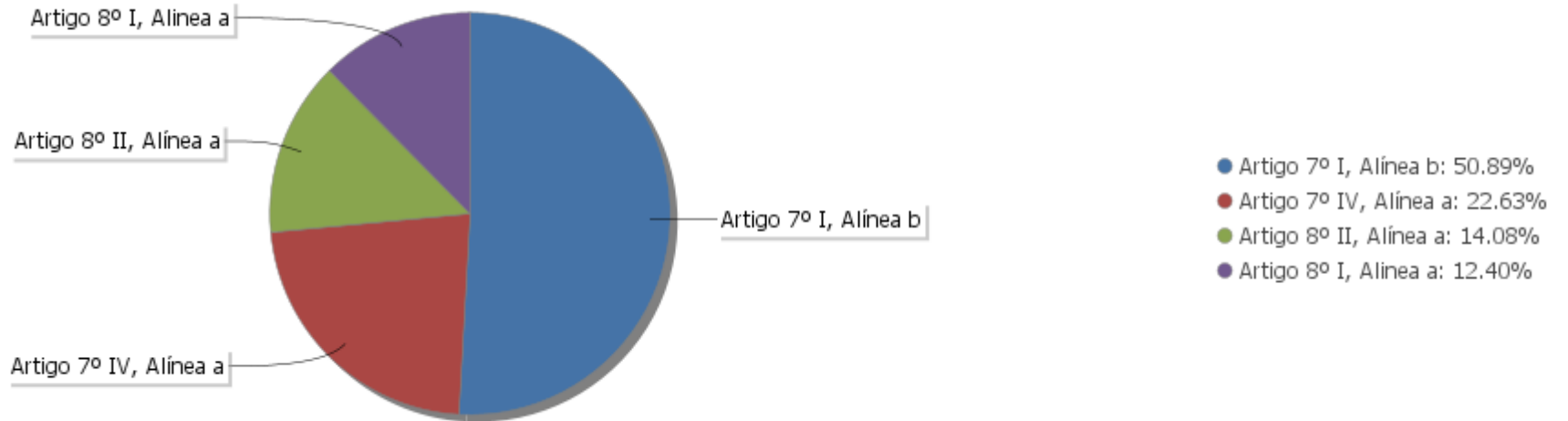
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

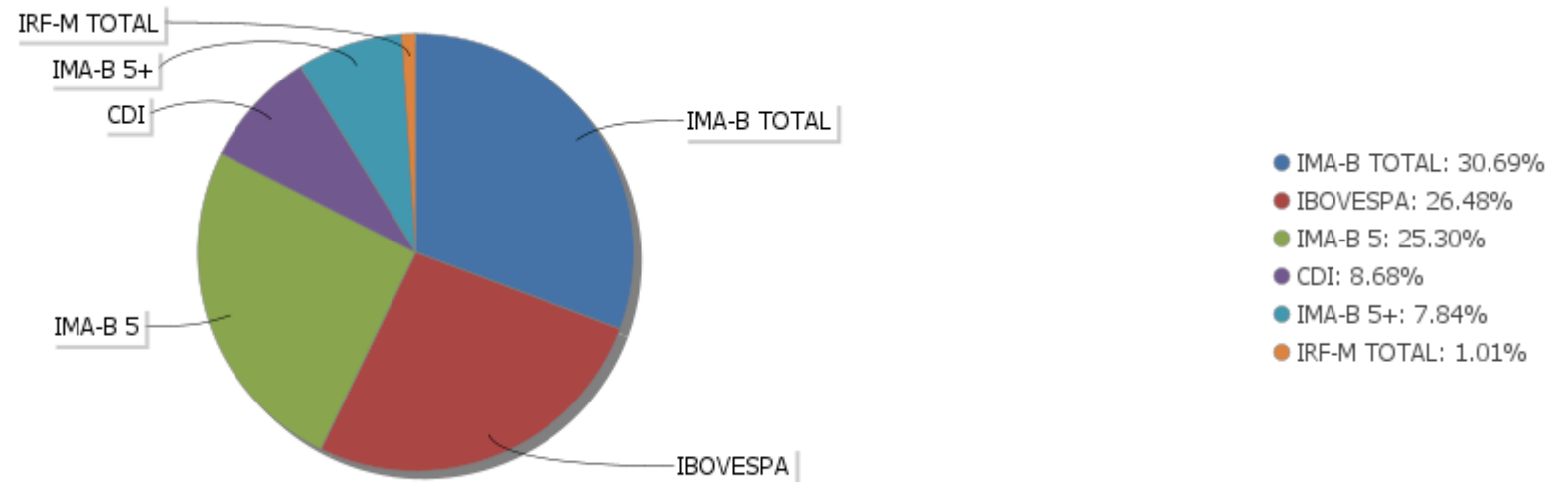
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	182.468.755,87	100,00	182.468.755,87	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	182.468.755,87	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	182.468.755,87	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

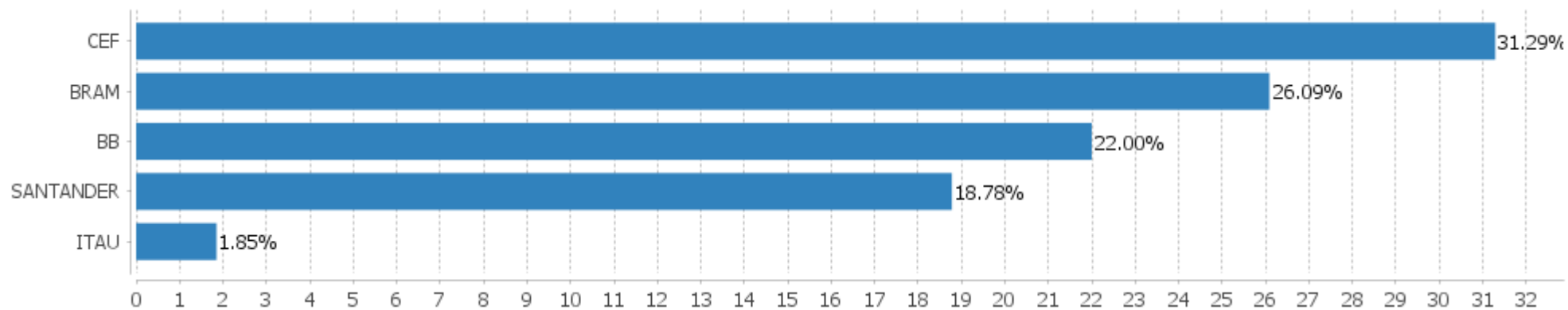


Alocação Por Estratégia



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
2021	-1,25	-1,72	1,08	1,36	2,39	0,39	-1,37	-1,38	-1,68				-2,26
IPCA + 5,42%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,43	1,34	1,61				11,19
p.p. indexador	-1,92	-2,97	-0,34	0,63	1,12	-0,58	-2,79	-2,72	-3,29				-13,45
2020	0,07	-2,11	-11,70	2,89	2,80	3,28	4,26	-1,48	-1,92	-0,10	4,59	4,91	4,37
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	1,86	10,65
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	3,06	-6,28
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 + 6,00%	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 + 6,00%	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 + 6,00%	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

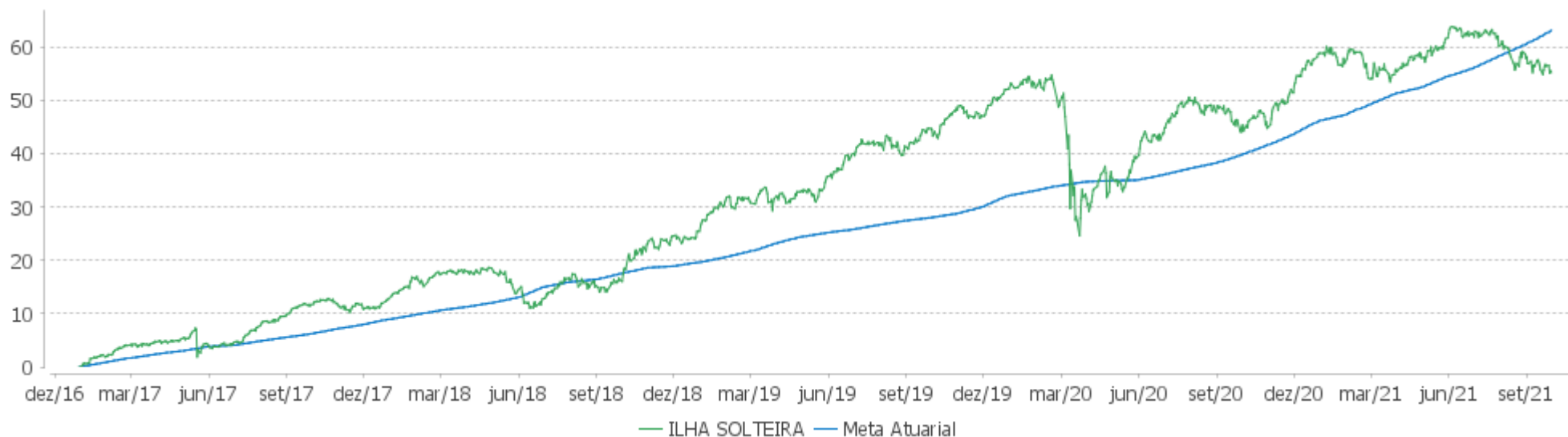
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

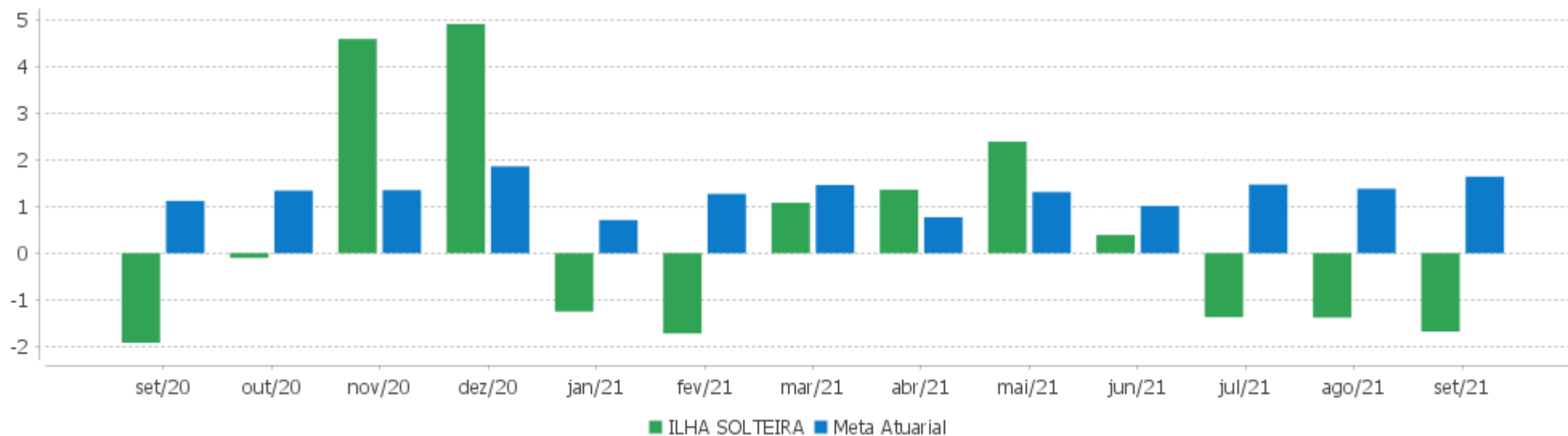
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	29	50,88	03 meses	-4,37	4,43	-8,80	7,55
Meses abaixo - Meta Atuarial	28	49,12	06 meses	-0,36	7,57	-7,93	6,67
			12 meses	7,15	16,33	-9,18	7,21
			24 meses	7,28	27,07	-19,79	12,17
Maior rentabilidade da Carteira	5,90	2018-10	36 meses	33,47	38,56	-5,10	10,79
Menor rentabilidade da Carteira	-11,70	2020-03	48 meses	39,01	53,42	-14,41	9,78
			Desde 30/12/2016	55,24	63,09	-7,85	9,36

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
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,20 -0,07	-3,14 -0,84	-1,80 -0,21	0,31 -0,21	3,79 -0,92	5,90 -1,02	39,52 -0,94
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	0,95 -0,05	1,69 -0,79	1,01 -0,18	2,43 -0,21	4,98 -0,97	12,47 -1,16	29,72 -1,40
SANTANDER RF ATIVO FIC % do CDI	0,31 69,64	1,63 65,17	0,82 66,80	1,63 80,81	2,40 80,19	6,83 102,64	21,45 160,73
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,49 112,38	2,84 113,34	1,38 112,49	2,28 113,27	3,26 109,08	6,25 93,96	12,84 96,20
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,46 104,77	2,64 105,40	1,31 106,72	2,13 105,74	3,23 107,92	6,30 94,70	12,80 95,91
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,53 120,89	2,65 105,83	1,48 120,99	2,31 114,51	3,31 110,66	6,30 94,74	12,82 96,01
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+ Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,27 -0,01	-6,75 -0,12	-4,34 -0,15	-1,89 -0,28	2,92 -0,29	0,38 -1,10	44,66 -2,33
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,33 76,33	1,77 70,76	0,91 74,56	1,49 74,03	2,04 68,15	4,77 71,74	10,42 78,06
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,16 -0,02	-2,51 -0,21	-1,68 -0,09	0,37 -0,15	4,45 -0,26	6,20 -0,72	39,29 -1,17
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,99 -0,02	2,33 -0,16	1,12 -0,06	2,52 -0,12	5,72 -0,23	13,16 -0,46	30,33 -0,79
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,98 -0,02	2,30 -0,19	1,13 -0,05	2,53 -0,11	5,69 -0,26	13,00 -0,62	30,19 -0,93
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,98 -0,02	2,29 -0,20	1,11 -0,08	2,49 -0,15	5,70 -0,25	13,04 -0,58	30,18 -0,94
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,38 -0,05	-3,19 -0,24	-1,51 -0,12	-0,38 -0,23	-1,26 -0,24	4,87 -0,60	22,26 -0,96
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,15 -0,02	-2,46 -0,16	-1,66 -0,07	0,40 -0,12	4,49 -0,22	6,40 -0,52	39,39 -1,07
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,27 -0,01	-6,87 -0,24	-4,33 -0,14	-1,81 -0,20	2,97 -0,24	0,80 -0,67	45,16 -1,83
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,15 -0,02	-2,50 -0,20	-1,65 -0,06	0,38 -0,14	4,42 -0,29	6,07 -0,85	38,99 -1,47
FIA BRASIL IBX-50	-7,25	-6,05	-14,34	-5,34	17,51	5,44	34,48

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-0,69	0,70	-1,86	-0,49	0,20	-0,51	-5,39
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	-6,75	-5,50	-13,47	-4,90	17,56	7,93	46,90
Var. IBOVESPA p.p.	-0,18	1,26	-0,99	-0,05	0,25	1,97	7,02
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	-6,62	-7,01	-12,57	-5,04	16,91	5,32	38,82
Var. IBOVESPA p.p.	-0,05	-0,25	-0,09	-0,20	-0,40	-0,63	-1,05
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	-7,05	-8,20	-14,12	-5,86	14,97	0,89	28,85
Var. IBOVESPA p.p.	-0,48	-1,45	-1,64	-1,01	-2,34	-5,06	-11,02
BRADESCO FIA SELECTION	-8,28	-9,84	-14,73	-4,60	8,76	-5,07	25,32
Var. IBOVESPA p.p.	-1,72	-3,09	-2,25	0,25	-8,55	-11,03	-14,55
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-6,52	-6,24	-15,87	-5,36	13,95	9,19	65,50
Var. IBOVESPA p.p.	0,04	0,51	-3,40	-0,51	-3,36	3,24	25,63
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	-7,96	-11,37	-13,62	-5,88	5,36	-7,28	26,51
Var. IBOVESPA p.p.	-1,39	-4,62	-1,15	-1,03	-11,95	-13,23	-13,36
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	-6,60	-8,41	-13,64	-6,12	11,40	5,54	45,87
Var. IBOVESPA p.p.	-0,04	-1,65	-1,16	-1,27	-5,91	-0,41	5,99
BB AÇÕES DIVIDENDOS	-6,04	-10,92	-14,46	-7,63	7,38	-10,29	22,14
Var. IBOVESPA p.p.	0,53	-4,17	-1,98	-2,78	-9,93	-16,24	-17,73
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	-3,91	2,47	-9,75	2,89	17,72	15,75	74,77
Var. IBOVESPA p.p.	2,66	9,22	2,73	7,74	0,41	9,80	34,90
ILHA SOLTEIRA	-1,68	-2,26	-4,37	-0,36	7,15	7,28	33,47
Var. IPCA + 5,89% p.p.	-3,33	-13,82	-8,92	-8,17	-9,57	-20,18	-5,38
CDI	0,44	2,51	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35
IBOVESPA	-6,57	-6,75	-12,48	-4,85	17,31	5,95	39,87
INPC + 6,00%	1,69	11,97	4,69	8,28	17,40	29,29	41,02
IPCA + 6,00%	1,65	11,65	4,58	7,87	16,83	27,73	39,28

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,40	1,78	0,96	1,65	2,49	7,15	15,12	22,90	38,45
IRF-M 1+	-0,73	-5,87	-2,65	-1,15	-3,14	4,23	25,92	32,64	58,13
IRF-M TOTAL	-0,33	-2,95	-1,39	-0,15	-1,02	5,48	23,23	30,30	53,03
IMA-B 5	1,00	2,48	1,18	2,64	5,95	13,62	31,12	39,68	58,47
IMA-B 5+	-1,26	-6,63	-4,19	-1,61	3,20	1,48	46,98	45,78	70,99
IMA-B TOTAL	-0,13	-2,30	-1,59	0,52	4,71	6,92	40,46	44,04	66,75
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,02	-0,76	-0,42	0,89	2,05	6,02	23,59	29,99	49,60
IMA-GERAL TOTAL	-0,01	-0,38	-0,52	0,96	2,48	6,93	24,87	31,60	51,09
IDKA 2	1,10	3,07	1,18	3,12	6,21	14,71	29,45	40,48	59,67
IDKA 20	-3,03	-11,97	-8,65	-5,13	2,03	-7,04	59,98	49,40	80,44
CDI	0,44	2,51	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35	20,90	34,86

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-6,57	-6,75	-12,48	-4,85	17,31	5,95	39,87	49,38	90,14
IBRX 100	-6,99	-5,99	-13,61	-5,31	17,82	7,71	45,23	53,72	95,90
IBRX 50	-7,47	-6,33	-14,15	-5,58	18,46	6,59	37,53	47,56	87,32
SMALL CAP	-6,43	-5,54	-15,22	-4,70	15,75	13,69	78,82	65,15	133,65
IFIX	-1,24	-5,38	-1,42	-4,61	-2,83	1,17	27,21	22,27	49,54
Índice Consumo - ICON	-5,95	-11,50	-14,34	-7,48	-1,67	-2,69	50,48	25,77	51,19
Índice Dividendos - IDIV	-4,48	-4,67	-6,59	-1,51	19,58	7,85	64,83	56,04	121,60

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	1,16	6,90	3,02	4,75	10,25	13,70	16,99	22,29	25,39
INPC	1,20	7,21	3,13	5,14	10,78	15,09	18,46	23,16	25,17
IGPM	-0,64	16,00	0,80	7,15	24,86	47,25	52,21	67,49	65,07
SELIC	0,44	2,51	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35	20,91	34,89

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	0,73	20,04	8,99	3,52	23,52	89,01	100,82	193,57	232,88
MSCI ACWI	1,23	14,91	7,16	0,61	21,06	78,00	83,86	150,21	184,12
MSCI World	1,22	16,99	8,36	2,09	22,47	80,14	87,02	158,04	191,94

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,49	10,07	4,07	6,84	14,64	22,96	31,56	42,95	52,39
IPCA + 5,00%	1,57	10,86	4,32	7,36	15,74	25,33	35,38	48,50	59,82
IPCA + 5,50%	1,61	11,26	4,45	7,61	16,29	26,53	37,32	51,33	63,64
IPCA + 5,89%	1,64	11,56	4,55	7,81	16,71	27,46	38,84	53,57	66,67
IPCA + 6,00%	1,65	11,65	4,58	7,87	16,83	27,73	39,28	54,21	67,53
INPC + 4,00%	1,53	10,39	4,18	7,24	15,20	24,46	33,20	43,97	52,12
INPC + 6,00%	1,69	11,97	4,69	8,28	17,40	29,29	41,02	55,31	67,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

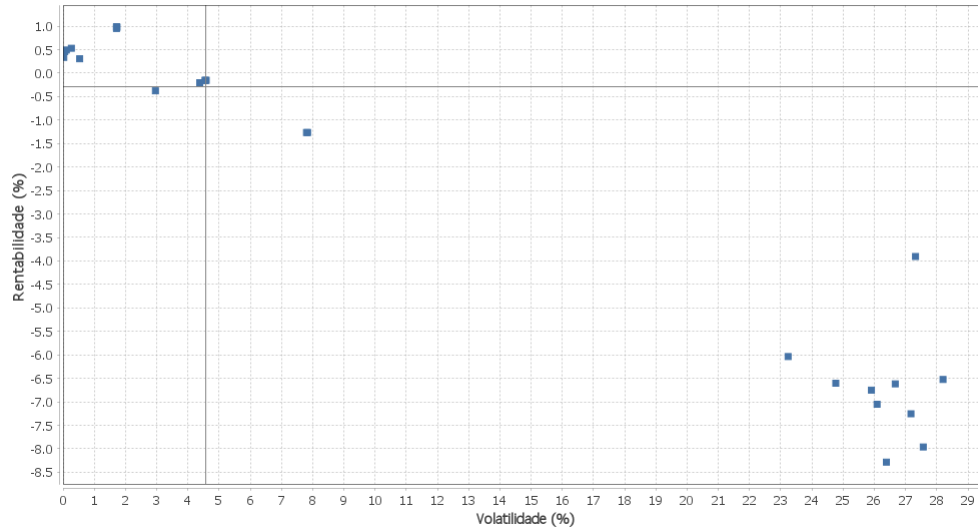
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
81	02/09/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	30.000,00	7.852,41022500	3,8204830000
84	14/09/2021	SANTANDER RF ATIVO FIC	1.100.000,00	0,00	84.559,87236100	13,0085343000
82	21/09/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	70.000,00	18.275,32150300	3,8303020000
78	27/09/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	320.000,00	135.538,77510200	2,3609480000
85	27/09/2021	SANTANDER RF ATIVO FIC	0,00	350.000,00	26.873,25906900	13,0240995000
79	28/09/2021	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	220.369,95	17.452,28000000	12,6270004000
80	28/09/2021	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	329.630,05	26.105,17500000	12,6270004000
83	29/09/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	80.000,00	20.844,03773500	3,8380280000
Total						

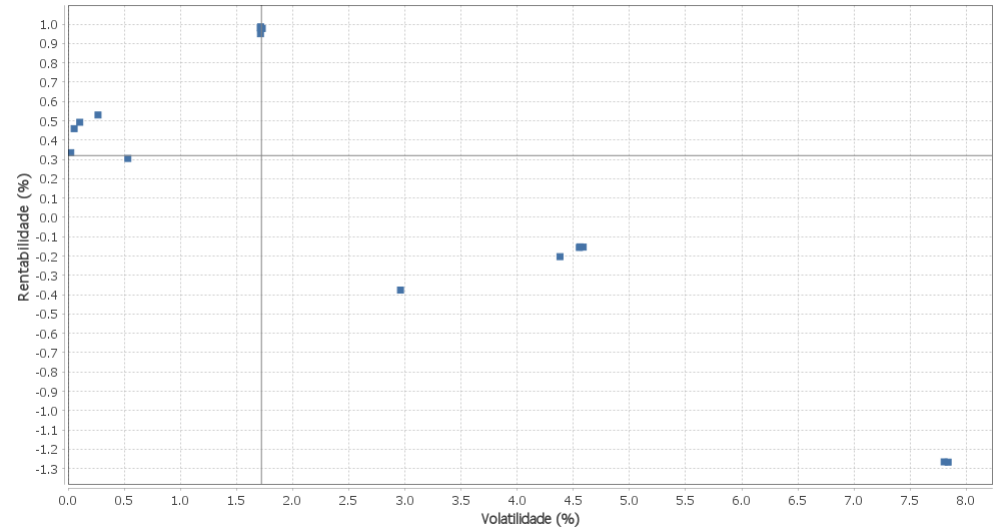
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

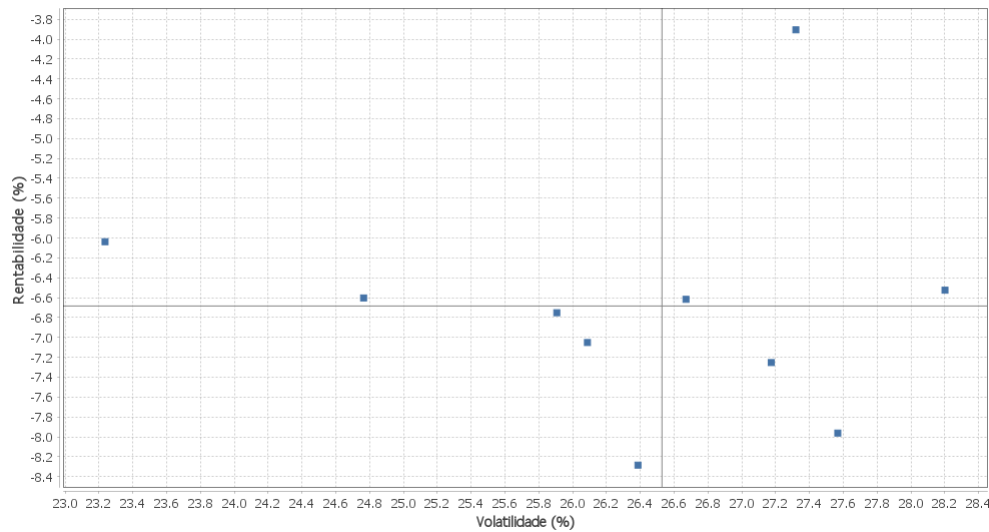
ILHA SOLTEIRA - No Mês



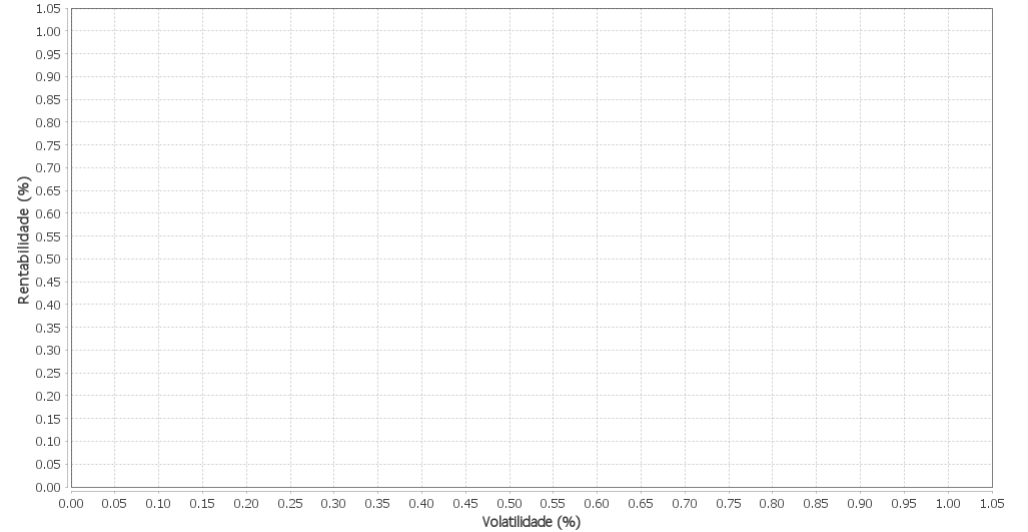
Renda Fixa - No Mês



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\$): 6.373.579,44

Value-At-Risk: 3,49%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,01	-0,00	-4,27	0,33	100.285,96	0,05
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,05	0,03	-0,00	0,39	0,46	846.148,15	0,46
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	Artigo 7º IV, Alínea a	0,10	0,04	-0,00	0,52	0,49	791.416,22	0,43
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,27	0,05	0,00	0,34	0,53	12.986.384,17	7,12
SANTANDER RF ATIVO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,53	0,29	0,00	-0,25	0,31	1.121.591,79	0,61
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,71	1,23	0,04	0,32	0,98	8.315.695,25	4,56
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	Artigo 7º IV, Alínea a	1,71	1,26	0,06	0,30	0,95	12.991.806,34	7,12
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,72	1,24	0,06	0,32	0,99	12.699.411,34	6,96
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,73	1,25	0,05	0,31	0,98	12.154.440,22	6,66
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	2,96	1,48	0,01	-0,27	-0,38	1.849.957,05	1,01
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	4,38	3,03	0,11	-0,15	-0,20	8.045.734,83	4,41
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,55	2,95	0,17	-0,13	-0,16	13.039.209,15	7,15
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	Artigo 7º I, Alínea b	4,56	2,95	0,25	-0,13	-0,15	19.357.360,65	10,61
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,59	2,97	0,20	-0,13	-0,15	15.557.201,35	8,53
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	7,80	4,07	0,17	-0,22	-1,27	9.891.258,97	5,42
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	Artigo 7º IV, Alínea a	7,84	4,06	0,08	-0,22	-1,27	4.410.844,77	2,42
BB AÇÕES DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	23,24	9,42	0,15	-0,28	-6,04	3.258.358,74	1,79
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	24,76	8,78	0,15	-0,28	-6,60	3.368.519,76	1,85
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	25,91	8,65	0,11	-0,28	-6,75	2.553.547,66	1,40
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	Artigo 8º II, Alínea a	26,09	9,50	0,19	-0,29	-7,05	3.917.487,08	2,15
BRADESCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	26,39	8,18	0,17	-0,33	-8,28	4.117.067,38	2,26
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	Artigo 8º I, Alínea a	26,67	10,09	0,54	-0,26	-6,62	10.780.967,69	5,91
FIA BRASIL IBX-50	Artigo 8º I, Alínea a	27,17	9,92	0,46	-0,28	-7,25	9.284.162,26	5,09
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	27,32	9,29	0,29	-0,16	-3,91	6.474.531,41	3,55
SANTANDER FIC FI SELECAO TOP ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	27,57	9,23	0,05	-0,30	-7,96	1.081.904,68	0,59
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	28,20	11,60	0,20	-0,25	-6,52	3.473.463,00	1,90