



**LDB**  
EMPRESAS

**LENÇÓIS PAULISTA**  
MAIO 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 31.05.2021.

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

100,00%

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
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,35	0,19	0,56	4.310.929,87	1,07	228.795.569,18	1,88
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	5,81	1,04	-1,24	2.880.959,29	0,71	408.646.892,21	0,70
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,34	0,18	0,47	50.107.940,58	12,43	8.309.754.636,48	0,60
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,83	1,05	-1,19	2.155.450,84	0,53	7.382.686.390,39	0,03
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5,82	1,03	-1,29	11.914.302,55	2,96	698.111.228,03	1,71
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,47	0,19	0,52	13.487.857,56	3,35	146.011.117,00	9,24
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,32	0,17	0,51	50.352.492,05	12,49	8.656.296.995,82	0,58
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,35	0,20	0,42	61.434.464,63	15,24	787.139.847,80	7,80
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,58	0,38	-0,82	0,00	0,00	1.078.471.153,85	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,44	0,67	1,31	48.138.729,68	11,95	14.343.181.790,80	0,34
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,23	0,67	1,51	58.786.358,93	14,59	10.138.018.656,57	0,58
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	5,82	1,03	-1,26	24.028.655,65	5,96	1.180.044.595,00	2,04
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>1,44</b>	<b>0,44</b>	<b>0,55</b>	<b>327.598.141,63</b>	<b>81,29</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	0,29	0,35	1,17	16.527,79	0,00	1.662.530.779,21	0,00
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,28	0,99	185.756,42	0,05	3.866.862.013,76	0,00
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,53	0,27	0,72	68.337.382,38	16,96	3.524.278.161,54	1,94
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF ATIVO FIC	0,69	0,33	0,51	6.843.480,19	1,70	969.985.350,52	0,71
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>0,53</b>	<b>0,28</b>	<b>0,70</b>	<b>75.383.146,78</b>	<b>18,71</b>		

Renda Fixa

1,24

0,41

0,57

402.981.288,41

100,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Total

1,24

0,41

0,57

402.981.288,41

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
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	327.598.141,63	81,29	60,00	80,00	98,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	75.383.146,78	18,71	2,00	10,00	40,00	0,00	40,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>402.981.288,41</b>	<b>100,00</b>					100,00

## 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	0,44 164,57	0,55 56,97	0,98 143,77	1,84 161,98	4,02 184,65	1.462.443,62	1.790.792,69
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,28 102,31	0,70 72,85	0,53 77,80	0,94 82,77	1,74 79,97	206.935,23	508.669,69
<b>LENÇÓIS PAULISTA (Total)</b>						<b>1.669.378,85</b>	<b>2.299.462,38</b>

## 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 IDKA2	57.368.789,49	1.025.908,58	0,00	0,00	58.786.358,93	391.660,86	862.185,93
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	2.132.953,78	0,00	0,00	0,00	2.155.450,84	22.497,06	-25.942,76
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	52.513.824,78	0,00	-2.499.225,26	0,00	50.107.940,58	93.341,06	247.989,15
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	61.314.279,30	0,00	0,00	0,00	61.434.464,63	120.185,33	260.664,38
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	11.792.452,20	0,00	0,00	0,00	11.914.302,55	121.850,35	-156.143,19
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.173.888,90	0,00	-1.178.397,15	0,00	0,00	4.508,25	-9.738,65
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	46.645.445,58	1.178.499,16	0,00	0,00	48.138.729,68	314.784,94	607.957,68
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	50.266.923,48	0,00	0,00	0,00	50.352.492,05	85.568,57	253.427,14
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	2.851.433,83	0,00	0,00	0,00	2.880.959,29	29.525,46	-36.143,86
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	4.302.605,62	0,00	0,00	0,00	4.310.929,87	8.324,25	23.889,56
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.462.266,60	0,00	0,00	0,00	13.487.857,56	25.590,96	68.786,31
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	23.784.049,12	0,00	0,00	0,00	24.028.655,65	244.606,53	-306.139,00
					327.598.141,63	0,00	0,00

## 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	185.230,14	0,00	0,00	0,00	185.756,42	526,28	1.817,60
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	66.378.791,36	1.775.000,00	0,00	0,00	68.337.382,38	183.591,02	472.039,91

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	16.469,45	0,00	0,00	0,00	16.527,79	58,34	190,73
SANTANDER RF ATIVO FIC	6.820.720,60	0,00	0,00	0,00	6.843.480,19	22.759,59	34.621,45
					75.383.146,78	0,00	0,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

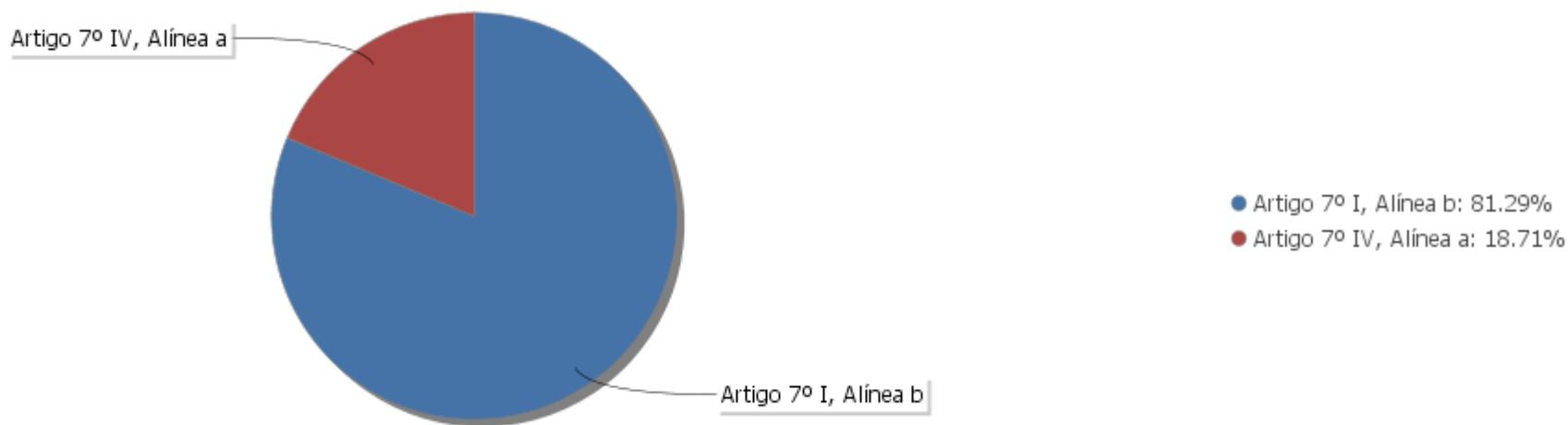
## Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	402.981.288,41	100,00	402.981.288,41	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	402.981.288,41	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	402.981.288,41	100,00

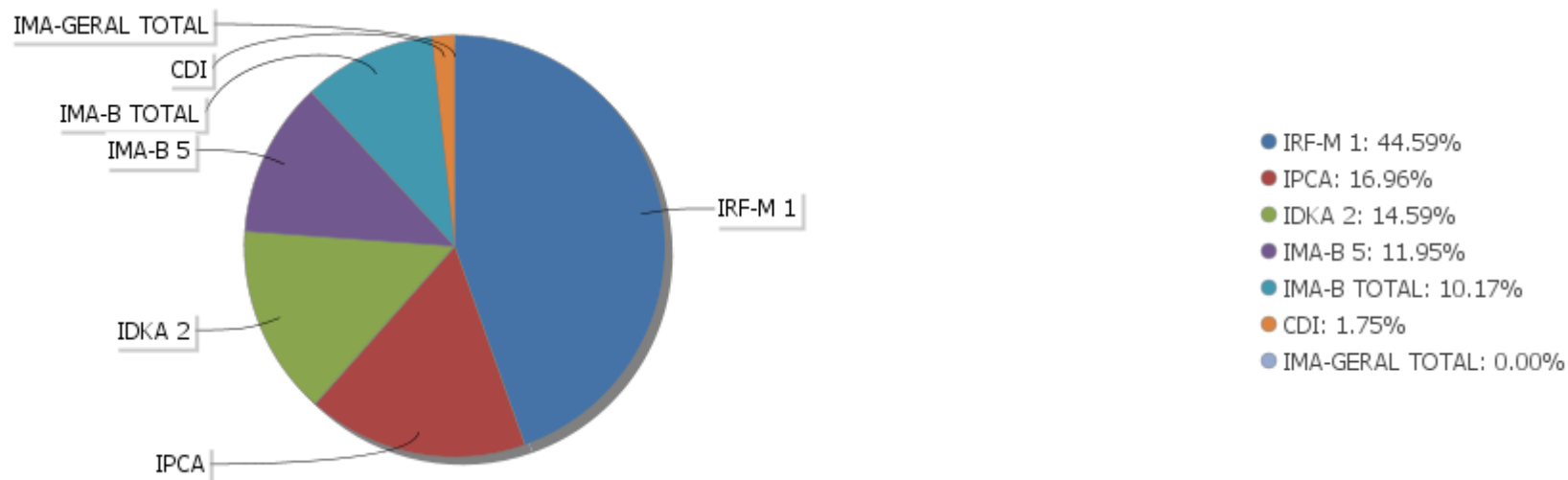


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

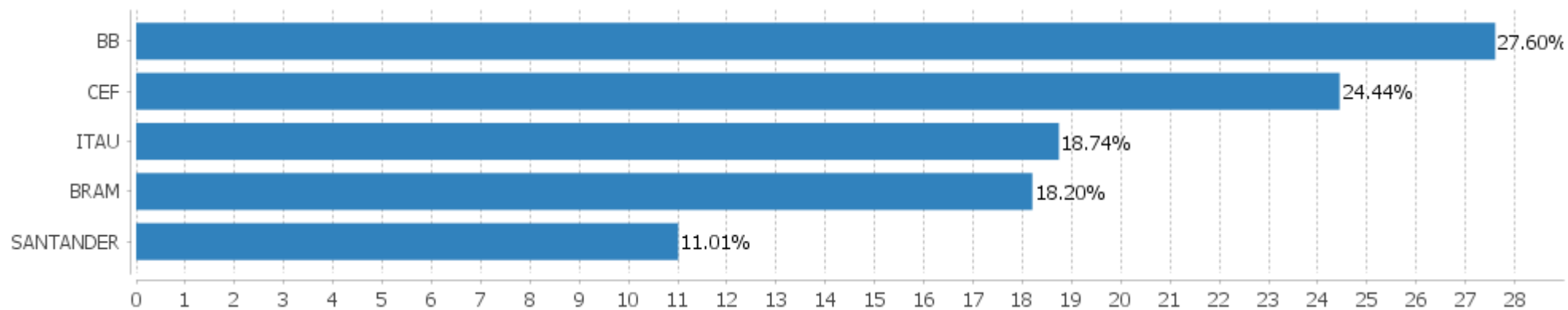


Alocação Por Estratégia



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Alocação por Gestor



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**
**Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial**

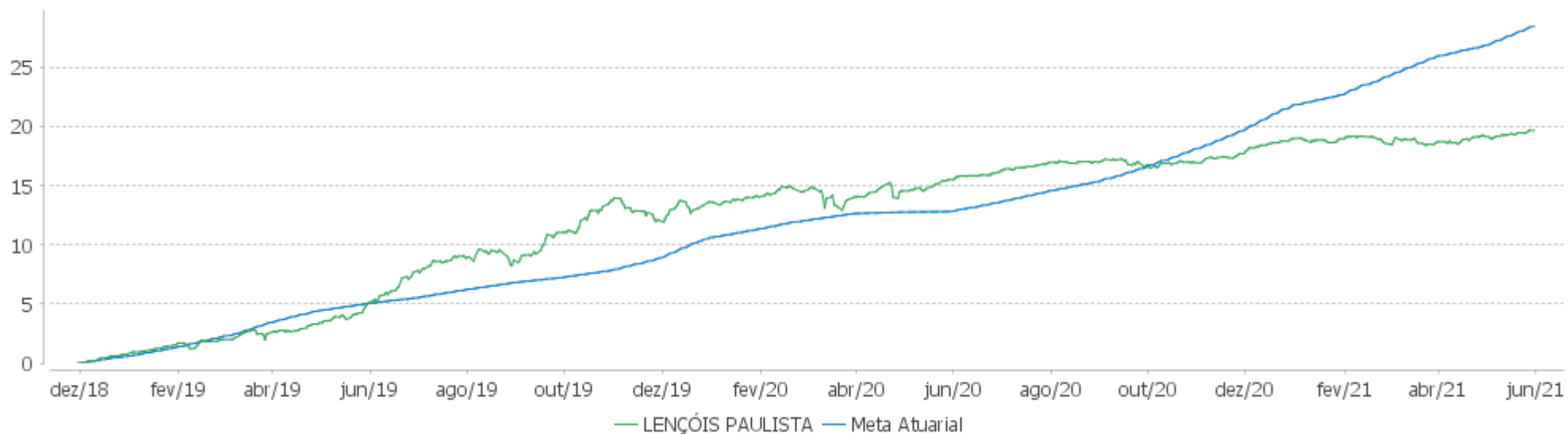
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2021	-0,02	-0,30	0,07	0,41	0,41								0,57
IPCA + 5,41%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27								5,44
p.p. indexador	-0,69	-1,54	-1,35	-0,32	-0,86								-4,87
2020	0,36	0,42	-0,38	0,41	0,83	0,58	0,66	0,03	-0,19	0,16	0,64	1,09	4,71
IPCA + 6,00%	0,72	0,67	0,58	0,15	0,08	0,75	0,90	0,73	1,13	1,35	1,36	1,87	10,76
p.p. indexador	-0,36	-0,25	-0,96	0,26	0,75	-0,17	-0,23	-0,70	-1,32	-1,19	-0,72	-0,77	-6,05
2019	0,87	0,34	0,50	0,87	1,64	2,45	1,12	-0,16	2,15	2,42	-1,46	1,38	12,76
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	0,04	-0,55	-0,69	-0,19	1,00	2,00	0,40	-0,78	1,70	1,79	-2,43	-0,26	2,17
2018												0,76	0,76
IPCA + 6,00%												0,61	0,61
p.p. indexador												0,15	0,15

**Performance Sobre a Meta Atuarial**
**Relatório**

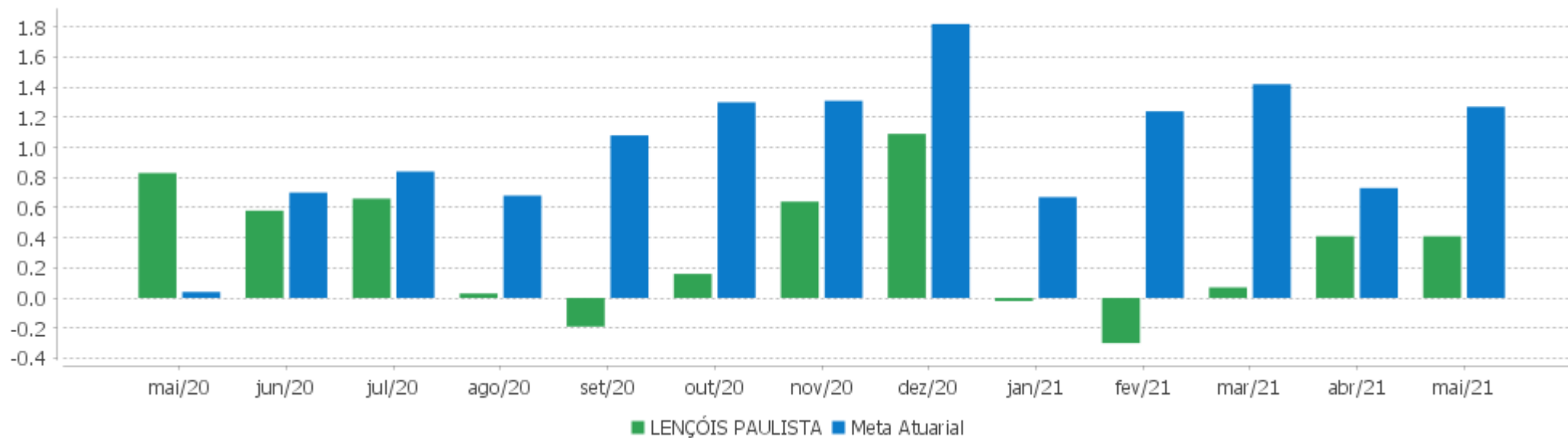
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	9	30,00	03 meses	0,90	3,46	-2,56	1,42
Meses abaixo - Meta Atuarial	21	70,00	06 meses	1,67	7,41	-5,74	1,28
			12 meses	3,60	14,25	-10,66	1,24
			24 meses	13,86	23,35	-9,50	2,35
Maior rentabilidade da Carteira	2,45	2019-06	Desde 30/11/2018	19,65	29,95	-10,30	2,23
Menor rentabilidade da Carteira	-1,46	2019-11					

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
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,19 -0,00	0,56 -0,04	0,44 -0,07	0,90 -0,01	1,84 -0,26	8,03 -0,54	15,49 -0,88
ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,04 -0,02	-1,24 -0,10	1,19 -0,06	3,53 -0,13	8,83 -0,34	15,85 -0,61	42,59 -1,50
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,67 -0,02	1,31 -0,11	1,85 -0,07	3,15 -0,12	7,10 -0,30	16,90 -0,65	32,13 -0,96
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,67 -0,20	1,51 -0,68	1,89 -0,64	3,06 -0,90	7,77 -0,70	16,46 -1,80	29,34 -3,17
BRDESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,20 -0,00	0,42 -0,18	0,40 -0,12	0,74 -0,17	1,70 -0,41	7,82 -0,75	15,28 -1,09
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,18 -0,02	0,47 -0,13	0,44 -0,08	0,79 -0,12	1,73 -0,38	7,88 -0,69	15,39 -0,99
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,19 -0,01	0,52 -0,07	0,50 -0,02	0,93 0,02	1,77 -0,34	7,93 -0,64	15,54 -0,83
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,17 -0,03	0,51 -0,09	0,46 -0,05	0,79 -0,12	1,89 -0,21	8,12 -0,44	15,70 -0,67
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,05 -0,00	-1,19 -0,05	1,22 -0,02	3,59 -0,07	8,90 -0,27	15,96 -0,50	43,05 -1,05
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,47 -0,15	-0,74 -0,52	0,55 -0,18	1,35 -0,45	3,31 -0,89	10,72 -1,38	25,50 -2,03
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,03 -0,02	-1,29 -0,16	1,15 -0,10	3,47 -0,19	8,80 -0,37	15,67 -0,79	42,58 -1,51
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,03 -0,03	-1,26 -0,12	1,17 -0,08	3,51 -0,15	8,82 -0,34	15,51 -0,95	42,54 -1,55
SANTANDER RF ATIVO FIC % do CDI	0,33 123,44	0,51 52,84	0,60 87,61	1,13 99,33	1,56 71,67	10,63 148,61	21,64 154,76
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,28 105,11	0,99 102,20	0,73 106,60	1,24 109,65	2,28 104,53	6,64 92,82	13,30 95,08
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,27 -0,56	0,72 -2,50	0,52 -1,56	0,92 -3,69	1,75 -6,31	9,72 -0,36	21,51 6,29
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI % do CDI	0,35 131,03	1,17 120,74	0,87 128,24	1,44 127,43	2,40 110,35	6,51 91,00	13,29 95,03
LENÇÓIS PAULISTA	0,41	0,57	0,90	1,67	3,60	13,86	

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA + 5,41% p.p.	-0,86	-4,87	-2,56	-5,69	-10,28	-8,41	
CDI	0,27	0,97	0,68	1,13	2,18	7,16	13,98
IBOVESPA	6,16	6,05	14,70	15,91	44,41	30,08	64,44
INPC + 6,00%	1,45	5,80	3,74	7,89	15,40	24,81	38,59
IPCA + 6,00%	1,32	5,68	3,61	7,65	14,51	23,63	37,13

**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	0,20	0,60	0,52	0,91	2,11	8,57	16,37	25,88	43,11
IRF-M 1+	0,20	-3,51	-0,14	-0,57	-0,28	13,33	31,30	45,86	74,27
IRF-M TOTAL	0,20	-1,79	0,19	0,13	0,71	12,10	27,04	40,22	64,99
IMA-B 5	0,69	1,42	1,92	3,27	7,39	17,55	33,09	46,16	64,24
IMA-B 5+	1,38	-3,35	0,65	3,91	10,69	15,30	52,84	63,86	92,42
IMA-B TOTAL	1,06	-1,14	1,25	3,66	9,17	16,46	44,09	56,66	80,66
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,50	-0,66	0,61	1,45	3,33	11,00	26,04	37,48	59,06
IMA-GERAL TOTAL	0,61	-0,21	0,73	1,81	4,20	12,11	27,53	39,29	60,68
IDKA 2	0,88	2,19	2,53	3,96	8,47	18,26	32,51	46,64	65,76
IDKA 20	2,37	-4,65	0,81	6,18	15,79	13,16	71,22	79,58	122,22
CDI	0,27	0,97	0,68	1,13	2,18	7,16	13,98	22,72	38,97

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,16	6,05	14,70	15,91	44,41	30,08	64,44	101,27	160,39
IBRX 100	5,92	8,14	15,50	18,03	47,63	34,45	72,38	109,11	171,70
IBRX 50	6,18	8,39	15,91	18,61	49,33	32,34	65,03	102,41	160,17
SMALL CAP	6,32	10,00	16,04	18,26	57,75	55,08	97,90	135,01	241,15
IFIX	-1,56	-1,87	-2,43	0,28	5,97	10,33	27,21	36,94	74,68
Índice Consumo - ICON	6,51	2,66	9,81	7,79	27,87	37,71	69,55	74,93	108,51
Índice Dividendos - IDIV	5,64	4,32	15,93	13,64	37,85	30,26	78,57	100,70	199,05

## 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	0,83	3,22	2,08	4,61	8,06	10,08	15,21	18,50	22,77
INPC	0,96	3,33	2,22	4,84	8,90	11,13	16,44	18,49	22,46
IGPM	4,10	14,39	8,77	15,49	37,04	45,96	57,11	63,81	66,39
SELIC	0,27	0,97	0,68	1,13	2,18	7,16	13,99	22,73	39,01

**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	-2,64	12,69	4,37	13,92	33,16	102,83	116,09	181,17	191,78
MSCI ACWI	-1,84	10,84	2,43	12,92	34,65	91,95	95,33	147,44	157,20
MSCI World	-1,95	11,37	3,24	13,05	33,59	93,08	98,36	151,08	158,61

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,16	4,87	3,11	6,65	12,36	19,03	29,54	38,50	49,22
IPCA + 5,00%	1,24	5,28	3,36	7,15	13,44	21,32	33,30	43,87	56,50
IPCA + 5,50%	1,28	5,48	3,48	7,40	13,97	22,47	35,20	46,62	60,24
IPCA + 5,89%	1,31	5,64	3,58	7,60	14,39	23,38	36,70	48,78	63,21
IPCA + 6,00%	1,32	5,68	3,61	7,65	14,51	23,63	37,13	49,40	64,06
INPC + 4,00%	1,29	4,99	3,24	6,88	13,23	20,16	30,92	38,49	48,86
INPC + 6,00%	1,45	5,80	3,74	7,89	15,40	24,81	38,59	49,39	63,66



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

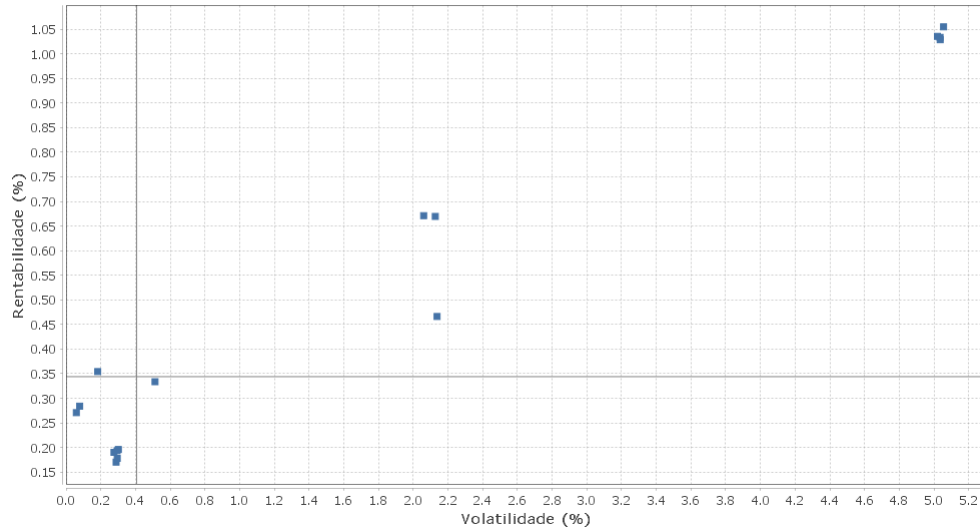
## Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
16	07/05/2021	BB PREV RF IDKA2	210.001,13	0,00	72.020,13348800	2,9158669920
15	10/05/2021	BB PREV RF IDKA2	815.907,45	0,00	279.824,87106800	2,9157788830
21	10/05/2021	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1.775.000,00	0,00	97.975,77630347	18,1167230000
18	27/05/2021	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	1.178.397,15	398.748,91629500	2,9552360000
19	27/05/2021	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.058.562,45	0,00	324.409,59251800	3,2630430000
17	28/05/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	2.499.225,26	912.803,91378500	2,7379651010
20	28/05/2021	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	119.936,71	0,00	36.655,76499000	3,2719740000
<b>Total</b>						

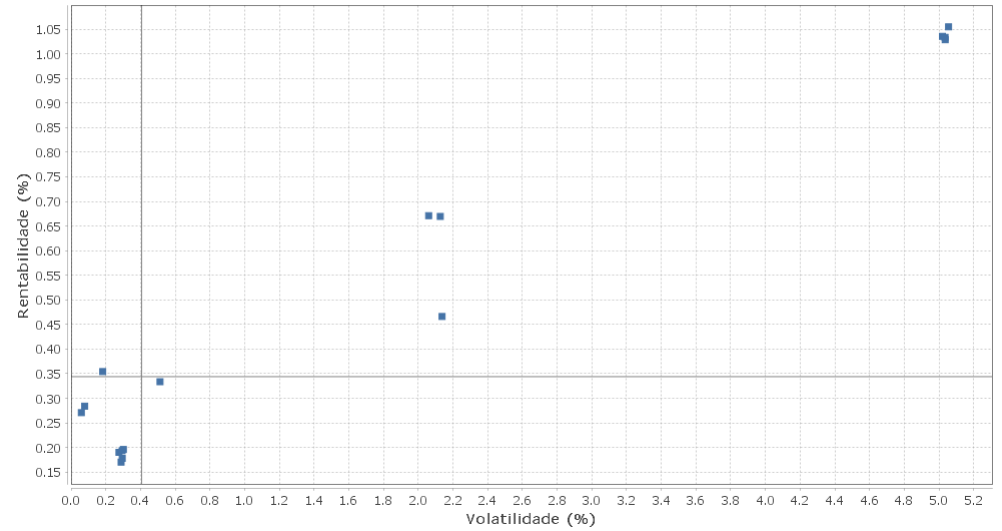
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

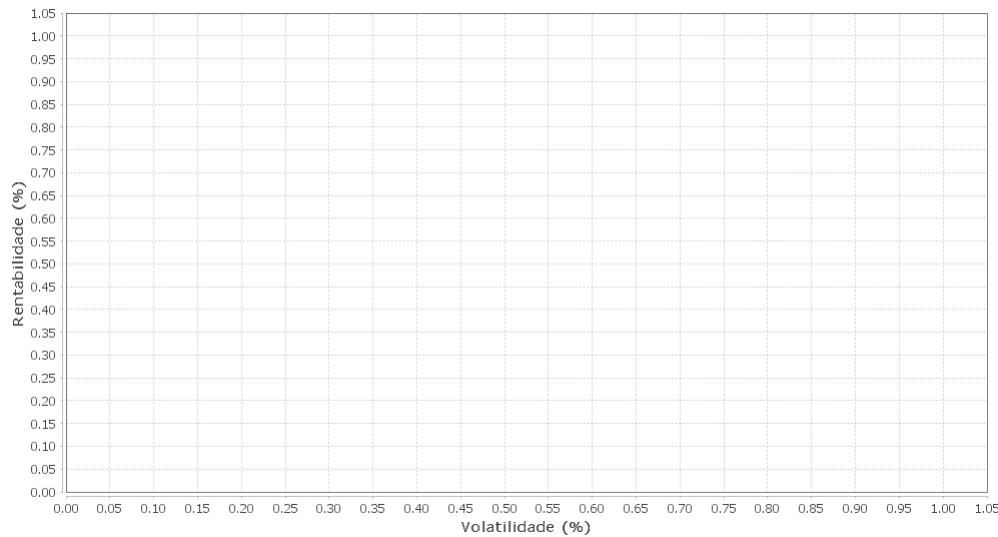
LENÇÓIS PAULISTA - No Mês



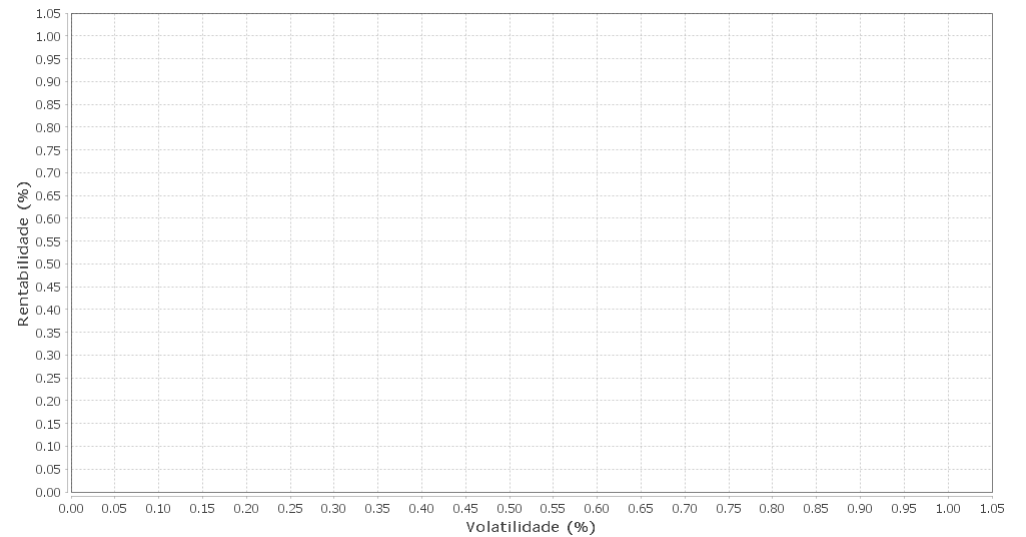
Renda Fixa - No Mês



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\$): 2.803.281,46

Value-At-Risk: 0,70%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,06	0,04	0,00	0,01	0,27	68.337.382,38	16,96
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,08	0,04	0,00	0,18	0,28	185.756,42	0,05
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,18	0,04	0,00	0,46	0,35	16.527,79	0,00
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,28	0,15	0,00	-0,29	0,19	13.487.857,56	3,35
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,29	0,15	0,01	-0,35	0,17	50.352.492,05	12,49
ITAU SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,29	0,15	0,00	-0,26	0,19	4.310.929,87	1,07
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,29	0,15	0,01	-0,31	0,18	50.107.940,58	12,43
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	Artigo 7º I, Alínea b	0,30	0,15	0,02	-0,25	0,20	61.434.464,63	15,24
SANTANDER RF ATIVO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,51	0,26	0,00	0,12	0,33	6.843.480,19	1,70
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	2,06	1,37	0,19	0,19	0,67	58.786.358,93	14,59
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,13	1,39	0,16	0,19	0,67	48.138.729,68	11,95
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,14	NaN	0,00	0,09	0,47	0,00	0,00
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	5,02	2,96	0,02	0,15	1,04	2.880.959,29	0,71
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	Artigo 7º I, Alínea b	5,04	2,96	0,08	0,15	1,03	11.914.302,55	2,96
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	Artigo 7º I, Alínea b	5,04	2,97	0,17	0,15	1,03	24.028.655,65	5,96
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	5,06	2,97	0,02	0,16	1,05	2.155.450,84	0,53