



LDB
EMPRESAS

CAMPO MOURÃO
JANEIRO 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 29.01.2021.

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

70,23%

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-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,58	0,03	0,03	5.141.904,35	3,18	8.572.331.669,58	0,06
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,90	-0,87	-0,87	6.902.603,21	4,27	6.185.705.380,20	0,11
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,56	0,03	0,03	5.512.238,68	3,41	10.435.150.283,00	0,05
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,06	0,08	0,08	11.935.657,59	7,39	13.518.203.391,91	0,09
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	4,24	0,18	0,18	13.608.544,06	8,42	9.200.599.633,08	0,15
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,18	0,13	0,13	7.389.591,14	4,57	10.852.113.121,11	0,07
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	5,04	0,10	0,10	13.971.418,68	8,64	5.043.806.710,80	0,28
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,97	0,03	0,03	24.657.047,97	15,26	14.822.912.413,17	0,17
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			4,92	0,02	0,02	89.119.005,68	55,14		

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
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,67	0,13	0,13	3.099.701,30	1,92	3.621.561.522,63	0,09
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	6,98	-0,58	-0,58	19.487.737,24	12,06	1.406.368.486,30	1,39
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			6,01	-0,48	-0,48	22.587.438,54	13,98		

Artigo 7º VII, Alínea a (Cota Sênior de FIDC)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
AURORA	CM CAPITAL	FIDC GGR PRIME I	12,65	0,03	0,03	1.797.739,79	1,11	155.844.626,83	1,15
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a			12,65	0,03	0,03	1.797.739,79	1,11		
Renda Fixa			5,00	-0,08	-0,08	113.504.184,01	70,23		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

28,42%

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	BEM	BRADERCO F I A SELECTION	44,62	-2,48	-2,48	2.559.679,43	1,58	781.607.838,45	0,33
CONSTÂNCIA	BEM	CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA	42,65	-3,89	-3,89	1.438.985,44	0,89	303.493.072,64	0,47
BRAM	BRADERCO	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	44,62	-3,31	-3,31	3.907.697,53	2,42	254.934.014,43	1,53
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	53,08	-2,91	-2,91	1.220.128,17	0,75	1.335.473.423,07	0,09
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	42,54	-5,59	-5,59	6.888.333,31	4,26	1.137.598.937,97	0,61
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	42,64	-3,56	-3,56	7.032.879,73	4,35	296.764.545,63	2,37
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			43,31	-4,00	-4,00	23.047.703,61	14,26		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	33,60	-0,05	-0,05	15.553.790,01	9,62	729.276.922,74	2,13
Sub-total Artigo 8º III			33,60	-0,05	-0,05	15.553.790,01	9,62		

Artigo 8º IV, Alínea a (Fundos de Participações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
A5	PLANNER	W7 FIP MULTISTRATÉGIA	4,74	4,78	4,78	3.252.576,21	2,01	140.443.002,71	2,32
LEGATUS	DAYCOVAL	FIP LA SHOPPING CENTERS	9,31	-0,26	-0,26	2.521.073,88	1,56	243.530.060,71	1,04
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			4,80	2,52	2,52	5.773.650,09	3,57		

Artigo 8º IV, Alínea b (Fundos de Investimentos Imobiliários)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
PLANNER	PLANNER	CARE11	48,77	-1,43	-1,43	1.558.063,47	0,96	249.287.660,42	0,63
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			48,77	-1,43	-1,43	1.558.063,47	0,96		

Renda Variável e Investimentos Estruturados

22,31

-1,82

-1,82

45.933.207,18

28,42

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,35%

Artigo 9º A, III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	30,33	5,79	5,79	2.178.172,34	1,35	2.159.778.426,35	0,10
Sub-total Artigo 9º A, III			30,33	5,79	5,79	2.178.172,34	1,35		
Investimentos no Exterior			22,17	5,79	5,79	2.178.172,34	1,35		
Total			8,42	-0,51	-0,51	161.615.563,53	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	89.119.005,68	55,14	0,00	47,91	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	22.587.438,54	13,98	0,00	13,25	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	1.797.739,79	1,11	0,00	1,17	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	113.504.184,01	70,23				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	23.047.703,61	14,26	0,00	12,64	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	15.553.790,01	9,62	0,00	10,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	5.773.650,09	3,57	0,00	3,82	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.558.063,47	0,96	0,00	1,21	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	45.933.207,18	28,42				30,00
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	2.178.172,34	1,35	0,00	5,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	2.178.172,34	1,35				10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

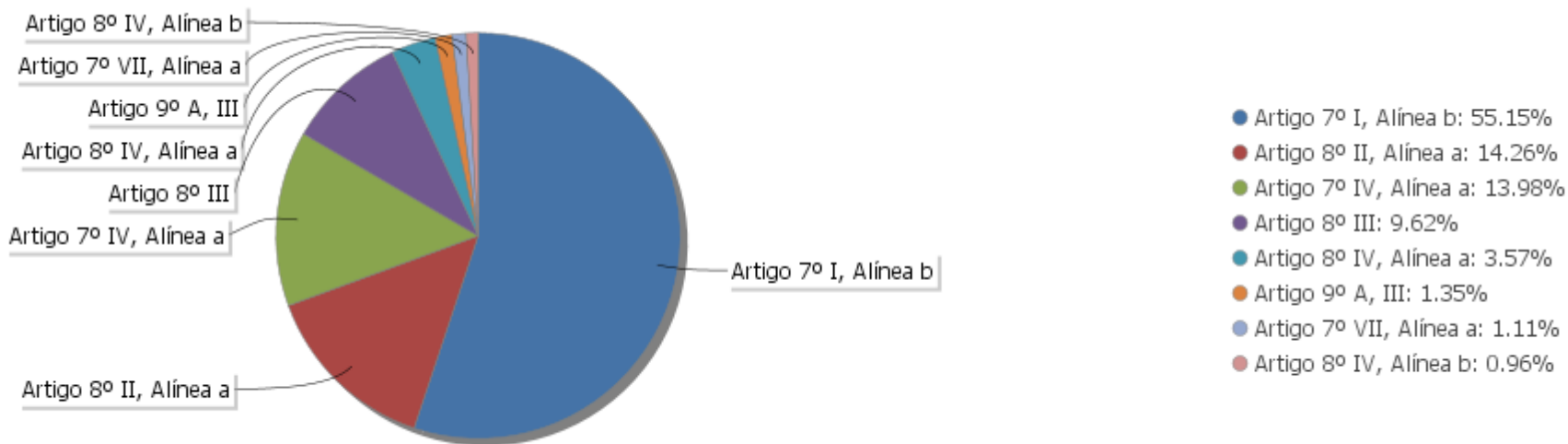
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,02 11,34	0,02 11,34	2,69 580,20	2,58 274,04	6,17 244,50	14.460,66	14.460,66
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,48 -322,43	-0,48 -322,43	2,36 507,88	0,49 52,58	3,48 137,96	-109.399,20	-109.399,20
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	0,03 17,18	0,03 17,18	3,88 836,68	3,74 397,05	0,06 2,22	461,57	461,57
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-4,00 -0,69	-4,00 -0,69	18,31 -4,16	10,48 -1,33	-3,47 -4,62	-961.217,93	-961.217,93
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-0,05 3,27	-0,05 3,27	4,77 -17,70	3,33 -8,48	3,00 1,85	-8.258,58	-8.258,58
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	2,52 5,84	2,52 5,84	2,16 -20,31	1,59 -10,22	4,87 3,72	141.880,56	141.880,56
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-1,43 1,89	-1,43 1,89	-12,66 -35,13	-27,37 -39,18	-40,00 -41,15	-22.580,63	-22.580,63
Artigo 9º A, III % do CDI	5,79 3.871,18	5,79 3.871,18				119.156,31	119.156,31
CAMPO MOURÃO (Total)						-825.497,24	-825.497,24

Análise de Liquidez

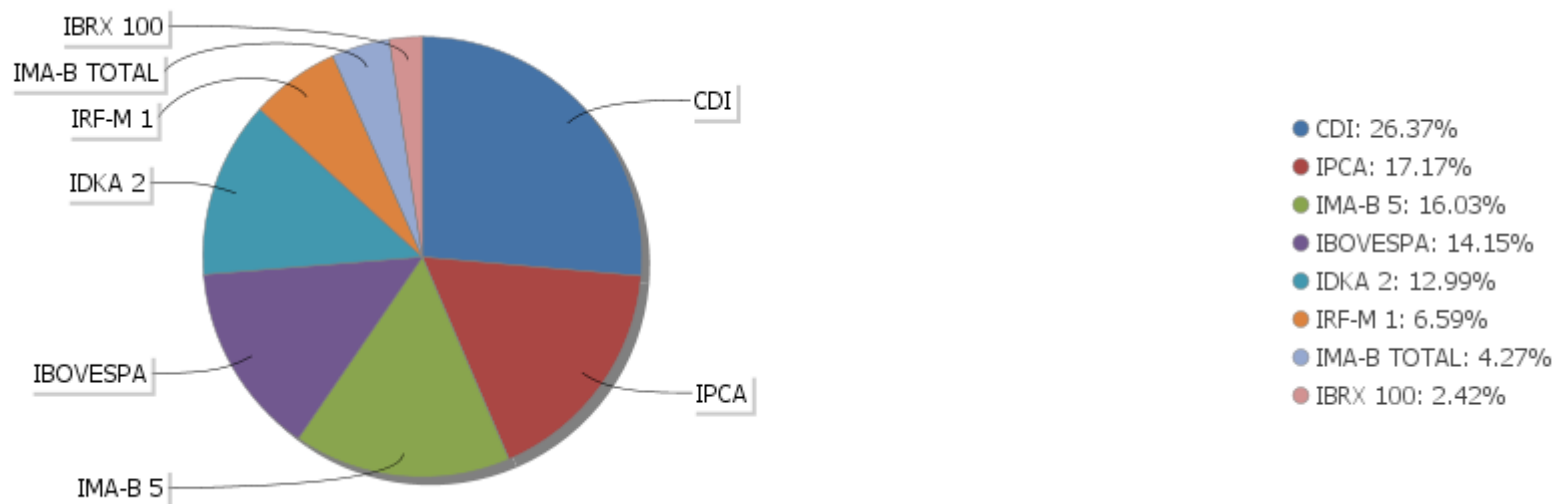
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	147.155.840,34	91,05	147.155.840,34	91,05
de 31 a 365 dias	6.888.333,31	4,26	154.044.173,65	95,32
acima de 365 dias	7.571.389,88	4,68	161.615.563,53	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

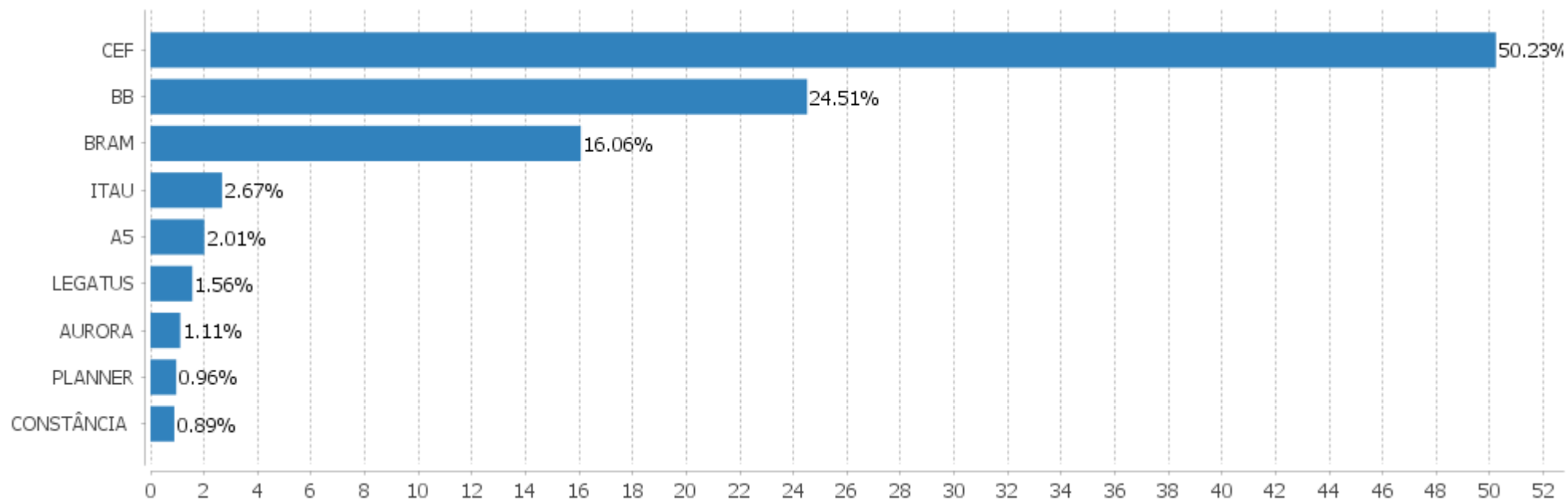


Alocação Por Estratégia



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	-0,51												-0,51
IPCA + 5,45% p.p. indexador	0,67												0,67
	-1,19												-1,19
2020	0,13	-0,88	-5,49	1,11	1,81	1,72	2,31	-0,61	-1,04	0,13	2,62	2,64	4,25
IPCA + 5,88% p.p. indexador	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,64
	-0,58	-1,54	-6,06	0,97	1,74	0,98	1,43	-1,33	-2,16	-1,21	1,27	0,79	-6,39

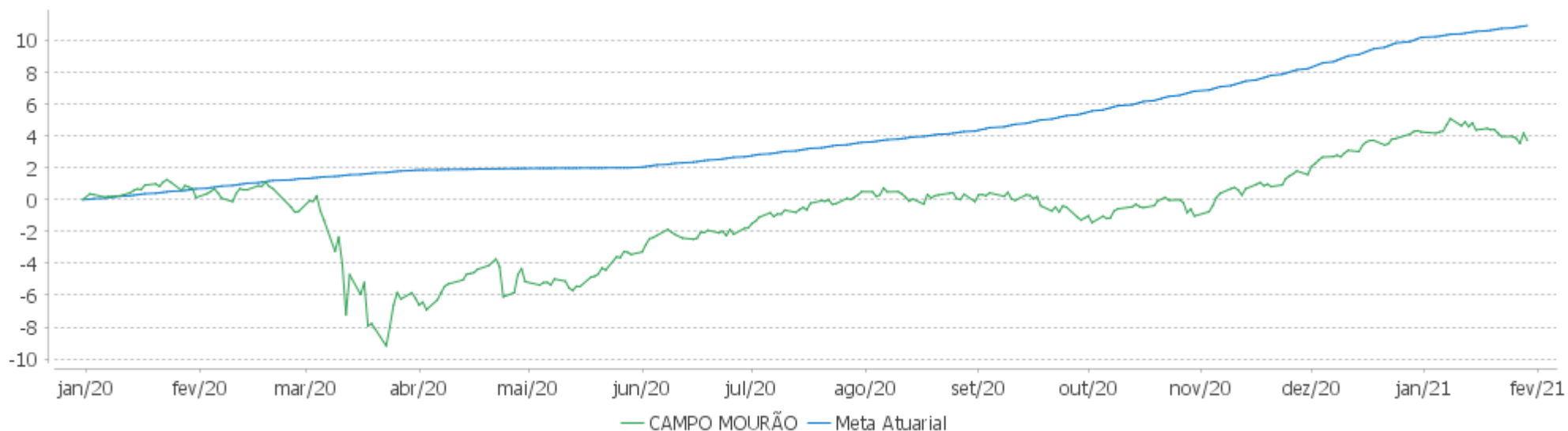
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

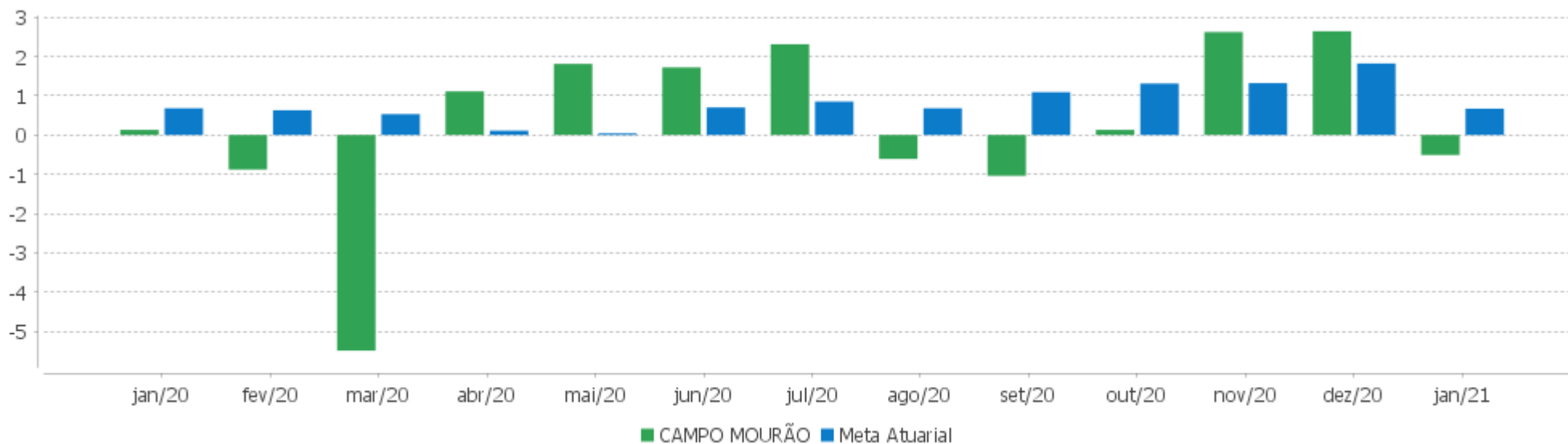
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	6	46,15	03 meses	4,79	3,93	0,86	3,86
Meses abaixo da Meta Atuarial	7	53,85	06 meses	3,20	7,26	-4,06	4,21
			12 meses	3,58	10,60	-7,02	8,42
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,64	2020-12					
Menor rentabilidade da Carteira	-5,49	2020-03	Desde 31/12/2019	3,72	11,38	-7,67	8,13

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
FIDC GGR PRIME I % do CDI	0,03 17,18	0,03 17,18	3,88 836,68	3,74 397,05	0,06 2,22	-7,97 -94,26	-22,78 -148,19
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,13 -0,12	0,13 -0,12	0,44 -2,07	0,16 -4,14	2,65 -1,91	12,60 3,66	22,91 9,86
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA % do CDI	-0,58 -387,50	-0,58 -387,50	2,68 578,29	0,52 55,25	3,61 143,02	14,74 174,36	26,30 171,10
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,87 -0,02	-0,87 -0,02	5,99 -0,05	2,66 -0,12	4,88 -0,35	23,46 -0,82	40,68 -1,14
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,08 -0,02	0,08 -0,02	3,22 -0,07	3,64 -0,16	7,25 -0,30	19,86 -0,66	31,74 -0,94
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,18 0,03	0,18 0,03	3,07 -0,09	4,24 -0,05	7,69 -0,51	18,77 -1,35	30,05 -2,43
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,03 -0,22	0,03 -0,22	2,18 -0,33	0,99 -3,31	5,82 1,27	20,75 11,80	32,60 19,54
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,03 -0,01	0,03 -0,01	0,54 -0,04	0,79 -0,23	3,07 -0,36	9,59 -0,68	16,98 -0,96
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,10 -0,01	0,10 -0,01	3,24 -0,04	3,66 -0,15	7,29 -0,27	19,97 -0,56	31,81 -0,87
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,13 -0,01	0,13 -0,01	3,03 -0,13	4,04 -0,24	7,68 -0,52	18,78 -1,35	30,23 -2,26
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,03 -0,02	0,03 -0,02	0,53 -0,05	0,90 -0,12	3,22 -0,21	9,83 -0,44	17,30 -0,65
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP % do CDI	-0,05 -35,50	-0,05 -35,50	14,08 3.033,05	12,91 1.371,67	10,76 426,15	36,09 426,83	
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE Var. IBOVESPA p.p.	-3,56 -0,24	-3,56 -0,24	14,87 -7,61	8,21 -3,60	-2,16 -3,31		
BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA Var. IBRX 100 p.p.	-3,31 -0,29	-3,31 -0,29	20,25 -1,96	11,47 -0,59	1,42 -0,22	24,41 3,49	46,53 6,99
BRADESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	-2,48 0,84	-2,48 0,84	13,85 -8,62	13,11 1,30	-4,84 -5,98	13,16 -4,98	33,95 -1,56
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	-2,91 0,41	-2,91 0,41	19,42 -3,05	1,12 -10,69	-24,63 -25,77	-1,24 -19,38	25,09 -10,42
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA	-3,89	-3,89	17,38	2,83	-10,01	8,22	30,25

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.	-0,57	-0,57	-5,10	-8,98	-11,16	-9,92	-5,26
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	-5,59	-5,59	22,28	14,80	1,52	22,76	50,70
Var. IBOVESPA p.p.	-2,27	-2,27	-0,20	2,99	0,37	4,61	15,19
CARE11	-1,43	-1,43	-12,66	-27,37	-40,00	-60,57	-69,33
Var. IBOVESPA p.p.	1,89	1,89	-35,13	-39,18	-41,15	-78,72	-104,85
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	4,78	4,78	4,41	3,80	2,79	0,77	-1,28
% do CDI	3.198,68	3.198,68	949,31	403,53	110,50	9,06	-8,32
FIP LA SHOPPING CENTERS	-0,26	-0,26	-0,59	-1,12	7,68	20,28	78,52
% do CDI	-173,37	-173,37	-127,31	-118,95	304,05	239,85	510,73
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	5,79	5,79	9,11	20,97	53,70	118,69	138,83
Var. IBOVESPA p.p.	9,11	9,11	-13,36	9,15	52,55	100,54	103,32
CAMPO MOURÃO	-0,51	-0,51	4,79	3,20	3,58		
Var. IPCA + 5,45% p.p.	-1,19	-1,19	0,93	-3,88	-6,61		
CDI	0,15	0,15	0,46	0,94	2,53	8,46	15,37
IBOVESPA	-3,32	-3,32	22,47	11,81	1,15	18,15	35,51
INPC + 6,00%	0,73	0,73	4,18	7,97	11,79	23,62	35,65
IPCA + 6,00%	0,71	0,71	3,99	7,36	10,76	22,35	34,53

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	0,04	0,04	0,58	1,02	3,43	10,27	17,95
IRF-M 1+	-1,39	-1,39	2,09	-0,60	5,77	20,12	35,07
IRF-M TOTAL	-0,80	-0,80	1,50	-0,15	4,92	16,95	29,61
IMA-B 5	0,11	0,11	3,28	3,80	7,55	20,52	32,68
IMA-B 5+	-1,69	-1,69	8,43	2,01	3,68	26,83	48,69
IMA-B TOTAL	-0,85	-0,85	6,04	2,78	5,22	24,29	41,83
IMA-C TOTAL	6,46	6,46	7,31	15,99	26,73	52,15	76,01
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,44	-0,44	2,38	0,96	3,87	15,36	26,95
IMA-GERAL TOTAL	-0,24	-0,24	2,52	1,39	4,50	16,33	28,20
IDKA 2	0,15	0,15	3,16	4,28	8,20	20,12	32,49
IDKA 20	-2,81	-2,81	11,88	1,09	0,71	29,02	58,93
CDI	0,15	0,15	0,46	0,94	2,53	8,46	15,37
Renda Variável							
IBOVESPA	-3,32	-3,32	22,47	11,81	1,15	18,15	35,51
IBRX 100	-3,03	-3,03	22,21	12,06	1,64	20,92	39,53
IBRX 50	-2,78	-2,78	23,61	13,27	2,67	17,81	33,39
SMALL CAP	-3,43	-3,43	21,10	10,52	-4,50	38,71	57,28
IFIX	0,32	0,32	4,07	5,35	-6,43	19,49	26,00
Índice Consumo - ICON			12,91	3,78	-3,99	37,57	37,84
Índice Dividendos - IDIV	-5,08	-5,08	18,30	8,08	-4,52	21,27	43,95
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,25	0,25	2,51	4,30	4,56	8,94	13,06
INPC	0,27	0,27	2,70	4,89	5,53	10,07	14,00
IGPM	2,58	2,58	6,95	18,36	25,71	35,53	44,66
SELIC	0,15	0,15	0,46	0,94	2,53	8,46	15,38
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

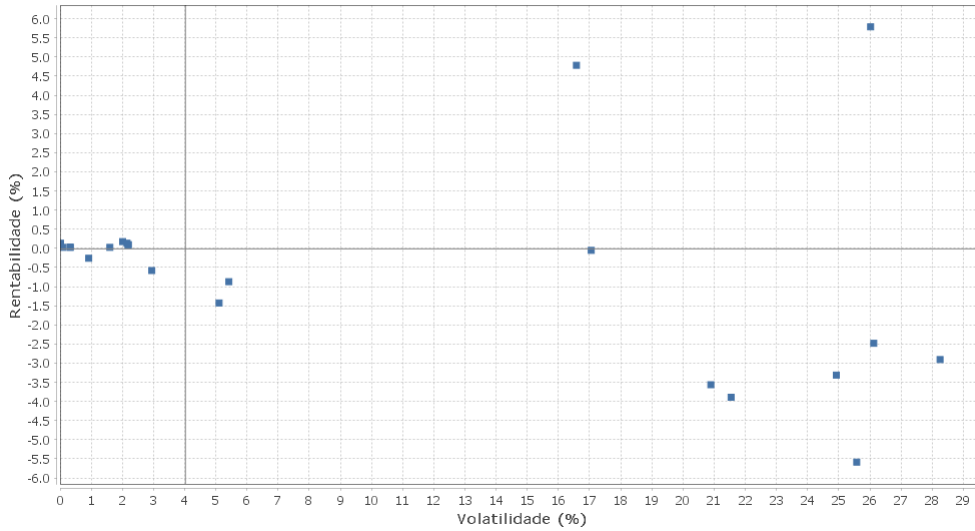
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1	28/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	210.000,00	80.363,79556300	2,6131170000
2	28/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	55.000,00	21.047,66057000	2,6131170000
3	29/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	679.359,74	0,00	259.925,00218000	2,6136760000
4	29/01/2021	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.005.845,01	0,00	274.684,59928900	3,6618180000
5	29/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	41.581,14	0,00	15.909,06447400	2,6136760000
Total						

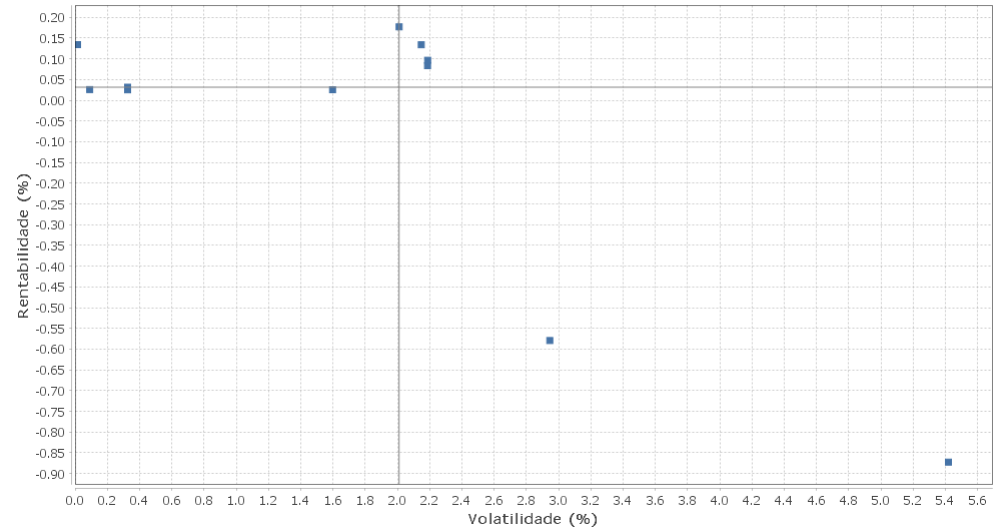
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

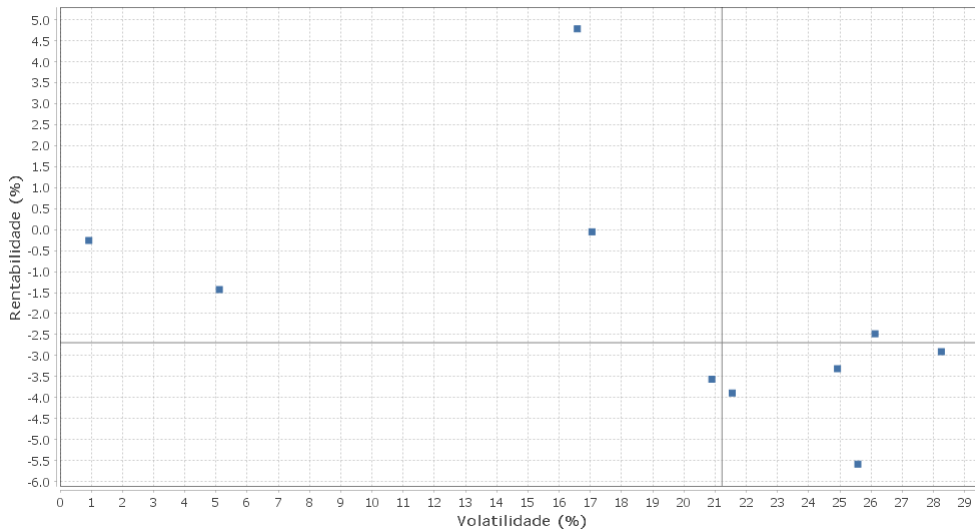
CAMPO MOURÃO - No Mês



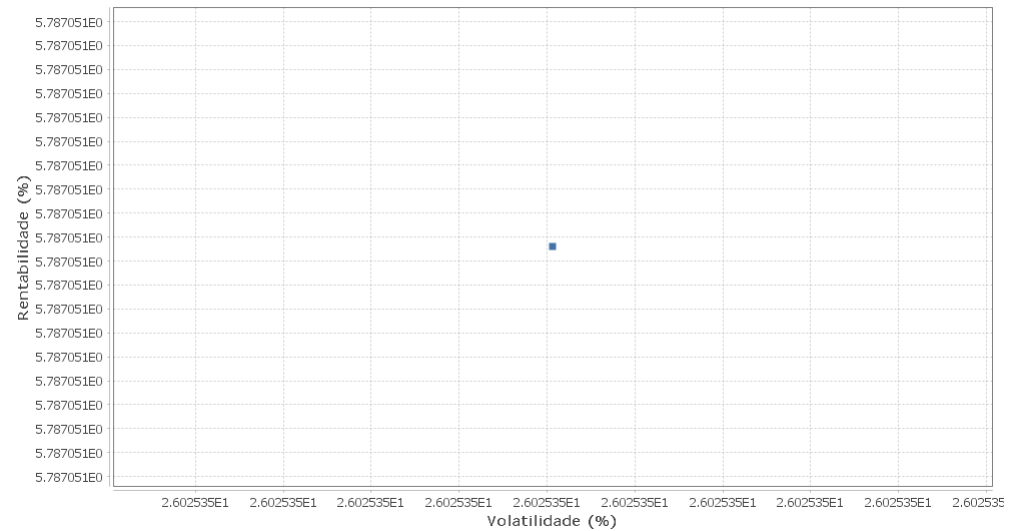
Renda Fixa - No Mês



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\$): 4.101.803,53

Value-At-Risk: 2,54%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,23	0,00	-1,01	0,13	3.099.701,30	1,92
FIDC GGR PRIME I	Artigo 7º VII, Alínea a	0,09	0,17	-0,00	-1,36	0,03	1.797.739,79	1,11
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,19	0,00	-0,36	0,03	5.141.904,35	3,18
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,15	0,00	-0,38	0,03	5.512.238,68	3,41
FIP LA SHOPPING CENTERS	Artigo 8º IV, Alínea a	0,92	0,05	0,00	-0,44	-0,26	2.521.073,88	1,56
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,60	1,03	0,10	-0,08	0,03	24.657.047,97	15,26
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	2,01	1,08	0,05	0,01	0,18	13.608.544,06	8,42
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,15	1,17	0,03	-0,01	0,13	7.389.591,14	4,57
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,19	1,23	0,06	-0,03	0,08	11.935.657,59	7,39
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,19	1,22	0,06	-0,02	0,10	13.971.418,68	8,64
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	Artigo 7º IV, Alínea a	2,95	1,43	0,11	-0,25	-0,58	19.487.737,24	12,06
CARE11	Artigo 8º IV, Alínea b	5,11	1,22	-0,00	-0,31	-1,43	1.558.063,47	0,96
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,42	2,57	0,07	-0,19	-0,87	6.902.603,21	4,27
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	Artigo 8º IV, Alínea a	16,58	0,18	-0,00	0,28	4,78	3.252.576,21	2,01
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	17,05	8,34	0,64	-0,01	-0,05	15.553.790,01	9,62
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	Artigo 8º II, Alínea a	20,89	9,52	0,36	-0,18	-3,56	7.032.879,73	4,35
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA	Artigo 8º II, Alínea a	21,55	10,41	0,09	-0,19	-3,89	1.438.985,44	0,89
BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	Artigo 8º II, Alínea a	24,92	11,70	0,26	-0,14	-3,31	3.907.697,53	2,42
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	25,58	11,21	0,43	-0,22	-5,59	6.888.333,31	4,26
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	26,03	11,89	0,05	0,22	5,79	2.178.172,34	1,35
BRADESCO F I A SELECTION	Artigo 8º II, Alínea a	26,13	11,48	0,16	-0,10	-2,48	2.559.679,43	1,58
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	28,25	11,71	0,08	-0,11	-2,91	1.220.128,17	0,75