



WEALTH MANAGEMENT

# Portfólio Sugerido

Perfil III

[bsideinvestimentos.com](https://bsideinvestimentos.com)

# Portfólio Sugerido

Perfil III

R\$ 25,000,000

Perfil 3

Ativo	R\$	% do PL	Retorno YTD	Retorno %CDI YTD	Retorno 12M	Retorno %CDI 12M	Retorno 24M	Retorno %CDI 24M	Retorno 36M	Retorno %CDI 36M	Vol. 12M	Sharpe 12M	Liquidez (D+)	Veículo
<b>Renda Fixa</b>	<b>R\$ 17,000,000</b>	<b>68.00%</b>												
<b>Pós-fixado</b>	<b>R\$ 13,000,000</b>	<b>52.00%</b>												
Tesouro Selic Simples FI RF	R\$ 625,000	2.50%	11.81%	101%	12.24%	101%	16.98%	101%	19.41%	97%	0.1%	0.63	D+0	F. Excl.
Tesouro Selic Simples FI RF	R\$ 625,000	2.50%	11.81%	101%	12.24%	101%	16.98%	101%	19.41%	97%	0.1%	0.63	D+0	C. Adm.
Títulos Privados - 2 anos (116.0% CDI)	R\$ 1,000,000	4.00%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	D+730	C. Adm.
Títulos Privados - 3 anos (116.5% CDI)	R\$ 1,000,000	4.00%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	D+1095	C. Adm.
Títulos Privados - 2 anos (CDI+1.70%)	R\$ 1,000,000	4.00%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	D+730	C. Adm.
Títulos Privados - 3 anos (CDI+2.00%)	R\$ 1,000,000	4.00%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	D+1095	C. Adm.
Itau Privilege RF REF DI Distribuidores FIC	R\$ 1,250,000	5.00%	12.33%	105%	12.77%	105%	-	-	-	-	1.5%	0.40	D+0	F. Excl.
ARX Denali FIRF CP	R\$ 875,000	3.50%	12.83%	109%	13.29%	109%	21.15%	126%	23.10%	115%	0.1%	9.14	D+1	F. Excl.
Sul America Excellence FIRF CP	R\$ 625,000	2.50%	12.92%	110%	13.38%	110%	21.60%	129%	20.10%	100%	0.2%	6.05	D+1	F. Excl.
Itau Precision CP Distribuidores FIC FIM	R\$ 750,000	3.00%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.00	D+22	F. Excl.
Sparta Top FIC RF CP LP	R\$ 750,000	3.00%	13.19%	112%	13.65%	112%	21.90%	131%	23.99%	120%	0.2%	9.67	D+31	F. Excl.
SPX Seahawk Access FIC RF CP LP	R\$ 750,000	3.00%	13.32%	113%	13.78%	113%	22.08%	132%	-	-	0.2%	10.22	D+46	F. Excl.
M Ca II FIC FIM CP	R\$ 750,000	3.00%	14.84%	126%	15.42%	127%	23.90%	143%	29.89%	149%	0.1%	27.73	D+61	F. Excl.
Everest High Yield FIC FIM - CP E1	R\$ 750,000	3.00%	14.85%	126%	15.43%	127%	24.32%	145%	-	-	0.1%	26.20	D+91	F. Excl.
Augme 90 FIC FIM CP	R\$ 625,000	2.50%	13.80%	117%	14.33%	118%	23.67%	141%	29.28%	146%	0.4%	5.97	D+179	F. Excl.
Leste Credit Access IE FIC MM CP	R\$ 625,000	2.50%	12.77%	109%	13.34%	110%	24.87%	149%	31.36%	156%	0.7%	1.71	D+271	F. Excl.
<b>Inflação</b>	<b>R\$ 2,750,000</b>	<b>11.00%</b>												
<b>Inflação Média (4-6)</b>	<b>R\$ 2,750,000</b>	<b>11.00%</b>												
NTN-B 2028 (IPCA+6.10%)	R\$ 1,375,000	5.50%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	D+2066	F. Excl.
Títulos Privados - 4 anos (IPCA+7.00%)	R\$ 687,500	2.75%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	D+1460	C. Adm.
Títulos Privados - 5 anos (IPCA+7.10%)	R\$ 687,500	2.75%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	D+1825	C. Adm.
<b>Pré-fixado</b>	<b>R\$ 1,000,000</b>	<b>4.00%</b>												
<b>Pré Curta (0-3)</b>	<b>R\$ 1,000,000</b>	<b>4.00%</b>												
Títulos Privados - 1 ano (14.85%)	R\$ 300,000	1.20%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	D+365	C. Adm.
Títulos Privados - 2 anos (14.70%)	R\$ 350,000	1.40%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	D+730	C. Adm.
Títulos Privados - 3 anos (14.65%)	R\$ 350,000	1.40%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	D+1095	C. Adm.
<b>Internacional</b>	<b>R\$ 250,000</b>	<b>1.00%</b>												
Pimco Income FIC FIM IE	R\$ 250,000	1.00%	1.06%	9%	2.03%	17%	6.93%	41%	13.60%	68%	6.7%	-1.52	D+6	F. Excl.

Ativo	R\$	% do PL	Retorno YTD	Retorno %CDI YTD	Retorno 12M	Retorno %CDI 12M	Retorno 24M	Retorno %CDI 24M	Retorno 36M	Retorno %CDI 36M	Vol. 12M	Sharpe 12M	Liquidez (D+)	Veículo
<b>Multimercado</b>	<b>R\$ 5,875,000</b>	<b>23.50%</b>												
<b>Macro</b>	<b>R\$ 5,000,000</b>	<b>20.00%</b>												
Kapitalo K10 FIC FIM	R\$ 1,250,000	5.00%	20.12%	171%	21.15%	174%	39.63%	237%	57.82%	288%	4.8%	1.85	D+31	F. Excl.
SPX Nimitz Feeder FIC de FIM	R\$ 1,250,000	5.00%	21.38%	182%	23.25%	191%	37.52%	224%	46.41%	231%	8.0%	1.38	D+61	F. Excl.
Vinland Macro Access FIC MM	R\$ 1,250,000	5.00%	20.40%	174%	20.76%	171%	29.14%	174%	41.59%	207%	3.3%	2.62	D+31	F. Excl.
Genoa Capital Radar FIC FIM	R\$ 1,250,000	5.00%	20.79%	177%	21.29%	175%	32.06%	191%	-	-	3.8%	2.37	D+31	F. Excl.
<b>Descorrelacionados</b>	<b>R\$ 875,000</b>	<b>3.50%</b>												
<b>Quant</b>	<b>R\$ 500,000</b>	<b>2.00%</b>												
Giant Zarathustra FIC FIM	R\$ 500,000	2.00%	8.69%	74%	8.90%	73%	18.06%	108%	28.39%	141%	5.4%	-0.61	D+33	F. Excl.
<b>Long &amp; Short</b>	<b>R\$ 375,000</b>	<b>1.50%</b>												
Solana LS FIC FIM	R\$ 375,000	1.50%	14.36%	122%	15.52%	127%	26.12%	156%	33.94%	169%	4.6%	0.73	D+15	F. Excl.
<b>Renda Variável</b>	<b>R\$ 2,125,000</b>	<b>8.50%</b>												
<b>Brasil</b>	<b>R\$ 1,750,000</b>	<b>7.00%</b>												
<b>Long Only</b>	<b>R\$ 750,000</b>	<b>3.00%</b>												
BOVA11	R\$ 750,000	3.00%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	D+2	F. Excl.
<b>Long Bias</b>	<b>R\$ 1,000,000</b>	<b>4.00%</b>												
Absolute Pace LB FIC FIA	R\$ 500,000	2.00%	9.98%	85%	8.67%	71%	20.47%	122%	36.88%	184%	15.7%	-0.22	D+32	F. Excl.
Norte Long Bias FIC FIM	R\$ 500,000	2.00%	19.73%	168%	20.34%	167%	-	-	-	-	16.9%	0.48	D+32	F. Excl.
<b>Internacional</b>	<b>R\$ 375,000</b>	<b>1.50%</b>												
<b>EUA</b>	<b>R\$ 375,000</b>	<b>1.50%</b>												
IVVB11	R\$ 375,000	1.50%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	F. Excl.
<b>Total</b>	<b>R\$ 25,000,000</b>	<b>100.00%</b>												

Taxa de Gestão: 0.50%  
Rebates das taxas de adm. dos fundos: 0.22%  
Taxa efetiva de gestão: 0.28%

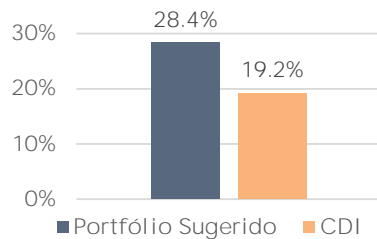
# Simulação do Portfólio

Perfil III

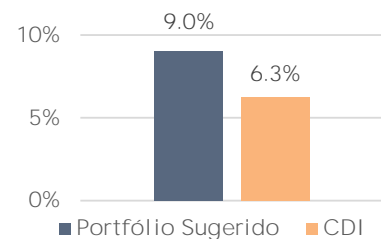
## Resumo

02/01/2020 - 30/11/2022

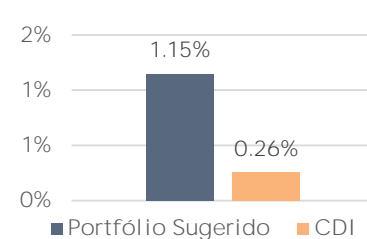
### Rentabilidade Acumulada



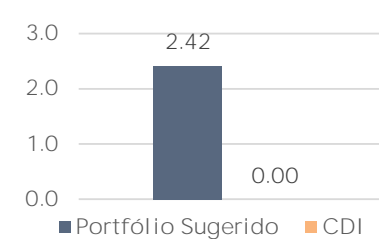
### Rentabilidade Anualizada



### Volatilidade Anualizada

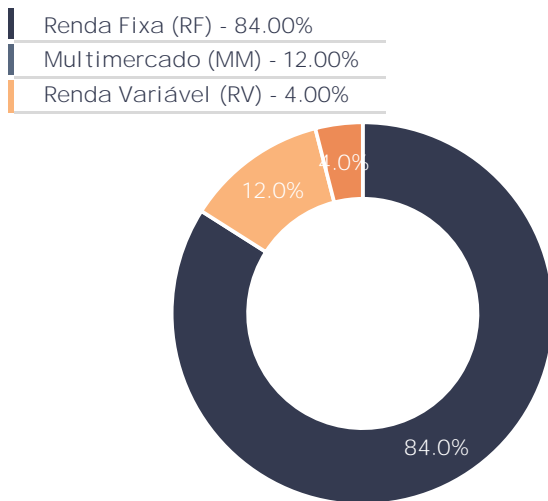


### Índice Sharpe

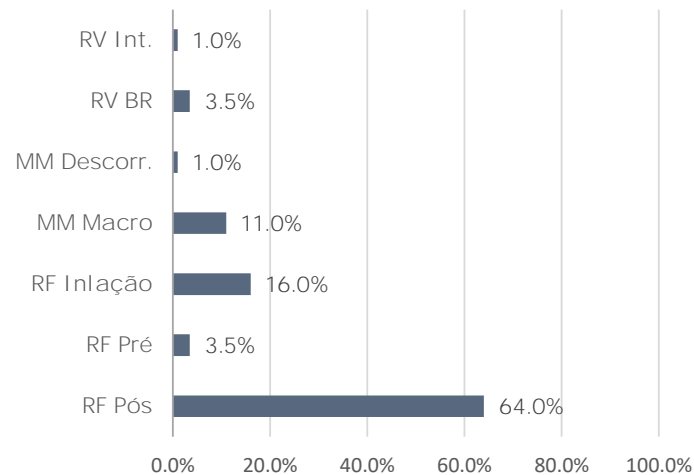


## Composição das Carteiras

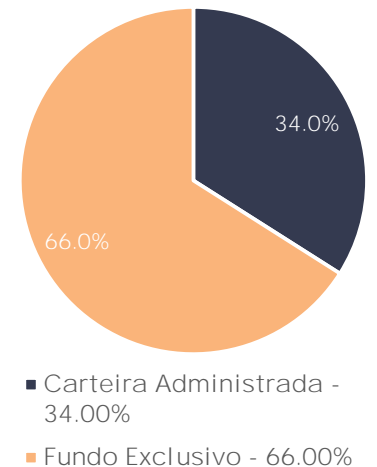
### Alocação por Classe de Ativo



### Alocação por Estratégia

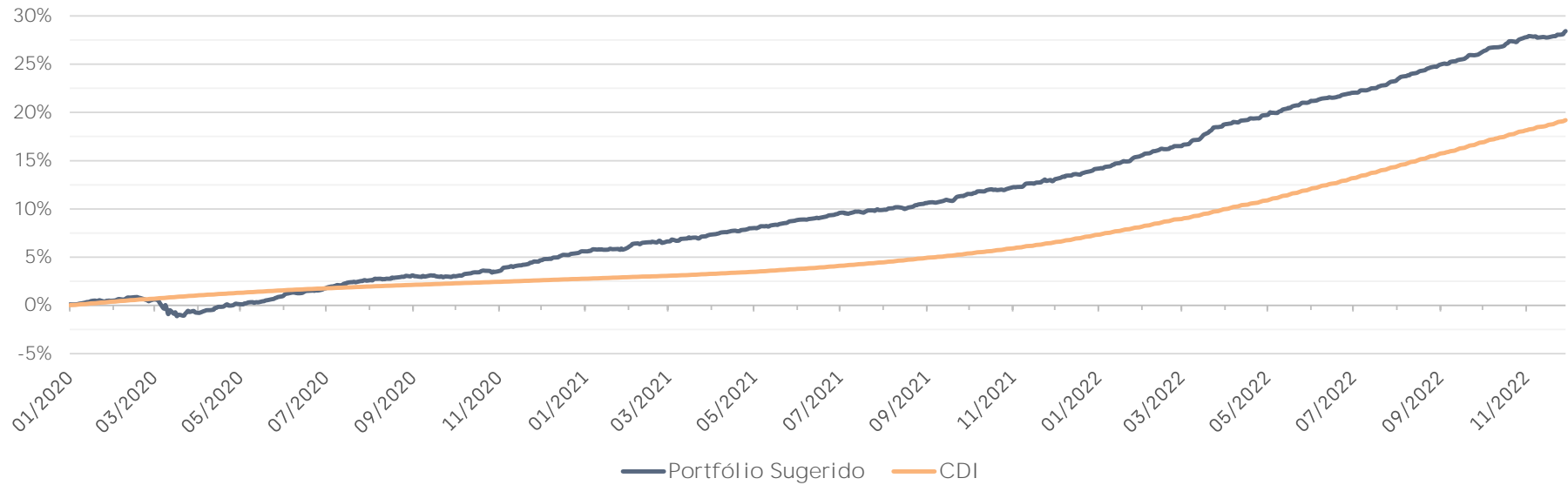


### Alocação por Veículo



## Rentabilidade

02/01/2020 - 30/11/2022

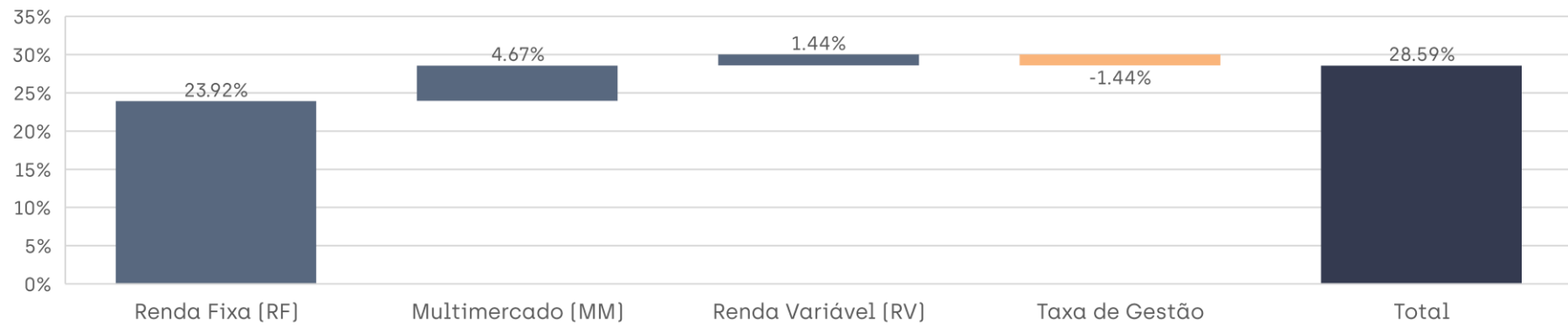


	Mês	Ano	6 Meses	12 Meses	2 Anos	Saldo Inicial 01/01/2020	Saldo Final 30/11/2022
Portfólio Sugerido	0.52%	12.52%	6.14%	13.78%	22.85%	R\$ 25,000,000.00	R\$ 32,106,953.92
CDI	0.92%	11.09%	6.50%	11.94%	16.19%	R\$ 25,000,000.00	R\$ 29,799,806.68

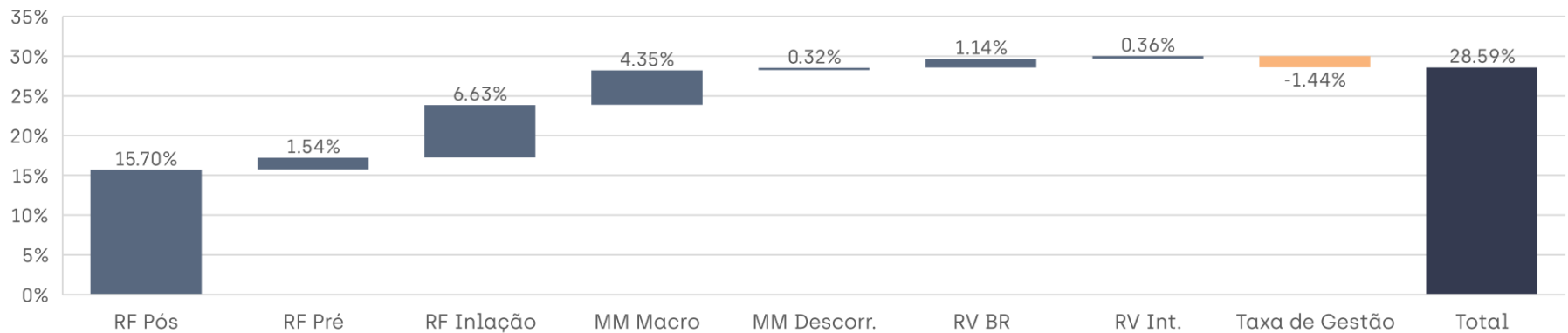
## Atribuição de Performance

02/01/2020 - 30/11/2022

Por Classe de Ativo



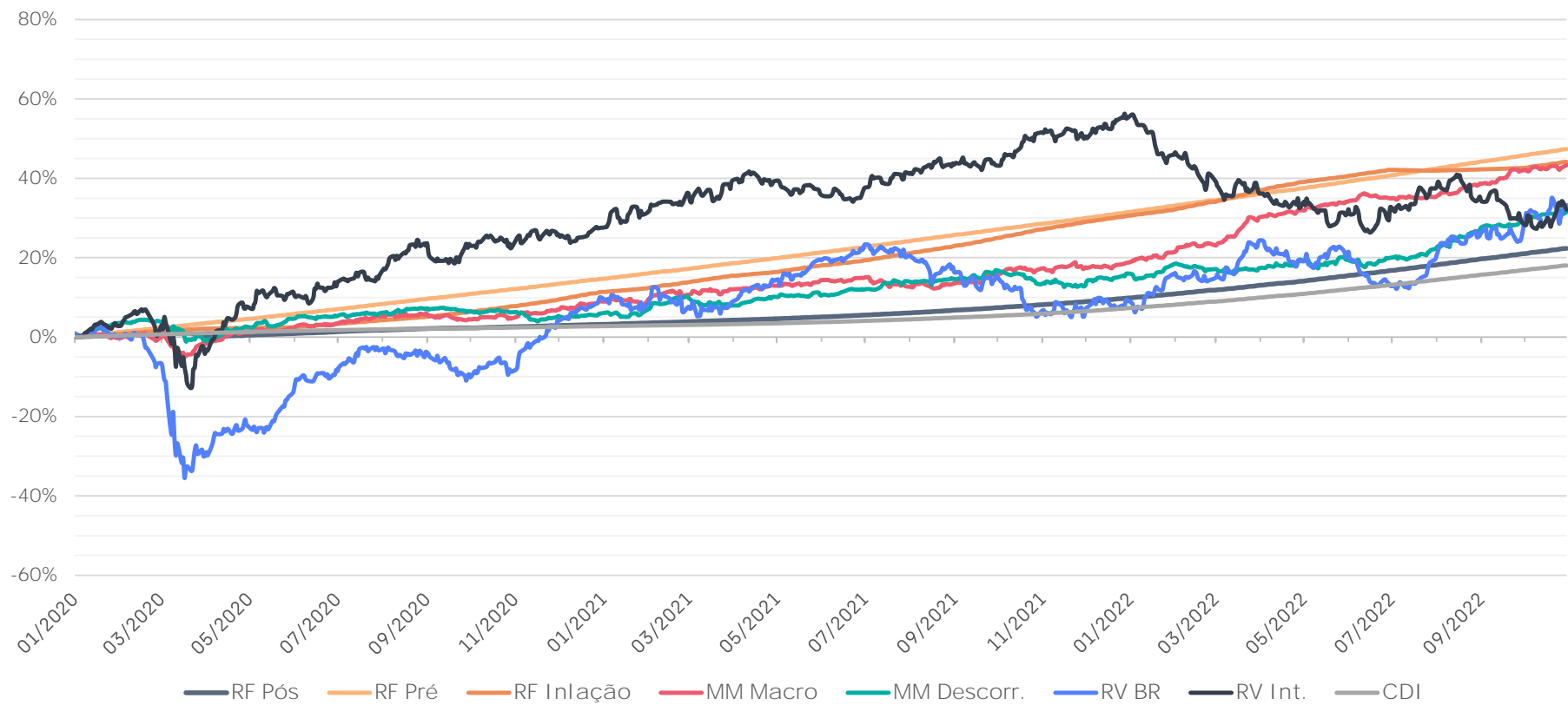
Por Classe de Ativo



## Atribuição de Performance

02/01/2020 - 30/11/2022

Por Classe de Ativo



## Rentabilidade Mês a Mês

02/01/2020 - 30/11/2022

Ano	Jan.	Fev.	Mar.	Abr.	Mai.	Jun.	Jul.	Ago.	Set.	Out.	Nov.	Dez.	Acum. Ano
2020													
Portfólio Sugerido	0.48%	0.02%	-1.20%	0.87%	0.72%	0.80%	0.87%	0.44%	-0.00%	0.45%	1.03%	1.02%	5.61%
%CDI	126%	6%	-353%	305%	304%	377%	445%	273%	-1%	289%	692%	621%	203%

Ano	Jan.	Fev.	Mar.	Abr.	Mai.	Jun.	Jul.	Ago.	Set.	Out.	Nov.	Dez.	Acum. Ano
2021													
Portfólio Sugerido	0.16%	0.66%	0.75%	0.66%	0.72%	0.64%	0.38%	0.60%	0.83%	0.55%	0.72%	1.12%	8.08%
%CDI	106%	494%	375%	317%	267%	207%	107%	139%	188%	114%	122%	146%	183%

Ano	Jan.	Fev.	Mar.	Abr.	Mai.	Jun.	Jul.	Ago.	Set.	Out.	Nov.	Dez.	Acum. Ano
2022													
Portfólio Sugerido	1.13%	0.93%	1.76%	0.96%	1.12%	0.78%	0.99%	1.31%	1.04%	1.27%	0.57%	-	12.52%
%CDI	154%	123%	190%	114%	108%	77%	95%	112%	97%	125%	58%	-	113%

## Estatísticas

	Meses Positivos	Meses Negativos	Maior Retorno Mensal	Menor Retorno Mensal	Acima do CDI (meses)	Abaixo do CDI (meses)
Portfólio Sugerido	33	2	1.76%	-1.20%	28	7
CDI	35	0	1.17%	0.13%	0	0



## Volatilidade

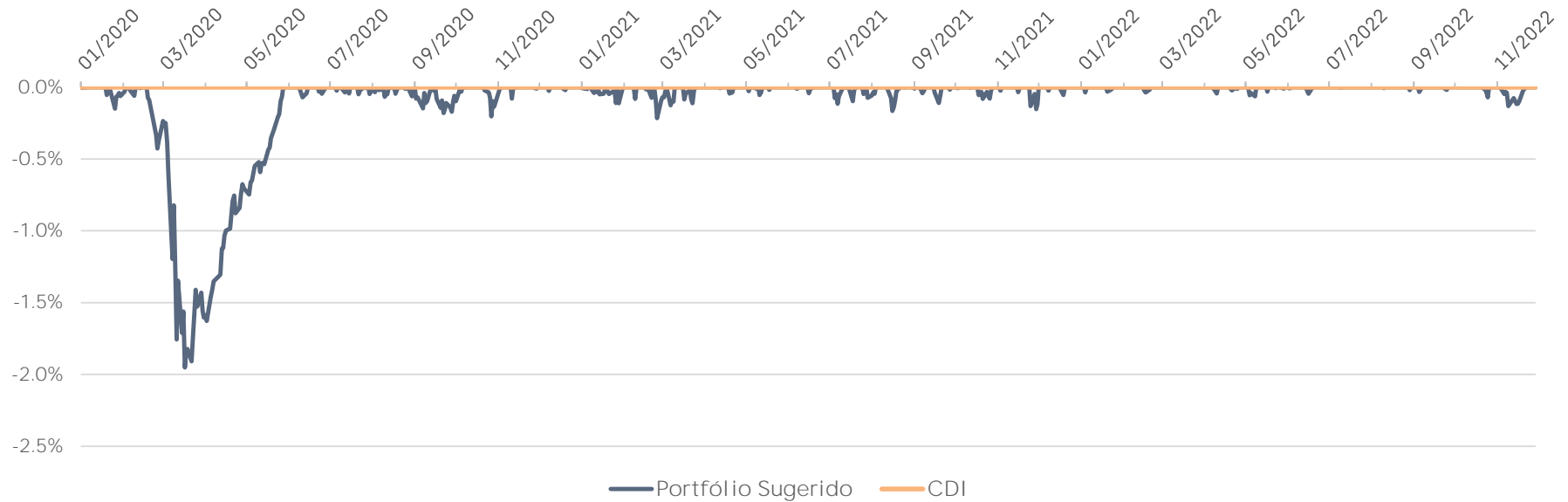
02/01/2020 - 30/11/2022



	Mes	Ano	6 meses	12 meses	2 anos
Portfólio Sugerido	0.91%	0.73%	0.70%	0.74%	0.80%
CDI	0.00%	0.08%	0.02%	0.10%	0.26%

## Drawdown

02/01/2020 - 30/11/2022



	Mes	Ano	6 meses	12 meses	2 anos	Drawdown Máximo	Data	Tempo de Recuperação
Portfólio Sugerido	-0.13%	-0.13%	-0.13%	-0.13%	-0.21%	-1.95%	18/03/2020	49
CDI	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	-	-

# Correlação (Fundos de Investimentos)

02/01/2020 - 30/11/2022

	(A)	(B)	(C)	(D)	(E)	(F)	(G)	(H)	(I)	(J)	(K)	(L)	(M)	(N)	(O)	(P)	(Q)	(R)	(S)	(T)	(U)	(V)	(W)	(X)
(A) CDI	1.00	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
(B) Tesouro Selic Simples FI	0.81	1.00	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
(C) Tesouro Selic Simples FI	0.81	1.00	1.00	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
(D) Itaú Privilege REF DI Distribuidor	0.31	0.26	0.26	1.00	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
(E) ARX Denali	0.33	0.34	0.34	0.11	1.00	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
(F) Sul America Excellence	0.26	0.22	0.22	0.08	0.41	1.00	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
(G) NCH Cash	0.86	0.76	0.76	0.27	0.31	0.22	1.00	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
(H) Itaú Precision Distribuidores	1.00	0.81	0.81	0.31	0.33	0.26	0.86	1.00	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
(I) Sparta Top	0.23	0.20	0.20	0.07	0.72	0.43	0.21	0.23	1.00	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
(J) SPX Seahawk	0.18	0.16	0.16	0.06	0.55	0.44	0.17	0.18	0.77	1.00	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
(K) M Ca II	0.96	0.80	0.80	0.30	0.35	0.29	0.83	0.96	0.25	0.20	1.00	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
(L) Everest High Yield - E1	0.90	0.89	0.89	0.28	0.33	0.24	0.80	0.90	0.21	0.16	0.88	1.00	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
(M) Augme 90	0.34	0.29	0.29	0.11	0.48	0.43	0.31	0.34	0.51	0.50	0.37	0.32	1.00	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
(N) Leste Credit	0.15	0.15	0.15	0.03	0.04	0.03	0.12	0.15	0.01	0.00	0.15	0.17	0.05	1.00	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
(O) Pimco Income	-0.04	-0.04	-0.04	-0.02	-0.06	-0.07	-0.01	-0.04	-0.10	-0.15	-0.04	-0.05	0.06	-0.05	1.00	-	-	-	-	-	-	-	-	-
(P) Kapitalo K10	0.02	0.02	0.02	-0.01	-0.11	-0.14	0.04	0.02	-0.13	-0.19	0.03	0.02	-0.05	0.03	0.33	1.00	-	-	-	-	-	-	-	-
(Q) SPX Nimitz	0.05	0.01	0.01	0.04	0.01	-0.02	0.00	0.05	0.00	-0.03	0.05	0.04	0.01	0.02	-0.11	0.23	1.00	-	-	-	-	-	-	-
(R) Vinland Macro	0.07	0.10	0.10	0.02	0.07	0.00	0.06	0.07	0.03	-0.06	0.07	0.09	0.01	0.06	0.14	0.33	0.38	1.00	-	-	-	-	-	-
(S) Genoa Capital Radar	0.02	0.05	0.05	0.02	0.02	-0.06	0.05	0.02	-0.02	-0.10	0.04	0.04	0.10	0.00	0.46	0.66	0.35	0.58	1.00	-	-	-	-	-
(T) Solana LS	0.05	0.06	0.06	0.00	0.07	-0.02	0.04	0.05	0.08	-0.01	0.05	0.05	0.08	-0.04	0.31	0.18	0.03	0.19	0.36	1.00	-	-	-	-
(U) BOVA11	-0.02	-0.01	-0.01	0.03	-0.01	-0.05	0.03	-0.02	0.00	-0.01	-0.01	-0.01	0.02	-0.05	0.02	0.12	-0.05	-0.02	0.10	0.03	1.00	-	-	-
(V) Absolute Pace LB	-0.01	0.02	0.02	0.02	-0.01	-0.10	0.03	-0.01	-0.05	-0.13	0.01	0.01	0.10	-0.04	0.52	0.55	0.12	0.38	0.89	0.35	0.12	1.00	-	-
(W) Norte Long Bias	0.00	0.03	0.03	0.02	-0.01	-0.09	0.04	0.00	-0.04	-0.12	0.03	0.02	0.10	-0.01	0.46	0.52	0.17	0.40	0.87	0.39	0.09	0.88	1	-
(X) IVVB11	-0.05	-0.05	-0.05	-0.07	-0.13	-0.15	-0.06	-0.05	-0.08	-0.12	-0.07	-0.06	-0.03	-0.02	0.34	0.28	0.07	0.11	0.33	0.17	-0.09	0.34	0.27	1

## Avisos / Disclaimers

---

**Liquidez:** no caso dos fundos, trata-se do prazo de resgate (cotização + liquidação). No caso de ativos de renda fixa, trata-se do prazo para o vencimento.

**Retornos dos ativos:** os retornos calculados são meramente uma **simulação** que é baseada em resultados passados (fundos) e perspectivas de retornos futuros (ativos), considerando marcação na curva (ativos de renda fixa), servindo simplesmente como um exercício para tentar estimar o que esperar do portfólio em termos de rentabilidade, não sendo garantia de performance futura. O **retorno simulado** da carteira proposta **é líquido de taxa de gestão**. Os **preços ou taxas indicados** para a compra dos ativos são **meramente indicativos e podem oscilar sem aviso prévio**, de acordo com as condições de mercado, assim não há segurança de que uma transação possa, de fato, ser contratada nos níveis aqui especificados, estando sujeitas às condições de fechamento da data de aplicação. Os retornos dos ativos isentos estão com **“gross-up”** (alíquota de IR de 15%), para efeitos de simulação. No caso de fundos com início posterior ao início da simulação, utilizou-se o benchmark que mais se assemelha à estratégia do fundo para o cálculo da performance anterior ao seu início.

**Retornos do portfólio:** o retorno calculado dos portfólios é meramente uma simulação baseada em resultados passados (fundos) e perspectivas de retornos futuros (ativos, considerando marcação na curva (ativos de renda fixa), servindo simplesmente como um exercício para tentar estimar o que esperar do portfólio em termos de rentabilidade, não sendo garantia de performance futura. A rentabilidade simulada é líquida da taxa de gestão especificada na proposta comercial e bruta de eventual taxa de performance.

**Disclaimer:** Este material contém informações atualizadas até a presente data, não comprometendo a B.Side Investimentos em efetuar atualizações de informações e/ou eventos futuros. Desse modo, ressaltamos que a responsabilidade pelo uso de quaisquer dados ou análises desta publicação bem como consequência, são assumidas exclusivamente pelo usuário, eximindo a B.Side Investimentos de todas as ações decorrentes do uso deste material. O seu conteúdo é destinado exclusivamente à(s) pessoas(s) e/ou organizações indicadas no endereçamento eletrônico, podendo conter informações confidenciais, as quais não podem, sob qualquer forma ou pretexto, serem utilizadas, divulgadas, alteradas, impressas ou copiadas, total ou parcialmente, por pessoas não autorizadas B.Side Investimentos. Em caso de dúvida, fale com o seu Gerente.



## SÃO PAULO

Avenida Horácio Lafer, 160 - 9º andar  
Itaim Bibi - São Paulo/SP  
CEP 04538-080

## BELO HORIZONTE

Rua Bernardo Figueiredo, 33 - 12º andar  
Serra - Belo Horizonte/MG  
CEP 30220-140



<http://bsideinvestimentos.com>



[contato@bsideinvestimentos.com](mailto:contato@bsideinvestimentos.com)



[/b-side-investimentos](https://www.linkedin.com/company/b-side-investimentos)

Este material foi elaborado pela B.Side Investimentos Wealth Management. O material é destinado aos seus receptores, fornecido unicamente para fins comerciais, não constituindo compromisso, indicação ou recomendação para iniciar ou encerrar qualquer transação. Em caso de dúvidas, sugestões e reclamações, entre em contato conosco pelo telefone (11) 4502-1234 ou e-mail [contato@bsideinvestimentos.com](mailto:contato@bsideinvestimentos.com).

