



LDB
EMPRESAS

SÃO VICENTE
ABRIL 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 21.01.2021.

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

83,71%

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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,26	1,30	-5,12	3.877.523,17	2,59	5.412.184.320,85	0,07
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,33	1,30	-5,25	32.039.976,44	21,39	5.880.207.997,15	0,54
ITAU	ITAU	ITAU RF IMAB5+ FIC DE FI	18,70	1,96	-8,95	5.919.893,84	3,95	85.739.122,81	6,90
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	18,85	1,95	-8,95	12.382.492,27	8,27	1.937.305.372,80	0,64
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,97	0,43	0,02	10.762.657,58	7,19	8.182.089.077,85	0,13
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,01	0,91	-0,28	12.090.492,38	8,07	10.512.346.440,60	0,12
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	13,08	1,49	-3,73	1.743.435,00	1,16	64.181.530,37	2,72
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			11,40	1,27	-4,67	78.816.470,68	52,62		

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	0,23	-0,05	0,57	750.888,20	0,50	4.060.176.085,06	0,02
ITAU	ITAU	ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO	14,12	1,53	-3,82	7.118.599,58	4,75	400.972.197,96	1,78
ITAU	ITAU	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,06	0,27	1,23	1.107.779,45	0,74	18.862.068.676,10	0,01
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	18,98	1,97	-9,34	3.123.060,68	2,08	253.113.651,78	1,23
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	5,31	0,55	-0,04	14.813.630,18	9,89	887.003.090,20	1,67
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	1,98	0,14	1,28	18.005.955,90	12,02	5.079.848.328,78	0,35
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			5,75	0,62	-0,98	44.919.913,99	29,99		

Artigo 7º VII, Alínea b (Fundos Renda Fixa "Crédito Privado")

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	0,33	-0,15	0,72	1.652.394,21	1,10	1.247.788.907,54	0,13
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			0,33	-0,15	0,72	1.652.394,21	1,10		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

9,26

1,02

-3,36

125.388.778,88

83,71

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

16,29%

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	BRDESCO	BRDESCO FIA DIVIDENDOS	39,65	7,25	-30,67	2.615.747,44	1,75	1.761.839.540,18	0,15
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST ACOES FIC FIA	43,86	11,36	-31,54	712.382,93	0,48	699.654.427,07	0,10
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	45,04	13,44	-35,54	3.741.255,56	2,50	527.391.430,97	0,71
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	44,25	16,50	-24,62	4.101.627,10	2,74	1.601.688.122,14	0,26
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	38,93	10,92	-28,05	2.833.387,14	1,89	235.257.525,45	1,20
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			41,81	12,47	-29,97	14.004.400,17	9,35		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SAFRA	SAFRA	SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	1,27	0,24	0,86	2.392.953,19	1,60	1.295.286.475,44	0,18
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	30,85	11,71	-11,32	8.004.049,90	5,34	375.097.540,79	2,13
Sub-total Artigo 8º III			22,56	8,85	-8,77	10.397.003,09	6,94		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			33,12	10,90	-22,28	24.401.403,26	16,29		
Total			12,21	2,51	-7,03	149.790.182,14	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	78.816.470,68	52,62	0,00	60,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	44.919.913,99	29,99	0,00	10,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	1.652.394,21	1,10	0,00	0,00	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	125.388.778,88	83,71				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	14.004.400,17	9,35	0,00	20,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	10.397.003,09	6,94	0,00	10,00	10,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	24.401.403,26	16,29				30,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

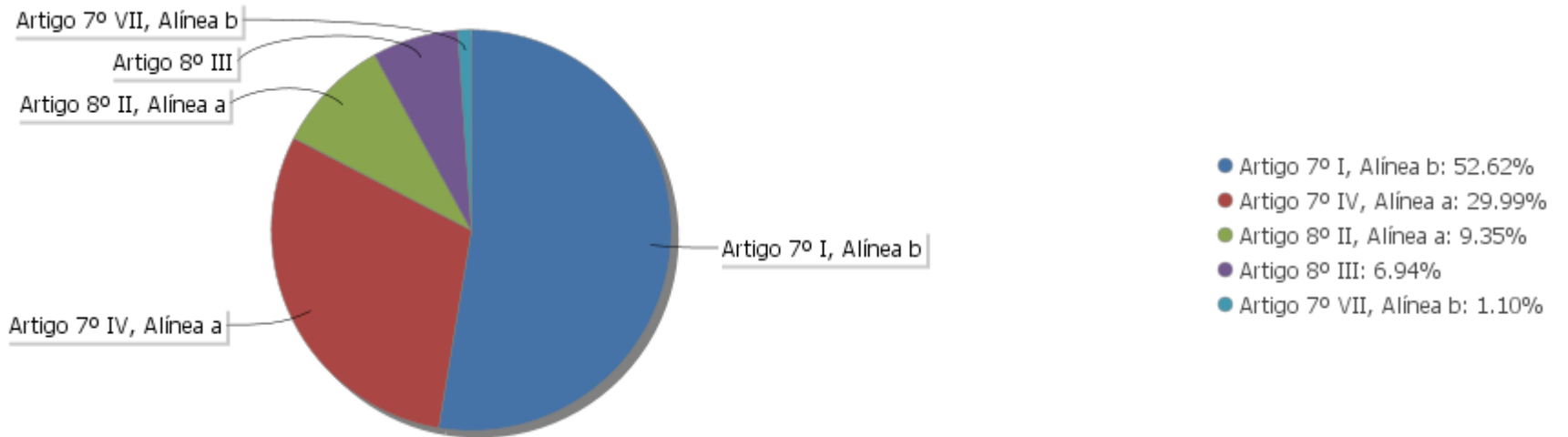
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,27 446,67	-4,67 -359,11	-4,92 -534,72	-4,63 -223,96	6,45 124,27	993.563,90	-3.852.622,42
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,62 217,74	-0,98 -75,05	-1,23 -134,01	-0,51 -24,70	8,90 171,36	276.513,49	-392.233,93
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	-0,15 -53,69	0,72 55,31	0,36 38,97	1,31 63,24	4,37 84,13	-2.531,73	11.795,37
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	12,47 2,22	-29,97 0,42	-30,44 -1,20	-22,52 2,39	-9,80 6,65	1.552.527,28	-5.992.590,23
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	8,85 -1,41	-8,77 21,62	-9,13 20,11	-4,26 20,65	-0,14 16,31	845.054,97	-992.678,56
SÃO VICENTE - CONSOLIDADO (Total)						3.665.127,91	-11.218.329,77

Análise de Liquidez

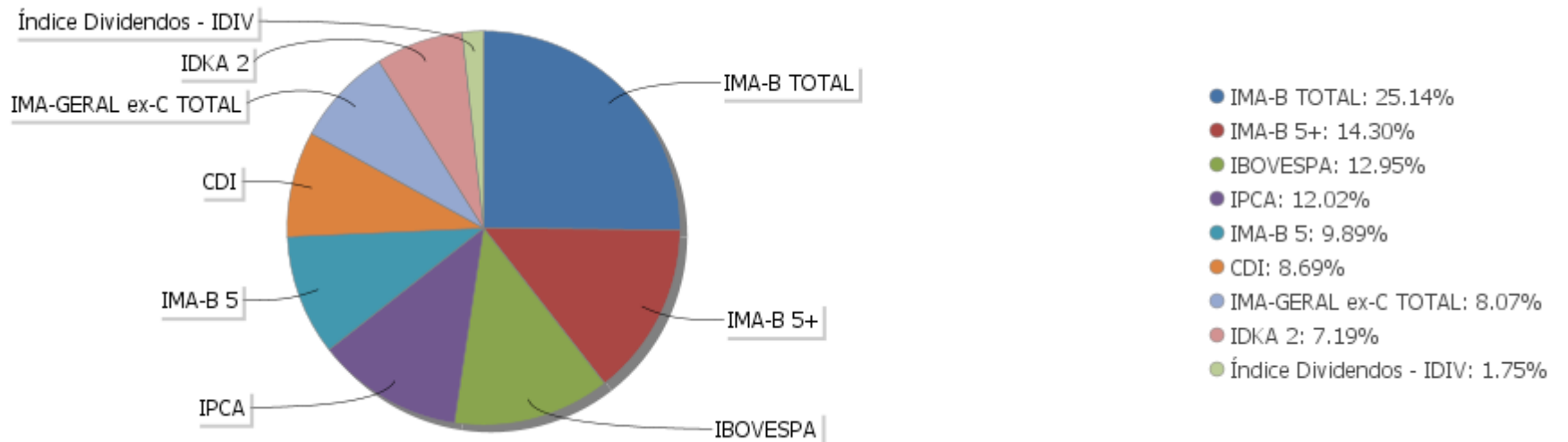
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	145.688.555,04	97,26	145.688.555,04	97,26
de 31 a 364 dias	4.101.627,10	2,74	149.790.182,14	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	149.790.182,14	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

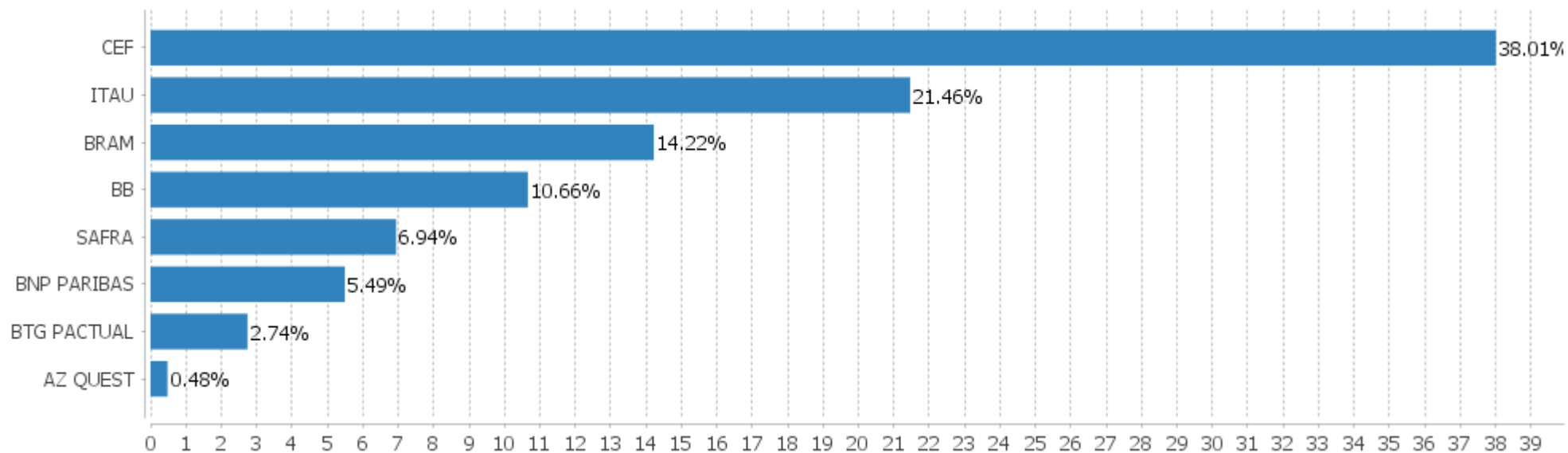


Alocação Por Estratégia



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	0,37	-1,02	-8,71	2,51									-7,03
INPC + 6%	0,70	0,59	0,69	0,23									2,23
p.p. indexador	-0,34	-1,61	-9,40	2,27									-9,26
2019	3,68	0,35	0,43	1,28	2,33	2,92	1,33	-0,10	2,15	2,38	-1,05	2,74	19,95
INPC + 6%	0,87	1,01	1,21	1,09	0,66	0,45	0,63	0,63	0,44	0,57	1,01	1,71	10,78
p.p. indexador	2,81	-0,66	-0,78	0,19	1,67	2,47	0,69	-0,73	1,72	1,81	-2,06	1,03	9,17
2018	1,94	0,51	0,85	0,19	-2,24	-0,23	1,89	-0,53	0,08	5,08	0,90	1,26	9,96
INPC + 6%	0,74	0,60	0,56	0,70	0,92	1,92	0,76	0,53	0,74	0,91	0,21	0,60	9,59
p.p. indexador	1,20	-0,08	0,29	-0,51	-3,16	-2,15	1,13	-1,07	-0,66	4,16	0,69	0,66	0,37
2017	1,43	2,24	1,15	0,15	-0,53	0,43	2,86	1,21	1,36	0,03	-0,23	0,89	11,50
INPC + 6%	0,93	0,66	0,85	0,50	0,87	0,19	0,66	0,50	0,44	0,86	0,64	0,72	8,12
p.p. indexador	0,50	1,58	0,29	-0,34	-1,40	0,24	2,21	0,71	0,91	-0,83	-0,88	0,16	3,39

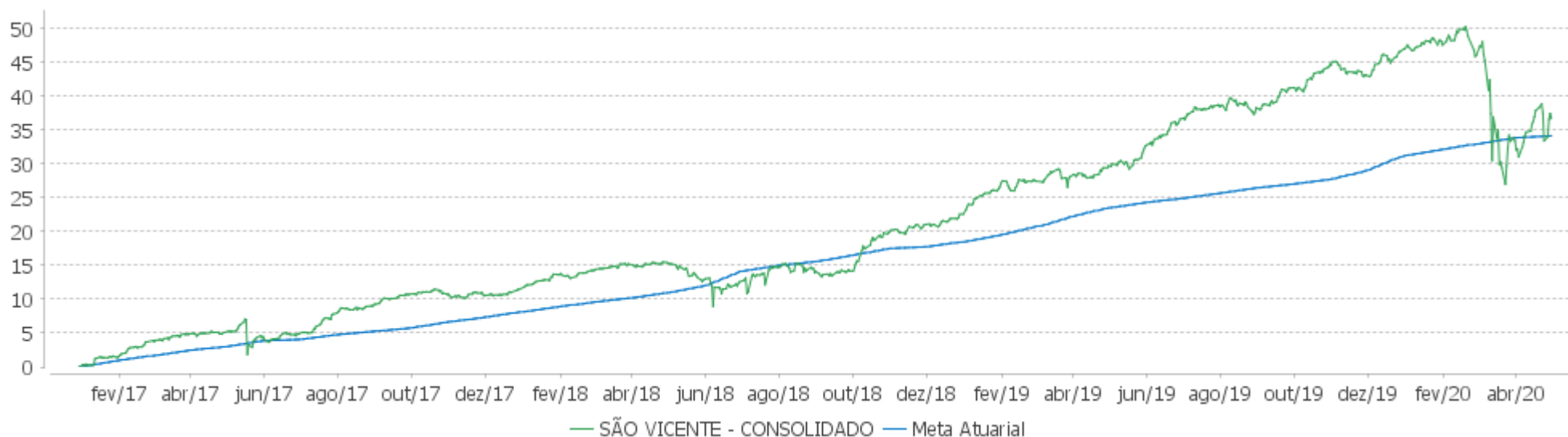
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

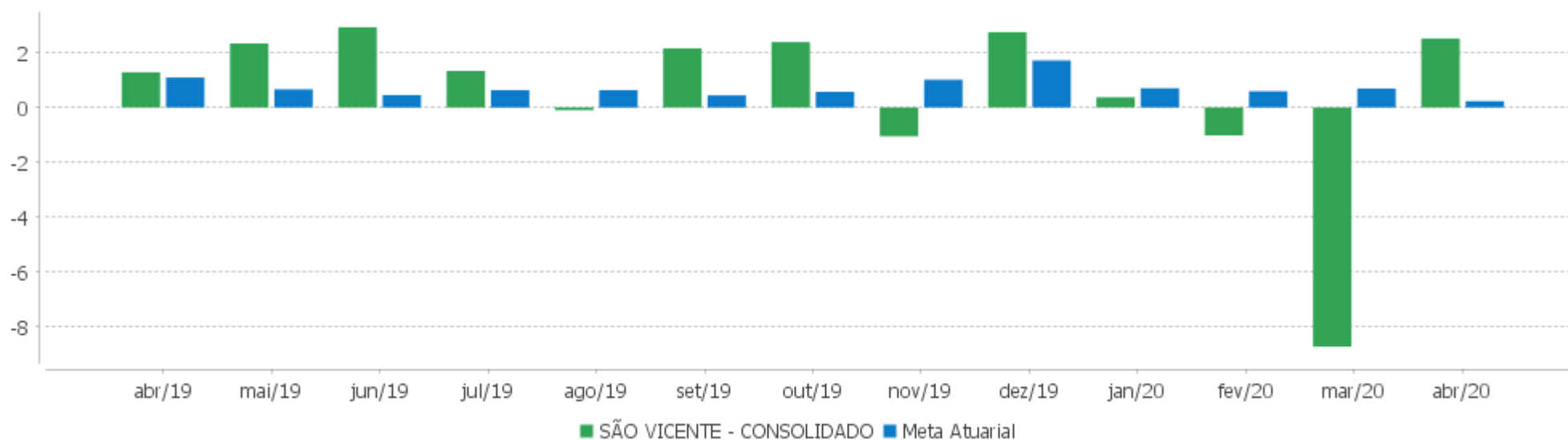
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	23	57,50	03 meses	-7,37	1,52	-8,89	24,06
Meses abaixo da Meta Atuarial	17	42,50	06 meses	-5,49	5,03	-10,52	17,01
			12 meses	5,38	8,63	-3,26	12,21
			24 meses	18,44	20,94	-2,50	9,94
			36 meses	30,14	30,30	-0,17	8,77
Maior rentabilidade da Carteira	5,08	2018-10	Desde 30/12/2016	36,72	34,18	2,54	8,37
Menor rentabilidade da Carteira	-8,71	2020-03					

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.	1,30 -0,01	-5,25 -0,17	-5,48 -0,15	-5,82 -0,27	8,47 -0,47	25,17 -0,75	38,56 -1,12
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,49 0,18	-3,73 1,35	-4,83 0,50	-5,23 0,32	10,12 1,18	28,13 2,21	38,55 -1,13
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,91 0,07	-0,28 -0,10	-0,76 -0,09	-0,26 -0,29	8,60 0,26	19,45 0,41	31,58 -0,29
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,43 -0,15	0,02 -0,55	-0,44 -0,47	1,13 -0,67	7,34 -1,27	17,02 -1,82	30,50 -2,96
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,30 -0,02	-5,12 -0,04	-5,36 -0,04	-5,65 -0,09	8,71 -0,22	25,32 -0,60	38,67 -1,01
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	1,95 -0,07	-8,95 -0,13	-8,91 -0,06	-10,50 -0,25	7,94 -0,53	29,14 -1,18	42,37 -1,57
ITAU RF IMAB5+ FIC DE FI Var. IMA-B 5+ p.p.	1,96 -0,05	-8,95 -0,13	-8,96 -0,11	-10,42 -0,17	8,03 -0,44	29,02 -1,30	41,72 -2,22
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	0,55 0,06	-0,04 0,04	-0,60 0,04	0,79 -0,07	8,61 -0,06	19,00 -0,47	32,79 -0,59
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	-0,05 -18,95	0,57 44,03	0,20 21,92	1,28 61,88	4,34 83,55	10,84 91,35	20,11 96,09
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	1,53 537,07	-3,82 -293,56	-4,01 -436,26	-4,58 -221,65	11,67 224,70	28,88 243,38	42,18 201,56
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI % do CDI	0,27 93,58	1,23 94,93	0,87 94,42	1,98 95,65	5,03 96,79	11,52 97,13	20,50 97,95
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+ Var. IMA-B 5+ p.p.	1,97 -0,04	-9,34 -0,52	-9,31 -0,46	-10,81 -0,56	7,64 -0,84	28,89 -1,43	41,77 -2,16
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,14 0,45	1,28 1,06	0,93 0,92	1,98 0,09	9,19 6,79	18,37 10,91	30,21 19,78
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV % do CDI	-0,15 -53,69	0,72 55,31	0,36 38,97	1,31 63,24	4,37 84,13	10,79 90,90	19,65 93,90
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	16,50 6,25	-24,62 5,77	-26,12 3,11	-19,00 5,92	-3,08 13,36	16,44 22,96	48,43 25,34
BRADESCO FIA DIVIDENDOS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	7,25 3,49	-30,67 -2,02	-28,73 -1,23	-25,69 -6,01	-20,22 -13,05	-10,14 -20,52	16,51 -14,24
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	10,92	-28,05	-27,50	-22,83	-12,03	2,31	14,48

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.	0,66	2,33	1,74	2,09	4,42	8,82	-8,62
AZ QUEST ACOES FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	11,36 1,11	-31,54 -1,16	-34,06 -4,83	-26,84 -1,93	-16,84 -0,39	-7,32 -0,80	29,80 6,71
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	13,44 3,19	-35,54 -5,16	-36,82 -7,59	-23,56 1,35	-6,97 9,48	-0,49 6,02	25,18 2,09
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO % do CDI	0,24 85,87	0,86 66,28	0,38 41,79	1,69 81,98	5,34 102,87	11,06 93,22	21,15 101,09
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	11,71 1,46	-11,32 19,06	-11,65 17,58	-5,55 19,37	-1,20 15,25	14,23 20,74	35,11 12,01
SÃO VICENTE - CONSOLIDADO Var. INPC + 6% p.p.	2,51 2,27	-7,03 -9,26	-7,37 -8,89	-5,49 -10,52	5,38 -3,26	18,44 -2,50	30,14 -0,17
CDI	0,28	1,30	0,92	2,07	5,19	11,87	20,93
IBOVESPA	10,25	-30,39	-29,23	-24,92	-16,45	-6,51	23,09
INPC + 6%	0,23	2,23	1,52	5,03	8,63	20,94	30,30
IPCA + 6%	0,15	2,14	1,41	4,83	8,57	20,71	31,43

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	0,45	1,88	1,44	2,65	6,60	13,72	23,89
IRF-M 1+	1,50	2,96	1,83	2,84	13,92	25,80	43,65
IRF-M TOTAL	1,15	2,59	1,70	2,75	11,69	22,07	37,69
IMA-B 5	0,49	-0,09	-0,64	0,86	8,67	19,47	33,38
IMA-B 5+	2,01	-8,82	-8,85	-10,25	8,47	30,32	43,94
IMA-B TOTAL	1,31	-5,08	-5,33	-5,55	8,94	25,91	39,68
IMA-C TOTAL	1,39	0,93	-1,57	0,17	12,99	32,94	49,94
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,84	-0,17	-0,67	0,03	8,34	19,04	31,87
IMA-GERAL TOTAL	0,86	-0,14	-0,69	0,03	8,47	19,43	32,35
IDKA 2	0,57	0,57	0,03	1,79	8,62	18,84	33,46
IDKA 20	1,77	-16,22	-15,05	-18,15	5,61	37,31	48,42
CDI	0,28	1,30	0,92	2,07	5,19	11,87	20,93
Renda Variável							
IBOVESPA	10,25	-30,39	-29,23	-24,92	-16,45	-6,51	23,09
IBRX 100	10,27	-30,14	-29,25	-24,33	-15,12	-4,14	25,76
IBRX 50	10,48	-31,05	-29,73	-25,91	-18,39	-9,72	19,28
SMALL CAP	10,19	-34,07	-34,37	-21,91	-4,59	5,90	40,30
IFIX	4,39	-18,58	-15,39	-6,75	3,79	11,40	27,89
Índice Consumo - ICON	17,67	-24,81	-27,47	-16,35	1,02	9,88	26,19
Índice Dividendos - IDIV	3,76	-28,65	-27,50	-19,68	-7,18	10,38	30,76
Indicadores Econômicos							
IPCA	-0,31	0,22	0,01	1,89	2,40	7,46	10,43
INPC	-0,23	0,31	0,12	2,08	2,46	7,66	9,48
IGPM	0,80	2,50	2,01	4,96	6,68	15,90	18,09
SELIC	0,28	1,30	0,92	2,07	5,19	11,87	20,94
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

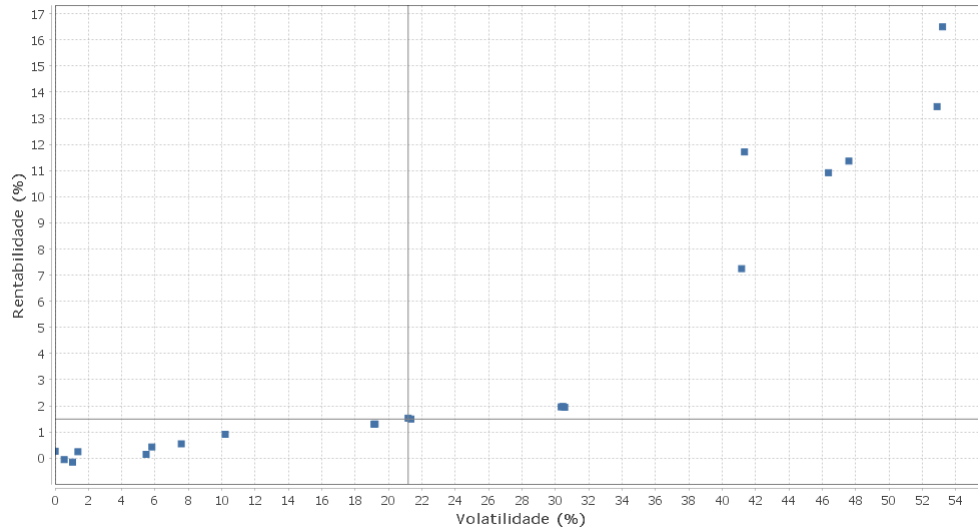
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
119	03/04/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	36.418,75	0,00	2.057,75622741	17,6982820000
123	07/04/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	48.681,93	0,00	1.011,61707207	48,1228830000
120	09/04/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	71.746,88	0,00	4.042,02172747	17,7502460000
124	09/04/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	96,60	0,00	2,00684567	48,1352410000
115	13/04/2020	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	12.508,76	5.604,92601500	2,2317440000
125	13/04/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	106.820,19	0,00	2.218,89453259	48,1411750000
126	16/04/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	16.446,26	0,00	341,48838701	48,1605250000
116	17/04/2020	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	995,36	444,52637400	2,2391470000
122	17/04/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	11.781,94	244,60553503	48,1671030000
117	22/04/2020	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	7.220,21	3.209,73256400	2,2494740000
121	23/04/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	4.704,25	0,00	263,91058574	17,8251660000
118	29/04/2020	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	184.963,97	83.391,14150400	2,2180290000
Total						

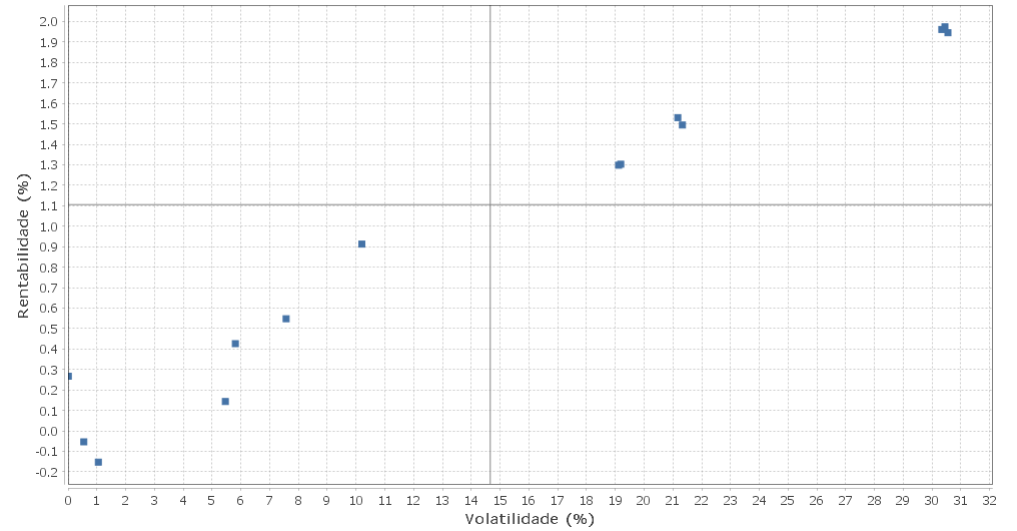
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

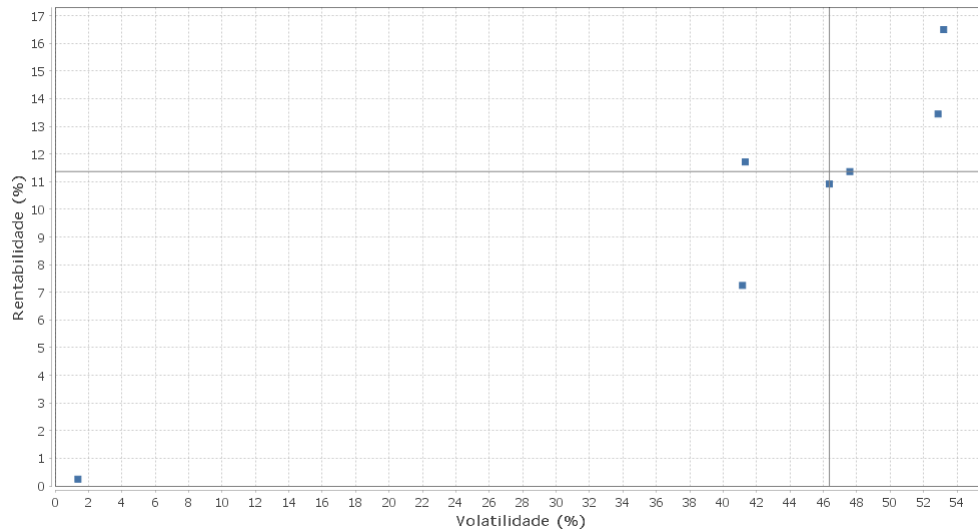
SÃO VICENTE - CONSOLIDADO - No Mês



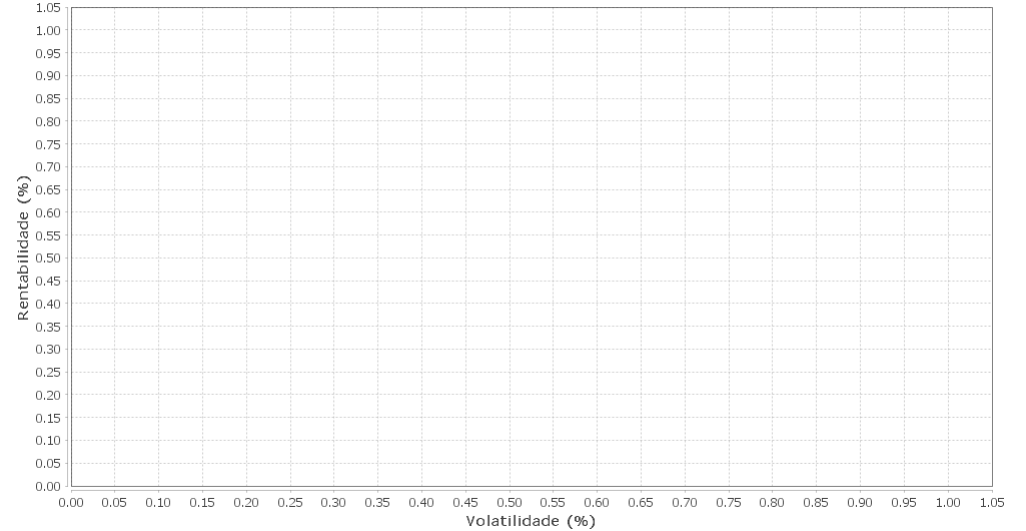
Renda Fixa - No Mês



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\$): 13.118.999,23

Value-At-Risk: 8,76%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,01	-0,00	-2,65	0,27	1.107.779,45	0,74
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	Artigo 7º IV, Alínea a	0,55	0,18	-0,00	-0,62	-0,05	750.888,20	0,50
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	Artigo 7º VII, Alínea b	1,05	0,08	-0,00	-0,42	-0,15	1.652.394,21	1,10
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	1,37	1,00	0,01	-0,03	0,24	2.392.953,19	1,60
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	5,46	0,45	0,02	-0,03	0,14	18.005.955,90	12,02
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,81	2,19	0,13	0,02	0,43	10.762.657,58	7,19
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	Artigo 7º IV, Alínea a	7,57	2,98	0,25	0,03	0,55	14.813.630,18	9,89
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	10,20	3,91	0,30	0,06	0,91	12.090.492,38	8,07
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	19,12	9,50	0,24	0,05	1,30	3.877.523,17	2,59
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	19,19	9,69	1,99	0,05	1,30	32.039.976,44	21,39
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	21,17	9,43	0,43	0,06	1,53	7.118.599,58	4,75
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	21,33	10,38	0,12	0,06	1,49	1.743.435,00	1,16
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	Artigo 7º I, Alínea b	30,34	14,08	0,53	0,06	1,96	5.919.893,84	3,95
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	Artigo 7º IV, Alínea a	30,45	14,10	0,28	0,06	1,97	3.123.060,68	2,08
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	30,55	14,14	1,12	0,05	1,95	12.382.492,27	8,27
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	41,16	30,62	0,49	0,17	7,25	2.615.747,44	1,75
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	41,33	21,31	0,88	0,28	11,71	8.004.049,90	5,34
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	46,36	26,67	0,46	0,23	10,92	2.833.387,14	1,89
AZ QUEST ACOES FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	47,59	29,18	0,13	0,23	11,36	712.382,93	0,48
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	52,87	28,60	0,65	0,25	13,44	3.741.255,56	2,50
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	53,21	29,62	0,73	0,30	16,50	4.101.627,10	2,74

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

Observar que no respectivo mês, abril de 2020:

- O Instituto possui 21,39% dos seus recursos alocados no fundo FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS P, percentual este superior ao permitido pela Resolução 3.922 de 25 de novembro de 2010.