



LDB
EMPRESAS

SÃO VICENTE
MAIO 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

83,13%

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 | 12,41 | 1,50 | -3,69 | 3.935.738,79 | 2,55 | 5.454.809.775,70 | 0,07 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 12,48 | 1,50 | -3,82 | 31.283.039,11 | 20,31 | 5.962.762.833,75 | 0,52 |
| ITAU | ITAU | ITAU RF IMAB5+ FIC DE FI | 18,96 | 0,91 | -8,12 | 5.974.031,95 | 3,88 | 81.515.296,90 | 7,33 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 19,11 | 1,00 | -8,04 | 13.005.054,36 | 8,44 | 1.931.164.845,98 | 0,67 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 4,03 | 1,91 | 1,92 | 11.455.978,69 | 7,44 | 7.977.728.907,89 | 0,14 |
| BB | BB | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI | 6,08 | 1,07 | 0,79 | 12.220.119,88 | 7,93 | 10.653.642.517,78 | 0,11 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF | 13,42 | 1,76 | -2,03 | 1.774.175,00 | 1,15 | 65.313.192,39 | 2,72 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b | | | 11,58 | 1,37 | -3,36 | 79.648.137,78 | 51,70 | | |

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 | 0,32 | 0,89 | 753.285,27 | 0,49 | 3.552.509.323,28 | 0,02 |
| ITAU | ITAU | ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO | 14,26 | 1,59 | -2,29 | 7.231.752,84 | 4,69 | 418.397.514,74 | 1,73 |
| ITAU | ITAU | ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI | 0,06 | 0,23 | 1,46 | 2.228.580,08 | 1,45 | 19.315.305.817,04 | 0,01 |
| BRAM | BRADESCO | BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+ | 19,23 | 1,01 | -8,43 | 3.154.462,35 | 2,05 | 247.908.135,19 | 1,27 |
| BRAM | BRADESCO | BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 | 5,37 | 2,16 | 2,12 | 15.134.037,24 | 9,82 | 889.703.632,35 | 1,70 |
| ITAU | ITAU | ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI | 1,92 | 0,54 | 1,82 | 18.266.062,13 | 11,86 | 5.202.369.354,06 | 0,35 |
| Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a | | | 5,81 | 1,26 | 0,27 | 46.768.179,91 | 30,36 | | |

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 | 0,17 | 0,89 | 1.655.198,82 | 1,07 | 1.195.648.775,63 | 0,14 |
| Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b | | | 0,33 | 0,17 | 0,89 | 1.655.198,82 | 1,07 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

9,39

1,31

-2,09

128.071.516,51

83,13

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

16,87%

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 | BRABESCO | BRABESCO FIA DIVIDENDOS | 40,26 | 6,42 | -26,21 | 2.783.746,65 | 1,81 | 1.845.404.610,84 | 0,15 |
| AZ QUEST | BEM | AZ QUEST ACOES FIC FIA | 44,35 | 9,33 | -25,16 | 778.852,30 | 0,51 | 752.971.612,41 | 0,10 |
| BNP PARIBAS | BNP PARIBAS | BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES | 46,07 | 6,94 | -31,07 | 4.001.019,92 | 2,60 | 556.518.549,70 | 0,72 |
| BTG PACTUAL | BTG PACTUAL | BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA | 44,90 | 10,28 | -16,87 | 4.523.146,22 | 2,94 | 1.808.642.265,33 | 0,25 |
| BNP PARIBAS | BNP PARIBAS | BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES | 39,60 | 8,58 | -21,88 | 3.076.621,90 | 2,00 | 247.425.546,08 | 1,24 |
| Sub-total Artigo 8º II, Alínea a | | | 42,51 | 8,28 | -24,17 | 15.163.386,99 | 9,84 | | |

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 | 1,29 | 0,46 | 1,32 | 2.403.936,57 | 1,56 | 1.260.363.348,37 | 0,19 |
| SAFRA | SAFRA | SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO | 31,30 | 5,18 | -6,73 | 8.418.964,50 | 5,46 | 405.852.853,75 | 2,07 |
| Sub-total Artigo 8º III | | | 23,11 | 4,10 | -5,03 | 10.822.901,07 | 7,03 | | |
| Renda Variável e Investimentos Estruturados | | | 33,61 | 6,50 | -17,23 | 25.986.288,06 | 16,87 | | |
| Total | | | 12,39 | 2,16 | -5,03 | 154.057.804,57 | 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 | 79.648.137,78 | 51,70 | 0,00 | 60,00 | 100,00 | 100,00 |
| Artigo 7º IV, Alínea a | Fundos de Renda Fixa | 46.768.179,91 | 30,36 | 0,00 | 10,00 | 40,00 | 40,00 |
| Artigo 7º VII, Alínea b | Fundos Renda Fixa "Crédito Privado" | 1.655.198,82 | 1,07 | 0,00 | 0,00 | 5,00 | 5,00 |
| | Total Renda Fixa | 128.071.516,51 | 83,13 | | | | 100,00 |
| Renda Variável e Investimentos Estruturados | | | | | | | |
| Artigo 8º II, Alínea a | Fundos de Ações | 15.163.386,99 | 9,84 | 0,00 | 20,00 | 20,00 | 20,00 |
| Artigo 8º III | Fundos Multimercados | 10.822.901,07 | 7,03 | 0,00 | 10,00 | 10,00 | 10,00 |
| | Total Renda Variável e Investimentos Estruturados | 25.986.288,06 | 16,87 | | | | 30,00 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

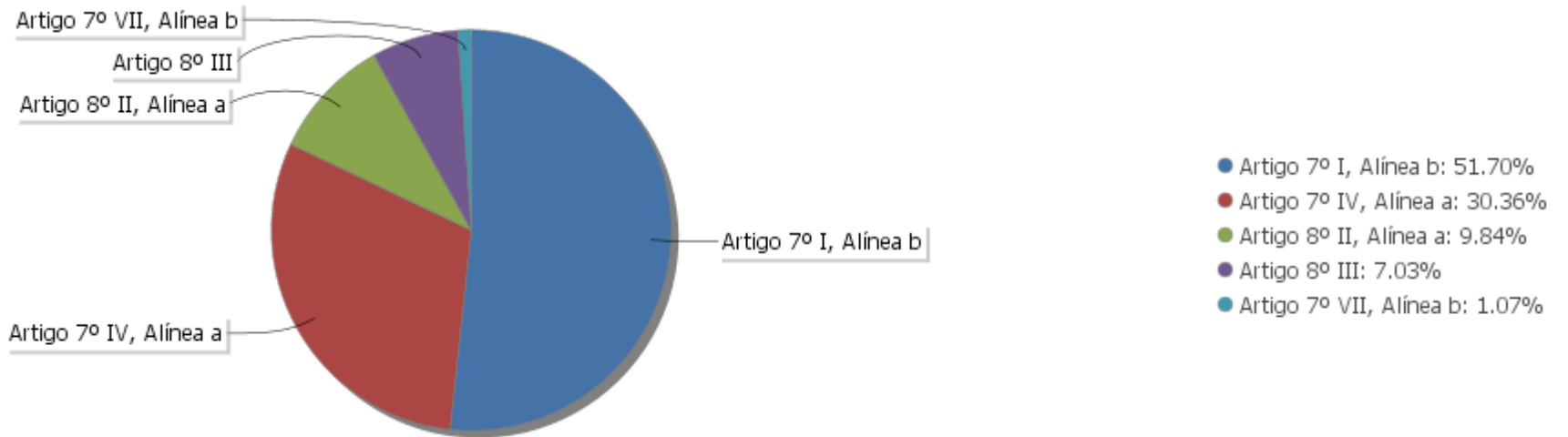
| Estratégia Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | No Mês(R\$) | No Ano(R\$) |
|--|----------------|------------------|------------------|-----------------|----------------|---------------------|----------------------|
| Artigo 7º I, Alínea b % do CDI | 1,37 582,64 | -3,36 -218,24 | -4,03 -467,61 | -1,58 -82,47 | 5,07 103,99 | 1.082.029,11 | -2.770.593,31 |
| Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI | 1,26 532,32 | 0,27 17,38 | -0,47 -53,98 | 1,72 89,47 | 8,14 167,20 | 567.973,68 | 175.739,75 |
| Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI | 0,17 71,98 | 0,89 57,83 | 0,25 28,67 | 1,18 61,39 | 4,00 82,06 | 2.804,61 | 14.599,98 |
| Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p. | 8,28 -0,29 | -24,17 0,25 | -18,43 -2,33 | -17,51 1,74 | -4,27 5,66 | 1.158.986,82 | -4.833.603,41 |
| Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p. | 4,10 -4,47 | -5,03 19,39 | 0,48 16,57 | -2,59 16,66 | 6,63 16,55 | 425.897,98 | -566.780,58 |
| SÃO VICENTE - CONSOLIDADO (Total) | | | | | | 3.237.692,20 | -7.980.637,57 |

Análise de Liquidez

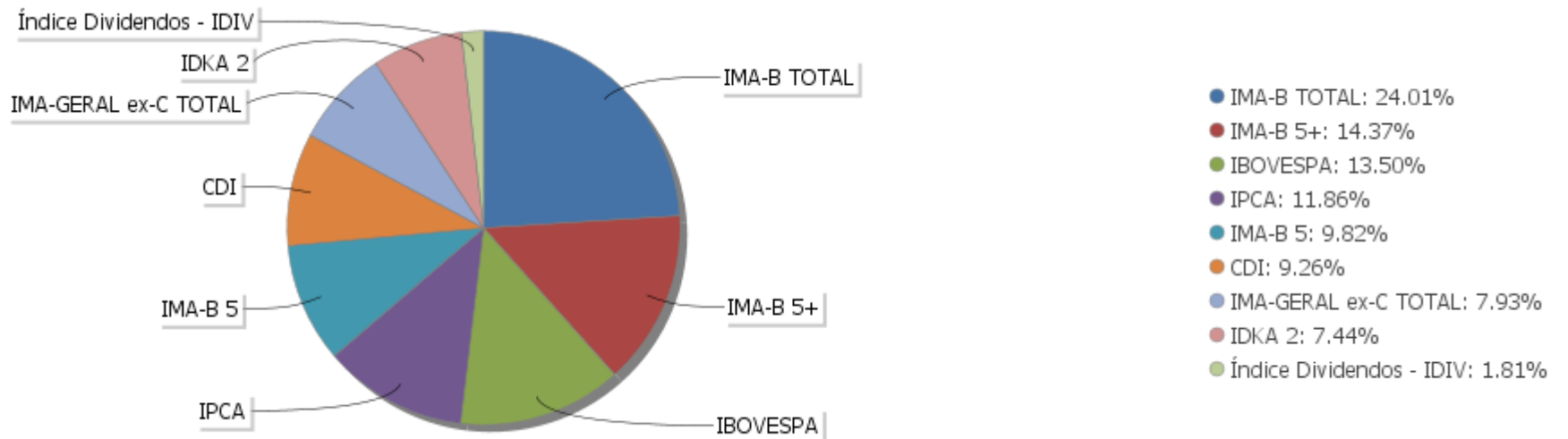
| Período | Valor (R\$) | (%) | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|----------------|-------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias | 149.534.658,35 | 97,06 | 149.534.658,35 | 97,06 |
| de 31 a 364 dias | 4.523.146,22 | 2,94 | 154.057.804,57 | 100,00 |
| acima de 365 dias | 0,00 | 0,00 | 154.057.804,57 | 100,00 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

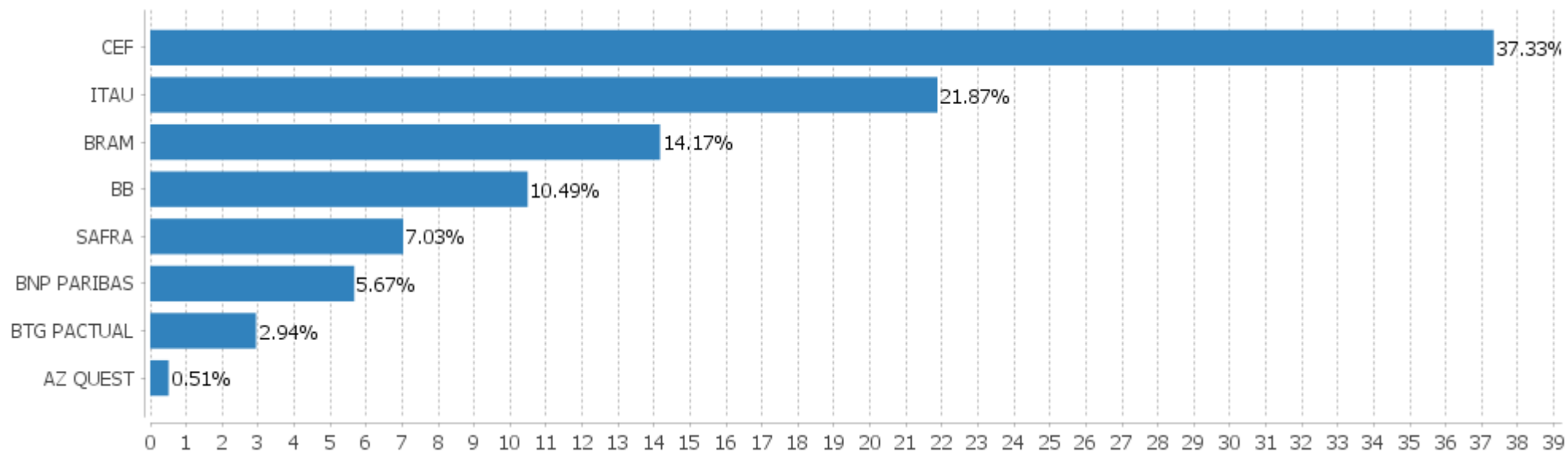


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

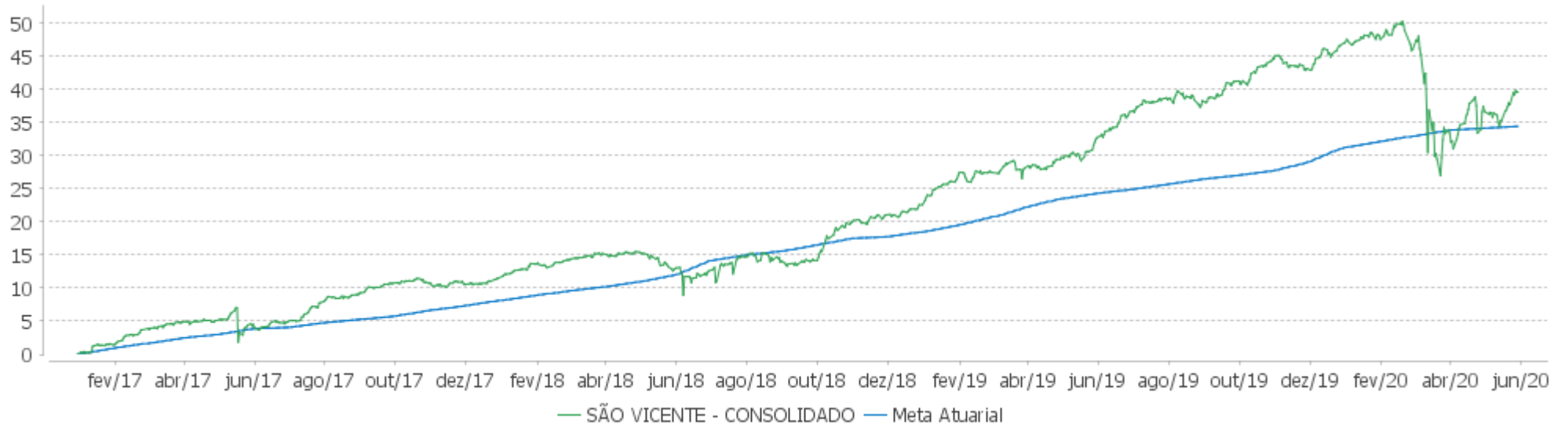
| Ano | Jan | Fev | Mar | Abr | Mai | Jun | Jul | Ago | Set | Out | Nov | Dez | Rent. Ano |
|----------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|------|-------|-------|-------|-------|------|-----------|
| 2020 | 0,37 | -1,02 | -8,71 | 2,51 | 2,16 | | | | | | | | -5,03 |
| INPC + 6% | 0,70 | 0,59 | 0,69 | 0,23 | 0,21 | | | | | | | | 2,45 |
| p.p. indexador | -0,34 | -1,61 | -9,40 | 2,27 | 1,94 | | | | | | | | -7,48 |
| 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

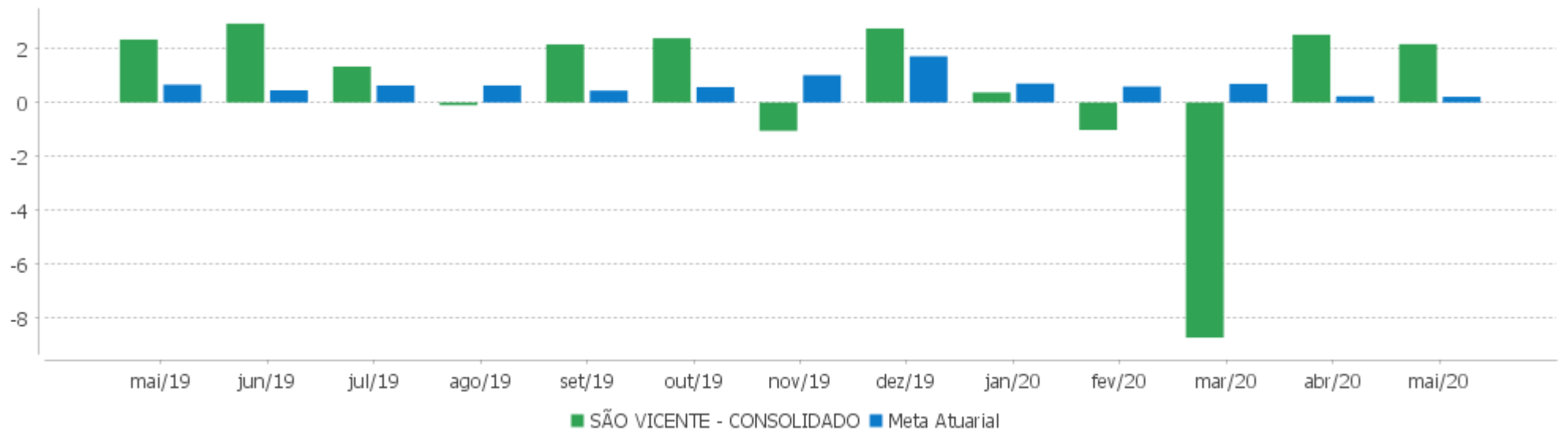
| | Quantidade | Perc. (%) | Período | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima da Meta Atuarial | 24 | 58,54 | 03 meses | -4,40 | 1,14 | -5,54 | 23,83 |
| Meses abaixo da Meta Atuarial | 17 | 41,46 | 06 meses | -2,42 | 4,20 | -6,63 | 17,29 |
| | | | 12 meses | 5,20 | 8,15 | -2,95 | 12,39 |
| | | | 24 meses | 23,77 | 20,09 | 3,68 | 10,04 |
| Maior rentabilidade da Carteira | 5,08 | 2018-10 | 36 meses | 33,64 | 29,45 | 4,19 | 8,34 |
| Menor rentabilidade da Carteira | -8,71 | 2020-03 | Desde 30/12/2016 | 39,66 | 34,46 | 5,20 | 8,37 |

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. | 1,50 -0,02 | -3,82 -0,19 | -4,48 -0,16 | -1,91 -0,20 | 6,23 -0,45 | 31,21 -0,78 | 42,33 -1,17 |
| FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF Var. IMA-B TOTAL p.p. | 1,76 0,24 | -2,03 1,60 | -3,76 0,56 | -0,96 0,75 | 7,56 0,88 | 35,70 3,71 | 42,90 -0,61 |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p. | 1,07 0,10 | 0,79 -0,00 | -0,15 0,00 | 1,76 0,05 | 7,59 0,17 | 22,37 0,40 | 33,47 0,42 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p. | 1,91 0,15 | 1,92 -0,41 | 0,85 -0,24 | 3,04 -0,52 | 8,24 -0,79 | 20,20 -1,97 | 32,44 -2,76 |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p. | 1,50 -0,02 | -3,69 -0,06 | -4,36 -0,04 | -1,79 -0,09 | 6,48 -0,20 | 31,36 -0,64 | 42,46 -1,05 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p. | 1,00 -0,02 | -8,04 -0,15 | -8,27 -0,06 | -5,68 -0,20 | 3,72 -0,45 | 36,70 -1,38 | 46,24 -1,80 |
| ITAU RF IMAB5+ FIC DE FI Var. IMA-B 5+ p.p. | 0,91 -0,11 | -8,12 -0,23 | -8,41 -0,20 | -5,75 -0,26 | 3,67 -0,50 | 36,61 -1,47 | 45,74 -2,30 |
| BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p. | 2,16 0,04 | 2,12 0,09 | 0,89 0,07 | 3,37 0,08 | 9,44 -0,02 | 23,69 -0,24 | 35,60 -0,49 |
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI | 0,32 135,38 | 0,89 58,06 | 0,27 31,55 | 1,26 65,83 | 4,11 84,34 | 10,64 92,12 | 19,38 96,42 |
| ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI | 1,59 674,09 | -2,29 -148,63 | -3,16 -367,28 | -0,29 -15,03 | 9,09 186,64 | 35,32 305,75 | 46,44 231,03 |
| ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI % do CDI | 0,23 96,07 | 1,46 95,10 | 0,82 95,03 | 1,83 95,47 | 4,71 96,67 | 11,22 97,14 | 19,67 97,87 |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+ Var. IMA-B 5+ p.p. | 1,01 -0,02 | -8,43 -0,55 | -8,67 -0,46 | -6,05 -0,57 | 3,37 -0,80 | 36,58 -1,49 | 45,84 -2,20 |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p. | 0,54 0,92 | 1,82 1,99 | 1,22 1,84 | 2,17 1,19 | 7,84 5,96 | 19,42 12,80 | 32,39 22,72 |
| BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV % do CDI | 0,17 71,98 | 0,89 57,83 | 0,25 28,67 | 1,18 61,39 | 4,00 82,06 | 10,41 90,11 | 18,74 93,23 |
| BRADESCO FIA DIVIDENDOS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p. | 6,42 1,42 | -26,21 -1,13 | -17,19 1,67 | -20,88 -3,28 | -15,67 -10,17 | 7,33 -22,21 | 31,00 -14,58 |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p. | 10,28 1,71 | -16,87 7,55 | -12,27 3,83 | -10,89 8,35 | 3,46 13,39 | 41,18 27,31 | 67,32 27,94 |
| BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES | 8,58 | -21,88 | -15,44 | -16,65 | -6,18 | 21,52 | 23,65 |

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. | 0,02 | 2,54 | 0,66 | 2,60 | 3,74 | 7,64 | -15,72 |
| AZ QUEST ACOES FIC FIA Var. IBOVESPA p.p. | 9,33 0,76 | -25,16 -0,73 | -21,39 -5,30 | -19,52 -0,27 | -9,51 0,41 | 10,88 -2,99 | 50,55 11,18 |
| BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES Var. IBOVESPA p.p. | 6,94 -1,62 | -31,07 -6,65 | -26,48 -10,39 | -22,01 -2,76 | -2,58 7,34 | 17,28 3,40 | 32,90 -6,48 |
| SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO % do CDI | 0,46 194,65 | 1,32 86,08 | 0,86 99,47 | 1,94 101,32 | 5,20 106,69 | 12,48 108,04 | 21,40 106,44 |
| SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p. | 5,18 -3,38 | -6,73 17,69 | 0,40 16,50 | -4,28 14,97 | 10,97 20,89 | 16,26 2,39 | 39,01 -0,36 |
| SÃO VICENTE - CONSOLIDADO Var. INPC + 6% p.p. | 2,16 1,94 | -5,03 -7,48 | -4,40 -5,54 | -2,42 -6,63 | 5,20 -2,95 | 23,77 3,68 | 33,64 4,19 |
| CDI | 0,24 | 1,54 | 0,86 | 1,92 | 4,87 | 11,55 | 20,10 |
| IBOVESPA | 8,57 | -24,42 | -16,10 | -19,25 | -9,92 | 13,87 | 39,37 |
| INPC + 6% | 0,21 | 2,45 | 1,14 | 4,20 | 8,15 | 20,09 | 29,45 |
| IPCA + 6% | 0,08 | 2,22 | 0,82 | 3,90 | 7,97 | 19,75 | 30,46 |

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 | 0,42 | 2,31 | 1,47 | 2,74 | 6,33 | 13,97 | 23,28 |
| IRF-M 1+ | 1,92 | 4,94 | 2,96 | 5,70 | 13,65 | 31,67 | 46,28 |
| IRF-M TOTAL | 1,42 | 4,05 | 2,47 | 4,69 | 11,31 | 26,14 | 39,22 |
| IMA-B 5 | 2,12 | 2,03 | 0,82 | 3,29 | 9,46 | 23,93 | 36,10 |
| IMA-B 5+ | 1,02 | -7,88 | -8,21 | -5,48 | 4,17 | 38,08 | 48,04 |
| IMA-B TOTAL | 1,52 | -3,64 | -4,32 | -1,70 | 6,68 | 31,99 | 43,51 |
| IMA-C TOTAL | 2,63 | 3,59 | 0,39 | 4,00 | 13,32 | 37,08 | 56,72 |
| IMA-GERAL ex-C TOTAL | 0,97 | 0,80 | -0,15 | 1,71 | 7,42 | 21,97 | 33,05 |
| IMA-GERAL TOTAL | 1,02 | 0,88 | -0,13 | 1,78 | 7,59 | 22,39 | 33,68 |
| IDKA 2 | 1,75 | 2,33 | 1,10 | 3,57 | 9,03 | 22,17 | 35,19 |
| IDKA 20 | 0,44 | -15,84 | -14,60 | -12,53 | -2,27 | 47,87 | 55,09 |
| CDI | 0,24 | 1,54 | 0,86 | 1,92 | 4,87 | 11,55 | 20,10 |
| Renda Variável | | | | | | | |
| IBOVESPA | 8,57 | -24,42 | -16,10 | -19,25 | -9,92 | 13,87 | 39,37 |
| IBRX 100 | 8,52 | -24,19 | -16,35 | -18,67 | -8,92 | 16,77 | 41,65 |
| IBRX 50 | 9,10 | -24,78 | -16,07 | -19,84 | -11,37 | 10,51 | 35,55 |
| SMALL CAP | 5,07 | -30,73 | -24,82 | -21,96 | -1,69 | 25,45 | 48,98 |
| IFIX | 2,08 | -16,88 | -10,33 | -8,05 | 4,11 | 20,03 | 29,22 |
| Índice Consumo - ICON | 7,65 | -19,06 | -13,24 | -12,56 | 7,69 | 32,60 | 36,80 |
| Índice Dividendos - IDIV | 5,00 | -25,08 | -18,87 | -17,60 | -5,50 | 29,54 | 45,59 |
| Indicadores Econômicos | | | | | | | |
| IPCA | -0,38 | -0,16 | -0,62 | 0,99 | 1,88 | 6,62 | 9,67 |
| INPC | -0,25 | 0,06 | -0,30 | 1,28 | 2,05 | 6,93 | 8,81 |
| IGPM | 0,28 | 2,79 | 2,34 | 4,94 | 6,51 | 14,65 | 19,54 |
| SELIC | 0,24 | 1,54 | 0,86 | 1,92 | 4,87 | 11,56 | 20,12 |
| Meta Atuarial | | | | | | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

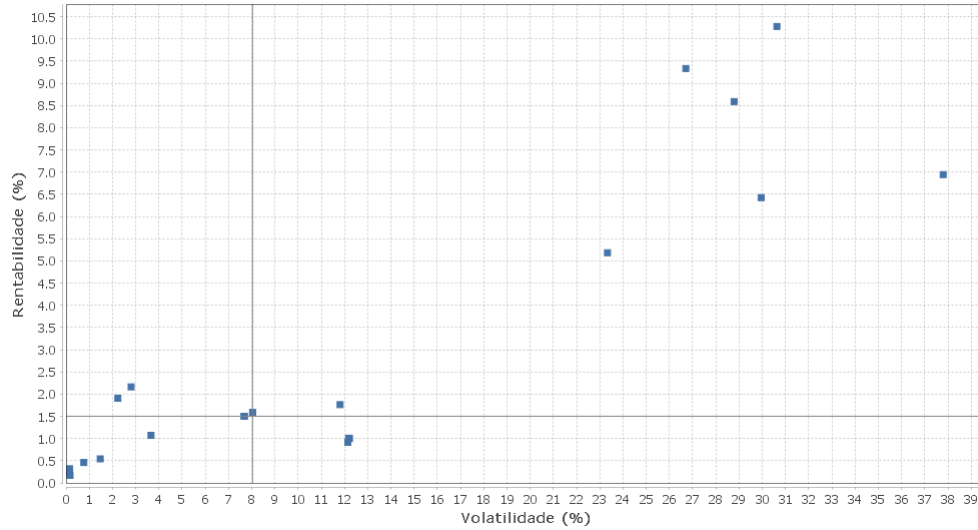
| APR | Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|-----|------------|---|------------|--------------|------------------|---------------|
| 142 | 06/05/2020 | ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI | 65.727,95 | 0,00 | 1.362,54604593 | 48,2390670000 |
| 148 | 08/05/2020 | ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI | 0,00 | 10.000,00 | 207,25044544 | 48,2508010000 |
| 146 | 08/05/2020 | ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI | 0,00 | 3.469,05 | 71,89621577 | 48,2508010000 |
| 147 | 08/05/2020 | ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI | 0,00 | 9.060,91 | 187,78776336 | 48,2508010000 |
| 139 | 08/05/2020 | ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI | 121.641,17 | 0,00 | 6.848,13814235 | 17,7626630000 |
| 149 | 11/05/2020 | ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI | 0,00 | 57.000,00 | 1.181,20166049 | 48,2559430000 |
| 137 | 11/05/2020 | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 0,00 | 12.711,00 | 5.686,85645300 | 2,2351540000 |
| 143 | 13/05/2020 | ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI | 163.533,17 | 0,00 | 3.388,14137456 | 48,2663360000 |
| 150 | 14/05/2020 | ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI | 0,00 | 10.000,00 | 207,16150701 | 48,2715160000 |
| 151 | 15/05/2020 | ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI | 0,00 | 10.000,00 | 207,13918027 | 48,2767190000 |
| 140 | 15/05/2020 | ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI | 764,39 | 0,00 | 43,08511010 | 17,7413960000 |
| 144 | 19/05/2020 | ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI | 16.440,00 | 0,00 | 340,46342581 | 48,2871250000 |
| 130 | 20/05/2020 | FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 0,00 | 36.652,68 | 11.066,41080700 | 3,3120660000 |
| 131 | 20/05/2020 | FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 0,00 | 8.608,02 | 2.598,98827400 | 3,3120660000 |
| 132 | 21/05/2020 | FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 0,00 | 13.100,00 | 3.940,48414300 | 3,3244640000 |
| 141 | 26/05/2020 | ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI | 39.798,14 | 0,00 | 2.231,61938637 | 17,8337490000 |
| 138 | 27/05/2020 | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 500.000,00 | 0,00 | 221.573,35695600 | 2,2565890000 |
| 136 | 27/05/2020 | FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 500.000,00 | 0,00 | 202.960,54487500 | 2,4635330000 |
| 133 | 27/05/2020 | FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 0,00 | 1.000.000,00 | 298.371,81641900 | 3,3515230000 |
| 145 | 29/05/2020 | ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI | 971.917,38 | 0,00 | 20.110,58700738 | 48,3286430000 |
| 134 | 29/05/2020 | FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 0,00 | 178.998,89 | 53.436,47631900 | 3,3497510000 |
| 135 | 29/05/2020 | FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 0,00 | 291,42 | 86,99748200 | 3,3497510000 |

Total

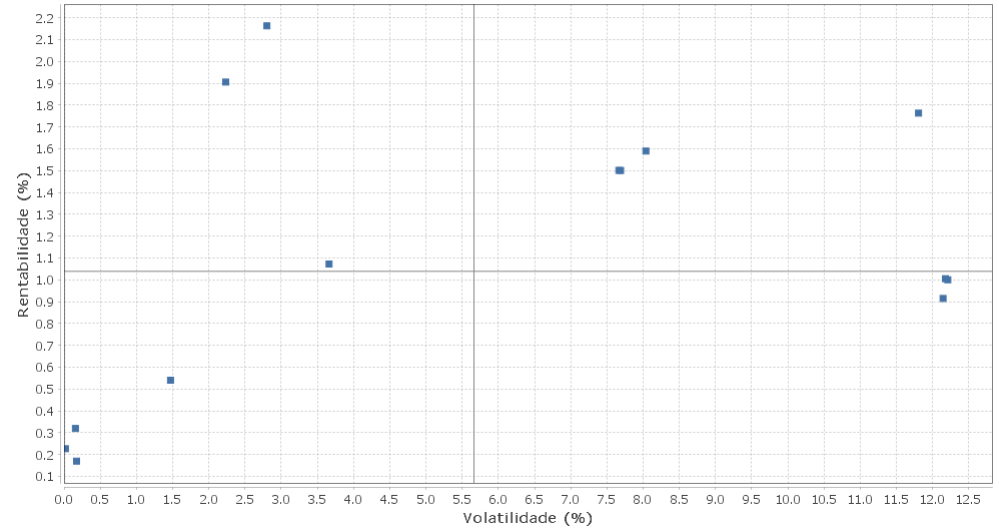
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

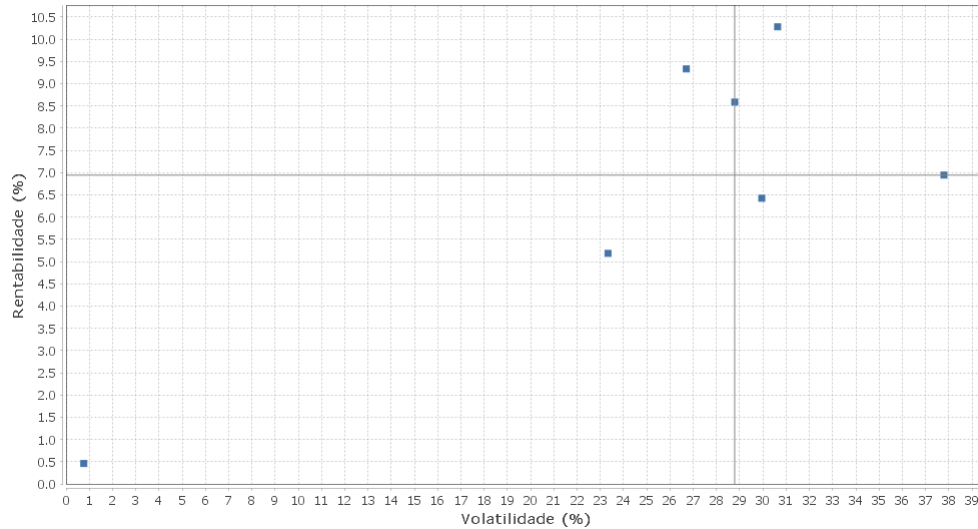
SÃO VICENTE - CONSOLIDADO - No Mês



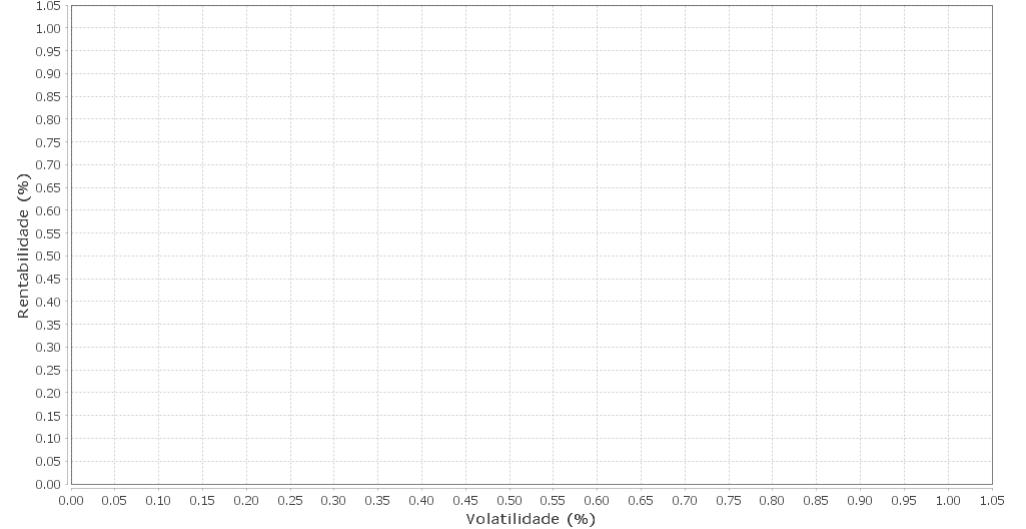
Renda Fixa - No Mês



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\$): 13.600.662,46

Value-At-Risk: 8,83%

| Ativo | Estratégia | Volatilidade | VaR | CVaR | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---|-------------------------|--------------|-------|-------|--------|-------|---------------|------------|
| ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,02 | 0,02 | -0,00 | -0,50 | 0,23 | 2.228.580,08 | 1,45 |
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,16 | 0,17 | -0,00 | 0,53 | 0,32 | 753.285,27 | 0,49 |
| BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV | Artigo 7º VII, Alínea b | 0,17 | 0,09 | -0,00 | -0,38 | 0,17 | 1.655.198,82 | 1,07 |
| SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO | Artigo 8º III | 0,77 | 0,99 | 0,01 | 0,29 | 0,46 | 2.403.936,57 | 1,56 |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI | Artigo 7º IV, Alínea a | 1,47 | 0,54 | 0,03 | 0,21 | 0,54 | 18.266.062,13 | 11,86 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 2,23 | 2,24 | 0,14 | 0,75 | 1,91 | 11.455.978,69 | 7,44 |
| BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 | Artigo 7º IV, Alínea a | 2,80 | 3,03 | 0,26 | 0,69 | 2,16 | 15.134.037,24 | 9,82 |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI | Artigo 7º I, Alínea b | 3,66 | 3,93 | 0,29 | 0,23 | 1,07 | 12.220.119,88 | 7,93 |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI | Artigo 7º I, Alínea b | 7,67 | 9,52 | 0,23 | 0,17 | 1,50 | 3.935.738,79 | 2,55 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 7,69 | 9,70 | 1,89 | 0,16 | 1,50 | 31.283.039,11 | 20,31 |
| ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO | Artigo 7º IV, Alínea a | 8,04 | 9,45 | 0,42 | 0,17 | 1,59 | 7.231.752,84 | 4,69 |
| FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF | Artigo 7º I, Alínea b | 11,81 | 10,42 | 0,11 | 0,13 | 1,76 | 1.774.175,00 | 1,15 |
| ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI | Artigo 7º I, Alínea b | 12,14 | 14,06 | 0,52 | 0,06 | 0,91 | 5.974.031,95 | 3,88 |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+ | Artigo 7º IV, Alínea a | 12,18 | 14,08 | 0,28 | 0,06 | 1,01 | 3.154.462,35 | 2,05 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 12,21 | 14,12 | 1,14 | 0,06 | 1,00 | 13.005.054,36 | 8,44 |
| SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO | Artigo 8º III | 23,33 | 21,36 | 0,91 | 0,21 | 5,18 | 8.418.964,50 | 5,46 |
| AZ QUEST ACOES FIC FIA | Artigo 8º II, Alínea a | 26,70 | 29,16 | 0,13 | 0,34 | 9,33 | 778.852,30 | 0,51 |
| BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES | Artigo 8º II, Alínea a | 28,78 | 26,75 | 0,49 | 0,29 | 8,58 | 3.076.621,90 | 2,00 |
| BRADESCO FIA DIVIDENDOS | Artigo 8º II, Alínea a | 29,95 | 30,58 | 0,51 | 0,21 | 6,42 | 2.783.746,65 | 1,81 |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA | Artigo 8º II, Alínea a | 30,63 | 29,72 | 0,79 | 0,33 | 10,28 | 4.523.146,22 | 2,94 |
| BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES | Artigo 8º II, Alínea a | 37,79 | 28,27 | 0,67 | 0,18 | 6,94 | 4.001.019,92 | 2,60 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

Observar que no respectivo mês, maio de 2020:

- O Instituto possui 20,31% 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.