



LDB
EMPRESAS

SÃO VICENTE
MARÇO 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

84,93%

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	11,10	-6,98	-6,33	3.827.830,12	2,62	5.743.378.118,49	0,07
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	11,16	-7,10	-6,46	31.627.825,02	21,65	5.890.819.394,91	0,54
ITAU	ITAU	ITAU RF IMAB5+ FIC DE FI	16,77	-10,98	-10,70	5.806.034,66	3,98	85.674.508,84	6,78
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	16,90	-10,91	-10,68	12.146.216,47	8,32	1.935.373.241,51	0,63
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,65	-1,45	-0,41	10.921.771,14	7,48	8.199.299.170,30	0,13
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	5,33	-2,10	-1,18	11.981.152,67	8,20	10.536.452.770,12	0,11
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	11,73	-6,82	-5,15	1.717.765,00	1,18	63.236.548,27	2,72
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			10,22	-6,52	-5,87	78.028.595,08	53,42		

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	0,15	0,01	0,63	751.293,89	0,51	4.670.618.286,55	0,02
ITAU	ITAU	ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO	12,89	-6,12	-5,27	7.011.308,50	4,80	389.255.098,96	1,80
ITAU	ITAU	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,06	0,32	0,96	944.718,68	0,65	16.468.896.650,56	0,01
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	17,06	-11,33	-11,10	3.062.596,42	2,10	277.385.545,74	1,10
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	4,89	-1,78	-0,59	14.732.938,39	10,09	863.147.105,19	1,71
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	1,32	0,53	1,13	17.867.411,70	12,23	5.019.962.419,71	0,36
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			5,09	-2,31	-1,59	44.370.267,58	30,38		

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	0,10	0,23	0,87	1.654.925,94	1,13	1.332.972.332,57	0,12
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			0,10	0,23	0,87	1.654.925,94	1,13		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

8,29

-4,99

-4,34

124.053.788,60

84,93

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

15,07%

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	38,17	-27,45	-35,35	2.439.007,78	1,67	1.656.219.425,52	0,15
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST ACOES FIC FIA	42,00	-35,44	-38,53	639.689,21	0,44	661.539.621,47	0,10
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	42,57	-39,40	-43,18	3.297.879,12	2,26	467.606.855,85	0,71
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	41,78	-31,71	-35,29	3.520.747,66	2,41	1.382.617.129,81	0,25
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	36,80	-29,79	-35,13	2.554.549,12	1,75	223.832.027,97	1,14
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			39,67	-33,02	-37,73	12.451.872,89	8,53		

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	1,22	0,15	0,62	2.387.112,63	1,63	1.335.018.880,15	0,18
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	28,59	-14,56	-20,62	7.164.835,49	4,91	330.179.248,95	2,17
Sub-total Artigo 8º III			20,77	-11,32	-16,18	9.551.948,12	6,54		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			31,52	-25,06	-29,92	22.003.821,01	15,07		
Total			11,36	-8,71	-9,31	146.057.609,61	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	78.028.595,08	53,42	0,00	60,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	44.370.267,58	30,38	0,00	10,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	1.654.925,94	1,13	0,00	0,00	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	124.053.788,60	84,93				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	12.451.872,89	8,53	0,00	20,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	9.551.948,12	6,54	0,00	10,00	10,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	22.003.821,01	15,07				30,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

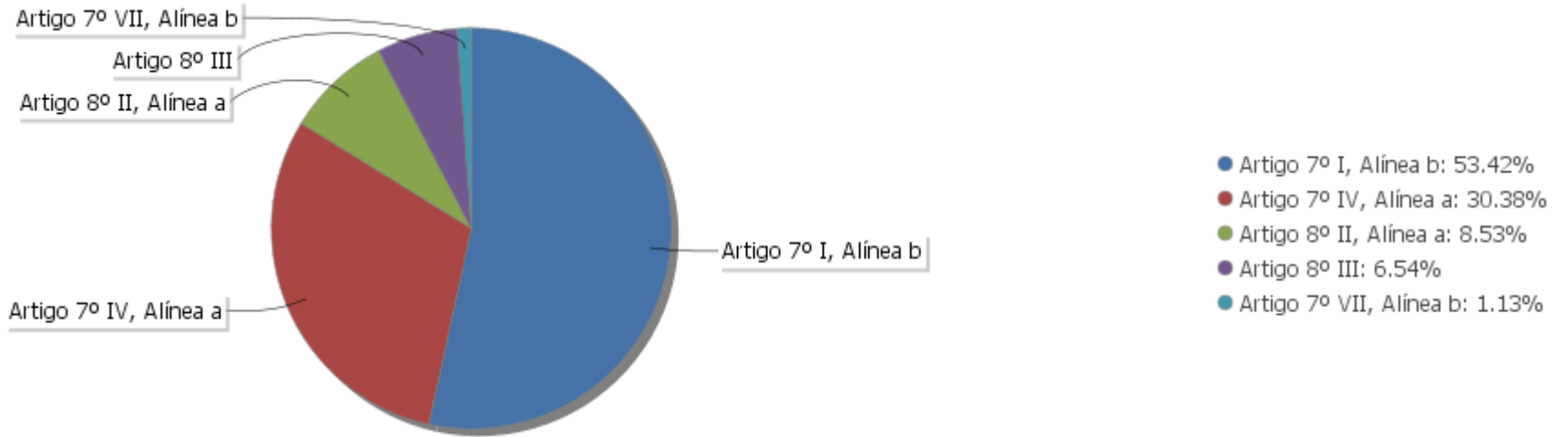
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-6,52 -1.926,59	-5,87 -579,60	-5,87 -579,60	-3,43 -151,32	6,33 116,37	-5.457.080,00	-4.846.186,32
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-2,31 -681,22	-1,59 -156,72	-1,59 -156,72	0,91 40,00	9,48 174,39	-1.019.829,06	-668.747,42
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,23 68,11	0,87 86,28	0,87 86,28	1,94 85,50	5,07 93,17	3.804,96	14.327,10
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-33,02 -3,11	-37,73 -0,87	-37,73 -0,87	-29,63 0,66	-18,06 5,41	-6.137.176,59	-7.545.117,51
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-11,32 18,58	-16,18 20,68	-16,18 20,68	-10,68 19,60	-6,34 17,13	-1.230.378,25	-1.837.733,53
SÃO VICENTE - CONSOLIDADO (Total)						-13.840.658,94	-14.883.457,68

Análise de Liquidez

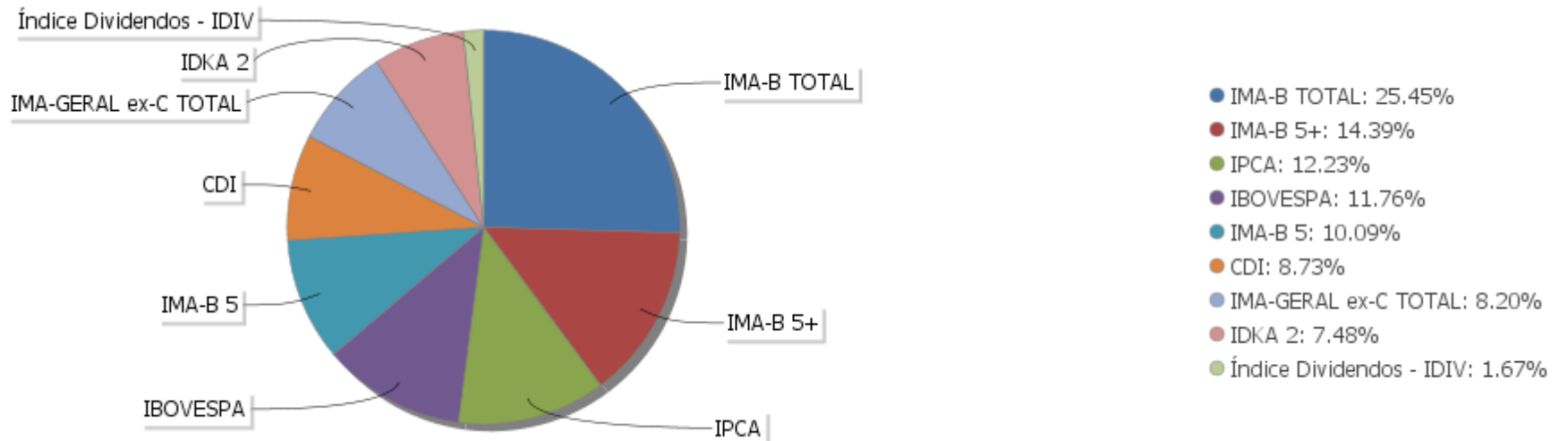
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	142.536.861,95	97,59	142.536.861,95	97,59
de 31 a 364 dias	3.520.747,66	2,41	146.057.609,61	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	146.057.609,61	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

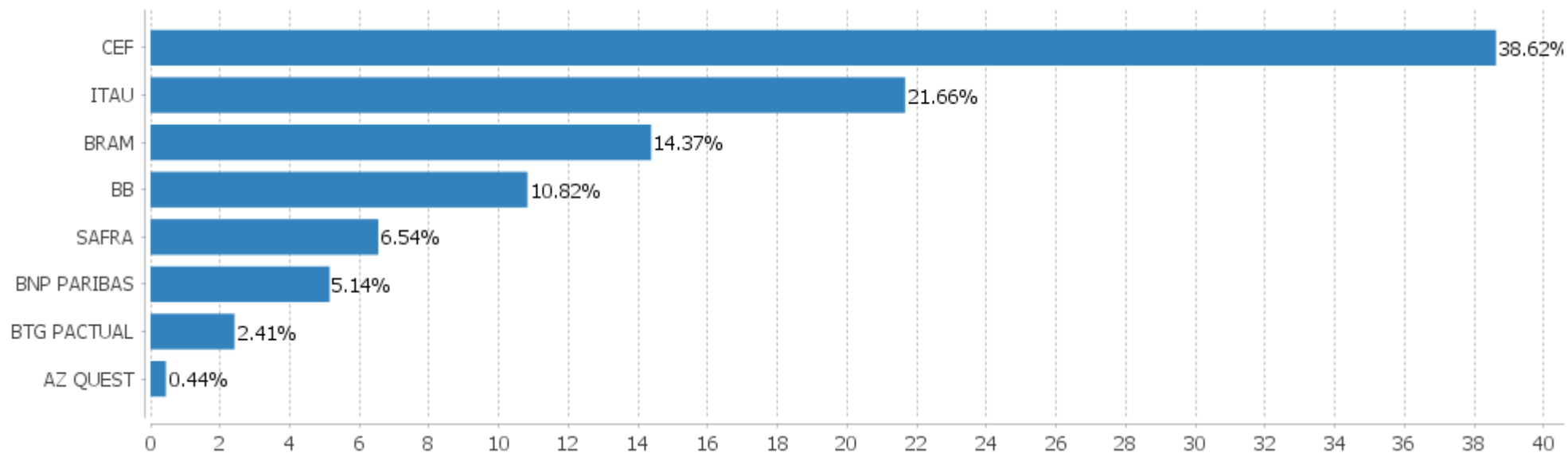


Alocação Por Estratégia



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										-9,31
INPC + 6%	0,70	0,59	0,69										1,99
p.p. indexador	-0,34	-1,61	-9,40										-11,30
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

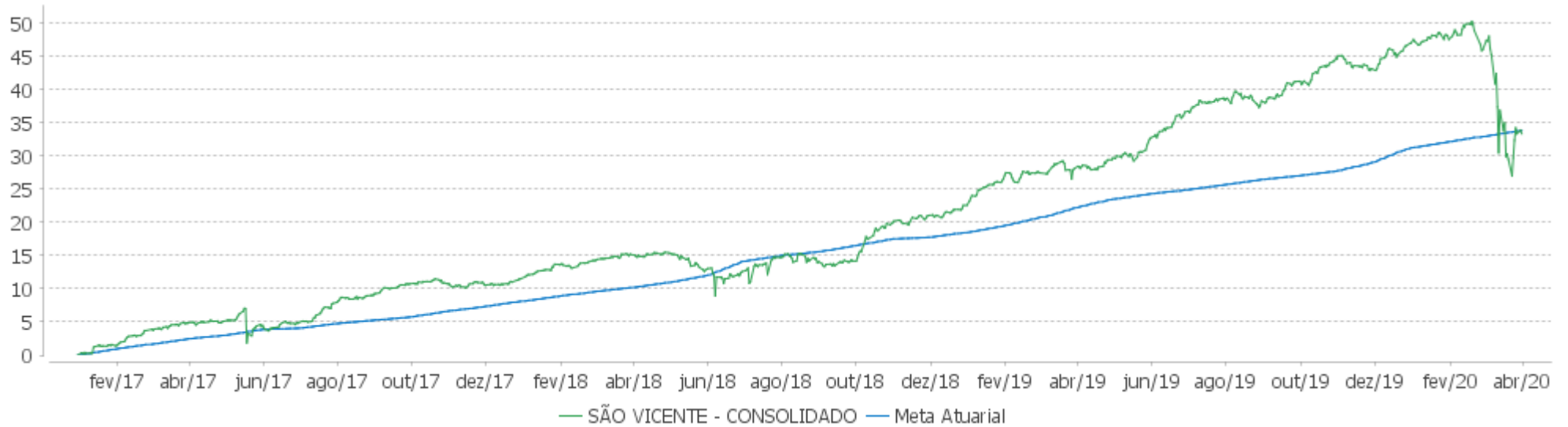
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

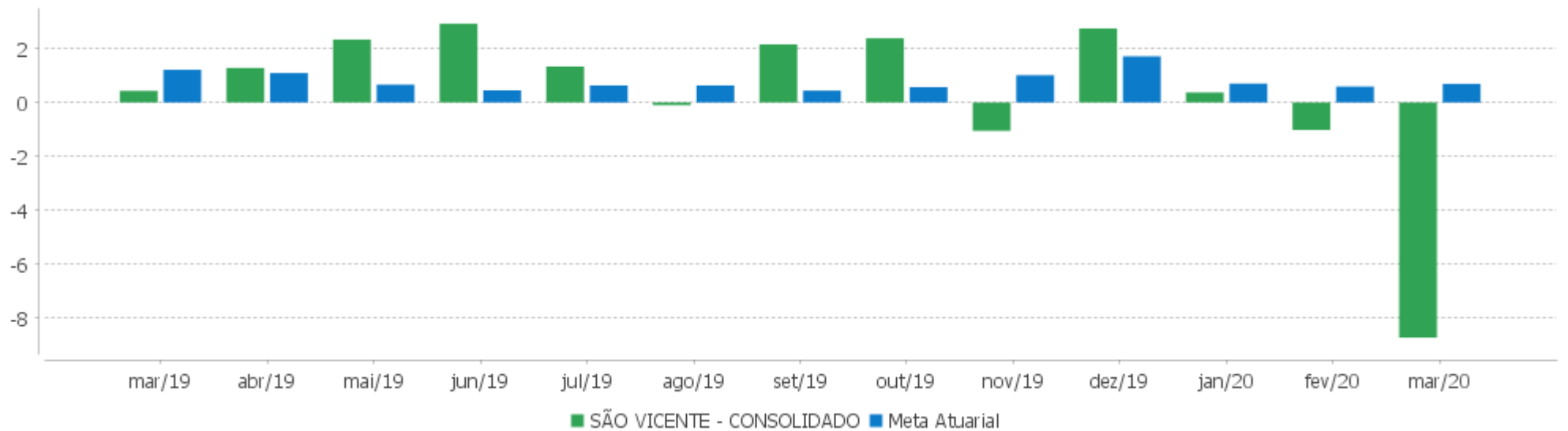
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	22	56,41	03 meses	-9,31	1,99	-11,30	21,88
Meses abaixo da Meta Atuarial	17	43,59	06 meses	-5,60	5,38	-10,99	15,63
			12 meses	4,12	9,56	-5,44	11,36
			24 meses	15,76	21,50	-5,74	9,41
Maior rentabilidade da Carteira	5,08	2018-10	36 meses	27,15	30,65	-3,50	8,39
Menor rentabilidade da Carteira	-8,71	2020-03	Desde 30/12/2016	33,37	33,87	-0,49	8,10

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
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV % do CDI	0,23 68,11	0,87 86,28	0,87 86,28	1,94 85,50	5,07 93,17	11,51 94,91	20,80 96,59
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	-1,78 -0,03	-0,59 -0,01	-0,59 -0,01	1,93 -0,09	9,18 -0,16	18,81 -0,58	32,94 -0,74
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,01 1,98	0,63 61,91	0,63 61,91	1,80 79,37	4,93 90,67	11,46 94,51	21,27 98,78
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	-6,12 -1.807,52	-5,27 -520,27	-5,27 -520,27	-2,62 -115,93	11,82 217,40	26,66 219,90	39,54 183,66
ITAÚ SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI % do CDI	0,32 95,56	0,96 95,33	0,96 95,33	2,18 96,33	5,28 97,05	11,79 97,24	21,12 98,09
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+ Var. IMA-B 5+ p.p.	-11,33 -0,39	-11,10 -0,48	-11,10 -0,48	-8,43 -0,52	7,39 -0,85	25,57 -1,37	37,80 -2,14
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,53 0,46	1,13 0,60	1,13 0,60	2,34 0,03	9,75 6,45	18,58 10,56	30,29 19,37
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-7,10 -0,13	-6,46 -0,15	-6,46 -0,15	-3,94 -0,30	8,66 -0,48	23,36 -0,75	36,31 -1,12
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-6,82 0,16	-5,15 1,16	-5,15 1,16	-3,50 0,14	9,93 0,79	25,82 1,72	34,82 -2,60
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-2,10 -0,17	-1,18 -0,17	-1,18 -0,17	0,61 -0,26	8,55 0,22	18,63 0,23	30,83 -0,39
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	-1,45 -0,24	-0,41 -0,41	-0,41 -0,41	1,98 -0,48	8,03 -1,08	17,44 -1,70	30,97 -2,96
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-6,98 -0,01	-6,33 -0,02	-6,33 -0,02	-3,73 -0,09	8,93 -0,22	23,52 -0,58	36,42 -1,00
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-10,91 0,02	-10,68 -0,07	-10,68 -0,07	-8,13 -0,22	7,75 -0,49	25,87 -1,08	38,51 -1,44
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI Var. IMA-B 5+ p.p.	-10,98 -0,05	-10,70 -0,08	-10,70 -0,08	-8,08 -0,16	7,82 -0,42	25,68 -1,27	37,82 -2,12
BRADERCO FIA DIVIDENDOS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-27,45 -1,92	-35,35 -4,11	-35,35 -4,11	-29,67 -8,26	-25,32 -17,55	-15,86 -20,74	9,55 -17,62
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-31,71 -1,81	-35,29 1,57	-35,29 1,57	-28,84 1,45	-13,47 10,00	-1,01 13,45	
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-29,79	-35,13	-35,13	-28,59	-18,70	-6,64	3,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Varição da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	0,12	1,72	1,72	1,69	4,77	7,83	-8,81
AZ QUEST ACOES FIC FIA	-35,44	-38,53	-38,53	-32,81	-24,02	-15,18	17,78
Var. IBOVESPA p.p.	-5,54	-1,67	-1,67	-2,53	-0,55	-0,71	5,41
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	-39,40	-43,18	-43,18	-31,25	-16,75	-10,58	14,82
Var. IBOVESPA p.p.	-9,50	-6,32	-6,32	-0,96	6,72	3,89	2,45
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	0,15	0,62	0,62	2,06	5,62	11,14	21,57
% do CDI	44,66	60,81	60,81	91,11	103,32	91,84	100,19
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	-14,56	-20,62	-20,62	-13,66	-7,63	2,85	22,88
Var. IBOVESPA p.p.	15,35	16,24	16,24	16,62	15,84	17,31	10,52
SÃO VICENTE - CONSOLIDADO	-8,71	-9,31	-9,31	-5,60	4,12	15,76	27,15
Var. INPC + 6% p.p.	-9,40	-11,30	-11,30	-10,99	-5,44	-5,74	-3,50
CDI	0,34	1,01	1,01	2,26	5,44	12,12	21,53
IBOVESPA	-29,90	-36,86	-36,86	-30,29	-23,47	-14,46	12,37
INPC + 6%	0,69	1,99	1,99	5,38	9,56	21,50	30,65
IPCA + 6%	0,58	1,98	1,98	5,33	9,55	21,38	31,96

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	0,60	1,43	1,43	2,83	6,66	13,79	24,42
IRF-M 1+	-0,47	1,44	1,44	3,57	12,96	24,50	42,11
IRF-M TOTAL	-0,11	1,42	1,42	3,31	11,09	21,25	36,85
IMA-B 5	-1,75	-0,57	-0,57	2,03	9,34	19,39	33,68
IMA-B 5+	-10,93	-10,62	-10,62	-7,92	8,24	26,94	39,94
IMA-B TOTAL	-6,97	-6,31	-6,31	-3,64	9,14	24,10	37,42
IMA-C TOTAL	-3,52	-0,45	-0,45	1,38	13,06	32,40	46,04
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-1,93	-1,00	-1,00	0,87	8,34	18,40	31,22
IMA-GERAL TOTAL	-1,98	-0,99	-0,99	0,89	8,47	18,79	31,60
IDKA 2	-1,21	-0,00	-0,00	2,46	9,11	19,14	33,92
IDKA 20	-16,46	-17,67	-17,67	-14,94	5,94	33,16	42,21
CDI	0,34	1,01	1,01	2,26	5,44	12,12	21,53
Renda Variável							
IBOVESPA	-29,90	-36,86	-36,86	-30,29	-23,47	-14,46	12,37
IBRX 100	-30,09	-36,64	-36,64	-29,86	-22,20	-12,35	15,05
IBRX 50	-30,37	-37,60	-37,60	-31,47	-25,64	-17,77	8,61
SMALL CAP	-35,07	-40,17	-40,17	-27,52	-11,98	-1,62	31,66
IFIX	-15,85	-22,00	-22,00	-7,08	0,45	5,79	22,69
Índice Consumo - ICON	-31,51	-36,10	-36,10	-30,32	-6,98	-7,63	14,29
Índice Dividendos - IDIV	-25,53	-31,24	-31,24	-21,42	-7,78	4,87	27,17
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,07	0,53	0,53	2,31	3,30	8,03	10,93
INPC	0,18	0,54	0,54	2,36	3,31	8,13	9,82
IGPM	1,24	1,69	1,69	4,83	6,81	15,64	15,87
SELIC	0,34	1,01	1,01	2,26	5,44	12,13	21,55
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

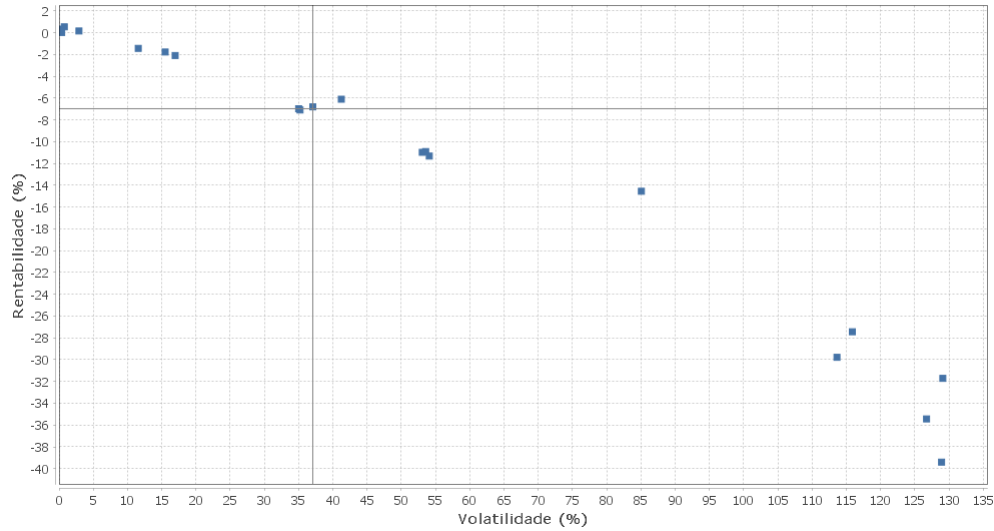
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
110	04/03/2020	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	307.404,34	0,00	1.468,78369800	209,2917700000
112	06/03/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	200.000,00	0,00	4.169,08829898	47,9721190000
111	10/03/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	52.000,00	1.083,63054158	47,9868350000
113	11/03/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	16.446,26	0,00	342,67200134	47,9941750000
109	16/03/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1.200.627,98	0,00	67.995,70152134	17,6574100000
104	18/03/2020	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	11.875,22	5.425,51955400	2,1887710000
114	19/03/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	13.000,00	0,00	270,61478371	48,0387650000
105	20/03/2020	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	5.672,16	2.607,23992200	2,1755420000
106	20/03/2020	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	6.944,27	3.191,97234300	2,1755420000
108	24/03/2020	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	4.705,25	0,00	478,87183180	9,8256980000
107	30/03/2020	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	195.029,45	88.538,71443200	2,2027590000
Total						

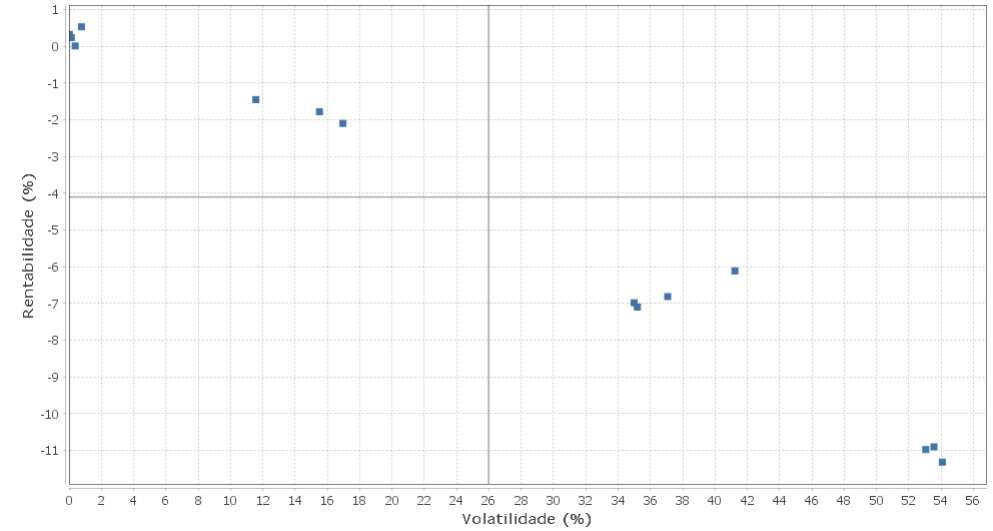
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

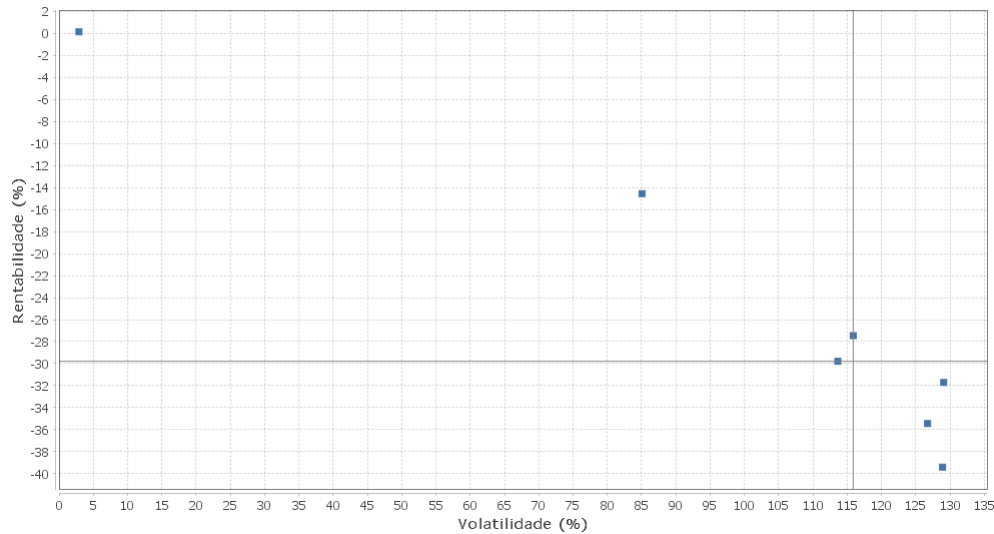
SÃO VICENTE - CONSOLIDADO - No Mês



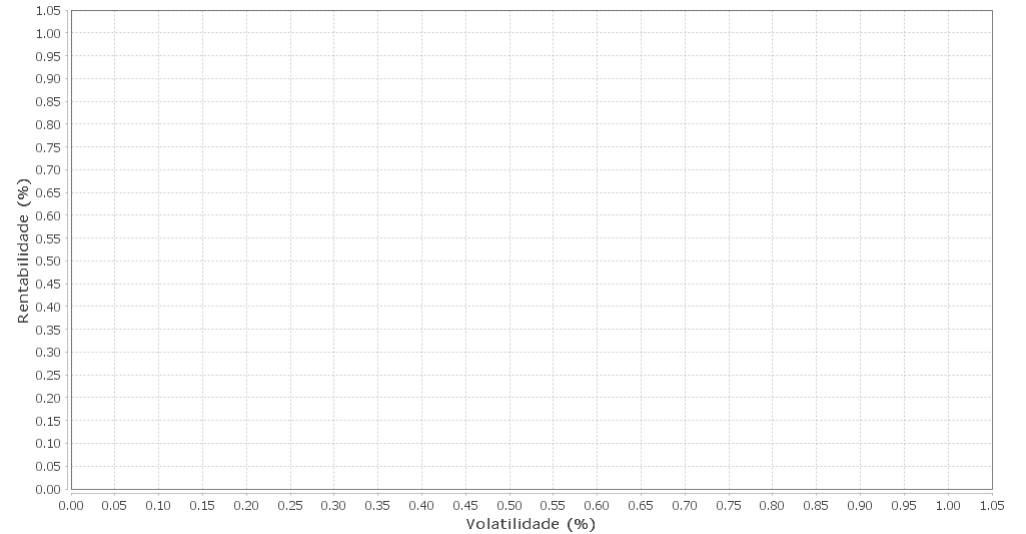
Renda Fixa - No Mês



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\$): 8.519.691,81

Value-At-Risk: 5,83%

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	-1,10	0,32	944.718,68	0,65
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	Artigo 7º VII, Alínea b	0,14	0,06	0,00	-0,76	0,23	1.654.925,94	1,13
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	Artigo 7º IV, Alínea a	0,38	0,11	-0,00	-0,87	0,01	751.293,89	0,51
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,77	0,02	0,00	0,25	0,53	17.867.411,70	12,23
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	2,91	0,93	0,01	-0,06	0,15	2.387.112,63	1,63
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	11,57	1,67	0,10	-0,15	-1,45	10.921.771,14	7,48
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	Artigo 7º IV, Alínea a	15,51	2,17	0,18	-0,14	-1,78	14.732.938,39	10,09
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	16,96	2,05	0,16	-0,14	-2,10	11.981.152,67	8,20
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	34,99	4,05	0,10	-0,21	-6,98	3.827.830,12	2,62
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	35,19	4,07	0,83	-0,21	-7,10	31.627.825,02	21,65
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	37,06	7,21	0,08	-0,19	-6,82	1.717.765,00	1,18
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	41,23	4,73	0,21	-0,16	-6,12	7.011.308,50	4,80
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	Artigo 7º I, Alínea b	53,05	7,68	0,29	-0,21	-10,98	5.806.034,66	3,98
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	53,55	7,89	0,61	-0,21	-10,91	12.146.216,47	8,32
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	Artigo 7º IV, Alínea a	54,07	7,48	0,15	-0,22	-11,33	3.062.596,42	2,10
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	85,06	19,17	0,83	-0,18	-14,56	7.164.835,49	4,91
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	113,63	26,26	0,44	-0,27	-29,79	2.554.549,12	1,75
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	115,87	30,30	0,49	-0,24	-27,45	2.439.007,78	1,67
AZ QUEST ACOES FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	126,71	28,66	0,12	-0,28	-35,44	639.689,21	0,44
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	128,91	27,81	0,59	-0,31	-39,40	3.297.879,12	2,26
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	129,09	28,98	0,66	-0,25	-31,71	3.520.747,66	2,41

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

Observar que no respectivo mês, março de 2020:

- O Instituto possui 21,65% dos seus recursos alocados no fundo FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO, percentual este superior ao permitido pela Resolução 3.922 de 25 de novembro de 2010.