



**LDB**  
EMPRESAS

**SÃO VICENTE**  
DEZEMBRO 2019



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

76,72%

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	4,94	1,97	22,64	4.086.669,07	3,06	6.490.168.573,84	0,06
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,95	1,99	22,59	24.987.454,41	18,72	6.698.026.543,95	0,37
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,25	0,30	6,44	0,00	0,00	10.910.469.036,62	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,07	0,26	11,61	0,00	0,00	1.431.995.533,36	0,00
ITAU	ITAU	ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	7,34	2,58	29,79	6.501.828,29	4,87	95.836.265,75	6,78
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7,34	2,56	29,73	13.599.065,23	10,19	2.752.338.613,28	0,49
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,50	1,10	11,19	9.035.928,43	6,77	8.750.821.084,96	0,10
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,37	0,96	13,07	12.123.855,23	9,08	9.800.245.404,11	0,12
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	5,12	1,10	23,20	1.850.265,00	1,39	68.114.289,84	2,72
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>3,66</b>	<b>1,84</b>	<b>17,89</b>	<b>72.185.065,66</b>	<b>54,07</b>		

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	0,05	0,37	5,83	746.615,37	0,56	4.945.222.995,17	0,02
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	5,36	2,05	5,96	6.285.406,85	4,71	328.797.143,11	1,91
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,04	0,36	3,77	51.960,95	0,04	13.085.747.310,25	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06	0,02	0,02	0,00	0,00	4.527.790.510,67	0,00
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	7,37	2,60	29,91	3.444.814,81	2,58	346.153.866,09	1,00
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,07	1,23	12,92	14.820.153,27	11,10	834.237.998,50	1,78
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	2,01	0,34	2,64	3.239.508,28	2,43	5.156.074.278,85	0,06
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>2,74</b>	<b>1,45</b>	<b>15,12</b>	<b>28.588.459,53</b>	<b>21,42</b>		

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	0,08	0,29	5,67	1.640.598,84	1,23	1.570.120.635,13	0,10
<b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b</b>			<b>0,08</b>	<b>0,29</b>	<b>5,67</b>	<b>1.640.598,84</b>	<b>1,23</b>		
Renda Fixa			3,43	1,70	17,28	102.414.124,03	76,72		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

23,28%

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	17,02	7,23	23,60	3.772.758,73	2,83	2.952.097.775,20	0,13
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST ACOES FIC FIA	18,48	7,53	28,60	1.040.622,51	0,78	992.713.892,80	0,10
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	15,88	13,14	58,00	5.804.359,13	4,35	447.002.800,14	1,30
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	16,60	7,19	39,23	5.441.037,55	4,08	1.723.423.208,96	0,32
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	13,99	6,70	41,91	3.938.212,48	2,95	339.460.454,72	1,16
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>15,23</b>	<b>8,79</b>	<b>42,30</b>	<b>19.996.990,40</b>	<b>14,98</b>		

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	0,85	0,61	6,46	2.372.510,98	1,78	1.477.358.397,29	0,16
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	12,73	3,12	31,99	8.709.766,33	6,52	402.673.499,26	2,16
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>5,65</b>	<b>2,57</b>	<b>17,29</b>	<b>11.082.277,31</b>	<b>8,30</b>		
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>			<b>12,04</b>	<b>6,44</b>	<b>34,24</b>	<b>31.079.267,71</b>	<b>23,28</b>		
<b>Total</b>			<b>4,05</b>	<b>2,74</b>	<b>19,95</b>	<b>133.493.391,74</b>	<b>100,00</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			
				Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>							
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	72.185.065,66	54,07	0,00	60,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	28.588.459,53	21,42	0,00	10,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	1.640.598,84	1,23	0,00	2,00	5,00	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>102.414.124,03</b>	<b>76,72</b>				100,00
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	19.996.990,40	14,98	0,00	10,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	11.082.277,31	8,30	0,00	3,00	10,00	10,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>31.079.267,71</b>	<b>23,28</b>				30,00

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Rentabilidades por Artigo**

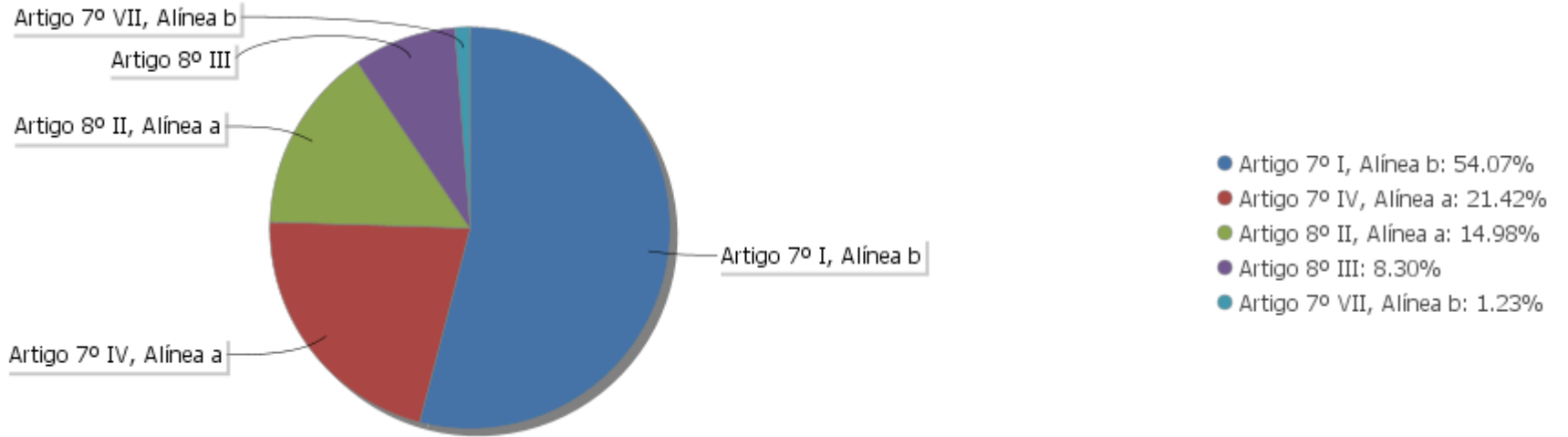
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,84 490,34	17,89 300,17	2,59 209,15	5,82 207,86	17,89 300,17	1.307.170,66	12.762.680,89
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	1,45 385,88	15,12 253,65	2,53 204,29	5,53 197,49	15,12 253,65	409.443,10	2.700.046,71
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,29 76,25	5,67 95,10	1,05 84,98	2,62 93,57	5,67 95,10	4.674,21	11.597,50
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,79 1,94	42,30 10,72	13,01 2,60	20,23 5,70	42,30 10,72	1.576.739,47	4.580.805,60
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	2,57 -4,27	17,29 -14,30	6,56 -3,85	8,57 -5,96	17,29 -14,30	278.169,43	844.972,55
<b>SÃO VICENTE - CONSOLIDADO (Total)</b>						<b>3.576.196,87</b>	<b>20.900.103,25</b>

**Análise de Liquidez**

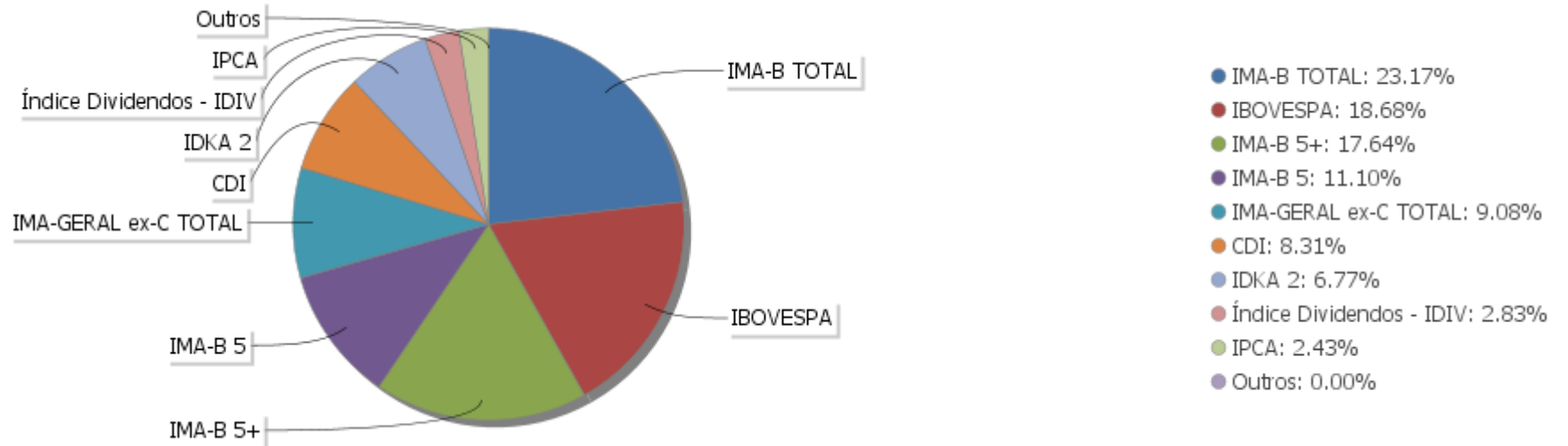
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	128.052.354,19	95,92	128.052.354,19	95,92
de 31 a 364 dias	5.441.037,55	4,08	133.493.391,74	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	133.493.391,74	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



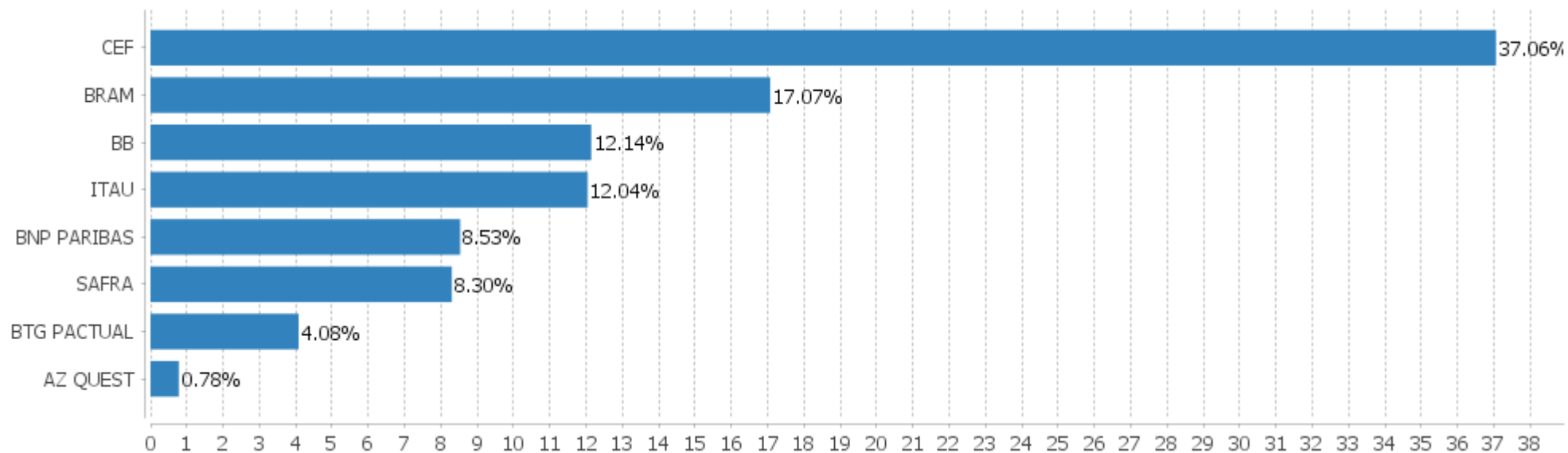
Alocação Por Estratégia





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
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

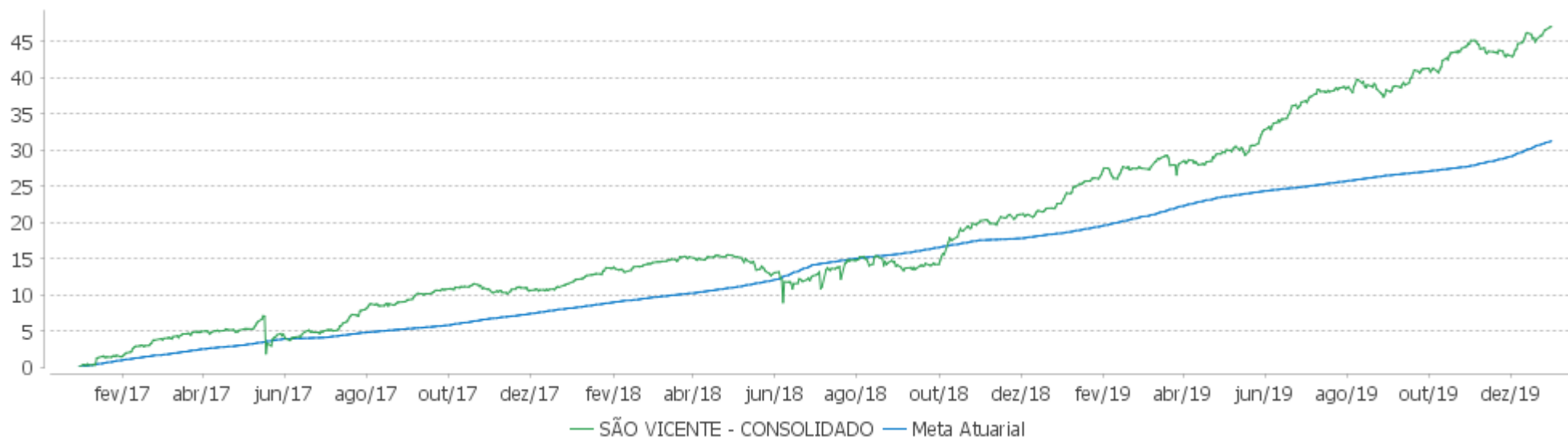
**PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL**

**RELATÓRIO TRIMESTRAL**

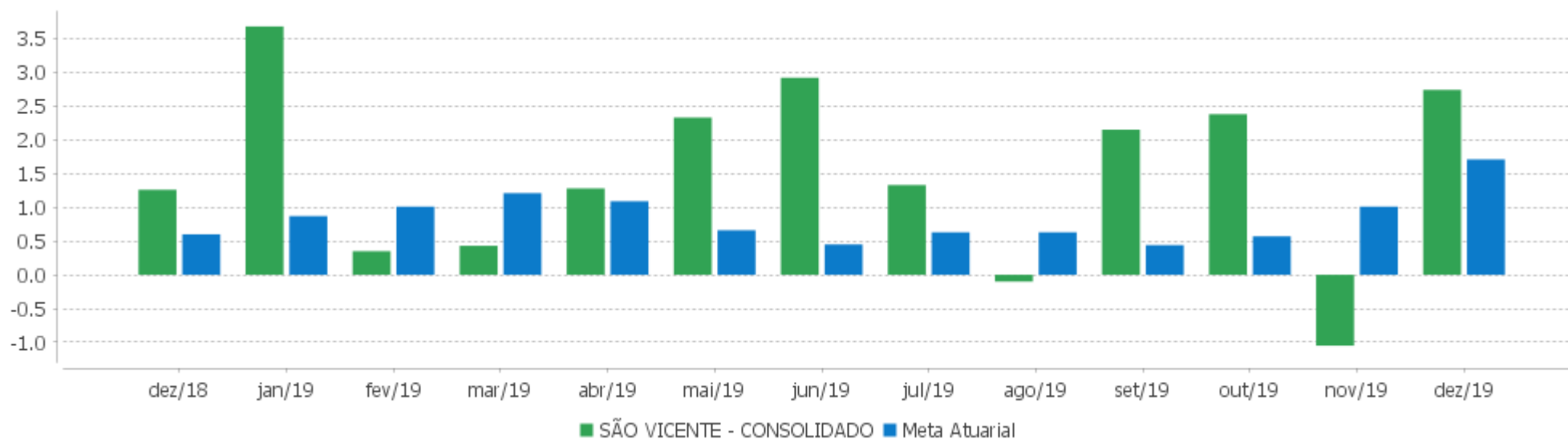
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	22	61,11	03 meses	4,08	3,33	0,76	3,83
Meses abaixo da Meta Atuarial	14	38,89	06 meses	7,63	5,09	2,54	3,81
			12 meses	19,95	10,78	9,17	4,05
			24 meses	31,89	21,40	10,49	5,46
Maior rentabilidade da Carteira	5,08	2018-10	36 meses	47,06	31,25	15,81	5,59
Menor rentabilidade da Carteira	-2,24	2018-05	Desde 30/12/2016	47,06	31,25	15,81	5,59

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
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	1,23 -0,01	12,92 -0,23	2,54 -0,08	5,35 -0,12	12,92 -0,23	23,79 -0,53	39,46 -0,50
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,37 97,88	5,83 97,87	1,16 93,85	2,70 96,58	5,83 97,87	12,53 98,19	24,18 100,95
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	2,05 545,87	24,47 410,62	2,79 224,93	7,08 252,84	24,47 410,62	40,22 315,12	57,40 239,59
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,35 93,90	5,72 95,89	1,11 89,85	2,62 93,73	5,72 95,89	12,30 96,38	23,46 97,95
ITAÚ SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI % do CDI	0,36 97,02	5,81 97,49	1,20 97,18	2,73 97,45	5,81 97,49	12,44 97,44	23,56 98,35
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+ Var. IMA-B 5+ p.p.	2,60 -0,01	29,91 -0,46	2,99 -0,02	7,47 -0,17	29,91 -0,46	49,45 -1,00	67,97 -1,67
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,34 -0,81	11,91 7,61	1,19 -0,57	3,28 1,25	11,91 7,61	21,11 12,90	36,70 25,30
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,99 -0,02	22,59 -0,36	2,70 -0,15	6,52 -0,20	22,59 -0,36	38,33 -0,68	55,69 -1,10
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,10 -0,91	23,20 0,25	1,74 -1,11	5,92 -0,80	23,20 0,25	39,99 0,99	49,07 -7,72
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,96 0,05	13,07 0,44	1,81 -0,09	4,48 -0,06	13,07 0,44	24,27 0,61	39,50 -0,09
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,10 -0,10	11,19 -0,63	2,40 -0,06	4,92 -0,33	11,19 -0,63	21,53 -1,20	36,53 -2,90
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,97 -0,03	22,64 -0,31	2,78 -0,07	6,61 -0,11	22,64 -0,31	38,29 -0,71	55,61 -1,18
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,40 -0,02	6,55 -0,21	1,33 -0,05	3,22 -0,11	6,55 -0,21	13,80 -0,40	26,25 -0,66
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,90 0,01	12,33 -0,49	1,85 -0,05	4,41 -0,15	12,33 -0,49	23,15 -0,99	38,65 -1,40
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	2,56 -0,05	29,73 -0,63	2,85 -0,17	7,41 -0,23	29,73 -0,63	49,17 -1,29	67,72 -1,92
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI Var. IMA-B 5+ p.p.	2,58 -0,03	29,79 -0,57	2,94 -0,08	7,44 -0,19	29,79 -0,57	48,89 -1,57	66,98 -2,65
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	0,29	5,67	1,05	2,62	5,67	12,23	23,45

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	76,25	95,10	84,98	93,57	95,10	95,82	97,89
<b>BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA</b> Var. IBOVESPA p.p.	<b>7,19</b> 0,34	<b>39,23</b> 7,65	<b>9,97</b> -0,44	<b>18,71</b> 4,17	<b>39,23</b> 7,65	<b>68,43</b> 17,06	
<b>BRADESCO FIA DIVIDENDOS</b> Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	<b>7,23</b> -2,75	<b>23,60</b> -21,56	<b>8,78</b> -5,50	<b>10,09</b> -12,24	<b>23,60</b> -21,56	<b>49,77</b> -18,55	<b>96,01</b> -14,88
<b>BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES</b> Var. IBOVESPA p.p.	<b>6,70</b> -0,15	<b>41,91</b> 10,33	<b>10,08</b> -0,32	<b>14,72</b> 0,18	<b>41,91</b> 10,33	<b>44,59</b> -6,77	<b>69,67</b> -22,35
<b>AZ QUEST ACOES FIC FIA</b> Var. IBOVESPA p.p.	<b>7,53</b> 0,69	<b>28,60</b> -2,98	<b>9,30</b> -1,11	<b>16,94</b> 2,40	<b>28,60</b> -2,98	<b>62,19</b> 10,82	<b>102,00</b> 9,98
<b>BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES</b> Var. IBOVESPA p.p.	<b>13,14</b> 6,29	<b>58,00</b> 26,42	<b>21,00</b> 10,59	<b>33,01</b> 18,47	<b>58,00</b> 26,42	<b>59,01</b> 7,64	<b>130,45</b> 38,43
<b>SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO</b> % do CDI	<b>0,61</b> 163,28	<b>6,46</b> 108,33	<b>1,44</b> 116,06	<b>3,15</b> 112,47	<b>6,46</b> 108,33	<b>12,66</b> 99,22	<b>25,13</b> 104,89
<b>SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO</b> Var. IBOVESPA p.p.	<b>2,63</b> -4,22	<b>31,99</b> 0,41	<b>8,77</b> -1,64	<b>11,11</b> -3,43	<b>31,99</b> 0,41	<b>28,57</b> -22,79	<b>67,32</b> -24,70
<b>SÃO VICENTE - CONSOLIDADO</b> Var. INPC + 6% p.p.	<b>2,74</b> 1,03	<b>19,95</b> 9,17	<b>4,08</b> 0,76	<b>7,63</b> 2,54	<b>19,95</b> 9,17	<b>31,89</b> 10,49	<b>47,06</b> 15,81
CDI	0,37	5,96	1,24	2,80	5,96	12,76	23,96
IBOVESPA	6,85	31,58	10,41	14,54	31,58	51,36	92,02
INPC + 6%	1,71	10,78	3,33	5,09	10,78	21,40	31,25
IPCA + 6%	1,64	10,59	3,28	5,15	10,59	21,56	32,56

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**
**Indexadores**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
<b>Renda Fixa</b>							
IRF-M 1	0,42	6,76	1,38	3,33	6,76	14,21	26,90
IRF-M 1+	0,72	14,24	2,10	5,44	14,24	28,25	49,63
IRF-M TOTAL	0,62	12,03	1,86	4,72	12,03	24,05	42,91
IMA-B 5	1,24	13,15	2,62	5,47	13,15	24,32	39,95
IMA-B 5+	2,60	30,37	3,02	7,64	30,37	50,45	69,64
IMA-B TOTAL	2,01	22,95	2,85	6,72	22,95	39,01	56,79
IMA-C TOTAL	0,40	19,41	1,84	5,35	19,41	41,36	56,88
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,91	12,63	1,90	4,54	12,63	23,66	39,60
IMA-GERAL TOTAL	0,90	12,82	1,90	4,56	12,82	24,14	40,06
IDKA 2	1,20	11,82	2,46	5,25	11,82	22,73	39,44
IDKA 20	3,94	44,26	3,32	8,71	44,26	73,70	94,85
CDI	0,37	5,96	1,24	2,80	5,96	12,76	23,96
<b>Renda Variável</b>							
IBOVESPA	6,85	31,58	10,41	14,54	31,58	51,36	92,02
IBRX 100	7,27	33,39	10,70	15,40	33,39	53,96	96,37
IBRX 50	6,56	29,15	9,81	13,17	29,15	47,91	87,58
SMALL CAP	12,65	58,20	21,15	32,65	58,20	71,06	155,48
IFIX	10,63	35,98	19,12	21,76	35,98	43,62	71,49
Índice Consumo - ICON	8,03	55,25	9,06	27,92	55,25	40,39	86,91
Índice Dividendos - IDIV	9,99	45,16	14,28	22,33	45,16	68,32	110,90
<b>Indicadores Econômicos</b>							
IPCA	1,15	4,31	1,77	2,03	4,31	8,21	11,40
INPC	1,22	4,48	1,81	1,98	4,48	8,07	10,30
IGPM	2,09	7,30	3,09	2,80	7,30	15,39	14,79
SELIC	0,37	5,96	1,24	2,80	5,96	12,77	23,98
<b>Meta Atuarial</b>							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
75	02/12/2019	BRASESCO FIA DIVIDENDOS	1.000.000,00	0,00	86.739,19028670	11,5288141000
76	02/12/2019	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	1.400.000,00	0,00	327.403,60197300	4,2760678000
77	02/12/2019	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	940.998,62	0,00	276.158,45707900	3,4074590000
129	02/12/2019	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	941.155,87	258.628,36724532	3,6390280000
79	04/12/2019	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	13.868,54	0,00	292,06040000	47,4851790000
80	04/12/2019	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	156.995,39	0,00	3.306,19771000	47,4851790000
81	06/12/2019	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	31.414,58	0,00	661,32792000	47,5022740000
82	10/12/2019	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	66.054,56	0,00	3.777,58476000	17,4859240000
83	10/12/2019	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	37.913,02	797,83173000	47,5200710000
84	13/12/2019	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	913.953,59	0,00	19.222,76986000	47,5453640000
85	16/12/2019	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	491.629,87	10.338,52294531	47,5532020000
86	17/12/2019	AZ QUEST ACOES FIC FIA	712.514,87	0,00	50.145,48573290	14,2089534000
87	17/12/2019	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1.081.259,69	0,00	61.785,72076000	17,5001550000
88	17/12/2019	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	1.422.346,08	29.905,69131674	47,5610500000
89	18/12/2019	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	150.328,16	8.588,77742000	17,5028590000
90	18/12/2019	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	393.465,32	0,00	8.271,48973000	47,5688580000
91	19/12/2019	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	150.328,16	0,00	3.159,70208000	47,5766880000
92	19/12/2019	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	4.060,00	1.841,49273300	2,2047330000
93	20/12/2019	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	500.000,00	10.507,61843000	47,5845220000
94	20/12/2019	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	6.868,65	3.109,95791000	2,2085990000
95	20/12/2019	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	66.106,82	23.404,96070249	2,8244790000
96	20/12/2019	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	306.845,13	121.819,82446700	2,5188440000
97	23/12/2019	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	350.844,27	0,00	7.371,85977000	47,5923690000
98	27/12/2019	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	82.300,00	0,00	4.697,71704000	17,5191480000
99	27/12/2019	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	537.990,00	11.298,53885000	47,6158920000
100	27/12/2019	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	136.364,19	61.570,19495200	2,2147760000
101	30/12/2019	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	421.906,15	8.859,15523863	47,6237450000
102	30/12/2019	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	51.952,39	0,00	1.090,89258000	47,6237450000

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

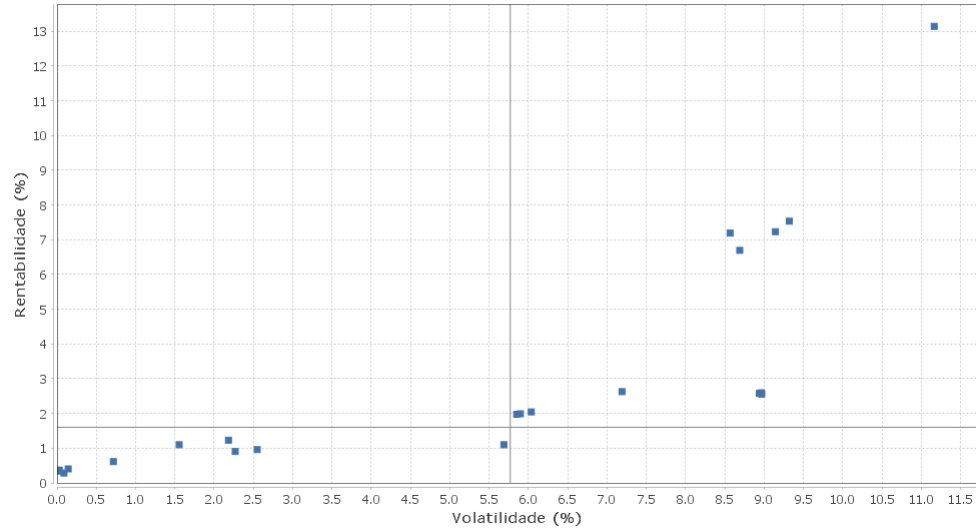
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
<b>Total</b>						



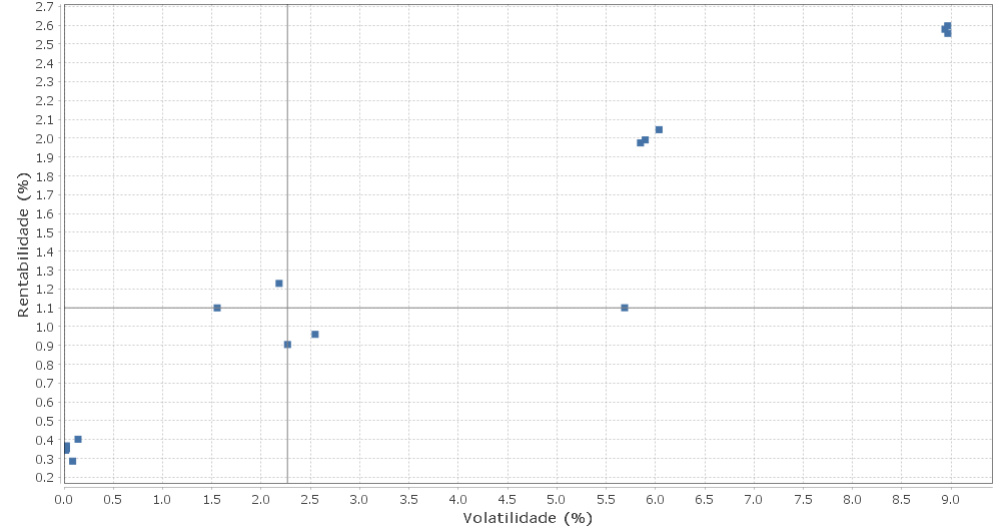
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

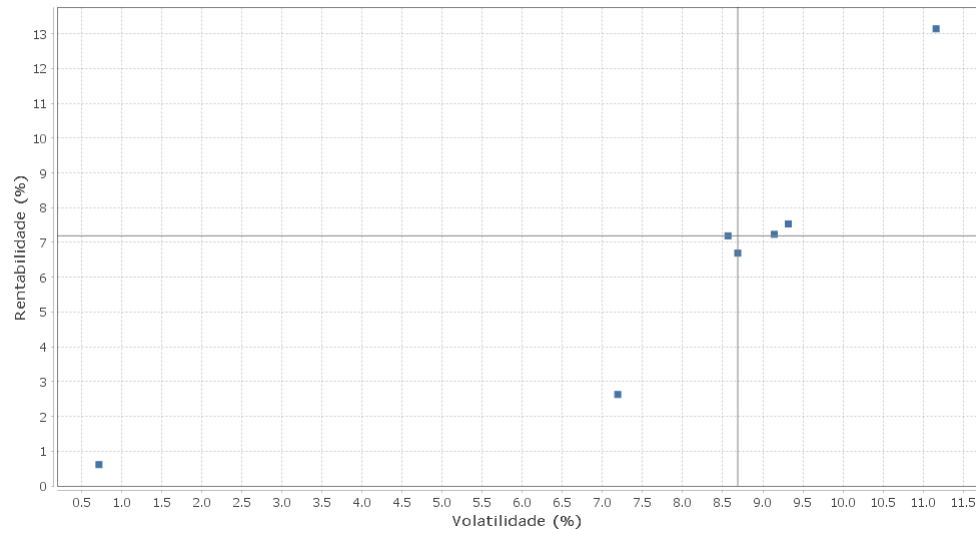
SÃO VICENTE - CONSOLIDADO - No Mês



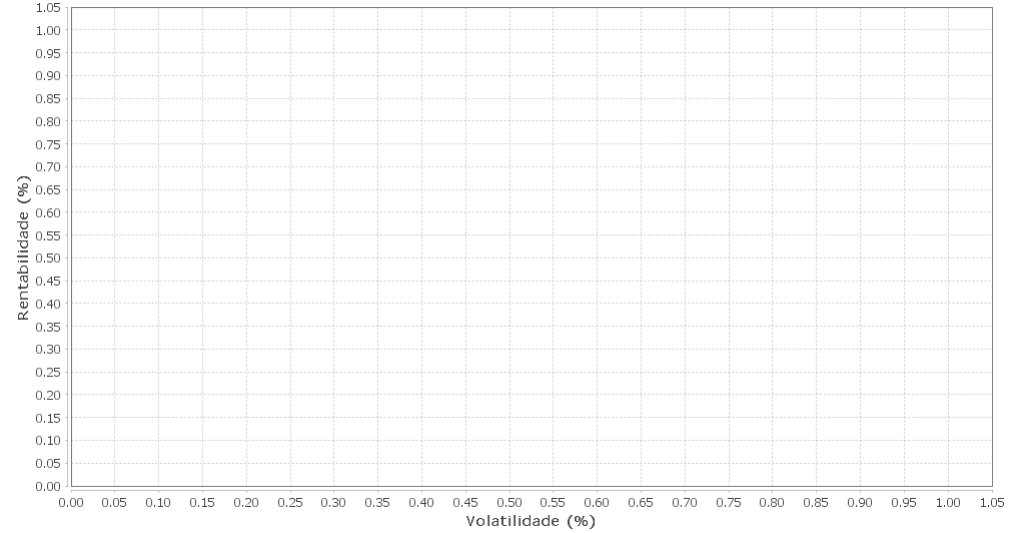
Renda Fixa - No Mês



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\$): 3.253.147,58

Value-At-Risk: 2,44%

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	-0,72	0,36	51.960,95	0,04
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,28	0,00	-1,93	0,34	3.239.508,28	2,43
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,02	0,00	-0,32	0,37	746.615,37	0,56
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	NaN	0,00	-0,89	0,35	0,00	0,00
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	Artigo 7º VII, Alínea b	0,09	0,03	0,00	-1,02	0,29	1.640.598,84	1,23
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,14	NaN	0,00	0,20	0,40	0,00	0,00
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	0,72	0,45	0,01	0,33	0,61	2.372.510,98	1,78
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,55	0,65	0,03	0,47	1,10	9.035.928,43	6,77
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	Artigo 7º IV, Alínea a	2,18	0,91	0,08	0,39	1,23	14.820.153,27	11,10
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,27	NaN	0,00	0,23	0,90	0,00	0,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,55	1,08	0,08	0,23	0,96	12.123.855,23	9,08
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	5,69	2,46	0,03	0,13	1,10	1.850.265,00	1,39
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	5,85	2,27	0,06	0,27	1,97	4.086.669,07	3,06
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,90	2,33	0,35	0,27	1,99	24.987.454,41	18,72
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	6,04	2,47	0,09	0,28	2,05	6.285.406,85	4,71
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	7,19	6,61	0,24	0,31	2,63	8.709.766,33	6,52
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	8,57	8,21	0,26	0,80	7,19	5.441.037,55	4,08
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	8,69	7,20	0,16	0,73	6,70	3.938.212,48	2,95
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	Artigo 7º I, Alínea b	8,94	3,53	0,14	0,25	2,58	6.501.828,29	4,87
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	Artigo 7º IV, Alínea a	8,97	3,55	0,07	0,25	2,60	3.444.814,81	2,58
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	8,97	3,59	0,29	0,24	2,56	13.599.065,23	10,19
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	9,14	9,33	0,20	0,75	7,23	3.772.758,73	2,83
AZ QUEST ACOES FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	9,32	8,16	0,05	0,77	7,53	1.040.622,51	0,78
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	11,16	8,96	0,29	1,14	13,14	5.804.359,13	4,35