



LDB
EMPRESAS

SÃO VICENTE
DEZEMBRO 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

77,78%

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	12,74	4,84	6,14	4.337.605,44	2,32	8.693.778.987,76	0,05
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,80	4,84	6,06	30.889.054,44	16,53	6.193.173.925,17	0,50
ITAU	ITAU	ITAU RF IMAB5+ FIC DE FI	19,64	7,44	5,01	6.827.471,39	3,65	87.617.039,38	7,79
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,80	7,56	5,23	14.881.423,31	7,96	1.733.830.686,04	0,86
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,13	1,65	8,03	24.345.283,51	13,03	10.655.087.063,09	0,23
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,27	2,38	5,09	13.450.181,50	7,20	9.568.490.825,39	0,14
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	13,90	5,52	9,32	1.938.139,00	1,04	71.349.252,27	2,72
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			11,99	4,27	5,72	96.669.158,59	51,73		

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	0,26	0,22	2,13	762.506,87	0,41	3.168.557.239,02	0,02
ITAU	ITAU	ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO	14,55	4,94	7,53	8.072.948,62	4,32	637.293.736,31	1,27
ITAU	ITAU	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,19	0,23	2,48	10.000,94	0,01	19.618.291.419,95	0,00
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	19,90	7,45	4,52	3.600.431,37	1,93	221.336.103,46	1,63
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	5,38	1,78	7,86	15.984.344,76	8,55	954.945.016,55	1,67
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	1,66	0,20	2,86	19.184.412,73	10,27	3.882.685.363,65	0,49
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			5,75	1,94	5,09	47.614.645,29	25,48		

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	0,42	0,33	1,71	1.063.486,35	0,57	750.232.037,12	0,14
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			0,42	0,33	1,71	1.063.486,35	0,57		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

9,62

3,45

5,44

145.347.290,23

77,78

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

22,22%

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	BRADESCO	BRADESCO FIA DIVIDENDOS	42,00	9,43	-5,65	3.559.698,40	1,90	1.837.636.759,23	0,19
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST ACOES FIC FIA	45,64	7,67	-3,87	1.000.392,44	0,54	812.622.043,38	0,12
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	47,91	8,50	-2,65	8.093.882,17	4,33	655.833.944,65	1,23
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	46,05	5,23	7,88	7.556.030,91	4,04	2.636.774.357,29	0,29
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	41,85	8,55	2,60	4.646.277,54	2,49	323.099.492,65	1,44
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	42,06	7,31	7,31	536.531,42	0,29	1.060.739.165,08	0,05
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FIA	40,15	5,40	5,40	526.993,73	0,28	268.718.538,49	0,20
SCHRODER	SICREDI	SICREDI SCHRODERS IBOVSPA - FIA	43,82	6,39	6,39	531.967,24	0,28	453.757.066,39	0,12
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			44,10	7,64	0,73	26.451.773,85	14,15		

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	1,36	0,76	3,08	2.445.504,48	1,31	886.261.045,44	0,28
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	32,77	3,07	12,58	12.629.534,57	6,76	734.034.454,86	1,72
Sub-total Artigo 8º III			25,25	2,67	11,03	15.075.039,05	8,07		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			34,91	5,79	4,49	41.526.812,90	22,22		
Total			12,87	3,94	5,49	186.874.103,13	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	96.669.158,59	51,73	0,00	60,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	47.614.645,29	25,48	0,00	10,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	1.063.486,35	0,57	0,00	0,00	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	145.347.290,23	77,78				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	26.451.773,85	14,15	0,00	20,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	15.075.039,05	8,07	0,00	10,00	10,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	41.526.812,90	22,22				30,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

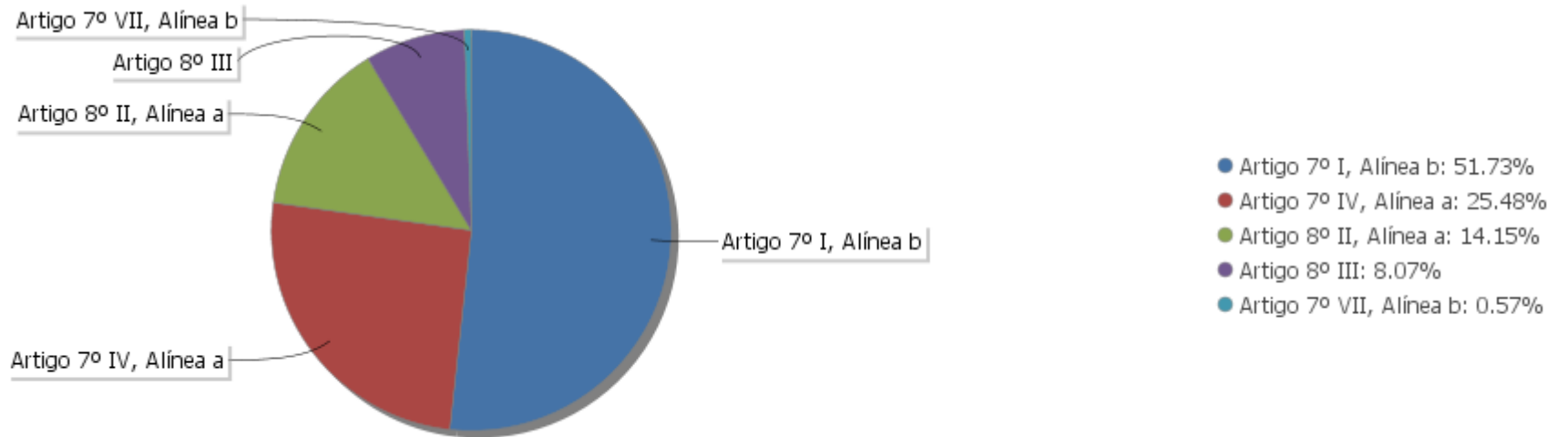
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	4,27 2.598,88	5,72 207,24	6,27 1.329,57	7,30 740,44	5,72 207,24	3.958.571,99	5.107.686,31
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	1,94 1.182,37	5,09 184,50	3,02 640,78	3,70 375,54	5,09 184,50	951.379,38	2.415.587,23
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,33 202,06	1,71 62,18	0,60 126,20	0,83 84,31	1,71 62,18	3.522,17	22.887,51
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	7,64 -1,66	0,73 -2,19	19,43 -6,38	21,18 -4,03	0,73 -2,19	1.849.821,82	875.950,04
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	2,67 -6,63	11,03 8,11	9,54 -16,27	16,01 -9,20	11,03 8,11	377.202,12	1.472.653,39
SÃO VICENTE - CONSOLIDADO (Total)						7.140.497,48	9.894.764,48

Análise de Liquidez

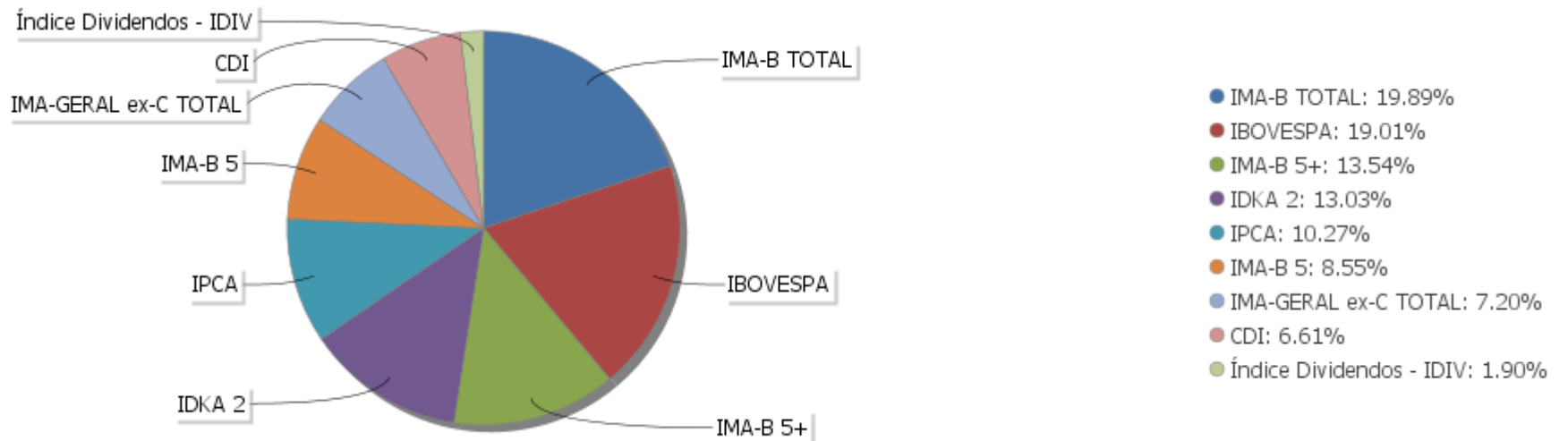
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	178.791.078,49	95,67	178.791.078,49	95,67
de 31 a 364 dias	8.083.024,64	4,33	186.874.103,13	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	186.874.103,13	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

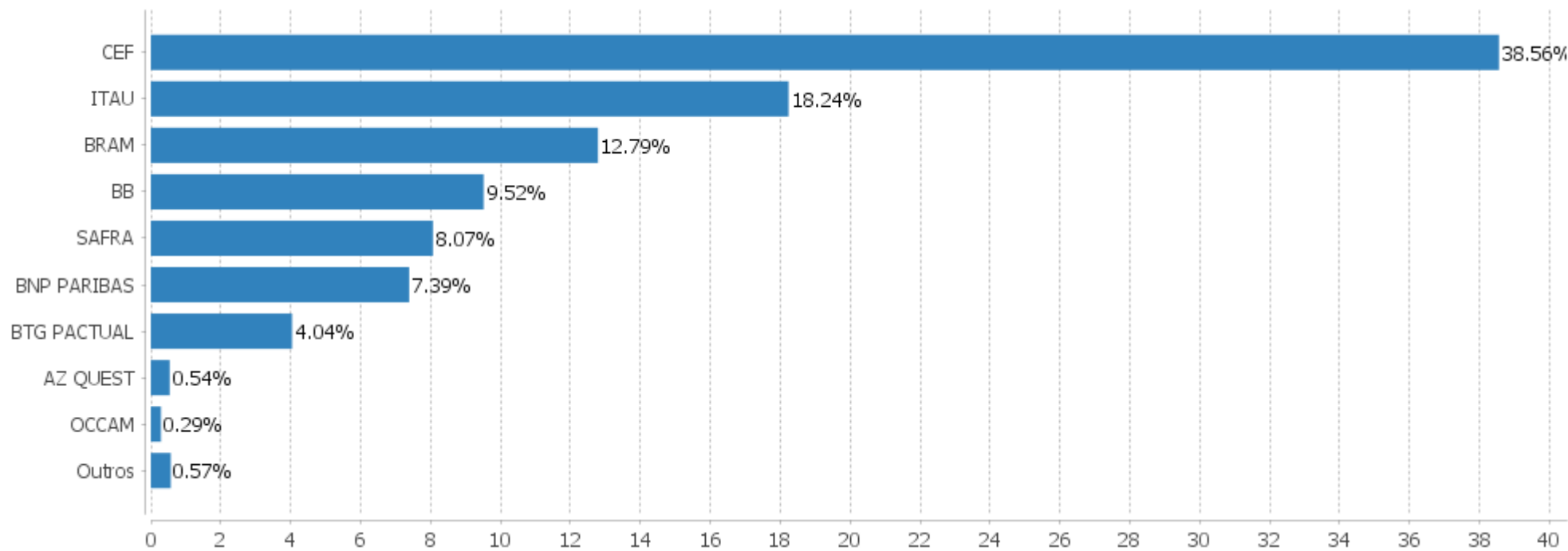


Alocação Por Estratégia



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	2,34	3,92	-0,89	-1,68	-0,23	3,36	3,94	5,49
INPC + 6%	0,70	0,59	0,69	0,23	0,21	0,79	0,98	0,85	1,36	1,38	1,42	1,98	11,75
p.p. indexador	-0,34	-1,61	-9,40	2,27	1,94	1,55	2,94	-1,74	-3,04	-1,62	1,94	1,96	-6,26
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

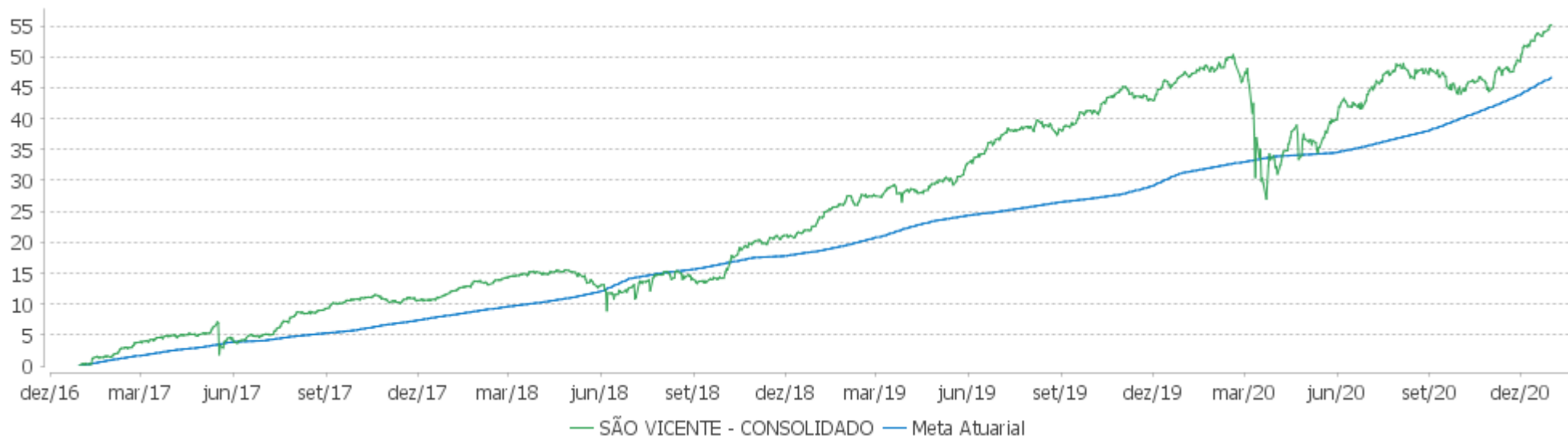
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

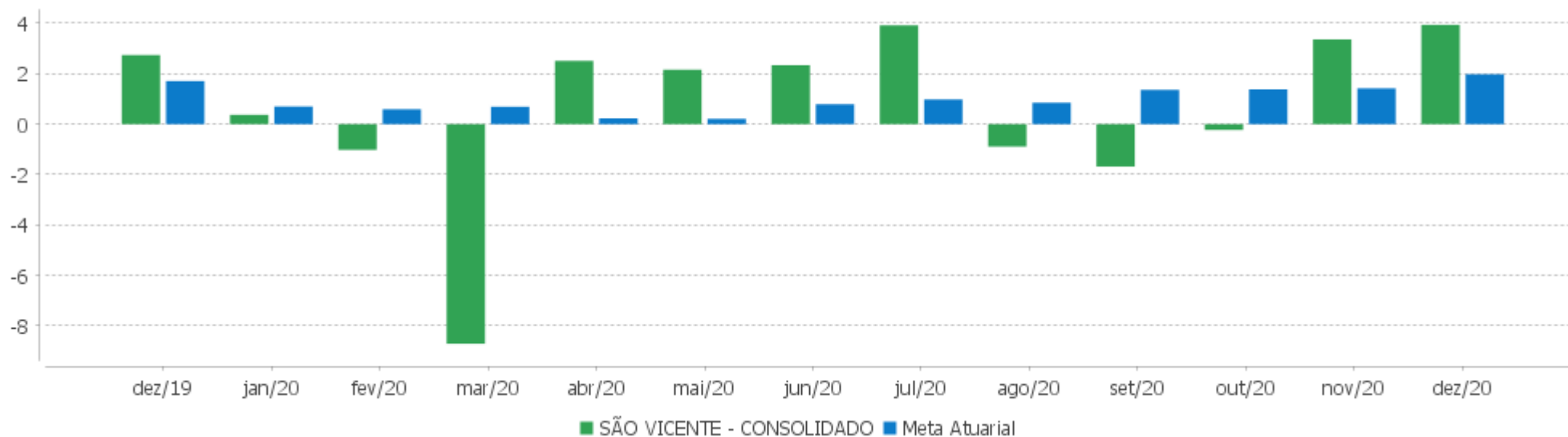
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	28	58,33	03 meses	7,18	4,85	2,33	5,11
Meses abaixo da Meta Atuarial	20	41,67	06 meses	8,54	8,23	0,31	5,83
			12 meses	5,49	11,75	-6,26	12,87
			24 meses	26,54	23,79	2,75	9,53
Maior rentabilidade da Carteira	5,08	2018-10	36 meses	39,14	35,66	3,47	8,66
Menor rentabilidade da Carteira	-8,71	2020-03	Desde 30/12/2016	55,14	46,67	8,47	8,05

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	0,33 202,06	1,71 62,18	0,60 126,20	0,83 84,31	1,71 62,18	7,48 84,21	14,16 89,17
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	1,78 -0,05	7,86 -0,18	3,23 -0,15	4,48 -0,24	7,86 -0,18	21,79 -0,46	33,51 -0,80
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,22 131,32	2,13 77,18	0,41 86,73	0,96 97,61	2,13 77,18	8,09 91,03	14,93 94,04
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	4,94 3.002,88	7,53 273,00	7,12 1.509,22	7,89 800,58	7,53 273,00	33,84 381,04	50,78 319,89
ITAÚ SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI % do CDI	0,23 138,02	2,48 89,88	0,45 96,03	0,80 80,75	2,48 89,88	8,43 94,95	15,22 95,91
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+ Var. IMA-B 5+ p.p.	7,45 -0,06	4,52 -0,98	10,37 -0,16	11,08 -0,28	4,52 -0,98	35,78 -1,76	56,20 -2,52
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,20 -1,15	2,86 -1,66	0,38 -2,75	0,58 -3,83	2,86 -1,66	15,12 6,10	24,58 11,47
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,84 -0,01	6,06 -0,34	7,13 -0,04	8,09 -0,12	6,06 -0,34	30,02 -0,81	46,71 -1,20
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	5,52 0,67	9,32 2,91	8,24 1,06	8,47 0,27	9,32 2,91	34,68 3,85	53,04 5,13
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	2,38 0,26	5,09 0,24	3,17 0,34	3,28 0,19	5,09 0,24	18,83 0,74	30,59 0,94
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,65 -0,08	8,03 -0,59	3,05 0,00	4,76 -0,34	8,03 -0,59	20,12 -1,34	31,29 -2,02
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,84 -0,02	6,14 -0,27	7,13 -0,04	8,03 -0,18	6,14 -0,27	30,17 -0,66	46,78 -1,13
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	7,56 0,05	5,23 -0,26	10,56 0,03	11,28 -0,08	5,23 -0,26	36,52 -1,01	56,97 -1,75
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI Var. IMA-B 5+ p.p.	7,44 -0,07	5,01 -0,49	10,41 -0,12	11,16 -0,20	5,01 -0,49	36,30 -1,24	56,34 -2,38
BRADERCO FIA DIVIDENDOS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	9,43 0,49	-5,65 -4,65	25,79 0,35	21,37 0,08	-5,65 -4,65	16,62 -27,09	41,31 -25,32
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,23 -4,06	7,88 4,96	12,39 -13,42	17,68 -7,53	7,88 4,96	50,20 14,78	81,69 25,92
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	8,55	2,60	22,63	21,85	2,60	45,60	48,36

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.	-0,74	-0,31	-3,17	-3,36	-0,31	10,18	-7,42
AZ QUEST ACOES FIC FIA	7,67	-3,87	16,78	16,90	-3,87	23,63	55,92
Var. IBOVESPA p.p.	-1,63	-6,78	-9,02	-8,31	-6,78	-11,79	0,14
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FIA	7,95	-9,41	20,13	13,28	-9,41		
Var. IBOVESPA p.p.	-1,35	-12,33	-5,68	-11,93	-12,33		
SICREDI SCHROEDERS IBOVESPA - FIA	9,46	3,80	25,26	25,79	3,80	41,09	64,09
Var. IBOVESPA p.p.	0,16	0,88	-0,55	0,58	0,88	5,67	8,31
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	8,50	-2,65	22,21	24,82	-2,65	53,82	54,79
Var. IBOVESPA p.p.	-0,79	-5,57	-3,60	-0,39	-5,57	18,40	-0,98
OCCAM FIC FIA	10,11	7,87	22,82	24,40	7,87	46,10	79,48
Var. IBOVESPA p.p.	0,81	4,95	-2,99	-0,80	4,95	10,68	23,71
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO % do CDI	0,76 464,61	3,08 111,56	1,50 318,49	1,45 146,73	3,08 111,56	9,73 109,56	16,13 101,62
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	3,07	12,58	11,36	19,62	12,58	48,60	44,75
Var. IBOVESPA p.p.	-6,23	9,67	-14,44	-5,59	9,67	13,18	-11,03
SÃO VICENTE - CONSOLIDADO	3,94	5,49	7,18	8,54	5,49	26,54	39,14
Var. INPC + 6% p.p.	1,96	-6,26	2,33	0,31	-6,26	2,75	3,47
CDI	0,16	2,76	0,47	0,99	2,76	8,88	15,87
IBOVESPA	9,30	2,92	25,81	25,21	2,92	35,42	55,78
INPC + 6%	1,98	11,75	4,85	8,23	11,75	23,79	35,66
IPCA + 6%	1,87	10,76	4,64	7,55	10,76	22,49	34,64

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	0,31	3,84	0,70	1,21	3,84	10,86	18,59
IRF-M 1+	3,05	8,45	2,90	2,29	8,45	23,90	39,09
IRF-M TOTAL	1,95	6,69	1,99	1,75	6,69	19,53	32,36
IMA-B 5	1,83	8,04	3,38	4,72	8,04	22,25	34,31
IMA-B 5+	7,51	5,50	10,53	11,36	5,50	37,54	58,72
IMA-B TOTAL	4,85	6,41	7,18	8,21	6,41	30,83	47,91
IMA-C TOTAL	-1,12	22,07	3,64	13,59	22,07	45,76	72,56
IMA-GERAL ex-C TOTAL	2,12	4,85	2,83	3,09	4,85	18,09	29,65
IMA-GERAL TOTAL	2,02	5,34	2,86	3,40	5,34	18,84	30,77
IDKA 2	1,73	8,62	3,05	5,10	8,62	21,46	33,31
IDKA 20	11,36	2,20	15,90	16,58	2,20	47,44	77,53
CDI	0,16	2,76	0,47	0,99	2,76	8,88	15,87
Renda Variável							
IBOVESPA	9,30	2,92	25,81	25,21	2,92	35,42	55,78
IBRX 100	9,15	3,50	25,34	25,28	3,50	38,06	59,35
IBRX 50	9,42	3,62	26,47	26,00	3,62	33,83	53,28
SMALL CAP	7,52	-0,65	22,54	25,33	-0,65	57,16	69,94
IFIX	2,19	-10,24	2,69	2,28	-10,24	22,05	28,91
Índice Consumo - ICON							
Índice Dividendos - IDIV	8,94	-1,00	25,44	21,29	-1,00	43,71	66,63
Indicadores Econômicos							
IPCA	1,35	4,52	3,13	4,42	4,52	9,02	13,10
INPC	1,46	5,45	3,34	5,07	5,45	10,17	13,96
IGPM	0,96	23,14	7,64	17,96	23,14	32,13	42,09
SELIC	0,16	2,76	0,47	0,99	2,76	8,88	15,88
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
258	02/12/2020	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FIA	500.000,00	0,00	528.164,19737581	0,9466753000
280	02/12/2020	OCCAM FIC FIA	500.000,00	0,00	153.254,00395242	3,2625575000
262	02/12/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	83.123,00	0,00	1.706,49382047	48,7098160000
294	02/12/2020	SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	500.000,00	0,00	195.755,85642790	2,5542020000
251	04/12/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	700.000,00	0,00	464.204,17954500	1,5079571250
293	04/12/2020	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	812.704,01	0,00	3.379,51816260	240,4792550000
263	07/12/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	14.106,25	289,52786264	48,7215630000
264	08/12/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	1.426,70	29,27918693	48,7274460000
252	09/12/2020	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.299,29	0,00	1.386,99350705	2,3787350000
254	10/12/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	18.985,14	5.245,49480663	3,6193230000
266	10/12/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	580.000,00	0,00	11.900,58351023	48,7371060000
265	10/12/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	13.764,91	0,00	282,43182925	48,7371060000
260	11/12/2020	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	104.286,68	0,00	9.147,81716871	11,4001710000
259	11/12/2020	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	8.571,77	0,00	751,89837065	11,4001710000
291	11/12/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	63.800,16	0,00	1.308,93052540	48,7422050000
290	11/12/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	16.109,44	0,00	330,50289785	48,7422050000
270	14/12/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	5.444,00	111,67977854	48,7465150000
255	15/12/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	130.314,59	35.748,13035990	3,6453540000
289	15/12/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	97.743,30	2.004,92492544	48,7516010000
271	15/12/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	21.167,20	434,18471529	48,7516010000
261	16/12/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	156,75	8,70406834	18,0088200000
273	16/12/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	22.699,74	465,55341111	48,7586160000
274	17/12/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	60,00	1,23043793	48,7631260000
256	18/12/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	11.346,83	3.106,74755046	3,6523180000
275	18/12/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	1.050.000,00	0,00	21.530,10035159	48,7689320000
282	21/12/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.344,44	0,00	641,90116030	3,6523380000
284	22/12/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	100.000,00	0,00	2.050,02655194	48,7798560000
253	23/12/2020	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	41.399,77	0,00	17.327,43722850	2,3892610000

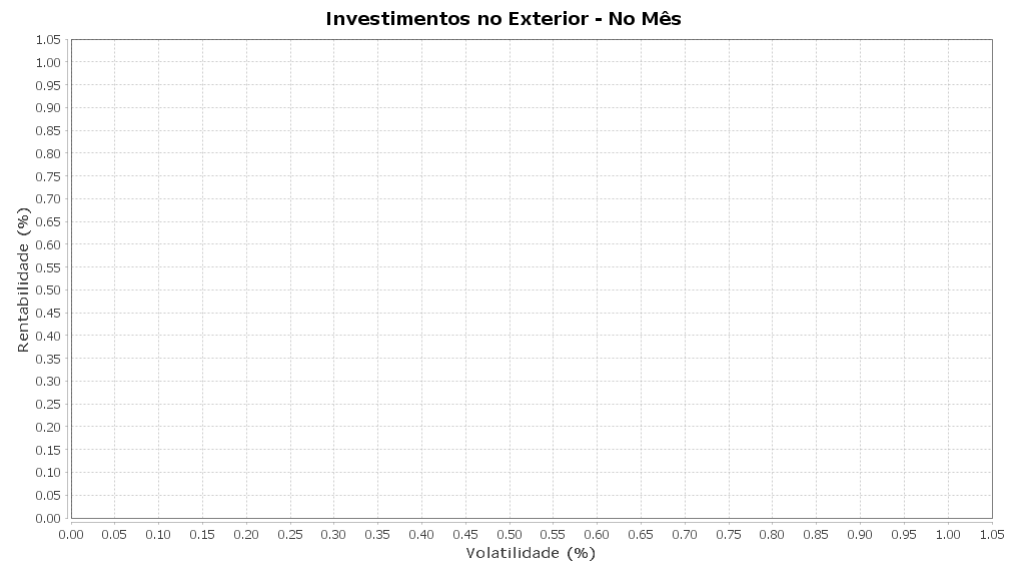
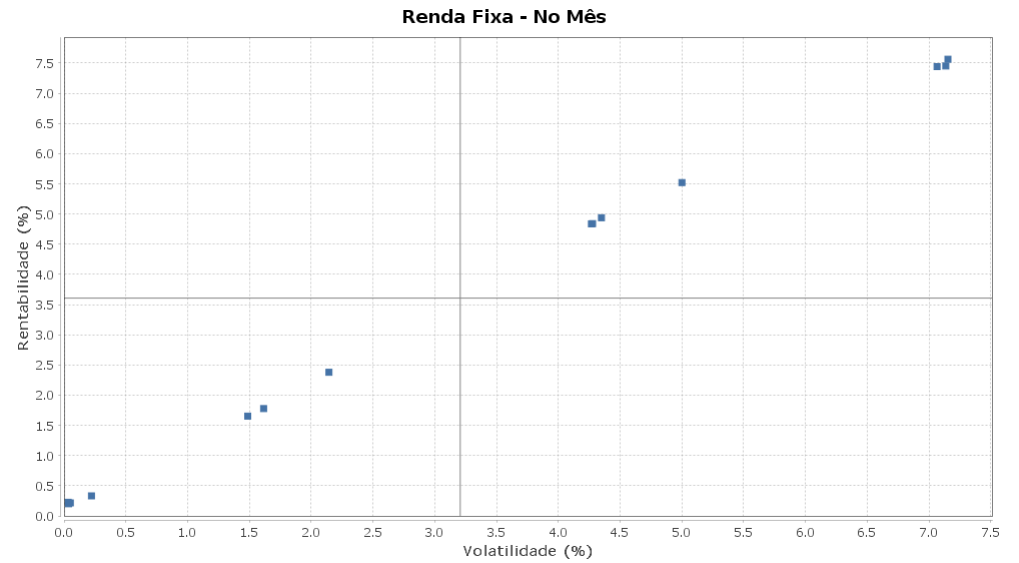
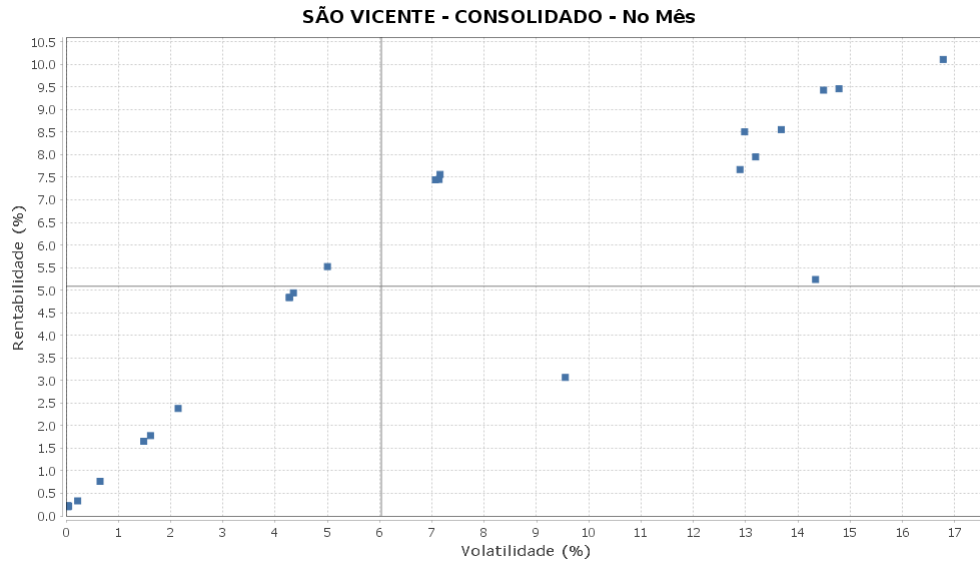
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
288	23/12/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	30.000,00	0,00	614,92539541	48,7864060000
257	29/12/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	136.369,34	37.004,01437294	3,6852580000
286	29/12/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	3.730.718,84	0,00	76.444,95521783	48,8026820000
292	30/12/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	7.132.036,55	146.125,32612447	48,8076690000

Total

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 5.577.766,44

Value-At-Risk: 2,98%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,08	0,00	1,89	0,23	10.000,94	0,01
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,26	0,02	1,02	0,20	19.184.412,73	10,27
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	Artigo 7º IV, Alínea a	0,05	0,04	-0,00	1,02	0,22	762.506,87	0,41
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	Artigo 7º VII, Alínea b	0,22	0,19	0,00	0,76	0,33	1.063.486,35	0,57
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	0,65	0,57	0,01	0,92	0,76	2.445.504,48	1,31
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,49	1,10	0,09	1,00	1,65	24.345.283,51	13,03
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	Artigo 7º IV, Alínea a	1,61	1,11	0,07	1,00	1,78	15.984.344,76	8,55
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,14	1,33	0,08	1,03	2,38	13.450.181,50	7,20
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,27	2,56	0,05	1,09	4,84	4.337.605,44	2,32
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,28	2,57	0,37	1,09	4,84	30.889.054,44	16,53
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	4,35	2,77	0,10	1,10	4,94	8.072.948,62	4,32
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	5,00	2,83	0,02	1,07	5,52	1.938.139,00	1,04
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	Artigo 7º I, Alínea b	7,07	4,58	0,14	1,03	7,44	6.827.471,39	3,65
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	Artigo 7º IV, Alínea a	7,14	4,52	0,07	1,02	7,45	3.600.431,37	1,93
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	7,15	4,57	0,31	1,03	7,56	14.881.423,31	7,96
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	9,55	8,13	0,32	0,30	3,07	12.629.534,57	6,76
AZ QUEST ACOES FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	12,89	11,33	0,05	0,58	7,67	1.000.392,44	0,54
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	12,98	10,58	0,41	0,64	8,50	8.093.882,17	4,33
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FIA	Artigo 8º II, Alínea a	13,19	10,07	0,03	0,59	7,95	526.993,73	0,28
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	13,68	10,83	0,24	0,61	8,55	4.646.277,54	2,49
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	14,34	10,25	0,35	0,35	5,23	7.556.030,91	4,04
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	14,49	11,32	0,18	0,64	9,43	3.559.698,40	1,90
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	Artigo 8º II, Alínea a	14,79	9,64	0,02	0,63	9,46	531.967,24	0,28
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	16,78	11,09	0,03	0,59	10,11	536.531,42	0,29