



LDB
EMPRESAS

SÃO VICENTE
JULHO 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

78,90%

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	12,47	4,36	2,54	4.190.385,18	2,52	5.823.784.558,48	0,07
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,54	4,38	2,42	31.105.179,43	18,72	6.313.416.954,01	0,49
ITAU	ITAU	ITAU RF IMAB5+ FIC DE FI	19,16	7,28	1,35	6.589.303,67	3,97	85.176.700,12	7,74
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,32	7,29	1,46	14.347.851,48	8,63	2.059.270.796,72	0,70
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,02	0,83	3,97	11.685.886,20	7,03	7.954.778.997,85	0,15
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,08	1,77	3,55	12.554.124,03	7,55	10.799.663.748,52	0,12
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	13,52	4,21	5,03	1.902.001,00	1,14	70.018.862,85	2,72
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			11,70	4,16	2,62	82.374.730,99	49,57		

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	0,27	1,42	757.239,59	0,46	3.786.771.901,20	0,02
ITAU	ITAU	ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO	14,27	4,43	4,08	7.702.999,06	4,64	579.735.064,46	1,33
ITAU	ITAU	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,07	0,18	1,85	1.535.577,88	0,92	20.223.830.369,52	0,01
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	19,44	7,33	0,99	3.478.798,59	2,09	277.273.059,94	1,25
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	5,32	0,97	4,24	15.447.996,78	9,30	831.066.921,71	1,86
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	1,64	0,55	2,83	18.755.631,13	11,29	5.186.154.771,17	0,36
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			5,77	1,76	3,12	47.678.243,03	28,69		

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	0,37	0,14	1,02	1.056.246,36	0,64	989.863.583,28	0,11
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			0,37	0,14	1,02	1.056.246,36	0,64		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

9,45

3,24

2,71

131.109.220,38

78,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

21,10%

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	40,82	7,15	-16,70	3.142.689,53	1,89	1.935.501.908,96	0,16
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST ACOES FIC FIA	44,85	8,86	-10,48	931.580,53	0,56	879.154.088,57	0,11
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	47,00	9,06	-14,94	7.072.137,43	4,26	678.995.367,84	1,04
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	45,16	8,38	-0,65	6.958.628,55	4,19	2.366.861.217,15	0,29
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	40,38	7,74	-9,28	4.108.272,92	2,47	288.706.911,09	1,42
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			43,10	8,25	-10,02	22.213.308,96	13,37		

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	0,53	2,15	2.423.487,81	1,46	1.145.463.737,72	0,21
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	32,09	5,58	-0,63	10.424.047,15	6,27	486.942.789,33	2,14
Sub-total Artigo 8º III			23,93	4,55	0,06	12.847.534,96	7,73		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			34,12	6,79	-6,38	35.060.843,92	21,10		
Total			12,52	3,92	1,00	166.170.064,30	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	82.374.730,99	49,57	0,00	60,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	47.678.243,03	28,69	0,00	10,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	1.056.246,36	0,64	0,00	0,00	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	131.109.220,38	78,90				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	22.213.308,96	13,37	0,00	20,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	12.847.534,96	7,73	0,00	10,00	10,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	35.060.843,92	21,10				30,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

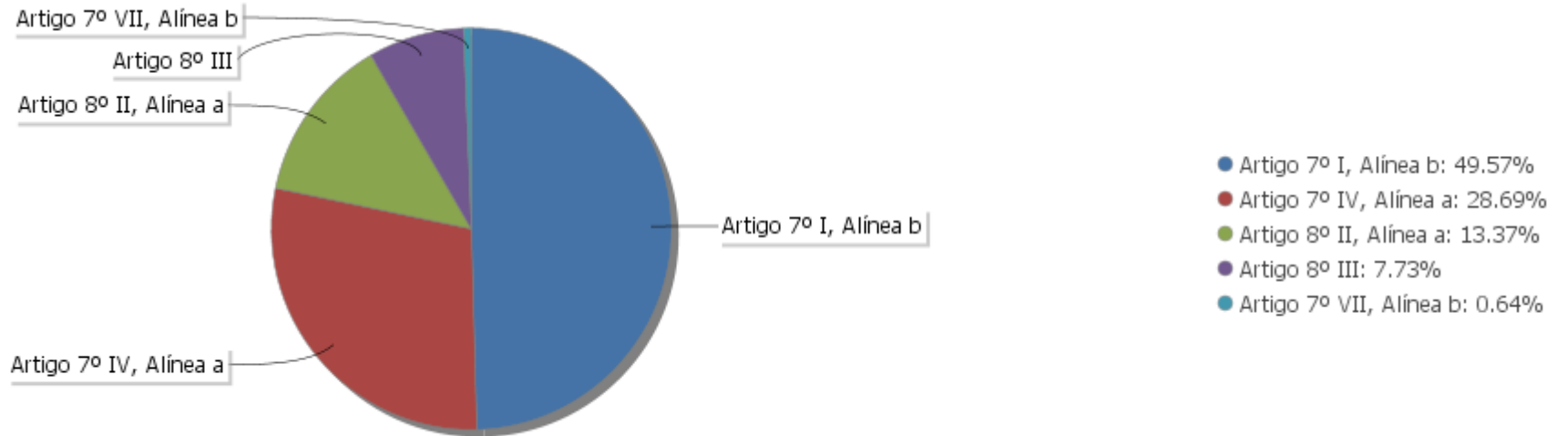
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	4,16 2.140,40	2,62 134,19	7,64 1.187,32	2,35 149,72	7,41 175,82	3.301.001,17	2.059.966,40
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	1,76 904,66	3,12 159,66	4,13 641,88	2,85 181,52	7,70 182,77	820.568,11	1.476.314,99
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,14 74,60	1,02 52,37	0,30 46,79	0,66 42,10	3,06 72,50	1.529,11	15.647,52
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,25 -0,01	-10,02 0,99	28,48 0,65	-10,62 -1,09	4,61 3,53	1.518.394,20	-1.862.514,85
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	4,55 -3,71	0,06 11,07	9,68 -18,16	-0,33 9,20	7,66 6,58	539.039,16	57.853,31
SÃO VICENTE - CONSOLIDADO (Total)						6.180.531,75	1.747.267,37

Análise de Liquidez

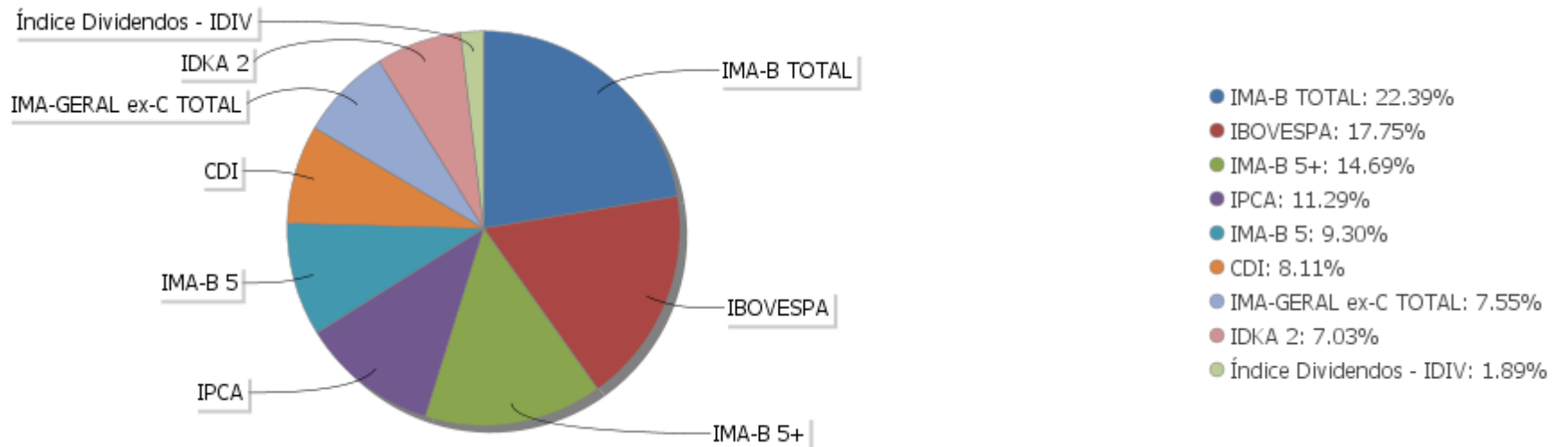
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	159.211.435,75	95,81	159.211.435,75	95,81
de 31 a 364 dias	6.958.628,55	4,19	166.170.064,30	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	166.170.064,30	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

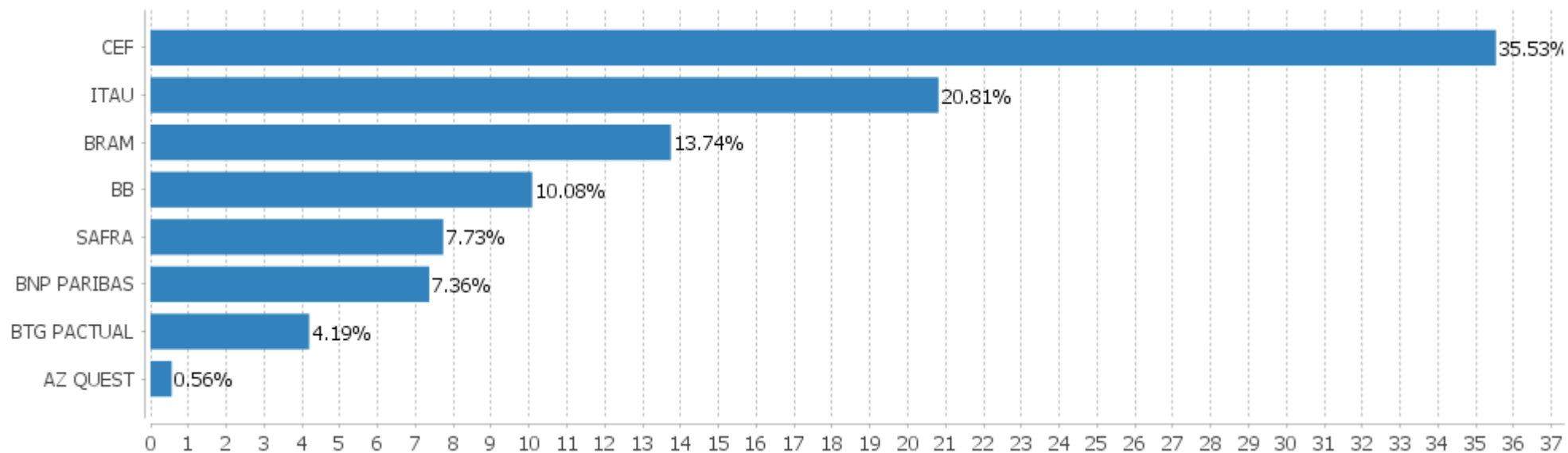


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

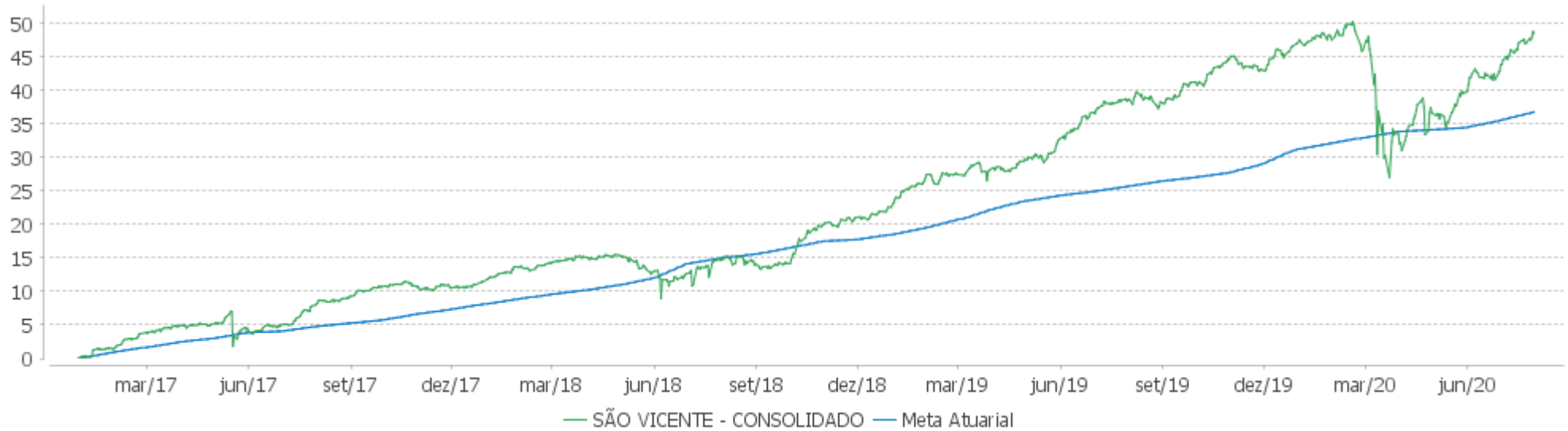
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2020	0,37	-1,02	-8,71	2,51	2,16	2,34	3,92						1,00
INPC + 6%	0,70	0,59	0,69	0,23	0,21	0,79	0,98						4,26
p.p. indexador	-0,34	-1,61	-9,40	2,27	1,94	1,55	2,94						-3,26
2019	3,68	0,35	0,43	1,28	2,33	2,92	1,33	-0,10	2,15	2,38	-1,05	2,74	19,95
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

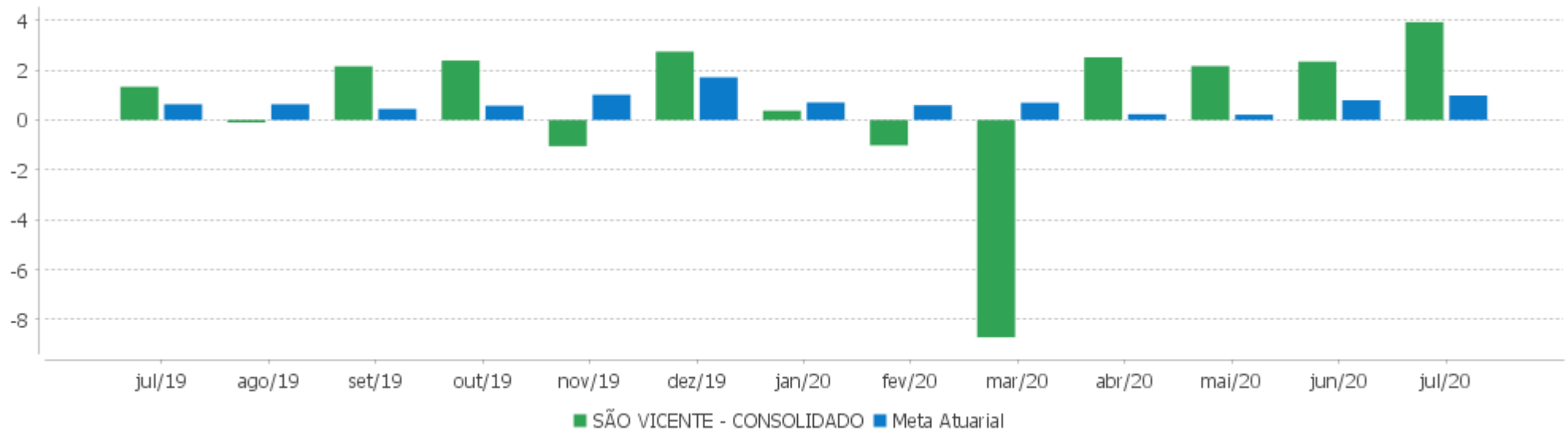
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	26	60,47	03 meses	8,64	1,99	6,66	6,56
Meses abaixo da Meta Atuarial	17	39,53	06 meses	0,63	3,54	-2,90	17,43
			12 meses	7,28	8,88	-1,60	12,52
			24 meses	29,48	19,01	10,48	9,38
Maior rentabilidade da Carteira	5,08	2018-10	36 meses	37,59	30,64	6,94	8,42
Menor rentabilidade da Carteira	-8,71	2020-03	Desde 30/12/2016	48,53	36,84	11,69	8,26

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.	4,38 -0,01	2,42 -0,23	8,09 -0,05	2,17 -0,22	7,72 -0,43	37,07 -0,79	45,56 -1,19
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,21 -0,17	5,03 2,38	9,10 0,95	3,83 1,45	10,23 2,07	43,20 5,34	46,97 0,22
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	1,77 0,11	3,55 0,15	3,83 0,26	3,05 0,17	7,10 0,02	23,78 0,51	32,81 0,56
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,83 -0,11	3,97 -0,34	3,96 0,24	3,50 -0,26	8,10 -0,58	20,93 -1,44	31,10 -2,25
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,36 -0,02	2,54 -0,11	8,07 -0,07	2,27 -0,11	7,94 -0,22	37,20 -0,66	45,69 -1,07
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	7,29 -0,03	1,46 -0,22	11,43 -0,08	1,50 -0,14	7,35 -0,46	47,92 -1,45	54,33 -1,86
ITAU RF IMAB5+ FIC DE FI Var. IMA-B 5+ p.p.	7,28 -0,05	1,35 -0,33	11,31 -0,20	1,33 -0,31	7,32 -0,49	47,88 -1,49	53,78 -2,41
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	0,97 -0,02	4,24 0,05	4,28 -0,00	3,66 0,04	8,77 -0,06	23,92 -0,24	33,83 -0,60
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,27 136,43	1,42 72,89	0,85 131,37	1,05 66,84	3,58 85,04	10,08 93,08	18,06 96,70
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	4,43 2.281,81	4,08 209,02	8,21 1.275,07	3,87 246,39	9,85 233,81	41,29 381,33	49,85 266,90
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI % do CDI	0,18 93,08	1,85 94,93	0,61 94,97	1,49 94,63	4,06 96,22	10,50 96,98	18,17 97,31
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+ Var. IMA-B 5+ p.p.	7,33 0,01	0,99 -0,69	11,39 -0,11	1,02 -0,62	6,98 -0,83	47,49 -1,88	53,87 -2,32
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,55 0,19	2,83 2,37	1,54 1,30	2,48 2,23	5,21 2,90	19,22 13,62	29,15 18,81
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV % do CDI	0,14 74,60	1,02 52,37	0,30 46,79	0,66 42,10	3,06 72,50	9,43 87,09	17,00 91,04
BRADESCO FIA DIVIDENDOS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	7,15 0,63	-16,70 -3,65	20,14 -1,72	-14,37 -2,72	-8,25 -11,75	17,96 -28,53	40,02 -23,17
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	8,38 0,11	-0,65 10,36	31,79 3,96	-2,63 6,91	12,75 11,67	62,07 32,16	87,26 31,14
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	7,74	-9,28	26,10	-8,57	3,46	33,73	39,84

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.	-0,53	1,73	-1,73	0,96	2,38	3,82	-16,28
AZ QUEST ACOES FIC FIA	8,86	-10,48	30,77	-13,77	0,82	29,12	68,56
Var. IBOVESPA p.p.	0,59	0,53	2,94	-4,23	-0,26	-0,78	12,44
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	9,06	-14,94	31,97	-16,62	6,04	43,49	52,19
Var. IBOVESPA p.p.	0,80	-3,93	4,14	-7,08	4,96	13,58	-3,93
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	0,53	2,15	1,28	1,67	4,88	12,16	19,56
% do CDI	274,57	110,07	198,19	106,10	115,80	112,32	104,72
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	5,58	-0,63	12,06	-0,99	8,83	19,17	42,60
Var. IBOVESPA p.p.	-2,68	10,38	-15,77	8,54	7,75	-10,73	-13,52
SÃO VICENTE - CONSOLIDADO	3,92	1,00	8,64	0,63	7,28	29,48	37,59
Var. INPC + 6% p.p.	2,94	-3,26	6,66	-2,90	-1,60	10,48	6,94
CDI	0,19	1,95	0,64	1,57	4,21	10,83	18,68
IBOVESPA	8,27	-11,01	27,83	-9,54	1,08	29,91	56,12
INPC + 6%	0,98	4,26	1,99	3,54	8,88	19,01	30,64
IPCA + 6%	0,90	3,91	1,73	3,16	8,47	18,63	31,32

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	0,24	2,84	0,94	2,39	5,51	13,20	21,56
IRF-M 1+	1,47	7,59	4,50	6,40	12,02	32,81	43,78
IRF-M TOTAL	1,08	6,00	3,32	5,08	9,81	26,59	36,79
IMA-B 5	0,99	4,19	4,28	3,61	8,83	24,16	34,43
IMA-B 5+	7,32	1,68	11,51	1,64	7,81	49,37	56,19
IMA-B TOTAL	4,39	2,65	8,14	2,38	8,16	37,86	46,75
IMA-C TOTAL	4,26	12,04	11,01	9,27	15,97	43,97	64,91
IMA-GERAL ex-C TOTAL	1,66	3,39	3,57	2,88	7,07	23,27	32,25
IMA-GERAL TOTAL	1,74	3,64	3,79	3,07	7,33	23,84	33,11
IDKA 2	0,94	4,31	3,72	3,76	8,68	22,37	33,35
IDKA 20	12,08	-1,74	17,28	-0,38	4,95	69,37	71,28
CDI	0,19	1,95	0,64	1,57	4,21	10,83	18,68
Renda Variável							
IBOVESPA	8,27	-11,01	27,83	-9,54	1,08	29,91	56,12
IBRX 100	8,41	-10,43	28,20	-9,30	2,17	33,69	59,04
IBRX 50	8,15	-11,06	29,00	-9,35	0,23	26,69	52,24
SMALL CAP	9,50	-13,20	31,66	-13,59	7,86	55,28	71,97
IFIX	-2,61	-14,53	4,97	-11,18	2,77	26,86	32,28
Índice Consumo - ICON	7,62	-4,11	27,54	-7,49	12,15	54,44	58,02
Índice Dividendos - IDIV	6,53	-13,05	21,87	-11,65	3,50	46,49	63,19
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,36	0,46	0,24	0,25	2,31	5,60	10,34
INPC	0,44	0,80	0,49	0,61	2,69	5,94	9,76
IGPM	2,23	6,71	4,11	6,21	9,27	16,26	25,84
SELIC	0,19	1,95	0,64	1,57	4,21	10,83	18,69
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

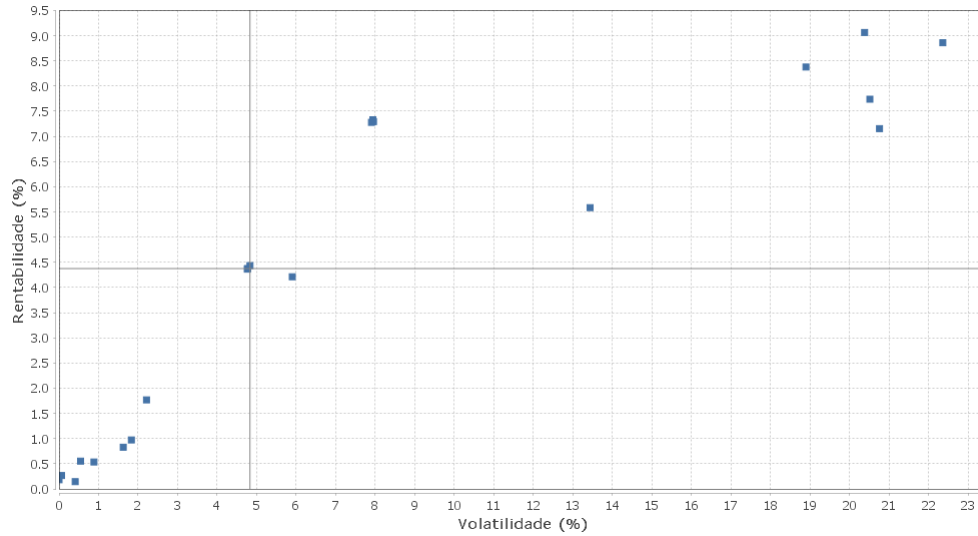
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
184	02/07/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	48.903,95	0,00	1.009,69555658	48,4343520000
180	03/07/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	78.556,08	0,00	4.377,33288770	17,9461060000
188	07/07/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	12.000,00	247,69996648	48,4457070000
185	10/07/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	110.154,75	0,00	2.273,24178573	48,4571200000
176	10/07/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	16.500,00	4.718,83398800	3,4966260000
189	13/07/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	16.000,00	330,16295048	48,4609190000
181	13/07/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	4.745,14	0,00	264,20858778	17,9598250000
190	15/07/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	12.000,00	247,58330327	48,4685350000
174	15/07/2020	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.500.000,00	0,00	651.651,74166900	2,3018430000
173	16/07/2020	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	978.833,41	0,00	222.632,31067900	4,3966368000
175	16/07/2020	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	1.500.000,00	652.015,16327300	2,3005600000
179	16/07/2020	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	800.000,00	0,00	3.821,16433100	209,3602710000
186	17/07/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	20.018,24	0,00	412,95016660	48,4761640000
172	17/07/2020	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	1.500.000,00	0,00	4.246,03474647	353,2707784000
177	20/07/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	45.000,00	12.811,35133300	3,5125100000
187	22/07/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	16.709,56	0,00	344,61516784	48,4875930000
182	22/07/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	36.544,83	0,00	2.032,54320085	17,9798540000
191	30/07/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	15.000,00	309,21159906	48,5104700000
178	30/07/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	194.869,96	54.661,84161700	3,5650090000
183	31/07/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	70.517,52	0,00	3.913,13250615	18,0207340000
		Total				

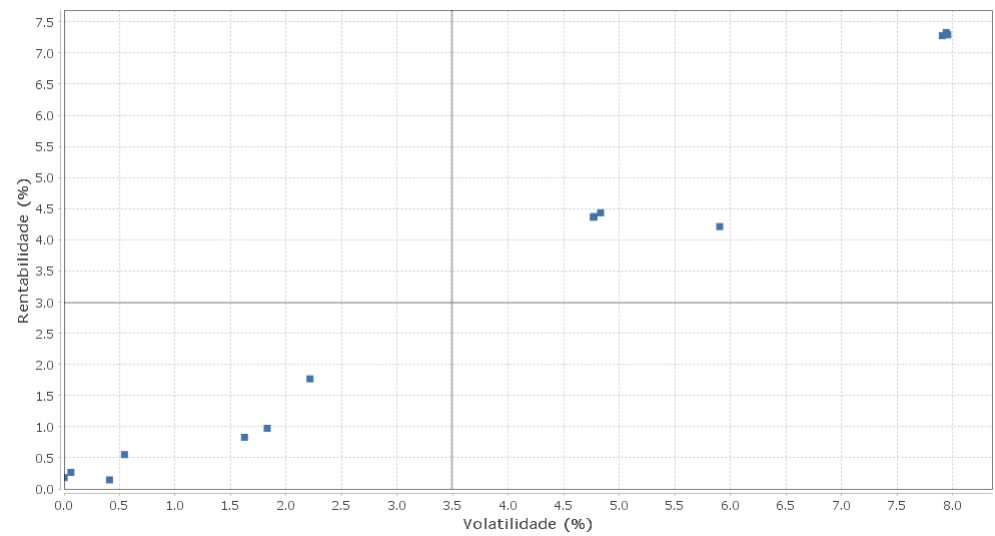
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

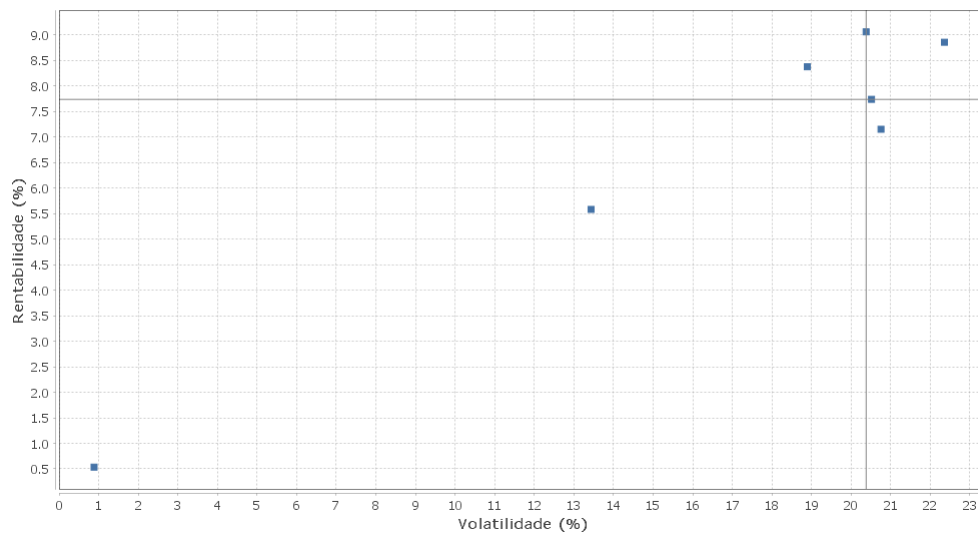
SÃO VICENTE - CONSOLIDADO - No Mês



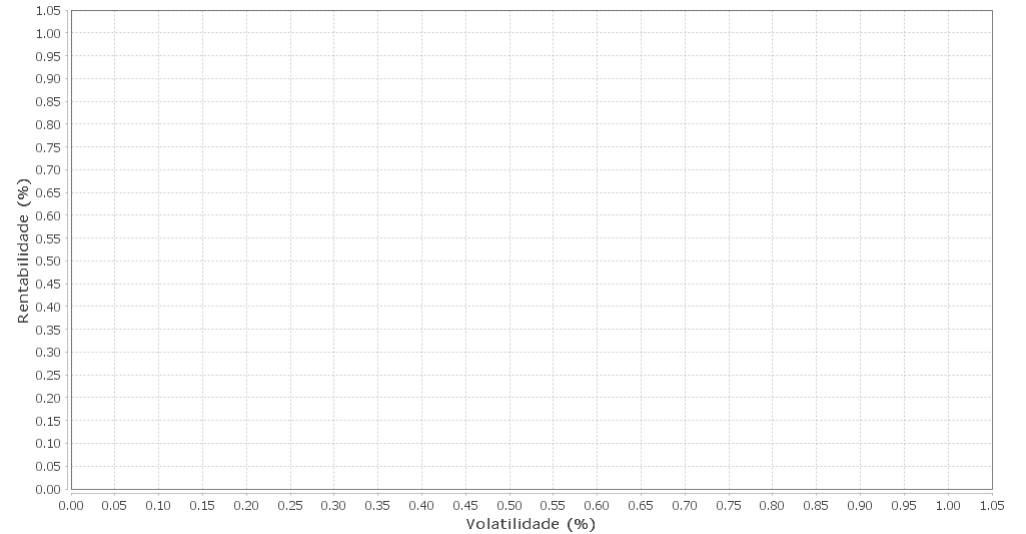
Renda Fixa - No Mês



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\$): 12.802.242,16

Value-At-Risk: 7,70%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	0,02	-0,00	-15,53	0,18	1.535.577,88	0,92
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	Artigo 7º IV, Alínea a	0,06	0,17	-0,00	1,13	0,27	757.239,59	0,46
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	Artigo 7º VII, Alínea b	0,41	0,21	-0,00	-0,12	0,14	1.056.246,36	0,64
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,54	0,53	0,02	0,66	0,55	18.755.631,13	11,29
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	0,88	0,52	0,01	0,38	0,53	2.423.487,81	1,46
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,62	2,28	0,12	0,39	0,83	11.685.886,20	7,03
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	Artigo 7º IV, Alínea a	1,83	2,42	0,18	0,43	0,97	15.447.996,78	9,30
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,21	3,09	0,21	0,71	1,77	12.554.124,03	7,55
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,76	5,98	0,14	0,87	4,36	4.190.385,18	2,52
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,77	5,93	1,02	0,88	4,38	31.105.179,43	18,72
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	4,83	6,68	0,28	0,88	4,43	7.702.999,06	4,64
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	5,90	7,96	0,08	0,68	4,21	1.902.001,00	1,14
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	Artigo 7º I, Alínea b	7,91	9,23	0,34	0,90	7,28	6.589.303,67	3,97
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	Artigo 7º IV, Alínea a	7,94	9,22	0,18	0,90	7,33	3.478.798,59	2,09
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	7,95	9,28	0,74	0,89	7,29	14.347.851,48	8,63
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	13,43	19,87	1,00	0,40	5,58	10.424.047,15	6,27
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	18,89	29,94	1,18	0,43	8,38	6.958.628,55	4,19
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	20,38	25,64	1,03	0,44	9,06	7.072.137,43	4,26
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	20,51	25,29	0,60	0,37	7,74	4.108.272,92	2,47
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	20,76	24,57	0,44	0,34	7,15	3.142.689,53	1,89
AZ QUEST ACOES FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	22,36	22,74	0,12	0,39	8,86	931.580,53	0,56