



LDB
EMPRESAS

SÃO VICENTE
JUNHO 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 **81,02%**

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	12,40	2,02	-1,75	4.015.222,92	2,56	5.526.503.185,82	0,07
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,47	2,03	-1,88	30.048.088,63	19,18	5.979.262.081,07	0,50
ITAU	ITAU	ITAU RF IMAB5+ FIC DE FI	19,01	2,82	-5,53	6.142.269,23	3,92	83.260.620,22	7,38
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,16	2,83	-5,44	13.372.738,75	8,54	1.967.228.116,14	0,68
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,01	1,18	3,12	11.590.618,09	7,40	7.740.606.629,29	0,15
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,05	0,95	1,75	12.336.051,16	7,88	10.783.491.196,95	0,11
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	13,42	2,87	0,78	1.825.111,00	1,17	67.188.321,04	2,72
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			11,62	1,95	-1,48	79.330.099,78	50,65		

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	0,26	1,15	755.237,18	0,48	3.675.261.371,45	0,02
ITAU	ITAU	ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO	14,21	1,99	-0,34	7.375.917,44	4,71	433.601.892,28	1,70
ITAU	ITAU	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,07	0,20	1,67	1.392.084,78	0,89	19.486.061.074,41	0,01
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	19,28	2,75	-5,91	3.241.183,89	2,07	249.666.176,43	1,30
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	5,31	1,09	3,23	15.299.082,07	9,77	863.646.242,11	1,77
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	1,67	0,44	2,27	18.463.019,49	11,79	5.170.951.886,47	0,36
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			5,76	1,06	1,34	46.526.524,85	29,70		

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	0,36	-0,01	0,88	1.054.717,25	0,67	1.143.745.992,34	0,09
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			0,36	-0,01	0,88	1.054.717,25	0,67		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

9,39

1,61

-0,52

126.911.341,88

81,02

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

18,98%

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	40,48	5,36	-22,26	2.932.911,89	1,87	1.863.872.898,82	0,16
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST ACOES FIC FIA	44,55	9,88	-17,76	855.777,14	0,55	806.010.588,17	0,11
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	46,76	13,15	-22,01	5.126.827,46	3,27	628.288.800,67	0,82
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	44,99	10,27	-8,33	5.487.363,88	3,50	2.091.503.187,63	0,26
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	39,99	7,79	-15,79	3.813.200,98	2,43	267.384.087,20	1,43
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			42,84	9,62	-16,88	18.216.081,35	11,63		

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	1,28	0,28	1,61	2.410.624,76	1,54	1.201.098.475,93	0,20
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	31,93	0,91	-5,88	9.097.871,04	5,81	449.269.476,57	2,03
Sub-total Artigo 8º III			23,73	0,77	-4,30	11.508.495,80	7,35		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			33,91	5,93	-12,33	29.724.577,15	18,98		
Total			12,44	2,34	-2,80	156.635.919,03	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	79.330.099,78	50,65	0,00	60,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	46.526.524,85	29,70	0,00	10,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	1.054.717,25	0,67	0,00	0,00	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	126.911.341,88	81,02				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	18.216.081,35	11,63	0,00	20,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	11.508.495,80	7,35	0,00	10,00	10,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	29.724.577,15	18,98				30,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

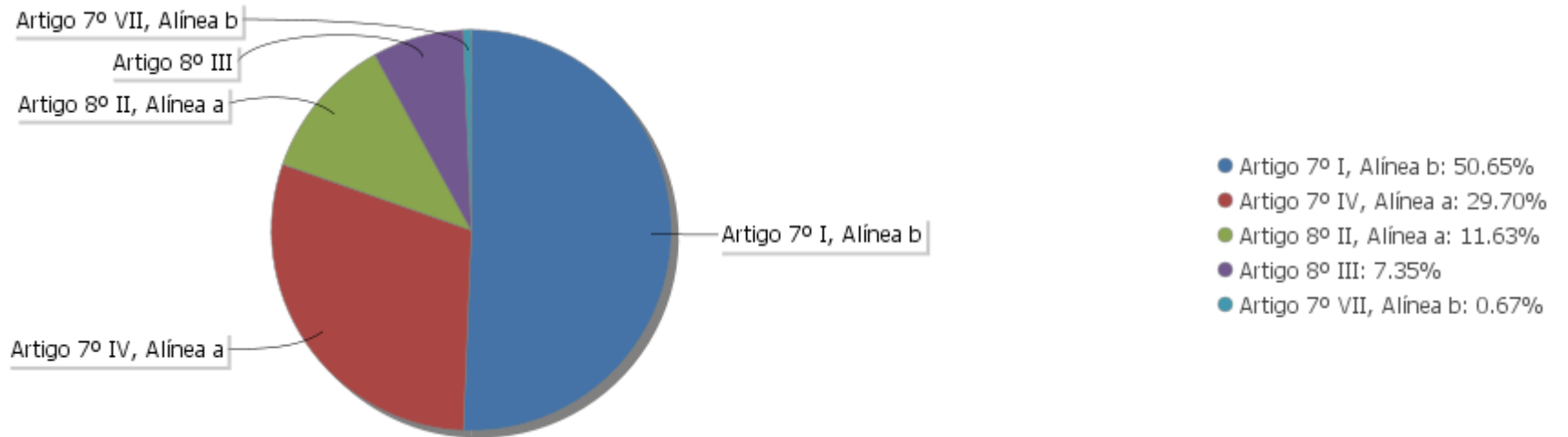
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,95 916,08	-1,48 -84,28	4,66 634,29	-1,48 -84,28	4,25 92,43	1.529.558,54	-1.241.034,77
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	1,06 501,58	1,34 76,11	2,97 403,96	1,34 76,11	6,94 150,73	480.007,13	655.746,88
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	-0,01 -6,42	0,88 49,94	0,00 0,39	0,88 49,94	3,52 76,44	-481,57	14.118,41
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	9,62 0,86	-16,88 0,92	33,49 3,31	-16,88 0,92	-0,06 5,79	1.452.694,36	-3.380.909,05
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	0,77 -7,98	-4,30 13,51	14,18 -16,00	-4,30 13,51	3,91 9,76	85.594,73	-481.185,85
SÃO VICENTE - CONSOLIDADO (Total)						3.547.373,19	-4.433.264,38

Análise de Liquidez

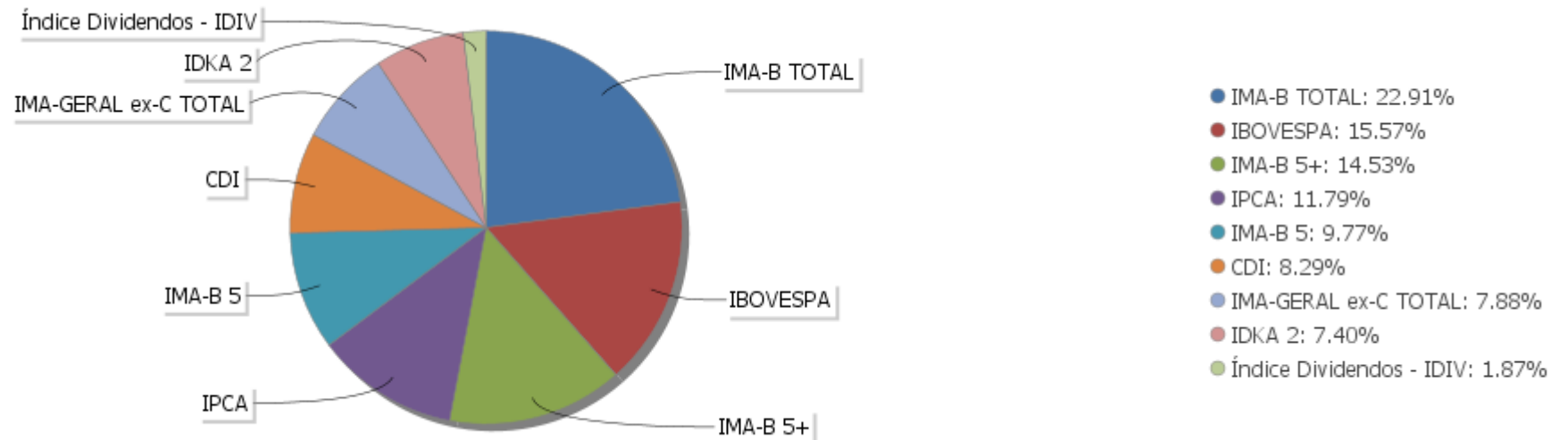
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	151.148.555,15	96,50	151.148.555,15	96,50
de 31 a 364 dias	5.487.363,88	3,50	156.635.919,03	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	156.635.919,03	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

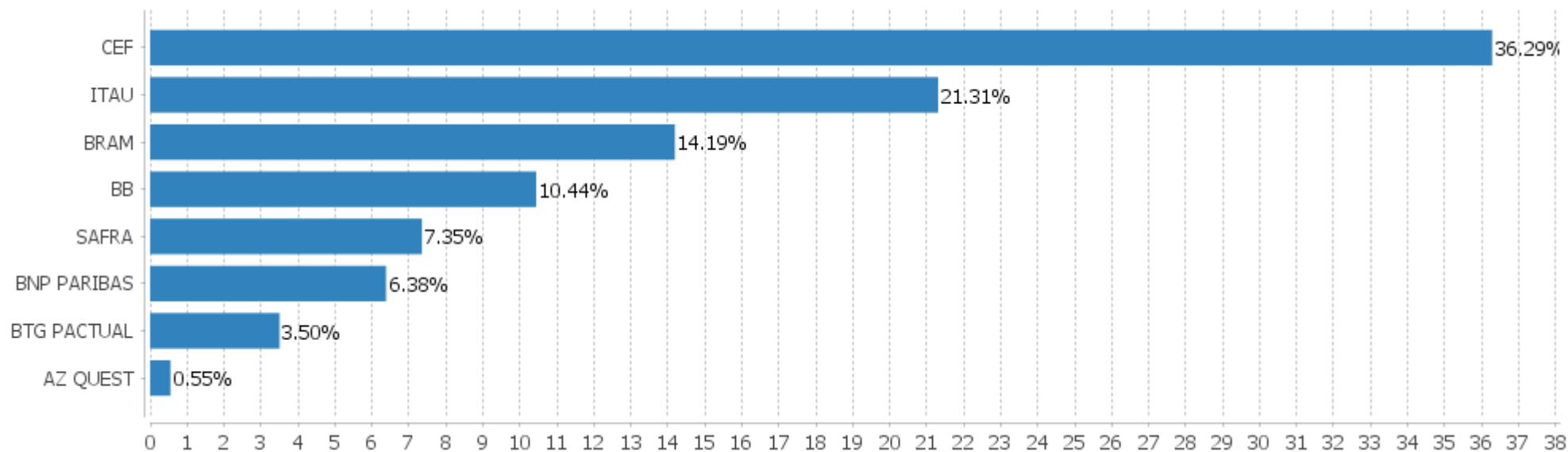


Alocação Por Estratégia



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							-2,80
INPC + 6%	0,70	0,59	0,69	0,23	0,21	0,79							3,25
p.p. indexador	-0,34	-1,61	-9,40	2,27	1,94	1,55							-6,06
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

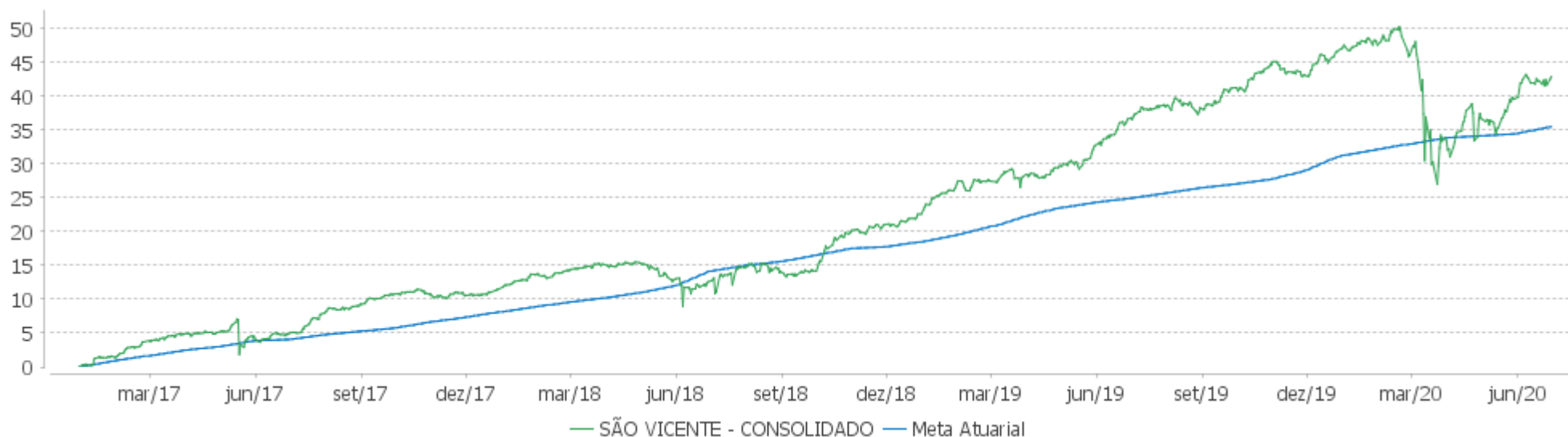
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

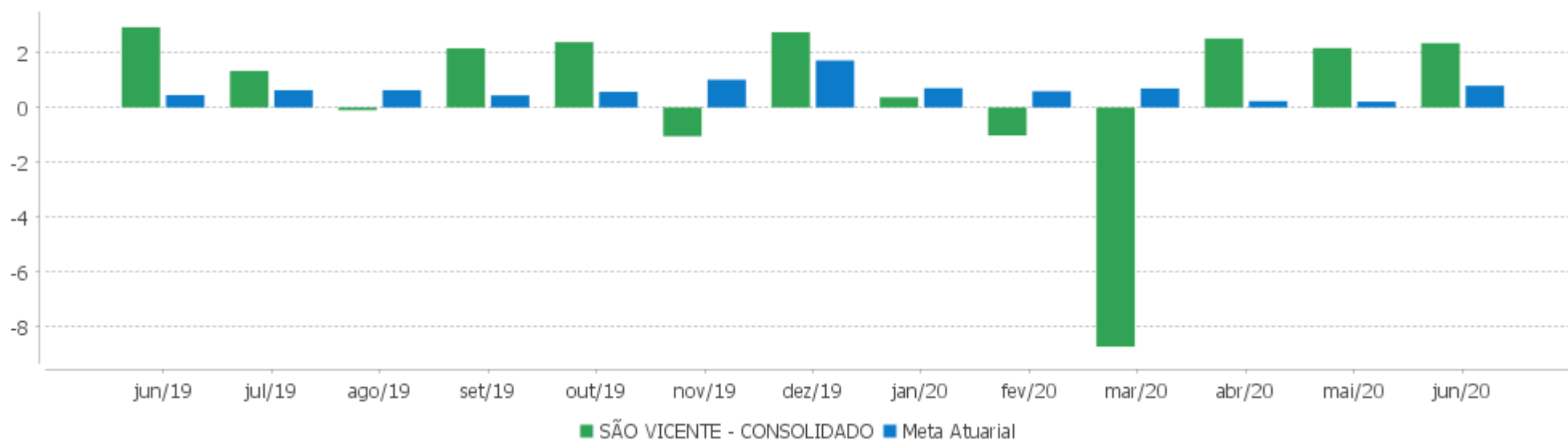
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	25	59,52	03 meses	7,17	1,24	5,93	10,97
Meses abaixo da Meta Atuarial	17	40,48	06 meses	-2,80	3,25	-6,06	17,42
			12 meses	4,61	8,51	-3,90	12,44
			24 meses	26,96	18,75	8,20	9,70
Maior rentabilidade da Carteira	5,08	2018-10	36 meses	36,19	30,23	5,96	8,39
Menor rentabilidade da Carteira	-8,71	2020-03	Desde 30/12/2016	42,94	35,52	7,41	8,33

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.	2,03 -0,02	-1,88 -0,21	4,91 -0,05	-1,88 -0,21	4,52 -0,42	34,35 -0,78	45,00 -1,21
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,87 0,82	0,78 2,44	6,25 1,29	0,78 2,44	6,75 1,80	40,97 5,84	46,57 0,36
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,95 0,05	1,75 0,04	2,96 0,22	1,75 0,04	6,31 -0,01	23,29 0,35	33,67 0,56
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,18 0,19	3,12 -0,23	3,54 0,19	3,12 -0,23	8,19 -0,58	21,36 -1,81	33,16 -2,29
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,02 -0,03	-1,75 -0,08	4,90 -0,06	-1,75 -0,08	4,74 -0,20	34,48 -0,65	45,12 -1,09
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	2,83 -0,02	-5,44 -0,17	5,88 -0,11	-5,44 -0,17	1,57 -0,40	42,12 -1,44	50,48 -1,85
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI Var. IMA-B 5+ p.p.	2,82 -0,03	-5,53 -0,27	5,79 -0,20	-5,53 -0,27	1,50 -0,47	42,11 -1,45	49,97 -2,36
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV % do CDI	-0,01 -6,42	0,88 49,94	0,00 0,39	0,88 49,94	3,52 76,44	9,84 87,72	17,76 91,61
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	1,09 -0,03	3,23 0,06	3,84 0,08	3,23 0,06	8,75 -0,06	24,57 -0,19	36,43 -0,47
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,26 122,04	1,15 65,82	0,52 71,43	1,15 65,82	3,89 84,51	10,37 92,47	18,70 96,44
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	1,99 938,88	-0,34 -19,33	5,20 707,68	-0,34 -19,33	6,72 145,89	38,42 342,63	49,17 253,57
ITAUBERCO SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI % do CDI	0,20 95,52	1,67 95,14	0,70 94,93	1,67 95,14	4,44 96,52	10,89 97,08	18,91 97,50
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+ Var. IMA-B 5+ p.p.	2,75 -0,09	-5,91 -0,65	5,83 -0,16	-5,91 -0,65	1,12 -0,86	41,71 -1,85	49,98 -2,35
ITAUBERCO INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,44 0,18	2,27 2,17	1,12 1,55	2,27 2,17	5,62 3,49	19,25 13,67	31,68 21,48
BRADERCO FIA DIVIDENDOS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	5,36 -3,59	-22,26 -3,88	20,25 1,55	-22,26 -3,88	-14,42 -14,26	19,49 -28,03	37,01 -23,56
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	10,27 1,52	-8,33 9,47	41,67 11,49	-8,33 9,47	8,82 14,67	55,69 25,05	80,75 29,62
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	7,79	-15,79	29,82	-15,79	-3,40	35,63	32,32

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.	-0,97	2,01	-0,36	2,01	2,46	5,00	-18,81
AZ QUEST ACOES FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	9,88 1,12	-17,76 0,04	33,78 3,60	-17,76 0,04	-3,83 2,02	27,38 -3,26	65,07 13,95
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	13,15 4,39	-22,01 -4,20	37,27 7,09	-22,01 -4,20	3,74 9,59	40,44 9,80	46,96 -4,16
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO % do CDI	0,28 131,03	1,61 91,57	0,98 134,04	1,61 91,57	4,81 104,40	12,46 111,09	20,47 105,55
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	0,91 -7,85	-5,88 11,92	18,57 -11,61	-5,88 11,92	4,57 10,43	17,16 -13,48	38,64 -12,48
SÃO VICENTE - CONSOLIDADO Var. INPC + 6% p.p.	2,34 1,55	-2,80 -6,06	7,17 5,93	-2,80 -6,06	4,61 -3,90	26,96 8,20	36,19 5,96
CDI	0,21	1,75	0,73	1,75	4,60	11,21	19,39
IBOVESPA	8,76	-17,80	30,18	-17,80	-5,85	30,64	51,12
INPC + 6%	0,79	3,25	1,24	3,25	8,51	18,75	30,23
IPCA + 6%	0,75	2,99	0,98	2,99	8,29	18,56	31,11

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	0,28	2,60	1,15	2,60	6,01	13,67	22,54
IRF-M 1+	1,04	6,03	4,53	6,03	11,80	33,23	45,60
IRF-M TOTAL	0,79	4,86	3,39	4,86	9,81	27,08	38,44
IMA-B 5	1,12	3,17	3,77	3,17	8,81	24,75	36,90
IMA-B 5+	2,84	-5,26	5,99	-5,26	1,97	43,55	52,33
IMA-B TOTAL	2,05	-1,66	4,96	-1,66	4,95	35,13	46,21
IMA-C TOTAL	3,74	7,46	7,95	7,46	13,21	41,24	63,14
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,90	1,71	2,74	1,71	6,32	22,95	33,11
IMA-GERAL TOTAL	0,99	1,87	2,89	1,87	6,52	23,45	33,90
IDKA 2	0,99	3,35	3,35	3,35	8,77	23,17	35,46
IDKA 20	4,18	-12,33	6,49	-12,33	-4,69	58,14	62,45
CDI	0,21	1,75	0,73	1,75	4,60	11,21	19,39
Renda Variável							
IBOVESPA	8,76	-17,80	30,18	-17,80	-5,85	30,64	51,12
IBRX 100	8,97	-17,39	30,39	-17,39	-4,66	34,21	53,90
IBRX 50	9,33	-17,76	31,79	-17,76	-6,93	27,59	47,47
SMALL CAP	14,43	-20,73	32,49	-20,73	5,15	49,01	69,83
IFIX	5,59	-12,24	12,52	-12,24	6,86	32,05	35,30
Índice Consumo - ICON	10,08	-10,90	39,45	-10,90	13,99	52,93	55,22
Índice Dividendos - IDIV	8,95	-18,38	18,70	-18,38	-0,15	47,52	60,57
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,26	0,10	-0,43	0,10	2,13	5,57	10,21
INPC	0,30	0,36	-0,18	0,36	2,35	5,74	9,47
IGPM	1,56	4,39	2,66	4,39	7,31	14,30	22,21
SELIC	0,21	1,75	0,73	1,75	4,60	11,22	19,40
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

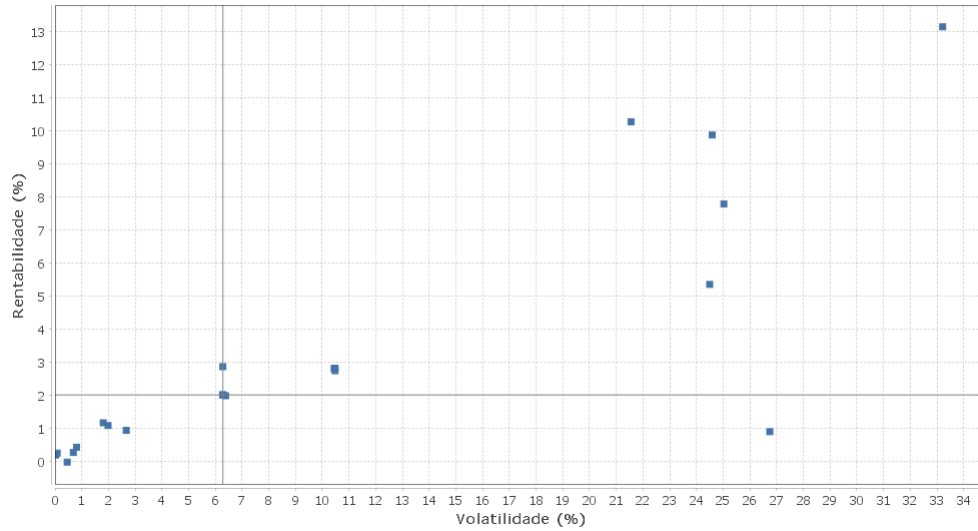
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
165	01/06/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	2.200.000,00	45.516,73410316	48,3338720000
162	01/06/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	77.024,10	0,00	4.316,45036528	17,8443150000
169	08/06/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	1.281.446,26	0,00	26.498,13340065	48,3598690000
166	10/06/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	55.000,00	1.137,06215432	48,3702670000
156	10/06/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	9.725,00	2.852,07427000	3,4097990000
157	10/06/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	2.000,00	586,54482200	3,4097990000
170	15/06/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	149.259,86	0,00	3.085,11379318	48,3806660000
158	18/06/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	32.349,80	9.540,65374200	3,3907320000
159	22/06/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	8.813,73	2.613,83222600	3,3719570000
167	23/06/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	15.000,00	309,86819261	48,4076790000
152	24/06/2020	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	0,00	600.000,00	2.015,73275570	297,6585040000
160	24/06/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	1.600.000,00	474.162,86463400	3,3743680000
154	25/06/2020	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	500.000,00	0,00	1.565,28440560	319,4307681000
153	25/06/2020	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	600.000,00	0,00	1.875,90621510	319,8454140000
155	25/06/2020	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	500.000,00	0,00	119.162,61380700	4,1959469000
164	25/06/2020	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	600.000,00	0,00	2.970,95719900	201,9551140000
171	26/06/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	15.000,00	0,00	309,79524868	48,4190770000
163	26/06/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	39.949,55	0,00	2.231,26174218	17,9044660000
168	30/06/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	14.341,96	296,15834963	48,4266610000
161	30/06/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	194.708,01	56.972,31402900	3,4175900000

Total

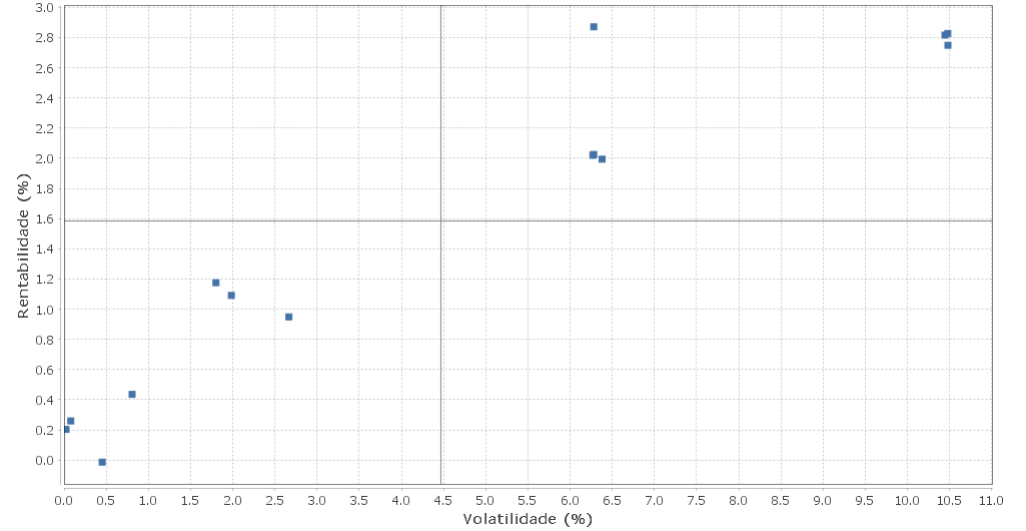
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

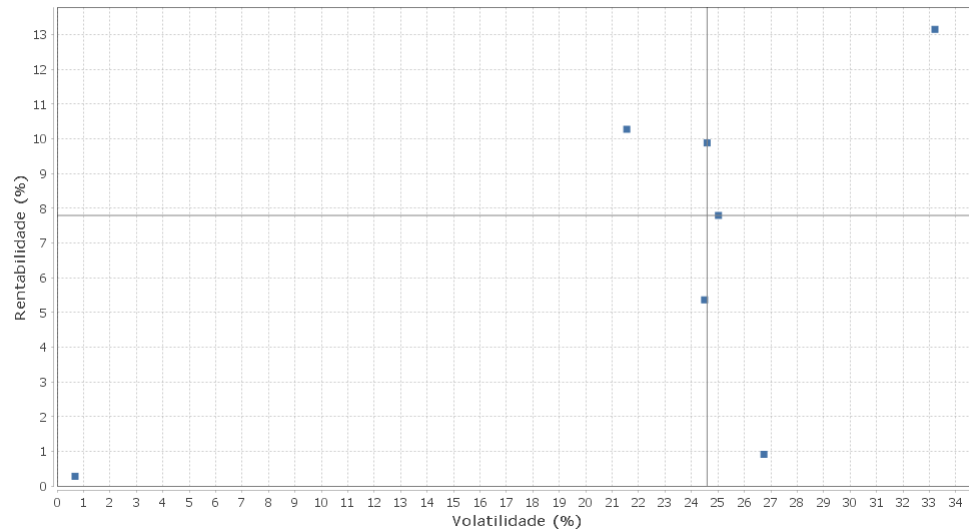
SÃO VICENTE - CONSOLIDADO - No Mês



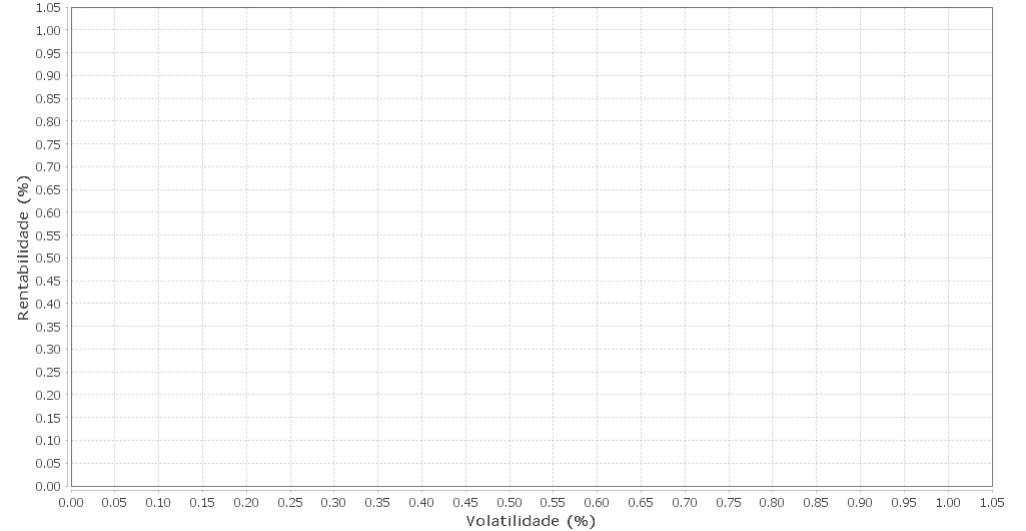
Renda Fixa - No Mês



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\$): 14.673.013,37

Value-At-Risk: 9,37%

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	-0,41	0,20	1.392.084,78	0,89
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	Artigo 7º IV, Alínea a	0,08	0,17	-0,00	0,59	0,26	755.237,18	0,48
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	Artigo 7º VII, Alínea b	0,45	0,22	-0,00	-0,50	-0,01	1.054.717,25	0,67
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	0,68	0,99	0,01	0,10	0,28	2.410.624,76	1,54
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,81	0,54	0,03	0,28	0,44	18.463.019,49	11,79
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,80	2,27	0,14	0,53	1,18	11.590.618,09	7,40
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	Artigo 7º IV, Alínea a	1,98	3,05	0,25	0,44	1,09	15.299.082,07	9,77
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,67	3,94	0,29	0,28	0,95	12.336.051,16	7,88
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	6,27	9,57	0,23	0,29	2,02	4.015.222,92	2,56
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,28	9,76	1,78	0,29	2,03	30.048.088,63	19,18
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	6,28	10,49	0,12	0,42	2,87	1.825.111,00	1,17
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	6,38	9,50	0,42	0,28	1,99	7.375.917,44	4,71
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	Artigo 7º I, Alínea b	10,44	14,15	0,53	0,25	2,82	6.142.269,23	3,92
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	10,48	14,21	1,15	0,25	2,83	13.372.738,75	8,54
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	Artigo 7º IV, Alínea a	10,48	14,17	0,28	0,24	2,75	3.241.183,89	2,07
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	21,55	30,10	0,97	0,47	10,27	5.487.363,88	3,50
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	24,50	30,99	0,54	0,21	5,36	2.932.911,89	1,87
AZ QUEST ACOES FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	24,59	29,50	0,15	0,39	9,88	855.777,14	0,55
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	25,02	27,15	0,62	0,30	7,79	3.813.200,98	2,43
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	26,74	22,12	1,00	0,03	0,91	9.097.871,04	5,81
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	33,21	28,77	0,87	0,39	13,15	5.126.827,46	3,27