



**LDB**  
EMPRESAS

**SÃO VICENTE**  
OUTUBRO 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

80,81%

## 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	12,77	0,20	-0,73	4.056.666,64	2,34	5.529.359.748,67	0,07
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,83	0,19	-0,81	29.351.603,56	16,95	5.818.645.931,87	0,50
ITAU	ITAU	ITAU RF IMAB5+ FIC DE FI	19,66	0,21	-4,69	6.196.823,24	3,58	78.441.211,22	7,90
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,82	0,22	-4,61	13.489.035,68	7,79	1.789.450.540,00	0,75
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,13	0,15	5,00	23.687.263,76	13,68	9.550.097.040,26	0,25
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,26	-0,07	1,78	12.340.239,34	7,13	9.938.464.189,22	0,12
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	13,86	0,15	1,15	1.793.323,00	1,04	66.018.098,52	2,72
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>12,02</b>	<b>0,15</b>	<b>-0,37</b>	<b>90.914.955,22</b>	<b>52,50</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	0,23	0,15	1,87	760.562,07	0,44	3.539.135.696,53	0,02
ITAU	ITAU	ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO	14,59	-0,00	0,38	7.429.347,32	4,29	640.033.097,32	1,16
ITAU	ITAU	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,19	0,12	2,14	1.878.152,09	1,08	18.245.029.496,49	0,01
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	19,92	0,21	-5,11	3.268.926,55	1,89	240.149.931,32	1,36
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	5,40	0,13	4,61	15.503.939,45	8,95	789.630.975,77	1,96
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	1,67	0,08	2,55	19.120.245,07	11,04	4.590.560.763,79	0,42
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>5,82</b>	<b>0,09</b>	<b>2,10</b>	<b>47.961.172,55</b>	<b>27,70</b>		

## 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	0,41	0,07	1,18	1.057.900,89	0,61	753.751.743,91	0,14
<b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b</b>			<b>0,41</b>	<b>0,07</b>	<b>1,18</b>	<b>1.057.900,89</b>	<b>0,61</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

9,67

0,13

0,45

139.934.028,66

80,81

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

19,19%

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	41,51	-0,93	-25,69	2.803.561,13	1,62	1.536.915.263,29	0,18
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST ACOES FIC FIA	45,50	-0,62	-18,20	851.271,06	0,49	718.713.706,57	0,12
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	47,73	-2,39	-22,25	6.464.435,27	3,73	571.816.889,36	1,13
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	45,78	-1,73	-5,68	6.606.745,47	3,82	2.238.639.550,31	0,30
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	41,39	-1,29	-17,41	3.740.075,35	2,16	261.401.794,63	1,43
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>43,83</b>	<b>-1,71</b>	<b>-17,10</b>	<b>20.466.088,28</b>	<b>11,82</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	1,36	0,16	1,71	2.413.119,74	1,39	947.452.547,61	0,25
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	32,37	-2,30	-1,22	10.361.420,79	5,98	571.445.122,37	1,81
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>24,85</b>	<b>-1,84</b>	<b>-0,51</b>	<b>12.774.540,53</b>	<b>7,38</b>		
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>			<b>34,60</b>	<b>-1,76</b>	<b>-11,24</b>	<b>33.240.628,81</b>	<b>19,19</b>		
<b>Total</b>			<b>12,82</b>	<b>-0,23</b>	<b>-1,81</b>	<b>173.174.657,47</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	90.914.955,22	52,50	0,00	60,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	47.961.172,55	27,70	0,00	10,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	1.057.900,89	0,61	0,00	0,00	5,00	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>139.934.028,66</b>	<b>80,81</b>				100,00
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	20.466.088,28	11,82	0,00	20,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	12.774.540,53	7,38	0,00	10,00	10,00	10,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>33.240.628,81</b>	<b>19,19</b>				30,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

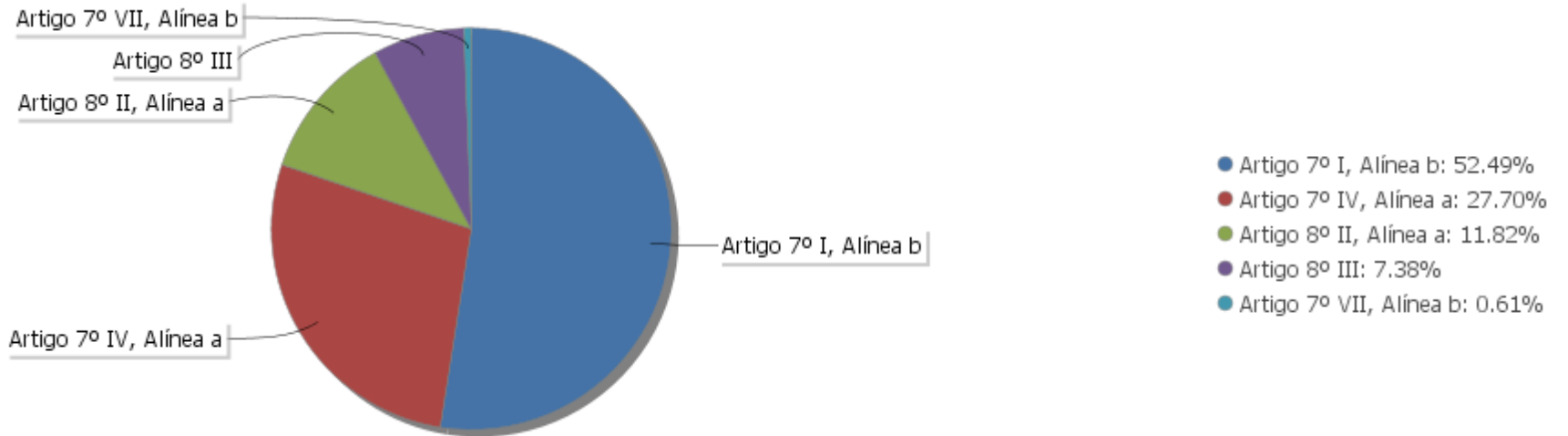
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,15 97,07	-0,37 -15,24	-2,91 -614,13	4,51 401,89	-0,33 -10,25	138.108,69	-460.081,18
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,09 59,70	2,10 86,24	-0,99 -207,63	3,11 277,01	2,58 80,36	44.265,30	1.004.764,66
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,07 42,62	1,18 48,47	0,16 33,01	0,46 40,87	1,77 55,16	707,30	17.302,05
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-1,71 -1,02	-17,10 1,66	-7,87 0,84	18,38 1,67	-8,29 4,09	-355.284,97	-3.609.735,53
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-1,84 -1,15	-0,51 18,25	-0,57 8,14	9,05 -7,65	4,40 16,78	-239.576,55	-15.141,12
<b>SÃO VICENTE - CONSOLIDADO (Total)</b>						<b>-411.780,23</b>	<b>-3.062.891,12</b>

Análise de Liquidez

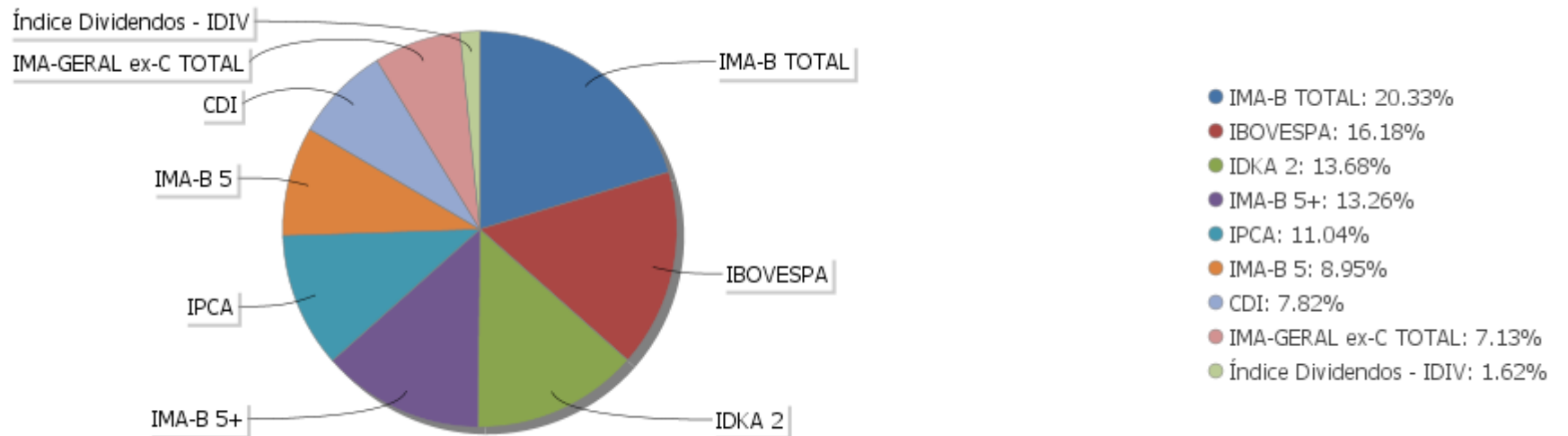
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	166.567.912,00	96,18	166.567.912,00	96,18
de 31 a 364 dias	6.606.745,47	3,82	173.174.657,47	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	173.174.657,47	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



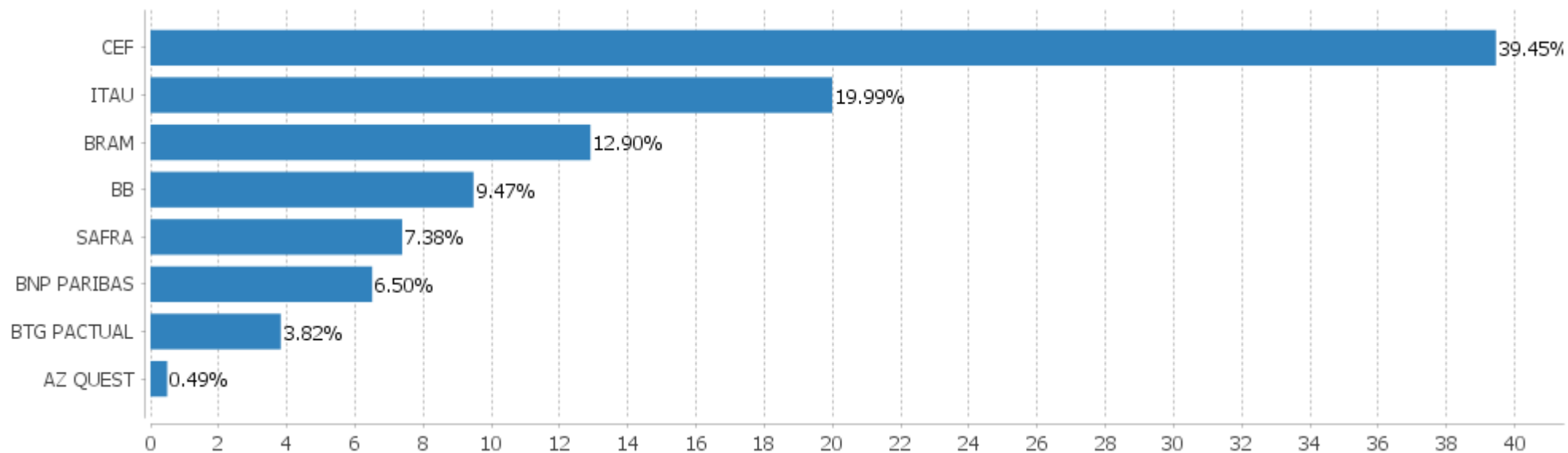
Alocação Por Estratégia





## 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			-1,81
INPC + 6%	0,70	0,59	0,69	0,23	0,21	0,79	0,98	0,85	1,36	1,38			8,05
p.p. indexador	-0,34	-1,61	-9,40	2,27	1,94	1,55	2,94	-1,74	-3,04	-1,62			-9,85
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

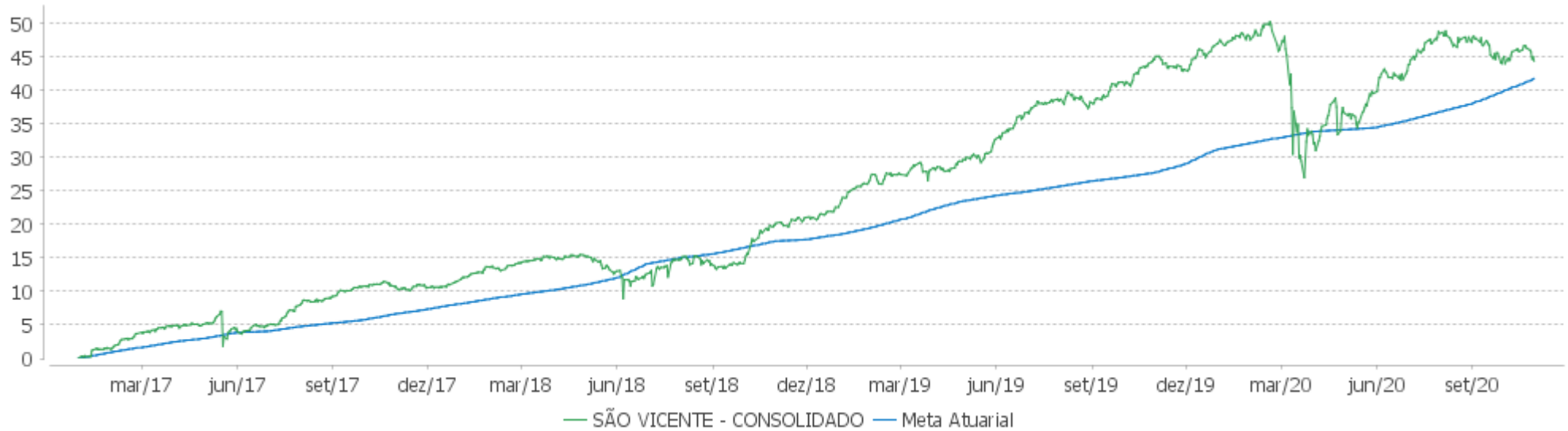
**PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL**

**RELATÓRIO TRIMESTRAL**

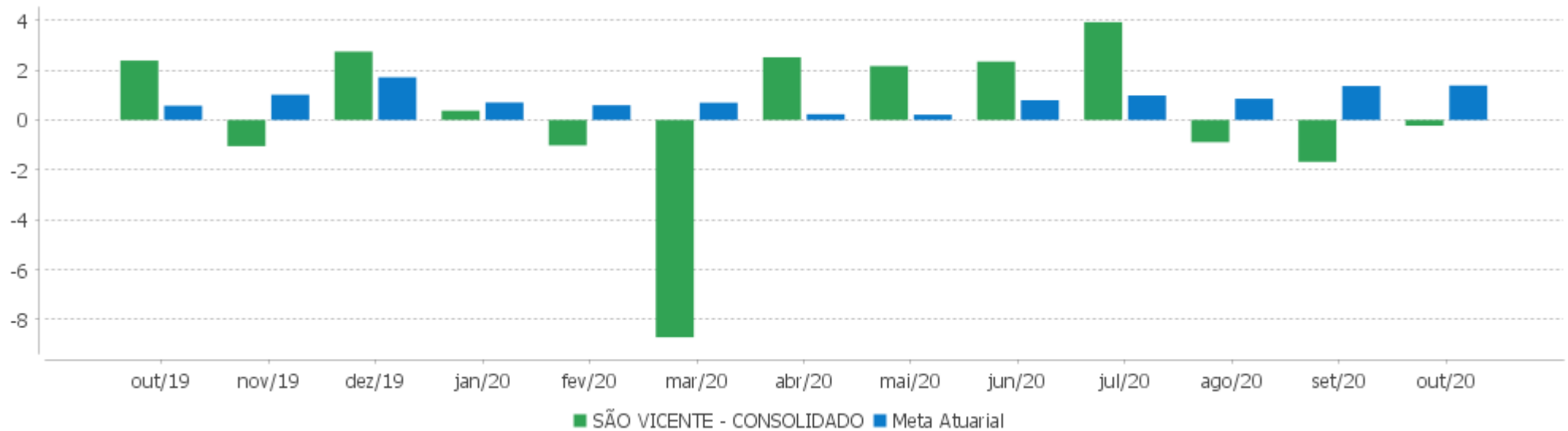
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	26	56,52	03 meses	-2,78	3,63	-6,41	6,38
Meses abaixo da Meta Atuarial	20	43,48	06 meses	5,62	5,69	-0,07	6,60
			12 meses	-0,17	11,01	-11,18	12,82
			24 meses	20,35	20,67	-0,32	9,47
			36 meses	30,36	32,97	-2,61	8,61
Maior rentabilidade da Carteira	5,08	2018-10	Desde 30/12/2016	44,41	41,82	2,59	8,16
Menor rentabilidade da Carteira	-8,71	2020-03					

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.	0,13 -0,08	4,61 -0,10	0,36 -0,14	4,66 -0,15	5,49 -0,22	19,92 -0,35	30,73 -0,74
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,15 97,45	1,87 76,68	0,44 92,45	1,29 114,88	2,58 80,46	8,86 92,13	15,89 94,61
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	-0,00 -0,32	0,38 15,71	-3,55 -748,56	4,37 389,24	-0,41 -12,91	28,07 291,97	40,76 242,73
ITAÚ SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI % do CDI	0,12 75,10	2,14 87,72	0,28 58,72	0,89 79,52	2,89 89,88	9,12 94,80	16,09 95,82
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+ Var. IMA-B 5+ p.p.	0,21 -0,01	-5,11 -0,76	-6,03 -0,11	4,67 -0,23	-6,64 -0,79	27,47 -1,52	40,87 -2,14
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,08 -0,78	2,55 0,33	-0,28 -2,03	1,25 -0,74	3,26 -0,66	17,36 10,81	25,35 13,94
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,19 -0,02	-0,81 -0,30	-3,15 -0,07	4,68 -0,13	-1,41 -0,40	24,69 -0,78	37,24 -1,15
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,15 -0,06	1,15 1,66	-3,69 -0,61	5,07 0,26	-0,43 0,58	27,55 2,08	41,26 2,88
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,07 -0,07	1,78 -0,17	-1,70 -0,31	2,07 -0,07	1,80 -0,37	17,32 0,22	27,46 0,26
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,15 0,12	5,00 -0,45	0,98 -0,11	4,98 0,13	6,16 -0,57	18,25 -1,35	29,01 -2,25
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,20 -0,02	-0,73 -0,23	-3,19 -0,11	4,62 -0,19	-1,29 -0,28	24,83 -0,64	37,31 -1,07
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	0,22 -0,00	-4,61 -0,27	-5,99 -0,06	4,76 -0,14	-6,25 -0,40	27,85 -1,13	41,32 -1,69
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI Var. IMA-B 5+ p.p.	0,21 -0,01	-4,69 -0,35	-5,96 -0,04	4,68 -0,22	-6,23 -0,37	27,83 -1,15	40,92 -2,10
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV % do CDI	0,07 42,62	1,18 48,47	0,16 33,01	0,46 40,87	1,77 55,16	7,95 82,70	14,80 88,16
BRADERCO FIA DIVIDENDOS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,93 -1,58	-25,69 -5,12	-10,79 -2,15	7,18 -4,16	-20,35 -9,77	-5,29 -29,79	14,17 -16,79
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-1,73 -1,04	-5,68 13,08	-5,06 3,65	25,13 8,42	1,35 13,73	39,74 32,27	63,12 36,69
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-1,29	-17,41	-8,96	14,80	-11,41	24,55	20,68

**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.	-0,60	1,35	-0,26	-1,91	0,97	17,08	-5,76
AZ QUEST ACOES FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-0,62 0,06	-18,20 0,56	-8,62 0,09	19,50 2,79	-12,58 -0,20	6,60 -0,87	33,64 7,21
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-2,39 -1,71	-22,25 -3,49	-8,59 0,11	20,63 3,93	-7,79 4,58	31,53 24,06	27,62 1,18
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO % do CDI	0,16 100,68	1,71 70,26	-0,43 -90,15	0,84 75,15	2,55 79,45	9,42 97,92	16,12 95,98
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	-2,30 -1,61	-1,22 17,53	-0,60 8,11	11,39 -5,31	5,21 17,58	21,82 14,35	33,51 7,07
SÃO VICENTE - CONSOLIDADO Var. INPC + 6% p.p.	-0,23 -1,62	-1,81 -9,85	-2,78 -6,41	5,62 -0,07	-0,17 -11,18	20,35 -0,32	30,36 -2,61
CDI	0,16	2,44	0,47	1,12	3,21	9,62	16,79
IBOVESPA	-0,69	-18,76	-8,71	16,70	-12,37	7,47	26,44
INPC + 6%	1,38	8,05	3,63	5,69	11,01	20,67	32,97
IPCA + 6%	1,35	7,28	3,24	5,03	10,10	19,67	32,57

## 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	0,16	3,29	0,43	1,38	4,06	11,49	19,36
IRF-M 1+	-0,61	4,76	-2,63	1,75	4,63	23,41	36,20
IRF-M TOTAL	-0,33	4,27	-1,63	1,64	4,44	19,78	31,08
IMA-B 5	0,20	4,72	0,50	4,81	5,71	20,28	31,47
IMA-B 5+	0,22	-4,35	-5,92	4,90	-5,85	28,98	43,02
IMA-B TOTAL	0,21	-0,51	-3,08	4,81	-1,00	25,47	38,38
IMA-C TOTAL	2,81	21,09	8,08	19,98	20,18	45,58	72,54
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,00	1,96	-1,39	2,13	2,16	17,10	27,20
IMA-GERAL TOTAL	0,09	2,49	-1,11	2,64	2,67	17,87	28,36
IDKA 2	0,04	5,45	1,09	4,85	6,73	19,60	31,26
IDKA 20	0,68	-11,22	-9,64	5,97	-13,27	34,55	50,97
CDI	0,16	2,44	0,47	1,12	3,21	9,62	16,79
<b>Renda Variável</b>							
IBOVESPA	-0,69	-18,76	-8,71	16,70	-12,37	7,47	26,44
IBRX 100	-0,55	-17,87	-8,31	17,55	-11,05	11,01	29,92
IBRX 50	-0,54	-18,50	-8,37	18,20	-12,42	5,25	23,91
SMALL CAP	-2,28	-20,78	-8,74	20,16	-6,17	34,08	41,52
IFIX	-1,01	-13,47	1,23	6,27	-0,90	23,38	24,28
Índice Consumo - ICON	-2,86	-11,86	-8,08	17,23	-1,94	42,20	27,52
Índice Dividendos - IDIV	0,65	-20,56	-8,64	11,34	-10,58	24,50	30,96
<b>Indicadores Econômicos</b>							
IPCA	0,86	2,22	1,75	1,99	3,92	6,55	11,41
INPC	0,89	2,95	2,13	2,63	4,77	7,45	11,75
IGPM	3,23	18,10	10,67	15,22	20,93	24,74	38,21
SELIC	0,16	2,44	0,47	1,12	3,21	9,62	16,80
<b>Meta Atuarial</b>							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

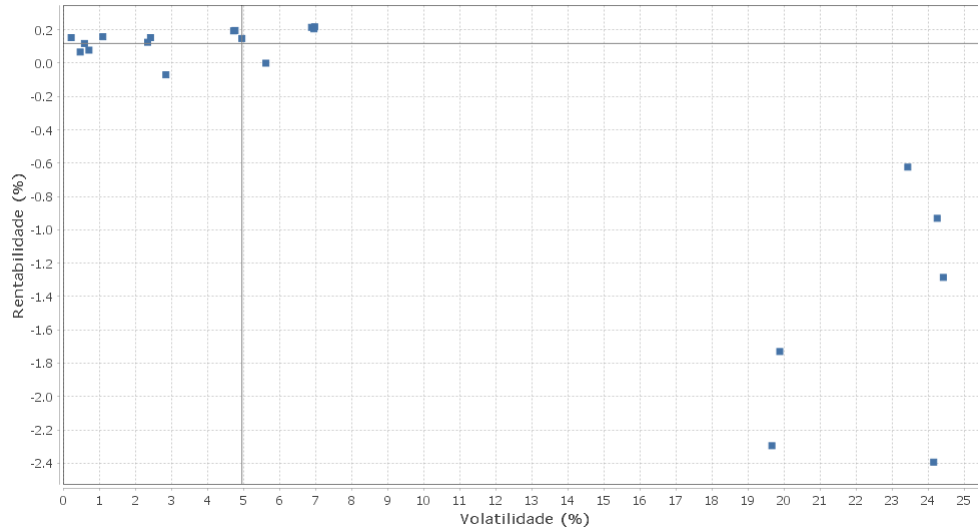
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
229	01/10/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	62.999,44	0,00	1.296,79460606	48,5808930000
219	01/10/2020	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.175.003,95	0,00	505.072,39274985	2,3264070000
230	07/10/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	10.300,00	212,34831862	48,5052110000
231	08/10/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	30.314,67	0,00	624,92297892	48,5094500000
232	09/10/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	119.113,88	0,00	2.454,50898870	48,5285980000
220	09/10/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	20.000,00	5.773,73039277	3,4639650000
224	09/10/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	7.066,10	0,00	393,71057100	17,9474480000
233	15/10/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	14.484,07	297,88729537	48,6226510000
222	20/10/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	11.020,23	3.165,34110003	3,4815300000
221	20/10/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	3.722,96	1.069,34594848	3,4815300000
225	22/10/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	47.410,63	0,00	2.639,11444052	17,9645980000
234	23/10/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	1.500,00	30,84262166	48,6339980000
235	27/10/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,00	16.500,00	339,22892648	48,6397200000
223	28/10/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	235.091,61	67.994,66146214	3,4575010000
227	29/10/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	66.221,18	0,00	3.685,05648854	17,9701940000
226	29/10/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	33.000,00	0,00	1.836,37416491	17,9701940000
236	30/10/2020	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	90.186,28	0,00	1.853,79836218	48,6494550000
228	30/10/2020	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	67.130,60	0,00	3.735,51000385	17,9709330000

**Total**

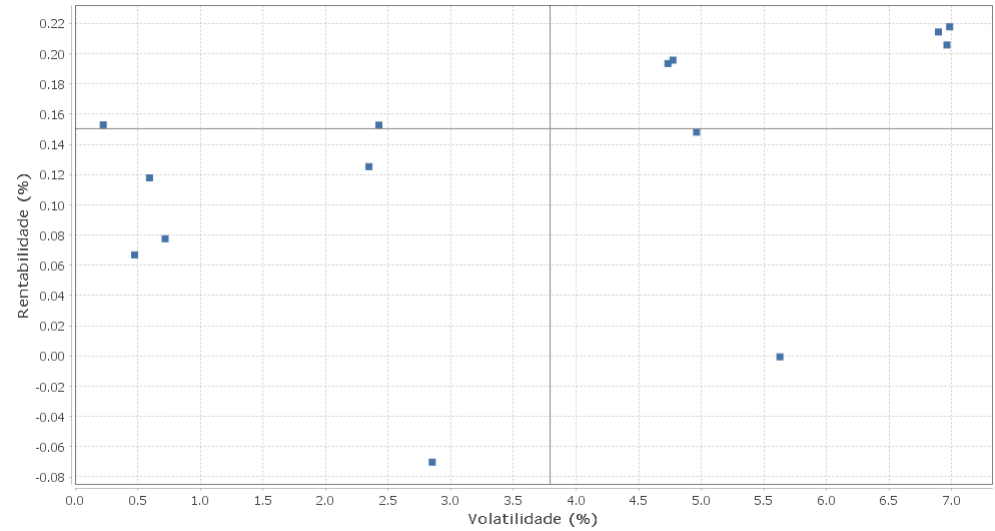
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

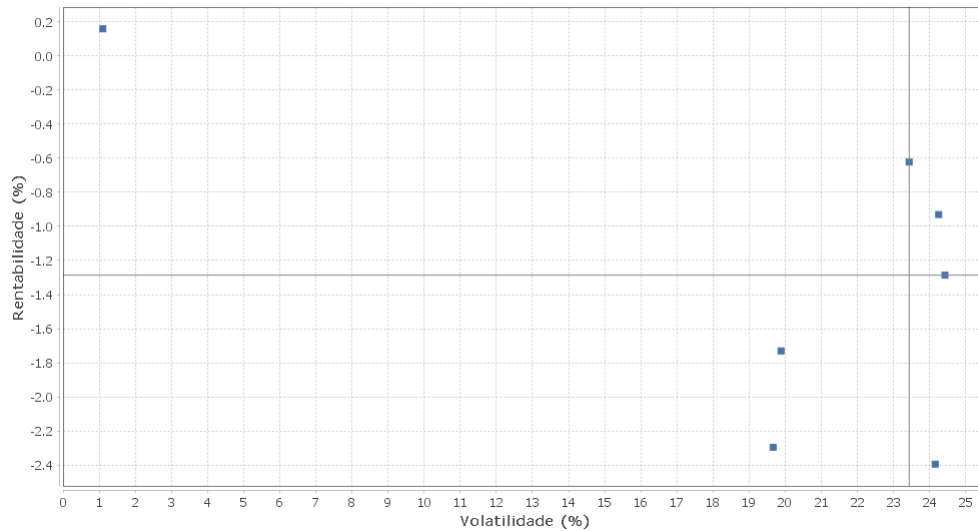
SÃO VICENTE - CONSOLIDADO - No Mês



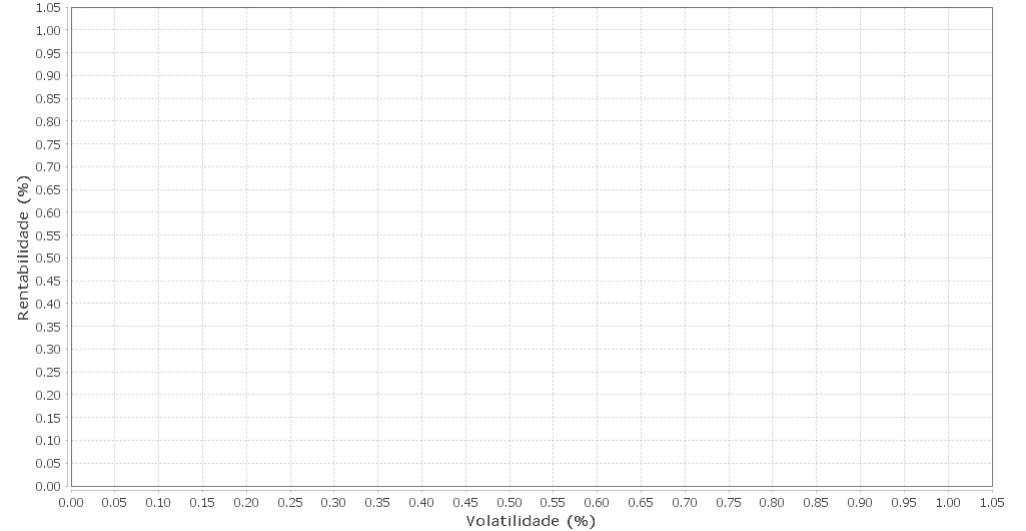
Renda Fixa - No Mês



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\$): 5.098.088,11

Value-At-Risk: 2,94%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	Artigo 7º IV, Alínea a	0,22	0,05	-0,00	-0,02	0,15	760.562,07	0,44
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	Artigo 7º VII, Alínea b	0,48	0,25	-0,00	-0,19	0,07	1.057.900,89	0,61
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,59	0,08	0,00	-0,07	0,12	1.878.152,09	1,08
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,72	0,33	0,03	-0,11	0,08	19.120.245,07	11,04
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	1,10	0,54	0,01	0,00	0,16	2.413.119,74	1,39
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	Artigo 7º IV, Alínea a	2,35	1,07	0,07	-0,01	0,13	15.503.939,45	8,95
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,43	1,08	0,09	-0,00	0,15	23.687.263,76	13,68
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,85	1,34	0,08	-0,08	-0,07	12.340.239,34	7,13
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,73	3,16	0,47	0,01	0,19	29.351.603,56	16,95
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,77	3,15	0,06	0,01	0,20	4.056.666,64	2,34
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	4,96	2,95	0,03	-0,00	0,15	1.793.323,00	1,04
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	5,63	3,35	0,13	-0,03	-0,00	7.429.347,32	4,29
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	Artigo 7º I, Alínea b	6,89	4,87	0,15	0,01	0,21	6.196.823,24	3,58
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	Artigo 7º IV, Alínea a	6,96	4,93	0,08	0,01	0,21	3.268.926,55	1,89
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,98	4,93	0,33	0,01	0,22	13.489.035,68	7,79
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	19,66	10,23	0,33	-0,12	-2,30	10.361.420,79	5,98
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	19,88	10,10	0,33	-0,09	-1,73	6.606.745,47	3,82
AZ QUEST ACOES FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	23,43	12,01	0,05	-0,03	-0,62	851.271,06	0,49
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	24,15	11,99	0,38	-0,11	-2,39	6.464.435,27	3,73
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	24,25	10,40	0,14	-0,04	-0,93	2.803.561,13	1,62
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	24,42	10,14	0,19	-0,06	-1,29	3.740.075,35	2,16