



**LDB**  
EMPRESAS

**DIADEMA**  
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 10.02.2020.

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

74,53%

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
BRDESCO	BRDESCO	BRDESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,25	0,40	6,48	1.221.516,08	0,34	739.650.976,36	0,17
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	1,98	1,21	12,85	31.491.580,41	8,65	9.819.854.122,58	0,32
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FI	1,98	1,22	12,90	2.005.299,76	0,55	1.270.875.315,97	0,16
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,93	1,98	2,81	29.645.319,52	8,14	1.008.932.506,25	2,94
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RENDA FIXA	3,20	1,40	15,95	25.142.851,27	6,91	537.480.070,49	4,68
BB	BB	BB PREV IPCA I	2,37	1,18	14,15	16.586.403,95	4,56	503.533.691,59	3,29
BB	BB	BB PREV ALOC FIC	2,37	0,96	13,07	44.730.533,96	12,29	9.800.245.404,11	0,46
CEF	CEF	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	3,76	0,59	12,63	34.196.611,82	9,40	9.818.666.120,10	0,35
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>2,11</b>	<b>1,17</b>	<b>12,41</b>	<b>185.020.116,77</b>	<b>50,83</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
BRDESCO	BRDESCO	BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	5,05	2,01	5,31	21.062.635,65	5,79	1.900.404.411,61	1,11
BB	BB	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,05	0,35	5,74	7.030.896,64	1,93	2.851.366.973,39	0,25
BRDESCO	BRDESCO	BRDESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	2,21	0,85	10,03	45.118.622,03	12,40	1.115.373.957,19	4,05
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>2,07</b>	<b>1,13</b>	<b>10,51</b>	<b>73.212.154,32</b>	<b>20,11</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
BB	BB	BB CRED PRIV III	1,70	1,10	12,20	9.370.175,40	2,57	585.025.878,87	1,60
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	0,17	0,27	1,62	3.658.154,78	1,01	136.319.272,73	2,68
<b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b</b>			<b>1,47</b>	<b>0,87</b>	<b>11,47</b>	<b>13.028.330,18</b>	<b>3,58</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

2,07

1,14

12,03

271.260.601,27

74,53

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

25,47%

## 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
ICATU VANGUARDA	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	14,58	7,51	31,74	15.660.576,65	4,30	2.163.582.480,78	0,72
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	17,86	10,83	49,67	9.335.517,30	2,56	1.491.876.431,54	0,63
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	16,60	7,19	30,22	6.510.859,03	1,79	1.723.423.208,96	0,38
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	18,23	7,40	35,45	4.343.586,49	1,19	583.652.398,75	0,74
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	17,47	10,21	39,84	26.918.508,98	7,40	2.457.745.616,59	1,10
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>16,76</b>	<b>9,10</b>	<b>39,59</b>	<b>62.769.048,45</b>	<b>17,25</b>		

## Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	12,91	2,62	32,29	21.403.713,38	5,88	804.084.944,48	2,66
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>12,91</b>	<b>2,62</b>	<b>21,46</b>	<b>21.403.713,38</b>	<b>5,88</b>		

## Artigo 8º IV, Alínea a (Fundos de Participações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
PÁTRIA	PÁTRIA	PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FI EM PARTICIPAÇÕES	48,41	-38,33	-38,93	2.560.786,58	0,70	572.786.978,20	0,45
CEF	CEF	FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	159,49	-0,58	-67,44	229.414,09	0,06	22.795.921,32	1,01
<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a</b>			<b>49,40</b>	<b>-36,34</b>	<b>-41,74</b>	<b>2.790.200,67</b>	<b>0,77</b>		

## Artigo 8º IV, Alínea b (Fundos de Investimentos Imobiliários)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
RIO BRAVO	RIO BRAVO	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	16,43	0,82	-7,78	4.074.126,16	1,12	84.334.411,42	4,83
BRPP	GERAÇÃO FUTURO	BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	13,78	9,90	19,49	1.678.584,52	0,46	298.660.472,78	0,56

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b</b>	<b>17,02</b>	<b>3,31</b>	<b>20,00</b>	<b>5.752.710,68</b>	<b>1,58</b>
Renda Variável e Investimentos Estruturados	10,55	4,95	28,21	92.715.673,18	25,47
<b>Total</b>				<b>363.976.274,45</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	185.020.116,77	50,83	15,00	35,00	70,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	73.212.154,32	20,11	5,00	20,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	13.028.330,18	3,58	0,00	2,50	5,00	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>271.260.601,27</b>	<b>74,53</b>				
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	62.769.048,45	17,25	2,00	12,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	21.403.713,38	5,88	2,00	8,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	2.790.200,67	0,77	1,00	2,50	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	5.752.710,68	1,58	1,00	2,50	5,00	5,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>92.715.673,18</b>	<b>25,47</b>				

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Rentabilidades por Artigo**

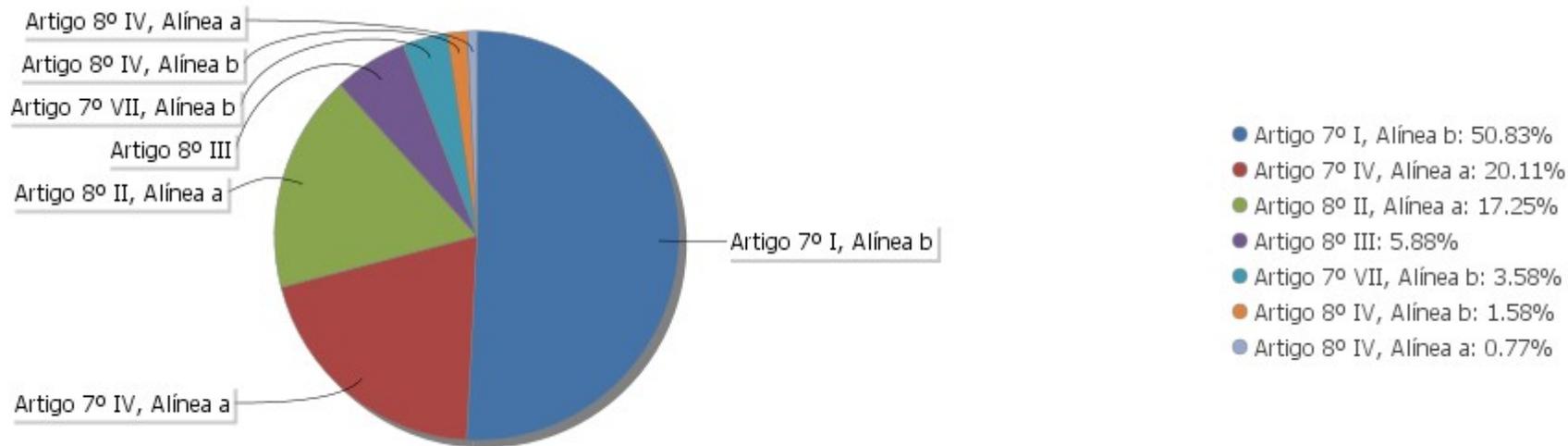
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,17 311,02	12,41 208,29	2,26 181,95	5,04 179,89	12,41 208,29	2.208.106,44	27.329.738,98
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	1,13 302,28	10,51 176,36	2,04 164,95	4,78 170,90	10,51 176,36	814.047,73	6.177.359,75
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,87 231,28	11,47 192,50	1,90 153,08	4,44 158,42	11,47 192,50	111.933,99	1.077.344,93
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	9,10 2,25	39,59 8,01	13,06 2,66	21,84 7,30	39,59 8,01	5.235.495,40	16.375.253,59
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	2,62 -4,23	21,46 -10,13	7,39 -3,02	9,06 -5,48	21,46 -10,13	545.756,95	4.388.893,00
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-36,34 -43,19	-41,74 -73,32	-36,47 -46,88	-41,43 -55,97	-41,74 -73,32	-1.593.096,80	-1.962.588,33
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	3,31 -3,54	20,00 -11,58	8,94 -1,46	9,59 -4,95	20,00 -11,58	184.688,32	1.060.974,91
						7.506.932,03	54.446.976,83

**Análise de Liquidez**

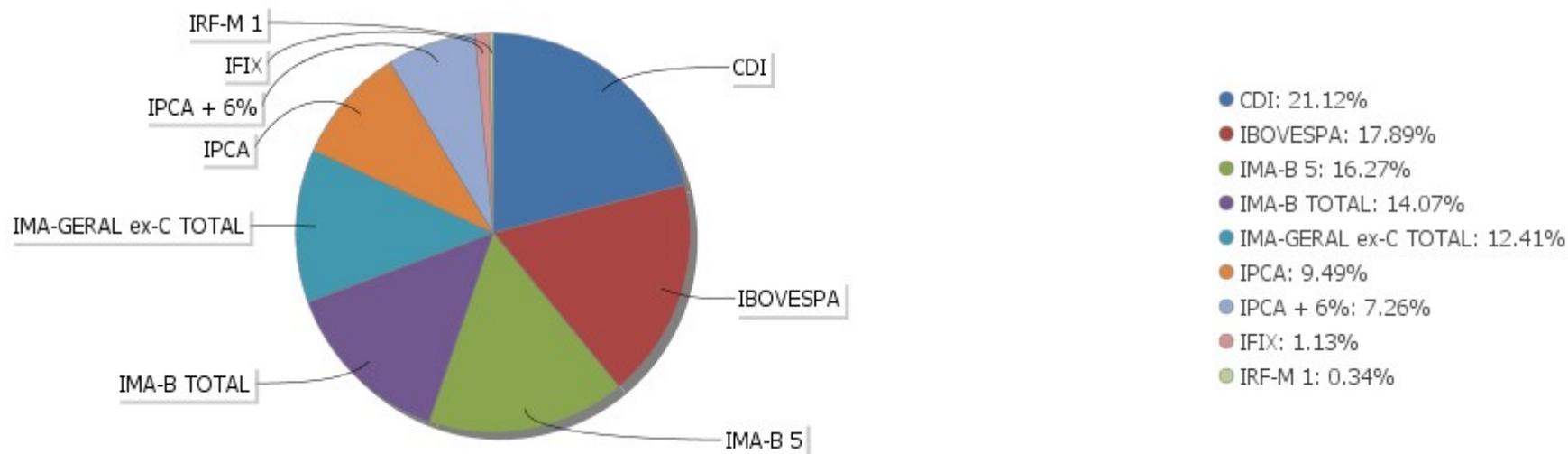
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	324.873.923,33	89,26	324.873.923,33	89,26
de 31 a 364 dias	6.510.859,03	1,79	331.384.782,36	91,05
acima de 365 dias	32.591.492,09	8,95	363.976.274,45	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

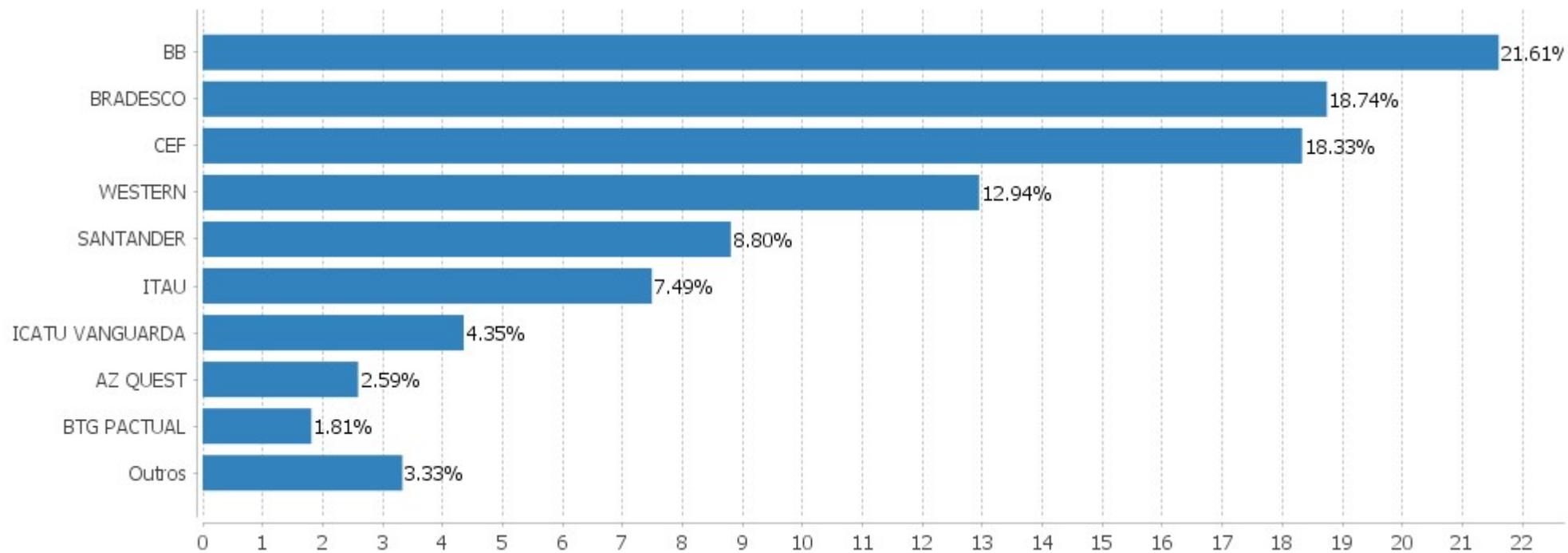


Alocação Por Estratégia



## 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	1,96	0,42	0,53	1,12	1,29	2,25	1,43	0,12	1,52	1,92	-0,27	2,07	15,31
IPCA + 6%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	1,12	-0,47	-0,67	0,06	0,65	1,80	0,71	-0,50	1,07	1,28	-1,24	0,43	4,72

**PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL**

**RELATÓRIO TRIMESTRAL**

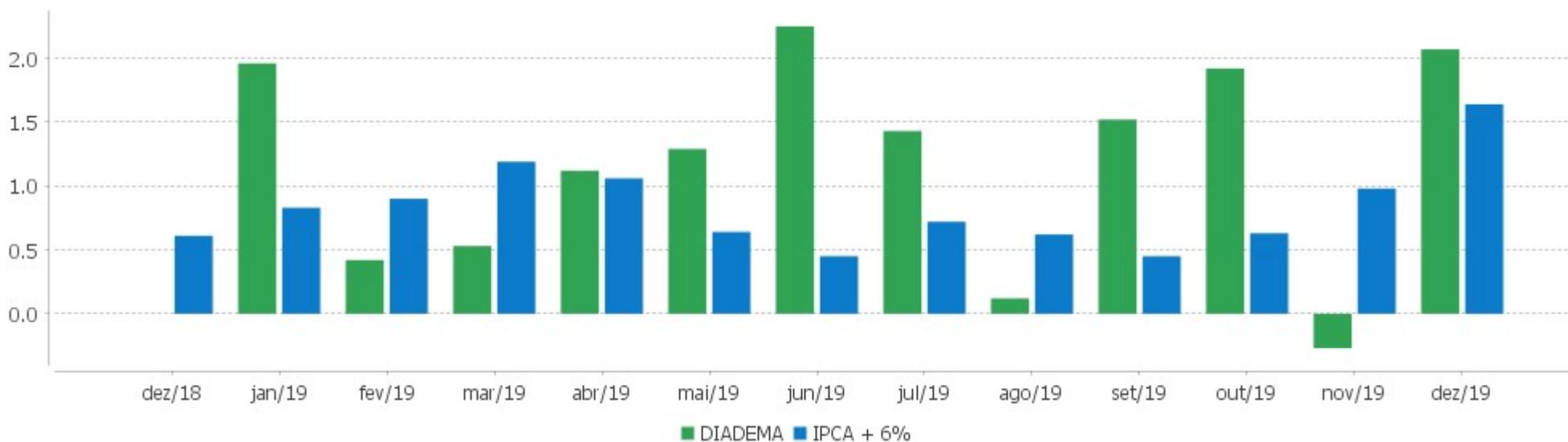
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	8	66,67	03 meses	3,75	3,28	0,47	3,45
Meses abaixo da Meta Atuarial	4	33,33	06 meses	6,97	5,15	1,82	3,58
			12 meses	15,31	10,59	4,72	3,32
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,25	2019-06					
Menor rentabilidade da Carteira	-0,27	2019-11	Desde 31/12/2018	15,31	10,59	4,72	3,32

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
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RENDA FIXA Var. IMA-B 5 p.p.	1,40 0,17	15,95 2,79	2,84 0,22	5,98 0,50	15,95 2,79	29,58 5,26	47,88 7,93
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B 5 p.p.	1,21 -0,03	12,85 -0,30	2,52 -0,10	5,31 -0,17	12,85 -0,30	23,77 -0,55	39,09 -0,86
SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,22 -0,02	12,90 -0,26	2,56 -0,06	5,35 -0,12	12,90 -0,26	23,79 -0,53	39,12 -0,84
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6% p.p.	1,18 -0,46	14,15 3,56	2,45 -0,83	5,43 0,29	14,15 3,56	26,26 4,70	43,86 11,30
BB PREV ALOC FIC 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
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,40 -0,02	6,48 -0,28	1,31 -0,07	3,18 -0,14	6,48 -0,28	13,63 -0,57	26,04 -0,87
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF Var. IPCA p.p.	0,59 -0,56	16,43 12,13	1,80 0,03	4,97 2,94	16,43 12,13	25,53 17,32	39,61 28,21
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,98 -0,02	22,58 -0,37	2,78 -0,07	6,57 -0,15	22,58 -0,37	38,26 -0,75	55,67 -1,12
BB CRED PRIV III Var. IPCA + 6% p.p.	1,10 -0,54	12,20 1,61	2,43 -0,85	5,12 -0,03	12,20 1,61	24,52 2,96	43,08 10,52
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	0,27	5,36	0,55	2,07	5,36	12,61	24,34
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,01 0,00	22,85 -0,10	2,85 0,01	6,66 -0,06	22,85 -0,10	38,66 -0,35	56,63 -0,16
BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,35 94,44	5,74 96,34	1,14 91,79	2,65 94,83	5,74 96,34	12,44 97,46	23,77 99,24
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA % do CDI	0,85 226,08	12,43 208,62	1,81 145,88	4,38 156,48	12,43 208,62	23,11 181,08	
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA Var. IPCA + 6% p.p.	-0,58 -2,23	-67,41 -78,00	-1,36 -4,64	-67,28 -72,42	-67,41 -78,00	-67,91 -89,47	-62,81 -95,37
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FI EM PARTICIPAÇÕES % do CDI	-38,33 -10.230,12	-38,93 -653,18	-38,43 -3.100,99	-38,61 -1.379,07	-38,93 -653,18	-38,23 -299,53	-37,31 -155,74
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO Var. IFIX p.p.	-0,02 -10,65	-7,78 -43,76	3,13 -16,00	-12,04 -33,80	-7,78 -43,76	-15,86 -59,47	-4,50 -75,99
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11 Var. IBOVESPA p.p.	9,00 2,15	19,49 -12,09	15,07 4,67	13,95 -0,59	19,49 -12,09	14,89 -36,47	38,84 -53,18

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	7,19 0,34	39,23 7,65	9,97 -0,44	18,71 4,17	39,23 7,65	68,43 17,06	118,49 26,47
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	10,21 3,36	39,84 8,25	14,53 4,13	21,51 6,98	39,84 8,25	76,22 24,86	135,61 43,59
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	10,83 3,98	49,67 18,09	19,61 9,20	34,48 19,94	49,67 18,09	89,25 37,89	166,63 74,61
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	7,51 0,66	42,62 11,03	10,02 -0,39	17,23 2,69	42,62 11,03	73,48 22,11	110,31 18,29
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	7,40 0,55	35,45 3,86	7,15 -3,25	19,63 5,09	35,45 3,86	66,40 15,03	109,26 17,25
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	2,62 698,31	32,29 541,85	8,83 712,04	11,25 401,81	32,29 541,85	29,08 227,87	67,09 280,06
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							
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	7,32	3,09	2,80	7,32	15,42	14,81
SELIC	0,37	5,96	1,24	2,80	5,96	12,77	23,98
<b>Meta Atuarial</b>							
IPCA + 4%	1,48	8,50	2,79	4,12	8,50	17,02	25,23

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

IPCA + 5%	1,56	9,54	3,04	4,63	9,54	19,28	28,86
IPCA + 5,5%	1,60	10,07	3,16	4,89	10,07	20,42	30,70
IPCA + 5,89%	1,63	10,47	3,26	5,09	10,47	21,31	32,15
IPCA + 6%	1,64	10,59	3,28	5,15	10,59	21,56	32,56
INPC + 4%	1,55	8,68	2,83	4,06	8,68	16,87	24,00
INPC + 6%	1,71	10,78	3,33	5,09	10,78	21,40	31,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
02/12/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	4.463,73292700	2,2402774010
04/12/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	15.000,00	6.693,56014200	2,2409599200
05/12/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	75.000,00	33.462,01082700	2,2413476700
05/12/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.588.096,44	708.545,33692200	2,2413476700
05/12/2019	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,00	3.450.338,50	1.390.617,42918360	2,4811558000
06/12/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.768.731,18	0,00	789.000,25436800	2,2417371480
06/12/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	22.304,13143900	2,2417371480
06/12/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	836,52	373,15704100	2,2417371480
06/12/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.985.163,48	885.546,94370400	2,2417371480
09/12/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.769.050,97	789.000,25345000	2,2421424610
10/12/2019	BB PREV ALOC FIC	1.769.050,97	0,00	1.220.414,95832500	1,4495487440
12/12/2019	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	0,00	5.000.000,00	1.676.084,58328600	2,9831430000
12/12/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.520.640,81	0,00	1.123.613,17889300	2,2433350350
12/12/2019	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,00	197.158,29	79.362,39754770	2,4842784000
13/12/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	40.000,00	17.826,61137100	2,2438364290
13/12/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	288.616,06	128.626,15842700	2,2438364290
13/12/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.800.000,00	802.197,51169700	2,2438364290
13/12/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	144.308,03	0,00	64.313,07921300	2,2438364290
17/12/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	255.870,57	0,00	113.995,56920000	2,2445659230
18/12/2019	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	0,00	5.000.000,00	1.678.033,66555900	2,9796780000
19/12/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	150.000,00	66.806,61164200	2,2452867510
19/12/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.847.250,00	822.723,42237700	2,2452867510
19/12/2019	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	176.138,70	0,00	70.858,75702660	2,4857718000
20/12/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	22.265,41085500	2,2456356330
20/12/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	25.000,00	11.132,70542800	2,2456356330
20/12/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.971.619,21	0,00	1.323.286,45232100	2,2456356330
26/12/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.443.000,00	0,00	1.087.361,74004000	2,2467224200
26/12/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.406.380,58	1.071.062,69941400	2,2467224200

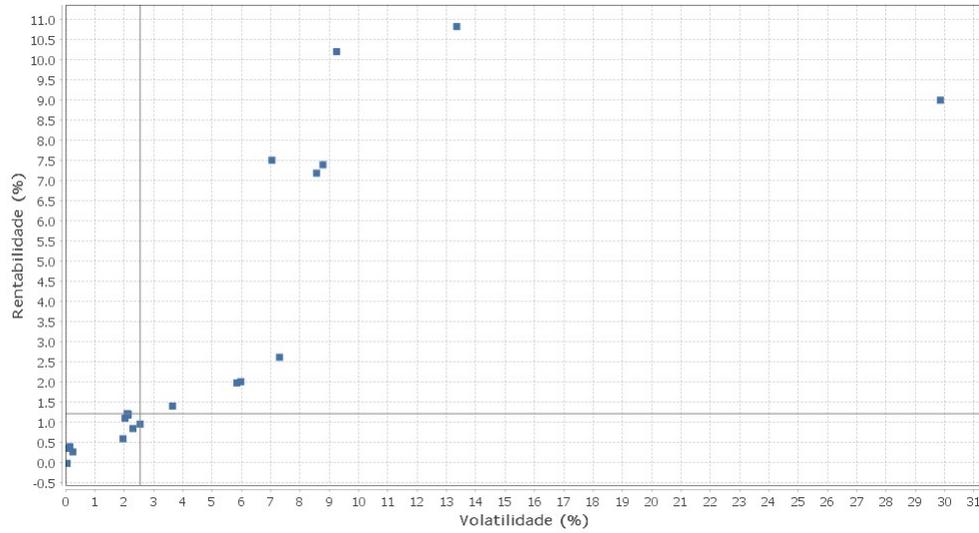
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

26/12/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	85.445,73	38.031,28025000	2,2467224200
27/12/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.339.455,42	0,00	596.083,10567700	2,2470950900
27/12/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	59.477,20	0,00	26.468,48380500	2,2470950900

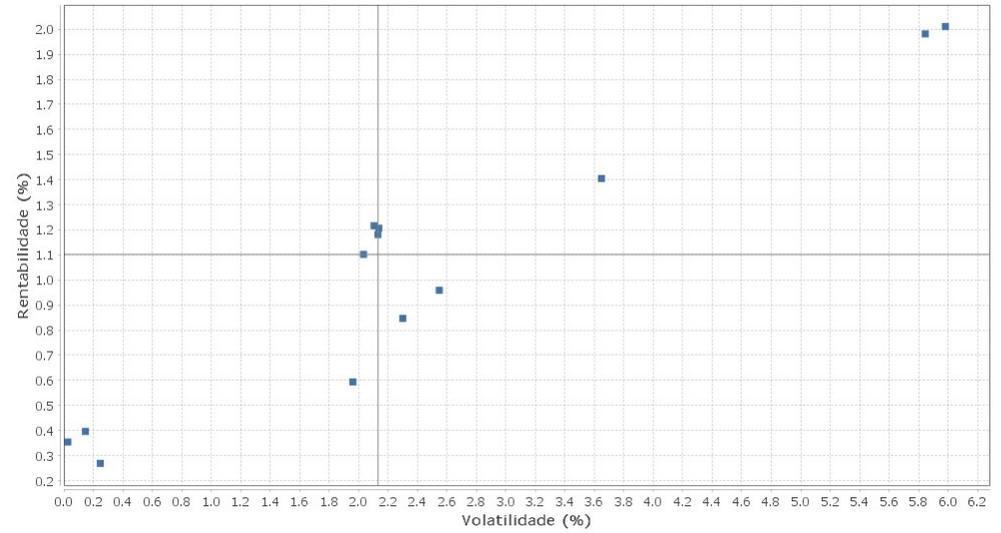
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

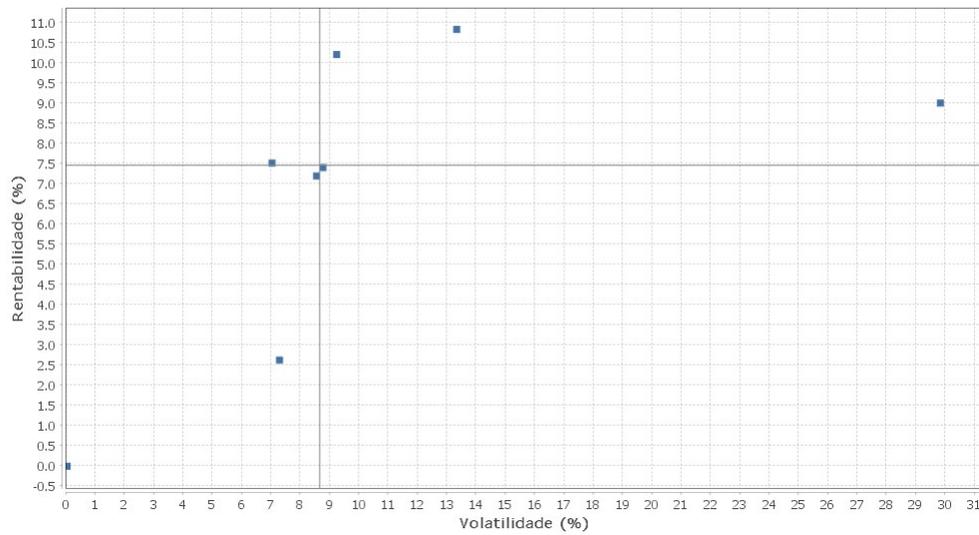
DIADEMA - No Mês



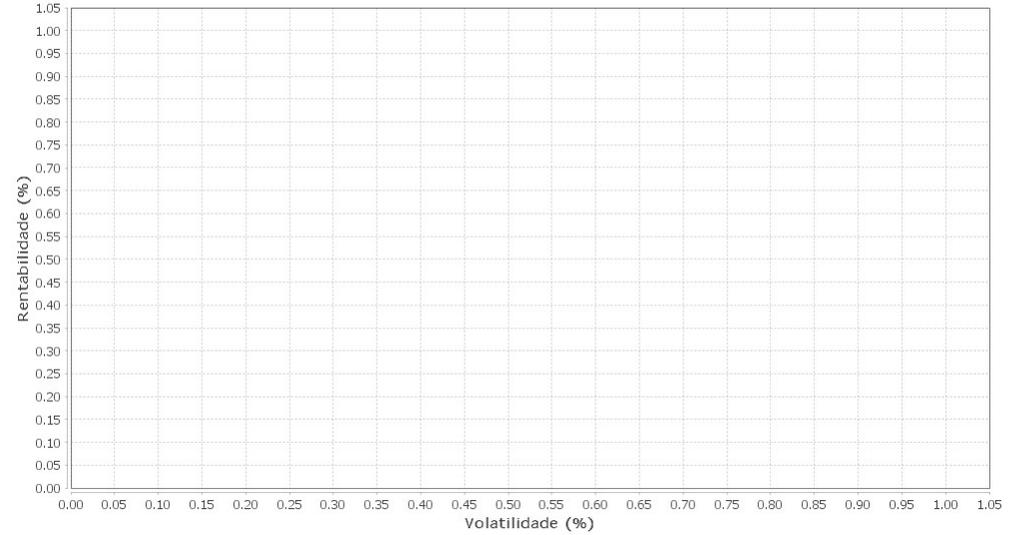
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,02	0,35	7.030.896,64	1,93
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	Artigo 8º IV, Alínea b	0,05	0,00	-0,02	4.074.126,16	1,12
BRADERCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	Artigo 7º I, Alínea b	0,15	0,03	0,40	1.221.516,08	0,34
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	Artigo 7º VII, Alínea b	0,25	0,04	0,27	3.658.154,78	1,01
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,96	0,23	0,59	34.196.611,82	9,40
BB CRED PRIV III	Artigo 7º VII, Alínea b	2,03	0,26	1,10	9.370.175,40	2,57
SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,11	0,28	1,22	2.005.299,76	0,55
BB PREV IPCA I	Artigo 7º I, Alínea b	2,13	0,28	1,18	16.586.403,95	4,56
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	2,14	0,28	1,21	31.491.580,41	8,65
BRADERCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	Artigo 7º IV, Alínea a	2,30	0,28	0,85	45.118.622,03	12,40
BB PREV ALOC FIC	Artigo 7º I, Alínea b	2,55	0,31	0,96	44.730.533,96	12,29
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	3,65	0,44	1,40	25.142.851,27	6,91
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,85	0,70	1,98	29.645.319,52	8,14
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	5,98	0,71	2,01	21.062.635,65	5,79
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	7,05	1,07	7,51	15.660.576,65	4,30
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	7,30	0,88	2,62	21.403.713,38	5,88
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	8,57	1,22	7,19	6.510.859,03	1,79
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	8,78	1,25	7,40	4.343.586,49	1,19
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	9,25	1,42	10,21	26.918.508,98	7,40
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	13,35	1,87	10,83	9.335.517,30	2,56
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11	Artigo 8º IV, Alínea b	29,85	3,50	9,00	1.678.584,52	0,46

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Observações**

No respectivo mês, dezembro de 2019, observar que:

- O percentual alocado no Artigo 8, Inciso IV, Alínea A (0,77% dos recursos) está inferior ao limite mínimo estipulado em Política de Investimentos.