



LDB
EMPRESAS

DIADEMA
NOVEMBRO 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 08.01.2020.

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

76,04%

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	0,31	6,06	4.685.359,12	1,27	685.399.278,77	0,68
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	1,93	-0,34	11,51	41.047.729,60	11,13	9.996.525.968,83	0,41
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FI	1,92	-0,30	11,54	1.981.200,22	0,54	1.298.833.749,12	0,15
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,71	-2,48	0,82	29.069.463,49	7,88	1.030.045.605,16	2,82
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RENDA FIXA	3,12	-1,01	14,34	24.794.624,69	6,72	487.496.231,60	5,09
BB	BB	BB PREV IPCA I	2,36	-0,38	12,82	16.392.775,71	4,44	497.655.483,13	3,29
BB	BB	BB PREV ALOC FIC	2,29	-0,94	12,00	42.548.276,50	11,53	9.385.285.182,14	0,45
CEF	CEF	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	3,74	-0,51	11,97	33.994.888,12	9,22	9.094.359.000,50	0,37
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,03	-0,88	11,12	194.514.317,45	52,73		

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
BRDESCO	BRDESCO	BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	4,82	-2,56	3,24	20.647.602,04	5,60	1.864.594.011,71	1,11
BB	BB	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,04	0,34	5,37	7.693.620,49	2,09	2.711.296.282,19	0,28
BRDESCO	BRDESCO	BRDESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	2,16	-0,94	9,10	44.739.621,42	12,13	1.015.325.062,17	4,41
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,94	-1,23	9,27	73.080.843,95	19,81		

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	1,65	-0,19	10,98	9.268.053,64	2,51	578.649.918,09	1,60
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	0,16	0,09	1,34	3.648.342,55	0,99	164.390.136,65	2,22
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			1,48	-0,11	10,51	12.916.396,19	3,50		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

1,91

-0,94

10,77

280.511.557,59

76,04

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

23,96%

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	14,88	0,46	22,54	14.566.220,37	3,95	2.037.041.662,03	0,72
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	18,16	4,14	35,05	8.423.448,39	2,28	1.349.430.352,56	0,62
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	17,08	0,24	21,48	6.074.082,29	1,65	1.600.410.389,56	0,38
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	18,59	-1,16	26,12	4.044.375,29	1,10	531.487.836,61	0,76
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	17,82	3,00	26,89	24.425.426,71	6,62	2.239.240.686,39	1,09
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			17,27	1,91	27,95	57.533.553,05	15,60		

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 LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1,67	-0,55	3,07	0,00	0,00	218.157.616,17	0,00
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	14,29	3,84	28,92	20.857.956,43	5,65	758.586.898,64	2,75
Sub-total Artigo 8º III			8,07	2,90	18,36	20.857.956,43	5,65		

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	0,22	-0,07	-0,97	4.152.533,97	1,13	572.786.978,20	0,72
CEF	CEF	FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	159,80	-0,35	-67,25	230.763,50	0,06	22.795.921,32	1,01
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			20,72	-0,08	-8,47	4.383.297,47	1,19		

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	16,48	-0,62	-7,77	4.074.760,45	1,10	84.347.541,34	4,83
BRPP	GERAÇÃO	BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII -	11,53	2,83	9,62	1.539.996,91	0,42	274.002.410,07	0,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUTURO	BPFF11					
	Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b	17,59	0,30	16,15	5.614.757,36	1,52
	Renda Variável e Investimentos Estruturados	10,65	2,02	22,16	88.389.564,31	23,96
	Total				368.901.121,90	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	194.514.317,45	52,73	15,00	35,00	70,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	73.080.843,95	19,81	5,00	20,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	12.916.396,19	3,50	0,00	2,50	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	280.511.557,59	76,04				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	57.533.553,05	15,60	2,00	12,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	20.857.956,43	5,65	2,00	8,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	4.383.297,47	1,19	1,00	2,50	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	5.614.757,36	1,52	1,00	2,50	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	88.389.564,31	23,96				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

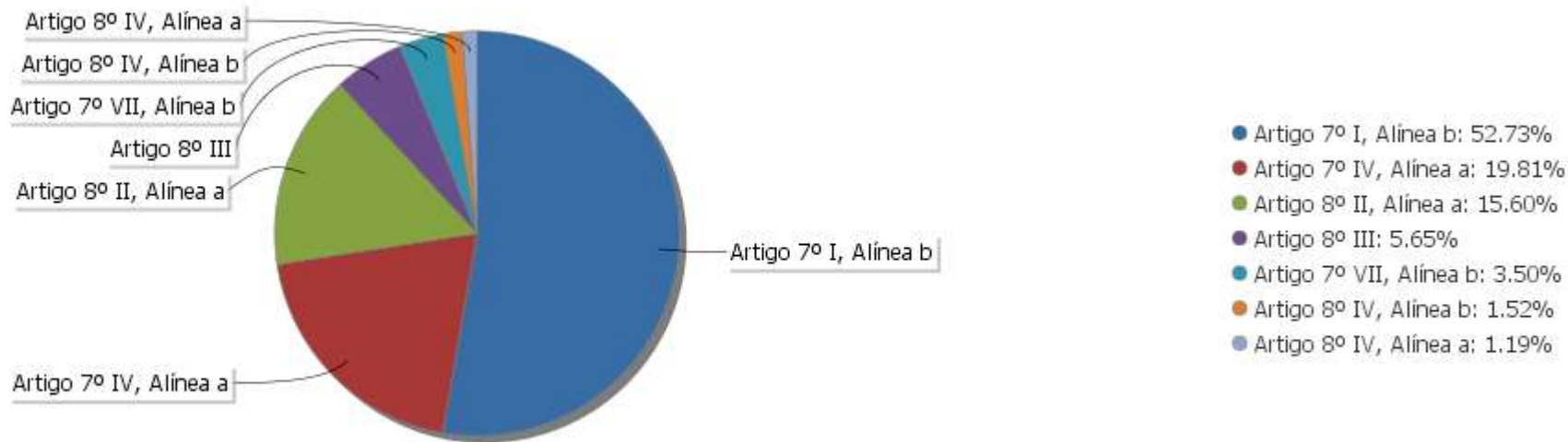
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,88 -232,51	11,12 199,83	2,82 211,79	5,66 195,32		-1.773.843,03	25.121.632,54
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-1,23 -322,09	9,27 166,66	2,73 205,73	5,38 185,87		-933.003,19	5.363.312,02
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	-0,11 -29,22	10,51 188,97	2,34 176,06	4,89 168,83		-14.372,59	965.410,94
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	1,91 0,97	27,95 4,80	4,23 -2,79	17,14 5,59		1.080.087,29	11.139.758,19
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	2,90 1,96	18,36 -4,79	5,88 -1,13	10,90 -0,64		610.902,74	3.843.136,05
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,08 -1,03	-8,47 -31,62	-10,60 -17,62	-8,06 -19,61		-3.558,01	-369.491,53
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	0,30 -0,64	16,15 -7,00	16,22 9,21	8,57 -2,98		17.194,22	876.286,59
						-1.016.592,57	46.940.044,80

Análise de Liquidez

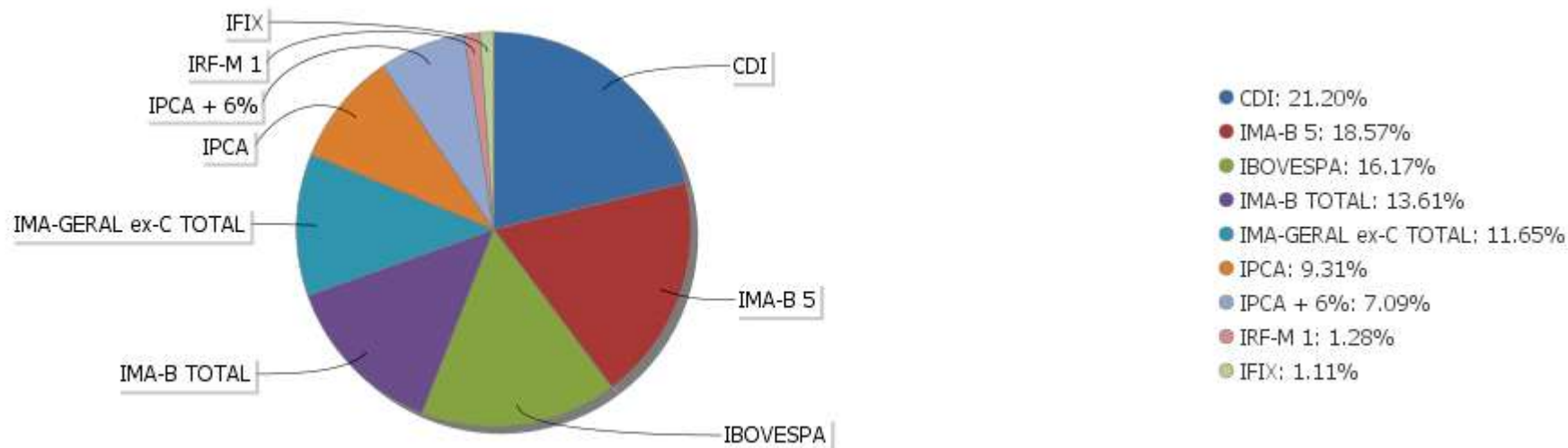
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	328.938.915,84	89,17	328.938.915,84	89,17
de 31 a 364 dias	6.074.082,29	1,65	335.012.998,13	90,81
acima de 365 dias	33.888.123,77	9,19	368.901.121,90	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

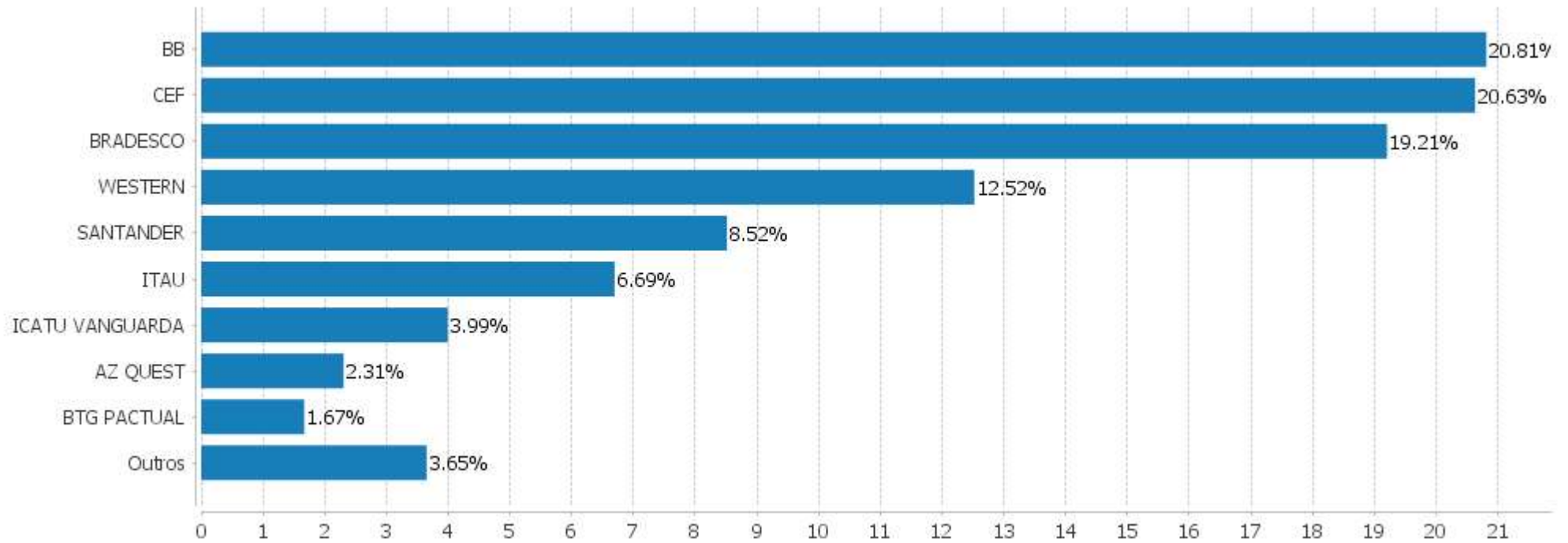


Alocação Por Estratégia



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		12,97
IPCA + 6%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98		8,80
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		4,17
2018			0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IPCA + 6%			0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	8,25
p.p. indexador			-0,58	-0,71	-0,89	-1,75	-0,84	-0,44	-0,92	-0,96	-0,25	-0,61	-8,25

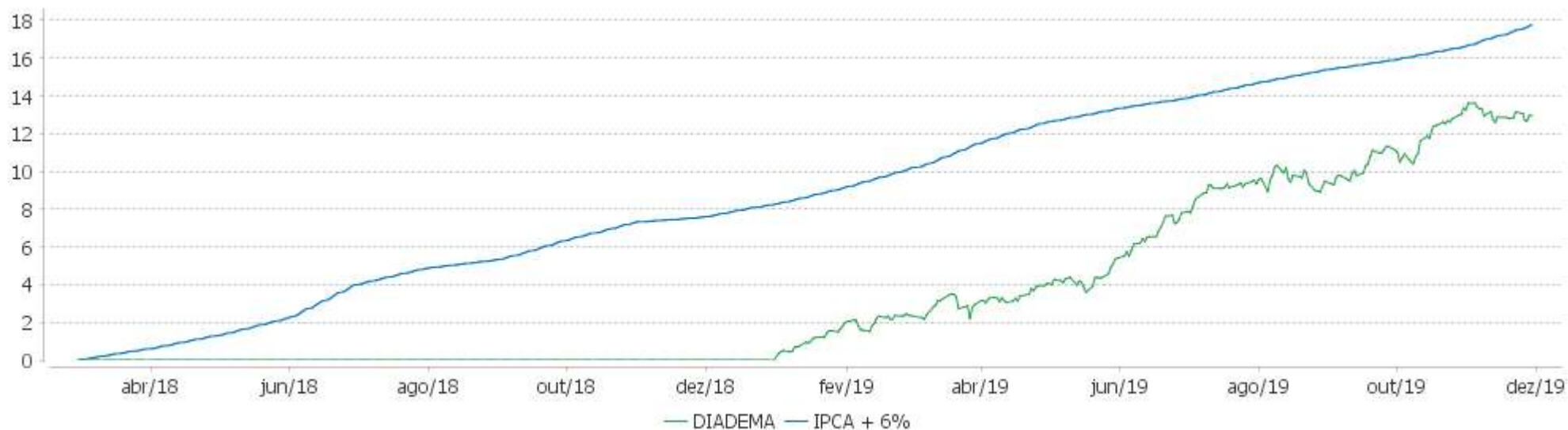
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

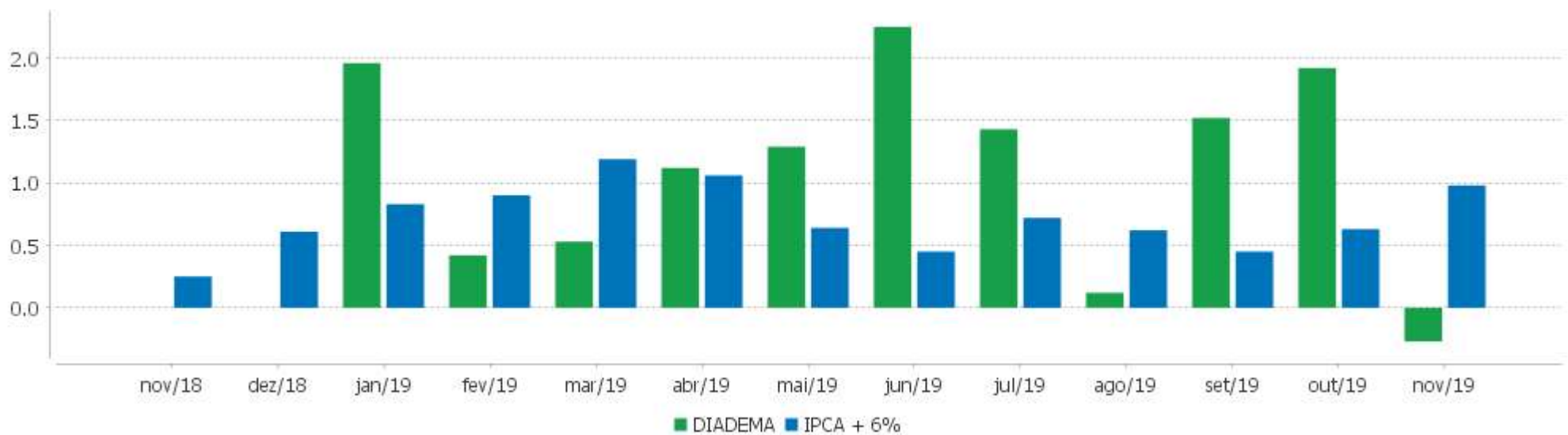
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	IPCA + 6%	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	7	33,33	03 meses	3,19	2,07	1,12	3,35
Meses abaixo da Meta Atuarial	14	66,67	06 meses	7,16	3,91	3,25	3,60
			12 meses	12,97	9,47	3,50	3,19
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,25	2019-06					
Menor rentabilidade da Carteira	-0,27	2019-11	Desde 28/02/2018	12,97	17,78	-4,81	2,44

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.	-1,01 -0,72	14,34 2,57	3,59 0,46	7,07 1,10	16,77 3,47	29,28 5,40	48,36 8,18
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B 5 p.p.	-0,34 -0,05	11,51 -0,26	3,04 -0,09	5,82 -0,15	13,05 -0,25	23,35 -0,53	39,33 -0,85
SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FI Var. IMA-B 5 p.p.	-0,30 -0,02	11,54 -0,23	3,07 -0,06	5,86 -0,12	13,04 -0,26	23,36 -0,52	39,34 -0,83
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6% p.p.	-0,38 -1,36	12,82 4,02	3,10 1,03	6,10 2,19	14,66 5,19	26,09 5,41	44,72 13,24
BB PREV ALOC FIC Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,94 -0,24	12,00 0,39	2,36 -0,09	5,73 0,12	13,31 0,38	24,20 0,56	40,84 -0,17
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,31 -0,02	6,06 -0,26	1,54 -0,07	3,35 -0,14	6,63 -0,28	13,81 -0,56	27,01 -0,88
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,51 -1,02	15,75 12,63	3,34 2,77	7,20 6,32	17,28 14,01	25,78 18,33	40,59 30,13
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,48 -0,02	20,20 -0,33	3,65 -0,06	8,37 -0,16	22,20 -0,32	36,67 -0,73	57,07 -1,11
BB CRED PRIV III Var. IPCA + 6% p.p.	-0,19 -1,17	10,98 2,18	3,00 0,93	5,33 1,42	12,20 2,73	24,42 3,74	43,85 12,37
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	0,09	5,08	0,71	2,28	5,69	12,89	25,45
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,56 -0,11	20,43 -0,10	3,75 0,04	8,45 -0,08	22,49 -0,04	37,08 -0,33	58,16 -0,02
BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,34 89,83	5,37 96,49	1,24 92,92	2,76 95,33	5,86 96,33	12,70 98,07	24,74 99,42
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA % do CDI	-0,94 -246,45	11,49 206,47	2,45 184,17	5,67 195,94	12,86 211,40		
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,24 -0,70	29,89 6,74	3,88 -3,14	16,11 4,57	33,64 12,71	64,90 14,52	101,33 26,49
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	3,00 2,05	26,89 3,74	3,43 -3,59	15,64 4,10	31,54 10,62	69,02 18,64	108,39 33,55
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	4,14 3,20	35,05 11,90	8,74 1,72	28,02 16,47	41,40 20,48	79,34 28,96	146,02 71,19
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,46 -0,49	32,65 9,50	5,03 -1,99	14,55 3,01	35,68 14,75	67,83 17,45	94,92 20,08

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-1,16 -2,10	26,12 2,97	0,56 -6,46	15,19 3,64	26,25 5,32	63,71 13,33	85,28 10,44
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA Var. IPCA + 6% p.p.	-0,35 -1,33	-67,21 -76,02	-71,75 -73,82	-67,10 -71,01	-67,29 -76,76	-67,76 -88,44	-62,65 -94,12
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FI EM PARTICIPAÇÕES % do CDI	-0,07 -17,33	-0,97 -17,39	-0,26 -19,20	-0,53 -18,28	-1,05 -17,31	0,39 3,00	1,57 6,31
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO Var. IFIX p.p.	-1,43 -4,95	-7,77 -30,67	0,75 -8,05	-10,53 -23,75	-7,17 -32,81	-15,69 -46,28	-3,20 -60,52
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11 Var. IBOVESPA p.p.	2,17 1,23	9,62 -13,53	6,07 -0,95	6,09 -5,45	14,02 -6,90	5,08 -45,30	20,36 -54,48
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO % do CDI	-0,23 -59,65	3,40 61,11	0,23 17,10	1,81 62,64	4,25 69,84	12,68 97,90	23,43 94,17
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	3,84 1.008,71	28,92 519,74	8,39 631,25	16,13 557,02	18,52 304,36	27,94 215,84	67,98 273,23
CDI	0,38	5,56	1,33	2,90	6,09	12,95	24,88
IBOVESPA	0,95	23,15	7,02	11,55	20,93	50,38	74,83
INPC + 6%	1,01	8,91	2,03	3,79	9,57	20,22	29,88
IPCA + 6%	0,98	8,80	2,07	3,91	9,47	20,68	31,48

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	0,33	6,31	1,61	3,49	6,91	14,37	27,89
IRF-M 1+	-0,83	13,42	3,27	7,53	15,61	29,19	51,70
IRF-M TOTAL	-0,46	11,34	2,69	6,32	13,05	24,82	44,64
IMA-B 5	-0,28	11,77	3,13	5,97	13,30	23,89	40,17
IMA-B 5+	-4,07	27,06	4,15	10,21	29,45	47,79	71,47
IMA-B TOTAL	-2,45	20,53	3,71	8,53	22,52	37,40	58,18
IMA-C TOTAL	-1,15	18,93	3,20	8,96	19,85	41,50	57,00
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,70	11,61	2,45	5,61	12,93	23,64	41,02
IMA-GERAL TOTAL	-0,71	11,82	2,47	5,71	13,13	24,13	41,42
IDKA 2	0,01	10,49	2,86	5,28	11,88	22,68	39,55
IDKA 20	-6,02	38,79	4,15	11,72	41,69	68,38	100,86
CDI	0,38	5,56	1,33	2,90	6,09	12,95	24,88
Renda Variável							
IBOVESPA	0,95	23,15	7,02	11,55	20,93	50,38	74,83
IBRX 100	0,97	24,34	6,51	11,98	22,74	52,63	78,38
IBRX 50	0,85	21,20	6,85	10,57	18,64	47,41	71,10
SMALL CAP	5,14	40,43	9,78	25,98	43,38	62,52	125,57
IFIX	3,52	22,91	8,79	13,22	25,64	30,60	57,32
Índice Consumo - ICON	2,99	43,71	3,63	23,17	43,50	38,80	70,19
Índice Dividendos - IDIV	2,35	31,98	5,87	14,68	32,84	60,60	90,05
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,51	3,12	0,57	0,88	3,27	7,45	10,47
INPC	0,54	3,22	0,53	0,76	3,37	7,04	9,13
IGPM	0,30	5,12	0,97	1,50	3,99	14,07	13,06
SELIC	0,38	5,56	1,33	2,89	6,08	12,95	24,90
Meta Atuarial							
IPCA + 4%	0,82	6,91	1,58	2,91	7,41	16,19	24,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

IPCA + 5%	0,90	7,86	1,82	3,41	8,44	18,42	27,80
IPCA + 5,5%	0,94	8,33	1,95	3,66	8,95	19,55	29,63
IPCA + 5,89%	0,97	8,70	2,04	3,86	9,36	20,43	31,07
IPCA + 6%	0,98	8,80	2,07	3,91	9,47	20,68	31,48
INPC + 4%	0,85	7,02	1,54	2,79	7,50	15,74	22,69
INPC + 6%	1,01	8,91	2,03	3,79	9,57	20,22	29,88

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

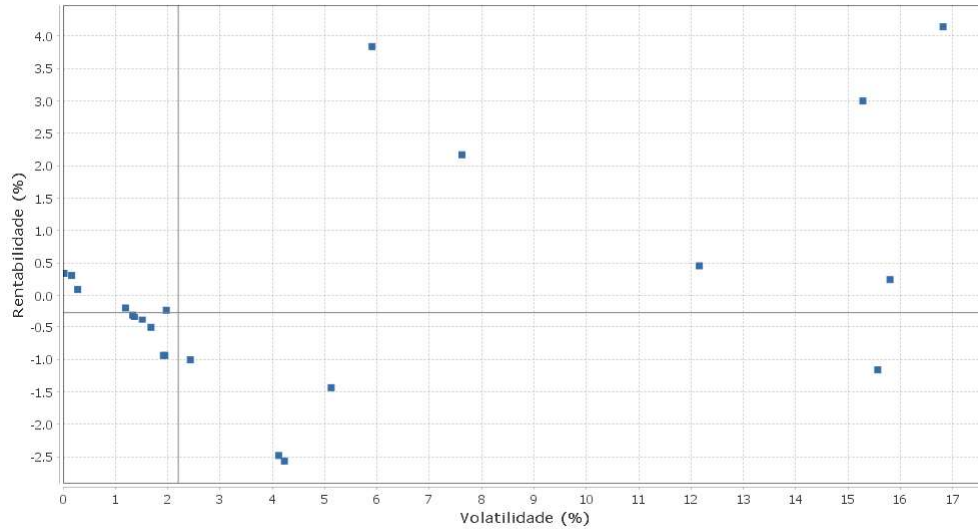
Movimentações

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
01/11/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	4.478,76592200	2,2327579010
05/11/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	70.000,00	31.340,72844300	2,2335154120
05/11/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.757.474,38	786.864,67555000	2,2335154120
08/11/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	32.094,74	0,00	14.362,49427100	2,2346216050
13/11/2019	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,00	3.461.471,50	1.398.602,03292910	2,4749510000
14/11/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	22.360,52788100	2,2360831670
14/11/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.972.176,83	881.978,29987100	2,2360831670
18/11/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	34.000,00	0,00	15.202,53395400	2,2364692690
18/11/2019	WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	0,00	5.289.780,72	1.219,99610445	4.335,8996809000
19/11/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.201.369,17	0,00	3.666.503,50588700	2,2368365820
21/11/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	15.000,00	6.703,53342200	2,2376258990
21/11/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.289.780,72	2.364.014,79012300	2,2376258990
21/11/2019	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	5.289.780,72	0,00	1.579.040,29355480	3,3499973000
22/11/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	248.907,20	0,00	111.218,77935300	2,2379961500
25/11/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	100.000,00	44.674,71885300	2,2384024470
26/11/2019	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	0,00	5.000.000,00	1.687.912,98794100	2,9622380000
26/11/2019	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	5.000.000,00	0,00	2.018.035,50620460	2,4776571000
28/11/2019	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,00	2.327.298,34	938.864,45814110	2,4788438000
29/11/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	43.000,00	19.197,23440100	2,2399059730
29/11/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.035.358,05	908.680,12967300	2,2399059730

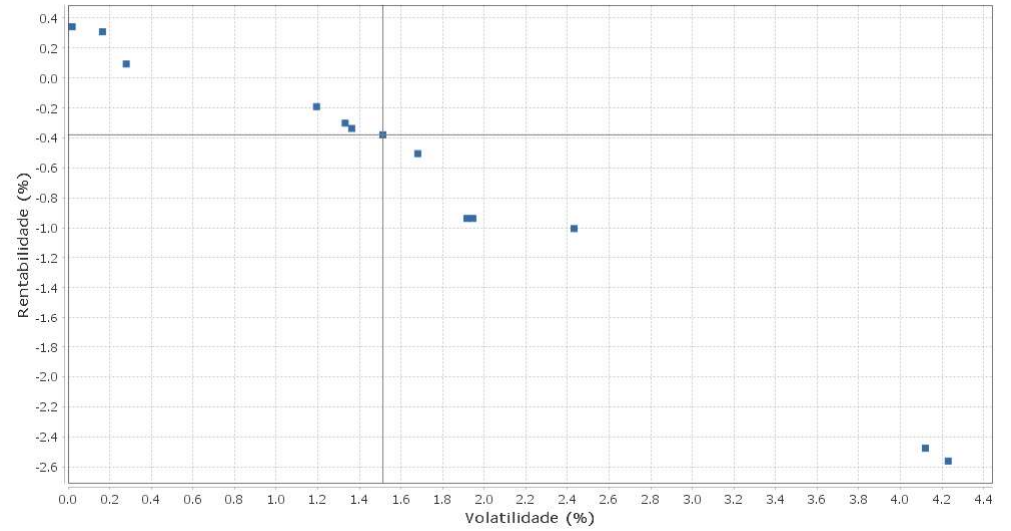
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

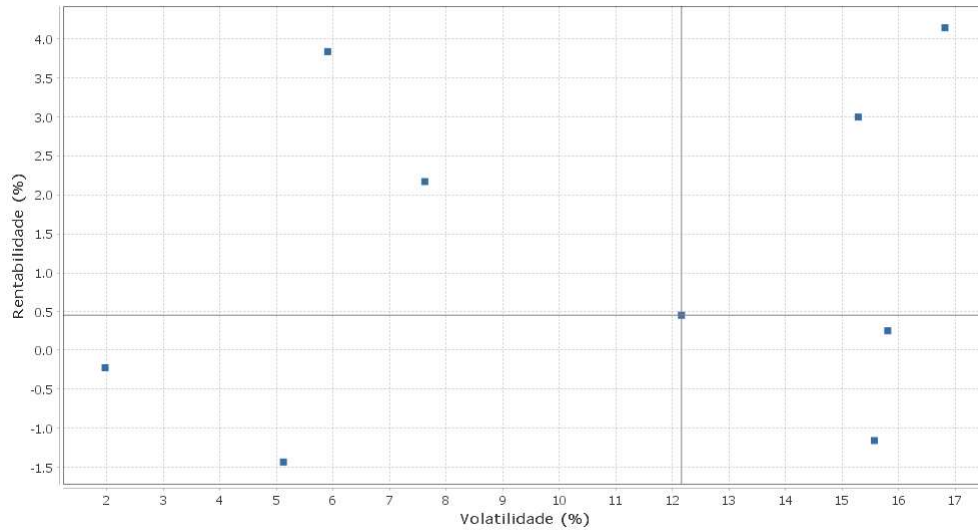
DIADEMA - No Mês



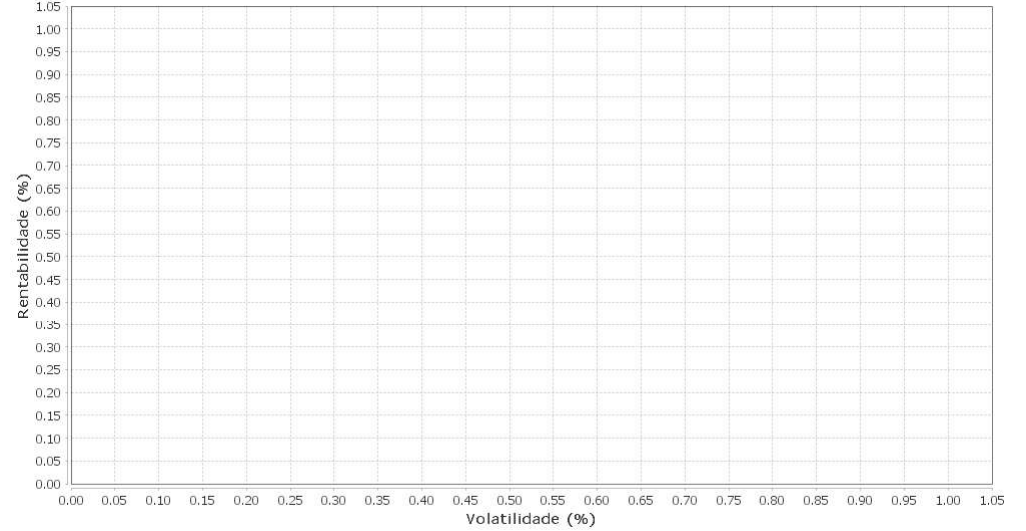
Renda Fixa - No Mês



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	0,02	0,02	0,34	7.693.620,49	2,09
BRADERCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	Artigo 7º I, Alínea b	0,17	0,03	0,31	4.685.359,12	1,27
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	Artigo 7º VII, Alínea b	0,28	0,03	0,09	3.648.342,55	0,99
BB CRED PRIV III	Artigo 7º VII, Alínea b	1,19	0,11	-0,19	9.268.053,64	2,51
SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,33	0,12	-0,30	1.981.200,22	0,54
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	1,36	0,12	-0,34	41.047.729,60	11,13
BB PREV IPCA I	Artigo 7º I, Alínea b	1,51	0,14	-0,38	16.392.775,71	4,44
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,68	0,15	-0,51	33.994.888,12	9,22
BRADERCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	Artigo 7º IV, Alínea a	1,92	0,15	-0,94	44.739.621,42	12,13
BB PREV ALOC FIC	Artigo 7º I, Alínea b	1,95	0,15	-0,94	42.548.276,50	11,53
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	1,97	0,19	-0,23	0,00	0,00
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	2,43	0,20	-1,01	24.794.624,69	6,72
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,12	0,30	-2,48	29.069.463,49	7,88
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	4,23	0,31	-2,56	20.647.602,04	5,60
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	Artigo 8º IV, Alínea b	5,12	0,46	-1,43	4.074.760,45	1,10
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	5,91	0,80	3,84	20.857.956,43	5,65
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11	Artigo 8º IV, Alínea b	7,62	0,90	2,17	1.539.996,91	0,42
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	12,16	1,28	0,46	14.566.220,37	3,95
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	15,28	1,73	3,00	24.425.426,71	6,62
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	15,57	1,55	-1,16	4.044.375,29	1,10
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	15,80	1,65	0,24	6.074.082,29	1,65
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	16,82	1,95	4,14	8.423.448,39	2,28