



LDB
EMPRESAS

DIADEMA
OUTUBRO 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 02.12.2019.

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

77,09%

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	0,24	0,60	5,73	5.460.427,75	1,44	733.085.810,57	0,74
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	1,95	1,64	11,89	46.201.204,99	12,20	10.184.716.977,20	0,45
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FI	1,95	1,63	11,88	1.987.185,64	0,52	1.319.606.230,39	0,15
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,64	3,38	3,38	29.807.741,46	7,87	1.516.704.216,68	1,97
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RENDA FIXA	3,15	2,45	15,50	25.046.533,61	6,62	517.818.803,51	4,84
BB	BB	BB PREV IPCA I	2,42	1,64	13,25	16.455.203,81	4,35	499.550.689,04	3,29
BB	BB	BB PREV ALOC FIC	2,26	1,80	13,06	42.951.165,79	11,35	8.931.824.899,36	0,48
CEF	CEF	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	3,73	1,71	12,54	34.167.467,27	9,03	8.654.594.983,92	0,39
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,99	1,98	12,10	202.076.930,32	53,38		

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	4,75	3,48	5,95	21.190.462,42	5,60	1.872.094.222,18	1,13
BB	BB	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,03	0,44	5,01	10.486.801,03	2,77	2.878.753.759,77	0,36
BRDESCO	BRDESCO	BRDESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	2,14	1,91	10,14	45.163.002,56	11,93	897.957.354,97	5,03
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,84	2,15	10,63	76.840.266,01	20,30		

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	1,67	1,51	11,19	9.285.822,82	2,45	579.759.334,71	1,60
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	0,11	0,19	1,25	3.644.945,96	0,96	161.437.871,29	2,26
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			1,50	1,13	10,64	12.930.768,78	3,42		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa	1,80	1,99	11,81	291.847.965,11	77,09
------------	------	------	-------	----------------	-------

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

22,91%

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	15,23	1,86	21,98	14.499.783,58	3,83	1.993.814.995,42	0,73
AZ QUEST	BNY MELLON	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	18,50	3,63	29,68	8.088.399,97	2,14	1.301.378.668,74	0,62
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	17,38	2,34	21,18	6.059.240,43	1,60	1.541.004.268,10	0,39
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	18,96	0,94	27,60	4.091.812,45	1,08	441.379.291,70	0,93
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	18,06	0,90	23,19	23.714.229,33	6,26	2.102.836.709,28	1,13
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			17,56	1,69	25,55	56.453.465,76	14,91		

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	1,63	0,49	3,64	5.318.819,80	1,40	236.210.884,02	2,25
WESTERN	WESTERN	WESTERN ASSET US INDEX 500 FIM	14,91	2,13	24,16	14.928.233,89	3,94	724.008.624,76	2,06
Sub-total Artigo 8º III			8,30	1,70	15,02	20.247.053,69	5,35		

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	1,87	-0,10	-0,90	4.155.273,85	1,10	572.219.637,36	0,73
CEF	CEF	FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	159,80	-0,43	-75,80	231.581,63	0,06	22.795.921,32	1,02
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			20,14	-0,12	-14,82	4.386.855,48	1,16		

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	16,46	5,54	-6,43	4.134.011,78	1,09	85.574.043,87	4,83
BRPP	GERAÇÃO	BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII -	11,66	4,02	7,30	1.507.277,09	0,40	268.180.768,83	0,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUTURO	BPFF11					
	Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b	18,39	5,13	15,81	5.641.288,87	1,49
	Renda Variável e Investimentos Estruturados	10,78	1,81	19,19	86.728.663,80	22,91
	Total				378.576.628,91	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	202.076.930,32	53,38	15,00	35,00	70,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	76.840.266,01	20,30	5,00	20,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	12.930.768,78	3,42	0,00	2,50	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	291.847.965,11	77,09				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	56.453.465,76	14,91	2,00	12,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	20.247.053,69	5,35	2,00	8,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	4.386.855,48	1,16	1,00	2,50	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	5.641.288,87	1,49	1,00	2,50	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	86.728.663,80	22,91				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

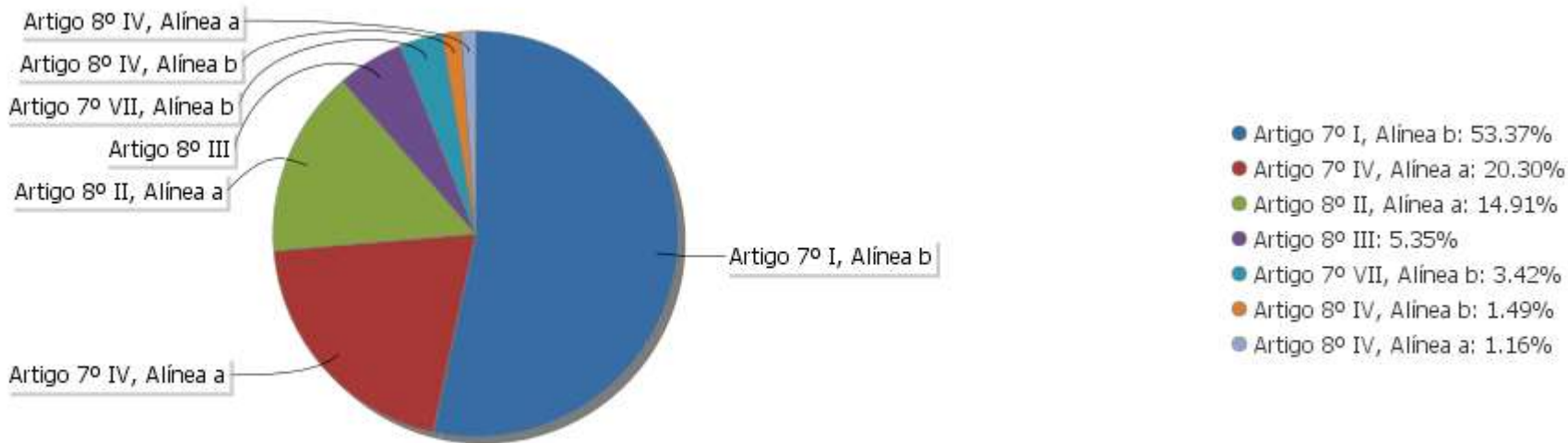
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,98 412,94	12,10 234,31	3,77 259,64	8,30 271,07		4.007.617,01	26.894.142,64
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	2,15 449,24	10,63 205,81	4,03 277,34	8,01 261,38		1.595.135,45	6.296.315,21
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	1,13 236,66	10,64 205,99	2,68 184,82	6,31 205,90		145.018,51	979.783,53
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	1,69 -0,68	25,55 3,55	4,15 -1,16	17,44 6,16		936.220,03	10.059.670,90
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	1,70 -0,67	15,02 -6,98	2,37 -2,94	3,72 -7,56		337.524,44	3.232.233,31
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,12 -2,48	-14,82 -36,82	-14,29 -19,60	-14,52 -25,80		-5.114,50	-763.291,82
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	5,13 2,77	15,81 -6,19	4,61 -0,70	10,07 -1,21		275.695,70	859.092,37
						7.292.096,64	47.557.946,14

Análise de Liquidez

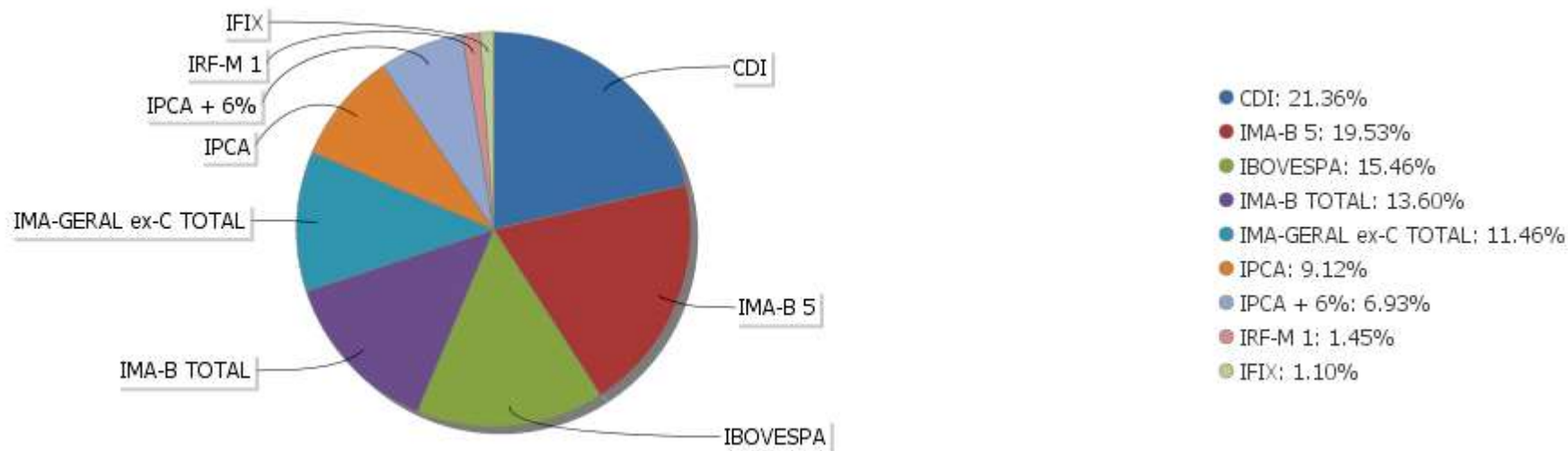
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	341.421.302,91	90,19	341.421.302,91	90,19
de 31 a 364 dias	23.714.229,33	6,26	365.135.532,24	96,45
acima de 365 dias	13.441.096,67	3,55	378.576.628,91	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

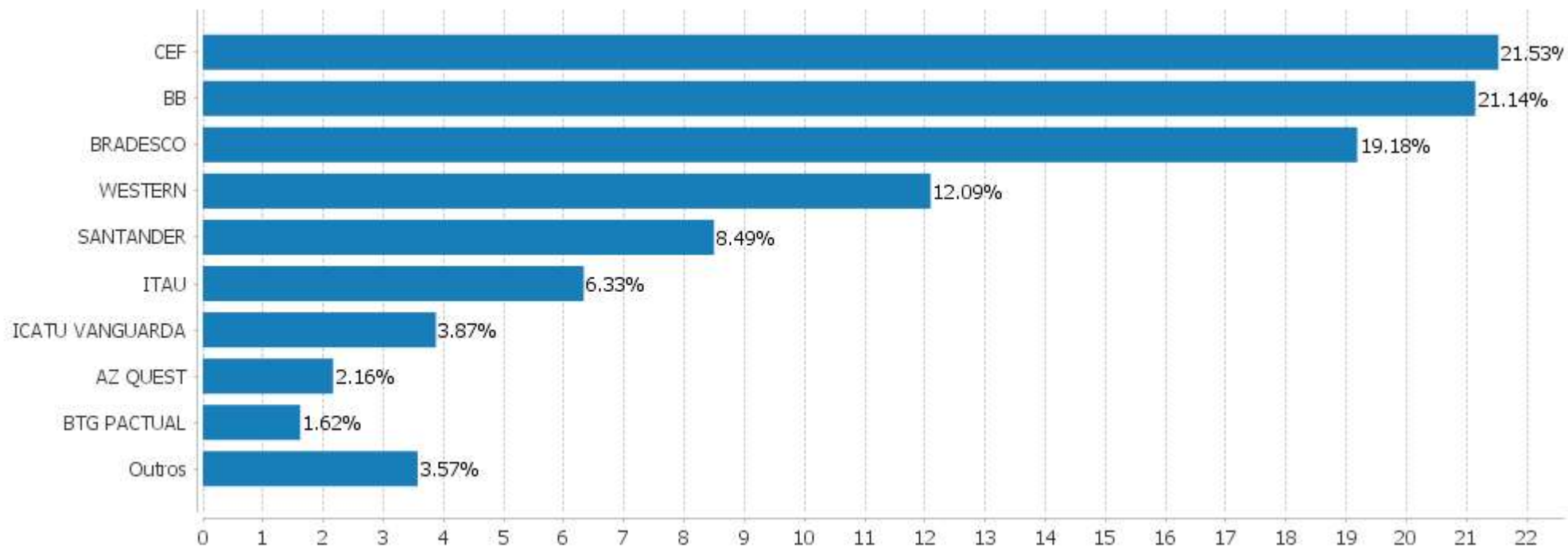


Alocação Por Estratégia



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	1,28	2,25	1,43	0,12	1,41	1,92			13,15
IPCA + 6%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63			7,75
p.p. indexador	1,12	-0,47	-0,67	0,06	0,64	1,80	0,71	-0,50	0,97	1,28			5,39
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

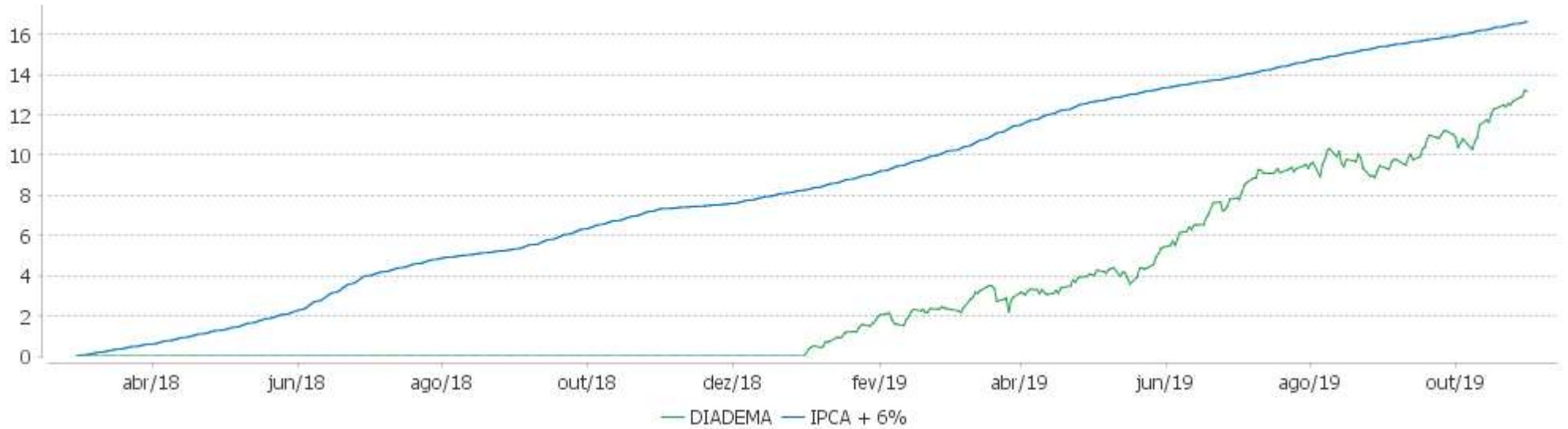
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

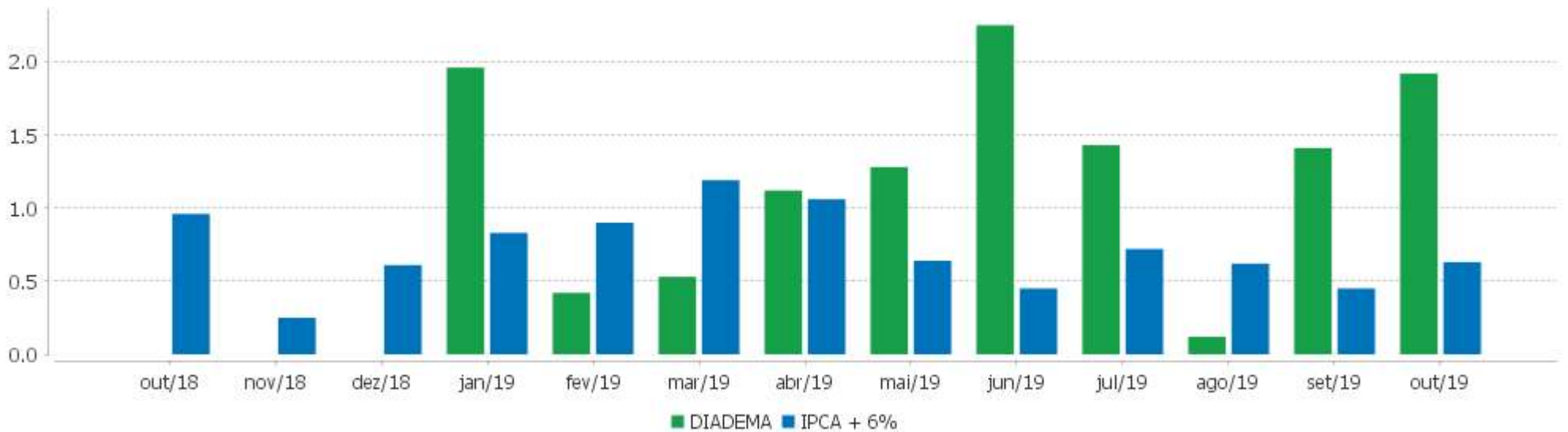
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	IPCA + 6%	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	7	35,00	03 meses	3,49	1,71	1,78	4,05
Meses abaixo da Meta Atuarial	13	65,00	06 meses	8,71	3,57	5,14	3,58
			12 meses	13,15	8,69	4,46	3,06
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,25	2019-06					
Menor rentabilidade da Carteira	0,00	2018-03	Desde 28/02/2018	13,15	16,64	-3,49	2,39

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
BB CRED PRIV III Var. IPCA + 6% p.p.	1,51 0,88	11,19 3,44	3,32 1,61	6,84 3,27	12,79 4,10	24,85 4,45	44,57 13,53
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	0,19	4,98	1,10	2,75	6,12	13,43	26,64
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RENDA FIXA Var. IMA-B 5 p.p.	2,45 0,79	15,50 3,41	4,41 0,94	10,52 2,78	18,52 4,74	30,28 5,92	49,34 8,21
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B 5 p.p.	1,64 -0,01	11,89 -0,20	3,42 -0,05	7,63 -0,11	13,58 -0,20	23,88 -0,48	40,32 -0,80
SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,63 -0,02	11,88 -0,21	3,41 -0,06	7,62 -0,13	13,53 -0,25	23,88 -0,49	40,31 -0,82
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6% p.p.	1,64 1,01	13,25 5,50	3,55 1,84	8,32 4,75	15,44 6,76	26,44 6,03	44,97 13,92
BB PREV ALOC FIC Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	1,80 0,11	13,06 0,66	3,41 0,06	8,88 0,58	15,25 0,63	25,21 0,71	41,83 -0,26
BRADERCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,60 -0,02	5,73 -0,23	1,76 -0,07	3,71 -0,14	6,86 -0,27	14,16 -0,54	27,91 -0,89
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF Var. IPCA p.p.	1,71 1,61	16,33 13,74	3,73 3,56	10,67 10,17	18,32 15,78	26,77 19,56	
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,34 -0,02	23,26 -0,31	5,82 -0,07	15,15 -0,19	26,43 -0,31	39,06 -0,73	59,05 -1,13
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,48 0,11	23,60 0,03	6,01 0,11	15,39 0,06	26,90 0,16	39,54 -0,25	60,26 0,08
BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,44 91,35	5,01 97,01	1,39 95,59	2,95 96,41	6,02 96,97	12,94 98,37	25,61 99,69
BRADERCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA % do CDI	1,91 398,15	12,54 242,89	3,53 242,83	8,56 279,34	14,84 239,14		
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO Var. IFIX p.p.	4,64 0,63	-6,43 -25,15	-11,29 -16,27	-8,11 -19,41	-5,61 -30,11	-15,26 -40,67	-1,62 -49,66
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11 Var. IBOVESPA p.p.	3,33 0,97	7,30 -14,70	2,54 -2,77	4,19 -7,09	9,34 -13,30	2,54 -41,75	15,50 -49,65
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	2,34 -0,02	29,58 7,58	5,62 0,31	19,65 8,37	37,87 15,23	60,94 16,65	82,25 17,10
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	0,90 -1,46	23,19 1,20	2,00 -3,31	15,03 3,75	31,41 8,77	57,88 13,59	88,56 23,41

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,63 1,27	29,68 7,68	6,42 1,11	24,41 13,13	42,57 19,93	65,28 20,99	115,93 50,79
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	1,86 -0,50	32,05 10,05	6,08 0,77	16,69 5,41	42,22 19,58	65,78 21,49	84,07 18,92
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,94 -1,42	27,60 5,60	5,79 0,48	17,80 6,52	28,90 6,25	61,43 17,14	76,99 11,85
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO % do CDI	0,49 102,42	3,64 70,40	1,24 85,18	2,03 66,36	4,56 73,46	12,87 97,79	25,01 97,32
WESTERN ASSET US INDEX 500 FIM % do CDI	2,13 444,73	24,16 467,76	2,91 200,47	4,65 151,76	16,29 262,52	27,30 207,48	69,05 268,73
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA Var. IPCA + 6% p.p.	-0,43 -1,06	-67,10 -74,85	-66,93 -68,64	-67,02 -70,58	-67,23 -75,92	-67,59 -87,99	-62,56 -93,61
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FI EM PARTICIPAÇÕES % do CDI	-0,10 -20,67	-0,90 -17,48	-0,28 -19,59	-0,56 -18,22	0,63 10,15	2,64 20,07	3,70 14,41
CDI	0,48	5,16	1,45	3,06	6,20	13,16	25,70
IBOVESPA	2,36	22,00	5,31	11,28	22,64	44,29	65,15
INPC + 6%	0,57	7,83	1,65	3,43	8,71	19,79	29,27
IPCA + 6%	0,63	7,75	1,71	3,57	8,69	20,40	31,04

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	0,62	5,96	1,83	3,85	7,13	14,70	28,80
IRF-M 1+	2,22	14,38	4,24	10,78	17,94	30,17	53,02
IRF-M TOTAL	1,70	11,85	3,43	8,70	14,69	25,51	45,78
IMA-B 5	1,65	12,09	3,47	7,74	13,78	24,36	41,13
IMA-B 5+	4,67	32,45	7,73	20,86	37,00	51,90	75,09
IMA-B TOTAL	3,36	23,57	5,89	15,34	26,74	39,79	60,18
IMA-C TOTAL	2,62	20,32	4,30	12,80	21,14	43,57	56,42
IMA-GERAL ex-C TOTAL	1,69	12,40	3,35	8,30	14,62	24,51	42,09
IMA-GERAL TOTAL	1,72	12,62	3,38	8,43	14,80	25,02	42,44
IDKA 2	1,23	10,48	2,93	6,70	12,06	22,98	40,32
IDKA 20	5,77	47,68	9,33	29,04	55,14	74,07	103,08
CDI	0,48	5,16	1,45	3,06	6,20	13,16	25,70
Renda Variável							
IBOVESPA	2,36	22,00	5,31	11,28	22,64	44,29	65,15
IBRX 100	2,20	23,15	5,31	12,17	24,80	46,06	67,84
IBRX 50	2,18	20,18	4,87	10,15	20,18	41,48	61,64
SMALL CAP	2,28	33,56	4,91	22,18	42,89	50,82	96,44
IFIX	4,01	18,73	4,98	11,30	24,51	25,41	48,04
Índice Consumo - ICON	-1,97	39,55	5,13	20,77	45,02	30,04	51,68
Índice Dividendos - IDIV	1,52	28,95	5,74	15,57	39,23	46,45	81,59
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,10	2,60	0,17	0,50	2,54	7,21	10,10
INPC	0,04	2,67	0,11	0,37	2,55	6,66	8,62
IGPM	0,68	4,81	-0,00	1,65	3,17	14,32	12,69
SELIC	0,48	5,16	1,45	3,06	6,20	13,16	25,72
Meta Atuarial							
IPCA + 4%	0,46	6,04	1,20	2,56	6,64	15,92	23,79

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

IPCA + 5%	0,55	6,90	1,46	3,06	7,66	18,15	27,38
IPCA + 5,5%	0,59	7,32	1,58	3,32	8,17	19,27	29,21
IPCA + 5,89%	0,62	7,66	1,68	3,51	8,57	20,15	30,64
IPCA + 6%	0,63	7,75	1,71	3,57	8,69	20,40	31,04
INPC + 4%	0,40	6,11	1,14	2,42	6,66	15,33	22,12
INPC + 6%	0,57	7,83	1,65	3,43	8,71	19,79	29,27

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

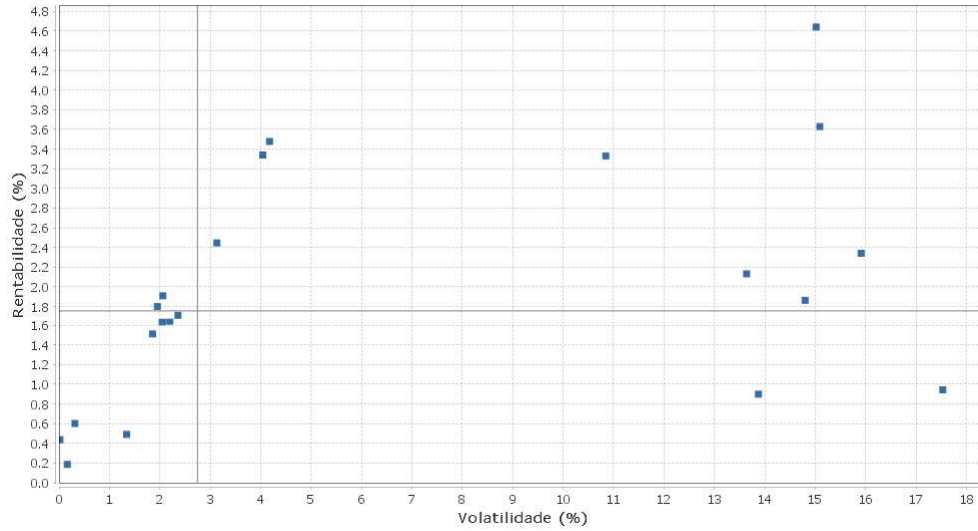
Movimentações

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
01/10/2019	SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FI	0,00	17.017.524,60	687.346,86939612	24,7582776000
01/10/2019	SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FI	0,00	561.926,83	22.696,52352553	24,7582776000
01/10/2019	SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FI	0,00	11.254.573,20	454.578,19731369	24,7582776000
02/10/2019	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	28.834.024,63	0,00	1.095.899,42750200	26,3108310000
04/10/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	80.000,00	35.965,47779500	2,2243552680
04/10/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.568.516,70	705.155,65681700	2,2243552680
08/10/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	5.040.898,31	0,00	2.265.338,54823400	2,2252295640
08/10/2019	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	0,00	5.000.000,00	1.710.305,68635593	2,9234540000
10/10/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	9.625,02	4.323,72770500	2,2260930050
14/10/2019	BRADERCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,00	3.369.065,29	1.366.812,61135057	2,4649065000
15/10/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	60.000,00	26.937,43400700	2,2273836470
15/10/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.964.386,06	881.925,33093500	2,2273836470
16/10/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	34.000,00	0,00	15.261,67126900	2,2278031940
18/10/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	3.148.525,16	0,00	1.412.759,22320400	2,2286353600
23/10/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	4.484,47859100	2,2299136450
23/10/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	248.020,21	0,00	111.224,13217900	2,2299136450
24/10/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	35.000,00	15.693,03505200	2,2302887800
25/10/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	47.000,00	21.069,94325800	2,2306657130
29/10/2019	BRADERCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,00	2.380.544,57	963.157,72012192	2,4716041000
30/10/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	22.402,73746700	2,2318701040
30/10/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.069.822,62	927.393,85517600	2,2318701040
31/10/2019	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.774.120,63	0,00	794.757,89700100	2,2322780770

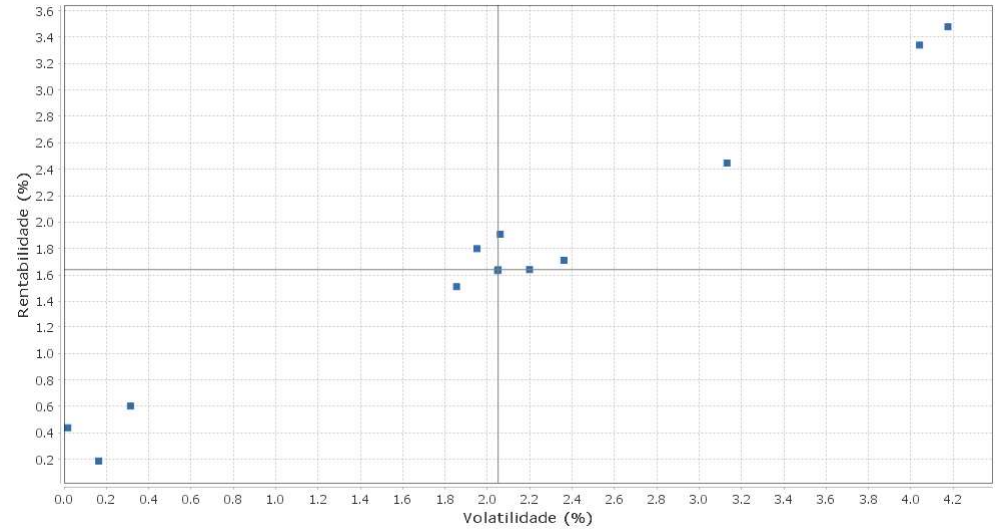
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

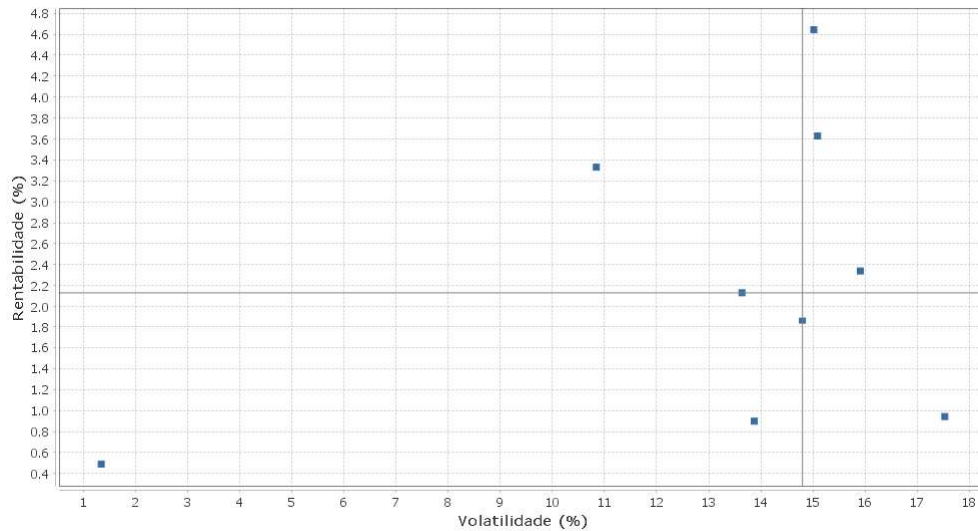
DIADEMA - No Mês



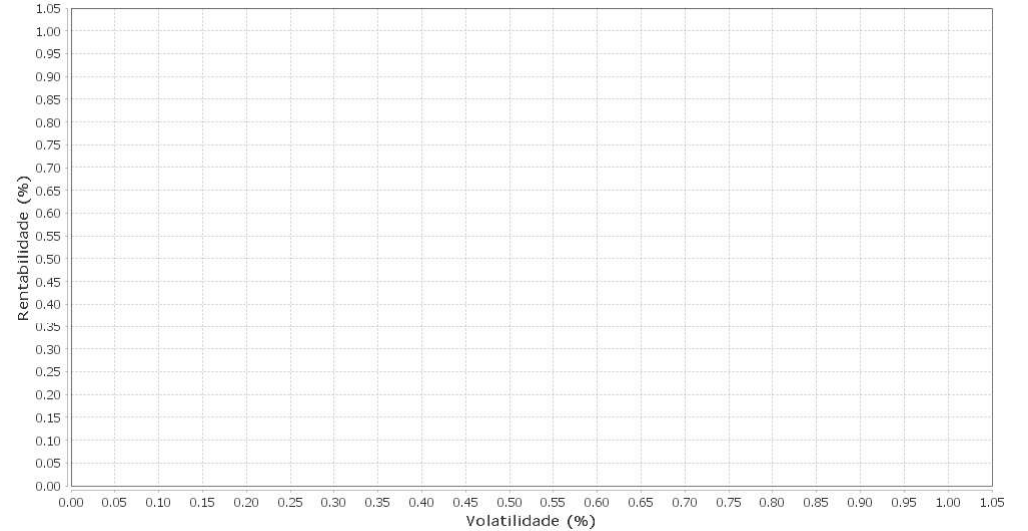
Renda Fixa - No Mês



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	0,44	10.486.801,03	2,77
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	Artigo 7º VII, Alínea b	0,16	0,03	0,19	3.644.945,96	0,96
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	Artigo 7º I, Alínea b	0,31	0,06	0,60	5.460.427,75	1,44
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	1,34	0,16	0,49	5.318.819,80	1,40
BB CRED PRIV III	Artigo 7º VII, Alínea b	1,85	0,26	1,51	9.285.822,82	2,45
BB PREV ALOC FIC	Artigo 7º I, Alínea b	1,95	0,28	1,80	42.951.165,79	11,35
SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,05	0,28	1,63	1.987.185,64	0,52
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	2,05	0,28	1,64	46.201.204,99	12,20
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	Artigo 7º IV, Alínea a	2,06	0,30	1,91	45.163.002,56	11,93
BB PREV IPCA I	Artigo 7º I, Alínea b	2,20	0,30	1,64	16.455.203,81	4,35
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,36	0,32	1,71	34.167.467,27	9,03
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	3,13	0,43	2,45	25.046.533,61	6,62
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,04	0,56	3,34	29.807.741,46	7,87
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	4,18	0,58	3,48	21.190.462,42	5,60
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11	Artigo 8º IV, Alínea b	10,84	1,27	3,33	1.507.277,09	0,40
WESTERN ASSET US INDEX 500 FIM	Artigo 8º III	13,64	1,50	2,13	14.928.233,89	3,94
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	13,87	1,48	0,90	23.714.229,33	6,26
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	14,80	1,61	1,86	14.499.783,58	3,83
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	Artigo 8º IV, Alínea b	15,02	1,75	4,64	4.134.011,78	1,09
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	15,09	1,72	3,63	8.088.399,97	2,14
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	15,91	1,75	2,34	6.059.240,43	1,60
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	17,53	1,86	0,94	4.091.812,45	1,08