



**LDB**  
EMPRESAS

**DIADEMA**  
3º TRIMESTRE 2020



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações relevantes para 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 não constituem recomendações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis e consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e 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 29.10.2023.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas físicas ou jurídicas sem a autorização da CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários.

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira
BRAM	BRDESCO	BRDESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,54	0,03	0,34	31.025,37	0,01
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TÍTULOS PUBLICOS RF	5,03	-0,14	1,23	2.092.942,00	0,75
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	12,77	-1,54	0,88	29.299.128,29	10,46
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	9,16	-0,81	0,67	26.527.575,09	9,47
BB	BB	BB PREV IPCA I	4,95	0,20	1,82	16.601.109,14	5,93
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,22	-0,75	0,10	47.444.554,12	16,94
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,95	-0,50	-0,09	35.745.970,31	12,77
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>7,22</b>	<b>-0,75</b>	<b>0,50</b>	<b>157.742.304,32</b>	<b>56,34</b>

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira
BRAM	BRDESCO	BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	13,29	-1,60	0,92	20.894.384,66	7,46
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,02	0,44	14.294.239,43	5,11
BRAM	BRDESCO	BRDESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	6,82	-0,91	-0,09	0,00	0,00
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>8,36</b>	<b>-1,12</b>	<b>0,18</b>	<b>35.188.624,09</b>	<b>12,57</b>

Artigo 7º VII, Alínea b (Fundos Renda Fixa "Crédito Privado")

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira
BB	BB	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4,48	-0,08	1,40	9.755.525,39	3,48
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	1,57	0,37	1,91	3.620.256,89	1,29
<b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b</b>			<b>3,31</b>	<b>0,04</b>	<b>1,54</b>	<b>13.375.782,28</b>	<b>4,78</b>
<b>Renda Fixa</b>			<b>7,28</b>	<b>-0,76</b>	<b>0,52</b>	<b>206.306.710,69</b>	<b>73,68</b>

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações )

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	39,27	-5,41	-5,72	11.802.834,52	4,22
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	45,87	-5,97	3,84	7.730.654,86	2,76
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	45,49	-2,97	4,71	6.249.419,56	2,23
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	41,30	-5,72	1,29	3.814.881,72	1,36
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	51,80	-8,03	-6,52	17.988.954,44	6,42
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>45,43</b>	<b>-6,23</b>	<b>-2,77</b>	<b>47.586.745,10</b>	<b>17,00</b>

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	32,62	-4,88	7,43	21.522.767,31	7,69
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>32,62</b>	<b>-4,88</b>	<b>7,43</b>	<b>21.522.767,31</b>	<b>7,69</b>

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira
PÁTRIA	PÁTRIA	PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FI EM PARTICIPAÇÕES	546,25	-0,28	-1,82	11.281,60	0,00
CEF	CEF	FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	7,27	-0,51	-1,54	205.814,38	0,07
<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a</b>			<b>264,21</b>	<b>-0,49</b>	<b>-1,56</b>	<b>217.095,98</b>	<b>0,08</b>

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira
RIO BRAVO	RIO BRAVO	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	27,54	20,21	-16,93	3.021.468,55	1,08
BRPP	GERAÇÃO FUTURO	BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11	19,24	-1,26	-4,09	1.345.800,64	0,48
<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b</b>			<b>21,66</b>	<b>13,49</b>	<b>0,16</b>	<b>4.367.269,19</b>	<b>1,56</b>

Carteira: DIADEMA

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável e Investimentos Estruturados	36,15	-4,71	0,17	73.693.877,58	26,32
Total	12,61	-1,83	0,35	280.000.588,27	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos		M
				Mínimo	Objetivo	
<b>Renda Fixa</b>						
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	157.742.304,32	56,34	15,00	55,00	10
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	35.188.624,09	12,57	5,00	15,00	4
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	13.375.782,28	4,78	0,00	2,00	5
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>206.306.710,69</b>	<b>73,68</b>			
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>						
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	47.586.745,10	17,00	2,00	15,00	2
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	21.522.767,31	7,69	2,00	7,00	1
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	217.095,98	0,08	1,00	2,00	5
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	4.367.269,19	1,56	1,00	2,00	5
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>73.693.877,58</b>	<b>26,32</b>			

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

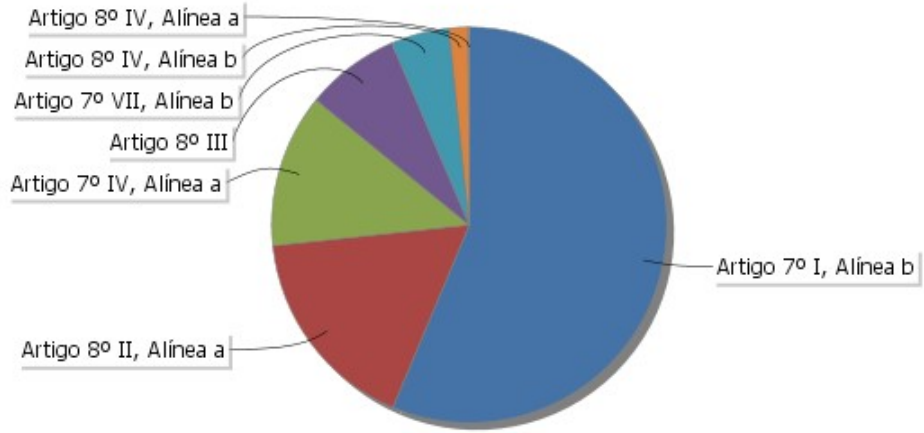
Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,75 -475,07	0,50 96,82	0,50 96,82	4,37 349,78	5,33 150,38	-1.188.025,35
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-1,12 -714,57	0,18 34,67	0,18 34,67	3,79 302,73	2,79 78,88	-403.093,66
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,04 27,18	1,54 300,09	1,54 300,09	4,16 332,90	4,61 130,25	5.704,76
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-6,23 -1,43	-2,77 -2,29	-2,77 -2,29	26,34 -3,22	-14,28 -4,60	-3.160.103,74
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-4,88 -0,08	7,43 7,91	7,43 7,91	27,61 -1,95	7,98 17,67	-1.103.161,04
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,49 4,30	-1,56 -1,08	-1,56 -1,08	-92,18 -121,74	-95,06 -85,37	-1.077,06
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	13,49 18,28	0,16 0,64	0,16 0,64	5,90 -23,66	0,71 10,39	597.602,98
						-5.252.153,11

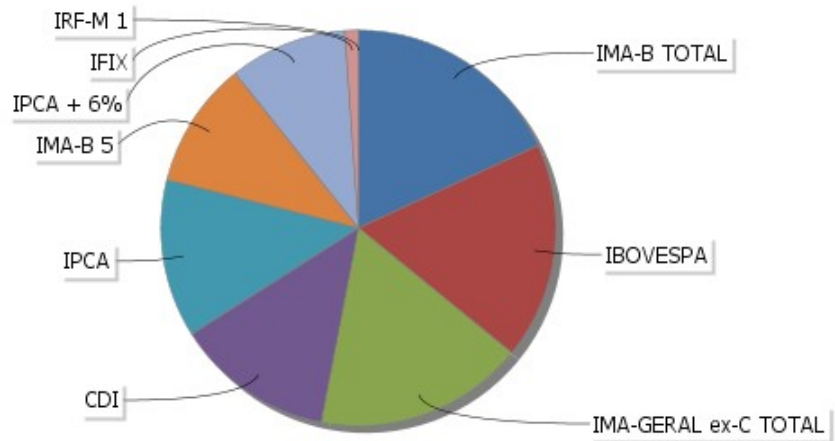
Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)
de 0 a 30 dias	244.361.784,03	87,27	244.361.784,03
de 31 a 364 dias	6.260.701,16	2,24	250.622.485,19
acima de 365 dias	29.378.103,08	10,49	280.000.588,27

**Alocação por Artigo**

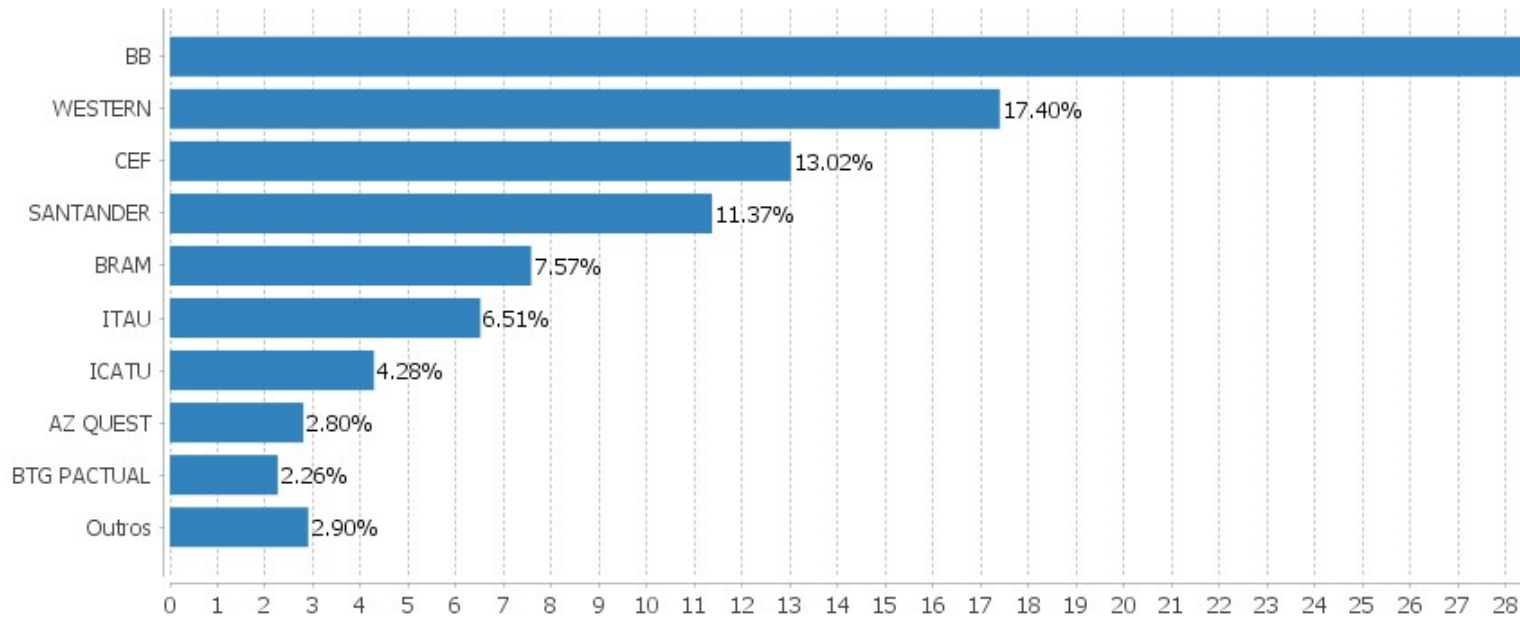


**Alocação Por Estratégia**





## 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
2020	0,65	-1,49	-9,14	2,57	2,61	1,62	3,08	-0,83	-1,83		
IPCA + 5,88%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12		
p.p. indexador	-0,06	-2,15	-9,71	2,43	2,54	0,89	2,20	-1,55	-2,95		
2019	1,96	0,42	0,53	1,12	1,29	2,25	1,43	0,12	1,52	1,92	-0,27
IPCA + 6%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98
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

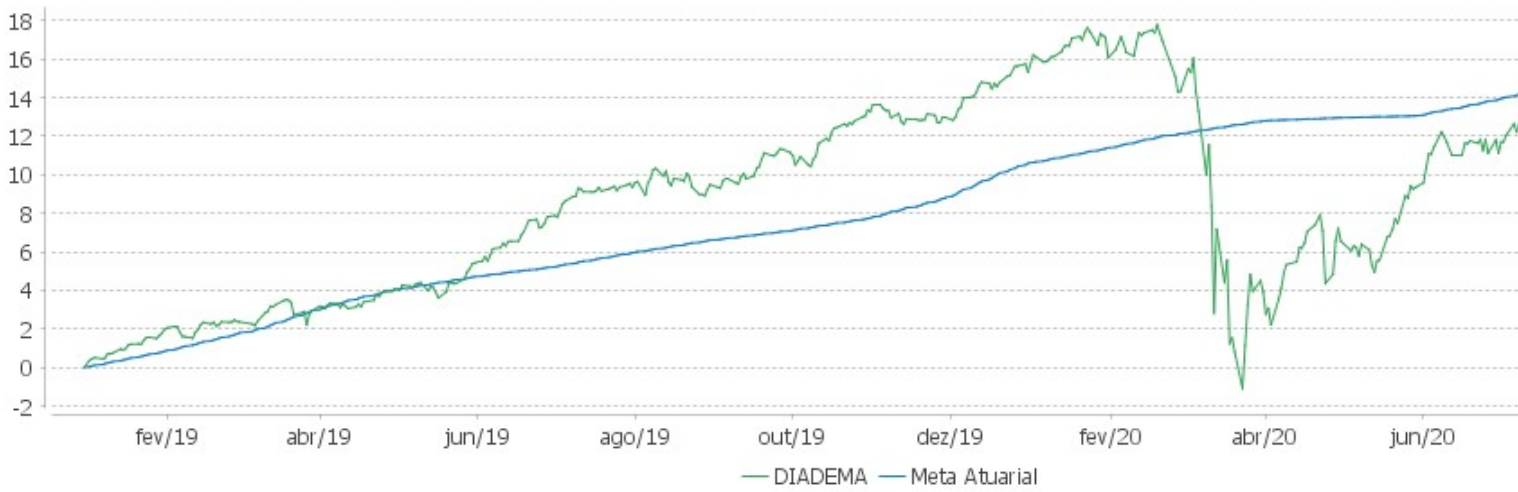
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

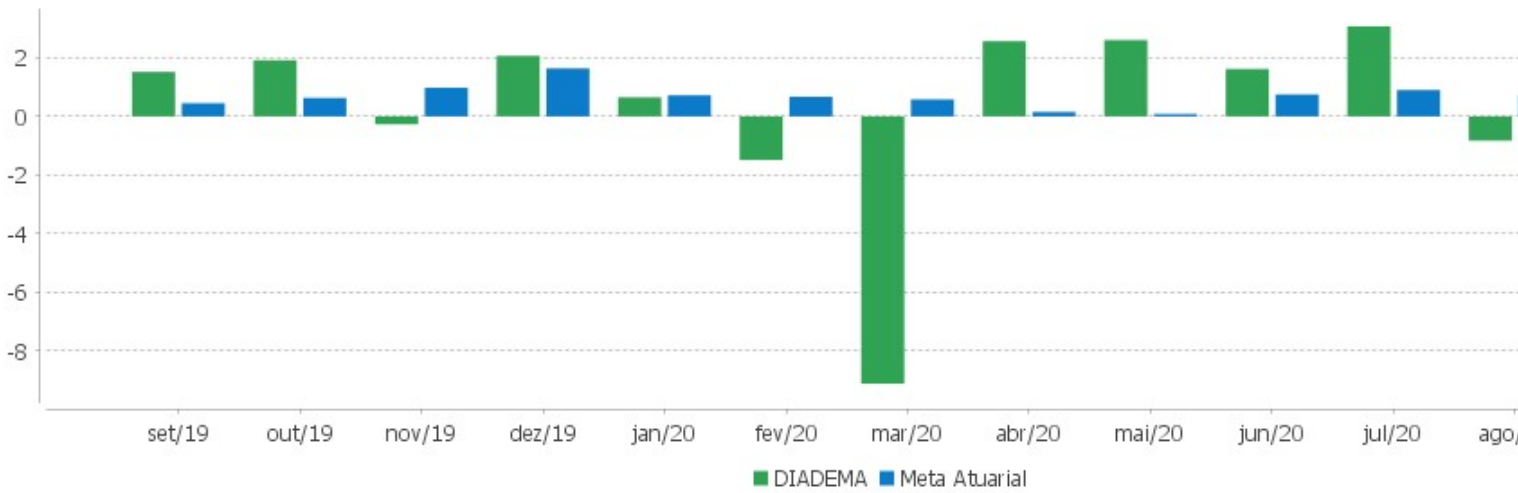
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Ind
Meses acima da Meta Atuarial	12	57,14	03 meses	0,35	2,75	-2,40
Meses abaixo da Meta Atuarial	9	42,86	06 meses	7,34	3,73	3,61
			12 meses	0,32	9,23	-8,91
			24 meses			
			36 meses			
Maior rentabilidade da Carteira	3,08	2020-07				
Menor rentabilidade da Carteira	-9,14	2020-03	Desde 31/12/2018	11,50	16,96	-5,45

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,60 -0,09	0,92 -0,04	0,92 -0,04	6,12 0,15	2,03 -0,08
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,02 15,30	0,44 86,28	0,44 86,28	1,22 97,65	2,98 84,04
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA % do CDI	-0,98 -626,37	-0,16 -30,69	-0,16 -30,69	2,97 237,17	3,46 97,53
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6% p.p.	-0,08 -1,21	1,40 -1,38	1,40 -1,38	5,06 1,27	6,65 -2,68
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	0,37	1,91	1,91	1,81	-0,49
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	-0,81 -0,69	0,67 -0,63	0,67 -0,63	5,99 0,88	8,50 1,26
SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TÍTULOS PUBLICOS RF Var. IMA-B 5 p.p.	-0,14 -0,02	1,23 -0,07	1,23 -0,07	5,00 -0,11	7,04 -0,20
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6% p.p.	0,20 -0,93	1,82 -0,95	1,82 -0,95	5,68 1,89	7,86 -1,46
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,75 -0,04	0,10 -0,15	0,10 -0,15	3,07 0,08	3,70 -0,19
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,03 -0,12	0,34 -0,17	0,34 -0,17	1,42 -0,25	4,14 -0,40
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,50 -1,14	-0,09 -1,34	-0,09 -1,34	3,18 2,37	6,41 3,27
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,54 -0,03	0,88 -0,08	0,88 -0,08	5,75 -0,21	1,58 -0,53
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	-4,88 -3.106,08	7,43 1.451,94	7,43 1.451,94	27,61 2.207,30	9,43 266,17
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,97 1,83	4,71 5,18	4,71 5,18	48,34 18,78	5,55 15,24
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	-8,03 -3,24	-6,52 -6,04	-6,52 -6,04	24,90 -4,66	-23,46 -13,78
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-5,97 -1,17	3,84 4,32	3,84 4,32	32,93 3,37	-0,95 8,73
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-5,41 -0,62	-5,72 -5,25	-5,72 -5,25	14,18 -15,38	-17,08 -7,40

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-5,72 -0,93	1,29 1,77	1,29 1,77	31,74 2,18	-5,89 3,79
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA Var. IPCA + 6% p.p.	-0,51 -1,63	-1,54 -4,32	-1,54 -4,32	-9,10 -12,89	-11,51 -20,83
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FI EM PARTICIPAÇÕES % do CDI	-0,29 -182,02	-1,82 -354,53	-1,82 -354,53	-99,56 -7.960,31	-99,73 -2.814,79
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO Var. IFIX p.p.	-0,76 -1,22	-16,93 -16,52	-16,93 -16,52	-15,42 -27,48	-23,13 -27,25
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11 Var. IBOVESPA p.p.	-1,80 3,00	-4,09 -3,61	-4,09 -3,61	1,55 -28,01	-7,74 1,94
CDI	0,16	0,51	0,51	1,25	3,54
IBOVESPA	-4,80	-0,48	-0,48	29,56	-9,68
INPC + 6%	1,36	3,22	3,22	4,50	10,12
IPCA + 6%	1,13	2,78	2,78	3,79	9,32

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Indexadores**

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses
<b>Renda Fixa</b>						
IRF-M 1	0,15	0,51	0,51	1,66	4,54	12,3
IRF-M 1+	-0,91	-0,59	-0,59	3,90	7,61	30,0
IRF-M TOTAL	-0,56	-0,24	-0,24	3,15	6,56	24,3
IMA-B 5	-0,12	1,30	1,30	5,11	7,24	23,3
IMA-B 5+	-2,60	0,75	0,75	6,78	-1,67	42,3
IMA-B TOTAL	-1,51	0,96	0,96	5,97	2,11	34,3
IMA-C TOTAL	2,95	9,60	9,60	18,32	19,95	48,3
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,71	0,25	0,25	2,99	3,90	21,3
IMA-GERAL TOTAL	-0,60	0,53	0,53	3,43	4,35	21,3
IDKA 2	0,02	1,99	1,99	5,41	8,00	21,3
IDKA 20	-4,30	0,58	0,58	7,11	-8,89	56,3
CDI	0,16	0,51	0,51	1,25	3,54	10,3
<b>Renda Variável</b>						
IBOVESPA	-4,80	-0,48	-0,48	29,56	-9,68	19,3
IBRX 100	-4,58	-0,04	-0,04	30,33	-8,59	23,3
IBRX 50	-4,62	-0,37	-0,37	31,30	-10,02	16,3
SMALL CAP	-5,44	2,27	2,27	35,50	-1,78	54,3
IFIX	0,46	-0,41	-0,41	12,06	4,12	30,3
Índice Consumo - ICON	-3,96	1,83	1,83	42,00	-1,04	53,3
Índice Dividendos - IDIV	-4,63	-3,31	-3,31	14,78	-9,81	37,3
<b>Indicadores Econômicos</b>						
IPCA	0,64	1,24	1,24	0,81	3,14	6,1
INPC	0,87	1,68	1,68	1,49	3,89	6,9
IGPM	4,34	9,59	9,59	12,51	17,94	21,3
SELIC	0,16	0,51	0,51	1,25	3,54	10,3
<b>Meta Atuarial</b>						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Qua
121	02/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.100,00	921,38
122	06/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.002.000,00	878.179,14
133	06/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	66.000,00	28.950,96
123	07/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	34.054,40	0,00	14.937,08
140	07/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	139.073,08	0,00	61.000,81
119	08/07/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	134.900,88	0,00	90.842,22
141	08/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	139.081,91	61.000,81
120	09/07/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	4.181,03	0,00	2.811,57
124	09/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.030,00	0,00	3.521,59
117	10/07/2020	BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	0,00	8.435.984,78	6.687.120,27
118	10/07/2020	BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	0,00	3.564.015,22	2.825.159,07
125	14/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	12.020.777,71	0,00	5.270.049,17
126	15/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.956.000,00	2.610.955,85
134	15/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	21.918,70
127	20/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.288.183,66	0,00	1.879.121,67
128	20/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	241.922,96	0,00	106.012,87
135	20/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	8.000,00	3.505,67
129	22/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	32.255,75	0,00	14.132,58
136	24/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	21.901,70
130	28/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.000.000,00	437.934,96
137	28/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.000.000,00	0,00	437.934,96
138	29/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	4.379,06
131	30/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	10.565,73	0,00	4.626,08
132	30/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.731.000,00	2.071.414,30
139	30/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	45.000,00	19.702,73
140	03/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	4.377,81
141	05/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	977.000,00	427.662,10
142	05/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	60.000,00	26.263,79

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Qua
143	07/08/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	231.440,84	0,00	154.185,61
144	07/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	43.353,20	0,00	18.971,03
145	10/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	962.000,00	420.935,75
146	10/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	15.000,00	6.563,44
147	11/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.000.000,00	0,00	1.750.149,61
148	11/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.000.000,00	1.750.149,61
149	13/08/2020	BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	0,00	6.558.537,49	5.197.362,32
150	13/08/2020	BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	0,00	5.441.462,51	4.312.127,86
151	14/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.008.000,00	2.628.249,51
152	14/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	7.025.104,70	0,00	3.073.190,41
153	14/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	5.000.000,00	0,00	2.187.291,54
163	14/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	21.872,91
154	17/08/2020	BB PREV IPCA I	0,00	421.894,43	178.765,46
155	18/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	421.894,43	0,00	184.523,31
156	20/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.574.823,22	0,00	2.000.571,05
157	20/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	4.373,00
158	24/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	30.699,67	0,00	13.421,86
159	25/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	200.000,00	87.435,51
160	28/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.755.000,00	2.078.261,17
161	28/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	9.342,77	0,00	4.083,43
162	28/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	21.853,42
163	08/09/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	60.000,00	26.209,48
164	08/09/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	986.000,00	430.709,21
165	08/09/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	37.660,45	0,00	16.451,01
166	09/09/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	715.416,00	0,00	478.119,80
167	09/09/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	7.487,75	0,00	3.270,51
168	10/09/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	12.000,00	5.241,30
169	10/09/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.026.000,00	448.131,53
170	15/09/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	51.000,00	22.276,56
171	15/09/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	29.325,47	0,00	12.809,23

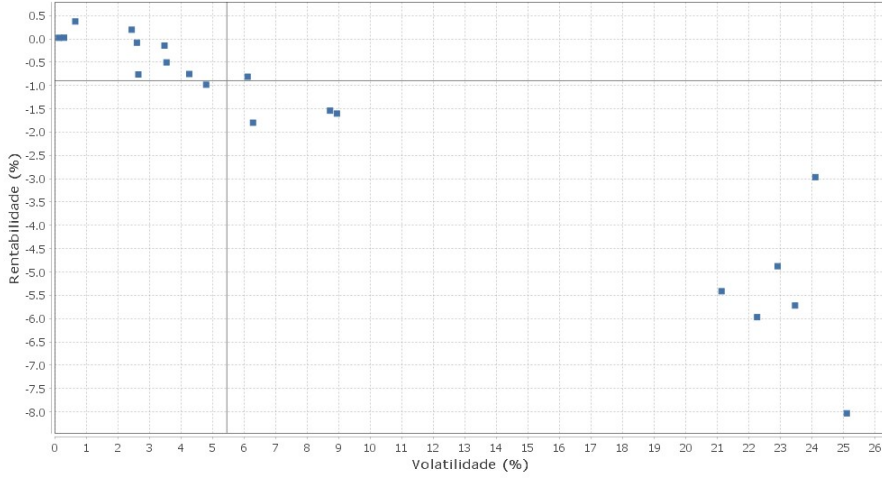


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

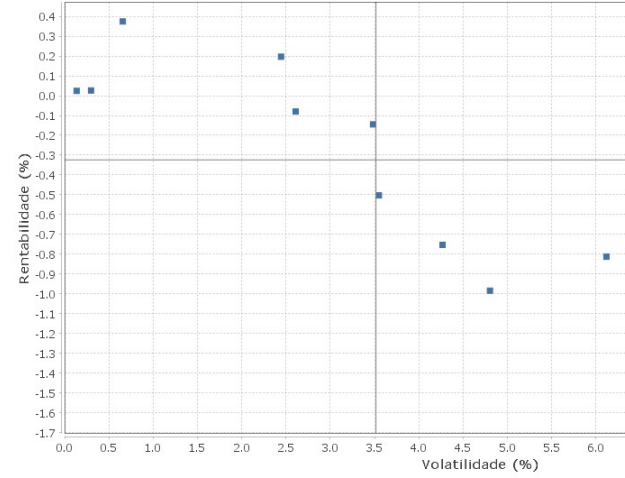
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Qua
172	15/09/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.106.000,00	2.667.073,14
173	18/09/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.534.993,69	0,00	1.980.898,36
184	21/09/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.000,00	2.183,99
174	21/09/2020	BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	0,00	7.010.098,46	5.598.512,92
175	22/09/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.500,00	2.838,99
176	22/09/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	30.442,84	0,00	13.296,27
177	23/09/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.000.000,00	0,00	436.754,09
178	23/09/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	6.010.385,45	0,00	2.625.060,47
179	25/09/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	60.000,00	26.204,07
180	25/09/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	610.501,20	0,00	266.626,94
181	30/09/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	47.000,00	20.535,47
182	30/09/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.835.000,00	2.112.532,76
183	30/09/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	11.000,00	0,00	4.806,17

Risco - Dispersão

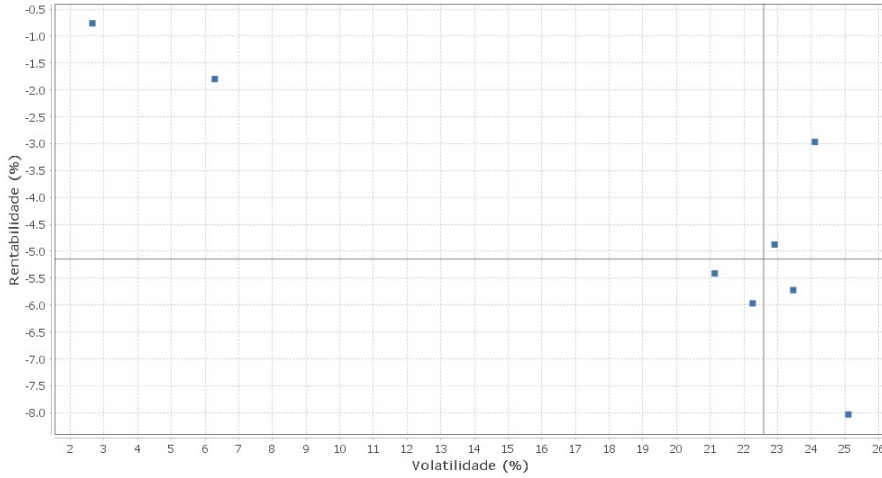
DIADEMA - No Mês



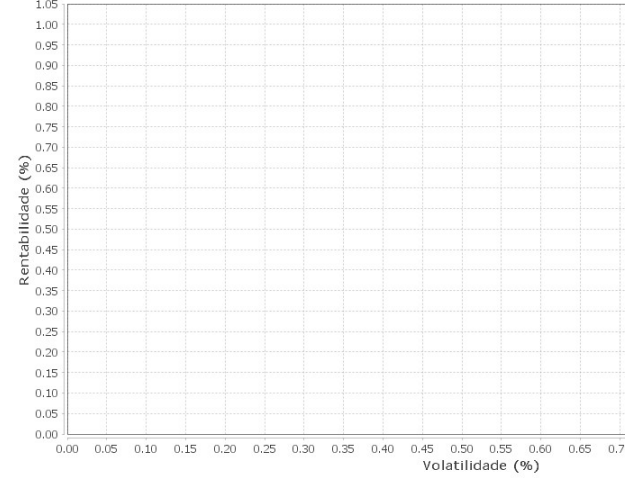
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,14	0,06	0,00	-0,97	0,02
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	Artigo 7º I, Alínea b	0,30	0,14	0,00	-0,44	0,03
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	Artigo 7º VII, Alínea b	0,66	0,26	0,00	0,33	0,37
BB PREV IPCA I	Artigo 7º I, Alínea b	2,44	0,98	0,03	0,02	0,20
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	Artigo 7º VII, Alínea b	2,61	0,87	0,02	-0,09	-0,08
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	Artigo 8º IV, Alínea b	2,65	0,76	0,00	-0,35	-0,76
SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TÍTULOS PUBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,48	1,01	0,01	-0,09	-0,14
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,55	1,33	0,13	-0,19	-0,50
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,27	1,43	0,19	-0,21	-0,75
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	Artigo 7º IV, Alínea a	4,80	NaN	0,00	-0,24	-0,98
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	6,12	2,00	0,14	-0,16	-0,81
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11	Artigo 8º IV, Alínea b	6,29	0,00	0,00	-0,31	-1,80
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	8,73	3,23	0,27	-0,19	-1,54
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	8,95	3,31	0,20	-0,20	-1,60
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	21,13	12,45	0,49	-0,26	-5,41
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	22,26	12,02	0,28	-0,28	-5,97
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	22,91	11,00	0,55	-0,22	-4,88
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	23,46	10,99	0,14	-0,25	-5,72
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	24,11	12,00	0,24	-0,13	-2,97
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	25,10	14,72	0,87	-0,33	-8,03

**Observações**

No respectivo mês de setembro de 2020, observar que:

- O percentual alocado no Artigo 8, Inciso IV, Alínea A (0,08% dos recursos) está inferior ao limite mínimo estipulado em Política de Investimentos.