



LDB
EMPRESAS

DIADEMA
4º TRIMESTRE 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 04.02.2021.

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

69,08%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	5,04	1,81	3,32	2.162.361,66	0,79	1.203.216.550,35	0,18
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	12,78	4,83	7,10	20.975.048,78	7,65	1.116.892.204,20	1,88
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	9,23	3,24	4,43	27.703.472,58	10,10	941.494.565,53	2,94
BB	BB	BB PREV IPCA I	4,92	1,22	2,92	17.085.725,36	6,23	518.693.988,11	3,29
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,27	2,38	3,17	25.371.233,59	9,25	9.568.490.825,39	0,27
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,95	1,32	2,04	36.475.668,18	13,30	14.722.139.597,34	0,25
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			7,27	2,50	3,76	129.773.510,15	47,34		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	13,31	4,94	7,16	22.389.848,89	8,17	2.099.544.961,17	1,07
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,23	0,25	0,57	23.447.795,12	8,55	2.596.482.307,62	0,90
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			8,37	2,63	4,00	45.837.644,01	16,72		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4,50	1,88	3,70	10.116.026,14	3,69	626.431.567,64	1,61
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	1,59	0,58	1,30	3.667.231,91	1,34	140.878.337,47	2,60
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			3,34	1,53	3,05	13.783.258,05	5,03		

Renda Fixa

7,31 2,46 3,75 189.394.412,21 69,08

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

30,92%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	40,19	7,96	20,15	14.181.223,87	5,17	1.793.128.513,73	0,79
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	46,24	6,93	16,94	9.040.587,23	3,30	1.356.738.390,13	0,67
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	46,05	5,23	12,39	7.023.686,25	2,56	2.636.774.357,29	0,27
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	42,06	10,11	22,82	4.685.247,22	1,71	1.060.739.165,08	0,44
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	52,63	7,97	17,87	21.203.702,96	7,73	1.462.115.658,32	1,45
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			46,13	7,62	17,96	56.134.447,53	20,48		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	33,38	3,19	11,55	24.009.333,42	8,76	1.201.804.027,43	2,00
Sub-total Artigo 8º III			33,38	3,19	11,55	24.009.333,42	8,76		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
PÁTRIA	PÁTRIA	PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FI EM PARTICIPAÇÕES	545,37	-0,76	-6,48	10.550,11	0,00	1.452.848,21	0,73
CEF	CEF	FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	11,16	-0,30	3,60	203.218,67	0,07	20.172.858,73	1,01
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			261,12	-0,33	3,09	213.768,78	0,08		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
RIO BRAVO	RIO BRAVO	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	32,98	0,51	5,23	3.102.132,69	1,13	64.214.146,47	4,83
BRPP	GERAÇÃO FUTURO	BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	17,90	2,13	-1,48	1.303.246,00	0,48	390.307.058,73	0,33
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			21,29	0,98	3,16	4.405.378,69	1,61		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável e Investimentos Estruturados	36,86	5,95	15,18	84.762.928,42	30,92
Total	12,87	3,52	6,92	274.157.340,63	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	129.773.510,15	47,34	15,00	55,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	45.837.644,01	16,72	5,00	15,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	13.783.258,05	5,03	0,00	2,00	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	189.394.412,21	69,08				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	56.134.447,53	20,48	2,00	15,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	24.009.333,42	8,76	2,00	7,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	213.768,78	0,08	1,00	2,00	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	4.405.378,69	1,61	1,00	2,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	84.762.928,42	30,92				30,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

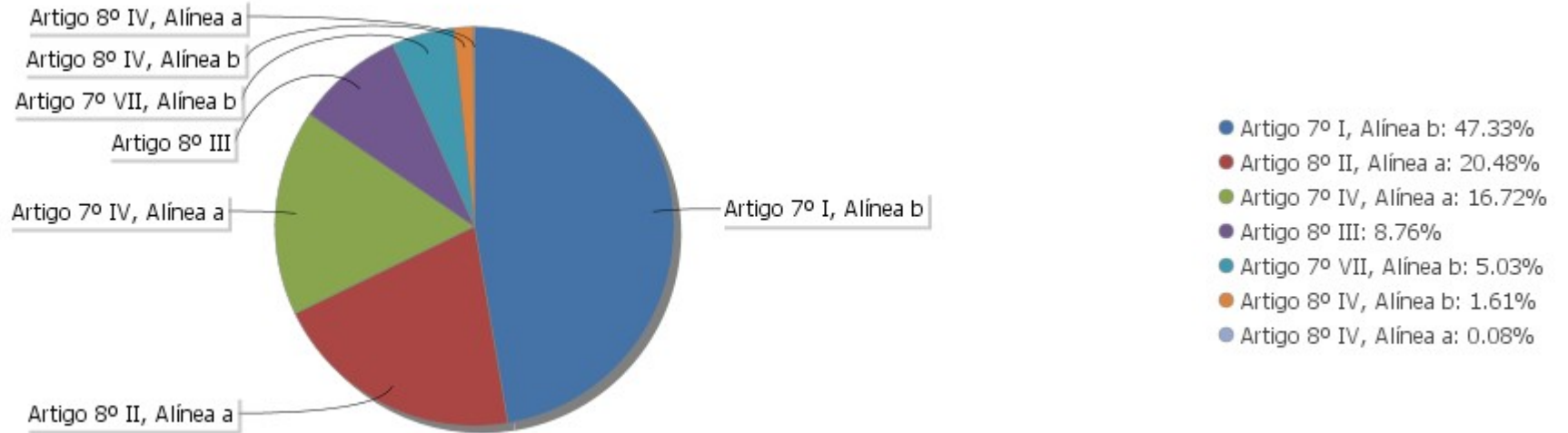
Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	2,50 1.522,81	3,76 796,78	3,76 796,78	4,27 433,25	6,88 249,33	3.305.106,56	5.083.171,47
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	2,63 1.601,59	4,00 847,97	4,00 847,97	4,18 424,29	4,76 172,75	1.110.982,34	1.599.925,93
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	1,53 932,89	3,05 645,89	3,05 645,89	4,63 469,49	5,79 210,11	208.260,63	407.475,77
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	7,62 -1,67	17,96 -7,84	17,96 -7,84	14,69 -10,51	-10,57 -13,49	3.976.321,84	8.547.702,43
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	3,19 -6,11	11,55 -14,25	11,55 -14,25	19,85 -5,36	12,17 9,26	742.063,15	2.486.566,11
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,33 -9,62	3,09 -22,72	3,09 -22,72	1,48 -23,73	-91,98 -94,89	-701,34	7.280,43
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	0,98 -8,32	3,16 -22,65	3,16 -22,65	3,33 -21,88	-4,63 -7,55	43.025,86	136.072,51
DIADEMA (Total)						9.385.059,04	18.268.194,65

Análise de Liquidez

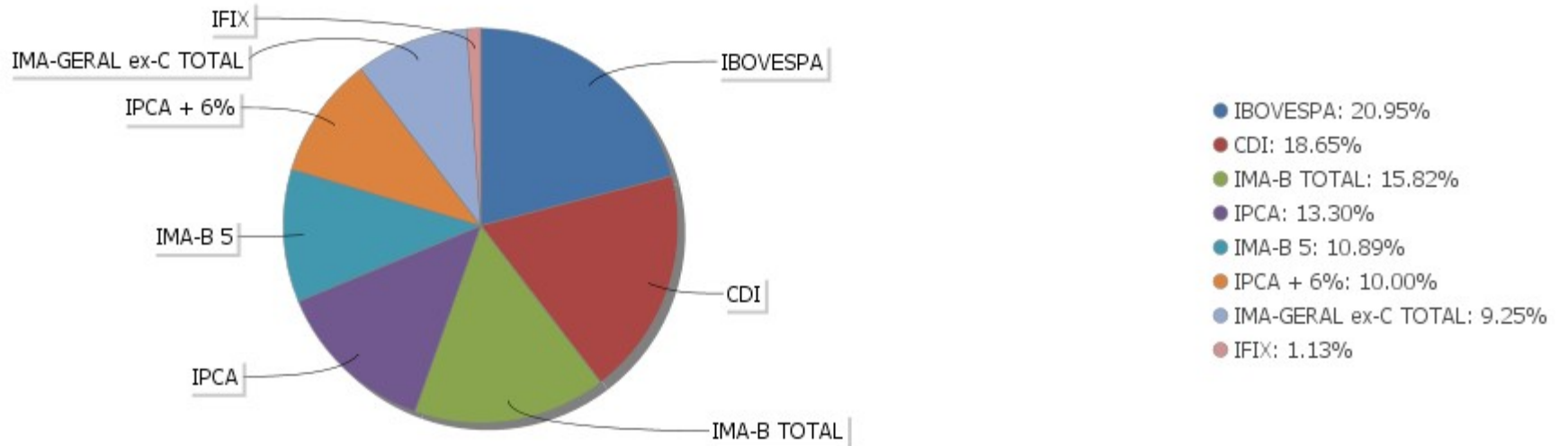
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	236.819.220,08	86,38	236.819.220,08	86,38
de 31 a 365 dias	7.034.236,36	2,57	243.853.456,44	88,95
acima de 365 dias	30.303.884,19	11,05	274.157.340,63	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

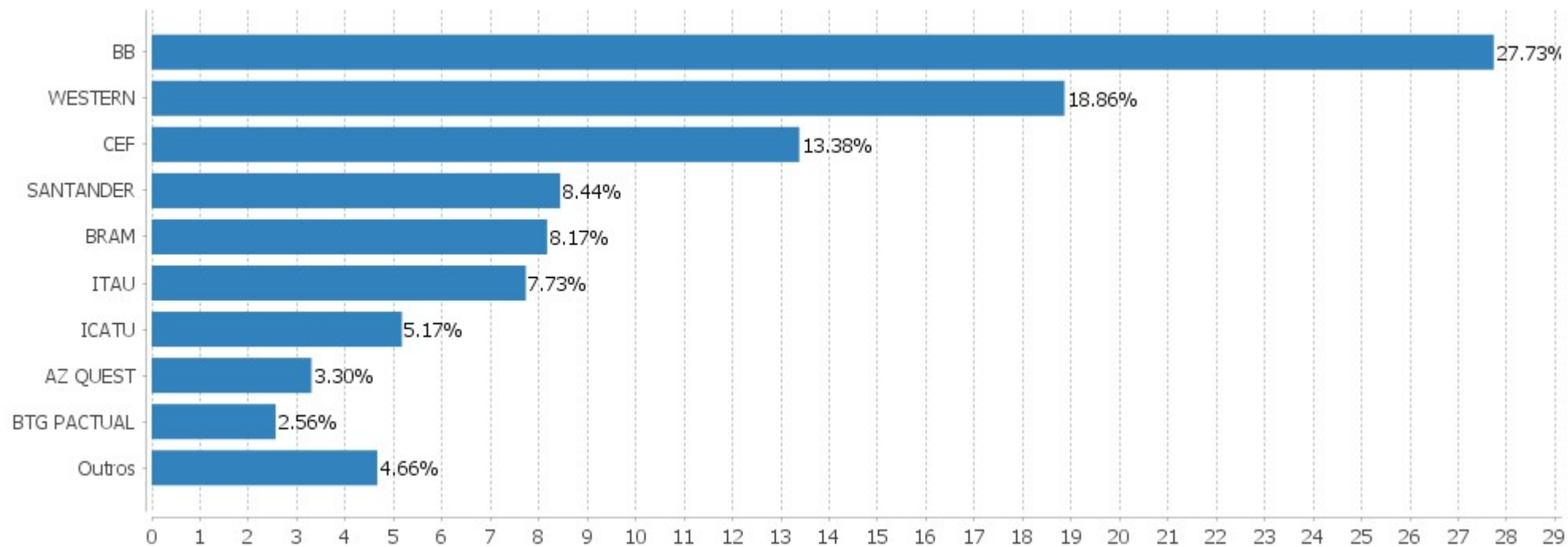


Alocação Por Estratégia



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	0,65	-1,49	-9,14	2,57	2,61	1,62	3,08	-0,83	-1,83	-0,62	3,93	3,52	3,39
IPCA + 5,88%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,64
p.p. indexador	-0,06	-2,15	-9,71	2,43	2,54	0,89	2,20	-1,55	-2,95	-1,96	2,58	1,66	-7,25
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	14	58,33	03 meses	6,92	4,62	2,30	5,82
Meses abaixo da Meta Atuarial	10	41,67	06 meses	7,29	7,49	-0,20	6,21
			12 meses	3,39	10,64	-7,25	12,87
			24 meses	19,22	22,35	-3,14	9,38
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,93	2020-11	Desde 31/12/2018	19,22	22,35	-3,14	9,38
Menor rentabilidade da Carteira	-9,14	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 Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	3,24 1,41	4,43 1,05	4,43 1,05	5,13 0,41	10,18 2,15	27,76 5,51	42,78 8,47
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,81 -0,02	3,32 -0,06	3,32 -0,06	4,59 -0,13	7,83 -0,21	21,74 -0,51	33,48 -0,83
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6% p.p.	1,22 -0,65	2,92 -1,73	2,92 -1,73	4,80 -2,76	8,36 -2,41	23,69 1,20	36,81 2,16
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	2,38 0,26	3,17 0,34	3,17 0,34	3,28 0,19	5,09 0,24	18,83 0,74	30,59 0,94
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	1,32 -0,03	2,04 -1,09	2,04 -1,09	1,95 -2,47	6,66 2,15	24,19 15,17	33,90 20,80
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,83 -0,03	7,10 -0,07	7,10 -0,07	8,05 -0,16	5,85 -0,55	29,76 -1,07	46,35 -1,56
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6% p.p.	1,88 0,02	3,70 -0,95	3,70 -0,95	5,14 -2,41	7,96 -2,80	21,14 -1,36	34,43 -0,21
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO % do CDI	0,58 352,28	1,30 275,11	1,30 275,11	3,24 328,09	0,25 9,00	5,63 63,34	12,89 81,20
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,94 0,09	7,16 -0,02	7,16 -0,02	8,14 -0,07	6,30 -0,10	30,60 -0,23	47,40 -0,51
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,25 153,00	0,57 120,84	0,57 120,84	1,01 102,85	2,40 87,00	8,28 93,21	15,14 95,36
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	3,19 1.939,35	11,55 2.449,51	11,55 2.449,51	19,85 2.012,61	12,17 441,42	48,40 544,90	44,80 282,22
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,23 -4,06	12,39 -13,42	12,39 -13,42	17,68 -7,53	7,88 4,96	50,20 14,78	81,69 25,92
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	7,97 -1,33	17,87 -7,94	17,87 -7,94	10,19 -15,02	-21,23 -24,15	10,15 -25,27	38,81 -16,97
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	6,93 -2,37	16,94 -8,86	16,94 -8,86	21,44 -3,77	-3,16 -6,07	44,95 9,53	83,27 27,49
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	10,11 0,81	22,82 -2,99	22,82 -2,99	24,40 -0,80	7,87 4,95	46,10 10,68	79,48 23,71
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	7,96 -1,33	20,15 -5,66	20,15 -5,66	13,27 -11,93	-9,45 -12,36	29,14 -6,28	57,09 1,31
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	0,51	5,23	5,23	6,54	0,23	16,41	6,04

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IFIX p.p.	-1,69	2,54	2,54	4,26	10,47	-5,64	-22,87
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPPF11	2,13	-1,48	-1,48	-3,92	-15,91	9,11	4,91
Var. IBOVESPA p.p.	-7,17	-27,29	-27,29	-29,13	-18,82	-26,31	-50,87
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	-0,30	3,60	3,60	2,00	-7,06	-69,71	-70,17
Var. IPCA + 6% p.p.	-2,17	-1,04	-1,04	-5,55	-17,82	-92,20	-104,81
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FI EM PARTICIPAÇÕES	-0,76	-6,48	-6,48	-8,18	-99,59	-99,75	-99,75
% do CDI	-462,04	-1.374,72	-1.374,72	-829,67	-3.611,12	-1.123,03	-628,37
DIADEMA	3,52	6,92	6,92	7,29	3,39	19,22	
Var. IPCA + 6% p.p.	1,65	2,27	2,27	-0,26	-7,38	-3,28	
CDI	0,16	0,47	0,47	0,99	2,76	8,88	15,87
IBOVESPA	9,30	25,81	25,81	25,21	2,92	35,42	55,78
INPC + 6%	1,98	4,85	4,85	8,23	11,75	23,79	35,66
IPCA + 6%	1,87	4,64	4,64	7,55	10,76	22,49	34,64

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Indexadores

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Renda Fixa							
IRF-M 1	0,31	0,70	0,70	1,21	3,84	10,86	18,59
IRF-M 1+	3,05	2,90	2,90	2,29	8,45	23,90	39,09
IRF-M TOTAL	1,95	1,99	1,99	1,75	6,69	19,53	32,36
IMA-B 5	1,83	3,38	3,38	4,72	8,04	22,25	34,31
IMA-B 5+	7,51	10,53	10,53	11,36	5,50	37,54	58,72
IMA-B TOTAL	4,85	7,18	7,18	8,21	6,41	30,83	47,91
IMA-C TOTAL	-1,12	3,64	3,64	13,59	22,07	45,76	72,56
IMA-GERAL ex-C TOTAL	2,12	2,83	2,83	3,09	4,85	18,09	29,65
IMA-GERAL TOTAL	2,02	2,86	2,86	3,40	5,34	18,84	30,77
IDKA 2	1,73	3,05	3,05	5,10	8,62	21,46	33,31
IDKA 20	11,36	15,90	15,90	16,58	2,20	47,44	77,53
CDI	0,16	0,47	0,47	0,99	2,76	8,88	15,87
Renda Variável							
IBOVESPA	9,30	25,81	25,81	25,21	2,92	35,42	55,78
IBRX 100	9,15	25,34	25,34	25,28	3,50	38,06	59,35
IBRX 50	9,42	26,47	26,47	26,00	3,62	33,83	53,28
SMALL CAP	7,52	22,54	22,54	25,33	-0,65	57,16	69,94
IFIX	2,19	2,69	2,69	2,28	-10,24	22,05	28,91
Índice Consumo - ICON							
Índice Dividendos - IDIV	8,94	25,44	25,44	21,29	-1,00	43,71	66,63
Indicadores Econômicos							
IPCA	1,35	3,13	3,13	4,42	4,52	9,02	13,10
INPC	1,46	3,34	3,34	5,07	5,45	10,17	13,96
IGPM	0,96	7,64	7,64	17,96	23,14	32,13	42,09
SELIC	0,16	0,47	0,47	0,99	2,76	8,88	15,88
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
184	05/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	13.000,00	5.688,16694400	2,2854462830
185	06/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	60.000,00	26.251,84779000	2,2855534010
186	06/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	976.000,00	427.030,05739200	2,2855534010
187	06/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	28.684,05	0,00	12.550,15524300	2,2855534010
188	07/10/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	133.382,80	0,00	90.338,50946000	1,4764777590
189	07/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	7.087,66	0,00	3.100,69619400	2,2858285870
190	08/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	7.487,62	0,00	3.274,15199300	2,2868883350
191	09/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	11.000,00	4.804,93904000	2,2893110420
192	09/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.058.000,00	462.147,77310300	2,2893110420
193	09/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.000,00	436,81264000	2,2893110420
194	09/10/2020	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,00	31.027,52	12.126,86131350	2,5585779000
195	13/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	32.173,15	0,00	14.045,97002700	2,2905609180
196	15/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	51.000,00	22.260,51344800	2,2910522760
197	15/10/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	0,00	10.000.000,00	6.753.764,44665800	1,4806557260
198	15/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	3.900.000,00	0,00	1.702.274,55778900	2,2910522760
199	20/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	14.000,00	6.109,17833400	2,2916338720
200	20/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	5.300.929,11	0,00	2.313.165,80487300	2,2916338720
201	22/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	32.006,15	0,00	13.965,73772100	2,2917622140
202	23/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	70.000,00	30.544,48270700	2,2917395810
203	29/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	48.000,00	20.939,85276500	2,2922797280
204	29/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.879.000,00	2.128.448,78415300	2,2922797280
205	29/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	15.796,57	0,00	6.891,20520800	2,2922797280
206	04/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.000,00	2.180,82851300	2,2927066340
207	05/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	56.000,00	24.423,42344200	2,2928808540
208	05/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	4.361,32561500	2,2928808540
209	05/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.011.000,00	440.930,01092300	2,2928808994
210	06/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	28.231,05	0,00	12.311,16386500	2,2931260040
211	09/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	12.000,00	5.232,51287500	2,2933531720

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
212	09/11/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	145.550,88	0,00	97.515,87289300	1,4925865470
213	09/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	7.988,90	0,00	3.483,50184200	2,2933531720
214	09/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.067.000,00	465.257,60315800	2,2933531720
215	10/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	11.553,41	0,00	5.037,43070800	2,2935124410
216	11/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.000.000,00	0,00	436.029,12154400	2,2934247980
217	11/11/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	0,00	5.000.000,00	3.363.147,29102700	1,4867026530
218	11/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.007.487,66	0,00	1.747.381,32398900	2,2934247980
219	13/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	51.000,00	22.235,25620000	2,2936547050
220	13/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.000,00	871,97083100	2,2936547050
221	13/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.126.000,00	2.670.846,65649400	2,2936547050
222	16/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	24.514,43	0,00	10.686,60010300	2,2939409880
223	19/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	9.000,00	3.922,47886800	2,2944674280
224	19/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	5.279.042,62	0,00	2.300.770,34678200	2,2944674280
225	24/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	30.877,74	0,00	13.454,58764800	2,2949599650
226	25/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	4.356,86388600	2,2952289220
227	25/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	60.000,00	26.141,18331500	2,2952289220
228	30/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	43.000,00	18.728,30951700	2,2959893930
229	30/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.800.000,00	2.090.601,99260300	2,2959893930
230	01/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	10.000,00	0,00	4.354,85531300	2,2962875410
231	01/12/2020	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	0,00	10.000.000,00	363.381,43900400	27,5192922000
232	02/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	10.000.000,00	0,00	4.354.230,31730400	2,2966171450
233	04/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	53.000,00	23.071,90142900	2,2971665410
234	04/12/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	0,00	8.299.871,80	5.504.050,25604600	1,5079571250
235	04/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.051.131,32	0,00	3.504.809,58881400	2,2971665410
236	04/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.014.000,00	441.413,35941600	2,2971665410
237	07/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	9.000,00	3.917,33324100	2,2974813340
238	09/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	292.775,23	0,00	127.405,32414100	2,2979826940
239	10/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	11.000,00	4.786,33475900	2,2982094970
240	10/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.041.000,00	452.961,31678100	2,2982094970
241	11/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	21.753,55030500	2,2984753890

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

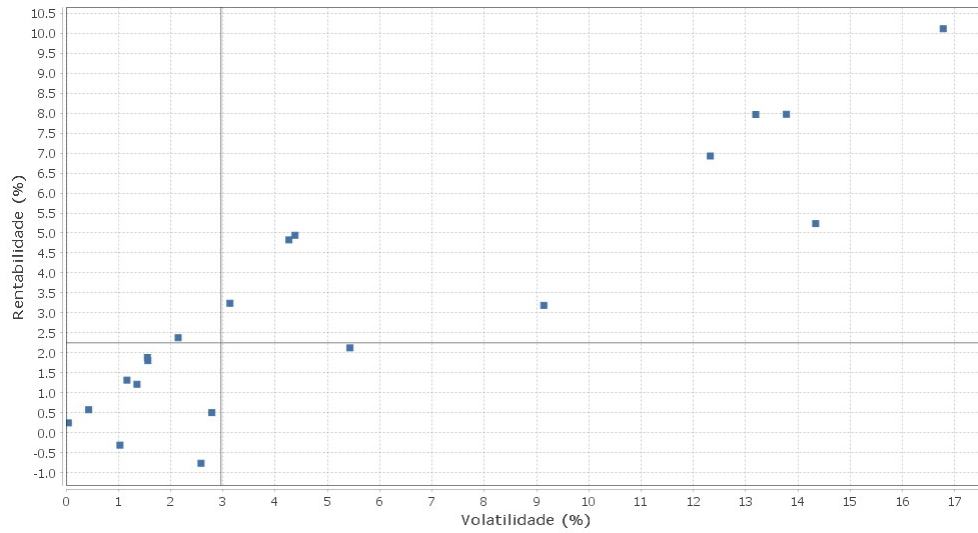
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
242	11/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.130.000,00	2.666.985,26742300	2,2984753890
243	14/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	33.205,78	0,00	14.445,09222700	2,2987586010
244	15/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	33.400,00	14.527,29606100	2,2991202120
245	15/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.192.000,00	2.258.255,12424300	2,2991202120
246	17/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	498.449,47	0,00	216.766,22590400	2,2994793950
247	18/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	15.000,00	6.522,53158100	2,2997205630
248	18/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	5.028.740,63	0,00	2.186.674,63817400	2,2997205630
249	18/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	600.000,00	260.901,26324600	2,2997205630
250	21/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	53.000,00	23.043,39684800	2,3000081260
251	21/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.035.000,00	449.998,41013600	2,3000081260
252	22/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	37.000,00	16.084,37744100	2,3003687980
253	22/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.740.000,00	2.060.539,16403400	2,3003687980
254	22/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.522.774,32	0,00	661.969,64648600	2,3003687980
255	23/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	11.000,00	4.781,17241700	2,3006909270
256	23/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.045.000,00	454.211,37960600	2,3006909270
257	24/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	68.000,00	29.554,02303400	2,3008711850
258	28/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	41.384,57	0,00	17.984,89314100	2,3010740000
259	29/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	272.724,11	0,00	118.506,27485000	2,3013474210
260	29/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	272.724,11	118.506,27485100	2,3013474210
261	30/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.000,00	868,96500300	2,3015886640
262	30/12/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	5.439.172,55	0,00	2.363.225,29523800	2,3015886640

Total

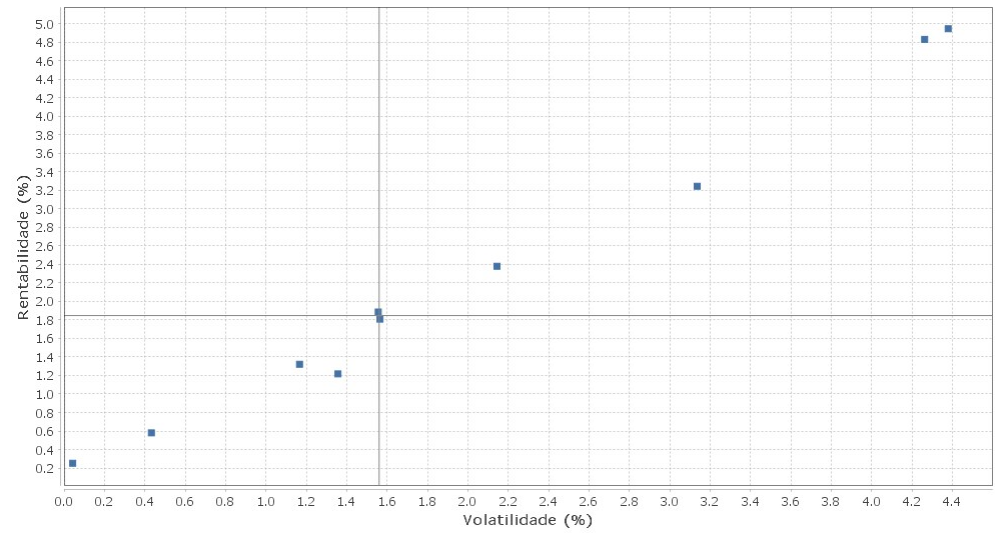
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

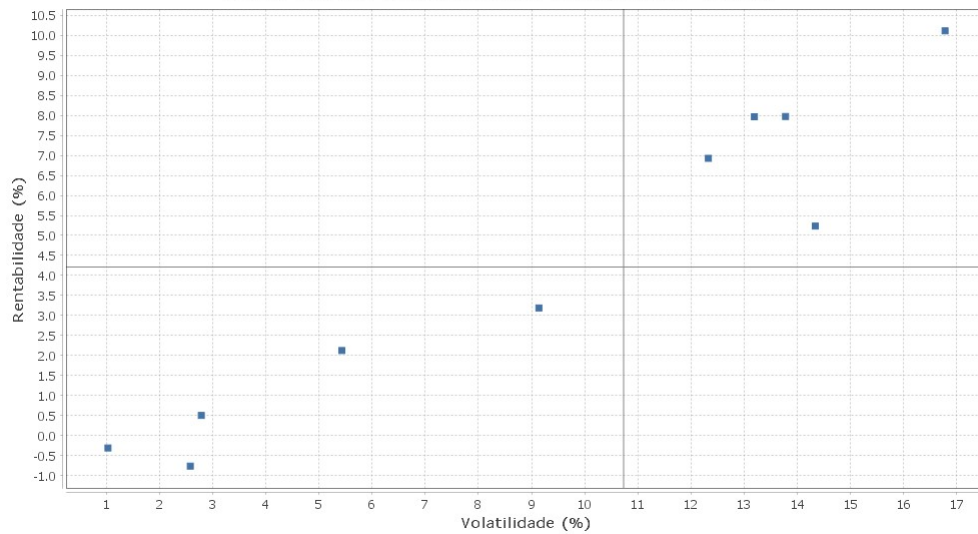
DIADEMA - No Mês



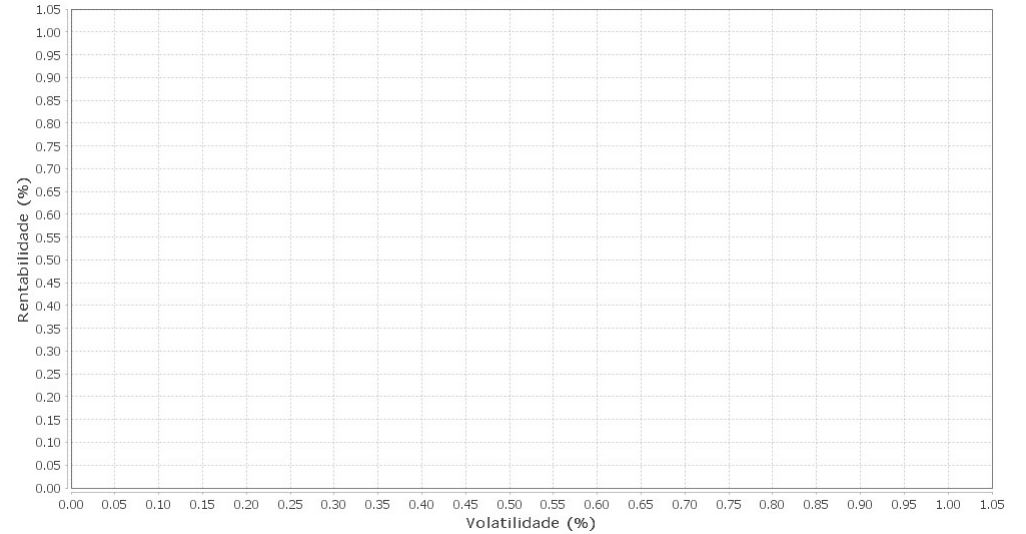
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 9.079.389,71

Value-At-Risk: 3,31%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,09	0,00	2,04	0,25	23.447.795,12	8,55
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	Artigo 7º VII, Alínea b	0,43	0,20	0,00	0,96	0,58	3.667.231,91	1,34
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	Artigo 8º IV, Alínea a	1,03	0,12	0,00	-0,45	-0,30	203.218,67	0,07
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,17	1,25	0,12	0,99	1,32	36.475.668,18	13,30
BB PREV IPCA I	Artigo 7º I, Alínea b	1,36	1,11	0,04	0,78	1,22	17.085.725,36	6,23
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	Artigo 7º VII, Alínea b	1,56	0,94	0,02	1,11	1,88	10.116.026,14	3,69
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,57	1,05	0,01	1,05	1,81	2.162.361,66	0,79
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,14	1,33	0,09	1,03	2,38	25.371.233,59	9,25
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FI EM PARTICIPAÇÕES	Artigo 8º IV, Alínea a	2,58	0,35	0,00	-0,36	-0,76	10.550,11	0,00
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	Artigo 8º IV, Alínea b	2,79	3,31	0,00	0,12	0,51	3.102.132,69	1,13
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,14	1,87	0,14	0,98	3,24	27.703.472,58	10,10
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,26	2,56	0,14	1,09	4,83	20.975.048,78	7,65
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	4,38	2,64	0,16	1,09	4,94	22.389.848,89	8,17
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	Artigo 8º IV, Alínea b	5,43	2,63	0,00	0,36	2,13	1.303.246,00	0,48
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	9,14	8,26	0,48	0,33	3,19	24.009.333,42	8,76
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	12,32	11,32	0,34	0,55	6,93	9.040.587,23	3,30
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	13,19	10,14	0,49	0,59	7,96	14.181.223,87	5,17
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	13,78	11,63	0,85	0,57	7,97	21.203.702,96	7,73
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	14,34	10,25	0,24	0,35	5,23	7.023.686,25	2,56
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	16,78	11,09	0,18	0,59	10,11	4.685.247,22	1,71

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

-Referente ao mês de dezembro de 2020, vale observar que:

- Os recursos alocados no Artigo 7º, Inciso V II, Alínea B, representavam 5,03% dos recursos totais do Instituto, alocação está superior ao limite máximos estipulado em Política de Investimentos.
- Os recursos alocados no Artigo 7º, Inciso V II, Alínea B, representavam 5,03% dos recursos totais do Instituto, percentual está superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;
- Os recursos alocados no Artigo 8º, Inciso II, Alínea A, representavam 20,48% dos recursos totais do Instituto, alocação está superior ao limite máximos estipulado em Política de Investimentos.
- Os recursos alocados no Artigo 8º, Inciso II, Alínea A, representavam 20,48% dos recursos totais do Instituto, percentual está superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;
- Os recursos alocados no Artigo 8º, Inciso IV, Alínea B, representavam 0,08% dos recursos totais do Instituto, alocação está inferior ao limite mínimo estipulado em Política de Investimentos.