



LDB
EMPRESAS

DIADEMA
FEVEREIRO 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 06.04.2020.

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 75,33%

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
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,25	0,35	0,77	30.416,81	0,01	788.508.955,47	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	1,98	0,63	1,18	27.012.047,91	7,68	9.698.235.388,71	0,28
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FI	1,97	0,62	1,17	2.028.691,51	0,58	1.191.923.039,47	0,17
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	4,90	0,43	0,67	29.844.085,10	8,49	1.413.979.781,38	2,11
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RENDA FIXA	3,15	1,03	1,94	25.629.693,77	7,29	533.375.496,94	4,81
BB	BB	BB PREV IPCA I	2,29	0,73	1,37	16.392.633,52	4,66	497.651.331,34	3,29
BB	BB	BB PREV ALOC FIC	2,33	0,46	0,94	45.152.811,60	12,84	10.908.803.618,87	0,41
CEF	CEF	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	3,44	0,62	1,44	34.689.540,26	9,87	10.626.779.468,55	0,33
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,21	0,61	1,20	180.779.920,48	51,42		

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
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	5,01	0,46	0,73	21.217.016,84	6,03	1.974.476.515,72	1,07
BB	BB	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,06	0,27	0,62	4.196.239,49	1,19	2.774.667.818,45	0,15
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	2,18	0,39	0,82	45.488.828,63	12,94	1.234.231.884,13	3,69
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			2,24	0,40	0,76	70.902.084,96	20,17		

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	1,74	0,32	1,15	9.478.246,24	2,70	591.773.269,86	1,60
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	0,19	0,08	0,47	3.675.483,85	1,05	115.837.077,62	3,17
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			1,44	0,25	0,96	13.153.730,09	3,74		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

2,18

0,53

1,07

264.835.735,53

75,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

24,67%

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	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	15,61	-7,00	-6,42	14.654.605,05	4,17	1.963.717.198,95	0,75
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	20,19	-6,19	0,07	9.341.821,83	2,66	1.484.406.611,62	0,63
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	18,63	-7,13	-5,24	6.169.553,93	1,75	1.938.091.271,83	0,32
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	20,50	-9,52	-8,66	3.967.627,08	1,13	585.852.213,57	0,68
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	19,26	-9,27	-7,93	24.782.535,45	7,05	2.262.526.519,52	1,10
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			18,17	-8,03	-6,14	58.916.143,34	16,76		

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	15,04	-7,50	-7,16	19.870.429,08	5,65	814.886.135,28	2,44
Sub-total Artigo 8º III			15,04	-7,50	-7,16	19.870.429,08	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	84,38	-0,13	-0,28	2.553.603,61	0,73	351.654.832,44	0,73
CEF	CEF	FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	160,13	-0,44	-0,87	227.417,10	0,06	22.795.921,32	1,00
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			81,31	-0,15	-0,33	2.781.020,71	0,79		

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	18,88	0,22	-2,04	3.640.412,64	1,04	84.334.411,42	4,32
BRPP	GERAÇÃO FUTURO	BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	12,45	-3,54	-8,85	1.530.104,98	0,44	272.242.397,80	0,56
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			18,38	-0,92	-8,40	5.170.517,62	1,47		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável e Investimentos Estruturados	13,65	-7,28	-6,35	86.738.110,75	24,67
Total				351.573.846,28	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	180.779.920,48	51,42	15,00	55,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	70.902.084,96	20,17	5,00	15,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	13.153.730,09	3,74	0,00	2,00	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	264.835.735,53	75,33				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	58.916.143,34	16,76	2,00	15,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	19.870.429,08	5,65	2,00	7,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	2.781.020,71	0,79	1,00	2,00	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	5.170.517,62	1,47	1,00	2,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	86.738.110,75	24,67				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Rentabilidades por Artigo

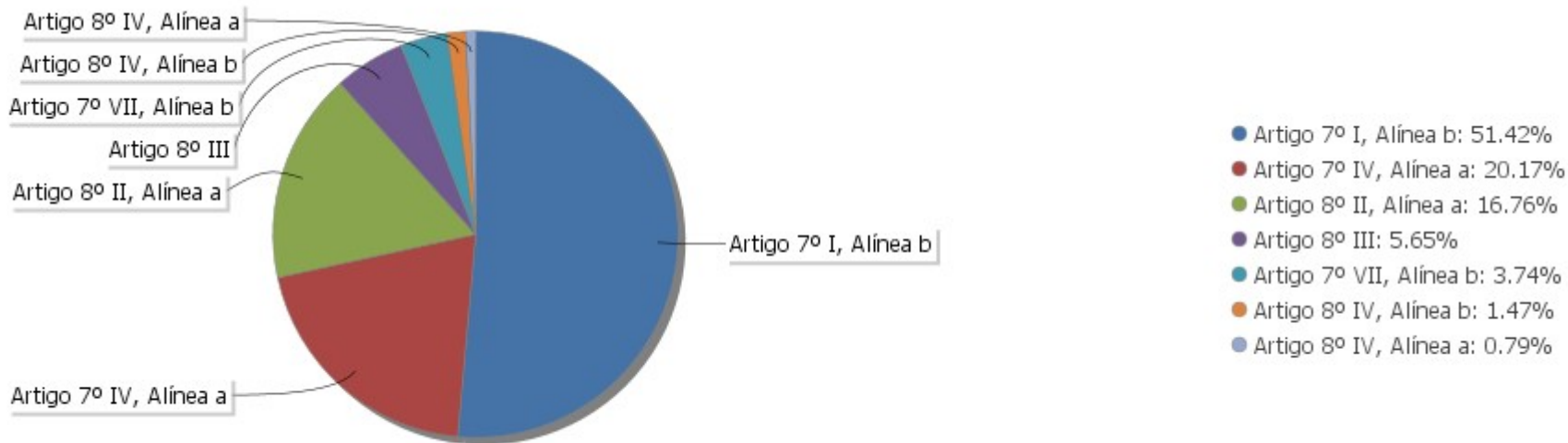
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,61 207,36	1,20 178,94	2,38 227,04	5,26 220,04	11,68 209,51	1.113.348,22	2.189.489,14
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,40 136,21	0,76 112,72	1,90 180,99	4,68 195,86	9,97 178,83	292.486,96	573.640,47
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,25 85,22	0,96 143,35	1,84 175,22	4,22 176,46	10,25 183,90	32.843,83	125.399,91
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-8,03 0,40	-6,14 3,78	2,40 6,16	6,73 3,73	23,52 14,54	-5.141.772,73	-3.852.905,11
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-7,50 0,93	-7,16 2,76	-4,73 -0,98	0,87 -2,13	5,74 -3,25	-1.611.864,57	-1.533.284,30
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,15 8,28	-0,33 9,59	-36,55 -32,80	-43,28 -46,28	-41,83 -50,81	-4.252,08	-9.179,96
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-0,92 7,50	-8,40 1,53	-5,36 -1,61	9,99 6,99	5,47 -3,51	-47.936,62	-480.481,52
						-5.367.146,99	-2.987.321,37

Análise de Liquidez

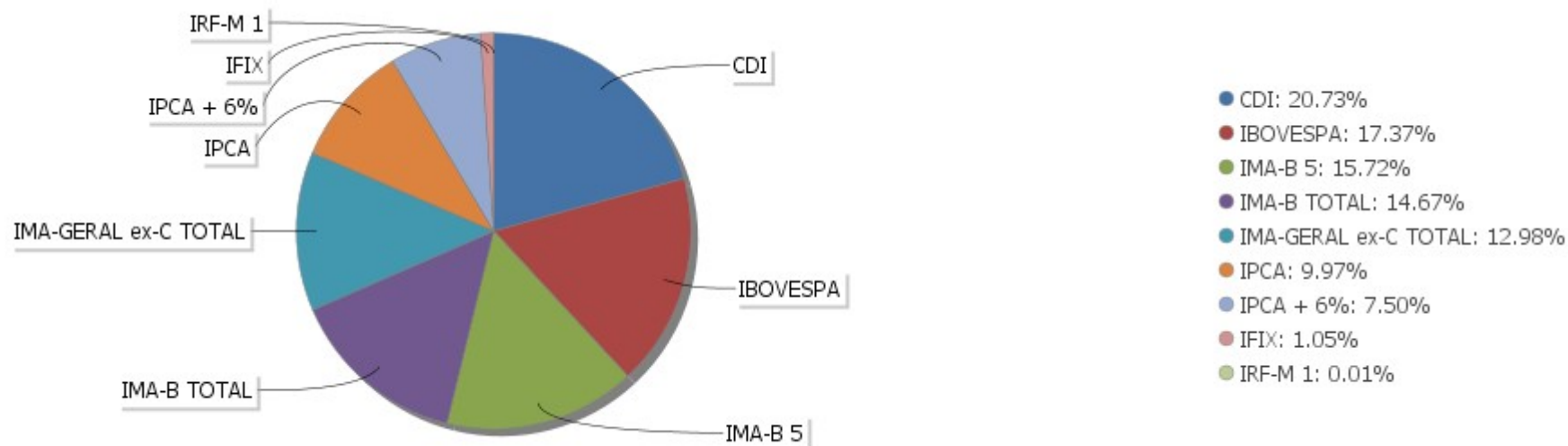
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	313.339.396,34	89,12	313.339.396,34	89,12
de 31 a 364 dias	6.169.553,93	1,75	319.508.950,27	90,88
acima de 365 dias	32.064.896,01	9,12	351.573.846,28	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

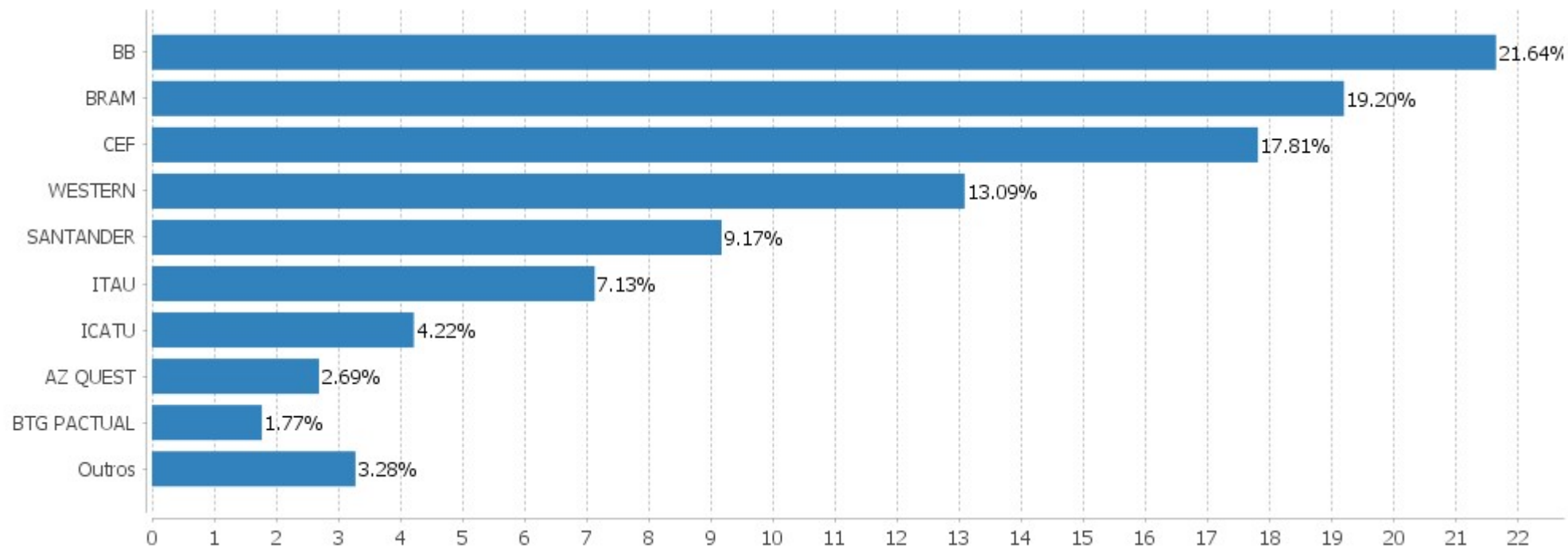


Alocação Por Estratégia



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											-0,85
IPCA + 5,88%	0,71	0,66											1,38
p.p. indexador	-0,06	-2,15											-2,22
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

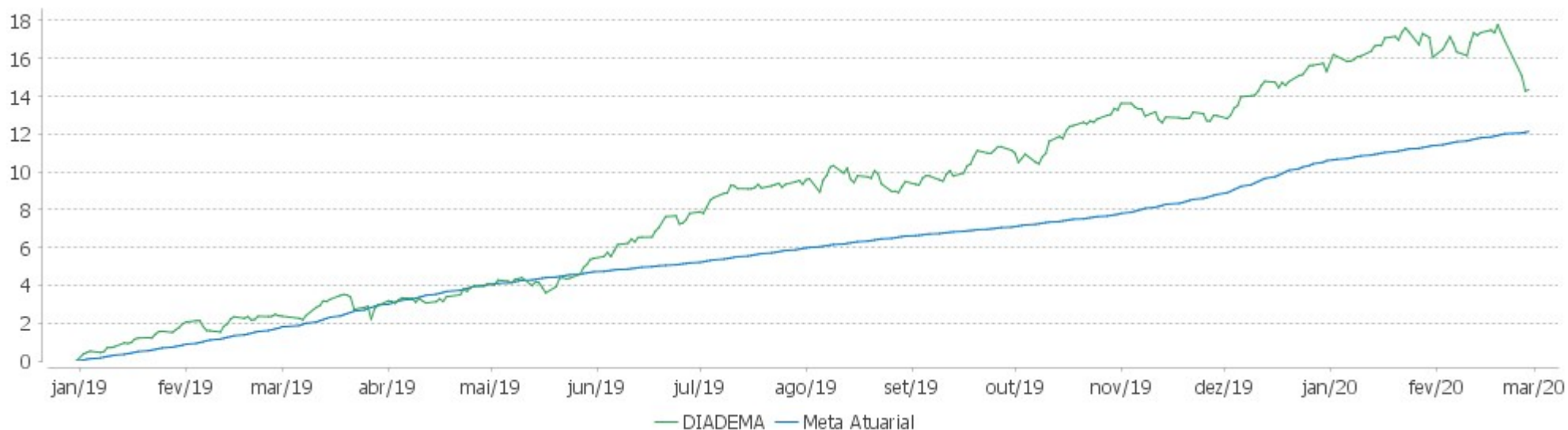
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

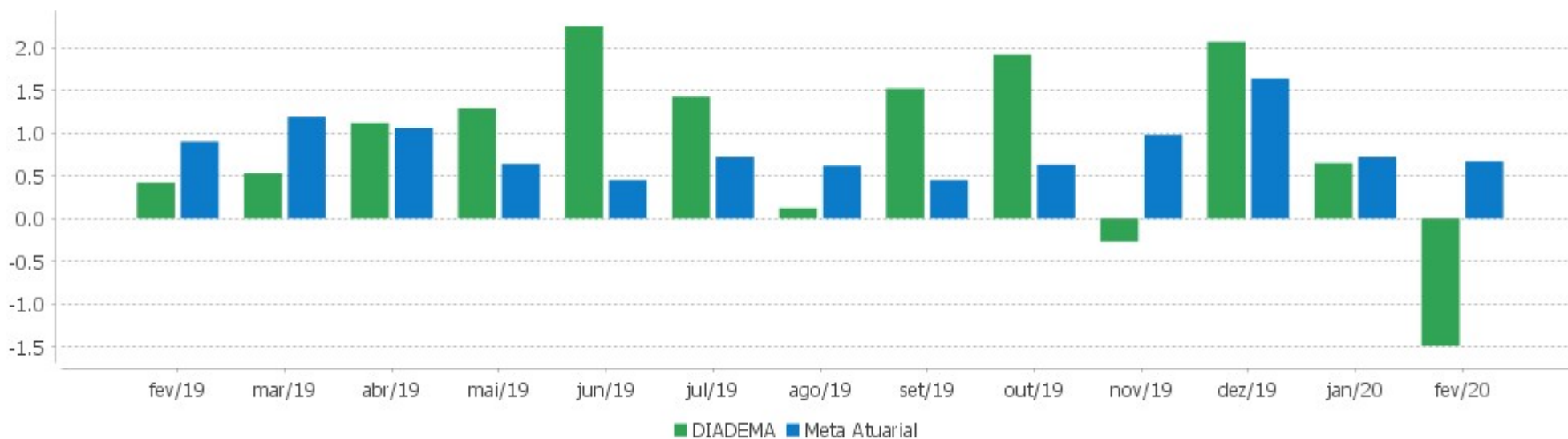
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	8	57,14	03 meses	1,21	3,04	-1,83	5,85
Meses abaixo da Meta Atuarial	6	42,86	06 meses	4,43	5,17	-0,74	4,72
			12 meses	11,67	10,20	1,47	4,21
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,25	2019-06					
Menor rentabilidade da Carteira	-1,49	2020-02	Desde 31/12/2018	14,33	12,11	2,22	3,98

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.	1,03 0,38	1,94 0,73	3,37 0,92	7,08 1,42	15,24 3,07	28,81 5,32	45,44 7,48
SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,62 -0,02	1,17 -0,04	2,40 -0,06	5,54 -0,12	11,91 -0,26	22,97 -0,52	37,12 -0,84
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B 5 p.p.	0,63 -0,01	1,18 -0,03	2,40 -0,05	5,51 -0,15	11,87 -0,29	22,95 -0,54	37,12 -0,84
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6% p.p.	0,73 0,06	1,37 -0,02	2,57 -0,49	5,75 0,56	12,96 2,74	25,03 3,65	40,63 8,40
BB PREV ALOC FIC Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,46 0,01	0,94 -0,00	1,91 0,05	4,31 -0,05	11,46 0,39	22,39 0,50	35,25 -0,19
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,35 -0,03	0,77 -0,05	1,17 -0,07	2,73 -0,15	6,23 -0,29	13,27 -0,58	24,19 -0,87
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF Var. IPCA p.p.	0,62 0,37	1,44 0,98	2,04 0,43	5,45 3,26	14,23 10,23	25,27 17,21	37,87 26,74
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,43 -0,02	0,67 -0,04	2,66 -0,07	6,41 -0,13	17,66 -0,34	33,92 -0,73	48,18 -1,08
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,46 0,01	0,73 0,02	2,76 0,03	6,61 0,07	17,85 -0,15	34,37 -0,29	48,92 -0,35
BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,27 92,98	0,62 92,92	0,98 93,45	2,23 93,12	5,33 95,61	11,98 97,04	22,11 98,72
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA % do CDI	0,39 132,79	0,82 122,20	1,67 159,69	4,16 174,08	10,71 192,17	21,41 173,53	
BB CRED PRIV III Var. IPCA + 6% p.p.	0,32 -0,35	1,15 -0,24	2,27 -0,79	5,33 0,14	11,18 0,96	23,55 2,17	39,64 7,41
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	0,08	0,47	0,74	1,46	4,69	11,87	22,40
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO Var. IFIX p.p.	-0,71 2,98	-2,04 5,27	-10,66 -13,20	-9,99 -21,55	-19,93 -41,67	-25,24 -53,47	-16,99 -63,07
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11 Var. IBOVESPA p.p.	-4,21 4,22	-8,85 1,08	-0,64 3,11	5,39 2,38	8,01 -0,98	-4,39 -26,44	8,52 -47,75
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-7,13 1,30	-5,24 4,68	1,57 5,32	5,51 2,51	24,91 15,92	47,72 25,67	92,53 36,26
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	-9,27 -0,84	-7,93 1,99	1,46 5,21	4,94 1,94	20,69 11,71	47,79 25,75	88,59 32,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-6,19 2,24	0,07 9,99	10,90 14,66	20,59 17,59	44,87 35,89	70,86 48,81	128,55 72,29
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-9,52 -1,09	-8,66 1,27	-1,90 1,86	-1,35 -4,35	14,90 5,91	33,22 11,17	72,91 16,64
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-7,00 1,43	-6,42 3,50	0,61 4,36	5,66 2,66	21,20 12,22	49,95 27,91	85,08 28,81
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	-7,50 -2.554,49	-7,16 -1.066,88	-4,73 -451,48	3,26 136,25	10,30 184,80	17,58 142,47	45,11 201,46
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA Var. IPCA + 6% p.p.	-0,44 -1,11	-0,87 -2,26	-1,45 -4,51	-72,16 -77,36	-67,67 -77,89	-68,10 -89,48	-63,04 -95,27
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FI EM PARTICIPAÇÕES % do CDI	-0,13 -43,32	-0,28 -41,77	-38,50 -3.671,79	-38,66 -1.616,41	-38,99 -699,50	-38,30 -310,37	-37,31 -166,61
CDI	0,29	0,67	1,05	2,39	5,57	12,34	22,39
IBOVESPA	-8,43	-9,92	-3,75	3,00	8,98	22,05	56,27
INPC + 6%	0,59	1,29	3,03	5,12	10,13	21,34	30,86
IPCA + 6%	0,67	1,39	3,06	5,19	10,22	21,38	32,23

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	0,38	0,82	1,25	2,87	6,52	13,85	25,06
IRF-M 1+	0,80	1,92	2,66	6,01	14,22	27,05	45,12
IRF-M TOTAL	0,65	1,53	2,17	4,91	11,86	22,99	39,06
IMA-B 5	0,64	1,20	2,45	5,66	12,17	23,49	37,96
IMA-B 5+	0,32	0,35	2,96	7,23	22,04	43,07	58,49
IMA-B TOTAL	0,45	0,71	2,73	6,54	18,00	34,65	49,27
IMA-C TOTAL	0,63	3,18	3,59	6,91	18,59	39,02	52,96
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,44	0,95	1,87	4,36	11,07	21,89	35,44
IMA-GERAL TOTAL	0,45	1,01	1,91	4,43	11,28	22,36	35,89
IDKA 2	0,69	1,22	2,44	5,37	11,19	22,52	37,76
IDKA 20	-0,09	-1,46	2,43	6,69	27,19	57,08	70,16
CDI	0,29	0,67	1,05	2,39	5,57	12,34	22,39
Renda Variável							
IBOVESPA	-8,43	-9,92	-3,75	3,00	8,98	22,05	56,27
IBRX 100	-8,22	-9,37	-2,78	3,55	11,15	25,47	60,69
IBRX 50	-8,66	-10,38	-4,50	2,05	6,61	18,16	52,61
SMALL CAP	-8,27	-7,86	3,80	13,95	35,70	51,63	99,83
IFIX	-3,69	-7,31	2,54	11,56	21,74	28,23	46,08
Índice Consumo - ICON	-10,00		0,78	4,44	34,77	34,01	67,27
Índice Dividendos - IDIV	-6,18	-7,66	1,56	7,52	21,63	42,31	67,61
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,25	0,46	1,62	2,20	4,00	8,05	11,13
INPC	0,17	0,36	1,58	2,12	3,92	8,02	9,97
IGPM	-0,04	0,44	2,54	3,54	6,84	14,98	14,49
SELIC	0,29	0,67	1,05	2,39	5,57	12,34	22,41
Meta Atuarial							
IPCA + 4%	0,53	1,09	2,59	4,20	8,15	16,85	24,92

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IPCA + 5%	0,60	1,24	2,82	4,70	9,18	19,10	28,54
IPCA + 5,5%	0,63	1,32	2,94	4,95	9,70	20,24	30,38
IPCA + 5,89%	0,66	1,38	3,03	5,14	10,11	21,13	31,82
IPCA + 6%	0,67	1,39	3,06	5,19	10,22	21,38	32,23
INPC + 4%	0,45	0,99	2,55	4,13	8,06	16,81	23,63
INPC + 6%	0,59	1,29	3,03	5,12	10,13	21,34	30,86

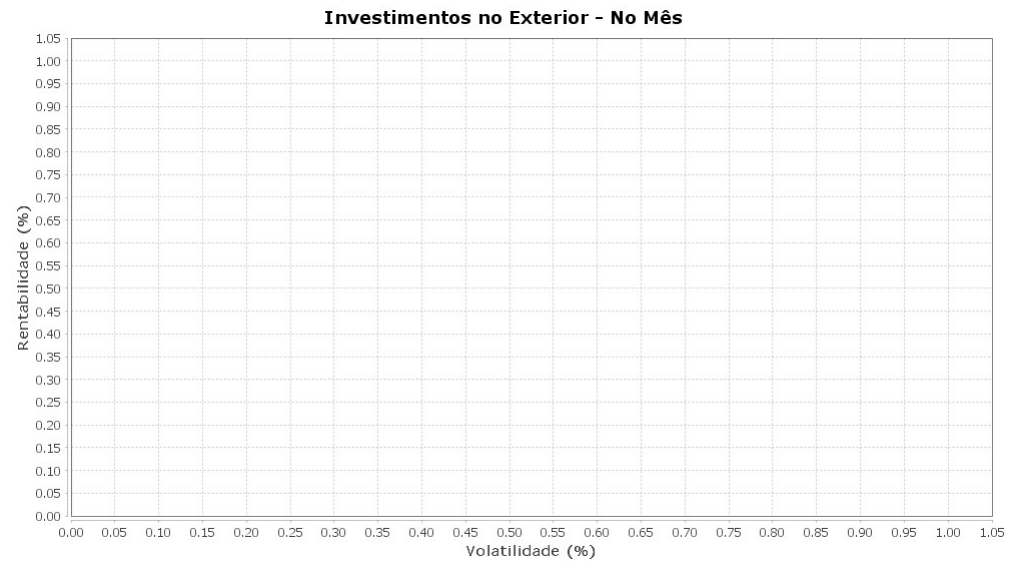
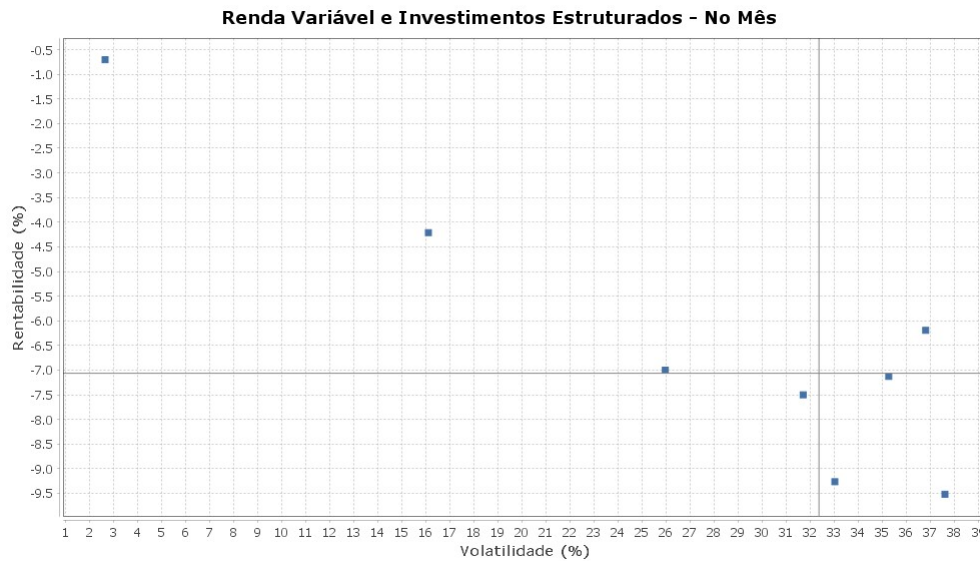
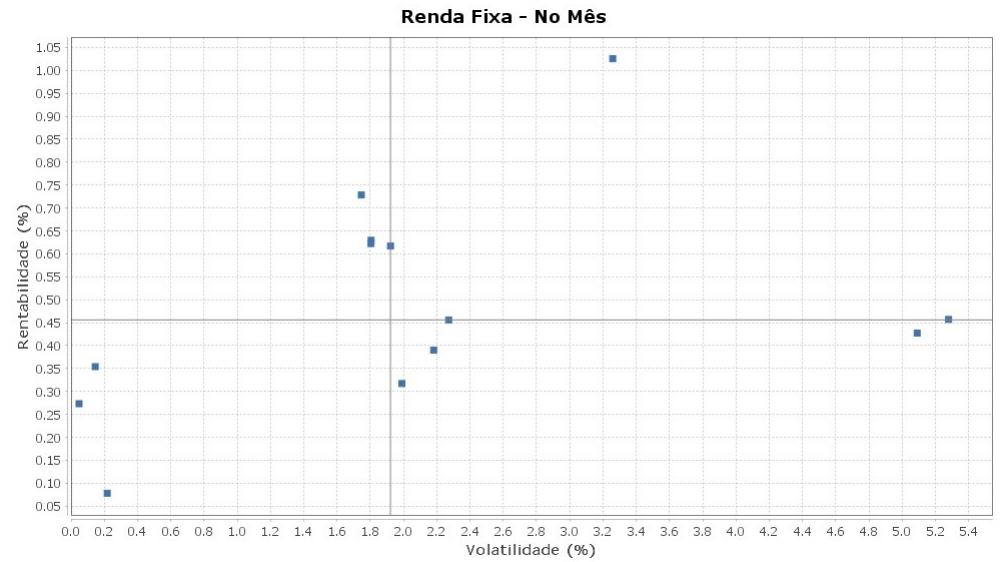
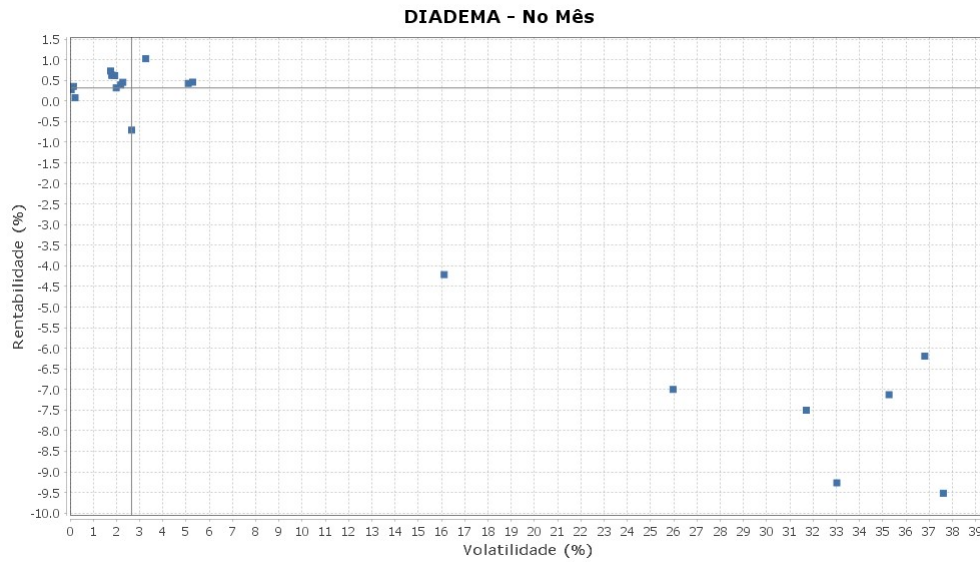
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
04/02/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.185.581,57	0,00	525.441,67721300	2,2563523630
05/02/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	939.300,46	416.183,86190600	2,2569362870
05/02/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	60.000,00	26.584,71147200	2,2569362870
07/02/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	28.225,74	0,00	12.501,89827300	2,2577163390
07/02/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	681.098,57	301.675,88294200	2,2577163390
07/02/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	28.225,74	12.501,89827300	2,2577163390
07/02/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	15.000,00	6.643,88158100	2,2577163390
12/02/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.000,00	2.213,72028700	2,2586410000
13/02/2020	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,00	1.198.381,56	478.643,73348496	2,5037026000
13/02/2020	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	0,00	1.360.000,00	450.003,01104956	3,0222020000
14/02/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.037.176,02	1.344.289,29080400	2,2593172770
14/02/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	55.000,00	24.343,63715100	2,2593172770
14/02/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	22.130,57922800	2,2593172770
17/02/2020	BB PREV IPCA I	0,00	420.721,50	184.844,32382400	2,2760855800
17/02/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	50.000,00	0,00	22.127,22048600	2,2596602240
18/02/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	455.822,63	0,00	201.693,23542800	2,2599797610
20/02/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.270.346,65	0,00	1.889.036,69054500	2,2605948690
21/02/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	80.000,00	35.383,77290500	2,2609233960
21/02/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.000,00	2.211,48580700	2,2609233960
28/02/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.346.029,99	1.921.443,80047000	2,2618564170
28/02/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	8.000,00	3.536,91770200	2,2618564170
28/02/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	42.000,00	18.568,81793400	2,2618564170

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



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	0,05	0,02	0,27	4.196.239,49	1,19
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	Artigo 7º I, Alínea b	0,15	0,03	0,35	30.416,81	0,01
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	Artigo 7º VII, Alínea b	0,22	0,03	0,08	3.675.483,85	1,05
BB PREV IPCA I	Artigo 7º I, Alínea b	1,75	0,22	0,73	16.392.633,52	4,66
SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,80	0,22	0,62	2.028.691,51	0,58
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	1,80	0,22	0,63	27.012.047,91	7,68
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,92	0,23	0,62	34.689.540,26	9,87
BB CRED PRIV III	Artigo 7º VII, Alínea b	1,99	0,22	0,32	9.478.246,24	2,70
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	Artigo 7º IV, Alínea a	2,18	0,25	0,39	45.488.828,63	12,94
BB PREV ALOC FIC	Artigo 7º I, Alínea b	2,27	0,26	0,46	45.152.811,60	12,84
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	Artigo 8º IV, Alínea b	2,65	0,24	-0,71	3.640.412,64	1,04
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	3,26	0,39	1,03	25.629.693,77	7,29
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,09	0,55	0,43	29.844.085,10	8,49
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	5,28	0,57	0,46	21.217.016,84	6,03
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	Artigo 8º IV, Alínea b	16,11	1,43	-4,21	1.530.104,98	0,44
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	25,96	2,29	-7,00	14.654.605,05	4,17
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	31,70	2,85	-7,50	19.870.429,08	5,65
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	33,02	2,88	-9,27	24.782.535,45	7,05
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	35,27	3,24	-7,13	6.169.553,93	1,75
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	36,80	3,46	-6,19	9.341.821,83	2,66
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	37,61	3,34	-9,52	3.967.627,08	1,13