



**LDB**  
EMPRESAS

**DIADEMA**  
JULHO 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 17.09.2020.

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

74,01%

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	BRADESCO	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,53	0,22	2,66	30.987,63	0,01	946.282.128,30	0,00
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TÍTULOS PUBLICOS RF	4,97	0,97	4,10	2.087.580,17	0,69	1.087.480.106,37	0,19
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	12,52	4,36	2,24	30.309.860,99	9,98	1.362.475.594,28	2,22
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	8,98	1,80	6,69	26.824.608,87	8,83	640.279.975,43	4,19
BB	BB	BB PREV IPCA I	4,97	0,79	4,21	16.851.301,24	5,55	511.575.671,32	3,29
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,08	1,77	3,55	47.281.072,05	15,56	10.799.663.748,52	0,44
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,95	0,98	5,65	36.128.028,99	11,89	12.451.209.797,34	0,29
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>7,06</b>	<b>1,96</b>	<b>4,50</b>	<b>159.513.439,94</b>	<b>52,50</b>		

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	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	13,04	4,47	2,70	21.631.226,23	7,12	1.967.216.400,50	1,10
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,24	1,61	11.180.962,04	3,68	2.412.408.451,26	0,46
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	6,64	1,71	3,52	19.257.537,04	6,34	1.237.407.026,84	1,56
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>8,19</b>	<b>2,39</b>	<b>2,96</b>	<b>52.069.725,31</b>	<b>17,14</b>		

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	4,46	0,98	3,69	9.715.709,56	3,20	606.599.266,38	1,60
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	1,55	0,97	-1,95	3.586.728,39	1,18	93.619.779,01	3,83
<b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b</b>			<b>3,29</b>	<b>0,98</b>	<b>2,10</b>	<b>13.302.437,95</b>	<b>4,38</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>7,13</b>	<b>2,01</b>	<b>3,94</b>	<b>224.885.603,20</b>	<b>74,01</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

25,99%

## 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	38,76	4,36	-16,57	13.065.564,71	4,30	1.602.131.208,86	0,82
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	45,92	14,10	-9,01	8.494.315,38	2,80	1.311.663.407,89	0,65
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	45,31	8,38	-0,65	6.468.372,64	2,13	2.366.861.217,15	0,27
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	41,18	9,90	-4,71	4.139.053,18	1,36	782.812.250,33	0,53
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	51,34	5,80	-24,37	20.359.396,40	6,70	1.851.616.977,67	1,10
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>45,12</b>	<b>7,32</b>	<b>-16,32</b>	<b>52.526.702,31</b>	<b>17,29</b>		

## 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	32,72	5,63	-1,13	21.161.769,62	6,96	934.074.693,62	2,27
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>32,72</b>	<b>5,63</b>	<b>-1,13</b>	<b>21.161.769,62</b>	<b>6,96</b>		

## 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	545,17	-0,89	-99,56	11.388,01	0,00	1.582.306,81	0,72
CEF	CEF	FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	159,94	-0,69	-9,51	207.591,06	0,07	20.489.283,34	1,01
<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a</b>			<b>264,40</b>	<b>-0,70</b>	<b>-92,15</b>	<b>218.979,07</b>	<b>0,07</b>		

## 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	24,18	1,58	-8,86	3.694.526,91	1,22	112.715.459,16	3,28
BRPP	GERAÇÃO FUTURO	BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	19,14	-2,70	-19,13	1.357.497,98	0,45	241.531.471,04	0,56
<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b</b>			<b>19,01</b>	<b>0,39</b>	<b>-7,34</b>	<b>5.052.024,89</b>	<b>1,66</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável e Investimentos Estruturados	35,80	6,37	-14,54	78.959.475,89	25,99
Total				303.845.079,09	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			
				Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>							
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	159.513.439,94	52,50	15,00	55,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	52.069.725,31	17,14	5,00	15,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	13.302.437,95	4,38	0,00	2,00	5,00	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>224.885.603,20</b>	<b>74,01</b>				
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	52.526.702,31	17,29	2,00	15,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	21.161.769,62	6,96	2,00	7,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	218.979,07	0,07	1,00	2,00	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	5.052.024,89	1,66	1,00	2,00	5,00	5,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>78.959.475,89</b>	<b>25,99</b>				

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	1,96 1.007,37	4,50 230,70	4,91 763,02	3,89 247,95	8,74 207,28	3.062.274,51	6.664.573,22
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	2,39 1.229,28	2,96 151,58	4,89 758,86	2,59 165,30	6,99 165,86	1.355.048,52	1.836.500,87
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,98 504,23	2,10 107,78	3,64 565,50	1,38 88,16	5,63 133,69	129.086,88	274.107,77
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	7,32 -0,94	-16,32 -5,31	27,29 -0,54	-18,00 -8,47	-3,09 -4,17	3.584.316,40	-10.242.346,14
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	5,63 -2,63	-1,13 9,88	12,25 -15,58	-1,49 8,04	6,88 5,80	1.128.466,45	-241.943,76
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,70 -8,97	-92,15 -81,14	-92,10 -119,93	-92,14 -82,60	-95,40 -96,48	-1.553,84	-2.571.221,60
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	0,39 -7,87	-7,34 3,67	4,32 -23,51	0,22 9,75	0,44 -0,64	19.840,34	-425.037,68
						9.277.479,26	-4.705.367,32

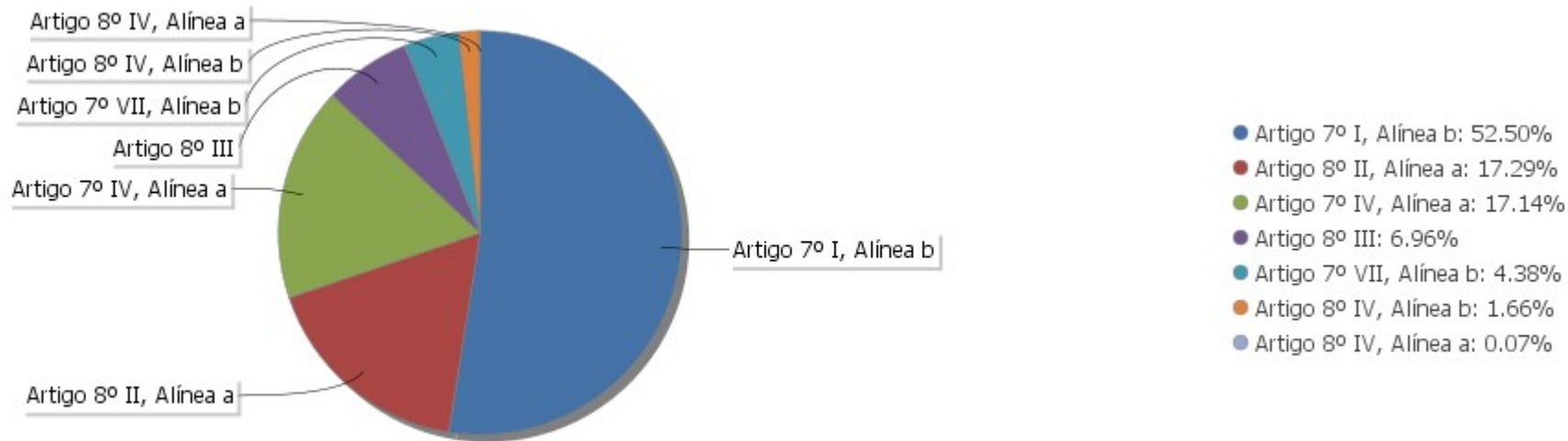
Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	267.103.780,73	87,91	267.103.780,73	87,91
de 31 a 364 dias	6.479.760,65	2,13	273.583.541,38	90,04
acima de 365 dias	30.261.537,71	9,96	303.845.079,09	100,00

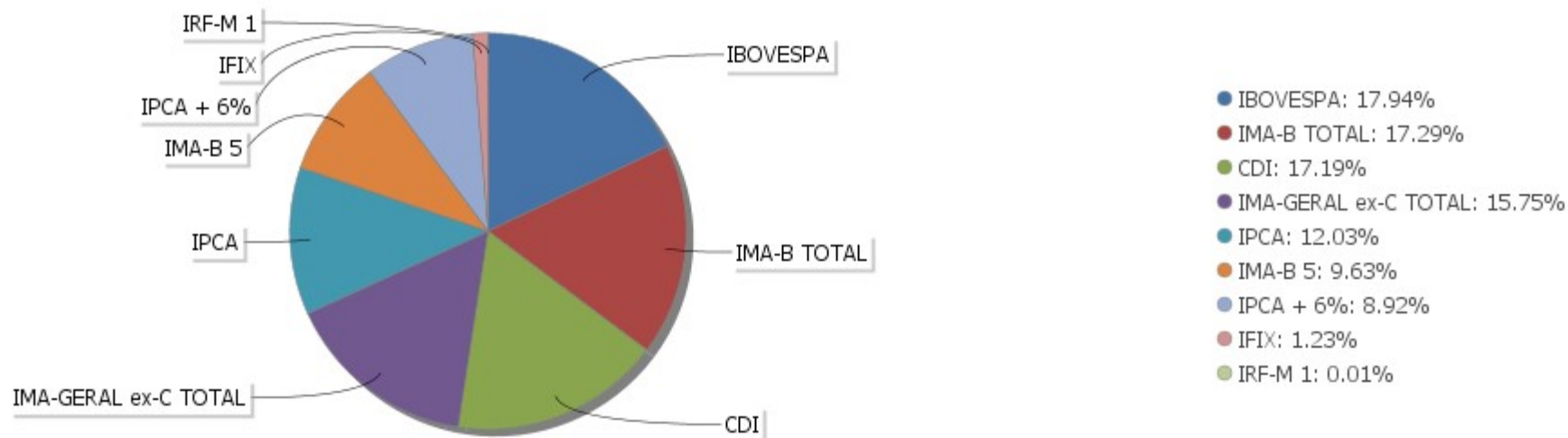


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



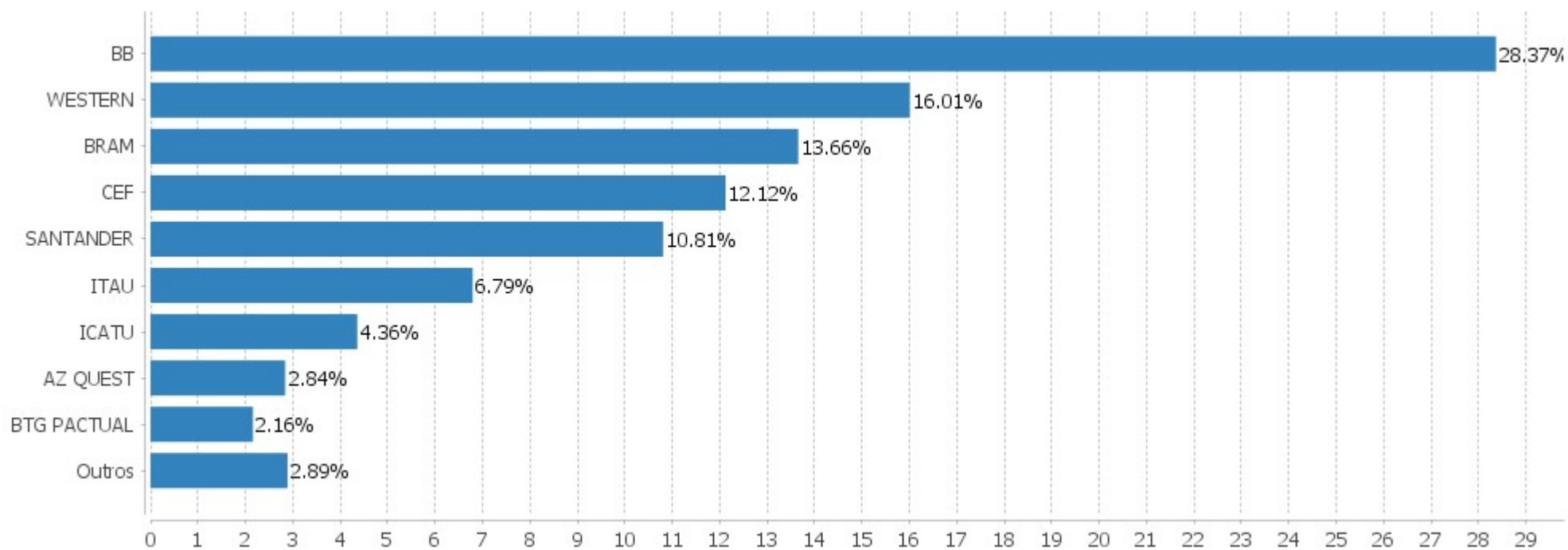
Alocação Por Estratégia





## 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						-0,67
IPCA + 5,88%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88						3,84
p.p. indexador	-0,06	-2,15	-9,71	2,43	2,54	0,89	2,20						-4,51
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

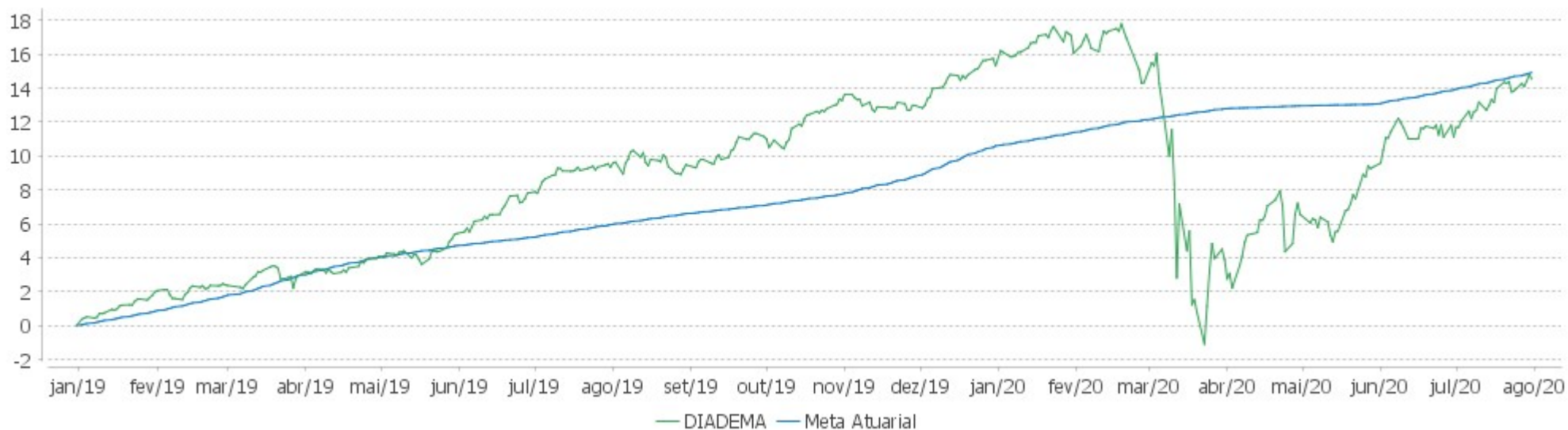
**PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL**

**RELATÓRIO TRIMESTRAL**

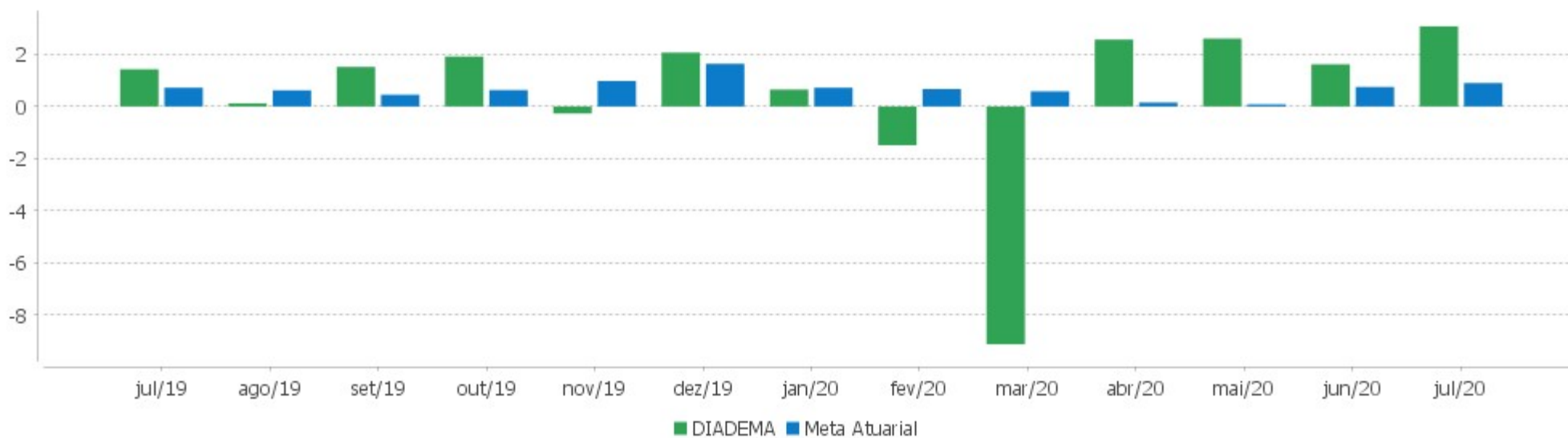
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	12	63,16	03 meses	7,50	1,70	5,79	6,81
Meses abaixo da Meta Atuarial	7	36,84	06 meses	-1,31	3,11	-4,42	17,22
			12 meses	4,75	8,40	-3,65	12,39
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,08	2020-07					
Menor rentabilidade da Carteira	-9,14	2020-03	Desde 31/12/2018	14,54	14,84	-0,30	10,02

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 RF Var. IMA-B 5 p.p.	1,80 0,81	6,69 2,50	6,22 1,94	5,74 2,12	11,82 2,99	32,54 8,38	43,15 8,72
SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TÍTULOS PUBLICOS RF Var. IMA-B 5 p.p.	0,97 -0,02	4,10 -0,09	4,23 -0,06	3,54 -0,07	8,64 -0,19	23,68 -0,47	33,67 -0,76
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6% p.p.	0,79 -0,11	4,21 0,30	4,12 2,39	3,55 0,38	8,77 0,30	26,46 7,83	36,61 5,29
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	1,77 0,11	3,55 0,15	3,83 0,26	3,05 0,17	7,10 0,02	23,78 0,51	32,81 0,56
BRADERCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,22 -0,02	2,66 -0,18	0,87 -0,07	2,24 -0,15	5,21 -0,30	12,59 -0,61	20,63 -0,93
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,98 0,62	5,65 5,19	3,14 2,90	4,79 4,54	9,68 7,38	28,24 22,64	37,15 26,81
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,36 -0,02	2,24 -0,41	8,04 -0,10	1,99 -0,39	7,60 -0,55	36,81 -1,06	45,25 -1,50
BB CRED PRIV III Var. IPCA + 6% p.p.	0,98 0,09	3,69 -0,22	4,19 2,45	2,83 -0,33	8,10 -0,37	22,05 3,42	34,67 3,35
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	0,97	-1,95	2,19	-2,34	-0,52	6,18	14,07
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,47 0,09	2,70 0,05	8,39 0,25	2,42 0,04	8,21 0,05	37,96 0,09	46,44 -0,31
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,24 121,46	1,61 82,50	0,75 117,07	1,26 80,04	3,74 88,70	10,19 94,14	18,03 96,53
BRADERCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA % do CDI	1,71 879,38	3,52 180,20	3,83 594,64	3,08 195,95	7,06 167,55	23,05 212,85	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	8,38 0,11	-0,65 10,36	31,79 3,96	-2,63 6,91	12,75 11,67	62,07 32,16	87,26 31,14
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	5,80 -2,47	-24,37 -13,36	29,49 1,65	-25,46 -15,92	-12,43 -13,51	22,51 -7,40	52,70 -3,42
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	14,10 5,84	-9,01 2,00	31,13 3,30	-14,70 -5,17	11,76 10,68	63,00 33,09	99,63 43,51
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	9,90 1,64	-4,71 6,30	29,69 1,85	-5,61 3,93	7,01 5,93	46,28 16,37	82,69 26,58
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	4,36 -3,90	-16,57 -5,56	19,15 -8,68	-17,09 -7,55	-4,41 -5,49	43,60 13,69	57,70 1,58

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

<b>Fundo</b> <b>Varição da Estratégia</b>	<b>No Mês</b>	<b>No Ano</b>	<b>3 meses</b>	<b>6 meses</b>	<b>12 meses</b>	<b>24 meses</b>	<b>36 meses</b>
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	5,63 2.898,52	-1,13 -57,91	12,25 1.902,60	-1,49 -95,06	8,42 199,67	19,09 176,32	42,14 225,65
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA Var. IPCA + 6% p.p.	-0,69 -1,59	-9,51 -13,42	-7,78 -9,51	-9,12 -12,28	-70,36 -78,83	-70,74 -89,37	-71,07 -102,39
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FI EM PARTICIPAÇÕES % do CDI	-0,89 -457,63	-99,56 -5.099,84	-99,55 -15.462,17	-99,55 -6.342,71	-99,73 -2.366,20	-99,72 -920,98	-99,72 -533,93
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO Var. IFIX p.p.	1,58 4,18	-8,86 5,67	3,57 -1,41	1,28 12,46	-20,32 -23,08	-24,76 -51,62	-19,93 -52,20
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11 Var. IBOVESPA p.p.	-3,25 -11,52	-19,13 -8,12	0,93 -26,90	-15,02 -5,48	-7,65 -8,73	-2,27 -32,17	-3,21 -59,33
CDI	0,19	1,95	0,64	1,57	4,21	10,83	18,68
IBOVESPA	8,27	-11,01	27,83	-9,54	1,08	29,91	56,12
INPC + 6%	0,98	4,26	1,99	3,54	8,88	19,01	30,64
IPCA + 6%	0,90	3,91	1,73	3,16	8,47	18,63	31,32

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Indexadores**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
<b>Renda Fixa</b>							
IRF-M 1	0,24	2,84	0,94	2,39	5,51	13,20	21,56
IRF-M 1+	1,47	7,59	4,50	6,40	12,02	32,81	43,78
IRF-M TOTAL	1,08	6,00	3,32	5,08	9,81	26,59	36,79
IMA-B 5	0,99	4,19	4,28	3,61	8,83	24,16	34,43
IMA-B 5+	7,32	1,68	11,51	1,64	7,81	49,37	56,19
IMA-B TOTAL	4,39	2,65	8,14	2,38	8,16	37,86	46,75
IMA-C TOTAL	4,26	12,04	11,01	9,27	15,97	43,97	64,91
IMA-GERAL ex-C TOTAL	1,66	3,39	3,57	2,88	7,07	23,27	32,25
IMA-GERAL TOTAL	1,74	3,64	3,79	3,07	7,33	23,84	33,11
IDKA 2	0,94	4,31	3,72	3,76	8,68	22,37	33,35
IDKA 20	12,08	-1,74	17,28	-0,38	4,95	69,37	71,28
CDI	0,19	1,95	0,64	1,57	4,21	10,83	18,68
<b>Renda Variável</b>							
IBOVESPA	8,27	-11,01	27,83	-9,54	1,08	29,91	56,12
IBRX 100	8,41	-10,43	28,20	-9,30	2,17	33,69	59,04
IBRX 50	8,15	-11,06	29,00	-9,35	0,23	26,69	52,24
SMALL CAP	9,50	-13,20	31,66	-13,59	7,86	55,28	71,97
IFIX	-2,61	-14,53	4,97	-11,18	2,77	26,86	32,28
Índice Consumo - ICON	7,62	-4,11	27,54	-7,49	12,15	54,44	58,02
Índice Dividendos - IDIV	6,53	-13,05	21,87	-11,65	3,50	46,49	63,19
<b>Indicadores Econômicos</b>							
IPCA	0,36	0,46	0,24	0,25	2,31	5,60	10,34
INPC	0,44	0,80	0,49	0,61	2,69	5,94	9,76
IGPM	2,23	6,71	4,11	6,21	9,27	16,26	25,84
SELIC	0,19	1,95	0,64	1,57	4,21	10,83	18,69
<b>Meta Atuarial</b>							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

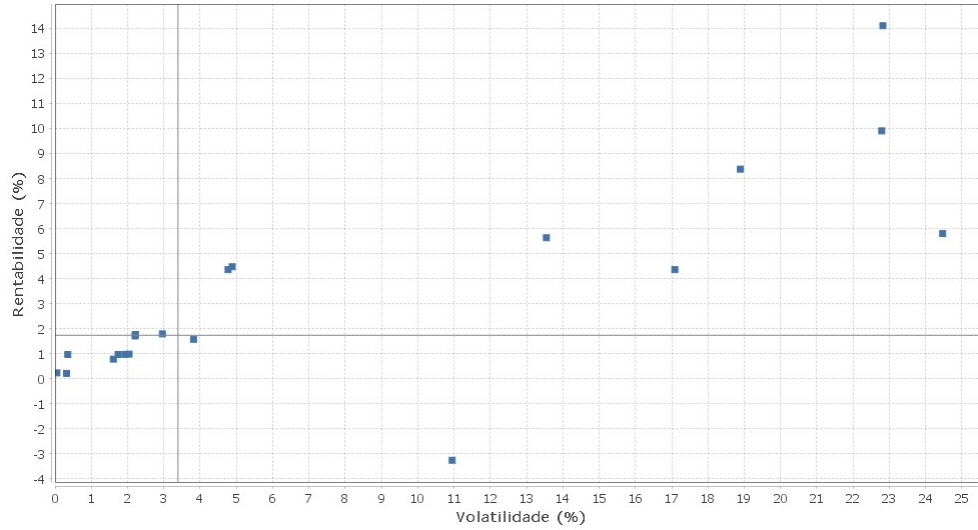
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
121	02/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.100,00	921,38008500	2,2791897010
122	06/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.002.000,00	878.179,14244900	2,2797170910
133	06/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	66.000,00	28.950,96074000	2,2797170910
123	07/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	34.054,40	0,00	14.937,08247400	2,2798561940
140	07/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	139.073,08	0,00	61.000,81240400	2,2798561940
119	08/07/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	134.900,88	0,00	90.842,22567500	1,4850019250
141	08/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	139.081,91	61.000,81240400	2,2800009740
120	09/07/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	4.181,03	0,00	2.811,57717500	1,4870763770
124	09/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.030,00	0,00	3.521,59091000	2,2802194250
117	10/07/2020	BRDESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	0,00	8.435.984,78	6.687.120,27080191	1,2615273000
118	10/07/2020	BRDESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	0,00	3.564.015,22	2.825.159,01162028	1,2615273000
125	14/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	12.020.777,71	0,00	5.270.049,17440900	2,2809612040
126	15/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.956.000,00	2.610.955,85580100	2,2811569130
134	15/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	21.918,70261800	2,2811569130
127	20/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.288.183,66	0,00	1.879.121,67362300	2,2820149010
128	20/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	241.922,96	0,00	106.012,87480300	2,2820149010
135	20/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	8.000,00	3.505,67386600	2,2820149010
129	22/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	32.255,75	0,00	14.132,58833900	2,2823667700
136	24/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	21.901,70063566	2,2829277430
130	28/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.000.000,00	437.934,96357500	2,2834440800
137	28/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.000.000,00	0,00	437.934,96357400	2,2834440800
138	29/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	4.379,06587600	2,2835920450
131	30/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	10.565,73	0,00	4.626,08418500	2,2839467630
132	30/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.731.000,00	2.071.414,30642900	2,2839467630
139	30/07/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	45.000,00	19.702,73595200	2,2839467630



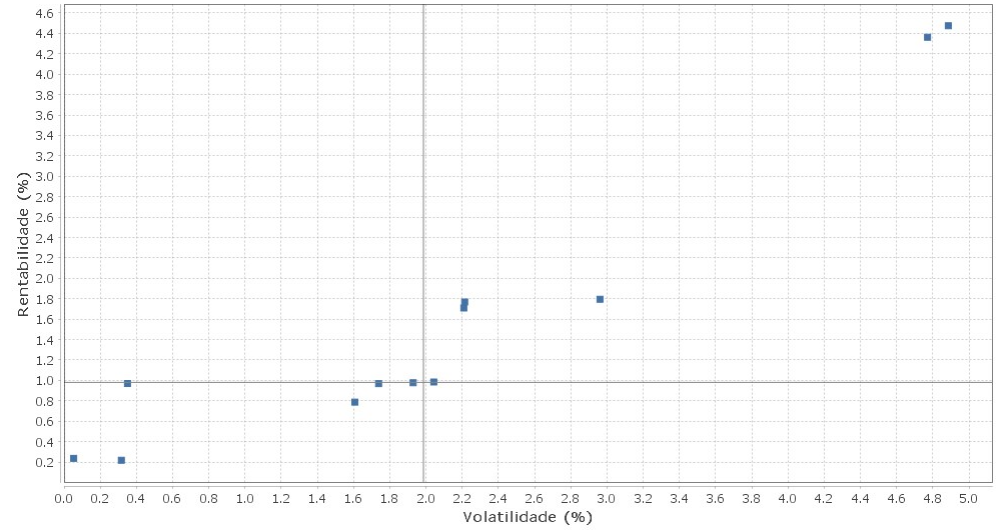
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

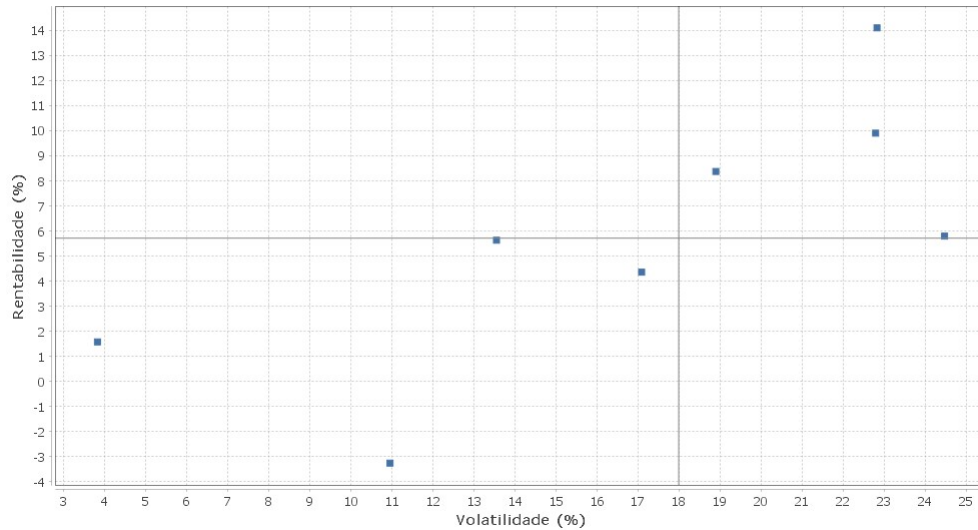
DIADEMA - No Mês



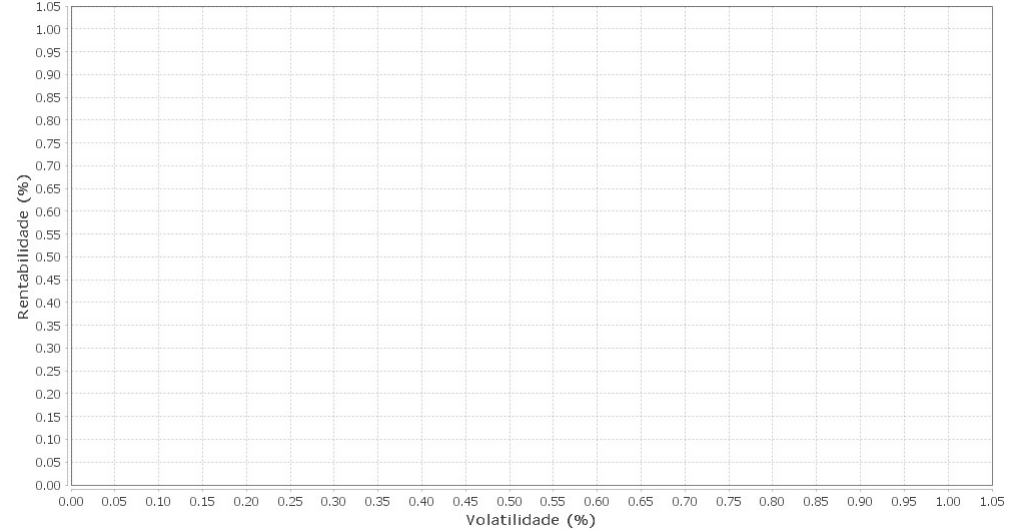
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,05			0,78	0,24	11.180.962,04	3,68
BRADERCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	Artigo 7º I, Alínea b	0,32			0,07	0,22	30.987,63	0,01
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	Artigo 7º VII, Alínea b	0,35			2,21	0,97	3.586.728,39	1,18
BB PREV IPCA I	Artigo 7º I, Alínea b	1,61			0,37	0,79	16.851.301,24	5,55
SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TÍTULOS PUBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,74			0,45	0,97	2.087.580,17	0,69
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,93			0,41	0,98	36.128.028,99	11,89
BB CRED PRIV III	Artigo 7º VII, Alínea b	2,04			0,39	0,98	9.715.709,56	3,20
BRADERCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	Artigo 7º IV, Alínea a	2,21			0,69	1,71	19.257.537,04	6,34
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,21			0,71	1,77	47.281.072,05	15,56
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,96			0,54	1,80	26.824.608,87	8,83
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	Artigo 8º IV, Alínea b	3,82			0,36	1,58	3.694.526,91	1,22
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,77			0,87	4,36	30.309.860,99	9,98
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	4,89			0,88	4,47	21.631.226,23	7,12
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11	Artigo 8º IV, Alínea b	10,95			-0,31	-3,25	1.357.497,98	0,45
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	13,55			0,40	5,63	21.161.769,62	6,96
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	17,09			0,24	4,36	13.065.564,71	4,30
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	18,89			0,43	8,38	6.468.372,64	2,13
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	22,79			0,43	9,90	4.139.053,18	1,36
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	22,82			0,61	14,10	8.494.315,38	2,80
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	24,47			0,23	5,80	20.359.396,40	6,70

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Observações**

No respectivo mês de julho de 2020, observar que:

- O percentual alocado no Artigo 8, Inciso IV, Alínea A (0,07% dos recursos) está inferior ao limite mínimo estipulado em Política de Investimentos.