



LDB
EMPRESAS

DIADEMA

3º TRIMESTRE 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 27.07.2020.

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 77,44%

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
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,28	0,62	1,85	11.151.947,06	2,95	784.201.361,10	1,42
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,14	1,72	2,72	50.455.413,82	13,36	10.040.403.127,50	0,50
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TÍTULOS PUBLICOS RF	2,13	1,72	2,72	30.788.467,40	8,15	1.300.830.937,77	2,37
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	3,33	2,15	3,05	24.448.407,56	6,47	506.807.313,87	4,82
BB	BB	BB PREV IPCA I	2,79	1,82	2,91	16.189.615,48	4,29	491.487.900,22	3,29
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,51	1,50	2,62	42.192.161,87	11,17	8.760.808.473,08	0,48
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	3,70	2,12	3,11	33.592.909,98	8,89	8.195.196.996,57	0,41
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,95	1,72	2,72	208.818.923,17	55,28		

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	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	5,35	2,90	3,70	20.478.320,89	5,42	1.765.107.201,07	1,16
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,02	0,45	1,50	6.098.252,59	1,61	3.076.678.877,78	0,20
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	2,40	1,48	2,53	44.317.343,17	11,73	833.675.084,59	5,32
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,75	1,82	2,69	70.893.916,65	18,77		

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 CRED PRIV III	1,84	1,66	2,62	9.147.593,77	2,42	571.129.018,97	1,60
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	0,08	0,43	1,51	3.638.156,50	0,96	153.799.252,24	2,37
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			1,53	1,31	2,49	12.785.750,27	3,38		

Renda Fixa			1,67	1,72	2,71	292.498.590,09	77,44		
-------------------	--	--	-------------	-------------	-------------	-----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

22,56%

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	16,42	2,64	6,56	14.234.765,57	3,77	1.581.305.323,77	0,90
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	20,91	0,76	12,43	7.805.192,26	2,07	1.262.371.454,02	0,62
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	18,83	1,25	7,95	5.920.668,30	1,57	1.490.872.974,30	0,40
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	20,46	0,79	11,64	4.053.585,76	1,07	387.988.727,91	1,04
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	20,20	-0,48	6,10	23.503.033,84	6,22	1.948.913.317,60	1,21
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			17,93	0,57	7,76	55.517.245,73	14,70		

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 LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1,71	-0,04	0,83	5.292.839,62	1,40	241.433.480,84	2,19
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	15,72	2,21	2,23	14.616.689,63	3,87	737.738.497,44	1,98
Sub-total Artigo 8º III			8,10	1,18	1,56	19.909.529,25	5,27		

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	1,87	-0,09	-0,28	4.159.393,70	1,10	572.786.978,20	0,73
CEF	CEF	FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	160,12	-71,53	-66,83	232.576,28	0,06	22.795.921,32	1,02
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			22,96	-10,42	-7,81	4.391.969,98	1,16		

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	15,23	13,37	-14,71	3.950.647,26	1,05	84.587.239,87	4,67
BRPP	GERAÇÃO FUTURO	BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11	12,39	1,14	-0,98	1.458.696,64	0,39	259.537.141,36	0,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
		Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b	18,87	10,22	0,60	5.409.343,90	1,43		
		Renda Variável e Investimentos Estruturados	10,78	0,85	4,60	85.228.088,86	22,56		
		Total				377.726.678,95	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	208.818.923,17	55,28	15,00	35,00	70,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	70.893.916,65	18,77	5,00	20,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	12.785.750,27	3,38	0,00	2,50	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	292.498.590,09	77,44				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	55.517.245,73	14,70	2,00	12,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	19.909.529,25	5,27	2,00	8,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	4.391.969,98	1,16	1,00	2,50	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	5.409.343,90	1,43	1,00	2,50	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	85.228.088,86	22,56				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

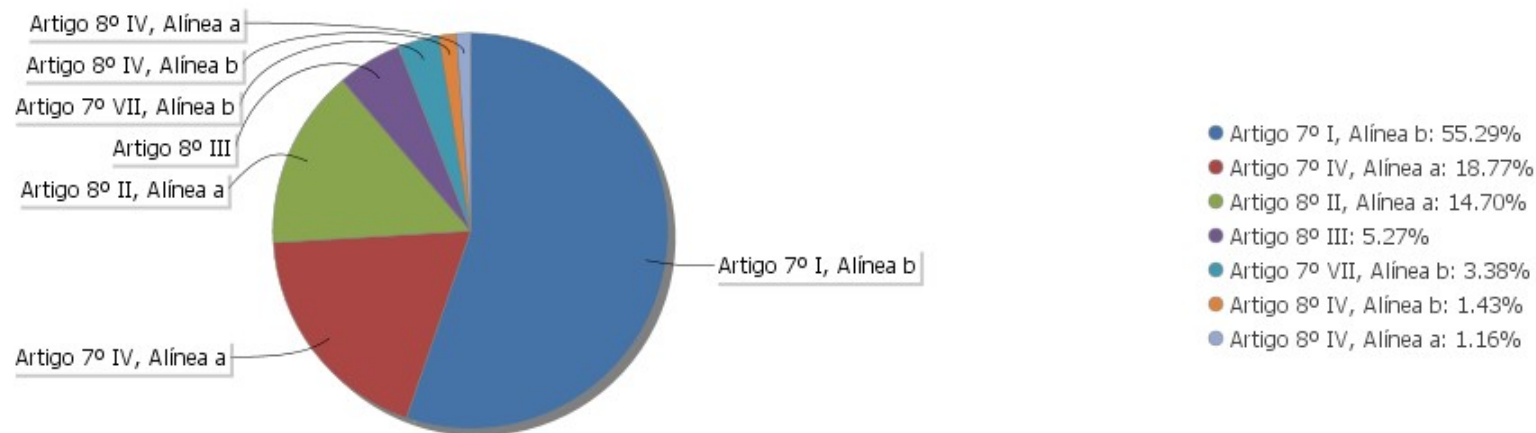
Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,72 370,76	2,72 176,48	2,72 176,48	7,22 232,61		3.582.062,07	5.946.375,04
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	1,82 391,75	2,69 174,24	2,69 174,24	6,43 207,32		1.252.996,75	1.698.316,18
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	1,31 281,42	2,49 161,61	2,49 161,61	6,31 203,53		164.715,89	272.014,96
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	0,57 -3,00	7,76 4,02	7,76 4,02	17,64 7,86		301.952,78	3.653.369,09
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	1,18 -2,39	1,56 -2,18	1,56 -2,18	4,71 -5,07		301.069,22	392.490,20
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-10,42 -13,99	-7,81 -11,56	-7,81 -11,56	-8,05 -17,83		-483.375,03	-334.100,75
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	10,22 6,65	0,60 -3,15	0,60 -3,15	5,68 -4,10		567.121,22	42.777,58
						5.686.542,90	11.671.242,30

Análise de Liquidez

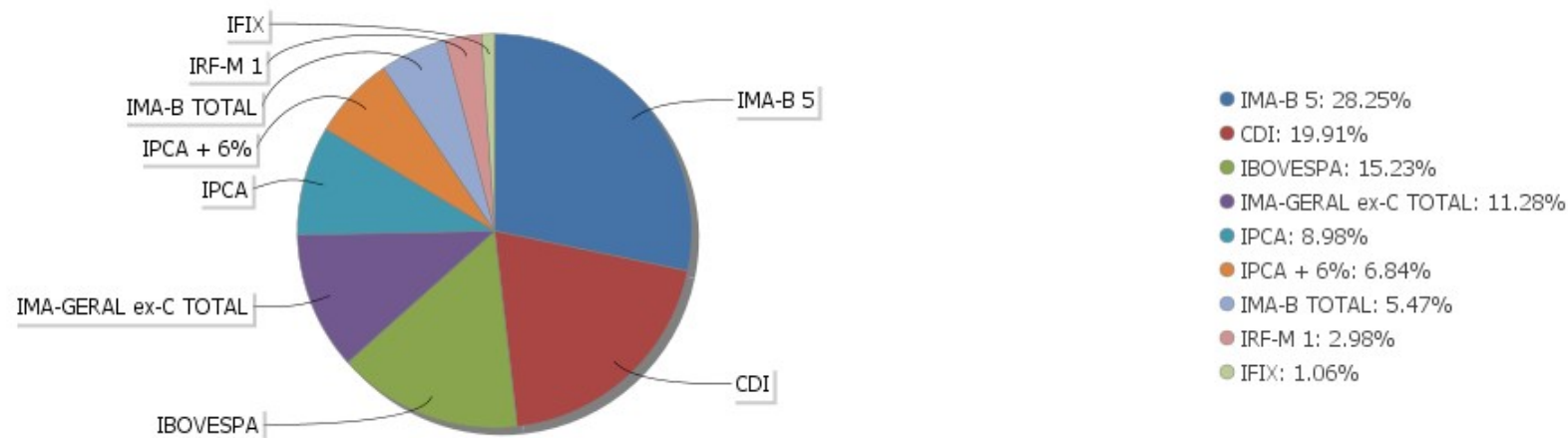
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	338.358.760,44	89,58	338.358.760,44	89,58
de 31 a 364 dias	5.920.668,30	1,57	344.279.428,74	91,15
acima de 365 dias	33.447.250,21	8,85	377.726.678,95	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

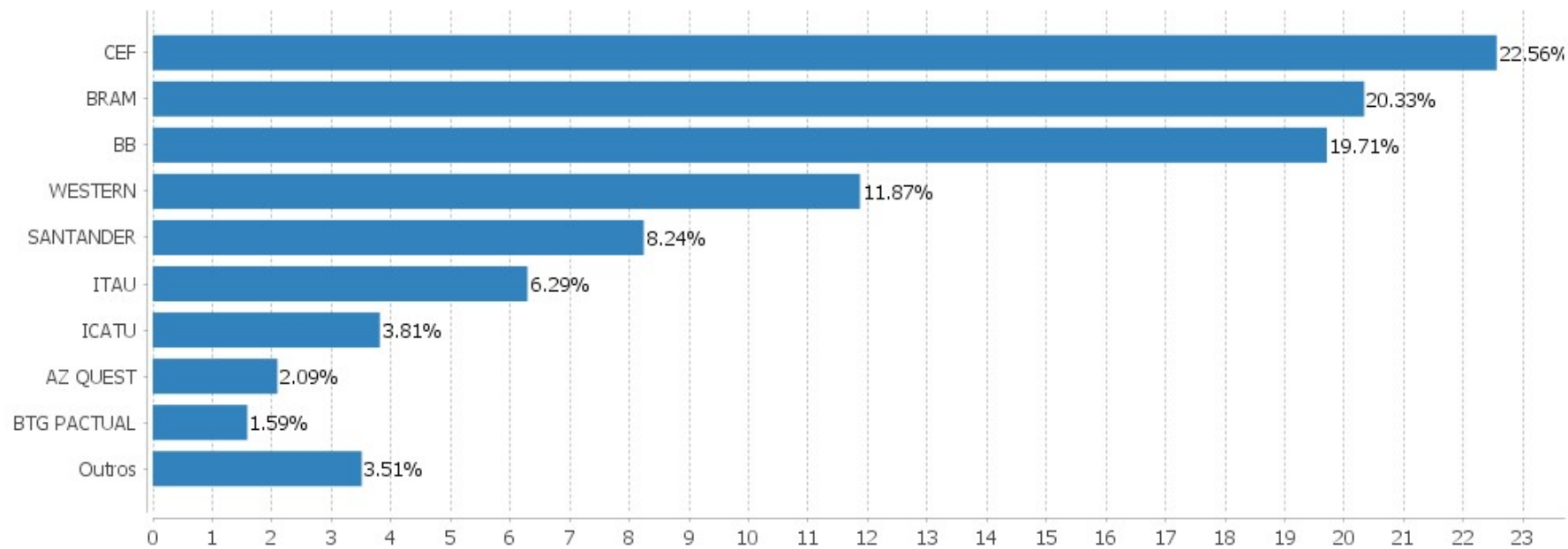


Alocação Por Estratégia



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	1,29	2,25	1,43	0,12	1,52				11,14
IPCA + 6%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45				7,07
p.p. indexador	1,12	-0,47	-0,67	0,06	0,65	1,80	0,71	-0,50	1,07				4,07

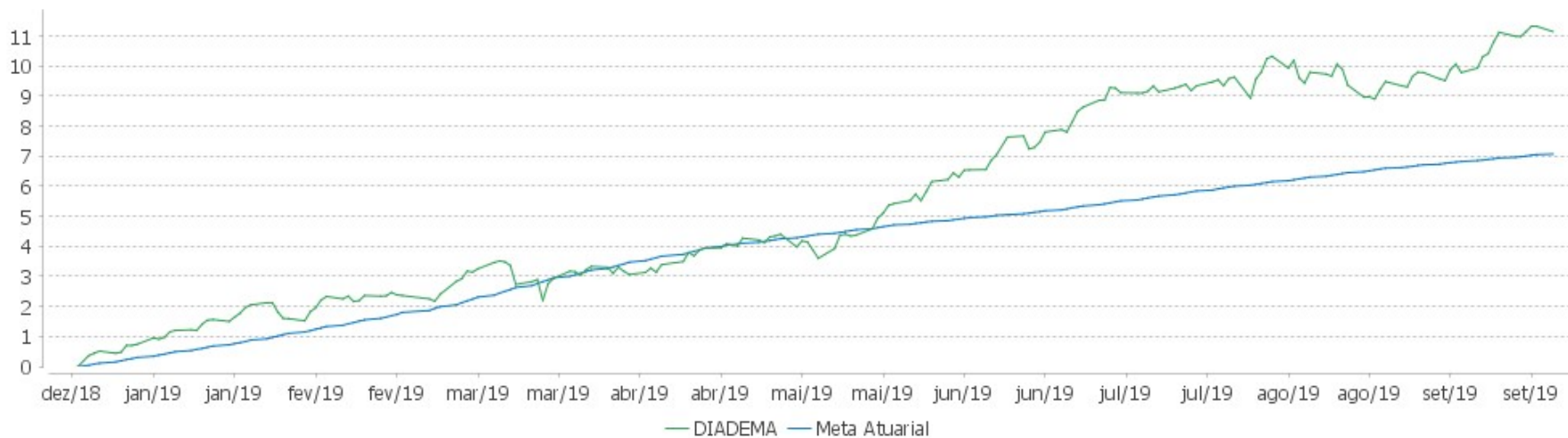
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

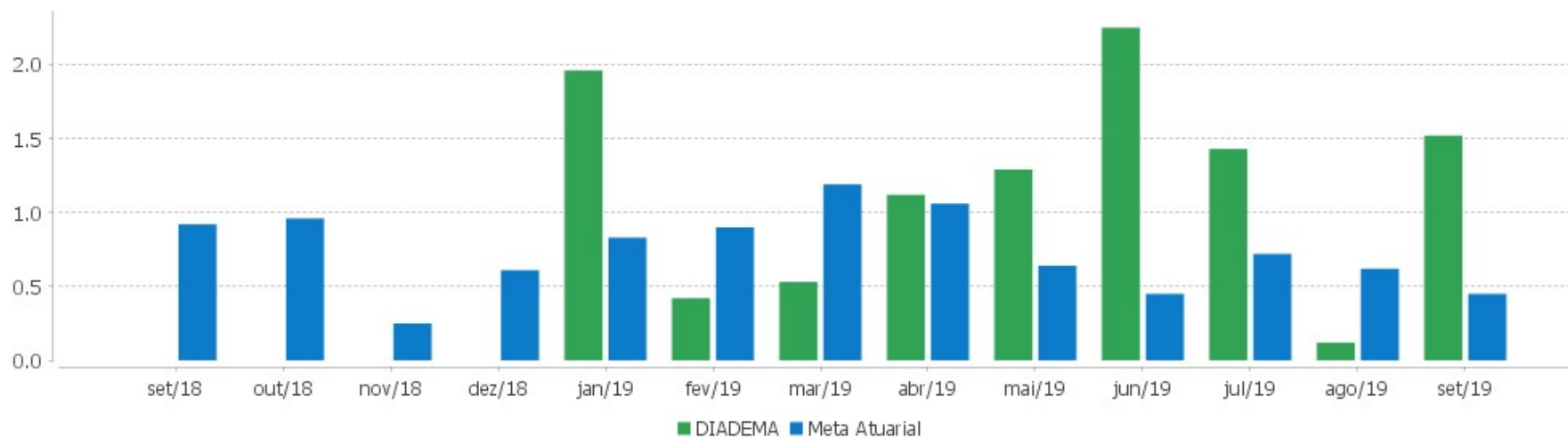
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	6	66,67	03 meses	3,10	1,80	1,30	3,73
Meses abaixo da Meta Atuarial	3	33,33	06 meses	7,98	4,01	3,98	3,38
			12 meses				
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,25	2019-06					
Menor rentabilidade da Carteira	0,12	2019-08	Desde 31/12/2018	11,14	7,07	4,07	3,28

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
BB CRED PRIV III Var. IPCA + 6% p.p.	1,66 1,21	2,62 0,82	2,62 0,82	6,45 2,45	14,32 5,28	23,53 2,79	43,19 12,03
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	0,43	1,51	1,51	3,12	6,50	13,98	27,78
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	2,15 0,41	3,05 0,27	3,05 0,27	9,09 1,93	20,45 5,05	27,43 4,50	46,62 7,15
SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TÍTULOS PUBLICOS RF Var. IMA-B 5 p.p.	1,72 -0,02	2,72 -0,06	2,72 -0,06	7,04 -0,13	15,17 -0,23	22,45 -0,48	38,66 -0,81
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,72 -0,02	2,72 -0,06	2,72 -0,06	7,04 -0,13	15,21 -0,19	22,44 -0,49	38,69 -0,78
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6% p.p.	1,82 1,37	2,91 1,11	2,91 1,11	7,91 3,90	18,25 9,21	24,39 3,66	43,44 12,28
BRABESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,62 -0,02	1,85 -0,07	1,85 -0,07	3,58 -0,14	7,18 -0,27	14,15 -0,54	28,36 -0,85
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	1,50 0,04	2,62 0,03	2,62 0,03	7,89 0,50	17,17 0,60	23,01 0,41	40,60 -0,51
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	2,12 2,16	3,11 2,85	3,11 2,85	10,02 9,05	18,30 15,40	25,15 17,60	
BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,90 0,04	3,70 -0,06	3,70 -0,06	13,17 -0,10	31,74 0,37	34,29 -0,44	55,97 0,01
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,45 97,16	1,50 97,34	1,50 97,34	3,02 97,47	6,12 97,49	13,21 99,02	26,40 99,98
BRABESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA % do CDI	1,48 319,36	2,53 163,99	2,53 163,99	7,33 236,37	16,59 264,57		
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	1,25 -2,32	7,95 4,21	7,95 4,21	21,60 11,82	52,23 20,22	53,35 12,37	89,31 9,85
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	-0,48 -4,05	6,10 2,35	6,10 2,35	15,52 5,74	48,78 16,76	55,68 14,69	102,80 23,34
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,76 -2,81	12,43 8,69	12,43 8,69	23,11 13,33	58,04 26,02	59,79 18,81	128,23 48,77
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,79 -2,78	11,64 7,90	11,64 7,90	17,76 7,98	41,39 9,38	59,18 18,19	99,09 19,63
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	2,64 -0,93	6,56 2,82	6,56 2,82	18,69 8,91	58,03 26,01	61,56 20,57	91,07 11,61

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO % do CDI	-0,04 -7,65	0,83 53,90	0,83 53,90	1,76 56,60	5,51 87,90	13,17 98,73	27,41 103,79
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	2,21 475,90	2,23 144,55	2,23 144,55	7,06 227,64	6,23 99,38	28,06 210,31	64,20 243,11
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO Var. IFIX p.p.	-2,62 -3,65	-14,71 -16,92	-14,71 -16,92	-13,49 -21,60	-7,52 -33,26	-19,46 -40,32	-5,71 -53,52
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11 Var. IBOVESPA p.p.	0,47 -3,10	-0,98 -4,72	-0,98 -4,72	1,21 -8,57	13,08 -18,94	1,30 -39,69	23,10 -56,36
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA Var. IPCA + 6% p.p.	-71,53 -71,98	-66,83 -68,63	-66,83 -68,63	-66,91 -70,91	-67,13 -76,18	-67,49 -88,23	-62,45 -93,62
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FI EM PARTICIPAÇÕES % do CDI	-0,09 -19,49	-0,28 -18,42	-0,28 -18,42	-0,55 -17,65	0,81 12,99	2,71 20,30	3,83 14,51
CDI	0,46	1,54	1,54	3,10	6,27	13,34	26,41
IBOVESPA	3,57	3,74	3,74	9,78	32,02	40,99	79,46
INPC + 6%	0,44	1,71	1,71	3,96	9,07	20,13	29,35
IPCA + 6%	0,45	1,80	1,80	4,01	9,04	20,73	31,16

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	0,64	1,92	1,92	3,72	7,44	14,70	29,21
IRF-M 1+	1,87	3,27	3,27	9,07	20,81	27,25	51,71
IRF-M TOTAL	1,44	2,81	2,81	7,53	16,83	23,54	45,09
IMA-B 5	1,74	2,78	2,78	7,17	15,40	22,93	39,47
IMA-B 5+	3,73	4,48	4,48	17,54	44,85	43,66	68,51
IMA-B TOTAL	2,86	3,77	3,77	13,27	31,37	34,72	55,96
IMA-C TOTAL	1,74	3,44	3,44	11,52	23,71	39,55	50,80
IMA-GERAL ex-C TOTAL	1,46	2,59	2,59	7,40	16,57	22,60	41,10
IMA-GERAL TOTAL	1,46	2,61	2,61	7,52	16,78	23,07	41,30
IDKA 2	1,60	2,72	2,72	6,49	12,85	22,46	39,19
IDKA 20	4,78	5,22	5,22	24,54	72,09	60,71	94,10
CDI	0,46	1,54	1,54	3,10	6,27	13,34	26,41
Renda Variável							
IBOVESPA	3,57	3,74	3,74	9,78	32,02	40,99	79,46
IBRX 100	3,21	4,25	4,25	10,92	34,84	42,73	81,88
IBRX 50	3,69	3,06	3,06	8,52	29,03	38,44	75,75
SMALL CAP	2,08	9,49	9,49	21,44	57,29	45,27	105,52
IFIX	1,04	2,21	2,21	8,11	25,74	20,86	47,81
Índice Consumo - ICON	2,64	17,30	17,30	33,49	54,64	29,25	55,37
Índice Dividendos - IDIV	1,89	7,04	7,04	17,36	52,83	44,68	105,47
Indicadores Econômicos							
IPCA	-0,04	0,26	0,26	0,97	2,89	7,55	10,28
INPC	-0,05	0,17	0,17	0,93	2,92	7,01	8,76
IGPM	-0,01	-0,28	-0,28	1,89	3,37	13,74	12,10
SELIC	0,46	1,54	1,54	3,10	6,27	13,35	26,43
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
468	05/07/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	80.000,00	36.491,16124500	2,1923117070
474	05/07/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.563.000,00	712.946,06282900	2,1923117070
478	11/07/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	52.650,26	0,00	23.993,08120400	2,1943934400
249	12/07/2019	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,00	3.233.722,66	1.335.887,62577331	2,4206547000
469	15/07/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	55.000,00	25.051,73601400	2,1954566330
475	15/07/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.957.266,68	891.507,78502300	2,1954566330
479	15/07/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	31.000,00	0,00	14.120,06938900	2,1954566330
480	19/07/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	6.519.297,27	0,00	2.966.622,67822500	2,1975485180
251	23/07/2019	MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	3.600.000,00	0,00	2.202.865,96533533	1,6342347000
470	23/07/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.500,00	2.956,45684300	2,1985776710
476	23/07/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.600.000,00	1.637.422,25143400	2,1985776710
481	23/07/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	243.000,00	0,00	110.526,00197100	2,1985776710
471	24/07/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.000,00	909,46250600	2,1991011040
472	25/07/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	83.000,00	37.733,53697500	2,1996347720
250	29/07/2019	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,00	2.234.829,94	920.274,38864321	2,4284387000
473	30/07/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	22.714,94551200	2,2011939220
477	30/07/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.033.000,00	923.589,68452600	2,2011939220
482	30/07/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	44.000,00	0,00	19.989,15205000	2,2011939220
483	01/08/2019	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	20.000.000,00	0,00	4.354.039,86976890	4,5934352000
484	01/08/2019	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,00	20.000.000,00	8.228.184,67568070	2,4306698000
494	05/08/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	893.306,50	405.434,60800100	2,2033306540
487	05/08/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	65.000,00	29.500,79230400	2,2033306540
495	07/08/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	535.725,87	243.039,60230000	2,2042739740
488	07/08/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	4.536,64114300	2,2042739740
498	09/08/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	41.908,98	0,00	19.004,32079100	2,2052342970
499	12/08/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	36.670,49	0,00	16.625,16771300	2,20527215080
485	14/08/2019	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,00	3.306.750,12	1.357.827,86968540	2,4353235000
493	15/08/2019	BB PREV IPCA I	0,00	412.401,35	191.145,84893000	2,1575218730

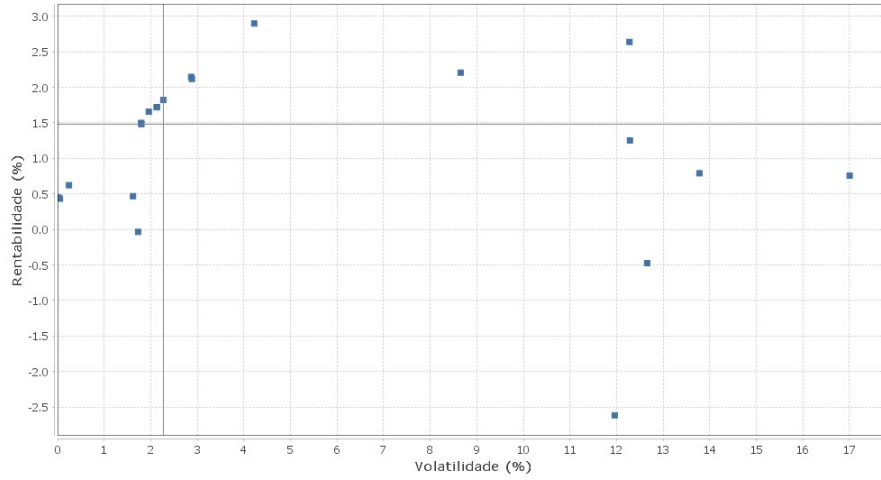
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
496	15/08/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.930.495,50	874.640,22464900	2,2071881050
489	15/08/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	115.000,00	52.102,49173600	2,2071881050
500	16/08/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	419.266,83	0,00	189.913,90012600	2,2076679470
501	20/08/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.385.253,79	0,00	627.195,16177900	2,2086487180
492	21/08/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.450.000,00	0,00	1.109.034,83192700	2,2091280900
502	22/08/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	247.472,52	0,00	111.997,58187900	2,2096237780
490	23/08/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	85.000,00	38.459,44212600	2,2101204620
486	29/08/2019	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,00	2.221.047,93	910.116,12191860	2,4404006000
491	30/08/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	45.000,00	20.338,27308200	2,2125772340
497	30/08/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.979.536,46	894.674,51331500	2,2125772340
503	05/09/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.583.305,26	714.968,60473500	2,2145101890
515	05/09/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	65.000,00	29.351,86314500	2,2145101890
516	06/09/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.000,00	2.257,34230400	2,2149941510
517	06/09/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.000,00	1.354,40538200	2,2149941510
510	12/09/2019	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,00	3.304.439,14	1.349.895,10494790	2,4479229000
504	13/09/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.911.701,66	862.136,57172200	2,2174000300
518	13/09/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	42.000,00	18.941,10193500	2,2174000300
519	13/09/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	65.000,00	29.313,61013800	2,2174000300
506	17/09/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	33.176,48	0,00	14.955,62297500	2,2183281870
507	20/09/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	3.037.499,77	0,00	1.368.348,79095900	2,2198285920
514	23/09/2019	WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	0,00	5.000.000,00	1.155,00978600	4.328,9676507000
512	24/09/2019	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	397.358,30	0,00	286.144,30848600	1,3886640000
508	25/09/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	857.286,90	0,00	385.954,79434300	2,2212106510
520	25/09/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	60.000,00	27.012,29618800	2,2212106510
513	26/09/2019	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	5.000.000,00	0,00	923.143,23032480	5,4162776000
511	27/09/2019	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,00	2.331.901,71	949.378,52983590	2,4562402000
505	30/09/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.034.777,19	915.515,87394158	2,2225471430
509	30/09/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	20.734,61	0,00	9.329,21043500	2,2225471430
521	30/09/2019	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	22.496,71065800	2,2225471430

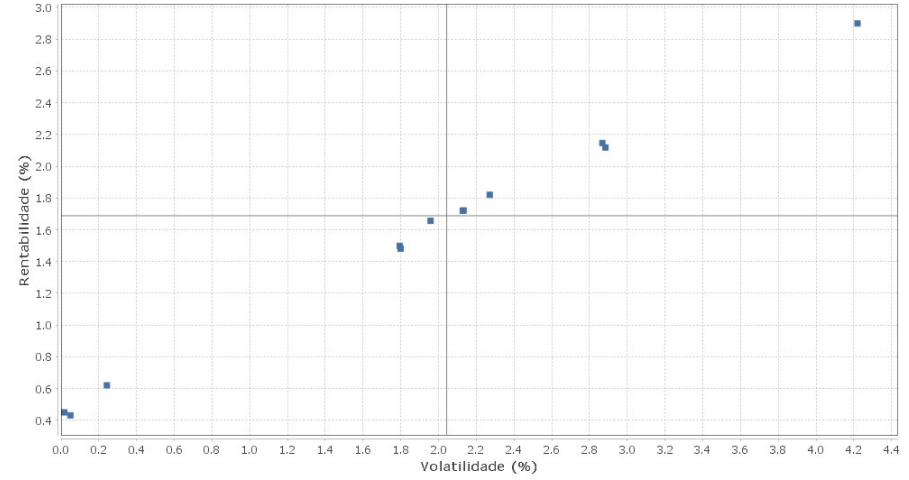
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

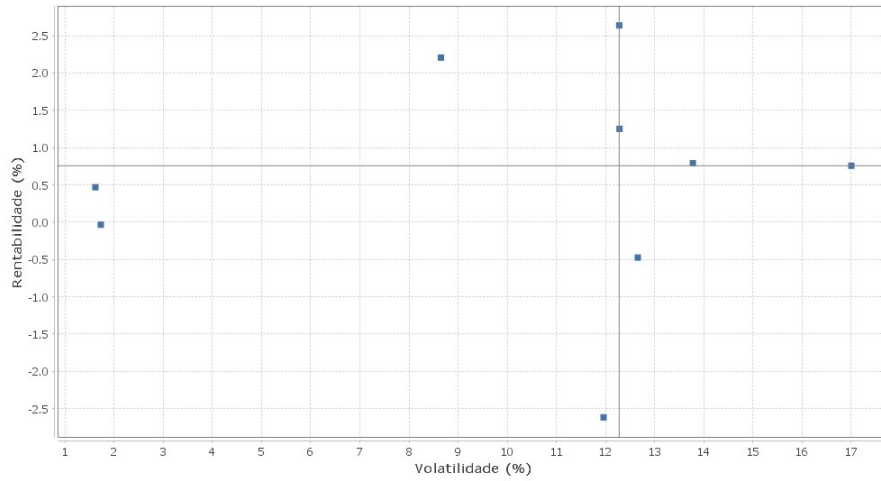
DIADEMA - No Mês



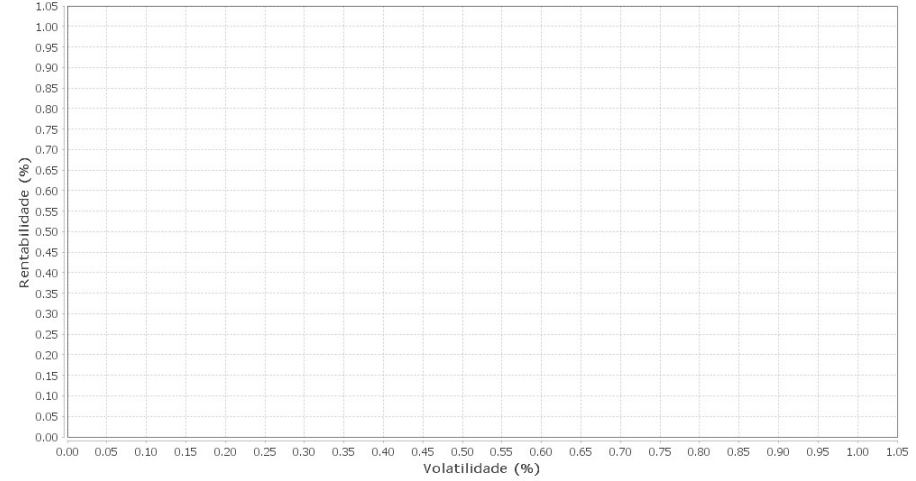
Renda Fixa - No Mês



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 PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,02	0,45	6.098.252,59	1,61
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	Artigo 7º VII, Alínea b	0,05	0,03	0,43	3.638.156,50	0,96
BRADERCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	Artigo 7º I, Alínea b	0,24	0,05	0,62	11.151.947,06	2,95
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	Artigo 8º IV, Alínea b	1,62	0,19	0,47	1.458.696,64	0,39
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	1,73	0,18	-0,04	5.292.839,62	1,40
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,79	0,26	1,50	42.192.161,87	11,17
BRADERCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	Artigo 7º IV, Alínea a	1,80	0,26	1,48	44.317.343,17	11,73
BB CRED PRIV III	Artigo 7º VII, Alínea b	1,96	0,28	1,66	9.147.593,77	2,42
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,13	0,30	1,72	50.455.413,82	13,36
SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TÍTULOS PUBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,13	0,30	1,72	30.788.467,40	8,15
BB PREV IPCA I	Artigo 7º I, Alínea b	2,27	0,32	1,82	16.189.615,48	4,29
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,87	0,40	2,15	24.448.407,56	6,47
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,88	0,40	2,12	33.592.909,98	8,89
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	4,22	0,57	2,90	20.478.320,89	5,42
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	8,65	1,00	2,21	14.616.689,63	3,87
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	Artigo 8º IV, Alínea b	11,96	1,11	-2,62	3.950.647,26	1,05
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	12,28	1,40	2,64	14.234.765,57	3,77
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	12,28	1,33	1,25	5.920.668,30	1,57
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	12,66	1,29	-0,48	23.503.033,84	6,22
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	13,78	1,46	0,79	4.053.585,76	1,07
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	17,00	1,80	0,76	7.805.192,26	2,07