



LDB
EMPRESAS

DIADEMA
4º 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 12.02.2020.

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

74,53%

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 |
|--|-------------|---|---------------------|-----------------|-------------------|-----------------------|--------------|------------------|---------|
| BRDESCO | BRDESCO | BRDESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS | 0,25 | 0,40 | 1,31 | 1.221.516,08 | 0,34 | 739.650.976,36 | 0,17 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO | 1,98 | 1,21 | 2,52 | 31.491.580,41 | 8,65 | 9.819.854.122,58 | 0,32 |
| SANTANDER | SANTANDER | SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FI | 1,98 | 1,22 | 2,56 | 2.005.299,76 | 0,55 | 1.270.875.315,97 | 0,16 |
| SANTANDER | SANTANDER | SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 4,93 | 1,98 | 2,78 | 29.645.319,52 | 8,14 | 1.008.932.506,25 | 2,94 |
| WESTERN | BNP PARIBAS | WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RENDA FIXA | 3,20 | 1,40 | 2,84 | 25.142.851,27 | 6,91 | 537.480.070,49 | 4,68 |
| BB | BB | BB PREV IPCA I | 2,37 | 1,18 | 2,45 | 16.586.403,95 | 4,56 | 503.533.691,59 | 3,29 |
| BB | BB | BB PREV ALOC FIC | 2,37 | 0,96 | 1,81 | 44.730.533,96 | 12,29 | 9.800.245.404,11 | 0,46 |
| CEF | CEF | FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF | 3,76 | 0,59 | 1,80 | 34.196.611,82 | 9,40 | 9.818.666.120,10 | 0,35 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b | | | 2,11 | 1,17 | 2,26 | 185.020.116,77 | 50,83 | | |

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 |
|---|---------|---|---------------------|-----------------|-------------------|----------------------|--------------|------------------|---------|
| BRDESCO | BRDESCO | BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B | 5,05 | 2,01 | 2,85 | 21.062.635,65 | 5,79 | 1.900.404.411,61 | 1,11 |
| BB | BB | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,05 | 0,35 | 1,14 | 7.030.896,64 | 1,93 | 2.851.366.973,39 | 0,25 |
| BRDESCO | BRDESCO | BRDESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA | 2,21 | 0,85 | 1,81 | 45.118.622,03 | 12,40 | 1.115.373.957,19 | 4,05 |
| Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a | | | 2,07 | 1,13 | 2,04 | 73.212.154,32 | 20,11 | | |

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 | 1,70 | 1,10 | 2,43 | 9.370.175,40 | 2,57 | 585.025.878,87 | 1,60 |
| MONGERAL | BEM | MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP | 0,17 | 0,27 | 0,55 | 3.658.154,78 | 1,01 | 136.319.272,73 | 2,68 |
| Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b | | | 1,47 | 0,87 | 1,90 | 13.028.330,18 | 3,58 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

2,07

1,14

2,18

271.260.601,27

74,53

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

25,47%

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 VANGUARDA | BEM | ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA | 14,58 | 7,51 | 10,02 | 15.660.576,65 | 4,30 | 2.163.582.480,78 | 0,72 |
| AZ QUEST | BEM | AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA | 17,86 | 10,83 | 19,61 | 9.335.517,30 | 2,56 | 1.491.876.431,54 | 0,63 |
| BTG PACTUAL | BTG PACTUAL | BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA | 16,60 | 7,19 | 9,97 | 6.510.859,03 | 1,79 | 1.723.423.208,96 | 0,38 |
| OCCAM | BEM | OCCAM FIC FIA | 18,23 | 7,40 | 7,15 | 4.343.586,49 | 1,19 | 583.652.398,75 | 0,74 |
| ITAU | ITAU | ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI | 17,47 | 10,21 | 14,53 | 26.918.508,98 | 7,40 | 2.457.745.616,59 | 1,10 |
| Sub-total Artigo 8º II, Alínea a | | | 16,76 | 9,10 | 13,06 | 62.769.048,45 | 17,25 | | |

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 | 12,91 | 2,62 | 8,83 | 21.403.713,38 | 5,88 | 804.084.944,48 | 2,66 |
| Sub-total Artigo 8º III | | | 12,91 | 2,62 | 7,39 | 21.403.713,38 | 5,88 | | |

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 | 48,41 | -38,33 | -38,43 | 2.560.786,58 | 0,70 | 572.786.978,20 | 0,45 |
| CEF | CEF | FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA | 159,49 | -0,58 | -1,36 | 229.414,09 | 0,06 | 22.795.921,32 | 1,01 |
| Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a | | | 49,40 | -36,34 | -36,47 | 2.790.200,67 | 0,77 | | |

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 | 18,78 | 0,82 | -5,94 | 4.074.126,16 | 1,12 | 84.334.411,42 | 4,83 |
| BRPP | GERAÇÃO FUTURO | BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11 | 13,78 | 9,90 | 15,07 | 1.678.584,52 | 0,46 | 298.660.472,78 | 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 | 17,02 | 3,31 | 8,94 | 5.752.710,68 | 1,58 | | |
| | | Renda Variável e Investimentos Estruturados | 10,55 | 4,95 | 9,01 | 92.715.673,18 | 25,47 | | |
| | | Total | | | | 363.976.274,45 | 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 | 185.020.116,77 | 50,83 | 15,00 | 35,00 | 70,00 | 100,00 |
| Artigo 7º IV, Alínea a | Fundos de Renda Fixa | 73.212.154,32 | 20,11 | 5,00 | 20,00 | 40,00 | 40,00 |
| Artigo 7º VII, Alínea b | Fundos Renda Fixa "Crédito Privado" | 13.028.330,18 | 3,58 | 0,00 | 2,50 | 5,00 | 5,00 |
| | Total Renda Fixa | 271.260.601,27 | 74,53 | | | | |
| Renda Variável e Investimentos Estruturados | | | | | | | |
| Artigo 8º II, Alínea a | Fundos de Ações | 62.769.048,45 | 17,25 | 2,00 | 12,00 | 20,00 | 20,00 |
| Artigo 8º III | Fundos Multimercados | 21.403.713,38 | 5,88 | 2,00 | 8,00 | 10,00 | 10,00 |
| Artigo 8º IV, Alínea a | Fundos de Participações | 2.790.200,67 | 0,77 | 1,00 | 2,50 | 5,00 | 5,00 |
| Artigo 8º IV, Alínea b | Fundos de Investimentos Imobiliários | 5.752.710,68 | 1,58 | 1,00 | 2,50 | 5,00 | 5,00 |
| | Total Renda Variável e Investimentos Estruturados | 92.715.673,18 | 25,47 | | | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

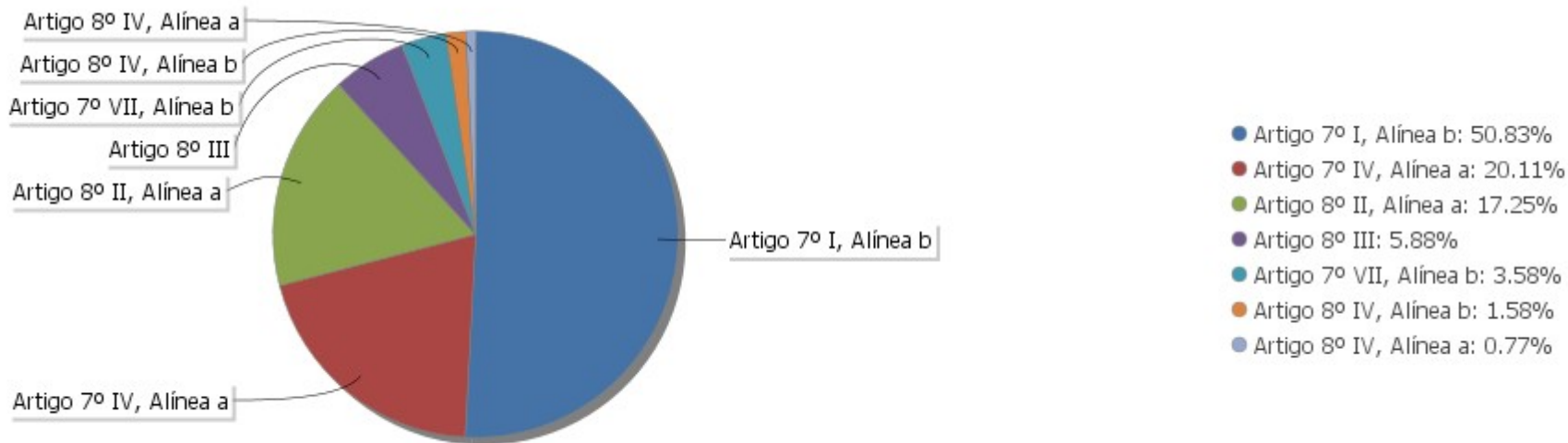
| Estratégia Indexador | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | No Mês(R\$) | No Trimestre(R\$) |
|--|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|---------------|-------------------|
| Artigo 7º I, Alínea b % do CDI | 1,17 311,02 | 2,26 181,95 | 2,26 181,95 | 5,04 179,89 | 12,41 208,29 | 2.208.106,44 | 4.441.880,42 |
| Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI | 1,13 302,28 | 2,04 164,95 | 2,04 164,95 | 4,78 170,90 | 10,51 176,36 | 814.047,73 | 1.476.179,99 |
| Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI | 0,87 231,28 | 1,90 153,08 | 1,90 153,08 | 4,44 158,42 | 11,47 192,50 | 111.933,99 | 242.579,91 |
| Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p. | 9,10 2,25 | 13,06 2,66 | 13,06 2,66 | 21,84 7,30 | 39,59 8,01 | 5.235.495,40 | 7.251.802,72 |
| Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p. | 2,62 -4,23 | 7,39 -3,02 | 7,39 -3,02 | 9,06 -5,48 | 21,46 -10,13 | 545.756,95 | 1.494.184,13 |
| Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p. | -36,34 -43,19 | -36,47 -46,88 | -36,47 -46,88 | -41,43 -55,97 | -41,74 -73,32 | -1.593.096,80 | -1.601.769,31 |
| Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p. | 3,31 -3,54 | 8,94 -1,46 | 8,94 -1,46 | 9,59 -4,95 | 20,00 -11,58 | 184.688,32 | 477.578,24 |
| | | | | | | 7.506.932,03 | 13.782.436,10 |

Análise de Liquidez

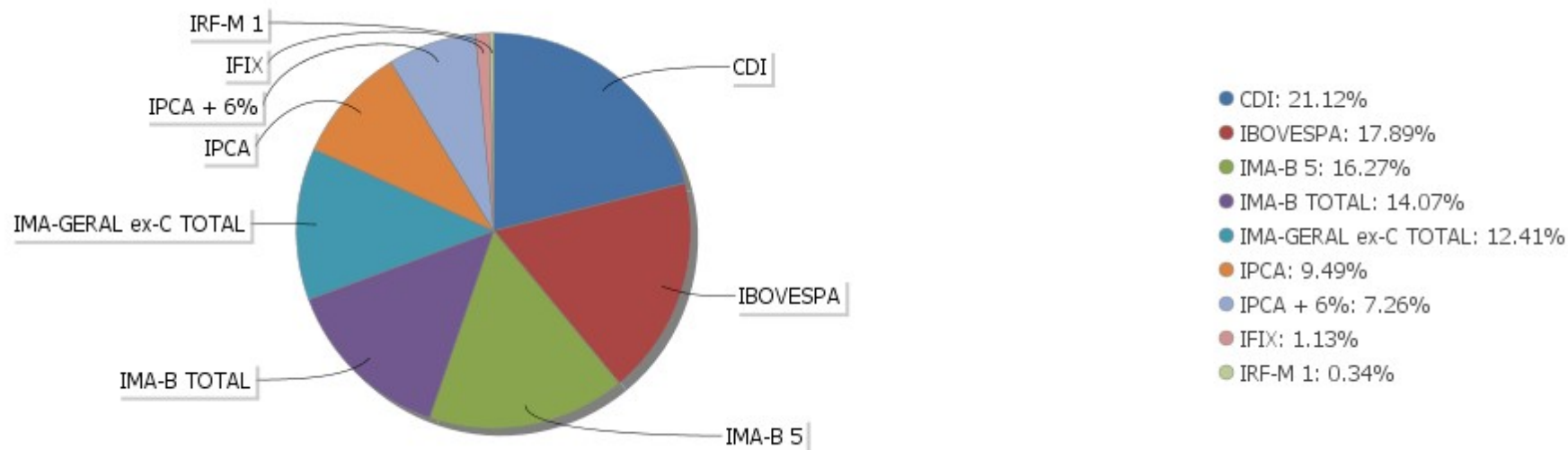
| Período | Valor (R\$) | (%) | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|----------------|-------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias | 324.873.923,33 | 89,26 | 324.873.923,33 | 89,26 |
| de 31 a 364 dias | 6.510.859,03 | 1,79 | 331.384.782,36 | 91,05 |
| acima de 365 dias | 32.591.492,09 | 8,95 | 363.976.274,45 | 100,00 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

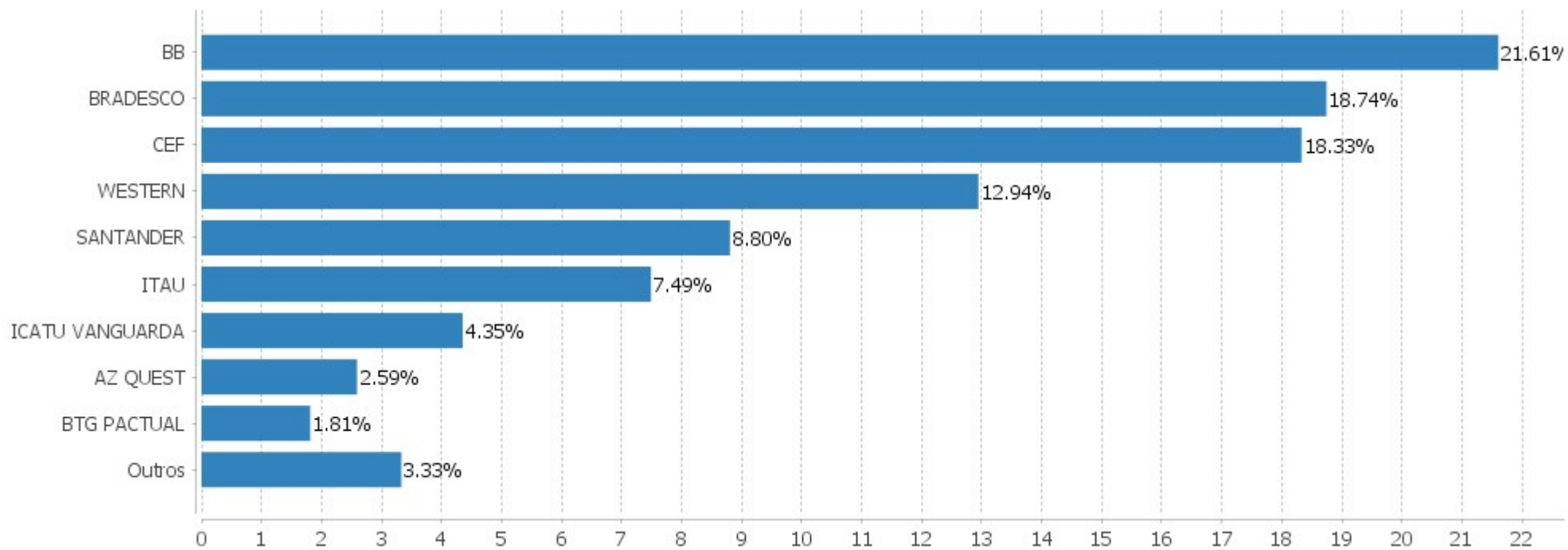


Alocação Por Estratégia



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 | 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

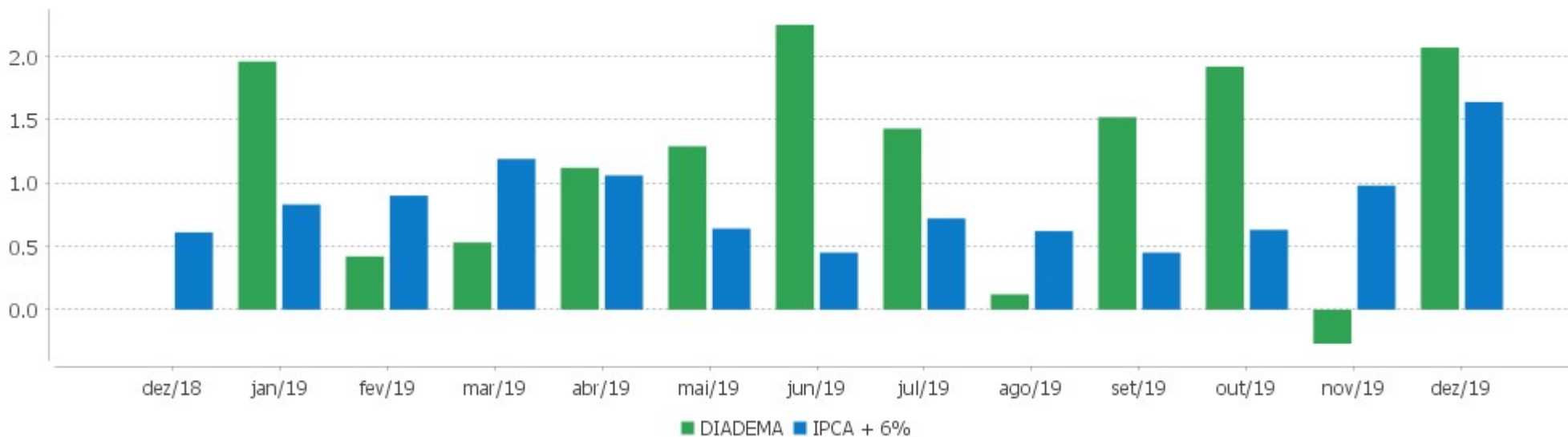
| | Quantidade | Perc. (%) | Período | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima da Meta Atuarial | 8 | 66,67 | 03 meses | 3,75 | 3,28 | 0,47 | 3,45 |
| Meses abaixo da Meta Atuarial | 4 | 33,33 | 06 meses | 6,97 | 5,15 | 1,82 | 3,58 |
| | | | 12 meses | 15,31 | 10,59 | 4,72 | 3,32 |
| | | | 24 meses | | | | |
| | | | 36 meses | | | | |
| Maior rentabilidade da Carteira | 2,25 | 2019-06 | | | | | |
| Menor rentabilidade da Carteira | -0,27 | 2019-11 | Desde 31/12/2018 | 15,31 | 10,59 | 4,72 | 3,32 |

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 |
|--|----------------|----------------|----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p. | 2,01 0,00 | 2,85 0,01 | 2,85 0,01 | 6,66 -0,06 | 22,85 -0,10 | 38,66 -0,35 | 56,63 -0,16 |
| BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI | 0,35 94,44 | 1,14 91,79 | 1,14 91,79 | 2,65 94,83 | 5,74 96,34 | 12,44 97,46 | 23,77 99,24 |
| BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA % do CDI | 0,85 226,08 | 1,81 145,88 | 1,81 145,88 | 4,38 156,48 | 12,43 208,62 | 23,11 181,08 | |
| BB CRED PRIV III Var. IPCA + 6% p.p. | 1,10 -0,54 | 2,43 -0,85 | 2,43 -0,85 | 5,12 -0,03 | 12,20 1,61 | 24,52 2,96 | 43,08 10,52 |
| MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP | 0,27 | 0,55 | 0,55 | 2,07 | 5,36 | 12,61 | 24,34 |
| WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RENDA FIXA Var. IMA-B 5 p.p. | 1,40 0,17 | 2,84 0,22 | 2,84 0,22 | 5,98 0,50 | 15,95 2,79 | 29,58 5,26 | 47,88 7,93 |
| FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B 5 p.p. | 1,21 -0,03 | 2,52 -0,10 | 2,52 -0,10 | 5,31 -0,17 | 12,85 -0,30 | 23,77 -0,55 | 39,09 -0,86 |
| SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FI Var. IMA-B 5 p.p. | 1,22 -0,02 | 2,56 -0,06 | 2,56 -0,06 | 5,35 -0,12 | 12,90 -0,26 | 23,79 -0,53 | 39,12 -0,84 |
| BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6% p.p. | 1,18 -0,46 | 2,45 -0,83 | 2,45 -0,83 | 5,43 0,29 | 14,15 3,56 | 26,26 4,70 | 43,86 11,30 |
| BB PREV ALOC FIC Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p. | 0,96 0,05 | 1,81 -0,09 | 1,81 -0,09 | 4,48 -0,06 | 13,07 0,44 | 24,27 0,61 | 39,50 -0,09 |
| BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p. | 0,40 -0,02 | 1,31 -0,07 | 1,31 -0,07 | 3,18 -0,14 | 6,48 -0,28 | 13,63 -0,57 | 26,04 -0,87 |
| FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF Var. IPCA p.p. | 0,59 -0,56 | 1,80 0,03 | 1,80 0,03 | 4,97 2,94 | 16,43 12,13 | 25,53 17,32 | 39,61 28,21 |
| SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p. | 1,98 -0,02 | 2,78 -0,07 | 2,78 -0,07 | 6,57 -0,15 | 22,58 -0,37 | 38,26 -0,75 | 55,67 -1,12 |
| WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI | 2,62 698,31 | 8,83 712,04 | 8,83 712,04 | 11,25 401,81 | 32,29 541,85 | 29,08 227,87 | 67,09 280,06 |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p. | 7,19 0,34 | 9,97 -0,44 | 9,97 -0,44 | 18,71 4,17 | 39,23 7,65 | 68,43 17,06 | 118,49 26,47 |
| ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p. | 10,21 3,36 | 14,53 4,13 | 14,53 4,13 | 21,51 6,98 | 39,84 8,25 | 76,22 24,86 | 135,61 43,59 |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p. | 10,83 3,98 | 19,61 9,20 | 19,61 9,20 | 34,48 19,94 | 49,67 18,09 | 89,25 37,89 | 166,63 74,61 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo Variação da Estratégia | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|---|----------------------|---------------------|---------------------|---------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p. | 7,51 0,66 | 10,02 -0,39 | 10,02 -0,39 | 17,23 2,69 | 42,62 11,03 | 73,48 22,11 | 110,31 18,29 |
| OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p. | 7,40 0,55 | 7,15 -3,25 | 7,15 -3,25 | 19,63 5,09 | 35,45 3,86 | 66,40 15,03 | 109,26 17,25 |
| BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO Var. IFIX p.p. | -8,80 -19,43 | -5,94 -25,06 | -5,94 -25,06 | -19,77 -41,53 | -15,88 -51,86 | -23,25 -66,87 | -12,89 -84,38 |
| BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11 Var. IBOVESPA p.p. | 9,00 2,15 | 15,07 4,67 | 15,07 4,67 | 13,95 -0,59 | 19,49 -12,09 | 14,89 -36,47 | 38,84 -53,18 |
| FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA Var. IPCA + 6% p.p. | -0,58 -2,23 | -1,36 -4,64 | -1,36 -4,64 | -67,28 -72,42 | -67,41 -78,00 | -67,91 -89,47 | -62,81 -95,37 |
| PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FI EM PARTICIPAÇÕES % do CDI | -38,33 -10.230,12 | -38,43 -3.100,99 | -38,43 -3.100,99 | -38,61 -1.379,07 | -38,93 -653,18 | -38,23 -299,53 | -37,31 -155,74 |
| CDI | 0,37 | 1,24 | 1,24 | 2,80 | 5,96 | 12,76 | 23,96 |
| IBOVESPA | 6,85 | 10,41 | 10,41 | 14,54 | 31,58 | 51,36 | 92,02 |
| INPC + 6% | 1,71 | 3,33 | 3,33 | 5,09 | 10,78 | 21,40 | 31,25 |
| IPCA + 6% | 1,64 | 3,28 | 3,28 | 5,15 | 10,59 | 21,56 | 32,56 |

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 | 0,42 | 1,38 | 1,38 | 3,33 | 6,76 | 14,21 | 26,90 |
| IRF-M 1+ | 0,72 | 2,10 | 2,10 | 5,44 | 14,24 | 28,25 | 49,63 |
| IRF-M TOTAL | 0,62 | 1,86 | 1,86 | 4,72 | 12,03 | 24,05 | 42,91 |
| IMA-B 5 | 1,24 | 2,62 | 2,62 | 5,47 | 13,15 | 24,32 | 39,95 |
| IMA-B 5+ | 2,60 | 3,02 | 3,02 | 7,64 | 30,37 | 50,45 | 69,64 |
| IMA-B TOTAL | 2,01 | 2,85 | 2,85 | 6,72 | 22,95 | 39,01 | 56,79 |
| IMA-C TOTAL | 0,40 | 1,84 | 1,84 | 5,35 | 19,41 | 41,36 | 56,88 |
| IMA-GERAL ex-C TOTAL | 0,91 | 1,90 | 1,90 | 4,54 | 12,63 | 23,66 | 39,60 |
| IMA-GERAL TOTAL | 0,90 | 1,90 | 1,90 | 4,56 | 12,82 | 24,14 | 40,06 |
| IDKA 2 | 1,20 | 2,46 | 2,46 | 5,25 | 11,82 | 22,73 | 39,44 |
| IDKA 20 | 3,94 | 3,32 | 3,32 | 8,71 | 44,26 | 73,70 | 94,85 |
| CDI | 0,37 | 1,24 | 1,24 | 2,80 | 5,96 | 12,76 | 23,96 |
| Renda Variável | | | | | | | |
| IBOVESPA | 6,85 | 10,41 | 10,41 | 14,54 | 31,58 | 51,36 | 92,02 |
| IBRX 100 | 7,27 | 10,70 | 10,70 | 15,40 | 33,39 | 53,96 | 96,37 |
| IBRX 50 | 6,56 | 9,81 | 9,81 | 13,17 | 29,15 | 47,91 | 87,58 |
| SMALL CAP | 12,65 | 21,15 | 21,15 | 32,65 | 58,20 | 71,06 | 155,48 |
| IFIX | 10,63 | 19,12 | 19,12 | 21,76 | 35,98 | 43,62 | 71,49 |
| Índice Consumo - ICON | | | | | | | |
| Índice Dividendos - IDIV | 9,99 | 14,28 | 14,28 | 22,33 | 45,16 | 68,32 | 110,90 |
| Indicadores Econômicos | | | | | | | |
| IPCA | 1,15 | 1,77 | 1,77 | 2,03 | 4,31 | 8,21 | 11,40 |
| INPC | 1,22 | 1,81 | 1,81 | 1,98 | 4,48 | 8,07 | 10,30 |
| IGPM | 2,09 | 3,09 | 3,09 | 2,80 | 7,32 | 15,42 | 14,81 |
| SELIC | 0,37 | 1,24 | 1,24 | 2,80 | 5,96 | 12,77 | 23,98 |
| Meta Atuarial | | | | | | | |
| IPCA + 4% | 1,48 | 2,79 | 2,79 | 4,12 | 8,50 | 17,02 | 25,23 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Indexador | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|--------------|--------|--------------|---------|---------|----------|----------|----------|
| IPCA + 5% | 1,56 | 3,04 | 3,04 | 4,63 | 9,54 | 19,28 | 28,86 |
| IPCA + 5,5% | 1,60 | 3,16 | 3,16 | 4,89 | 10,07 | 20,42 | 30,70 |
| IPCA + 5,89% | 1,63 | 3,26 | 3,26 | 5,09 | 10,47 | 21,31 | 32,15 |
| IPCA + 6% | 1,64 | 3,28 | 3,28 | 5,15 | 10,59 | 21,56 | 32,56 |
| INPC + 4% | 1,55 | 2,83 | 2,83 | 4,06 | 8,68 | 16,87 | 24,00 |
| INPC + 6% | 1,71 | 3,33 | 3,33 | 5,09 | 10,78 | 21,40 | 31,25 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

| Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|------------|---|---------------|---------------|--------------------|---------------|
| 01/10/2019 | SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FI | 0,00 | 17.017.524,60 | 687.346,86939612 | 24,7582776000 |
| 01/10/2019 | SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FI | 0,00 | 561.926,83 | 22.696,52352553 | 24,7582776000 |
| 01/10/2019 | SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FI | 0,00 | 11.254.573,20 | 454.578,19731369 | 24,7582776000 |
| 02/10/2019 | SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 28.834.024,63 | 0,00 | 1.095.899,42750200 | 26,3108310000 |
| 04/10/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 80.000,00 | 35.965,47779500 | 2,2243552680 |
| 04/10/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 1.568.516,70 | 705.155,65681700 | 2,2243552680 |
| 08/10/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 5.040.898,31 | 0,00 | 2.265.338,54823400 | 2,2252295640 |
| 08/10/2019 | FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO | 0,00 | 5.000.000,00 | 1.710.305,68635593 | 2,9234540000 |
| 10/10/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 9.625,02 | 4.323,72770500 | 2,2260930050 |
| 14/10/2019 | BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS | 0,00 | 3.369.065,29 | 1.366.812,61135057 | 2,4649065000 |
| 15/10/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 60.000,00 | 26.937,43400700 | 2,2273836470 |
| 15/10/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 1.964.386,06 | 881.925,33093500 | 2,2273836470 |
| 16/10/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 34.000,00 | 0,00 | 15.261,67126900 | 2,2278031940 |
| 18/10/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 3.148.525,16 | 0,00 | 1.412.759,22320400 | 2,2286353600 |
| 23/10/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 10.000,00 | 4.484,47859100 | 2,2299136450 |
| 23/10/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 248.020,21 | 0,00 | 111.224,13217900 | 2,2299136450 |
| 24/10/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 35.000,00 | 15.693,03505200 | 2,2302887800 |
| 25/10/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 47.000,00 | 21.069,94325800 | 2,2306657130 |
| 29/10/2019 | BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS | 0,00 | 2.380.544,57 | 963.157,72012192 | 2,4716041000 |
| 30/10/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 50.000,00 | 22.402,73746700 | 2,2318701040 |
| 30/10/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 2.069.822,62 | 927.393,85517600 | 2,2318701040 |
| 31/10/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 1.774.120,63 | 0,00 | 794.757,89700100 | 2,2322780770 |
| 01/11/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 10.000,00 | 4.478,76592200 | 2,2327579010 |
| 05/11/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 70.000,00 | 31.340,72844300 | 2,2335154120 |
| 05/11/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 1.757.474,38 | 786.864,67555000 | 2,2335154120 |
| 08/11/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 32.094,74 | 0,00 | 14.362,49427100 | 2,2346216050 |
| 13/11/2019 | BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS | 0,00 | 3.461.471,50 | 1.398.602,03292910 | 2,4749510000 |
| 14/11/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 50.000,00 | 22.360,52788100 | 2,2360831670 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|------------|--|--------------|--------------|--------------------|------------------|
| 14/11/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 1.972.176,83 | 881.978,29987100 | 2,2360831670 |
| 18/11/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 34.000,00 | 0,00 | 15.202,53395400 | 2,2364692690 |
| 18/11/2019 | WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO | 0,00 | 5.289.780,72 | 1.219,99610445 | 4.335,8996809000 |
| 19/11/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 8.201.369,17 | 0,00 | 3.666.503,50588700 | 2,2368365820 |
| 21/11/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 15.000,00 | 6.703,53342200 | 2,2376258990 |
| 21/11/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 5.289.780,72 | 2.364.014,79012300 | 2,2376258990 |
| 21/11/2019 | WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO | 5.289.780,72 | 0,00 | 1.579.040,29355480 | 3,3499973000 |
| 22/11/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 248.907,20 | 0,00 | 111.218,77935300 | 2,2379961500 |
| 25/11/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 100.000,00 | 44.674,71885300 | 2,2384024470 |
| 26/11/2019 | FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO | 0,00 | 5.000.000,00 | 1.687.912,98794100 | 2,9622380000 |
| 26/11/2019 | BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS | 5.000.000,00 | 0,00 | 2.018.035,50620460 | 2,4776571000 |
| 28/11/2019 | BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS | 0,00 | 2.327.298,34 | 938.864,45814110 | 2,4788438000 |
| 29/11/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 43.000,00 | 19.197,23440100 | 2,2399059730 |
| 29/11/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 2.035.358,05 | 908.680,12967300 | 2,2399059730 |
| 02/12/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 10.000,00 | 4.463,73292700 | 2,2402774010 |
| 04/12/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 15.000,00 | 6.693,56014200 | 2,2409599200 |
| 05/12/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 75.000,00 | 33.462,01082700 | 2,2413476700 |
| 05/12/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 1.588.096,44 | 708.545,33692200 | 2,2413476700 |
| 05/12/2019 | BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS | 0,00 | 3.450.338,50 | 1.390.617,42918360 | 2,4811558000 |
| 06/12/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 1.768.731,18 | 0,00 | 789.000,25436800 | 2,2417371480 |
| 06/12/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 50.000,00 | 22.304,13143900 | 2,2417371480 |
| 06/12/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 836,52 | 373,15704100 | 2,2417371480 |
| 06/12/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 1.985.163,48 | 885.546,94370400 | 2,2417371480 |
| 09/12/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 1.769.050,97 | 789.000,25345000 | 2,2421424610 |
| 10/12/2019 | BB PREV ALOC FIC | 1.769.050,97 | 0,00 | 1.220.414,95832500 | 1,4495487440 |
| 12/12/2019 | FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO | 0,00 | 5.000.000,00 | 1.676.084,58328600 | 2,9831430000 |
| 12/12/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 2.520.640,81 | 0,00 | 1.123.613,17889300 | 2,2433350350 |
| 12/12/2019 | BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS | 0,00 | 197.158,29 | 79.362,39754770 | 2,4842784000 |
| 13/12/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 40.000,00 | 17.826,61137100 | 2,2438364290 |
| 13/12/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 288.616,06 | 128.626,15842700 | 2,2438364290 |

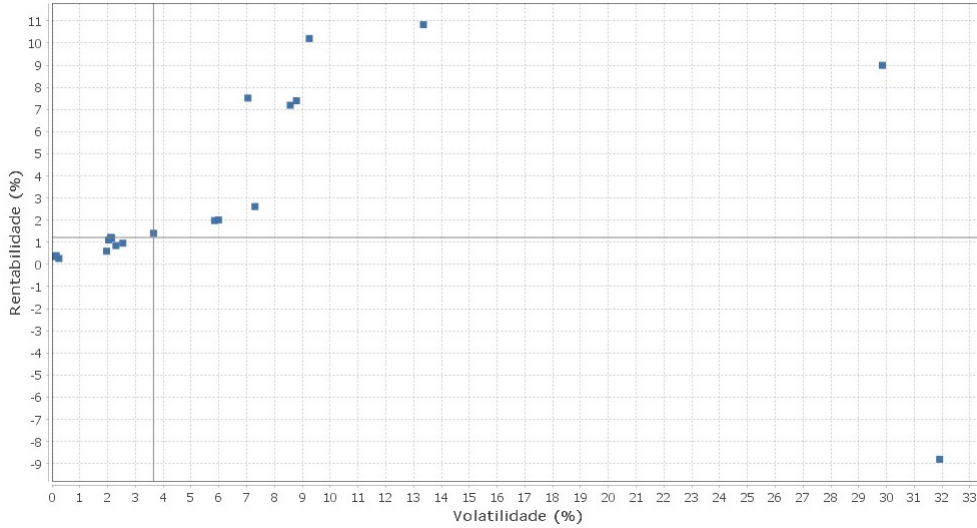
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|------------|--|--------------|--------------|--------------------|--------------|
| 13/12/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 1.800.000,00 | 802.197,51169700 | 2,2438364290 |
| 13/12/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 144.308,03 | 0,00 | 64.313,07921300 | 2,2438364290 |
| 17/12/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 255.870,57 | 0,00 | 113.995,56920000 | 2,2445659230 |
| 18/12/2019 | FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO | 0,00 | 5.000.000,00 | 1.678.033,66555900 | 2,9796780000 |
| 19/12/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 150.000,00 | 66.806,61164200 | 2,2452867510 |
| 19/12/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 1.847.250,00 | 822.723,42237700 | 2,2452867510 |
| 19/12/2019 | BRDESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS | 176.138,70 | 0,00 | 70.858,75702660 | 2,4857718000 |
| 20/12/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 50.000,00 | 22.265,41085500 | 2,2456356330 |
| 20/12/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 25.000,00 | 11.132,70542800 | 2,2456356330 |
| 20/12/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 2.971.619,21 | 0,00 | 1.323.286,45232100 | 2,2456356330 |
| 26/12/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 2.443.000,00 | 0,00 | 1.087.361,74004000 | 2,2467224200 |
| 26/12/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 2.406.380,58 | 1.071.062,69941400 | 2,2467224200 |
| 26/12/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 85.445,73 | 38.031,28025000 | 2,2467224200 |
| 27/12/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 1.339.455,42 | 0,00 | 596.083,10567700 | 2,2470950900 |
| 27/12/2019 | BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 59.477,20 | 0,00 | 26.468,48380500 | 2,2470950900 |

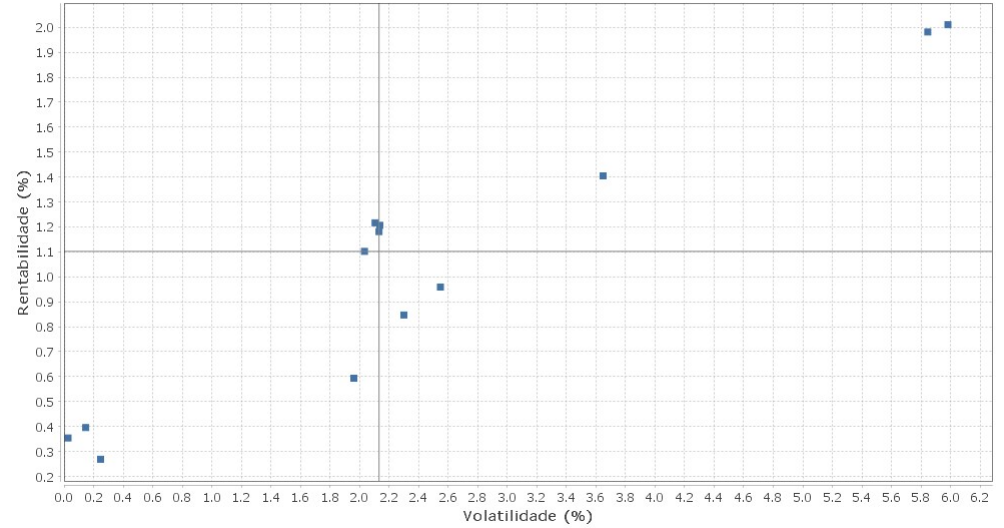
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

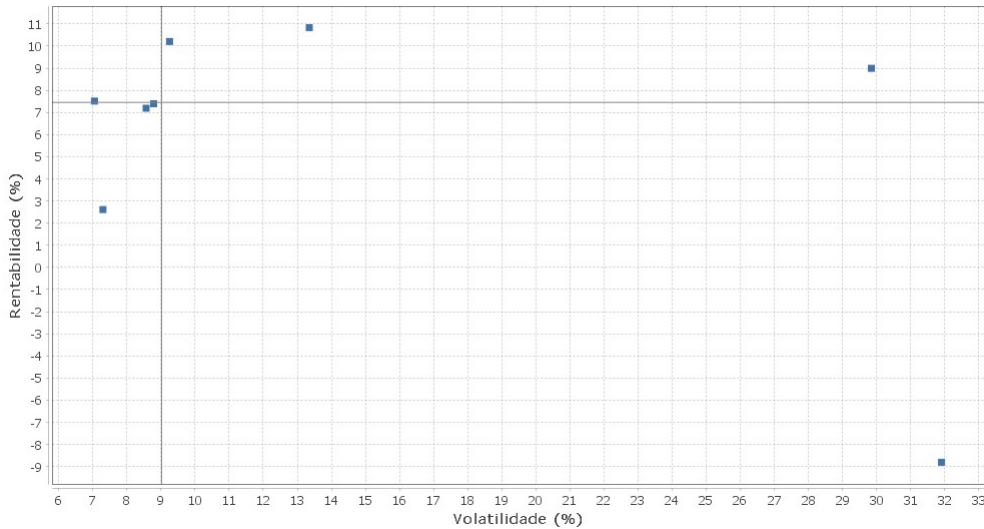
DIADEMA - No Mês



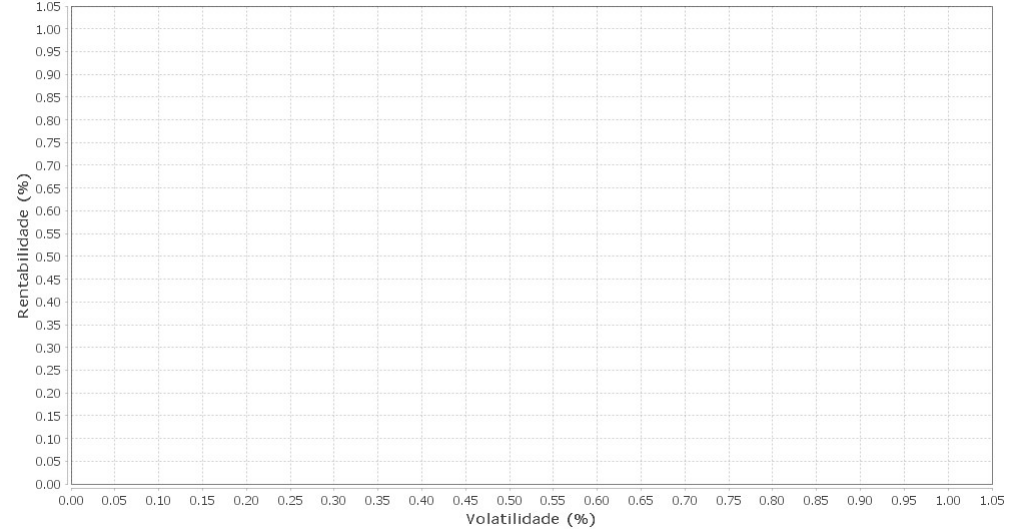
Renda Fixa - No Mês



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 PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,03 | 0,02 | 0,35 | 7.030.896,64 | 1,93 |
| BRADERCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS | Artigo 7º I, Alínea b | 0,15 | 0,03 | 0,40 | 1.221.516,08 | 0,34 |
| MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP | Artigo 7º VII, Alínea b | 0,25 | 0,04 | 0,27 | 3.658.154,78 | 1,01 |
| FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF | Artigo 7º I, Alínea b | 1,96 | 0,23 | 0,59 | 34.196.611,82 | 9,40 |
| BB CRED PRIV III | Artigo 7º VII, Alínea b | 2,03 | 0,26 | 1,10 | 9.370.175,40 | 2,57 |
| SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FI | Artigo 7º I, Alínea b | 2,11 | 0,28 | 1,22 | 2.005.299,76 | 0,55 |
| BB PREV IPCA I | Artigo 7º I, Alínea b | 2,13 | 0,28 | 1,18 | 16.586.403,95 | 4,56 |
| FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO | Artigo 7º I, Alínea b | 2,14 | 0,28 | 1,21 | 31.491.580,41 | 8,65 |
| BRADERCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA | Artigo 7º IV, Alínea a | 2,30 | 0,28 | 0,85 | 45.118.622,03 | 12,40 |
| BB PREV ALOC FIC | Artigo 7º I, Alínea b | 2,55 | 0,31 | 0,96 | 44.730.533,96 | 12,29 |
| WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RENDA FIXA | Artigo 7º I, Alínea b | 3,65 | 0,44 | 1,40 | 25.142.851,27 | 6,91 |
| SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 5,85 | 0,70 | 1,98 | 29.645.319,52 | 8,14 |
| BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B | Artigo 7º IV, Alínea a | 5,98 | 0,71 | 2,01 | 21.062.635,65 | 5,79 |
| ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA | Artigo 8º II, Alínea a | 7,05 | 1,07 | 7,51 | 15.660.576,65 | 4,30 |
| WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO | Artigo 8º III | 7,30 | 0,88 | 2,62 | 21.403.713,38 | 5,88 |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA | Artigo 8º II, Alínea a | 8,57 | 1,22 | 7,19 | 6.510.859,03 | 1,79 |
| OCCAM FIC FIA | Artigo 8º II, Alínea a | 8,78 | 1,25 | 7,40 | 4.343.586,49 | 1,19 |
| ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI | Artigo 8º II, Alínea a | 9,25 | 1,42 | 10,21 | 26.918.508,98 | 7,40 |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA | Artigo 8º II, Alínea a | 13,35 | 1,87 | 10,83 | 9.335.517,30 | 2,56 |
| BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11 | Artigo 8º IV, Alínea b | 29,85 | 3,50 | 9,00 | 1.678.584,52 | 0,46 |
| BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO | Artigo 8º IV, Alínea b | 31,91 | 2,87 | -8,80 | 4.074.126,16 | 1,12 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

No respectivo mês, dezembro de 2019, observar que:

- O percentual alocado no Artigo 8, Inciso IV, Alínea A (0,77% dos recursos) está inferior ao limite mínimo estipulado em Política de Investimentos.