



DIADEMA
2º TRIMESTRE 2020



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 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

75,47%

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	BRABESCO	BRABESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,53	0,26	1,07	30.920,39	0,01	980.825.577,34	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,95	0,32	2,91	0,00	0,00	8.746.335.681,60	0,00
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TÍTULOS PUBLICOS RF	4,97	1,08	3,73	2.067.555,07	0,68	1.060.557.880,47	0,19
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	12,44	2,00	4,83	29.042.910,29	9,59	1.214.596.338,04	2,39
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	8,96	1,41	5,29	26.351.490,19	8,70	608.337.847,65	4,33
BB	BB	BB PREV IPCA I	4,98	1,19	3,79	16.719.612,34	5,52	507.577.829,32	3,29
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,05	0,95	2,96	46.321.228,71	15,30	10.783.491.196,95	0,43
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,96	0,75	3,27	35.778.366,53	11,82	12.211.119.756,17	0,29
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			7,03	1,20	3,86	156.312.083,52	51,63		

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	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	12,96	2,09	5,16	20.704.740,54	6,84	1.949.868.392,71	1,06
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,26	0,78	7.439.122,31	2,46	2.439.958.346,20	0,30
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	6,62	0,95	3,13	30.855.132,56	10,19	1.185.458.143,51	2,60
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			8,15	1,26	3,60	58.998.995,41	19,49		

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	4,44	0,98	3,62	9.621.051,49	3,18	600.689.300,61	1,60
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	1,54	0,64	-0,10	3.552.299,58	1,17	93.068.742,14	3,82
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			3,27	0,88	2,59	13.173.351,07	4,35		

Renda Fixa			7,10	1,20	3,71	228.484.430,00	75,47		
------------	--	--	------	------	------	----------------	-------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

24,53%

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	38,57	7,89	21,11	12.519.507,55	4,14	1.556.319.793,19	0,80
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	45,57	8,63	28,01	7.444.536,57	2,46	1.154.678.354,43	0,64
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	45,13	10,27	41,67	5.968.440,06	1,97	2.091.503.187,63	0,29
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	40,84	8,97	30,06	3.766.182,53	1,24	682.416.337,20	0,55
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	50,97	12,10	33,61	19.243.719,20	6,36	1.785.775.187,89	1,08
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			44,85	10,00	29,94	48.942.385,91	16,17		

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	32,56	0,85	18,78	20.033.303,17	6,62	896.638.682,93	2,23
Sub-total Artigo 8º III			32,56	0,85	18,78	20.033.303,17	6,62		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
PÁTRIA	PÁTRIA	PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FI EM PARTICIPAÇÕES	545,18	-99,55	-99,55	11.490,20	0,00	1.582.306,81	0,73
CEF	CEF	FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	159,94	-0,49	-7,68	209.042,71	0,07	20.489.283,34	1,02
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			264,40	-91,99	-92,06	220.532,91	0,07		

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	24,16	0,53	1,81	3.655.554,17	1,21	75.669.971,34	4,83
BRPP	GERAÇÃO FUTURO	BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	18,86	4,11	5,87	1.403.160,38	0,46	249.655.908,27	0,56
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			18,99	1,50	5,73	5.058.714,55	1,67		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável e Investimentos Estruturados	35,51	3,00	19,58	74.254.936,54	24,53
Total				302.739.366,54	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

				Política de Investimentos			
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	156.312.083,52	51,63	15,00	55,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	58.998.995,41	19,49	5,00	15,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	13.173.351,07	4,35	0,00	2,00	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	228.484.430,00	75,47				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	48.942.385,91	16,17	2,00	15,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	20.033.303,17	6,62	2,00	7,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	220.532,91	0,07	1,00	2,00	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	5.058.714,55	1,67	1,00	2,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	74.254.936,54	24,53				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

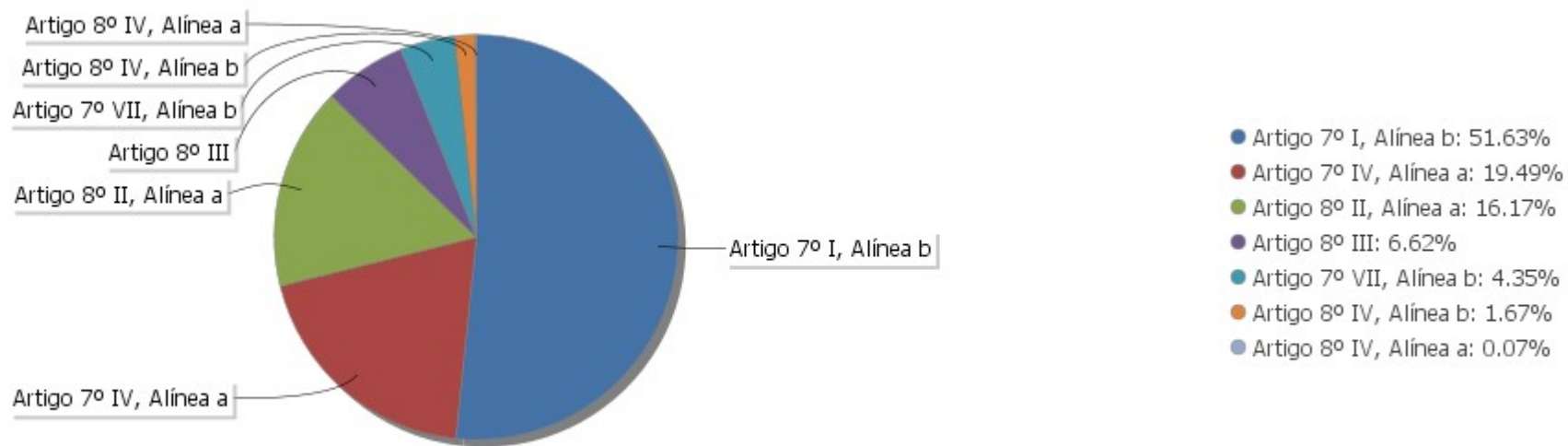
Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,20 563,83	3,86 525,25	3,86 525,25	2,50 142,33	7,66 166,38	1.864.767,35	6.034.353,40
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	1,26 592,71	3,60 490,20	3,60 490,20	0,56 31,74	5,37 116,61	822.067,97	2.402.085,13
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,88 416,63	2,59 352,07	2,59 352,07	1,11 63,45	5,60 121,60	115.511,76	332.215,72
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	10,00 1,25	29,94 -0,24	29,94 -0,24	-22,03 -4,22	-5,00 0,86	4.450.280,12	11.277.753,70
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	0,85 -7,91	18,78 -11,40	18,78 -11,40	-6,40 11,40	2,08 7,93	168.244,54	3.166.741,36
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-91,99 -100,74	-92,06 -122,23	-92,06 -122,23	-92,10 -74,29	-95,37 -89,52	-2.531.620,28	-2.555.524,02
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	1,50 -7,26	5,73 -24,45	5,73 -24,45	-7,70 10,10	1,15 7,00	74.655,86	276.500,94
						4.963.907,32	20.934.126,23

Análise de Liquidez

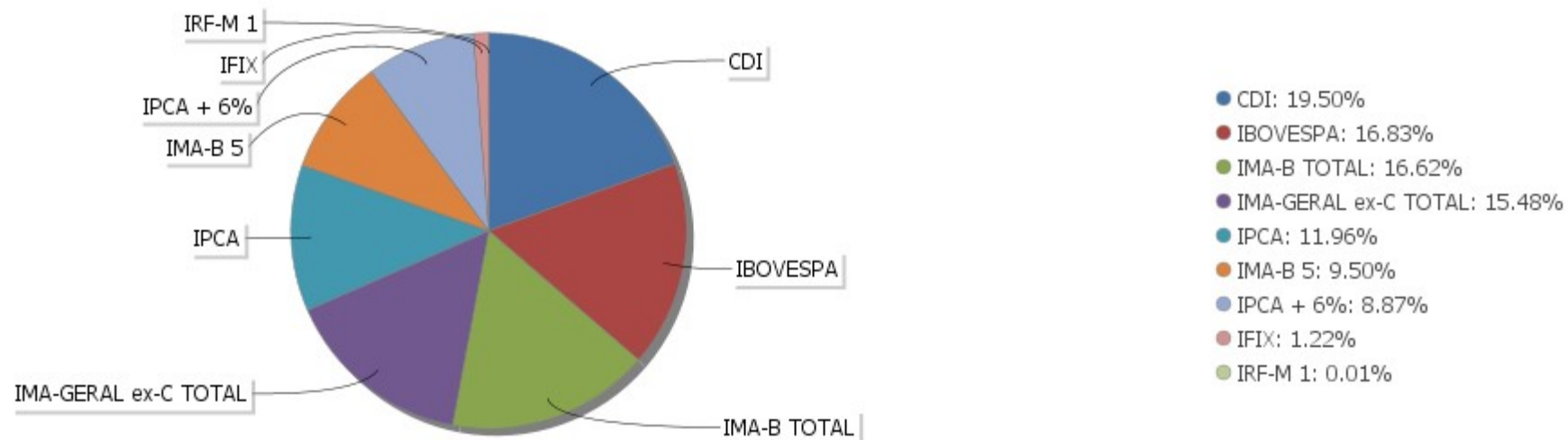
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	266.763.218,28	88,12	266.763.218,28	88,12
de 31 a 364 dias	5.979.930,26	1,98	272.743.148,54	90,09
acima de 365 dias	29.996.218,00	9,91	302.739.366,54	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

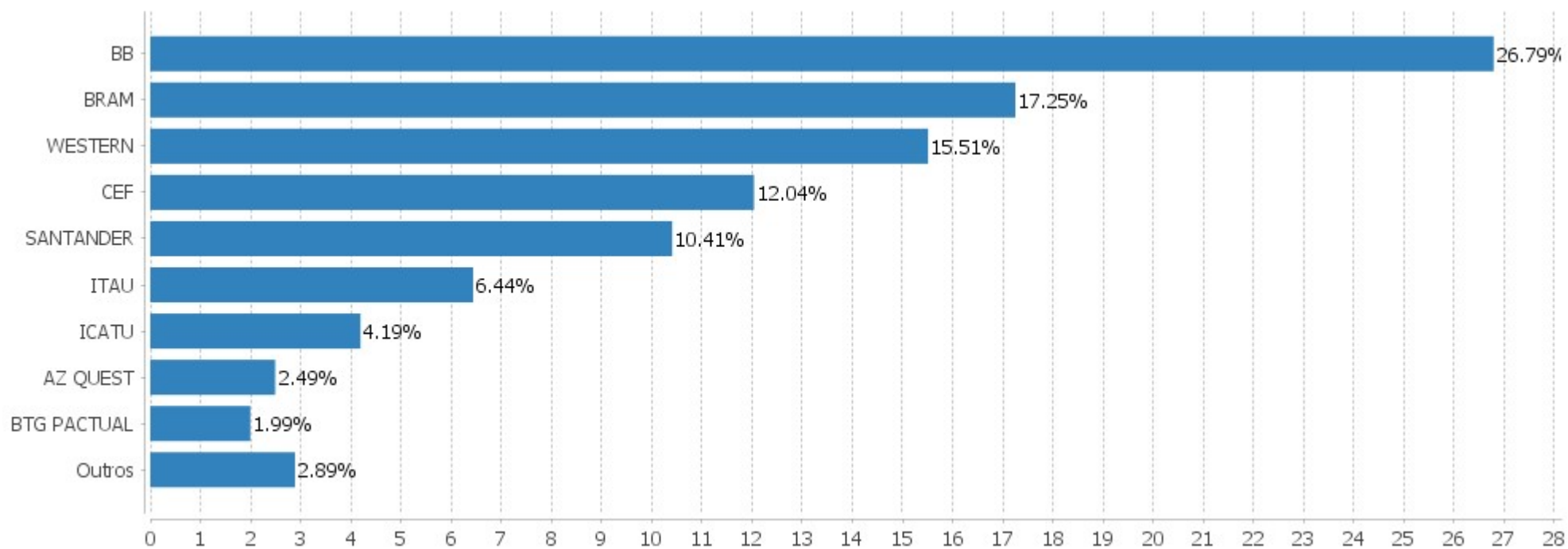


Alocação Por Estratégia



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							-3,64
IPCA + 5,88%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74							2,93
p.p. indexador	-0,06	-2,15	-9,71	2,43	2,54	0,89							-6,57
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

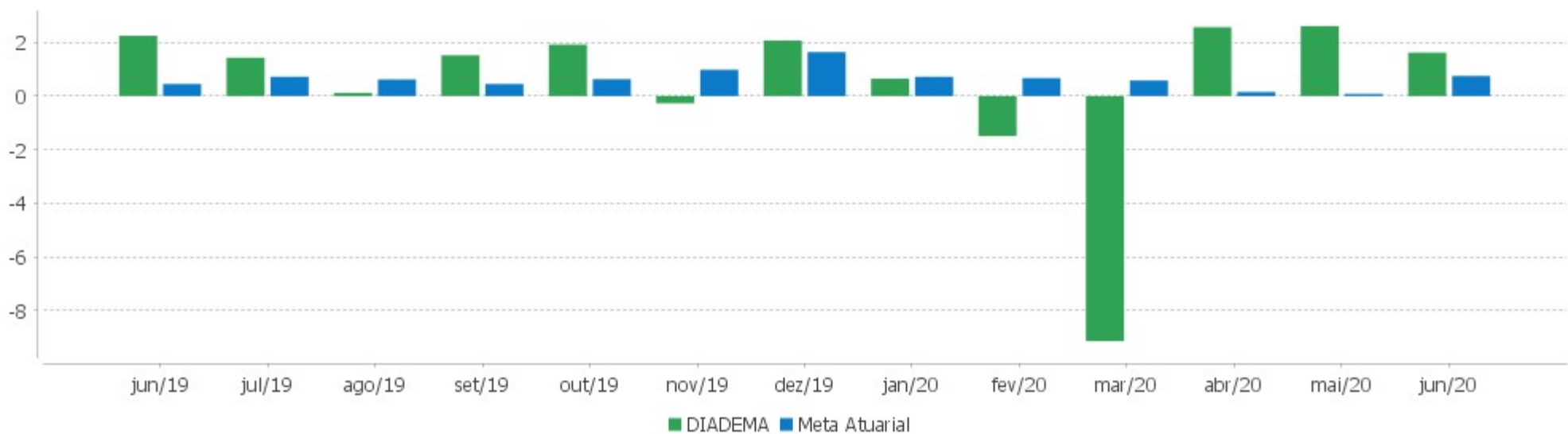
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	11	61,11	03 meses	6,96	0,96	6,01	10,40
Meses abaixo da Meta Atuarial	7	38,89	06 meses	-3,64	2,93	-6,57	17,27
			12 meses	3,08	8,23	-5,15	12,30
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,61	2020-05	Desde 31/12/2018	11,11	13,83	-2,71	10,24
Menor rentabilidade da Carteira	-9,14	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BB CRED PRIV III Var. IPCA + 6% p.p.	0,98 0,23	3,62 2,63	3,62 2,63	2,68 -0,31	7,94 -0,35	24,05 5,49	37,24 6,13
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	0,64	-0,10	-0,10	-2,89	-0,88	5,76	13,90
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,09 0,04	5,16 0,20	5,16 0,20	-1,70 -0,04	4,85 -0,10	35,14 0,01	45,86 -0,35
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,26 122,46	0,78 105,60	0,78 105,60	1,37 78,16	4,06 88,25	10,51 93,70	18,70 96,43
BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINAMICA % do CDI	0,95 447,46	3,13 425,71	3,13 425,71	1,78 101,36	6,24 135,50	22,63 201,78	
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	1,41 0,30	5,29 1,52	5,29 1,52	4,81 1,64	11,07 2,26	32,87 8,11	45,48 8,58
SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TÍTULOS PUBLICOS RF Var. IMA-B 5 p.p.	1,08 -0,04	3,73 -0,04	3,73 -0,04	3,10 -0,07	8,62 -0,19	24,28 -0,47	36,12 -0,77
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,10 -0,02	3,71 -0,06	3,71 -0,06	3,04 -0,13	8,51 -0,30	24,21 -0,55	35,98 -0,92
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6% p.p.	1,19 0,44	3,79 2,81	3,79 2,81	3,40 0,41	9,01 0,73	27,95 9,39	40,65 9,55
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,26 -0,02	1,07 -0,08	1,07 -0,08	2,44 -0,16	5,70 -0,31	13,08 -0,59	21,64 -0,90
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,95 0,05	2,96 0,22	2,96 0,22	1,75 0,04	6,31 -0,01	23,29 0,35	33,67 0,56
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,75 0,49	3,27 3,70	3,27 3,70	4,63 4,53	9,82 7,69	28,20 22,63	38,61 28,41
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,00 -0,05	4,83 -0,13	4,83 -0,13	-2,03 -0,37	4,40 -0,54	34,09 -1,04	44,71 -1,49
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	0,85 398,88	18,78 2.555,01	18,78 2.555,01	-6,40 -364,95	4,13 89,64	17,08 152,32	38,07 196,32
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO Var. IFIX p.p.	0,01 -5,58	1,81 -10,71	1,81 -10,71	-10,27 1,96	-21,08 -27,94	-23,46 -55,51	-18,83 -54,13
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11 Var. IBOVESPA p.p.	3,54 -5,22	5,87 -24,31	5,87 -24,31	-16,41 1,40	-4,75 1,11	4,75 -25,89	0,75 -50,38
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	10,27 1,52	41,67 11,49	41,67 11,49	-8,33 9,47	8,82 14,67	58,71 28,07	80,75 29,62

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	12,10 3,34	33,61 3,43	33,61 3,43	-28,51 -10,71	-13,13 -7,28	23,01 -7,63	52,90 1,78
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	8,63 -0,12	28,01 -2,17	28,01 -2,17	-20,26 -2,45	7,24 13,09	45,66 15,02	93,56 42,44
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	8,97 0,21	30,06 -0,12	30,06 -0,12	-13,29 4,51	3,73 9,58	44,34 13,70	75,17 24,04
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	7,89 -0,86	21,11 -9,07	21,11 -9,07	-20,06 -2,25	-6,28 -0,43	44,97 14,33	54,60 3,47
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA Var. IPCA + 6% p.p.	-0,49 -1,24	-7,68 -8,66	-7,68 -8,66	-8,88 -11,87	-70,18 -78,47	-70,52 -89,08	-70,91 -102,02
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FI EM PARTICIPAÇÕES % do CDI	-99,55 -46.884,12	-99,55 -13.547,07	-99,55 -13.547,07	-99,55 -5.674,45	-99,72 -2.166,47	-99,72 -889,35	-99,72 -514,26
CDI	0,21	0,73	0,73	1,75	4,60	11,21	19,39
IBOVESPA	8,76	30,18	30,18	-17,80	-5,85	30,64	51,12
INPC + 6%	0,79	1,24	1,24	3,25	8,51	18,75	30,23
IPCA + 6%	0,75	0,98	0,98	2,99	8,29	18,56	31,11

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	0,28	1,15	1,15	2,60	6,01	13,67	22,54
IRF-M 1+	1,04	4,53	4,53	6,03	11,80	33,23	45,60
IRF-M TOTAL	0,79	3,39	3,39	4,86	9,81	27,08	38,44
IMA-B 5	1,12	3,77	3,77	3,17	8,81	24,75	36,90
IMA-B 5+	2,84	5,99	5,99	-5,26	1,97	43,55	52,33
IMA-B TOTAL	2,05	4,96	4,96	-1,66	4,95	35,13	46,21
IMA-C TOTAL	3,74	7,95	7,95	7,46	13,21	41,24	63,14
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,90	2,74	2,74	1,71	6,32	22,95	33,11
IMA-GERAL TOTAL	0,99	2,89	2,89	1,87	6,52	23,45	33,90
IDKA 2	0,99	3,35	3,35	3,35	8,77	23,17	35,46
IDKA 20	4,18	6,49	6,49	-12,33	-4,69	58,14	62,45
CDI	0,21	0,73	0,73	1,75	4,60	11,21	19,39
Renda Variável							
IBOVESPA	8,76	30,18	30,18	-17,80	-5,85	30,64	51,12
IBRX 100	8,97	30,39	30,39	-17,39	-4,66	34,21	53,90
IBRX 50	9,33	31,79	31,79	-17,76	-6,93	27,59	47,47
SMALL CAP	14,43	32,49	32,49	-20,73	5,15	49,01	69,83
IFIX	5,59	12,52	12,52	-12,24	6,86	32,05	35,30
Índice Consumo - ICON	10,08	39,45	39,45	-10,90	13,99	52,93	55,22
Índice Dividendos - IDIV	8,95	18,70	18,70	-18,38	-0,15	47,52	60,57
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,26	-0,43	-0,43	0,10	2,13	5,57	10,21
INPC	0,30	-0,18	-0,18	0,36	2,35	5,74	9,47
IGPM	1,56	2,66	2,66	4,39	7,31	14,30	22,21
SELIC	0,21	0,73	0,73	1,75	4,60	11,21	19,40
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
62	03/04/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	943.453,76	417.279,68598700	2,2609625910
56	03/04/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	70.000,00	30.960,26457000	2,2609625910
57	09/04/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	990.000,00	437.892,32711400	2,2608297490
71	14/04/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	5.735.880,01	1.901.641,06515300	3,0162790000
63	15/04/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	89.272,01	0,00	39.471,33450200	2,2616922160
58	15/04/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	22.107,34053300	2,2616922160
70	16/04/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	140.702,06	0,00	96.663,10558200	1,4555921740
64	20/04/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	3.077.338,79	0,00	1.359.502,81999100	2,2635766140
65	22/04/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.830.194,68	808.323,56773000	2,2641857210
59	22/04/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.830.000,00	0,00	808.237,58538300	2,2641857210
66	23/04/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	31.771,70	0,00	14.027,50639100	2,2649570860
60	24/04/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	55.000,00	24.280,55560400	2,2651870450
67	27/04/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.422.796,96	0,00	628.183,21697200	2,2649394660
72	29/04/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	3.465.054,49	1.158.746,62396200	2,9903470000
68	30/04/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	9.230,81	0,00	4.071,91274000	2,2669469090
69	30/04/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.174.972,80	518.306,27145900	2,2669469090
61	30/04/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	36.394,94	16.054,60624400	2,2669469090
73	04/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.821,27	1.244,40370000	2,2671661930
74	05/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	320.000,00	141.140,23515800	2,2672485960
75	05/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.700.000,00	749.807,49927500	2,2672485960
76	06/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	28.225,74	0,00	12.446,75914300	2,2677180200
77	08/05/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	140.702,06	0,00	96.924,53341600	1,4516661060
78	08/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	7.646,87	0,00	3.370,65101800	2,2686620000
79	11/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.000,00	2.203,51630400	2,2691005240
80	11/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	9.737,59	0,00	4.291,38766500	2,2691005240
81	14/05/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	5.824.527,58	1.940.413,50469800	3,0016940000
82	15/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.000,00	2.643,38426400	2,2698175520
83	15/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	251.576,01	0,00	110.835,34435500	2,2698175520

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
84	15/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	22.028,20220300	2,2698175520
85	15/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	20.692,50	0,00	9.116,37148100	2,2698175520
86	20/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.228.008,24	0,00	1.861.933,77446400	2,2707618810
87	21/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	7.000,00	3.082,33807000	2,2710033230
88	21/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	11.086,56	0,00	4.881,78942200	2,2710033230
89	22/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	31.346,77	0,00	13.800,46896800	2,2714278820
90	25/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	22.011,52152100	2,2715376560
91	28/05/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	674.617,79	221.020,50369400	3,0522860000
92	29/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	21.999,82905000	2,2727449330
93	29/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.000.000,00	1.759.986,32399000	2,2727449330
94	29/05/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	11.376,86	0,00	5.005,77950200	2,2727449330
102	01/06/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	565,68	248,87126700	2,2729823570
103	02/06/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.533,85	674,74453300	2,2732307180
116	04/06/2020	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	2.699.277,39	880.938,46694601	3,0640930000
108	05/06/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	140.702,06	0,00	95.491,07251900	1,4734577410
96	05/06/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	746.378,63	0,00	328.190,55096100	2,2742233980
95	05/06/2020	BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	0,00	15.000.000,00	12.021.501,17614360	1,2477643000
110	05/06/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	60.000,00	26.382,63244200	2,2742233980
97	08/06/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	15.035.722,74	0,00	6.610.716,93398300	2,2744466130
104	15/06/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.910.000,00	2.597.036,20454200	2,2756710090
98	15/06/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	20.829,69	0,00	9.153,20796200	2,2756710090
111	15/06/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	21.971,54149400	2,2756710090
99	19/06/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.562.556,18	0,00	2.003.788,27572100	2,2769652040
112	19/06/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.000,00	1.317,54319100	2,2769652040
105	22/06/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.441.000,00	2.828.406,41235200	2,2772540650
113	22/06/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	55.000,00	24.151,89453200	2,2772540650
100	24/06/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	13.201,67	0,00	5.796,16382600	2,2776564630
106	25/06/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.000.000,00	438.988,37441700	2,2779646530
109	25/06/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.000.000,00	0,00	438.988,37441700	2,2779646530
114	25/06/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	21.949,41872100	2,2779646530

Carteira: DIADEMA

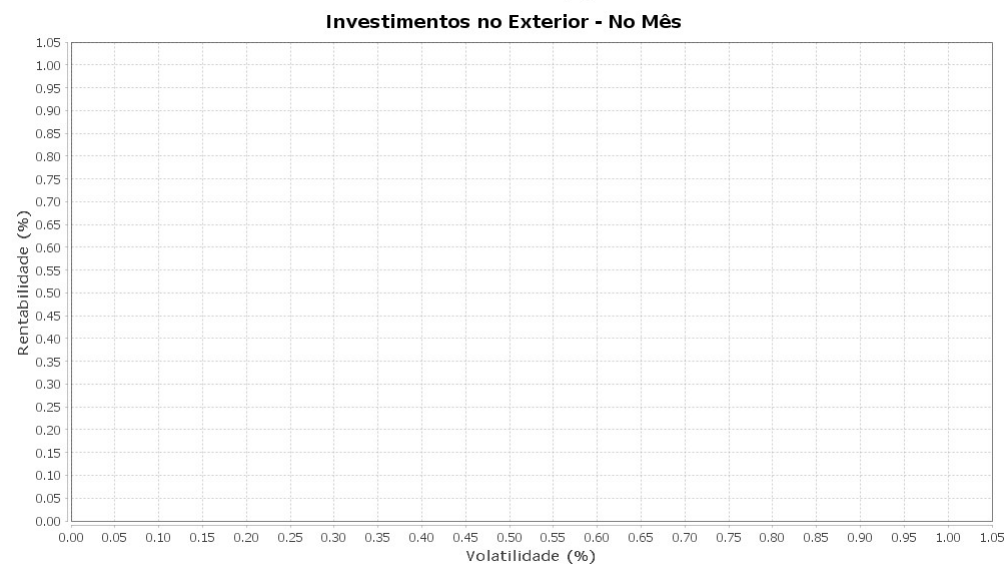
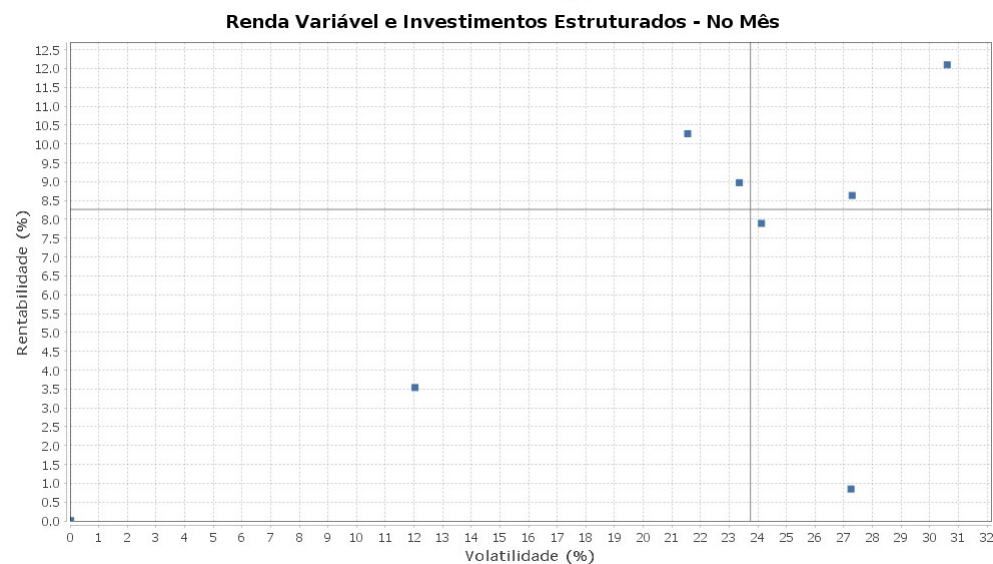
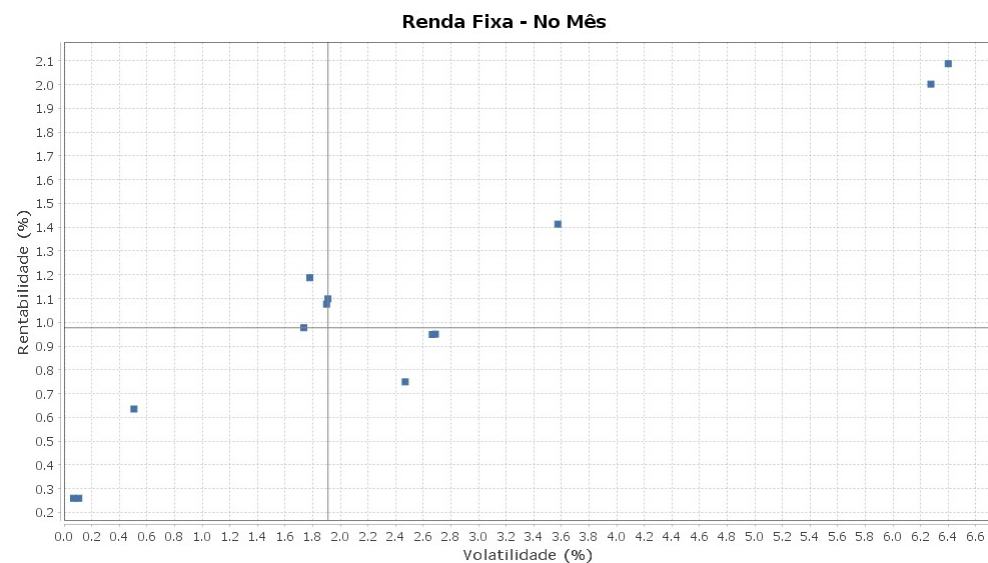
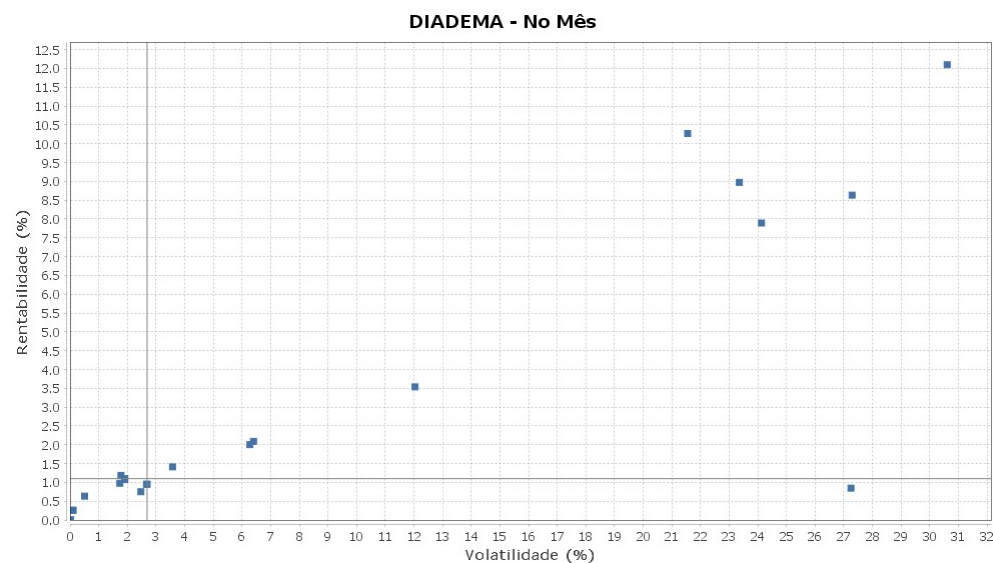
Data Extrato: 30/06/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
107	30/06/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.806.000,00	2.109.139,25758700	2,2786546610
101	30/06/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	13.164,08	0,00	5.777,12815600	2,2786546610
115	30/06/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	45.000,00	19.748,49492100	2,2786546610

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	Artigo 8º IV, Alínea b	0,02			-9,26	0,01	3.655.554,17	1,21
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,07			0,70	0,26	7.439.122,31	2,46
BRADERCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	Artigo 7º I, Alínea b	0,11			0,44	0,26	30.920,39	0,01
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	Artigo 7º VII, Alínea b	0,51			0,84	0,64	3.552.299,58	1,17
BB CRED PRIV III	Artigo 7º VII, Alínea b	1,74			0,44	0,98	9.621.051,49	3,18
BB PREV IPCA I	Artigo 7º I, Alínea b	1,78			0,55	1,19	16.719.612,34	5,52
SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TÍTULOS PUBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,90			0,45	1,08	2.067.555,07	0,68
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,91			0,46	1,10	0,00	0,00
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,47			0,22	0,75	35.778.366,53	11,82
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,67			0,28	0,95	46.321.228,71	15,30
BRADERCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	Artigo 7º IV, Alínea a	2,69			0,27	0,95	30.855.132,56	10,19
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,57			0,34	1,41	26.351.490,19	8,70
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,28			0,29	2,00	29.042.910,29	9,59
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	6,40			0,29	2,09	20.704.740,54	6,84
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	Artigo 8º IV, Alínea b	12,04			0,28	3,54	1.403.160,38	0,46
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	21,55			0,47	10,27	5.968.440,06	1,97
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	23,36			0,38	8,97	3.766.182,53	1,24
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	24,13			0,32	7,89	12.519.507,55	4,14
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	27,25			0,02	0,85	20.033.303,17	6,62
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	27,29			0,31	8,63	7.444.536,57	2,46
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	30,61			0,39	12,10	19.243.719,20	6,36

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

No respectivo mês de junho 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.