



LDB
EMPRESAS

DIADEMA
ABRIL 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 02.06.2020.

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

78,29%

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,53	0,41	1,78	30.719,28	0,01	900.254.306,47	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	4,95	0,47	-0,18	9.100.706,59	2,91	9.104.032.681,09	0,10
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FI	4,97	0,49	-0,12	2.002.923,69	0,64	1.142.331.144,38	0,18
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	12,31	1,26	-5,37	28.053.584,89	8,98	1.212.263.386,57	2,31
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RENDA FIXA	8,86	0,90	0,44	25.252.711,92	8,08	572.988.052,24	4,41
BB	BB	BB PREV IPCA I	5,03	0,46	0,08	16.183.916,14	5,18	491.315.041,18	3,29
BB	BB	BB PREV ALOC FIC	6,01	0,91	-0,28	45.120.194,10	14,44	10.512.346.440,60	0,43
CEF	CEF	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	6,00	1,11	2,43	35.029.206,84	11,21	11.368.843.034,79	0,31
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			6,92	0,93	-0,39	160.773.963,45	51,47		

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	12,82	1,36	-5,25	19.957.282,51	6,39	1.856.360.049,61	1,08
BB	BB	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,26	0,85	6.013.686,48	1,93	2.594.654.169,89	0,23
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	6,56	1,02	-0,30	44.983.516,44	14,40	1.194.562.049,15	3,77
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			8,02	1,14	-1,84	70.954.485,43	22,71		

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	4,40	0,43	-0,48	9.325.328,90	2,99	582.225.892,55	1,60
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	1,52	-1,29	-4,06	3.509.786,25	1,12	94.851.507,34	3,70
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			3,27	-0,05	-1,48	12.835.115,15	4,11		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

6,99

0,94

-0,84

244.563.564,03

78,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

21,71%

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	36,92	6,08	-29,98	10.965.626,05	3,51	1.392.329.916,92	0,79
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	44,95	11,39	-30,61	6.477.844,39	2,07	1.013.500.715,68	0,64
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	44,39	16,50	-24,62	4.908.092,56	1,57	1.653.659.615,37	0,30
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	40,28	10,22	-26,52	3.191.592,72	1,02	529.727.117,67	0,60
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	49,14	9,17	-41,59	15.723.198,29	5,03	1.465.473.198,75	1,07
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			43,63	9,56	-34,26	41.266.354,01	13,21		

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	31,44	11,77	-11,92	18.852.380,19	6,04	773.176.553,31	2,44
Sub-total Artigo 8º III			31,44	11,77	-11,92	18.852.380,19	6,04		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
PÁTRIA	PÁTRIA	PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FI EM PARTICIPAÇÕES	84,05	-0,15	-0,58	2.545.881,70	0,81	350.591.454,01	0,73
CEF	CEF	FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	159,81	-0,59	-1,88	225.092,13	0,07	22.192.914,31	1,01
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			80,99	-0,18	-0,69	2.770.973,83	0,89		

Artigo 8º IV, Alínea b (Fundos de Investimentos Imobiliários)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
RIO BRAVO	RIO BRAVO	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	18,51	1,63	-3,52	3.585.360,70	1,15	74.216.966,14	4,83
BRPP	GERAÇÃO FUTURO	BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	18,58	2,05	-19,88	1.344.952,86	0,43	239.299.392,83	0,56
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			18,93	1,75	-11,18	4.930.313,56	1,58		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável e Investimentos Estruturados	34,37	9,11	-26,68	67.820.021,59	21,71
Total				312.383.585,62	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	160.773.963,45	51,47	15,00	55,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	70.954.485,43	22,71	5,00	15,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	12.835.115,15	4,11	0,00	2,00	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	244.563.564,03	78,29				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	41.266.354,01	13,21	2,00	15,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	18.852.380,19	6,04	2,00	7,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	2.770.973,83	0,89	1,00	2,00	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	4.930.313,56	1,58	1,00	2,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	67.820.021,59	21,71				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

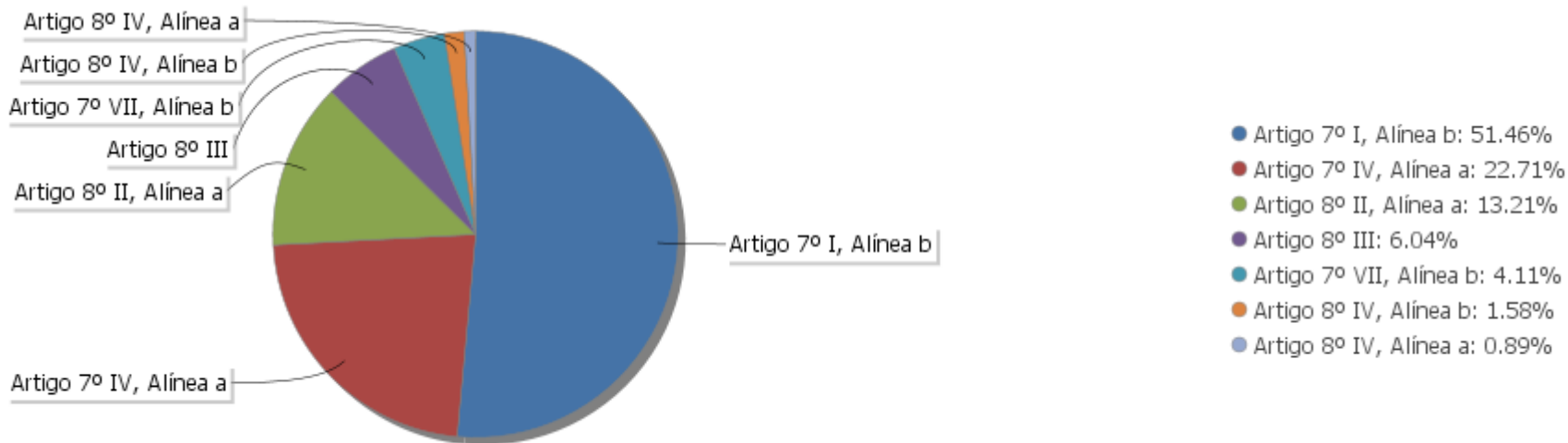
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,93 327,96	-0,39 -30,00	-0,97 -105,79	-0,12 -5,82	8,18 157,58	1.579.214,69	-852.840,00
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	1,14 398,64	-1,84 -141,32	-2,18 -237,51	-1,94 -93,96	5,91 113,79	736.204,48	-1.184.428,30
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	-0,05 -16,45	-1,48 -114,09	-2,18 -236,78	-0,74 -35,80	5,52 106,31	-6.020,20	-193.215,03
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	9,56 -0,69	-34,26 -3,87	-35,58 -6,35	-26,90 -1,99	-14,15 2,29	3.601.721,80	-21.502.694,44
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	11,77 1,52	-11,92 18,47	-12,24 16,99	-6,99 17,92	-3,53 12,92	1.985.818,38	-2.551.333,19
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,18 -10,44	-0,69 29,70	-0,51 28,72	-36,83 -11,92	-41,94 -25,49	-5.083,10	-19.226,84
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	1,75 -8,51	-11,18 19,20	-3,94 25,29	-7,96 16,95	1,30 17,75	84.865,36	-636.513,60
						7.976.721,41	-26.940.251,40

Análise de Liquidez

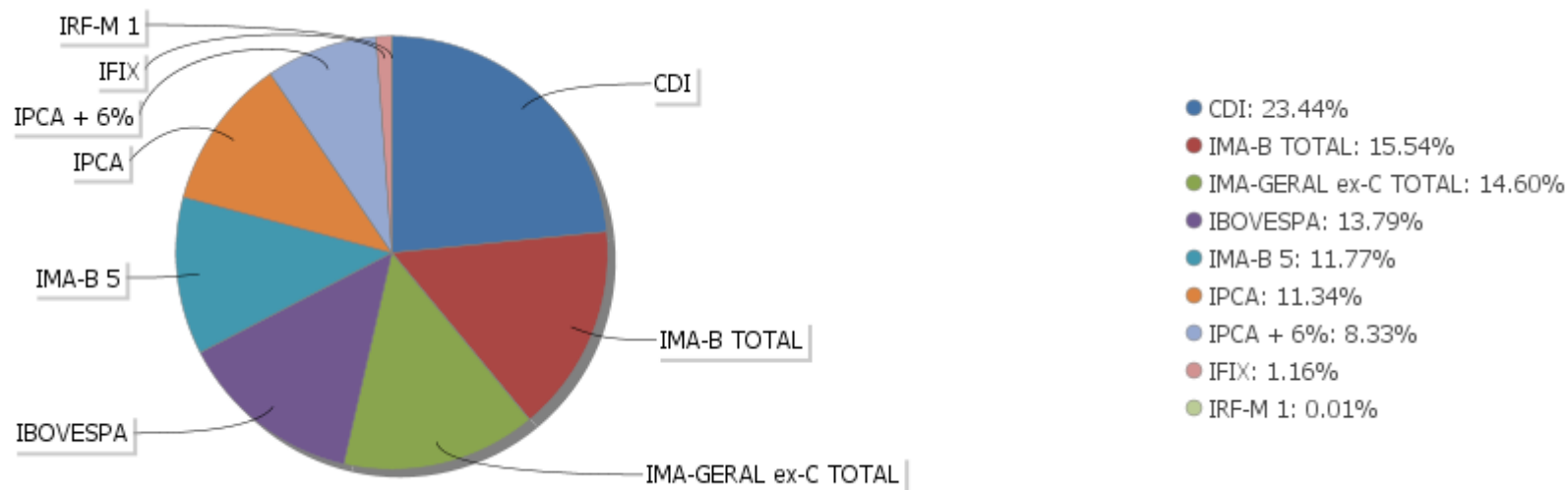
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	275.835.005,62	88,30	275.835.005,62	88,30
de 31 a 364 dias	7.453.974,26	2,39	283.288.979,88	90,69
acima de 365 dias	29.094.605,74	9,31	312.383.585,62	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

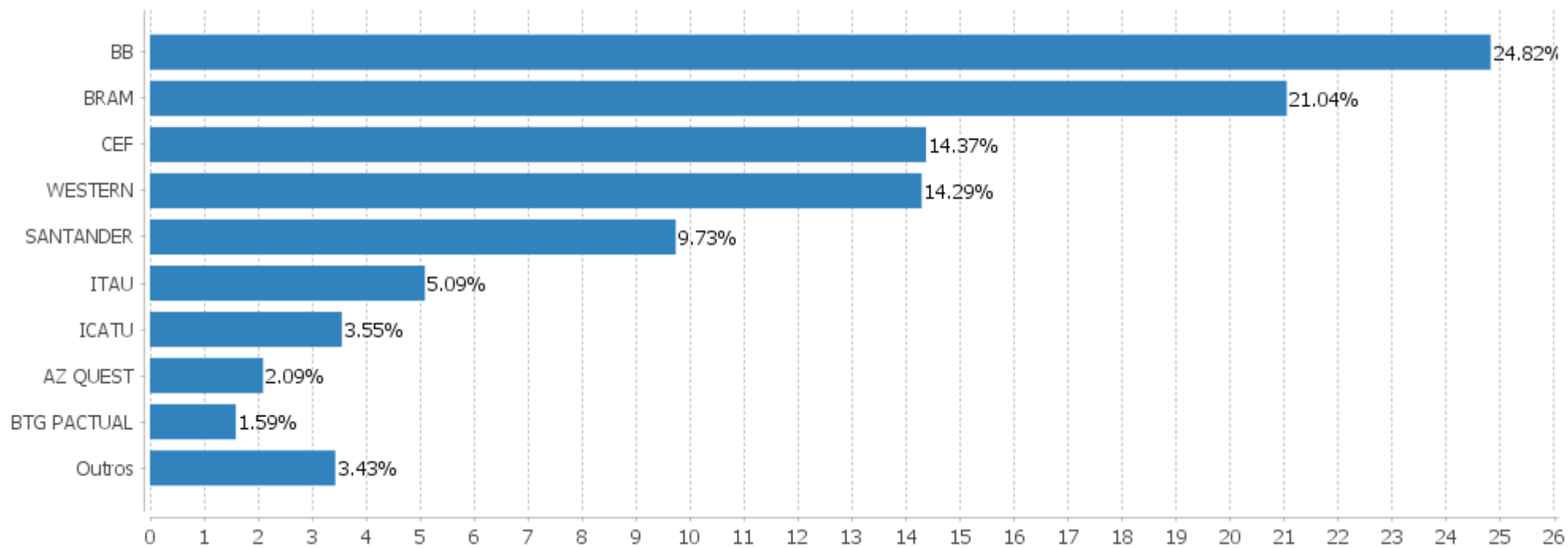


Alocação Por Estratégia



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									-7,60
IPCA + 5,88%	0,71	0,66	0,57	0,14									2,10
p.p. indexador	-0,06	-2,15	-9,71	2,43									-9,70
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

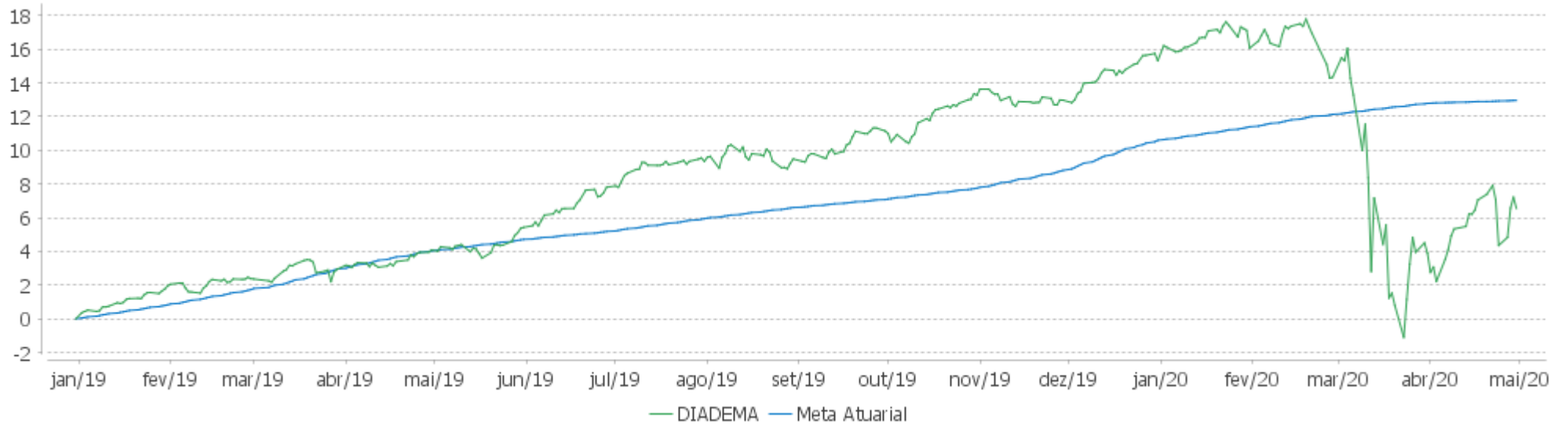
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

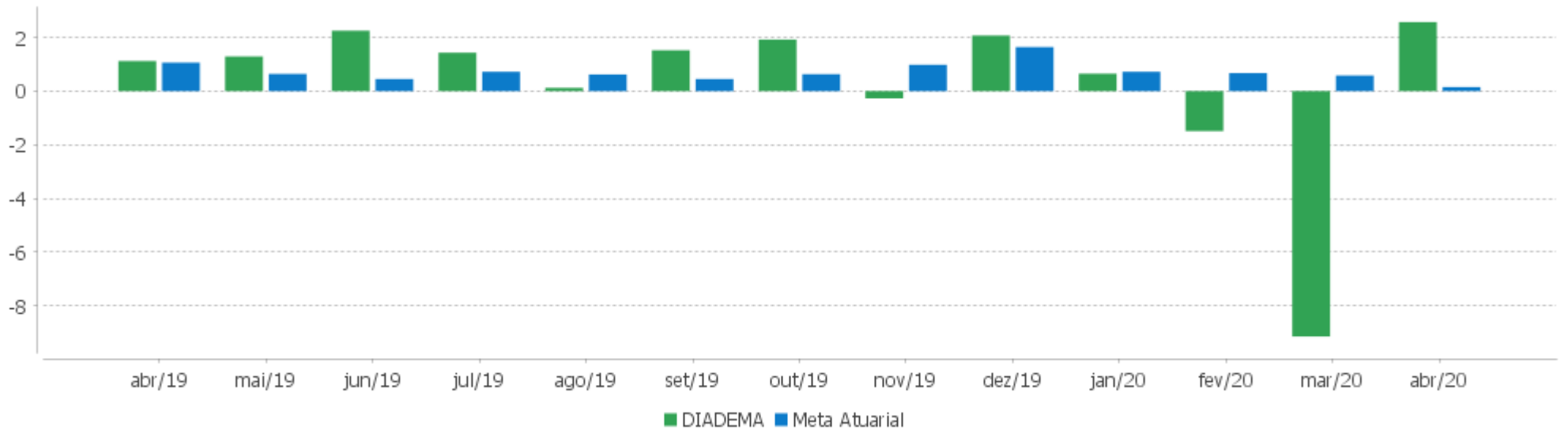
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	9	56,25	03 meses	-8,19	1,38	-9,57	23,66
Meses abaixo da Meta Atuarial	7	43,75	06 meses	-5,93	4,79	-10,72	16,78
			12 meses	2,37	8,53	-6,15	11,99
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,57	2020-04					
Menor rentabilidade da Carteira	-9,14	2020-03	Desde 31/12/2018	6,55	12,91	-6,36	10,51

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
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,36 0,05	-5,25 -0,17	-5,51 -0,18	-5,82 -0,27	8,68 -0,26	25,40 -0,51	39,14 -0,54
BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,26 90,62	0,85 65,42	0,50 54,23	1,55 75,16	4,55 87,67	11,05 93,13	20,15 96,28
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA % do CDI	1,02 359,05	-0,30 -23,04	-0,73 -78,84	-0,40 -19,23	8,12 156,46	18,37 154,80	
BB CRED PRIV III Var. IPCA + 6% p.p.	0,43 0,28	-0,48 -2,62	-1,30 -2,71	0,43 -4,40	7,30 -1,27	18,83 -1,89	34,25 2,82
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	-1,29	-4,06	-4,43	-3,71	-1,06	5,65	14,64
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RENDA FIXA Var. IMA-B 5 p.p.	0,90 0,41	0,44 0,53	-0,46 0,18	0,82 -0,04	11,43 2,76	23,76 4,30	40,15 6,77
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B 5 p.p.	0,47 -0,02	-0,18 -0,09	-0,72 -0,08	0,68 -0,18	8,37 -0,30	18,91 -0,56	32,52 -0,86
SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,49 -0,00	-0,12 -0,03	-0,66 -0,01	0,79 -0,07	8,47 -0,20	19,01 -0,46	32,61 -0,77
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6% p.p.	0,46 0,31	0,08 -2,05	-0,55 -1,96	0,88 -3,95	9,27 0,71	20,67 -0,04	36,11 4,68
BB PREV ALOC FIC Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,91 0,07	-0,28 -0,10	-0,76 -0,09	-0,26 -0,29	8,60 0,26	19,45 0,41	31,58 -0,29
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,41 -0,03	1,78 -0,11	1,35 -0,08	2,49 -0,16	6,30 -0,31	13,10 -0,62	23,01 -0,88
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF Var. IPCA p.p.	1,11 1,42	2,43 2,22	1,60 1,59	2,52 0,63	13,47 11,07	24,61 17,15	36,68 26,25
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,26 -0,06	-5,37 -0,29	-5,60 -0,27	-5,88 -0,33	8,37 -0,56	24,95 -0,96	38,35 -1,33
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	11,77 4.132,19	-11,92 -916,99	-12,24 -1.330,94	-6,15 -297,51	-1,79 -34,38	14,06 118,49	34,29 163,86
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	16,50 6,25	-24,62 5,77	-26,12 3,11	-19,00 5,92	-3,08 13,36	16,44 22,96	48,43 25,34
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	9,17 -1,08	-41,59 -11,20	-42,43 -13,20	-33,70 -8,78	-23,73 -7,28	-10,30 -3,79	19,90 -3,20
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	11,39 1,13	-30,61 -0,23	-34,95 -5,72	-19,91 5,00	-0,36 16,09	13,81 20,32	59,50 36,41

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	10,22 -0,04	-26,52 3,86	-27,22 2,02	-22,00 2,91	-8,12 8,33	5,15 11,66	42,09 19,00
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	6,08 -4,18	-29,98 0,41	-30,41 -1,18	-24,37 0,54	-11,75 4,69	9,04 15,56	36,68 13,59
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO Var. IFIX p.p.	0,74 -3,65	-3,52 15,06	-2,21 13,19	-13,27 -6,53	-20,30 -24,10	-26,94 -38,34	-20,33 -48,22
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11 Var. IBOVESPA p.p.	1,48 -8,77	-19,88 10,51	-15,80 13,43	-10,77 14,15	-7,03 9,42	-15,81 -9,29	-1,47 -24,56
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA Var. IPCA + 6% p.p.	-0,59 -0,74	-1,88 -4,02	-1,46 -2,86	-2,80 -7,63	-67,94 -76,51	-68,34 -89,05	-68,77 -100,20
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FI EM PARTICIPAÇÕES % do CDI	-0,15 -51,64	-0,58 -44,78	-0,43 -46,67	-38,73 -1.874,48	-39,07 -752,53	-38,38 -323,47	-37,40 -178,72
CDI	0,28	1,30	0,92	2,07	5,19	11,87	20,93
IBOVESPA	10,25	-30,39	-29,23	-24,92	-16,45	-6,51	23,09
INPC + 6%	0,23	2,23	1,52	5,03	8,63	20,94	30,30
IPCA + 6%	0,15	2,14	1,41	4,83	8,57	20,71	31,43

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Renda Fixa							
IRF-M 1	0,45	1,88	1,44	2,65	6,60	13,72	23,89
IRF-M 1+	1,50	2,96	1,83	2,84	13,92	25,80	43,65
IRF-M TOTAL	1,15	2,59	1,70	2,75	11,69	22,07	37,69
IMA-B 5	0,49	-0,09	-0,64	0,86	8,67	19,47	33,38
IMA-B 5+	2,01	-8,82	-8,85	-10,25	8,47	30,32	43,94
IMA-B TOTAL	1,31	-5,08	-5,33	-5,55	8,94	25,91	39,68
IMA-C TOTAL	1,39	0,93	-1,57	0,17	12,99	32,94	49,94
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,84	-0,17	-0,67	0,03	8,34	19,04	31,87
IMA-GERAL TOTAL	0,86	-0,14	-0,69	0,03	8,47	19,43	32,35
IDKA 2	0,57	0,57	0,03	1,79	8,62	18,84	33,46
IDKA 20	1,77	-16,22	-15,05	-18,15	5,61	37,31	48,42
CDI	0,28	1,30	0,92	2,07	5,19	11,87	20,93
Renda Variável							
IBOVESPA	10,25	-30,39	-29,23	-24,92	-16,45	-6,51	23,09
IBRX 100	10,27	-30,14	-29,25	-24,33	-15,12	-4,14	25,76
IBRX 50	10,48	-31,05	-29,73	-25,91	-18,39	-9,72	19,28
SMALL CAP	10,19	-34,07	-34,37	-21,91	-4,59	5,90	40,30
IFIX	4,39	-18,58	-15,39	-6,75	3,79	11,40	27,89
Índice Consumo - ICON	17,67	-24,81	-27,47	-16,35	1,02	9,88	26,19
Índice Dividendos - IDIV	3,76	-28,65	-27,50	-19,68	-7,18	10,38	30,76
Indicadores Econômicos							
IPCA	-0,31	0,22	0,01	1,89	2,40	7,46	10,43
INPC	-0,23	0,31	0,12	2,08	2,46	7,66	9,48
IGPM	0,80	2,50	2,01	4,95	6,69	15,93	18,12
SELIC	0,28	1,30	0,92	2,07	5,19	11,87	20,94
Meta Atuarial							
IPCA + 4%	0,00	1,51	0,95	3,86	6,51	16,21	24,16

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IPCA + 5%	0,08	1,82	1,18	4,34	7,54	18,45	27,76
IPCA + 5,5%	0,11	1,98	1,29	4,59	8,05	19,58	29,59
IPCA + 5,89%	0,14	2,10	1,38	4,78	8,45	20,46	31,02
IPCA + 6%	0,15	2,14	1,41	4,83	8,57	20,71	31,43
INPC + 4%	0,08	1,60	1,06	4,05	6,57	16,43	23,09
INPC + 6%	0,23	2,23	1,52	5,03	8,63	20,94	30,30

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

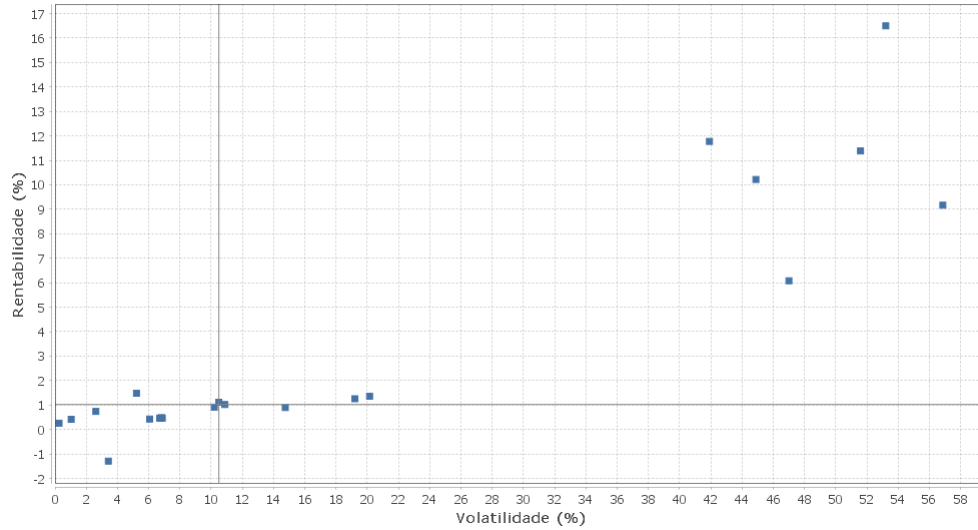
Movimentações

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
03/04/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	943.453,76	417.279,68598700	2,2609625910
03/04/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	70.000,00	30.960,26457000	2,2609625910
09/04/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	990.000,00	437.892,32711400	2,2608297490
14/04/2020	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	0,00	5.735.880,01	1.901.641,06515300	3,0162790000
15/04/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	89.272,01	0,00	39.471,33450200	2,2616922160
15/04/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	22.107,34053300	2,2616922160
16/04/2020	BB PREV ALOC FIC	140.702,06	0,00	96.663,10558200	1,4555921740
20/04/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	3.077.338,79	0,00	1.359.502,81999100	2,2635766140
22/04/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.830.194,68	808.323,56773000	2,2641857210
22/04/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.830.000,00	0,00	808.237,58538300	2,2641857210
23/04/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	31.771,70	0,00	14.027,50639100	2,2649570860
24/04/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	55.000,00	24.280,55560400	2,2651870450
27/04/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.422.796,96	0,00	628.183,21697200	2,2649394660
29/04/2020	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	0,00	3.465.054,49	1.158.746,62396200	2,9903470000
30/04/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	9.230,81	0,00	4.071,91274000	2,2669469090
30/04/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.174.972,80	518.306,27145900	2,2669469090
30/04/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	36.394,94	16.054,60624400	2,2669469090

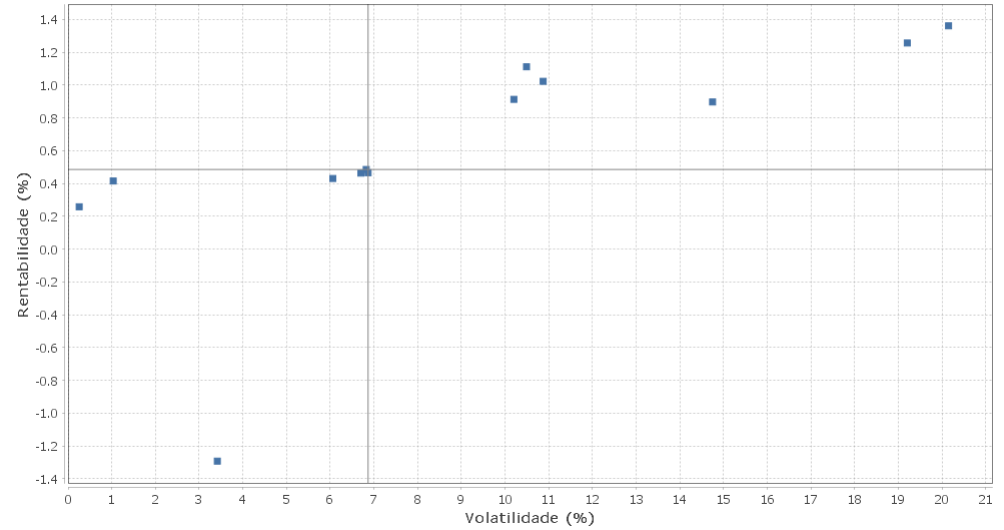
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

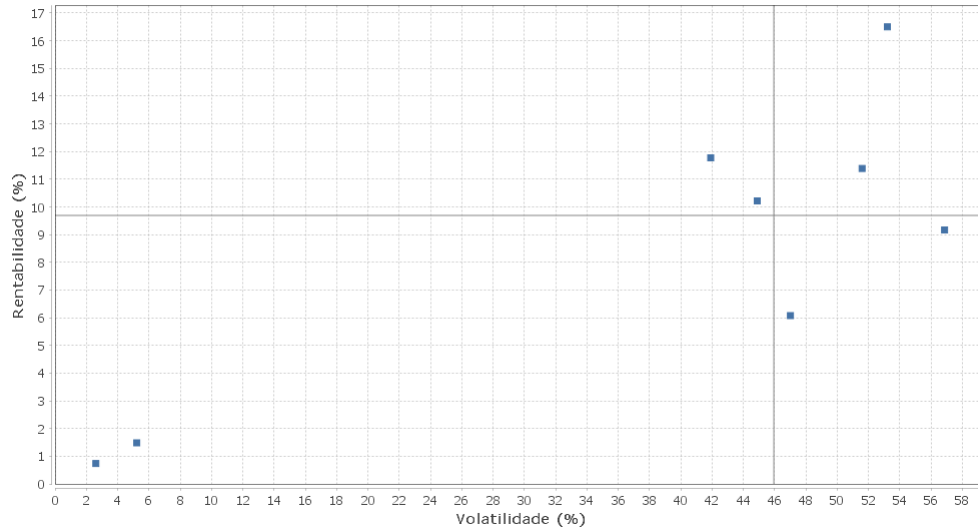
DIADEMA - No Mês



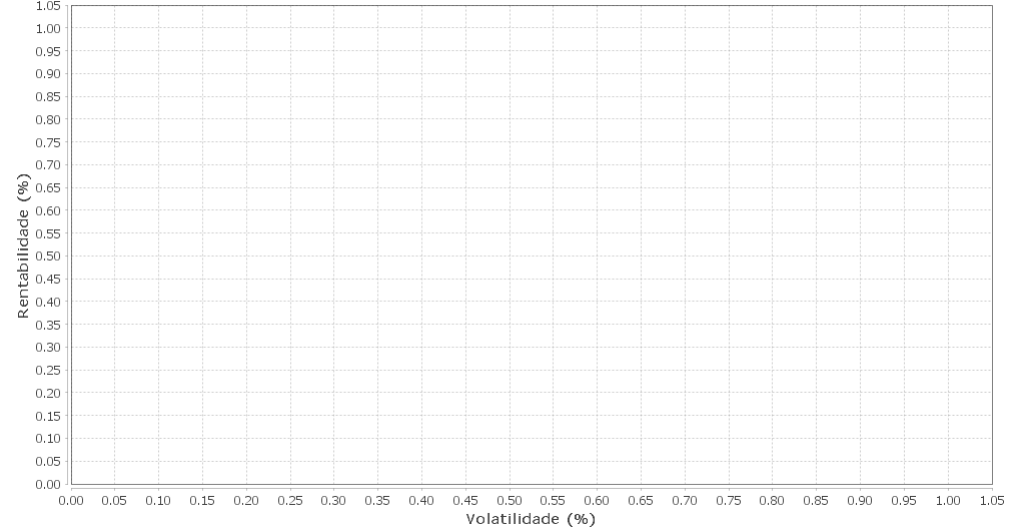
Renda Fixa - No Mês



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	0,25	0,04	0,26	6.013.686,48	1,93
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	Artigo 7º I, Alínea b	1,03	0,13	0,41	30.719,28	0,01
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	Artigo 8º IV, Alínea b	2,61	0,31	0,74	3.585.360,70	1,15
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	Artigo 7º VII, Alínea b	3,42	0,29	-1,29	3.509.786,25	1,12
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11	Artigo 8º IV, Alínea b	5,22	0,61	1,48	1.344.952,86	0,43
BB CRED PRIV III	Artigo 7º VII, Alínea b	6,06	0,65	0,43	9.325.328,90	2,99
BB PREV IPCA I	Artigo 7º I, Alínea b	6,70	0,72	0,46	16.183.916,14	5,18
SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FI	Artigo 7º I, Alínea b	6,82	0,73	0,49	2.002.923,69	0,64
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	6,87	0,73	0,47	9.100.706,59	2,91
BB PREV ALOC FIC	Artigo 7º I, Alínea b	10,20	1,10	0,91	45.120.194,10	14,44
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	10,49	1,14	1,11	35.029.206,84	11,21
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	Artigo 7º IV, Alínea a	10,87	1,18	1,02	44.983.516,44	14,40
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RENDA FIXA	Artigo 7º I, Alínea b	14,75	1,57	0,90	25.252.711,92	8,08
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	19,20	2,05	1,26	28.053.584,89	8,98
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	20,15	2,16	1,36	19.957.282,51	6,39
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	41,91	4,90	11,77	18.852.380,19	6,04
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	44,89	5,14	10,22	3.191.592,72	1,02
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	47,00	5,17	6,08	10.965.626,05	3,51
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	51,59	5,88	11,39	6.477.844,39	2,07
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	53,21	6,28	16,50	4.908.092,56	1,57
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	56,86	6,33	9,17	15.723.198,29	5,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

No respectivo mês de abril de 2020, observar que:

- O percentual alocado no Artigo 8, Inciso IV, Alínea A (0,89% dos recursos) está inferior ao limite mínimo estipulado em Política de Investimentos.