



LDB
EMPRESAS

DIADEMA
AGOSTO 2020



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações relevantes para a análise 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 não constituem recomendações de investimentos sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis no mercado e consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos, elas podem ser 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 29.10.2023.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas físicas ou jurídicas da CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários.

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

REDA FIXA

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,54	0,10	2,76	31.017,24	0,01
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TÍTULOS PUBLICOS RF	4,97	0,40	4,52	2.095.974,40	0,72
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	12,59	-1,82	0,38	29.756.869,48	10,15
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	9,03	-0,30	6,37	26.744.811,11	9,12
BB	BB	BB PREV IPCA I	4,95	0,83	5,08	16.568.585,49	5,65
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,12	-0,89	2,63	47.090.917,11	16,07
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,93	-0,56	5,06	35.926.738,84	12,26
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			7,11	-0,69	3,78	158.214.913,67	53,98

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	13,11	-1,83	0,82	21.234.558,40	7,24
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,18	1,79	15.215.144,25	5,19
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FIC FI RF ALOCAAO DINAMICA	6,70	-0,86	2,63	7.074.816,71	2,41
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			8,24	-1,05	1,88	43.524.519,36	14,85

Artigo 7º VII, Alínea b (Fundos Renda Fixa "Crédito Privado")

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
BB	BB	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4,46	0,49	4,20	9.763.317,59	3,33
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	1,56	0,56	-1,40	3.606.759,93	1,23
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			3,29	0,51	2,62	13.370.077,52	4,56
Renda Fixa			7,18	-0,70	3,20	215.109.510,55	73,39

Carteira: DIADEMA

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	38,97	-4,49	-20,32	12.478.340,46	4,26	1.
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	45,67	-3,21	-11,93	8.221.422,38	2,80	1.
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	45,11	-0,43	-1,08	6.440.405,68	2,20	2.
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	40,94	-2,24	-6,84	4.046.382,04	1,38	
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	51,42	-3,92	-27,34	19.560.298,28	6,67	1.
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			45,11	-3,39	-19,15	50.746.848,84	17,31	

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	32,04	6,92	5,71	22.625.928,35	7,72	1.
Sub-total Artigo 8º III			32,04	6,92	5,71	22.625.928,35	7,72	

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	
PÁTRIA	PÁTRIA	PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FI EM PARTICIPAÇÕES	546,25	-0,65	-99,56	11.313,92	0,00	
CEF	CEF	FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	159,47	-0,35	-9,83	206.859,12	0,07	
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			264,89	-0,37	-92,18	218.173,04	0,07	

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	
RIO BRAVO	RIO BRAVO	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	27,73	-17,09	-24,89	3.044.700,38	1,04	
BRPP	GERAÇÃO FUTURO	BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	19,17	1,51	-18,36	1.370.454,78	0,47	
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			20,34	-12,09	-18,54	4.415.155,16	1,51	

Carteira: DIADEMA

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável e Investimentos Estruturados	35,81	-1,17	-15,54	78.006.105,39	26,61
Total	12,45	-0,83	-1,50	293.115.615,94	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

				Política de Investimentos		
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo
Renda Fixa						
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	158.214.913,67	53,98	15,00	55,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	43.524.519,36	14,85	5,00	15,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	13.370.077,52	4,56	0,00	2,00	5,00
	Total Renda Fixa	215.109.510,55	73,39			
Renda Variável e Investimentos Estruturados						
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	50.746.848,84	17,31	2,00	15,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	22.625.928,35	7,72	2,00	7,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	218.173,04	0,07	1,00	2,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	4.415.155,16	1,51	1,00	2,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	78.006.105,39	26,61			

Carteira: DIADEMA

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

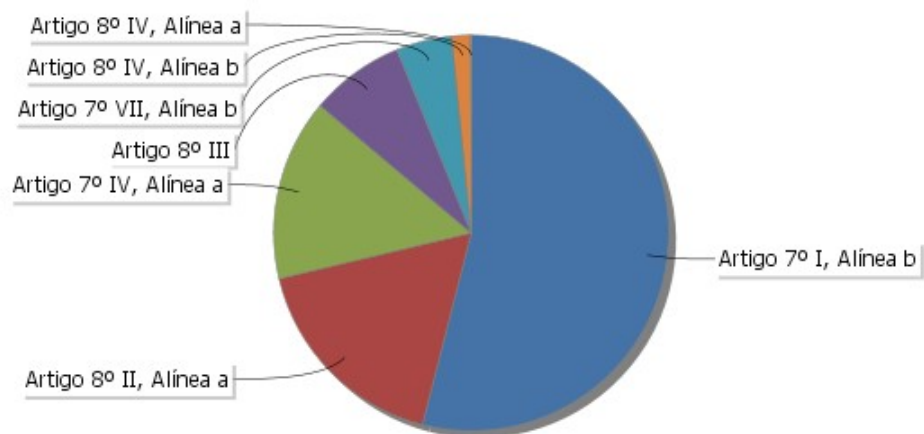
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,69 -433,62	3,78 178,67	2,46 433,91	2,55 177,61	7,94 205,79	-1.108.072,68
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-1,05 -656,67	1,88 88,79	2,59 456,10	1,11 77,60	5,85 151,53	-553.423,94
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,51 318,01	2,62 124,02	2,39 421,26	1,64 114,69	5,93 153,75	67.639,57
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-3,39 0,05	-19,15 -5,08	14,06 0,37	-13,87 -9,26	-8,07 -6,32	-1.779.853,47
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	6,92 10,36	5,71 19,78	13,90 0,21	13,87 18,48	14,86 16,61	1.464.158,73
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,37 3,07	-92,18 -78,11	-92,07 -105,76	-92,15 -87,54	-95,55 -93,80	-806,03
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-12,09 -8,64	-18,54 -4,47	-10,42 -24,11	-11,08 -6,47	-2,19 -0,44	-606.883,05
						-2.517.240,87

Análise de Liquidez

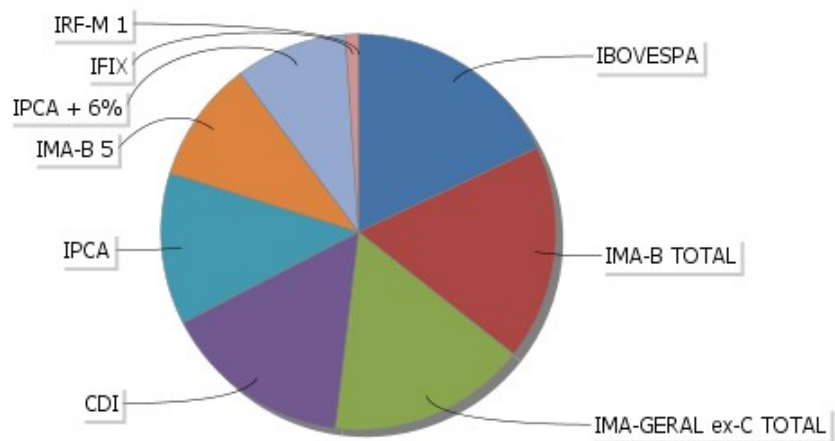
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)
de 0 a 30 dias	257.287.292,88	87,78	257.287.292,88
de 31 a 364 dias	6.451.719,60	2,20	263.739.012,48
acima de 365 dias	29.376.603,46	10,02	293.115.615,94

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

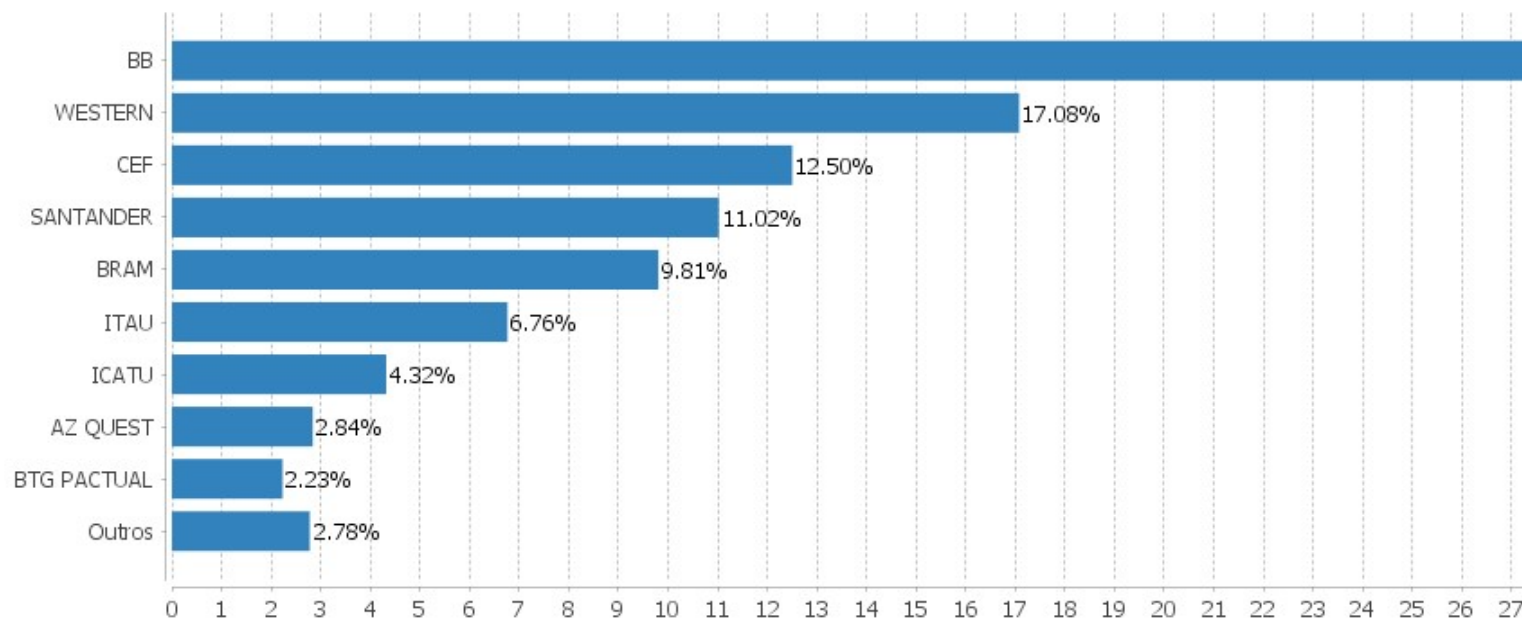


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: DIADEMA

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov
2020	0,65	-1,49	-9,14	2,57	2,61	1,62	3,08	-0,83			
IPCA + 5,88%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72			
p.p. indexador	-0,06	-2,15	-9,71	2,43	2,54	0,89	2,20	-1,55			
2019	1,96	0,42	0,53	1,12	1,29	2,25	1,43	0,12	1,52	1,92	-0,27
IPCA + 6%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98
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

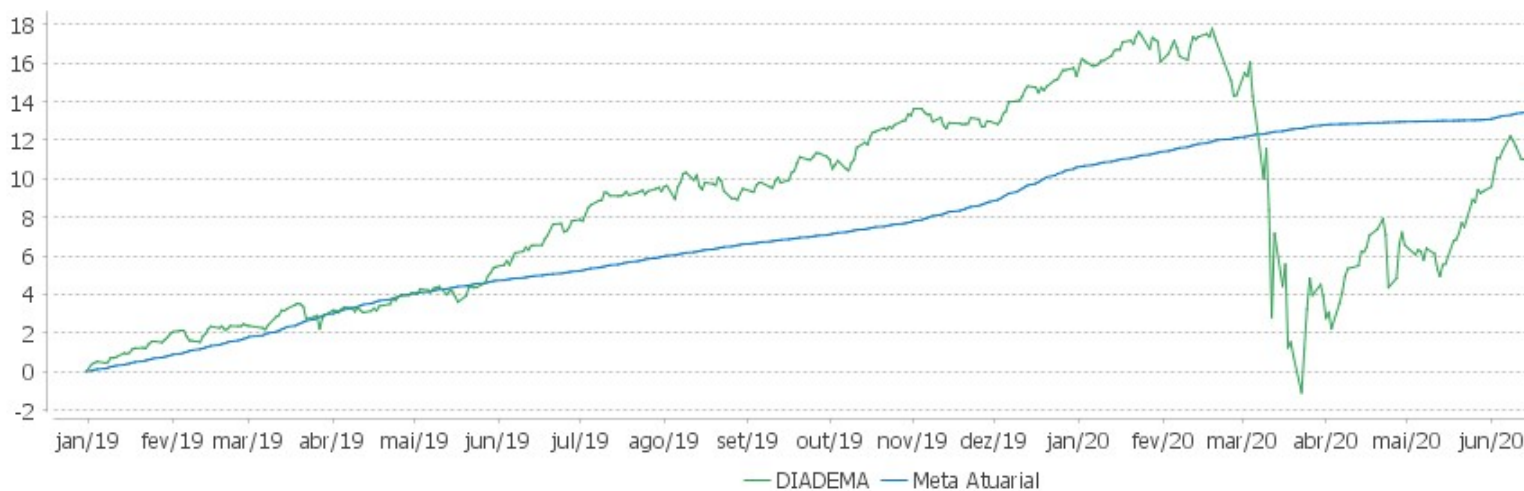
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

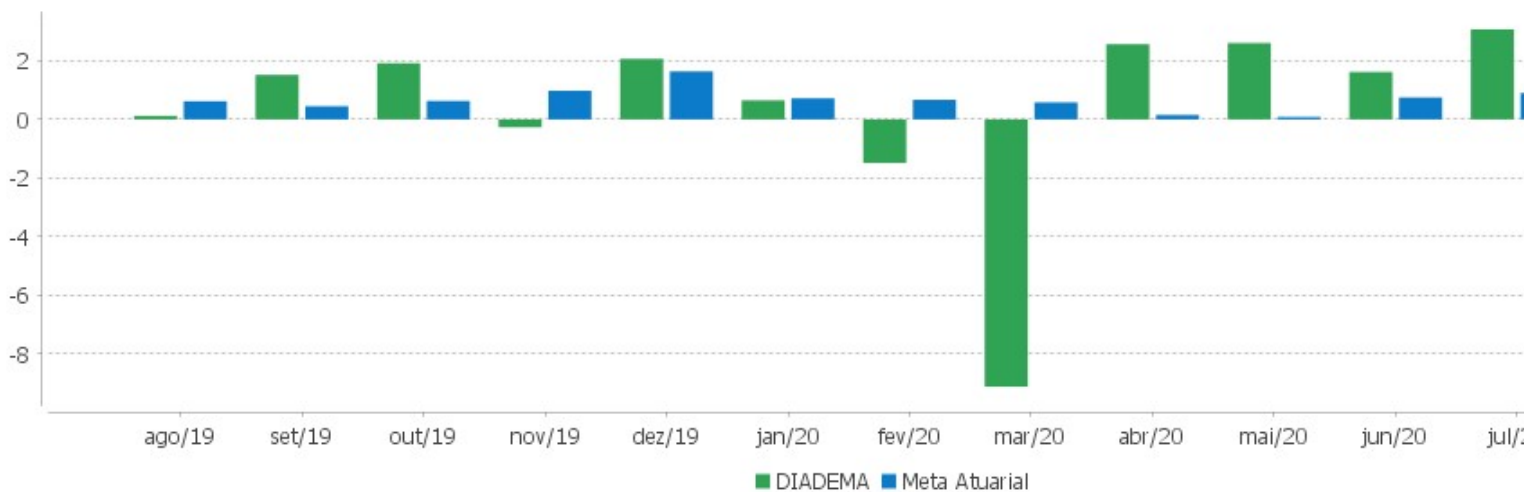
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Ind
Meses acima da Meta Atuarial	12	60,00	03 meses	3,89	2,36	1,53
Meses abaixo da Meta Atuarial	8	40,00	06 meses	-0,65	3,17	-3,82
			12 meses	3,75	8,50	-4,75
			24 meses			
			36 meses			
Maior rentabilidade da Carteira	3,08	2020-07				
Menor rentabilidade da Carteira	-9,14	2020-03	Desde 31/12/2018	13,59	15,66	-2,07

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
BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,83 -0,04	0,82 0,01	4,70 0,09	0,08 -0,01	6,70 0,06
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,18 113,33	1,79 84,85	0,68 119,59	1,16 81,13	3,42 88,51
BRABESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA % do CDI	-0,86 -537,87	2,63 124,22	1,79 315,75	1,79 124,97	6,03 156,22
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	-0,30 -0,72	6,37 1,74	2,93 0,37	4,35 0,96	11,74 2,50
SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TÍTULOS PUBLICOS RF Var. IMA-B 5 p.p.	0,40 -0,02	4,52 -0,11	2,47 -0,09	3,32 -0,08	9,04 -0,20
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6% p.p.	0,83 0,10	5,08 0,41	2,83 0,44	3,65 0,43	9,61 1,03
BRABESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,10 -0,02	2,76 -0,20	0,57 -0,07	1,97 -0,15	4,76 -0,30
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,89 -0,21	2,63 -0,06	1,82 -0,06	1,67 -0,06	6,05 -0,11
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,56 -0,80	5,06 4,36	1,17 0,30	3,57 3,33	9,21 6,77
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,82 -0,03	0,38 -0,43	4,51 -0,10	-0,29 -0,38	6,10 -0,54
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6% p.p.	0,49 -0,24	4,20 -0,47	2,47 0,08	3,01 -0,22	8,50 -0,09
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	0,56	-1,40	2,18	-1,87	-0,43
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA Var. IPCA + 6% p.p.	-0,35 -1,08	-9,83 -14,50	-1,53 -3,92	-9,04 -12,26	-74,68 -83,26
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FI EM PARTICIPAÇÕES % do CDI	-0,65 -406,87	-99,56 -4.706,93	-99,55 -17.538,92	-99,56 -6.942,35	-99,73 -2.583,51
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO Var. IFIX p.p.	-17,59 -19,38	-24,89 -11,90	-16,28 -20,96	-15,94 -9,81	-24,57 -29,29
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11 Var. IBOVESPA p.p.	0,95 4,40	-18,36 -4,28	1,12 -12,57	-10,43 -5,82	-5,61 -3,86
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-0,43 3,01	-1,08 12,99	18,99 5,30	4,39 9,00	10,14 11,89

Carteira: DIADEMA

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	-3,92 -0,48	-27,34 -13,26	13,94 0,25	-21,07 -16,46	-17,17 -15,43
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,21 0,23	-11,93 2,14	19,97 6,28	-11,99 -7,38	6,13 7,87
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,24 1,20	-6,84 7,23	17,08 3,39	1,98 6,60	0,61 2,36
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-4,49 -1,05	-20,32 -6,25	7,54 -6,15	-14,85 -10,24	-10,03 -8,28
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	6,92 4.327,20	5,71 269,97	13,90 2.448,48	13,87 967,00	17,58 455,37
CDI	0,16	2,12	0,57	1,43	3,86
IBOVESPA	-3,44	-14,07	13,69	-4,61	-1,75
INPC + 6%	0,85	5,15	2,64	3,80	9,12
IPCA + 6%	0,73	4,66	2,39	3,22	8,58

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

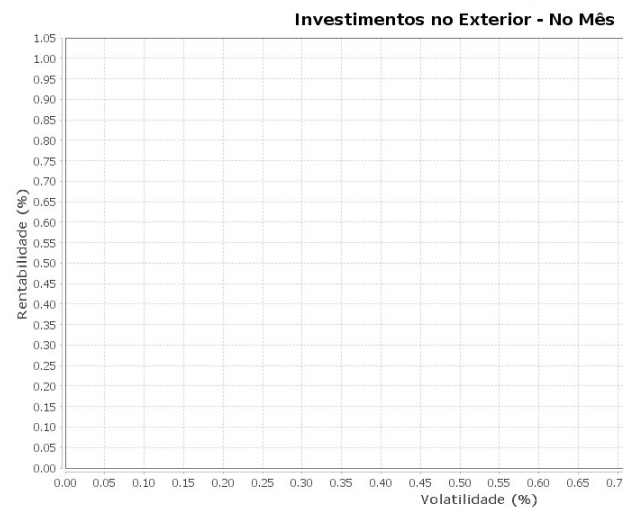
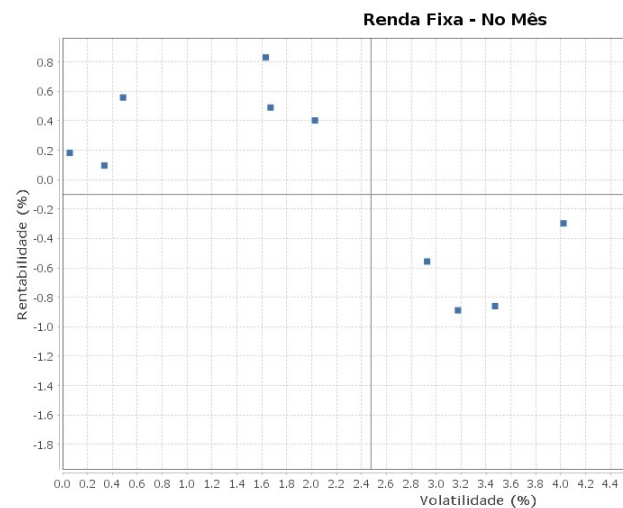
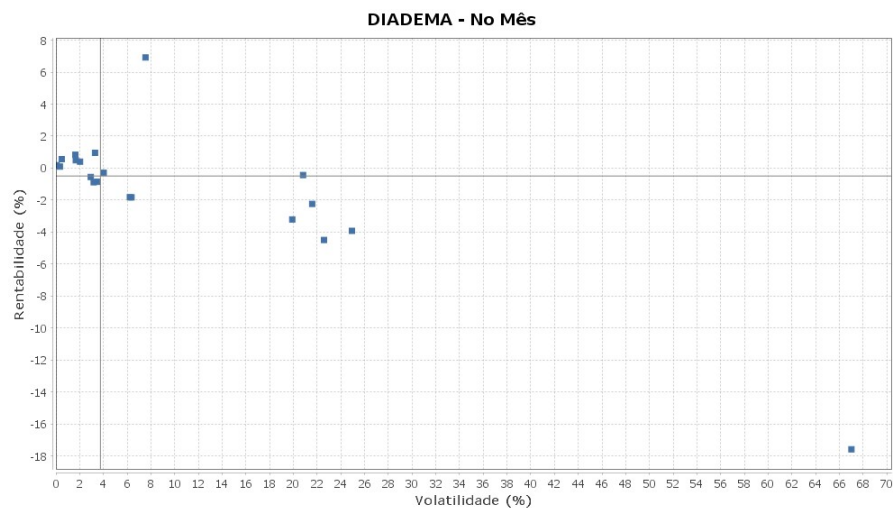
Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses
Renda Fixa						
IRF-M 1	0,12	2,96	0,64	2,12	5,06	12,83
IRF-M 1+	-1,13	6,37	1,36	4,37	10,64	33,26
IRF-M TOTAL	-0,75	5,20	1,11	3,62	8,70	26,82
IMA-B 5	0,43	4,63	2,55	3,39	9,24	25,01
IMA-B 5+	-3,62	-2,01	6,38	-2,35	4,71	44,71
IMA-B TOTAL	-1,80	0,80	4,61	0,09	6,64	36,00
IMA-C TOTAL	2,11	14,41	10,45	10,88	18,54	46,32
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,68	2,69	1,88	1,72	6,16	22,72
IMA-GERAL TOTAL	-0,60	3,02	2,13	1,99	6,51	23,37
IDKA 2	1,03	5,39	2,99	4,11	9,71	23,52
IDKA 20	-6,22	-7,86	9,49	-6,50	-0,24	59,80
CDI	0,16	2,12	0,57	1,43	3,86	10,38
Renda Variável						
IBOVESPA	-3,44	-14,07	13,69	-4,61	-1,75	29,59
IBRX 100	-3,38	-13,46	14,15	-4,51	-1,12	33,35
IBRX 50	-3,42	-14,10	14,20	-4,15	-2,18	26,25
SMALL CAP	-1,23	-14,27	23,76	-6,96	6,02	60,17
IFIX	1,79	-12,99	4,68	-6,13	4,72	30,04
Índice Consumo - ICON	-1,48	-5,53	16,72	1,26	5,75	60,13
Índice Dividendos - IDIV	-4,83	-17,25	10,46	-10,38	-3,64	44,78
Indicadores Econômicos						
IPCA	0,24	0,70	0,86	0,24	2,44	5,95
INPC	0,36	1,16	1,10	0,80	2,94	6,32
IGPM	2,74	9,64	6,67	9,17	13,02	18,62
SELIC	0,16	2,12	0,57	1,43	3,86	10,38
Meta Atuarial						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Qua
140	03/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	4.377,81
141	05/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	977.000,00	427.662,10
142	05/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	60.000,00	26.263,79
143	07/08/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	231.440,84	0,00	154.185,61
144	07/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	43.353,20	0,00	18.971,03
145	10/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	962.000,00	420.935,75
146	10/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	15.000,00	6.563,44
147	11/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.000.000,00	0,00	1.750.149,61
148	11/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.000.000,00	1.750.149,61
149	13/08/2020	BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	0,00	6.558.537,49	5.197.362,32
150	13/08/2020	BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	0,00	5.441.462,51	4.312.127,86
151	14/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.008.000,00	2.628.249,51
152	14/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	7.025.104,70	0,00	3.073.190,41
153	14/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	5.000.000,00	0,00	2.187.291,54
163	14/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	21.872,91
154	17/08/2020	BB PREV IPCA I	0,00	421.894,43	178.765,46
155	18/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	421.894,43	0,00	184.523,31
156	20/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.574.823,22	0,00	2.000.571,05
157	20/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	4.373,00
158	24/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	30.699,67	0,00	13.421,86
159	25/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	200.000,00	87.435,57
160	28/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.755.000,00	2.078.261,17
161	28/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	9.342,77	0,00	4.083,43
162	28/08/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	21.853,42

Risco - Dispersão



Carteira: DIADEMA

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,06	0,07	0,00	0,37	0,18
BRADERCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	Artigo 7º I, Alínea b	0,34	0,21	0,00	-0,19	0,10
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	Artigo 7º VII, Alínea b	0,49	0,51	0,00	0,82	0,56
BB PREV IPCA I	Artigo 7º I, Alínea b	1,63	1,09	0,03	0,41	0,83
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	Artigo 7º VII, Alínea b	1,67	1,09	0,02	0,20	0,49
SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TÍTULOS PUBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,03	1,09	0,01	0,12	0,40
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,93	1,39	0,12	-0,24	-0,56
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,17	1,37	0,17	-0,33	-0,89
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	Artigo 8º IV, Alínea b	3,29	0,15	-0,00	0,24	0,95
BRADERCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	Artigo 7º IV, Alínea a	3,47	1,51	0,03	-0,29	-0,86
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	4,02	2,28	0,14	-0,11	-0,30
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,22	3,11	0,25	-0,32	-1,82
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	6,36	3,22	0,18	-0,31	-1,83
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	7,54	11,45	0,48	0,90	6,92
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	19,91	13,73	0,33	-0,17	-3,21
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	20,82	12,70	0,25	-0,03	-0,43
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	21,58	12,09	0,16	-0,11	-2,24
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	22,58	12,71	0,51	-0,21	-4,49
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	24,93	16,56	1,04	-0,16	-3,92
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	Artigo 8º IV, Alínea b	67,01	0,73	0,00	-0,26	-17,59

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

No respectivo mês de agosto 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.