



LDB
EMPRESAS

DIADEMA
JUNHO 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 10.08.2020.

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

REDA FIXA

75,47%

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	0,26	2,44	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	2,25	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	3,10	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	-2,03	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	4,81	26.351.490,19	8,70	608.337.847,65	4,33
BB	BB	BB PREV IPCA I	4,98	1,19	3,40	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	1,75	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	4,63	35.778.366,53	11,82	12.211.119.756,17	0,29
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			7,03	1,20	2,50	156.312.083,52	51,63		

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	12,96	2,09	-1,70	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	1,37	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	1,78	30.855.132,56	10,19	1.185.458.143,51	2,60
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			8,15	1,26	0,56	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. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB CRED PRIV III	4,44	0,98	2,68	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	-2,89	3.552.299,58	1,17	93.068.742,14	3,82
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			3,27	0,88	1,11	13.173.351,07	4,35		

Renda Fixa			7,10	1,20	1,89	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. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	38,57	7,89	-20,06	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	-20,26	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	-8,33	5.968.440,06	1,97	2.091.503.187,63	0,29
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	40,84	8,97	-13,29	3.766.182,53	1,24	682.416.337,20	0,55
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	50,97	12,10	-28,51	19.243.719,20	6,36	1.785.775.187,89	1,08
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			44,85	10,00	-22,03	48.942.385,91	16,17		

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	32,56	0,85	-6,40	20.033.303,17	6,62	896.638.682,93	2,23
Sub-total Artigo 8º III			32,56	0,85	-6,40	20.033.303,17	6,62		

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	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	-8,88	209.042,71	0,07	20.489.283,34	1,02
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			264,40	-91,99	-92,10	220.532,91	0,07		

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	24,16	0,53	-10,27	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	-16,41	1.403.160,38	0,46	249.655.908,27	0,56
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			18,99	1,50	-7,70	5.058.714,55	1,67		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável e Investimentos Estruturados	35,51	3,00	-19,66	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

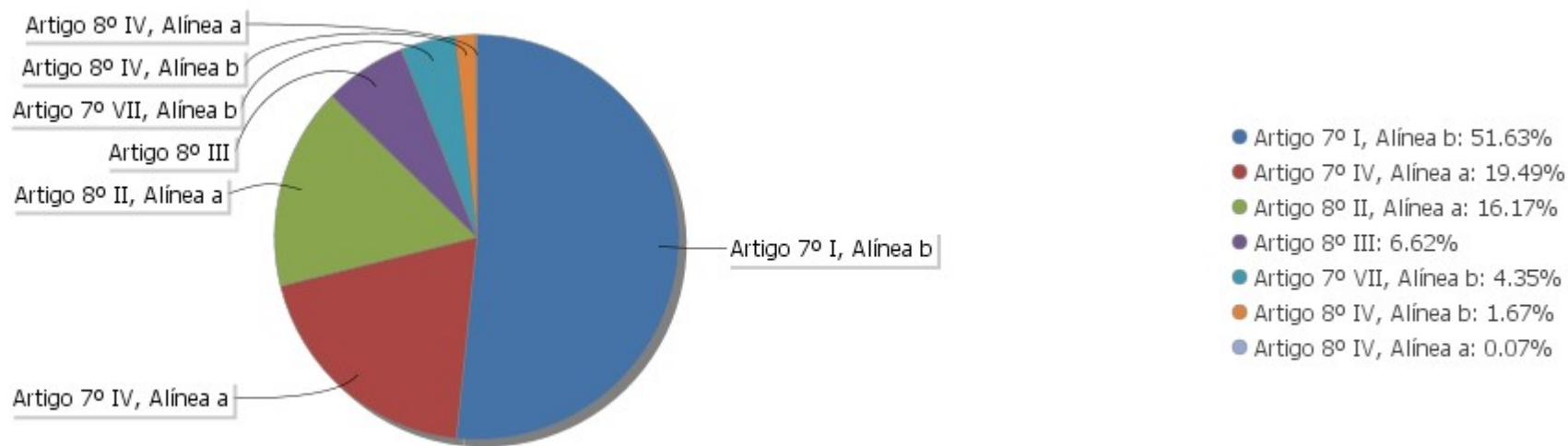
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,20 563,83	2,50 142,33	3,86 525,25	2,50 142,33	7,66 166,38	1.864.767,35	3.602.298,71
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	1,26 592,71	0,56 31,74	3,60 490,20	0,56 31,74	5,37 116,61	822.067,97	481.452,35
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,88 416,63	1,11 63,45	2,59 352,07	1,11 63,45	5,60 121,60	115.511,76	145.020,89
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	10,00 1,25	-22,03 -4,22	29,94 -0,24	-22,03 -4,22	-5,00 0,86	4.450.280,12	-13.826.662,54
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	0,85 -7,91	-6,40 11,40	18,78 -11,40	-6,40 11,40	2,08 7,93	168.244,54	-1.370.410,21
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-91,99 -100,74	-92,10 -74,29	-92,06 -122,23	-92,10 -74,29	-95,37 -89,52	-2.531.620,28	-2.569.667,76
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	1,50 -7,26	-7,70 10,10	5,73 -24,45	-7,70 10,10	1,15 7,00	74.655,86	-444.878,02
						4.963.907,32	-13.982.846,58

Análise de Liquidez

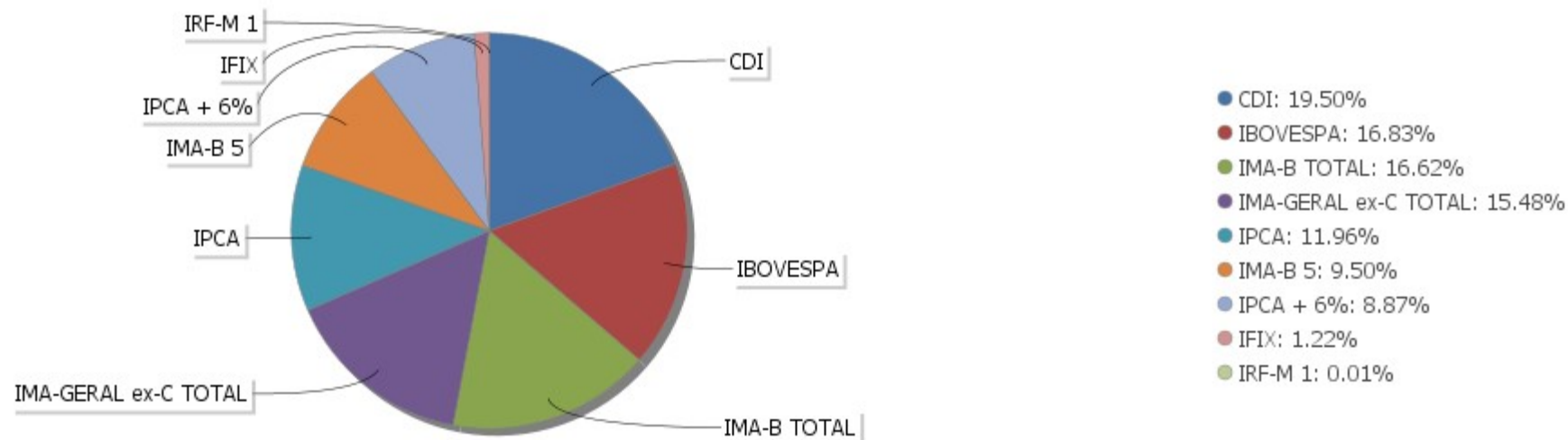
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	266.763.218,28	88,12	266.763.218,28	88,12
de 31 a 364 dias	5.979.930,26	1,98	272.743.148,54	90,09
acima de 365 dias	29.996.218,00	9,91	302.739.366,54	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

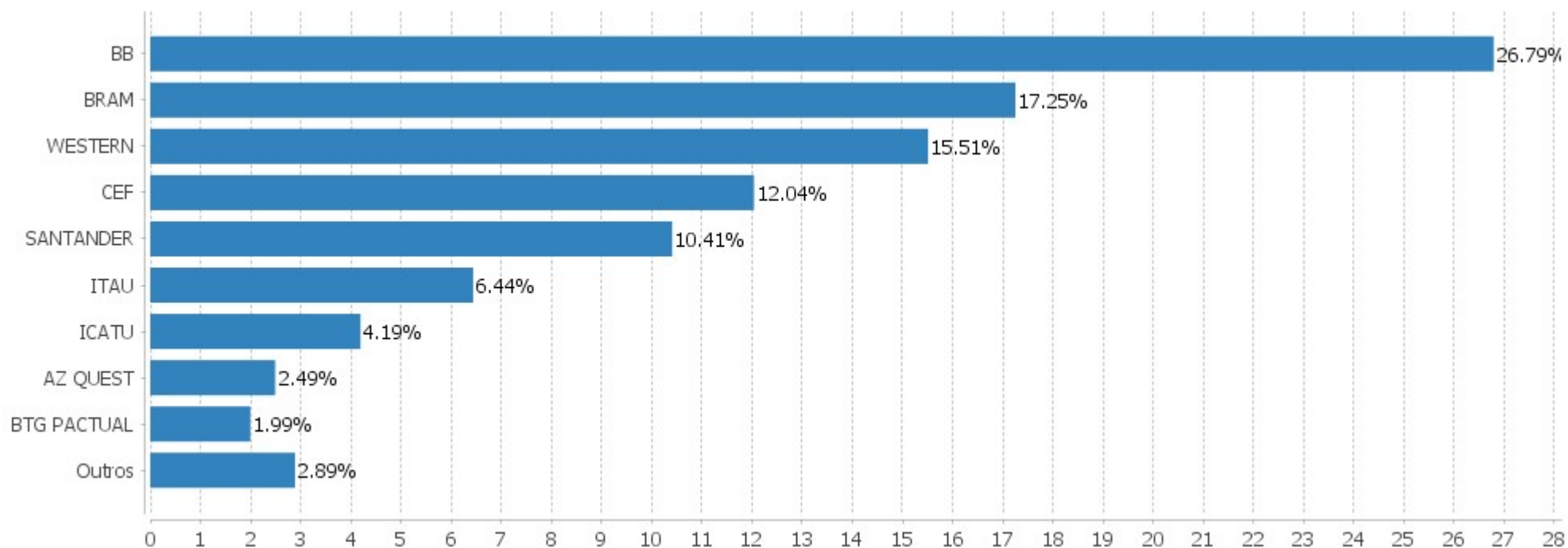


Alocação Por Estratégia



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

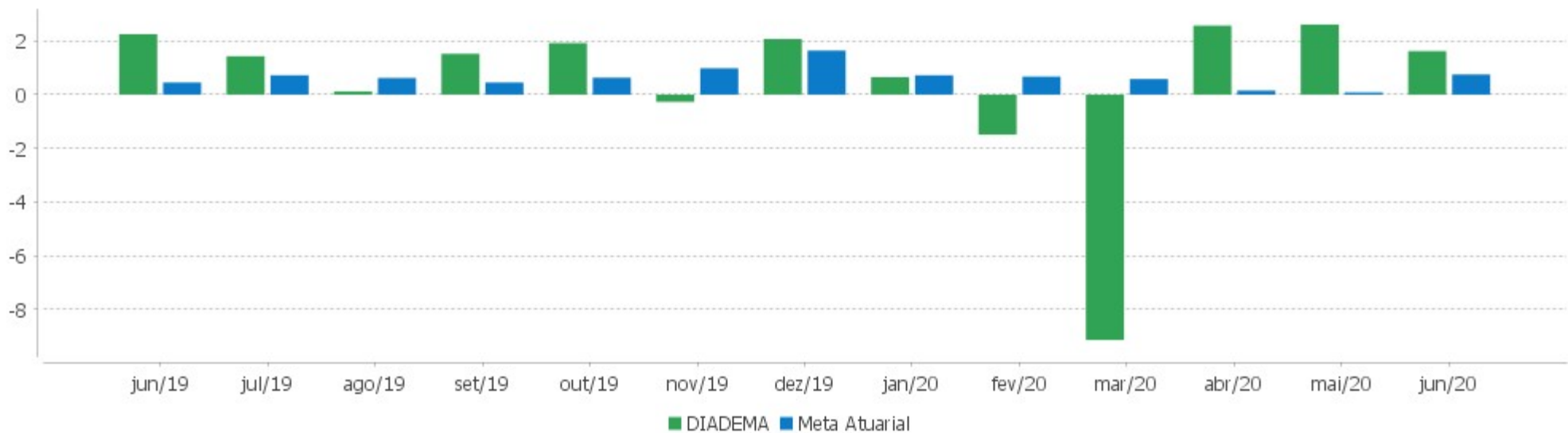
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	11	61,11	03 meses	6,96	0,96	6,01	10,40
Meses abaixo da Meta Atuarial	7	38,89	06 meses	-3,64	2,93	-6,57	17,27
			12 meses	3,08	8,23	-5,15	12,30
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade 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 Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,09 0,04	-1,70 -0,04	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	1,37 78,16	0,78 105,60	1,37 78,16	4,06 88,25	10,51 93,70	18,70 96,43
BRABESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA % do CDI	0,95 447,46	1,78 101,36	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	4,81 1,64	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	3,10 -0,07	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	3,04 -0,13	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	3,40 0,41	3,79 2,81	3,40 0,41	9,01 0,73	27,95 9,39	40,65 9,55
BRABESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,26 -0,02	2,44 -0,16	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	1,75 0,04	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	4,63 4,53	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	-2,03 -0,37	4,83 -0,13	-2,03 -0,37	4,40 -0,54	34,09 -1,04	44,71 -1,49
BB CRED PRIV III Var. IPCA + 6% p.p.	0,98 0,23	2,68 -0,31	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	-2,89	-0,10	-2,89	-0,88	5,76	13,90
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	0,85 398,88	-6,40 -364,95	18,78 2.555,01	-6,40 -364,95	4,13 89,64	17,08 152,32	38,07 196,32
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	10,27 1,52	-8,33 9,47	41,67 11,49	-8,33 9,47	8,82 14,67	58,71 28,07	80,75 29,62
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	12,10 3,34	-28,51 -10,71	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	-20,26 -2,45	28,01 -2,17	-20,26 -2,45	7,24 13,09	45,66 15,02	93,56 42,44

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.	8,97 0,21	-13,29 4,51	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	-20,06 -2,25	21,11 -9,07	-20,06 -2,25	-6,28 -0,43	44,97 14,33	54,60 3,47
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO Var. IFIX p.p.	0,01 -5,58	-10,27 1,96	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	-16,41 1,40	5,87 -24,31	-16,41 1,40	-4,75 1,11	4,75 -25,89	0,75 -50,38
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA Var. IPCA + 6% p.p.	-0,49 -1,24	-8,88 -11,87	-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 -5.674,45	-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	1,75	0,73	1,75	4,60	11,21	19,39
IBOVESPA	8,76	-17,80	30,18	-17,80	-5,85	30,64	51,12
INPC + 6%	0,79	3,25	1,24	3,25	8,51	18,75	30,23
IPCA + 6%	0,75	2,99	0,98	2,99	8,29	18,56	31,11

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

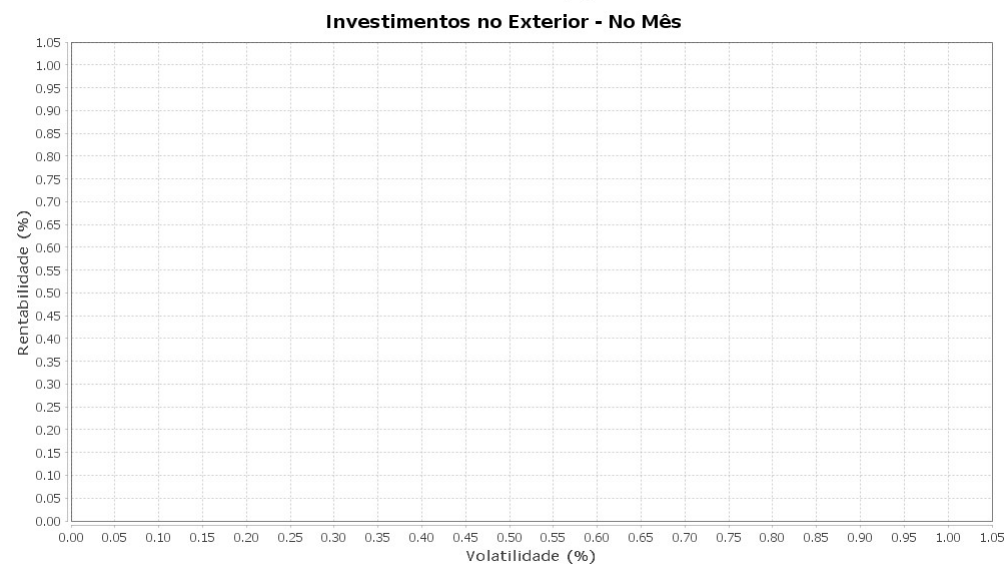
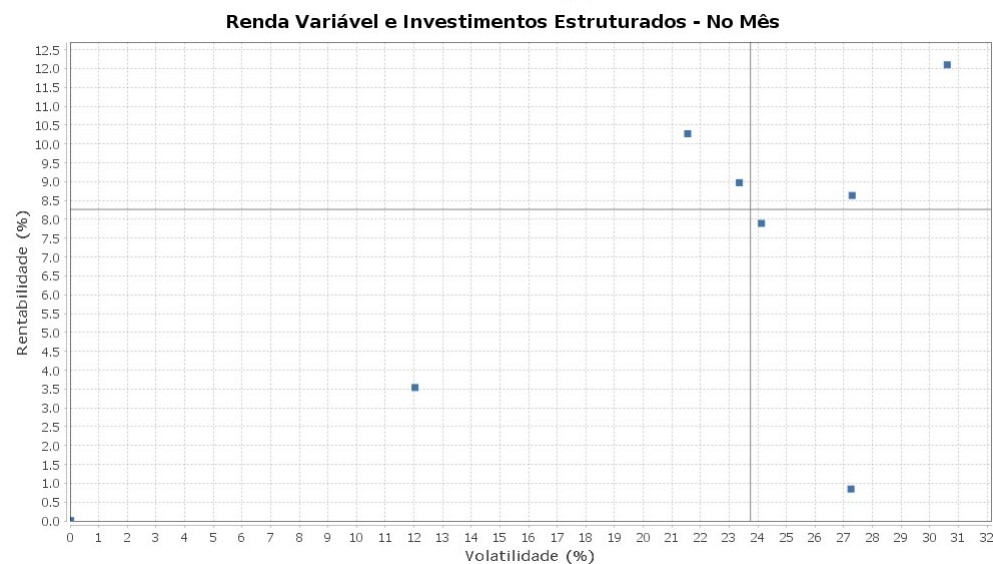
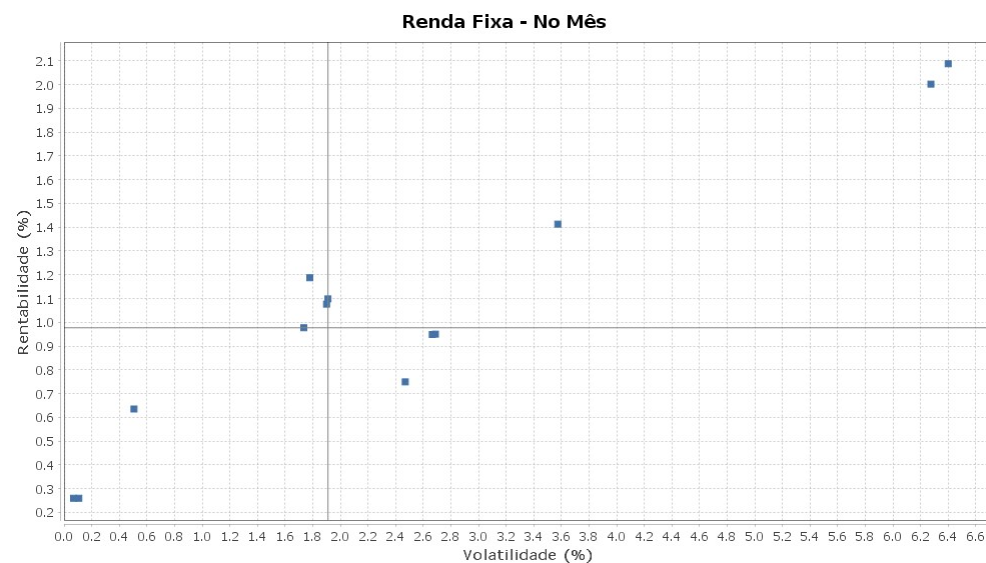
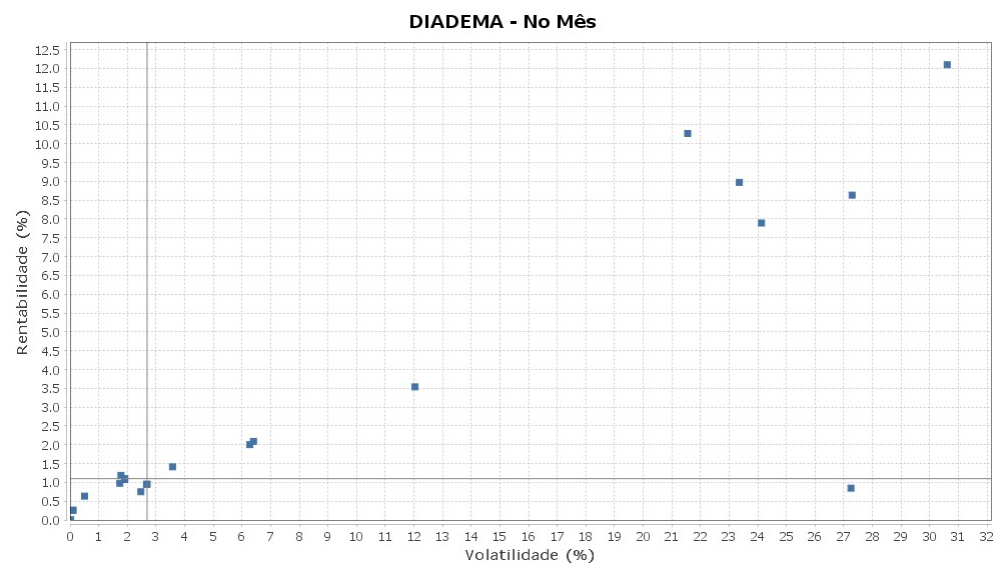
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
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
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	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	Artigo 8º IV, Alínea b	0,02	0,00	0,01	3.655.554,17	1,21
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,07	0,02	0,26	7.439.122,31	2,46
BRADERCO FI RF IRF-M 1 TÍTULOS PUBLICOS	Artigo 7º I, Alínea b	0,11	0,02	0,26	30.920,39	0,01
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	Artigo 7º VII, Alínea b	0,51	0,08	0,64	3.552.299,58	1,17
BB CRED PRIV III	Artigo 7º VII, Alínea b	1,74	0,23	0,98	9.621.051,49	3,18
BB PREV IPCA I	Artigo 7º I, Alínea b	1,78	0,24	1,19	16.719.612,34	5,52
SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TÍTULOS PUBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,90	0,25	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	0,25	1,10	0,00	0,00
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,47	0,29	0,75	35.778.366,53	11,82
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,67	0,32	0,95	46.321.228,71	15,30
BRADERCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINAMICA	Artigo 7º IV, Alínea a	2,69	0,32	0,95	30.855.132,56	10,19
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,57	0,44	1,41	26.351.490,19	8,70
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,28	0,74	2,00	29.042.910,29	9,59
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	6,40	0,76	2,09	20.704.740,54	6,84
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	Artigo 8º IV, Alínea b	12,04	1,41	3,54	1.403.160,38	0,46
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	21,55	2,70	10,27	5.968.440,06	1,97
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	23,36	2,83	8,97	3.766.182,53	1,24
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	24,13	2,86	7,89	12.519.507,55	4,14
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	27,25	2,86	0,85	20.033.303,17	6,62
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	27,29	3,22	8,63	7.444.536,57	2,46
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	30,61	3,72	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.