



DIADEMA
NOVEMBRO 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 22.12.2020.

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

RENTA FIXA

70,72%

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
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	5,06	1,30	5,92	2.123.949,76	0,78	1.163.360.094,10	0,18
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	12,83	1,98	0,98	29.934.851,65	10,95	1.200.450.883,37	2,49
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	9,25	1,44	6,72	26.833.208,44	9,82	771.886.825,67	3,48
BB	BB	BB PREV IPCA I	4,95	1,18	7,05	16.880.404,61	6,18	512.460.794,22	3,29
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,28	0,85	2,65	32.995.634,45	12,07	9.499.641.282,04	0,35
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,97	0,82	5,27	36.000.226,48	13,17	14.161.450.965,39	0,25
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			7,29	1,22	4,27	144.768.275,39	52,97		

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	13,35	2,01	1,29	21.335.090,57	7,81	2.002.230.156,54	1,07
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,23	0,16	2,14	13.613.337,23	4,98	2.405.684.296,02	0,57
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			8,40	1,15	2,08	34.948.427,80	12,79		

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 PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4,52	1,46	5,96	9.928.888,79	3,63	614.843.149,22	1,61
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	1,59	0,41	-0,33	3.646.108,63	1,33	138.233.417,80	2,64
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			3,35	1,17	4,20	13.574.997,42	4,97		

Renda Fixa			7,34	1,21	3,71	193.291.700,61	70,72		
------------	--	--	------	------	------	----------------	-------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

29,28%

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	40,13	13,58	-16,13	13.135.050,47	4,81	1.507.105.614,76	0,87
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	46,38	11,61	-9,43	8.455.028,15	3,09	1.275.891.286,53	0,66
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	46,03	8,68	2,51	6.674.321,48	2,44	2.456.975.630,65	0,27
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	41,91	11,89	-2,04	4.255.095,49	1,56	945.669.292,57	0,45
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	52,67	13,92	-27,04	19.638.630,10	7,19	1.529.783.249,31	1,28
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			46,15	12,59	-16,90	52.158.125,69	19,08		

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	33,40	10,70	8,71	23.267.270,27	8,51	1.113.802.596,37	2,09
Sub-total Artigo 8º III			33,40	10,70	8,71	23.267.270,27	8,51		

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	548,43	-0,77	-99,58	10.630,89	0,00	1.463.971,83	0,73
CEF	CEF	FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	11,29	-0,70	-6,77	203.839,23	0,07	20.172.858,73	1,01
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			265,41	-0,69	-91,95	214.470,12	0,08		

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	33,11	3,40	-0,28	3.110.302,02	1,14	64.383.251,69	4,83
BRPP	GERAÇÃO FUTURO	BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	19,89	1,41	-17,66	1.283.538,54	0,47	384.404.903,53	0,33
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			21,48	2,81	-5,56	4.393.840,56	1,61		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável e Investimentos Estruturados	36,89	11,41	-12,51	80.033.706,64	29,28
Total	12,86	3,93	-0,13	273.325.407,25	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	144.768.275,39	52,97	15,00	55,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	34.948.427,80	12,79	5,00	15,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	13.574.997,42	4,97	0,00	2,00	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	193.291.700,61	70,72				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	52.158.125,69	19,08	2,00	15,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	23.267.270,27	8,51	2,00	7,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	214.470,12	0,08	1,00	2,00	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	4.393.840,56	1,61	1,00	2,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	80.033.706,64	29,28				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

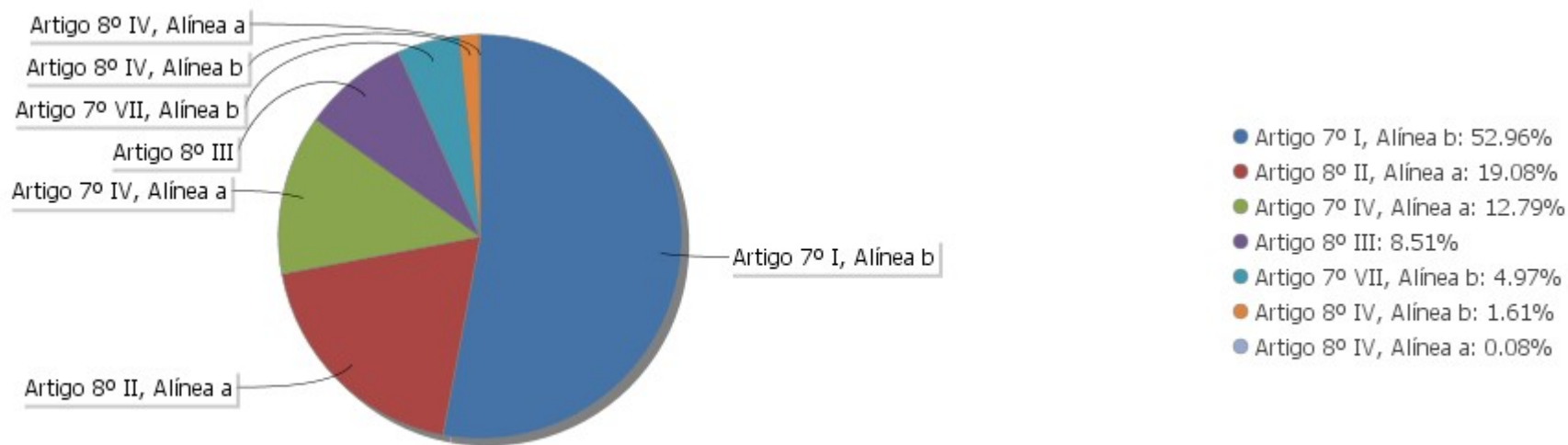
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,22 817,92	4,27 164,73	0,47 100,89	2,94 284,49	5,48 184,30	1.778.868,32	6.146.540,10
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	1,15 771,33	2,08 80,17	0,19 41,80	2,79 269,52	3,23 108,69	446.569,38	1.368.926,86
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	1,17 785,01	4,20 162,06	1,53 330,21	3,96 382,88	5,10 171,48	157.456,75	546.667,24
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	12,59 -3,31	-16,90 -11,07	2,78 -6,80	17,23 -7,36	-9,34 -9,95	5.834.277,26	-10.610.922,76
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	10,70 -5,20	8,71 14,55	2,83 -6,75	17,13 -7,46	11,55 10,94	2.248.592,86	1.863.556,89
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,69 -16,59	-91,95 -86,11	2,91 -6,67	-91,84 -116,43	-94,88 -95,49	-1.011,27	-2.565.122,92
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	2,81 -13,09	-5,56 0,28	15,94 6,35	3,85 -20,74	-2,43 -3,04	120.471,36	-341.271,10
DIADEMA (Total)						10.585.224,66	-3.591.625,69

Análise de Liquidez

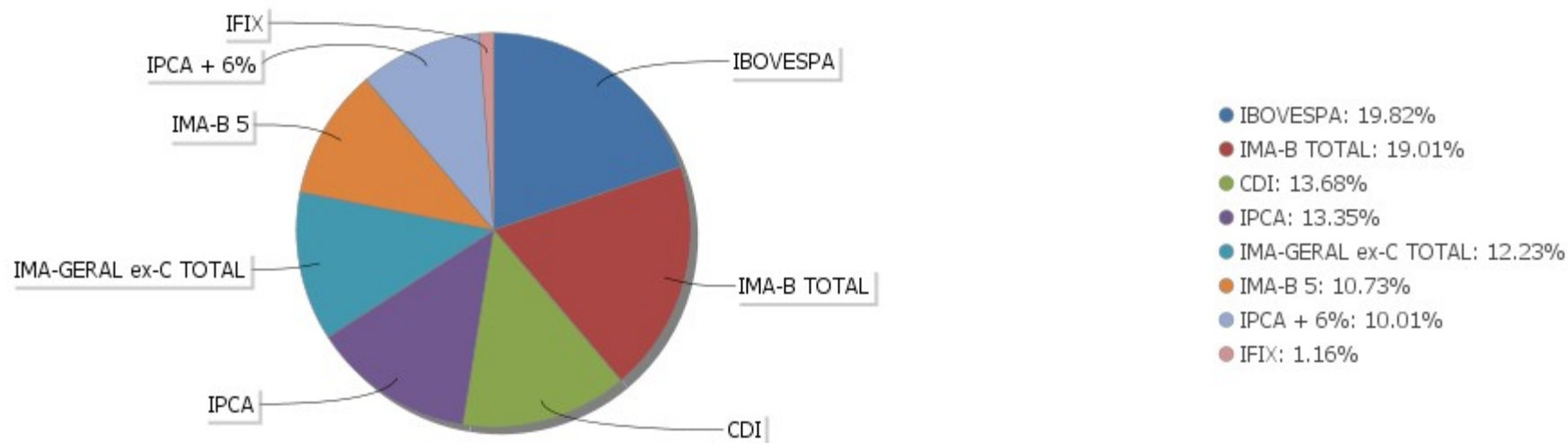
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	236.720.859,46	86,61	236.720.859,46	86,61
de 31 a 364 dias	6.684.952,37	2,45	243.405.811,83	89,05
acima de 365 dias	29.919.595,42	10,95	273.325.407,25	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

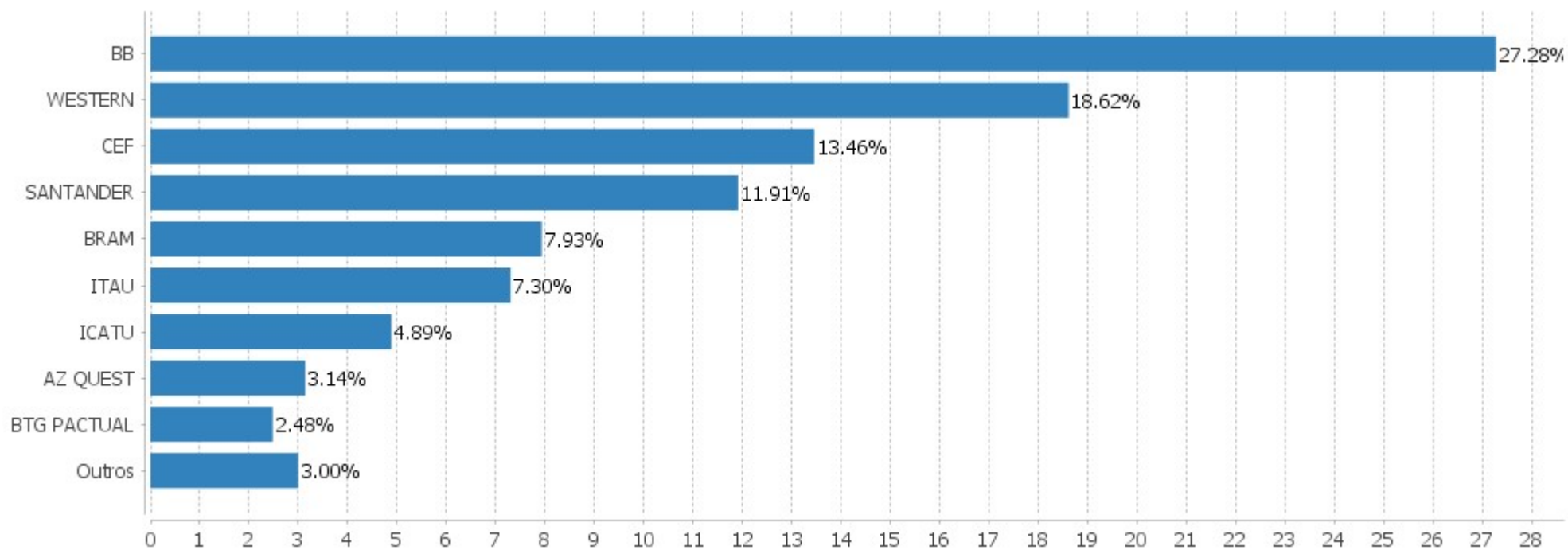


Alocação Por Estratégia



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	3,08	-0,83	-1,83	-0,62	3,93		-0,13
IPCA + 5,88%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35		8,62
p.p. indexador	-0,06	-2,15	-9,71	2,43	2,54	0,89	2,20	-1,55	-2,95	-1,96	2,58		-8,75
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

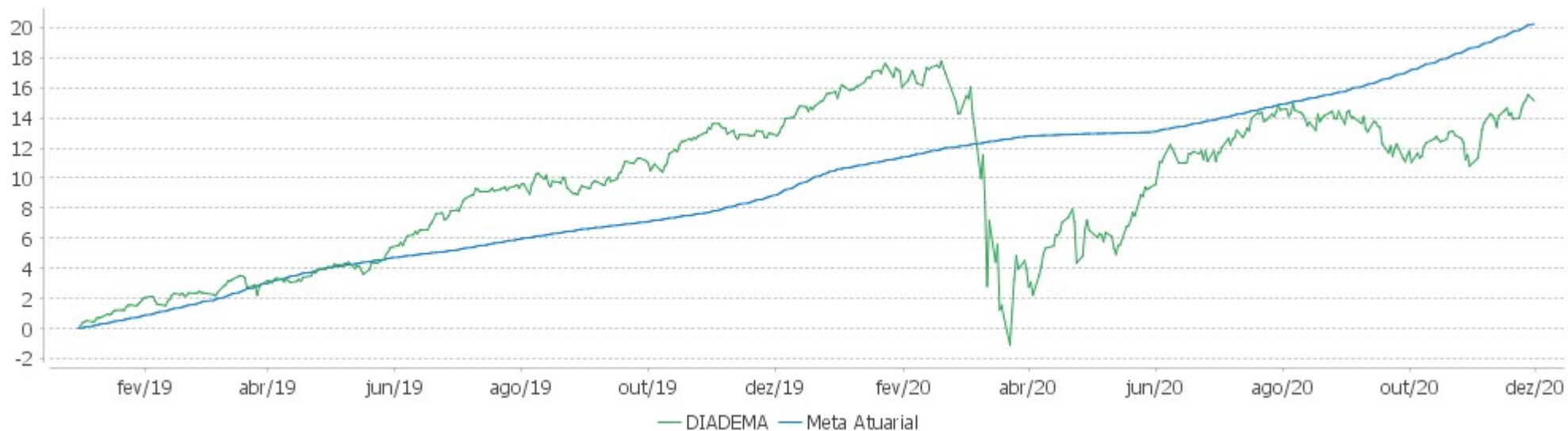
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

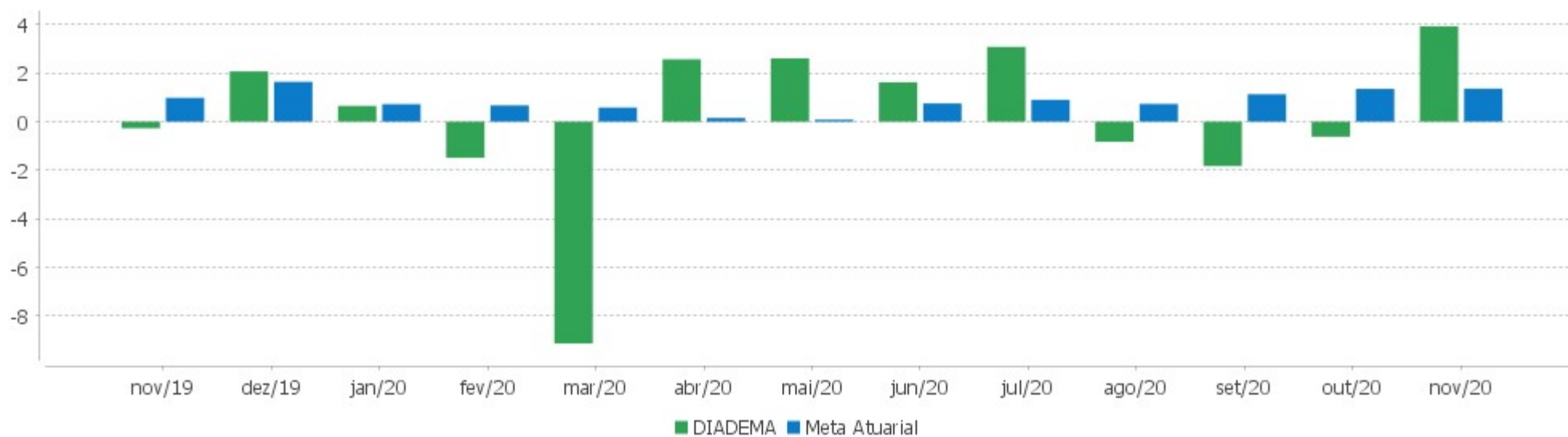
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	13	56,52	03 meses	1,39	3,86	-2,47	7,04
Meses abaixo da Meta Atuarial	10	43,48	06 meses	5,33	6,31	-0,98	6,61
			12 meses	1,94	10,40	-8,46	12,86
			24 meses				
			36 meses				
Desde 31/12/2018				15,16	20,12	-4,96	9,54
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	3,93	2020-11					
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
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	1,44 0,12	6,72 0,63	0,33 -1,07	3,27 -0,72	8,22 0,81	26,37 4,68	39,91 6,85
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,30 -0,02	5,92 -0,18	1,33 -0,06	3,83 -0,15	7,21 -0,20	21,19 -0,51	32,25 -0,81
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6% p.p.	1,18 -0,18	7,05 -1,68	1,88 -2,01	4,77 -1,60	8,32 -2,20	24,20 3,22	36,58 3,21
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,85 0,15	2,65 -0,02	0,02 0,04	1,84 -0,02	3,63 0,03	17,42 0,43	28,71 0,61
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,82 -0,07	5,27 2,15	0,20 -2,20	1,37 -1,92	5,90 1,59	24,20 16,47	33,20 21,12
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,98 -0,02	0,98 -0,50	0,60 -0,07	5,13 -0,18	2,98 -0,54	25,84 -0,99	40,74 -1,49
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,01 0,01	1,29 -0,19	0,47 -0,20	5,20 -0,12	3,33 -0,19	26,56 -0,26	41,64 -0,59
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,16 105,63	2,14 82,75	0,34 73,60	1,02 98,87	2,50 84,20	8,51 92,13	15,52 95,17
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6% p.p.	1,46 0,10	5,96 -2,77	1,70 -2,19	4,21 -2,16	7,13 -3,39	20,20 -0,78	33,29 -0,08
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	0,41	-0,33	1,09	3,29	-0,06	5,63	12,82
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	10,70 7.156,35	8,71 336,28	2,83 610,70	17,13 1.655,69	11,55 388,47	32,21 348,62	42,72 262,02
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA Var. IPCA + 6% p.p.	-0,70 -2,05	-6,77 -15,50	3,39 -0,49	1,81 -4,56	-7,32 -17,84	-69,69 -90,67	-70,12 -103,49
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FI EM PARTICIPAÇÕES % do CDI	-0,77 -515,58	-99,58 -3.846,30	-6,04 -1.300,69	-99,58 -9.626,95	-99,74 -3.354,43	-99,75 -1.079,53	-99,74 -611,71
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO Var. IFIX p.p.	3,40 1,89	-0,28 11,89	25,86 24,91	6,56 0,88	0,53 3,35	16,38 -5,70	5,70 -21,20
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11 Var. IBOVESPA p.p.	1,41 -14,49	-17,66 -11,82	-4,75 -14,33	-2,06 -26,64	-9,51 -10,12	11,12 -10,54	2,41 -48,89
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	8,68 -7,22	2,51 8,35	3,63 -5,95	23,31 -1,27	9,88 9,27	46,84 25,18	81,20 29,90
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	13,92 -1,98	-27,04 -21,21	0,40 -9,18	14,40 -10,19	-19,60 -20,21	5,77 -15,90	35,90 -15,40

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	11,61 -4,30	-9,43 -3,59	2,84 -6,74	23,38 -1,21	0,37 -0,23	41,93 20,27	80,01 28,71
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	11,89 -4,02	-2,04 3,80	5,16 -4,43	23,12 -1,47	5,21 4,60	32,83 11,16	72,24 20,94
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	13,58 -2,33	-16,13 -10,29	5,26 -4,32	13,20 -11,39	-9,83 -10,44	22,35 0,68	51,34 0,04
DIADEMA Var. IPCA + 6% p.p.	3,93 2,57	-0,13 -8,86	1,39 -2,50	5,33 -1,04	1,94 -8,58		
CDI	0,15	2,59	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
IBOVESPA	15,90	-5,84	9,58	24,59	0,61	21,66	51,30
INPC + 6%	1,42	9,58	4,22	6,96	11,46	22,12	33,99
IPCA + 6%	1,36	8,73	3,89	6,37	10,52	20,99	33,37

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	0,23	3,52	0,54	1,19	3,95	11,13	18,89
IRF-M 1+	0,46	5,24	-1,06	0,29	6,00	22,54	36,94
IRF-M TOTAL	0,36	4,65	-0,53	0,58	5,30	19,04	31,44
IMA-B 5	1,32	6,10	1,40	3,99	7,41	21,69	33,06
IMA-B 5+	2,59	-1,87	0,14	6,53	0,68	30,33	48,80
IMA-B TOTAL	2,00	1,48	0,67	5,31	3,52	26,83	42,23
IMA-C TOTAL	1,94	23,44	7,90	19,17	23,94	48,54	75,37
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,70	2,67	-0,02	1,86	3,60	17,00	28,09
IMA-GERAL TOTAL	0,73	3,25	0,22	2,35	4,17	17,84	29,30
IDKA 2	1,25	6,77	1,31	4,33	8,05	20,89	32,56
IDKA 20	3,37	-8,22	-0,40	9,06	-4,60	35,17	60,63
CDI	0,15	2,59	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
Renda Variável							
IBOVESPA	15,90	-5,84	9,58	24,59	0,61	21,66	51,30
IBRX 100	15,46	-5,18	9,57	25,07	1,72	24,85	55,25
IBRX 50	16,21	-5,30	10,24	25,90	0,92	19,73	48,77
SMALL CAP	16,64	-7,60	7,78	33,38	4,09	49,24	69,17
IFIX	1,51	-12,17	0,95	5,68	-2,83	22,09	26,91
Índice Consumo - ICON	8,93	-3,98	1,63	18,62	3,72	48,84	43,97
Índice Dividendos - IDIV	14,40	-9,12	9,82	21,30	-0,05	32,77	60,52
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,89	3,13	2,41	3,29	4,31	7,73	12,09
INPC	0,95	3,93	2,73	3,87	5,20	8,74	12,61
IGPM	3,28	21,97	11,24	18,66	24,52	29,46	41,99
SELIC	0,15	2,59	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
Meta Atuarial							

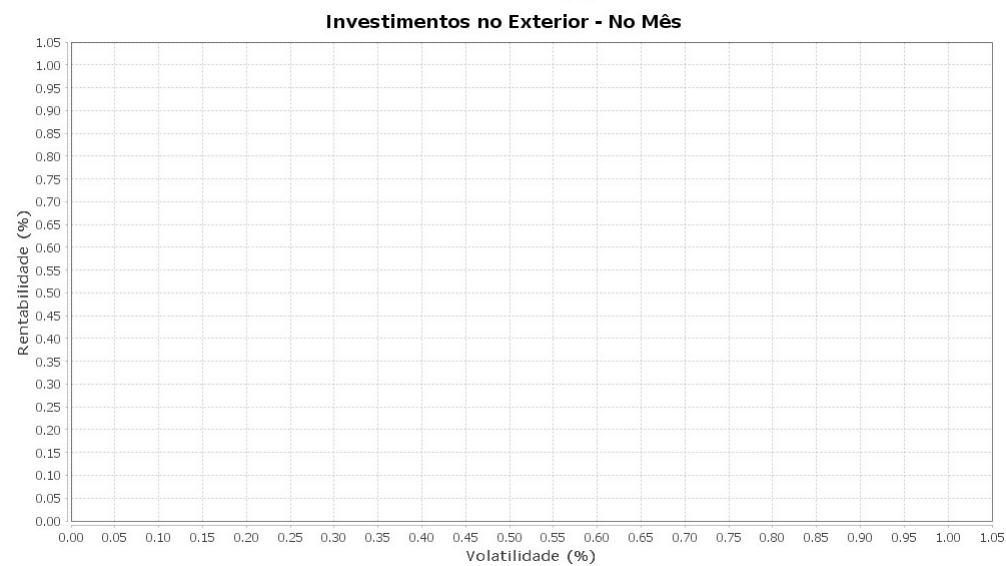
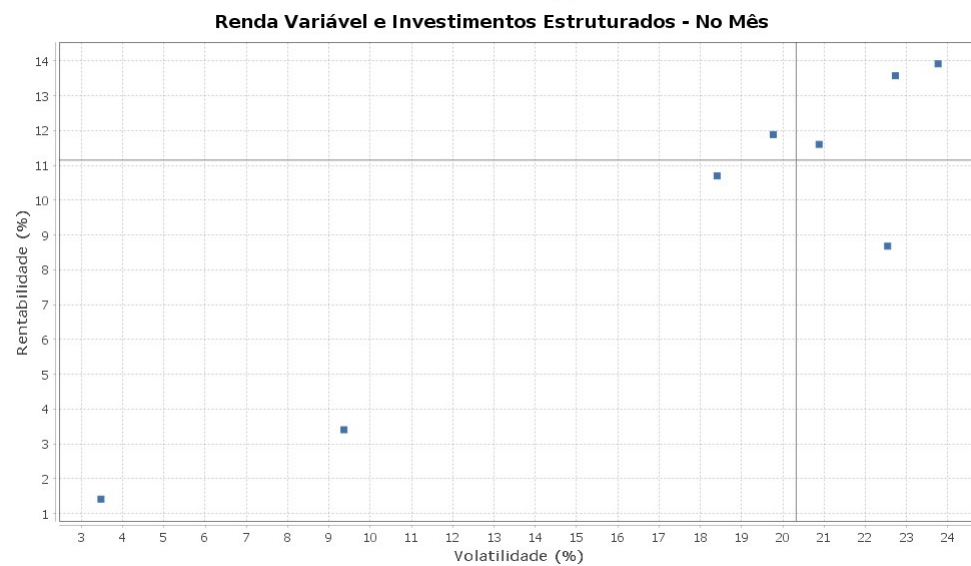
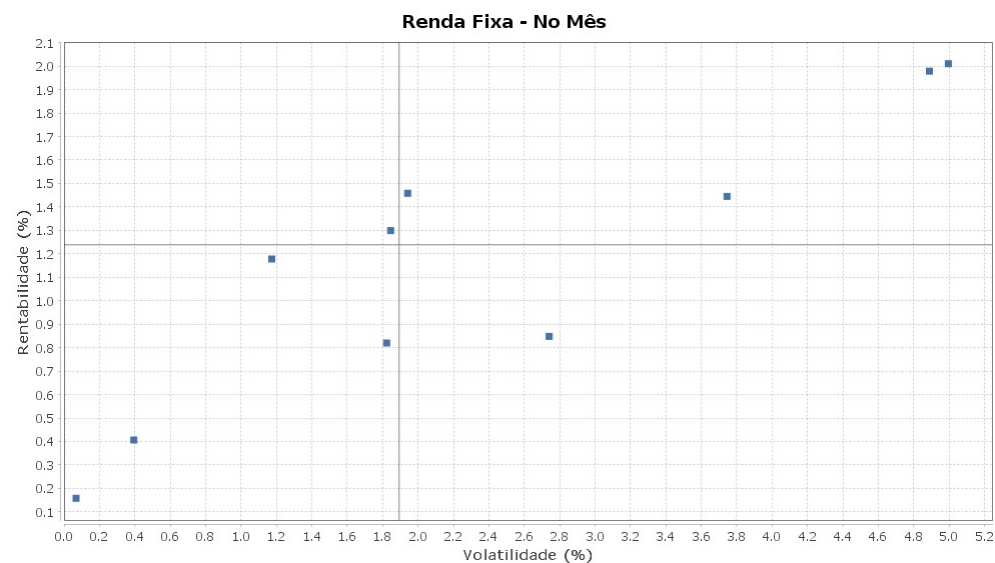
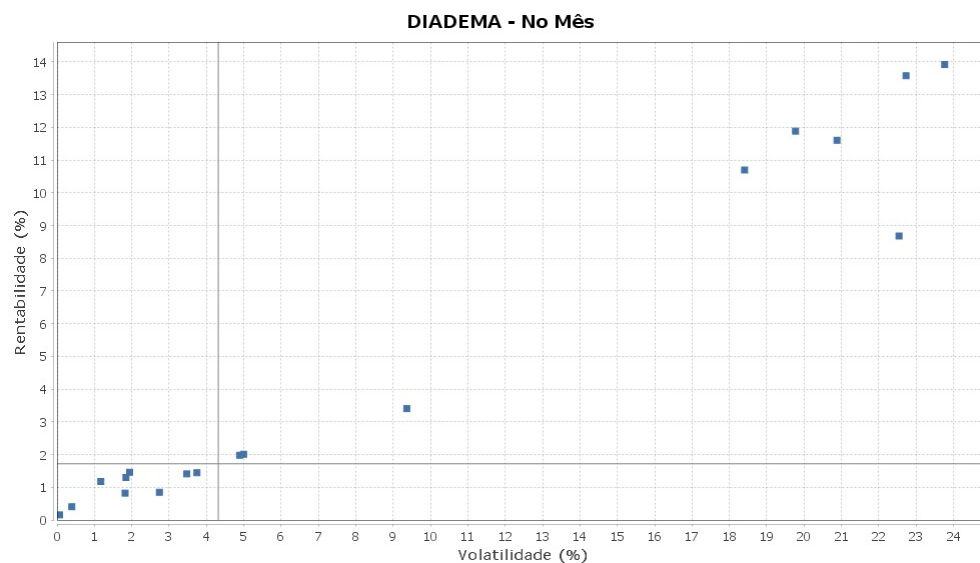
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
206	04/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.000,00	2.180,82851300	2,2927066340
207	05/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	56.000,00	24.423,42344200	2,2928808540
208	05/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	4.361,32561500	2,2928808540
209	05/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.011.000,00	440.930,01092300	2,2928808994
210	06/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	28.231,05	0,00	12.311,16386500	2,2931260040
211	09/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	12.000,00	5.232,51287500	2,2933531720
212	09/11/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	145.550,88	0,00	97.515,87289300	1,4925865470
213	09/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	7.988,90	0,00	3.483,50184200	2,2933531720
214	09/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.067.000,00	465.257,60315800	2,2933531720
215	10/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	11.553,41	0,00	5.037,43070800	2,2935124410
216	11/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.000.000,00	0,00	436.029,12154400	2,2934247980
217	11/11/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	0,00	5.000.000,00	3.363.147,29102700	1,4867026530
218	11/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.007.487,66	0,00	1.747.381,32398900	2,2934247980
219	13/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	51.000,00	22.235,25620000	2,2936547050
220	13/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.000,00	871,97083100	2,2936547050
221	13/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.126.000,00	2.670.846,65649400	2,2936547050
222	16/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	24.514,43	0,00	10.686,60010300	2,2939409880
223	19/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	9.000,00	3.922,47886800	2,2944674280
224	19/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	5.279.042,62	0,00	2.300.770,34678200	2,2944674280
225	24/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	30.877,74	0,00	13.454,58764800	2,2949599650
226	25/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	4.356,86388600	2,2952289220
227	25/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	60.000,00	26.141,18331500	2,2952289220
228	30/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	43.000,00	18.728,30951700	2,2959893930
229	30/11/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.800.000,00	2.090.601,99260300	2,2959893930
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 9.094.873,44

Value-At-Risk: 3,33%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,07	0,09	0,00	0,12	0,16	13.613.337,23	4,98
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	Artigo 7º VII, Alínea b	0,39	0,21	0,00	0,65	0,41	3.646.108,63	1,33
BB PREV IPCA I	Artigo 7º I, Alínea b	1,17	0,94	0,03	0,88	1,18	16.880.404,61	6,18
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,82	1,23	0,12	0,37	0,82	36.000.226,48	13,17
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,84	1,02	0,01	0,62	1,30	2.123.949,76	0,78
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	Artigo 7º VII, Alínea b	1,94	0,96	0,02	0,67	1,46	9.928.888,79	3,63
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,74	1,33	0,12	0,25	0,85	32.995.634,45	12,07
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	Artigo 8º IV, Alínea b	3,47	2,80	0,00	0,36	1,41	1.283.538,54	0,47
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,75	1,80	0,13	0,35	1,44	26.833.208,44	9,82
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,89	2,66	0,22	0,37	1,98	29.934.851,65	10,95
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	5,00	2,74	0,16	0,37	2,01	21.335.090,57	7,81
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	Artigo 8º IV, Alínea b	9,36	3,37	0,00	0,35	3,40	3.110.302,02	1,14
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	18,41	8,37	0,48	0,57	10,70	23.267.270,27	8,51
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	19,77	10,85	0,16	0,59	11,89	4.255.095,49	1,56
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	20,88	11,82	0,33	0,55	11,61	8.455.028,15	3,09
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	22,54	10,22	0,23	0,38	8,68	6.674.321,48	2,44
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	22,73	9,82	0,44	0,59	13,58	13.135.050,47	4,81
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	23,76	13,18	0,89	0,58	13,92	19.638.630,10	7,19

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

No respectivo mês de novembro de 2020, observar que:

- O percentual alocado no Artigo 8, Inciso IV, Alínea A (0,08% dos recursos) está inferior ao limite mínimo estipulado em Política de Investimentos.