



DIADEMA
OUTUBRO 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 20.01.2021.

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

73,43%

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	0,57	0,01	2,80	0,00	0,00	813.096.025,00	0,00
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	5,05	0,18	4,56	2.096.720,09	0,78	1.143.247.863,60	0,18
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	12,81	0,19	-0,98	29.354.107,59	10,85	1.209.283.118,14	2,43
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	9,22	-0,29	5,20	26.451.037,91	9,78	727.578.932,77	3,64
BB	BB	BB PREV IPCA I	4,96	0,50	5,81	16.683.873,31	6,17	506.494.433,30	3,29
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,26	-0,07	1,78	37.550.685,24	13,88	9.938.464.189,22	0,38
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,97	-0,11	4,42	35.707.432,05	13,20	13.635.004.724,81	0,26
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			7,27	0,00	3,01	147.843.856,19	54,65		

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	13,34	0,10	-0,70	20.914.678,84	7,73	1.945.147.907,08	1,08
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,23	0,16	1,98	16.459.483,77	6,08	2.401.972.433,04	0,69
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			8,39	0,18	0,91	37.374.162,61	13,82		

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	4,50	0,31	4,44	9.786.192,79	3,62	606.006.746,86	1,61
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	1,59	0,31	-0,73	3.631.347,88	1,34	119.902.739,11	3,03
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			3,33	0,31	2,99	13.417.540,67	4,96		
Renda Fixa			7,32	0,05	2,47	198.635.559,47	73,43		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

26,57%

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	39,66	-2,02	-26,15	11.564.935,54	4,28	1.361.368.675,14	0,85
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	46,19	-2,00	-18,85	7.575.678,31	2,80	1.150.872.550,85	0,66
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	45,78	-1,73	-5,68	6.141.280,77	2,27	2.238.639.550,31	0,27
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	41,70	-0,31	-12,44	3.803.051,13	1,41	861.563.706,40	0,44
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	52,33	-4,17	-35,96	17.238.902,68	6,37	1.442.025.574,85	1,20
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			45,84	-2,65	-26,20	46.323.848,43	17,12		

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	32,99	-2,34	-1,80	21.018.677,41	7,77	991.427.993,44	2,12
Sub-total Artigo 8º III			32,99	-2,34	-1,80	21.018.677,41	7,77		

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	-5,04	-99,58	10.713,46	0,00	1.475.342,75	0,73
CEF	CEF	FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	8,62	4,65	-6,12	215.375,56	0,08	20.172.858,73	1,07
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			265,31	4,14	-91,90	226.089,02	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	33,04	1,25	-3,56	3.031.729,12	1,12	62.544.398,94	4,85
BRPP	GERAÇÃO FUTURO	BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	20,00	-4,87	-18,80	1.273.127,74	0,47	381.640.750,48	0,33
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			21,38	-0,64	-8,14	4.304.856,86	1,59		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável e Investimentos Estruturados	36,54	-2,43	-21,47	71.873.471,72	26,57
Total	12,74	-0,62	-3,90	270.509.031,19	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	147.843.856,19	54,65	15,00	55,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	37.374.162,61	13,82	5,00	15,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	13.417.540,67	4,96	0,00	2,00	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	198.635.559,47	73,43				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	46.323.848,43	17,12	2,00	15,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	21.018.677,41	7,77	2,00	7,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	226.089,02	0,08	1,00	2,00	5,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	4.304.856,86	1,59	1,00	2,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	71.873.471,72	26,57				30,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

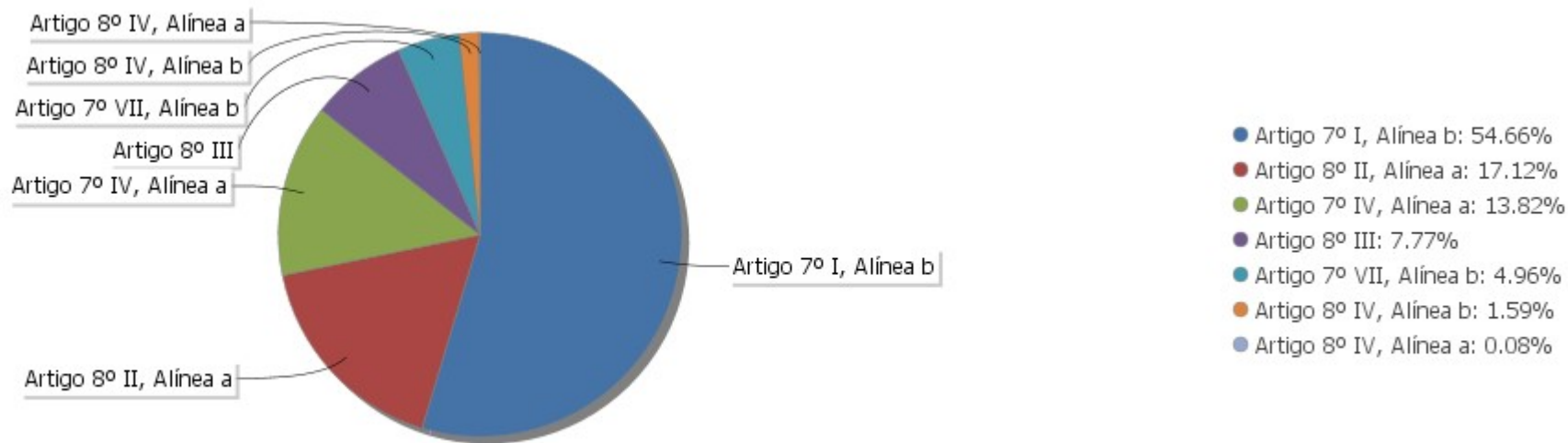
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,00 0,26	3,01 123,38	-1,43 -302,05	3,41 303,95	3,28 102,29	-803,41	4.367.671,78
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,18 111,81	0,91 37,44	-1,99 -418,92	2,80 249,72	0,80 25,06	42.374,21	922.357,48
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,31 198,89	2,99 122,64	0,87 182,32	4,54 404,62	3,76 117,24	41.758,39	389.210,49
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-2,65 -1,97	-26,20 -7,44	-11,81 -3,10	12,26 -4,45	-17,94 -5,57	-1.262.896,67	-16.445.200,02
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-2,34 -1,65	-1,80 16,96	-0,68 8,03	11,49 -5,21	3,70 16,07	-504.089,90	-385.035,97
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	4,14 4,83	-91,90 -73,14	3,25 11,95	-91,84 -108,54	-94,85 -82,47	8.993,04	-2.564.111,65
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-0,64 0,05	-8,14 10,61	-0,87 7,84	3,42 -13,28	-4,82 7,56	-27.424,71	-461.742,46
DIADEMA (Total)						-1.702.089,05	-14.176.850,35

Análise de Liquidez

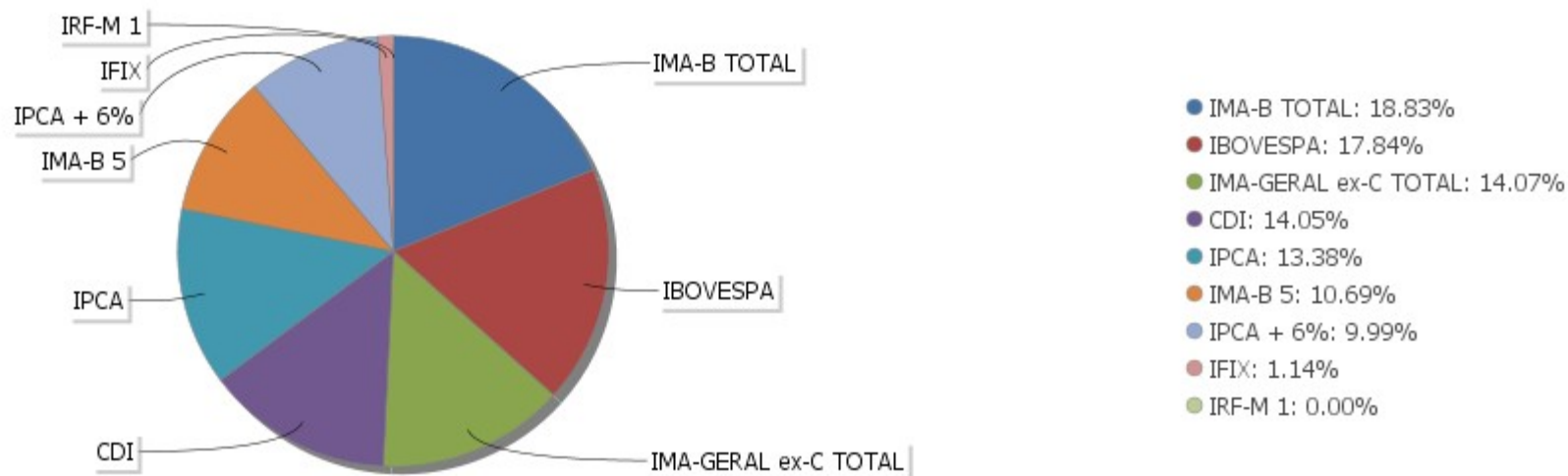
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	234.855.241,74	86,82	234.855.241,74	86,82
de 31 a 364 dias	6.151.994,23	2,27	241.007.235,97	89,09
acima de 365 dias	29.501.795,22	10,91	270.509.031,19	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

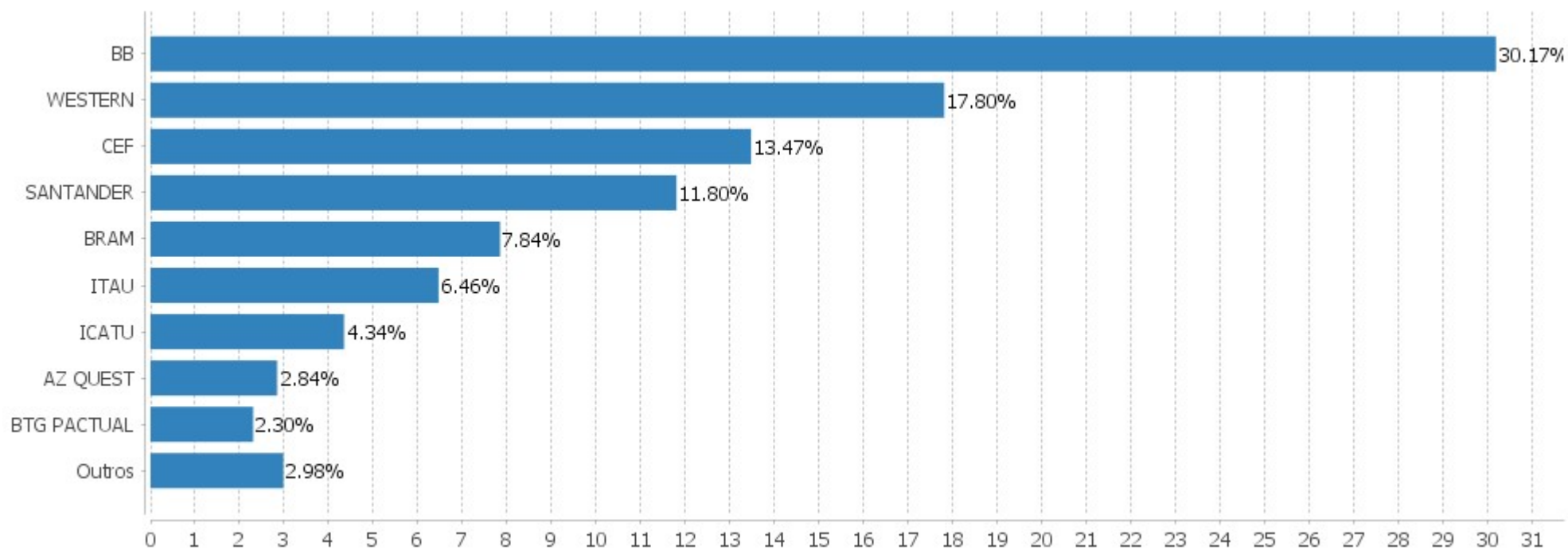


Alocação Por Estratégia



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			-3,90
IPCA + 5,88%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34			7,18
p.p. indexador	-0,06	-2,15	-9,71	2,43	2,54	0,89	2,20	-1,55	-2,95	-1,96			-11,08
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

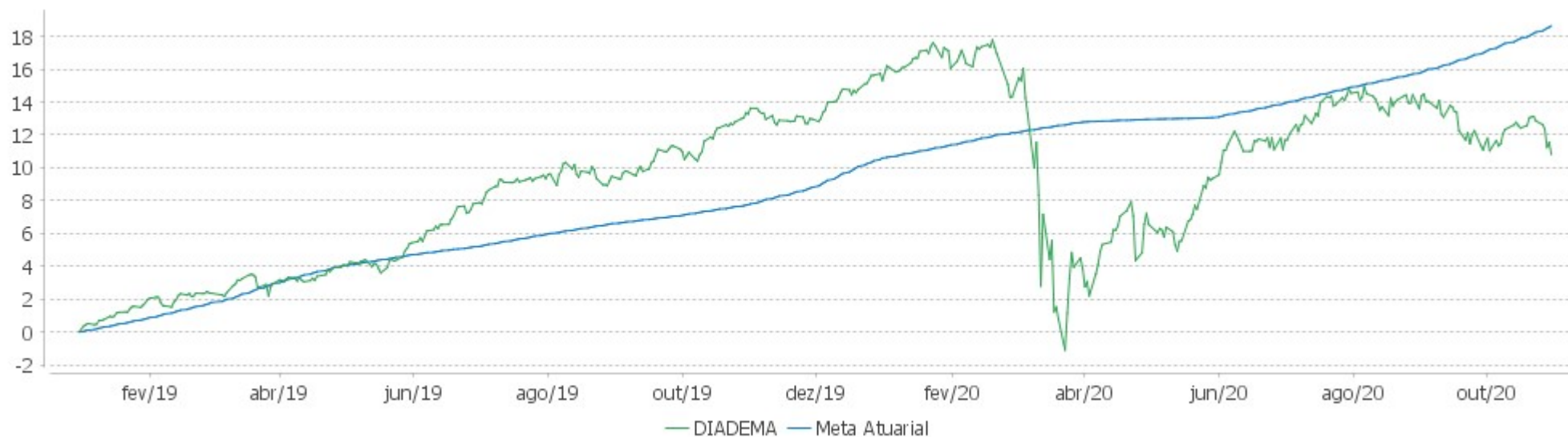
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	12	54,55	03 meses	-3,26	3,21	-6,47	6,74
Meses abaixo da Meta Atuarial	10	45,45	06 meses	3,99	4,97	-0,98	6,88
			12 meses	-2,18	10,00	-12,18	12,74
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,08	2020-07	Desde 31/12/2018	10,81	18,53	-7,72	9,65
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
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6% p.p.	0,31 -1,04	4,44 -2,84	0,73 -2,52	4,94 -0,09	5,39 -4,71	18,87 -0,80	31,58 -0,99
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	0,31	-0,73	1,24	3,46	-0,37	5,72	13,01
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	-0,29 -0,49	5,20 0,49	-1,39 -1,90	4,75 -0,06	5,61 -0,10	25,17 4,89	37,59 6,12
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,18 -0,02	4,56 -0,16	0,44 -0,07	4,68 -0,13	5,51 -0,20	19,78 -0,49	30,71 -0,76
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6% p.p.	0,50 -0,85	5,81 -1,47	1,53 -1,71	5,72 0,69	6,65 -3,45	23,12 3,45	34,84 2,28
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,07 -0,07	1,78 -0,17	-1,70 -0,31	2,07 -0,07	1,80 -0,37	17,32 0,22	27,46 0,26
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,15 -0,02	2,94 -0,35	0,27 -0,16	1,15 -0,23	3,67 -0,40	10,78 -0,71	18,35 -1,02
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,11 -0,97	4,42 2,20	-1,16 -2,91	1,94 -0,06	4,51 0,59	23,65 17,10	32,48 21,07
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,19 -0,02	-0,98 -0,47	-3,15 -0,08	4,64 -0,18	-1,52 -0,52	24,50 -0,97	36,94 -1,44
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,10 -0,11	-0,70 -0,19	-3,31 -0,24	4,80 -0,02	-1,30 -0,30	25,25 -0,22	37,72 -0,66
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,16 101,53	1,98 81,34	0,36 76,91	1,12 100,00	2,69 83,84	8,87 92,26	15,98 95,19
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO Var. IFIX p.p.	1,25 2,26	-3,56 9,91	0,92 -0,31	5,85 -0,41	-3,39 -2,49	12,80 -10,58	1,27 -23,01
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11 Var. IBOVESPA p.p.	-4,87 -4,19	-18,80 -0,05	-4,66 4,05	-1,98 -18,68	-8,24 4,13	7,36 -0,11	0,68 -25,76
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	-2,34 -1.492,07	-1,80 -73,85	-0,68 -142,48	11,49 1.024,61	4,64 144,42	21,68 225,50	33,20 197,74
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-1,73 -1,04	-5,68 13,08	-5,06 3,65	25,13 8,42	1,35 13,73	39,74 32,27	63,12 36,69
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	-4,17 -3,48	-35,96 -17,20	-15,33 -6,62	9,64 -7,06	-27,31 -14,93	-4,47 -11,94	14,77 -11,66
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,00 -1,32	-18,85 -0,09	-10,81 -2,11	16,95 0,25	-6,34 6,04	33,53 26,07	54,81 28,37

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.	-0,31 0,38	-12,44 6,31	-8,12 0,59	19,16 2,46	-7,06 5,32	19,80 12,33	50,04 23,60
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,02 -1,33	-26,15 -7,39	-11,49 -2,78	5,47 -11,24	-20,24 -7,87	13,43 5,97	32,23 5,79
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA Var. IPCA + 6% p.p.	4,65 3,29	-6,12 -13,40	3,75 0,51	-4,32 -9,35	-7,00 -17,10	-69,52 -89,19	-69,86 -102,42
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FI EM PARTICIPAÇÕES % do CDI	-5,04 -3.208,21	-99,58 -4.087,96	-5,92 -1.248,11	-99,58 -8.879,22	-99,74 -3.106,35	-99,74 -1.037,33	-99,74 -593,98
DIADEMA Var. IPCA + 6% p.p.	-0,62 -1,97	-3,90 -11,18	-3,26 -6,50	3,99 -1,04	-2,18 -12,28		
CDI	0,16	2,44	0,47	1,12	3,21	9,62	16,79
IBOVESPA	-0,69	-18,76	-8,71	16,70	-12,37	7,47	26,44
INPC + 6%	1,38	8,05	3,63	5,69	11,01	20,67	32,97
IPCA + 6%	1,35	7,28	3,24	5,03	10,10	19,67	32,57

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	0,16	3,29	0,43	1,38	4,06	11,49	19,36
IRF-M 1+	-0,61	4,76	-2,63	1,75	4,63	23,41	36,20
IRF-M TOTAL	-0,33	4,27	-1,63	1,64	4,44	19,78	31,08
IMA-B 5	0,20	4,72	0,50	4,81	5,71	20,28	31,47
IMA-B 5+	0,22	-4,35	-5,92	4,90	-5,85	28,98	43,02
IMA-B TOTAL	0,21	-0,51	-3,08	4,81	-1,00	25,47	38,38
IMA-C TOTAL	2,81	21,09	8,08	19,98	20,18	45,58	72,54
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,00	1,96	-1,39	2,13	2,16	17,10	27,20
IMA-GERAL TOTAL	0,09	2,49	-1,11	2,64	2,67	17,87	28,36
IDKA 2	0,04	5,45	1,09	4,85	6,73	19,60	31,26
IDKA 20	0,68	-11,22	-9,64	5,97	-13,27	34,55	50,97
CDI	0,16	2,44	0,47	1,12	3,21	9,62	16,79
Renda Variável							
IBOVESPA	-0,69	-18,76	-8,71	16,70	-12,37	7,47	26,44
IBRX 100	-0,55	-17,87	-8,31	17,55	-11,05	11,01	29,92
IBRX 50	-0,54	-18,50	-8,37	18,20	-12,42	5,25	23,91
SMALL CAP	-2,28	-20,78	-8,74	20,16	-6,17	34,08	41,52
IFIX	-1,01	-13,47	1,23	6,27	-0,90	23,38	24,28
Índice Consumo - ICON	-2,86	-11,86	-8,08	17,23	-1,94	42,20	27,52
Índice Dividendos - IDIV	0,65	-20,56	-8,64	11,34	-10,58	24,50	30,96
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,86	2,22	1,75	1,99	3,92	6,55	11,41
INPC	0,89	2,95	2,13	2,63	4,77	7,45	11,75
IGPM	3,23	18,10	10,67	15,22	20,93	24,74	38,21
SELIC	0,16	2,44	0,47	1,12	3,21	9,62	16,80
Meta Atuarial							

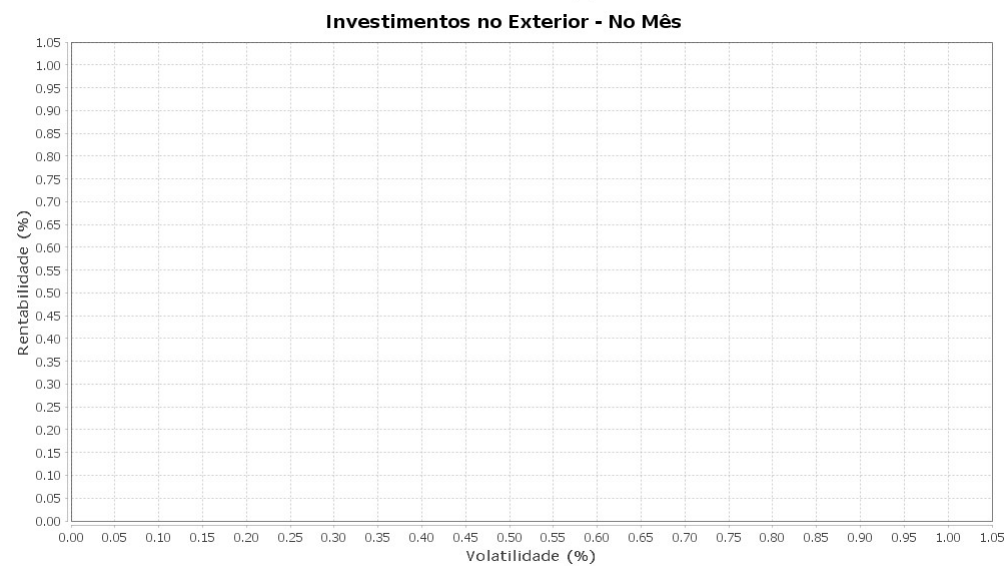
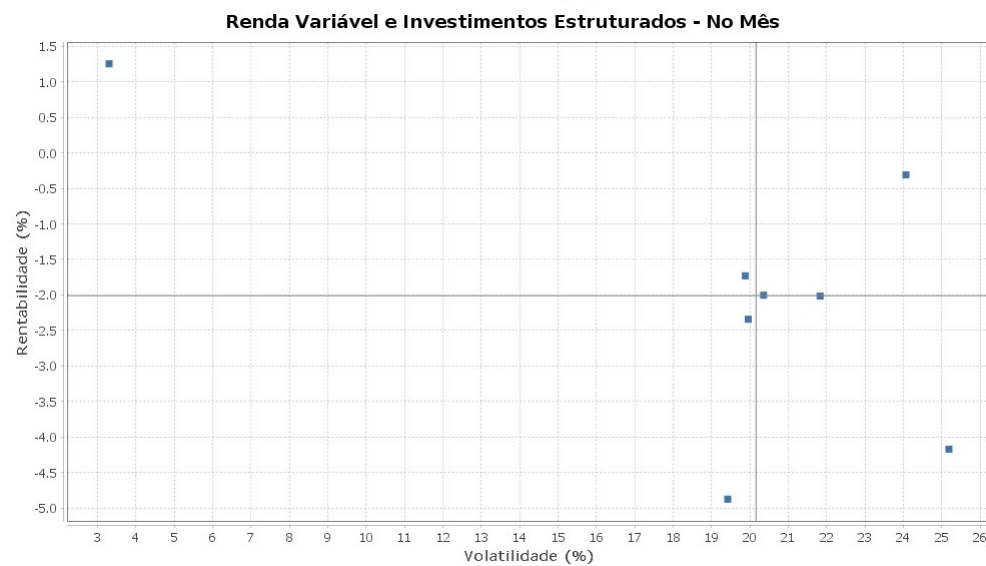
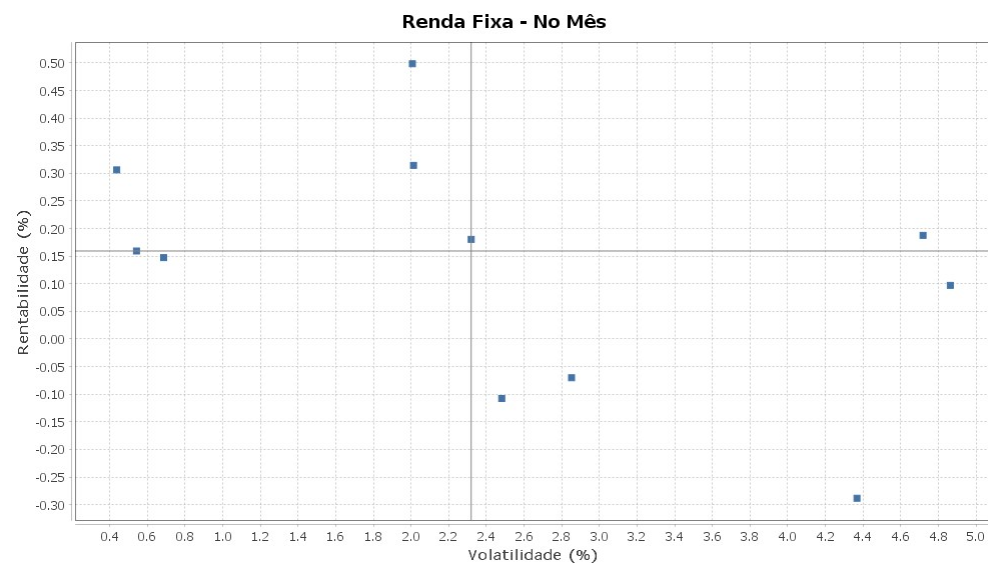
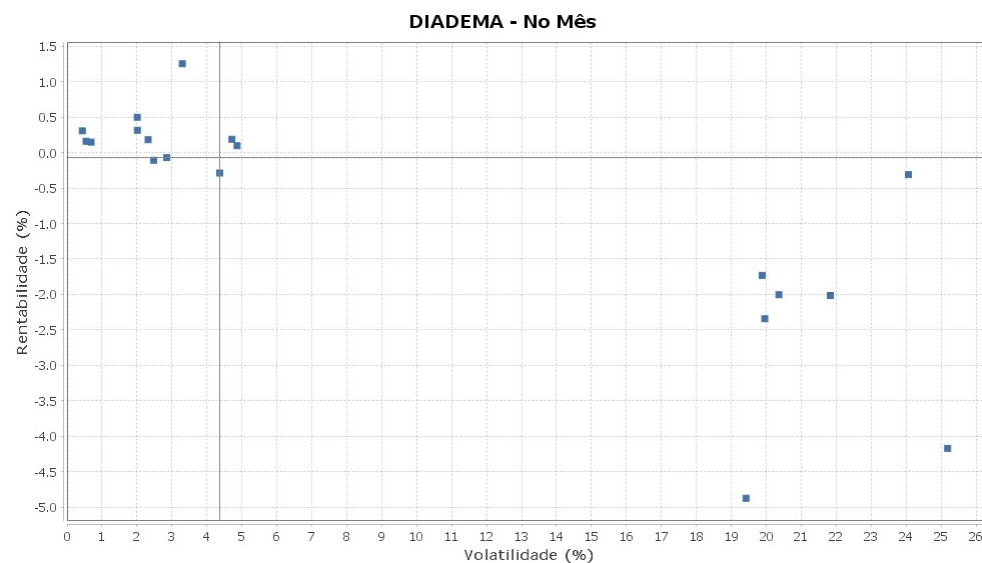
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
184	05/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	13.000,00	5.688,16694400	2,2854462830
185	06/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	60.000,00	26.251,84779000	2,2855534010
186	06/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	976.000,00	427.030,05739200	2,2855534010
187	06/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	28.684,05	0,00	12.550,15524300	2,2855534010
188	07/10/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	133.382,80	0,00	90.338,50946000	1,4764777590
189	07/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	7.087,66	0,00	3.100,69619400	2,2858285870
190	08/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	7.487,62	0,00	3.274,15199300	2,2868883350
191	09/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	11.000,00	4.804,93904000	2,2893110420
192	09/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.058.000,00	462.147,77310300	2,2893110420
193	09/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.000,00	436,81264000	2,2893110420
194	09/10/2020	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,00	31.027,52	12.126,86131350	2,5585779000
195	13/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	32.173,15	0,00	14.045,97002700	2,2905609180
196	15/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	51.000,00	22.260,51344800	2,2910522760
197	15/10/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	0,00	10.000.000,00	6.753.764,44665800	1,4806557260
198	15/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	3.900.000,00	0,00	1.702.274,55778900	2,2910522760
199	20/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	14.000,00	6.109,17833400	2,2916338720
200	20/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	5.300.929,11	0,00	2.313.165,80487300	2,2916338720
201	22/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	32.006,15	0,00	13.965,73772100	2,2917622140
202	23/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	70.000,00	30.544,48270700	2,2917395810
203	29/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	48.000,00	20.939,85276500	2,2922797280
204	29/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.879.000,00	2.128.448,78415300	2,2922797280
205	29/10/2020	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	15.796,57	0,00	6.891,20520800	2,2922797280
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 8.378.407,77

Value-At-Risk: 3,10%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	Artigo 7º VII, Alínea b	0,44	0,25	0,00	0,34	0,31	3.631.347,88	1,34
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,54	0,10	0,00	0,00	0,16	16.459.483,77	6,08
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	Artigo 7º I, Alínea b	0,69	NaN	0,00	-0,01	0,15	0,00	0,00
BB PREV IPCA I	Artigo 7º I, Alínea b	2,01	0,94	0,03	0,17	0,50	16.683.873,31	6,17
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	Artigo 7º VII, Alínea b	2,01	0,83	0,02	0,08	0,31	9.786.192,79	3,62
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,32	1,04	0,01	0,01	0,18	2.096.720,09	0,78
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,48	1,21	0,12	-0,11	-0,11	35.707.432,05	13,20
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,85	1,34	0,14	-0,08	-0,07	37.550.685,24	13,88
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	Artigo 8º IV, Alínea b	3,30	2,26	0,00	0,33	1,25	3.031.729,12	1,12
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	4,37	1,87	0,13	-0,10	-0,29	26.451.037,91	9,78
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,72	3,15	0,26	0,01	0,19	29.354.107,59	10,85
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	4,86	3,28	0,19	-0,01	0,10	20.914.678,84	7,73
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	Artigo 8º IV, Alínea b	19,42	2,68	0,00	-0,26	-4,87	1.273.127,74	0,47
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	19,88	10,10	0,21	-0,09	-1,73	6.141.280,77	2,27
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	19,96	10,49	0,52	-0,13	-2,34	21.018.677,41	7,77
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	20,36	12,29	0,31	-0,11	-2,00	7.575.678,31	2,80
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	21,83	9,93	0,38	-0,10	-2,02	11.564.935,54	4,28
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	24,07	10,63	0,14	-0,02	-0,31	3.803.051,13	1,41
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	25,19	11,25	0,65	-0,17	-4,17	17.238.902,68	6,37

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

No respectivo mês de outubro 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.