



LDB
EMPRESAS

DIADEMA
3º TRIMESTRE 2021



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 30.09.2021.

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

RENDA FIXA 71,06%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,48	0,99	1,12	23.167.741,43	9,74	1.170.815.240,32	1,98
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	4,02	0,67	-0,23	24.275.043,60	10,20	1.104.058.639,33	2,20
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,49	0,98	1,13	4.045.063,11	1,70	6.090.651.961,96	0,07
BB	BB	BB PREV IPCA I	1,59	1,30	2,44	16.969.594,23	7,13	515.171.032,99	3,29
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,68	-0,01	-0,70	25.673.684,42	10,79	8.672.013.980,14	0,30
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,43	0,35	-1,87	28.173.152,66	11,84	14.407.320.968,51	0,20
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,86	0,61	-0,07	122.304.279,45	51,42		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	5,55	-0,29	-1,88	0,00	0,00	1.126.747.978,22	0,00
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,18	0,46	1,31	10.740.835,76	4,52	5.468.058.659,45	0,20
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,64	1,05	1,05	21.894.667,44	9,20	1.161.932.475,65	1,88
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			3,29	0,66	-0,25	32.635.503,20	13,72		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	2,95	0,92	1,05	10.289.517,45	4,33	634.085.763,40	1,62
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	0,35	0,55	1,81	3.815.714,55	1,60	529.418.909,97	0,72
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			2,21	0,82	1,26	14.105.232,00	5,93		
Renda Fixa			2,83	0,64	0,03	169.045.014,65	71,06		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

21,55%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	19,65	-4,19	-13,08	8.902.328,32	3,74	1.594.005.198,12	0,56
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	20,91	-8,84	-18,94	5.947.662,28	2,50	2.403.304.462,99	0,25
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	20,34	-6,93	-12,94	7.696.536,03	3,24	1.069.194.291,65	0,72
TPE	DAYCOVAL	TARPON GT 30 FIC FIA	19,05	1,09	-6,41	3.743.474,01	1,57	309.178.071,40	1,21
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			18,88	-5,39	-13,58	26.290.000,64	11,05		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	13,92	-4,60	1,13	21.263.963,18	8,94	2.350.934.541,71	0,90
Sub-total Artigo 8º III			13,92	-4,60	1,13	21.263.963,18	8,94		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
PÁTRIA	PÁTRIA	PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	15,81	-0,71	-1,80	7.921,47	0,00	1.110.895,52	0,71
CEF	CEF	FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	98,58	-6,03	-12,41	11.503,34	0,00	1.127.496,83	1,02
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			128,15	-3,93	-8,77	19.424,81	0,01		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
RIO BRAVO	RIO BRAVO	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	30,07	23,44	1,61	2.506.710,52	1,05	64.937.296,84	3,86
BRPP	GERAÇÃO FUTURO	BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	8,15	-0,30	-0,54	1.182.357,60	0,50	354.102.384,87	0,33
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			22,75	15,90	1,45	3.689.068,12	1,55		

Renda Variável e Investimentos Estruturados

14,68 -3,61 -6,21 51.262.456,75 21,55

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

7,39%

Artigo 9º A, III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	18,31	0,50	9,62	17.567.155,39	7,39	3.893.001.873,31	0,45
Sub-total Artigo 9º A, III			18,31	0,50	9,62	17.567.155,39	7,39		
Investimentos no Exterior			15,58	0,50	9,62	17.567.155,39	7,39		
Total			5,30	-0,34	-1,17	237.874.626,79	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 1	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	122.304.279,45	51,42	15,00	60,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	32.635.503,20	13,72	1,00	10,00	40,00	0,00	45,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	14.105.232,00	5,93	0,00	3,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Fixa	169.045.014,65	71,06					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	26.290.000,64	11,05	2,00	16,00	25,00	0,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	21.263.963,18	8,94	2,00	8,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	19.424,81	0,01	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	3.689.068,12	1,55	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	51.262.456,75	21,55					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	17.567.155,39	7,39	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	17.567.155,39	7,39					10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,61 139,45	-0,07 -5,63	-0,07 -5,63	1,23 61,00	3,63 121,34	740.681,37	-107.926,73
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,66 151,49	-0,25 -20,12	-0,25 -20,12	1,26 62,71	3,30 110,27	209.615,12	-49.642,06
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,82 187,76	1,26 102,68	1,26 102,68	2,69 133,42	5,45 182,35	115.110,49	174.917,36
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-5,39 1,18	-13,58 -1,10	-13,58 -1,10	-5,71 -0,87	8,62 -8,69	-1.498.667,84	-4.129.788,95
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-4,60 1,97	1,13 13,61	1,13 13,61	9,92 14,77	30,75 13,44	-1.025.733,36	436.537,82
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-3,93 2,64	-8,77 3,70	-8,77 3,70	-61,80 -56,95	-73,87 -91,18	-794,64	-2.206,01
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	15,90 22,46	1,45 13,93	1,45 13,93	3,92 8,77	7,59 -9,72	599.630,92	69.204,78
Artigo 9º A, III % do CDI	0,50 113,57	9,62 786,32	9,62 786,32	7,13 353,74		86.994,02	825.231,65
DIADEMA (Total)						-773.163,92	-2.783.672,14

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV IPCA I	16.751.259,61	0,00	0,00	0,00	16.969.594,23	218.334,62	408.248,13
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	24.244.486,06	1.425.404,76	0,00	0,00	25.673.684,42	3.793,60	-179.828,23
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4.005.902,01	0,00	0,00	0,00	4.045.063,11	39.161,10	45.063,11
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	28.073.504,70	0,00	0,00	0,00	28.173.152,66	99.647,96	-547.538,57
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	22.941.512,45	0,00	0,00	0,00	23.167.741,43	226.228,98	257.351,65
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	27.121.528,49	0,00	-3.000.000,00	0,00	24.275.043,60	153.515,11	-91.222,82
					122.304.279,45	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	9.920.288,64	16.708.776,76	-15.934.411,06	0,00	10.740.835,76	46.181,42	140.038,18
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	0,00	21.668.162,86	0,00	0,00	21.894.667,44	226.504,58	226.504,58
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	21.731.233,74	0,00	-21.668.162,86	0,00	0,00	-63.070,88	-416.184,82
					32.635.503,20	0,00	0,00

Artigo 7º VII, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	10.195.332,65	0,00	0,00	0,00	10.289.517,45	94.184,80	107.236,50
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	3.794.788,86	0,00	0,00	0,00	3.815.714,55	20.925,69	67.680,86
					14.105.232,00	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	9.291.577,72	0,00	0,00	0,00	8.902.328,32	-389.249,40	-1.339.584,15
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	6.524.498,16	0,00	0,00	0,00	5.947.662,28	-576.835,88	-1.390.056,79
OCCAM FIC FIA	8.269.421,45	0,00	0,00	0,00	7.696.536,03	-572.885,42	-1.143.622,02
TARPON GT 30 FIC FIA	3.703.171,15	0,00	0,00	0,00	3.743.474,01	40.302,86	-256.525,99
					26.290.000,64	0,00	0,00

Artigo 8º III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	22.289.696,54	0,00	0,00	0,00	21.263.963,18	-1.025.733,36	436.537,82
					21.263.963,18	0,00	0,00

Artigo 8º IV, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	12.241,51	0,00	0,00	0,00	11.503,34	-738,17	-2.060,52
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	7.977,94	0,00	0,00	0,00	7.921,47	-56,47	-145,49
					19.424,81	0,00	0,00

Artigo 8º IV, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	2.539.030,23	0,00	0,00	0,00	635.501,20	2.506.710,52	603.181,49	75.248,78
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11	1.194.158,17	0,00	0,00	0,00	8.250,00	1.182.357,60	-3.550,57	-6.044,00
						3.689.068,12	0,00	0,00

Artigo 9º A, III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	17.480.161,37	0,00	0,00	0,00	17.567.155,39	86.994,02	825.231,65
					17.567.155,39	0,00	0,00

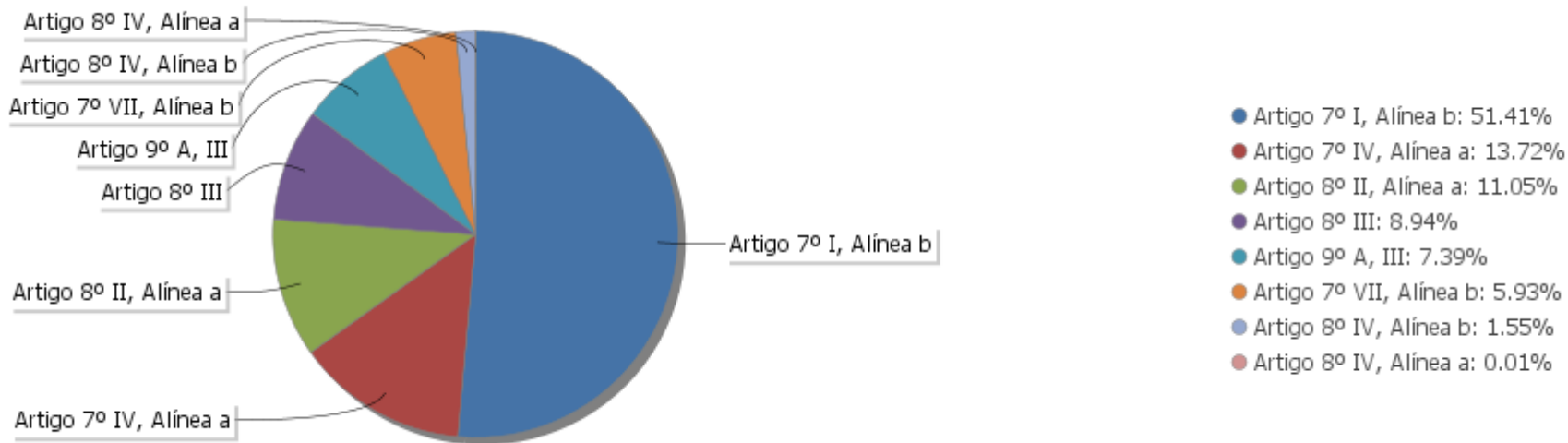
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

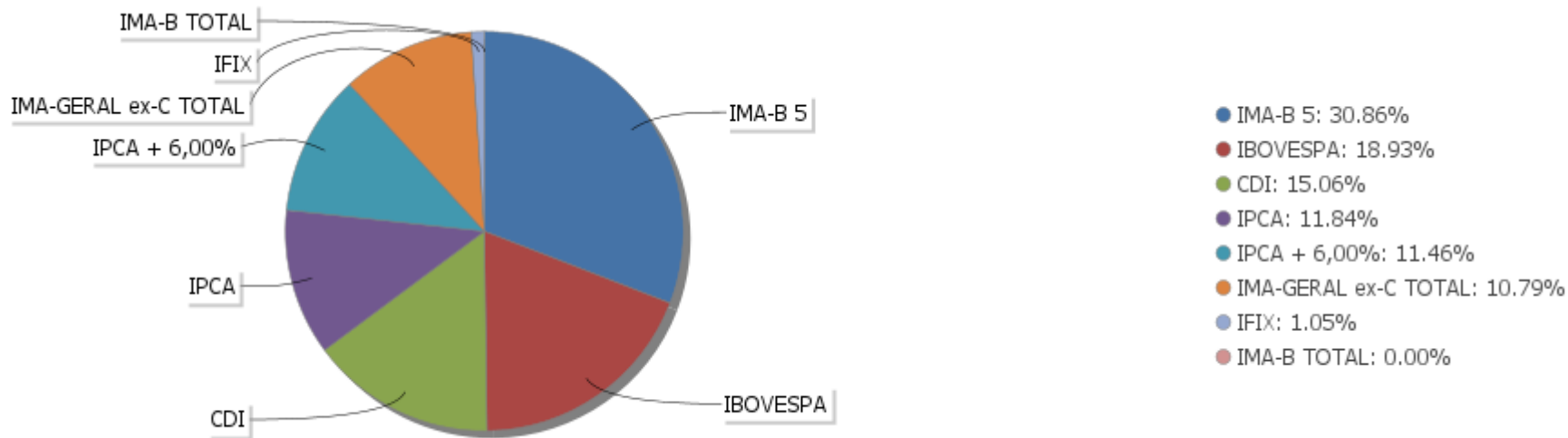
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	202.161.142,31	84,99	202.161.142,31	84,99
de 31 a 365 dias	22.917.256,51	9,63	225.078.398,82	94,62
acima de 365 dias	12.796.227,97	5,38	237.874.626,79	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

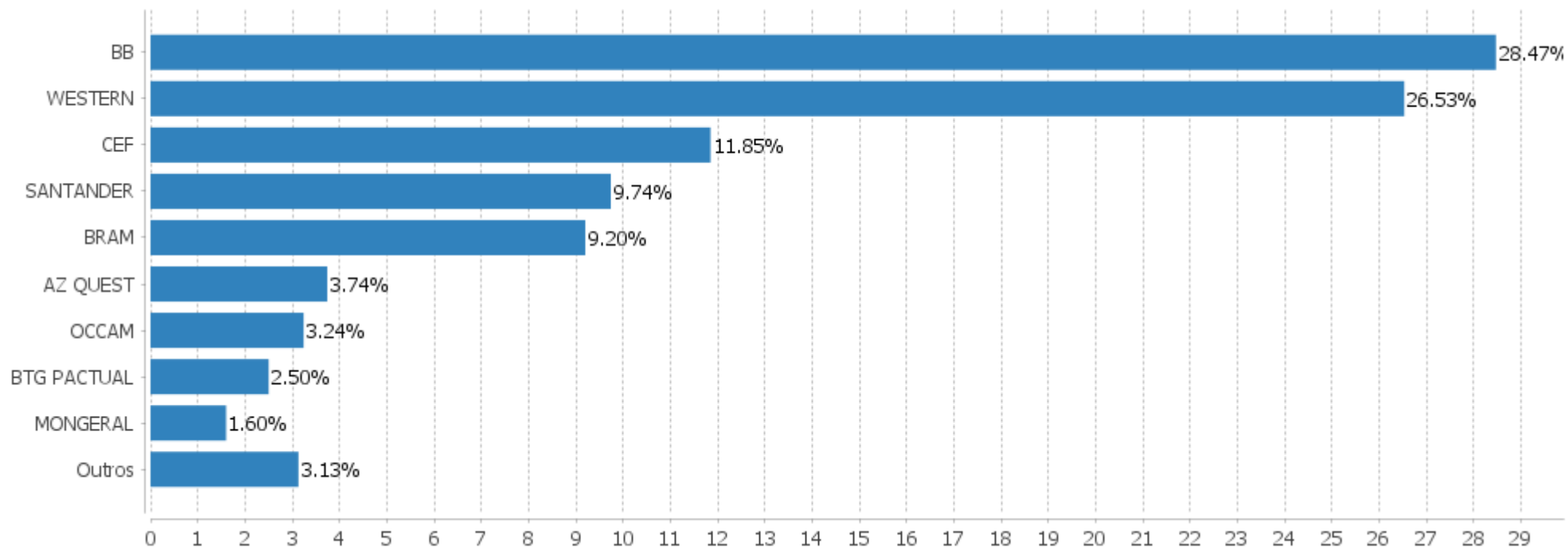


Alocação Por Estratégia



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
2021	-0,82	-0,99	0,86	1,54	0,90	0,39	-0,04	-0,79	-0,34				0,68
IPCA + 5,44%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,28	0,97	1,43	1,34	1,61				11,21
p.p. indexador	-1,49	-2,23	-0,56	0,81	-0,38	-0,59	-1,47	-2,13	-1,95				-10,53
2020	0,65	-1,49	-9,14	2,57	2,61	1,62	3,08	-0,83	-1,83	-0,62	3,93	3,52	3,39
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	1,86	10,64
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	1,66	-7,25
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 + 6,00%	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

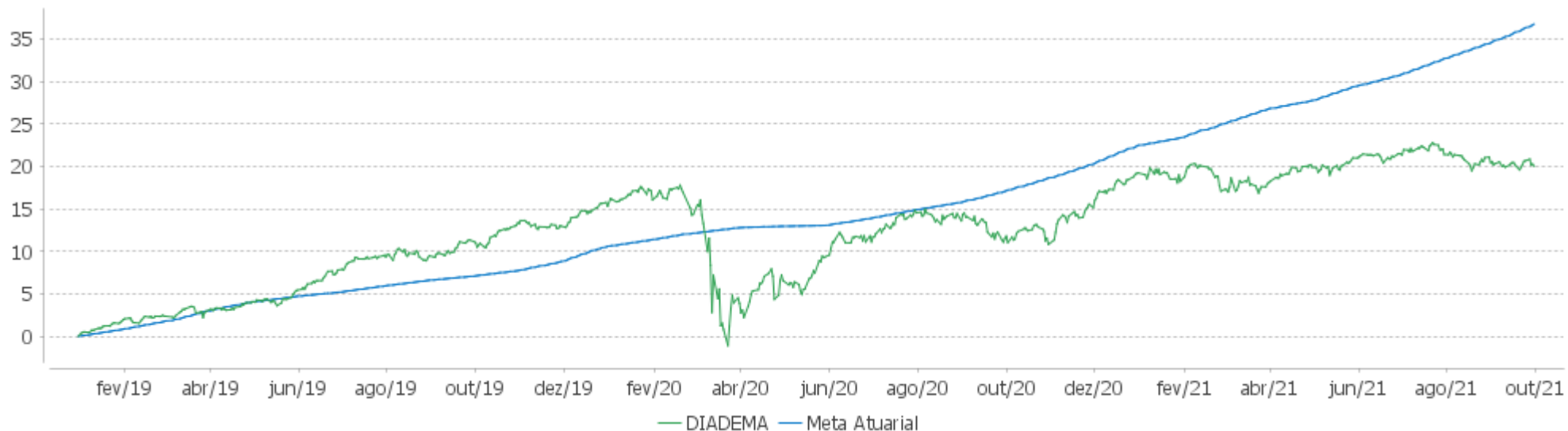
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	15	45,45
Meses abaixo - Meta Atuarial	18	54,55
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,93	2020-11
Menor rentabilidade da Carteira	-9,14	2020-03

Relatório

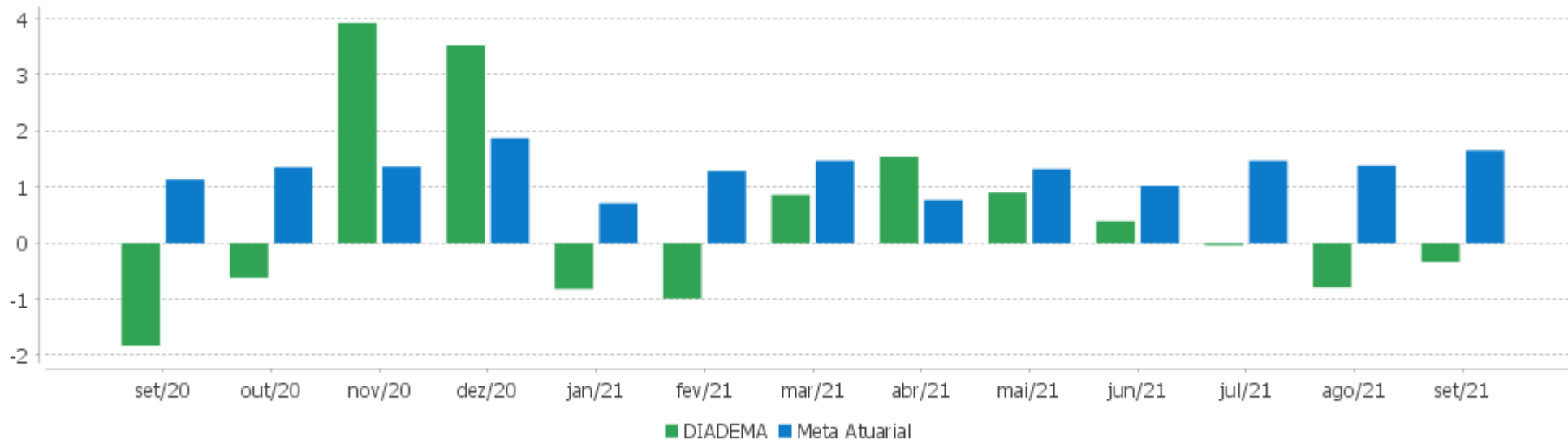
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	-1,17	4,44	-5,61	4,11
06 meses	1,64	7,58	-5,94	4,01
12 meses	7,64	16,34	-8,70	5,30
24 meses	7,99	27,08	-19,09	9,67
Desde 31/12/2018	20,02	36,07	-16,04	8,43

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,92 -0,73	1,05 -3,53	1,05 -3,53	2,51 -5,36	5,47 -11,36	12,48 -15,24	28,59 -10,69
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO % do CDI	0,55 125,83	1,81 147,66	1,81 147,66	3,18 157,86	5,40 180,52	4,88 73,35	11,69 87,62
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,20 -0,07	-1,80 -0,21	-1,80 -0,21	0,31 -0,21	3,79 -0,92	5,90 -1,02	39,52 -0,94
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	0,95 -0,05	1,01 -0,18	1,01 -0,18	2,43 -0,21	4,98 -0,97	12,47 -1,16	29,72 -1,40
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,46 104,77	1,31 106,72	1,31 106,72	2,13 105,74	3,23 107,92	6,30 94,70	12,80 95,91
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	0,67 -0,33	-0,23 -1,41	-0,23 -1,41	1,10 -1,54	2,93 -3,02	11,68 -1,94	34,52 3,40
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,99 -0,02	1,12 -0,06	1,12 -0,06	2,52 -0,12	5,72 -0,23	13,16 -0,46	30,33 -0,79
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,30 -0,35	2,44 -2,14	2,44 -2,14	4,01 -3,86	7,77 -9,06	16,25 -11,48	37,46 -1,82
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,01 -0,03	-0,70 -0,28	-0,70 -0,28	0,51 -0,38	1,75 -0,30	5,52 -0,51	23,63 0,04
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,35 -0,81	-1,87 -4,89	-1,87 -4,89	-0,98 -5,73	0,85 -9,39	7,32 -6,38	26,96 9,96
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,98 -0,02	1,11 -0,08	1,11 -0,08	2,49 -0,15	5,70 -0,25	13,04 -0,58	30,18 -0,94
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	-4,60 -1.050,12	1,13 92,43	1,13 92,43	9,92 492,62	30,75 1.028,32	43,09 647,50	52,00 389,60
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-8,84 -2,27	-18,94 -6,47	-18,94 -6,47	-14,07 -9,22	-4,83 -22,14	0,46 -5,50	52,93 13,05
TARPON GT 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	1,09 7,66	-6,41 6,07	-6,41 6,07	12,80 17,64	44,83 27,52		
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-4,19 2,38	-13,08 -0,60	-13,08 -0,60	-1,14 3,71	15,16 -2,15	14,06 8,11	80,26 40,38
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-6,93 -0,36	-12,94 -0,46	-12,94 -0,46	-6,39 -1,54	11,87 -5,44	5,28 -0,67	48,86 8,98
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	-6,03	-12,41	-12,41	-67,85	-67,11	-70,89	-90,43

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-7,68	-16,98	-16,98	-75,72	-83,94	-98,62	-129,71
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP % do CDI	-0,71 -161,52	-1,80 -147,48	-1,80 -147,48	-13,95 -692,39	-29,78 -995,87	-99,81 -1.499,98	-99,81 -747,74
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO Var. IFIX p.p.	22,77 24,01	1,61 3,03	1,61 3,03	6,39 10,99	12,56 15,40	13,35 12,18	28,57 1,36
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11 Var. IBOVESPA p.p.	-0,30 6,26	-0,54 11,94	-0,54 11,94	-3,52 1,33	-5,05 -22,36	-4,73 -10,68	14,51 -25,37
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	0,50 7,07	9,62 22,09	9,62 22,09	7,13 11,97	17,85 0,54	105,44 99,49	118,01 78,14
DIADEMA Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,34 -1,99	-1,17 -5,75	-1,17 -5,75	1,64 -6,23	7,64 -9,19	7,99 -19,74	
CDI	0,44	1,22	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35
IBOVESPA	-6,57	-12,48	-12,48	-4,85	17,31	5,95	39,87
INPC + 6,00%	1,69	4,69	4,69	8,28	17,40	29,29	41,02
IPCA + 6,00%	1,65	4,58	4,58	7,87	16,83	27,73	39,28

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,40	0,96	0,96	1,65	2,49	7,15	15,12	22,90	38,45
IRF-M 1+	-0,73	-2,65	-2,65	-1,15	-3,14	4,23	25,92	32,64	58,13
IRF-M TOTAL	-0,33	-1,39	-1,39	-0,15	-1,02	5,48	23,23	30,30	53,03
IMA-B 5	1,00	1,18	1,18	2,64	5,95	13,62	31,12	39,68	58,47
IMA-B 5+	-1,26	-4,19	-4,19	-1,61	3,20	1,48	46,98	45,78	70,99
IMA-B TOTAL	-0,13	-1,59	-1,59	0,52	4,71	6,92	40,46	44,04	66,75
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,02	-0,42	-0,42	0,89	2,05	6,02	23,59	29,99	49,60
IMA-GERAL TOTAL	-0,01	-0,52	-0,52	0,96	2,48	6,93	24,87	31,60	51,09
IDKA 2	1,10	1,18	1,18	3,12	6,21	14,71	29,45	40,48	59,67
IDKA 20	-3,03	-8,65	-8,65	-5,13	2,03	-7,04	59,98	49,40	80,44
CDI	0,44	1,22	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35	20,90	34,86

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-6,57	-12,48	-12,48	-4,85	17,31	5,95	39,87	49,38	90,14
IBRX 100	-6,99	-13,61	-13,61	-5,31	17,82	7,71	45,23	53,72	95,90
IBRX 50	-7,47	-14,15	-14,15	-5,58	18,46	6,59	37,53	47,56	87,32
SMALL CAP	-6,43	-15,22	-15,22	-4,70	15,75	13,69	78,82	65,15	133,65
IFIX	-1,24	-1,42	-1,42	-4,61	-2,83	1,17	27,21	22,27	49,54
Índice Consumo - ICON	-5,95	-14,34	-14,34	-7,48	-1,67	-2,69	50,48	25,77	51,19
Índice Dividendos - IDIV	-4,48	-6,59	-6,59	-1,51	19,58	7,85	64,83	56,04	121,60

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	1,16	3,02	3,02	4,75	10,25	13,70	16,99	22,29	25,39
INPC	1,20	3,13	3,13	5,14	10,78	15,09	18,46	23,16	25,17
IGPM	-0,64	0,80	0,80	7,15	24,86	47,25	52,21	67,49	65,07
SELIC	0,44	1,22	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35	20,91	34,89

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	0,73	8,99	8,99	3,52	23,52	89,01	100,82	193,57	232,88
MSCI ACWI	1,23	7,16	7,16	0,61	21,06	78,00	83,86	150,21	184,12
MSCI World	1,22	8,36	8,36	2,09	22,47	80,14	87,02	158,04	191,94

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,49	4,07	4,07	6,84	14,64	22,96	31,56	42,95	52,39
IPCA + 5,00%	1,57	4,32	4,32	7,36	15,74	25,33	35,38	48,50	59,82
IPCA + 5,50%	1,61	4,45	4,45	7,61	16,29	26,53	37,32	51,33	63,64
IPCA + 5,89%	1,64	4,55	4,55	7,81	16,71	27,46	38,84	53,57	66,67
IPCA + 6,00%	1,65	4,58	4,58	7,87	16,83	27,73	39,28	54,21	67,53
INPC + 4,00%	1,53	4,18	4,18	7,24	15,20	24,46	33,20	43,97	52,12
INPC + 6,00%	1,69	4,69	4,69	8,28	17,40	29,29	41,02	55,31	67,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
132	05/07/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	45.000,00	19.285,88425800	2,3333127690
147	05/07/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.182.752,87	506.898,55458500	2,3333127690
148	06/07/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.368,13	1.014,75049300	2,3337066750
133	07/07/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	4.284,26361200	2,3341234120
150	07/07/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.094.731,62	469.011,88445000	2,3341234120
149	07/07/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.000,00	856,85272200	2,3341234120
138	07/07/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	32.057,95	0,00	13.734,47086600	2,3341234120
131	08/07/2021	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	133.531,87	0,00	87.976,79153400	1,5178079090
139	08/07/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	10.248,80	0,00	4.390,12127500	2,3345140960
140	13/07/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.000.000,00	0,00	1.712.603,06807000	2,3356258520
130	13/07/2021	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	4.000.000,00	2.630.146,20841300	1,5208280000
134	15/07/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	21.399,35954500	2,3365185250
151	15/07/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.630.000,00	2.837.555,07566600	2,3365185250
141	16/07/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	42.137,65	0,00	18.031,05119500	2,3369491630
142	19/07/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	185.256,59	0,00	79.258,35089100	2,3373762880
143	20/07/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	7.129.804,64	0,00	3.049.703,76222300	2,3378679360
135	21/07/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	4.276,55753500	2,3383293500
144	21/07/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	16.303,66	0,00	6.972,35400100	2,3383293500
145	22/07/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	14.200,86	0,00	6.071,86045200	2,3387988100
136	23/07/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	140.000,00	59.849,09497900	2,3392166590
146	28/07/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.220.156,97	0,00	1.803.139,65868300	2,3404493100
137	30/07/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	45.000,00	19.219,88015800	2,3413257330
152	30/07/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.248,28	2.241,58472500	2,3413257330
153	30/07/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.158.062,16	2.203.051,92366000	2,3413257330
154	02/08/2021	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4.000.000,00	0,00	191.551,46681500	20,8821162610
156	02/08/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.000.000,00	1.708.014,09976900	2,3419010420
157	05/08/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	40.000,00	17.072,14513700	2,3429978880
172	05/08/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.230,92	952,16475100	2,3429978880

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
173	05/08/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.198.402,87	511.482,69323600	2,3429978880
158	06/08/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	15.000,00	6.400,90436600	2,3434188580
166	06/08/2021	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	133.531,87	0,00	88.443,92962300	1,5097912380
174	06/08/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.193.148,43	509.148,59967400	2,3434188580
159	12/08/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.286.000,00	548.293,40771300	2,3454595330
175	12/08/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.483.440,78	2.337.896,13681100	2,3454595330
165	16/08/2021	BB PREV IPCA I	0,00	457.343,77	181.965,34540500	2,5133564250
155	17/08/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.231.000,00	0,00	524.502,35593500	2,3469865980
167	17/08/2021	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	0,00	1.231.000,00	820.454,35550500	1,5003881590
168	17/08/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	475.453,43	0,00	202.580,37706900	2,3469865980
164	19/08/2021	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	0,00	7.000.000,00	1.502.646,98643270	4,6584461000
170	20/08/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	125.745,23	0,00	53.544,60381300	2,3484202150
169	20/08/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	7.122.596,49	0,00	3.032.931,00804700	2,3484202150
160	23/08/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	4.257,21425100	2,3489538960
163	23/08/2021	WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	7.000.000,00	0,00	984,26547850	7.111,9023809000
161	25/08/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	128.000,00	54.467,74270100	2,3500147730
171	27/08/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.299.063,51	0,00	1.828.822,97310100	2,3507269830
162	30/08/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	45.000,00	19.138,57610900	2,3512720980
176	30/08/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.171.192,13	2.199.316,75895700	2,3512720980
201	02/09/2021	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	19.582.088,49	0,00	9.484.615,75346770	2,0646159000
200	02/09/2021	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	0,00	21.668.162,86	4.354.039,86978890	4,9765651000
190	03/09/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	40.000,00	16.996,87460200	2,3533738370
184	03/09/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.255.362,50	533.430,97482600	2,3533738370
202	03/09/2021	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2.086.074,37	0,00	1.010.173,21964520	2,0650660000
191	08/09/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	4.247,46821900	2,3543436900
199	08/09/2021	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	1.425.404,76	0,00	949.364,13522200	1,5014310180
185	08/09/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.216.164,60	516.562,04876400	2,3543436900
203	08/09/2021	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	0,00	3.000.000,00	1.253.871,01328570	2,3925906000
177	09/09/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	3.014.159,07	0,00	1.280.098,37727400	2,3546308030
192	10/09/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.000,00	849,18929400	2,3551874880

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

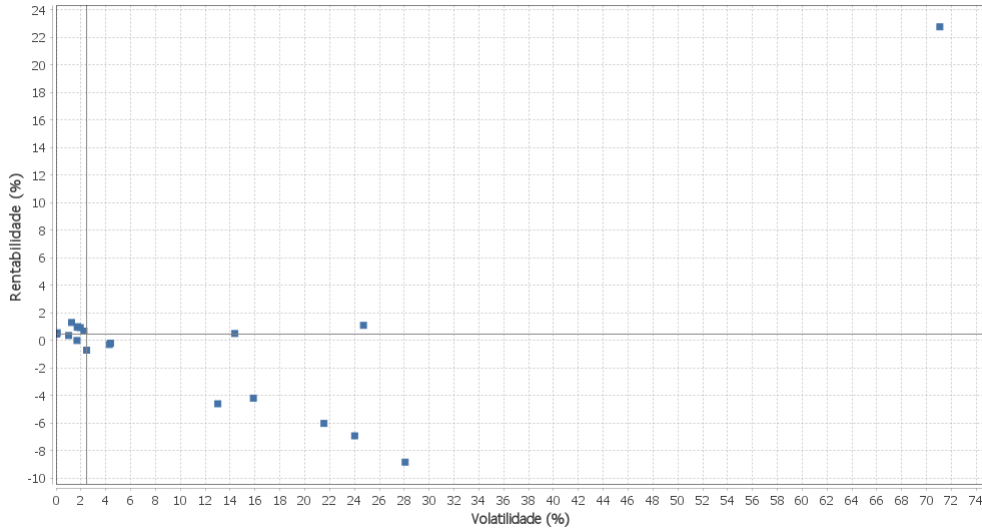
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
193	14/09/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.000,00	2.121,90333600	2,3563750130
194	15/09/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	55.000,00	23.336,22923800	2,3568503480
178	15/09/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	25.000,00	0,00	10.607,37692600	2,3568503480
186	15/09/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.719.546,35	2.851.070,43631500	2,3568503480
179	17/09/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	125.745,23	0,00	53.331,20265000	2,3578172580
180	20/09/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	7.541.468,33	0,00	3.197.754,79178800	2,3583635460
195	22/09/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.000,00	2.119,22594300	2,3593520160
181	23/09/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	25.006,29	0,00	10.596,79237700	2,3597980510
196	24/09/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.000,00	2.118,29089500	2,3603934720
197	24/09/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	155.000,00	65.667,01774000	2,3603934720
182	27/09/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	610.501,20	0,00	258.583,07764500	2,3609480000
183	28/09/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.366.896,64	0,00	1.849.280,46366000	2,3614031110
198	30/09/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	45.000,00	19.046,87403100	2,3625924090
189	30/09/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.000.000,00	0,00	423.263,86734700	2,3625924090
187	30/09/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.000.000,00	423.263,86734800	2,3625924090
188	30/09/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.421.337,61	2.294.656,32300700	2,3625924090

Total

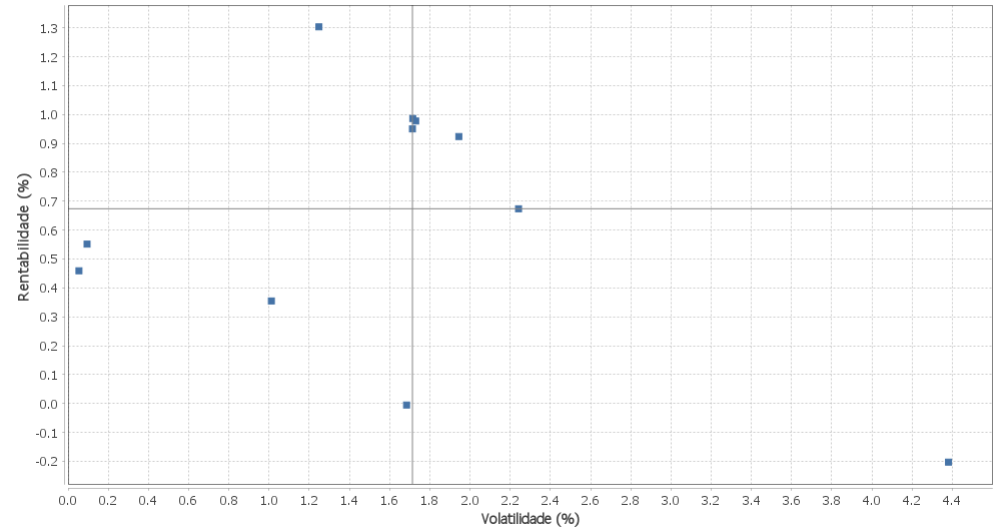
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

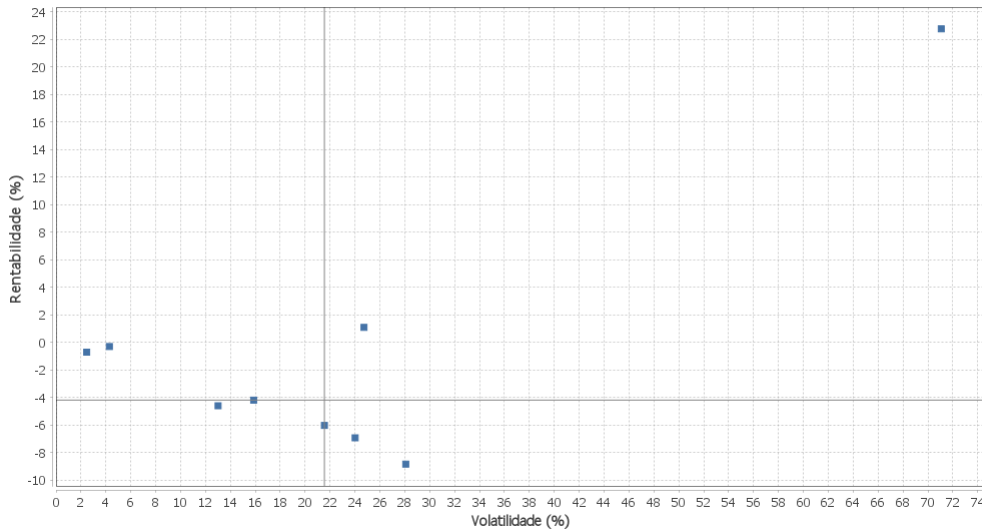
DIADEMA - No Mês



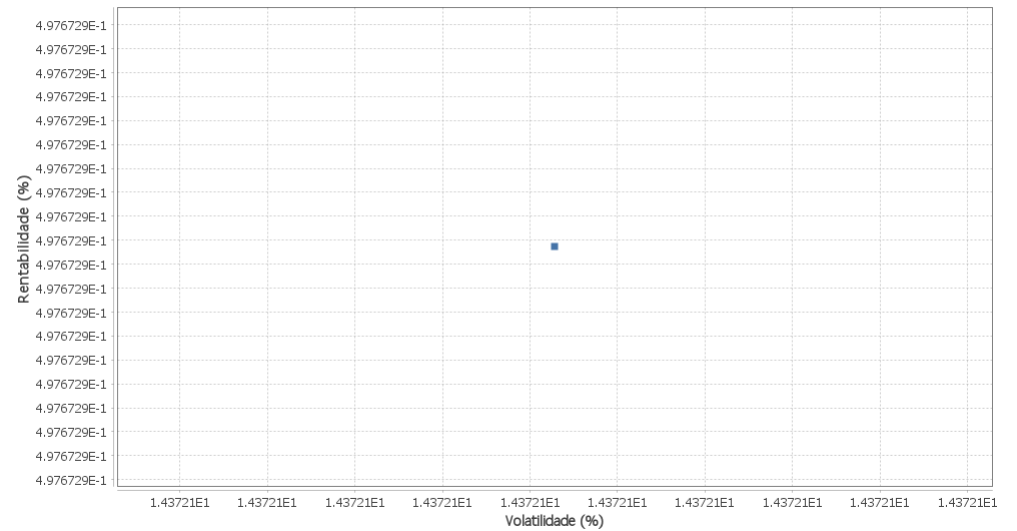
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 4.375.415,68

Value-At-Risk: 1,84%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,05	0,03	0,00	0,39	0,46	10.740.835,76	4,52
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	Artigo 7º VII, Alínea b	0,09	0,09	0,00	1,20	0,55	3.815.714,55	1,60
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,01	1,46	0,10	-0,08	0,35	28.173.152,66	11,84
BB PREV IPCA I	Artigo 7º I, Alínea b	1,25	0,55	0,01	0,69	1,30	16.969.594,23	7,13
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,68	1,11	0,08	-0,26	-0,01	25.673.684,42	10,79
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	Artigo 7º IV, Alínea a	1,71	1,26	0,07	0,30	0,95	21.894.667,44	9,20
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,72	1,24	0,07	0,32	0,99	23.167.741,43	9,74
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,73	1,25	0,01	0,31	0,98	4.045.063,11	1,70
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	Artigo 7º VII, Alínea b	1,94	1,27	0,03	0,25	0,92	10.289.517,45	4,33
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,24	1,50	0,10	0,11	0,67	24.275.043,60	10,20
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	Artigo 8º IV, Alínea a	2,46	0,61	0,00	-0,47	-0,71	7.921,47	0,00
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11	Artigo 8º IV, Alínea b	4,28	0,35	0,00	-0,17	-0,30	1.182.357,60	0,50
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	4,38	NaN	0,00	-0,15	-0,20	0,00	0,00
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	13,01	6,30	0,42	-0,39	-4,60	21.263.963,18	8,94
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	14,37	7,04	0,14	0,00	0,50	17.567.155,39	7,39
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	15,87	7,99	0,25	-0,29	-4,19	8.902.328,32	3,74
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	Artigo 8º IV, Alínea a	21,55	5,17	0,00	-0,30	-6,03	11.503,34	0,00
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	24,01	9,59	0,25	-0,31	-6,93	7.696.536,03	3,24
TARPON GT 30 FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	24,72	8,61	0,08	0,03	1,09	3.743.474,01	1,57
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	28,08	10,69	0,21	-0,33	-8,84	5.947.662,28	2,50
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	Artigo 8º IV, Alínea b	71,07	2,08	0,00	0,31	22,77	2.506.710,52	1,05