



**LDB**  
EMPRESAS

**DIADEMA**  
ABRIL 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 30.04.2021.

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

70,08%

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	2,49	0,85	0,66	2.176.652,88	0,85	1.203.625.509,04	0,18
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	6,03	0,63	-2,26	20.500.341,08	7,97	1.159.872.469,58	1,77
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	4,50	1,07	-1,47	27.296.298,99	10,61	1.289.613.390,80	2,12
BB	BB	BB PREV IPCA I	1,86	0,41	1,09	16.830.994,41	6,54	510.961.930,99	3,29
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	3,06	0,62	-1,27	26.177.550,84	10,17	9.467.835.833,78	0,28
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,49	0,66	0,48	36.650.945,00	14,24	15.772.466.647,51	0,23
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>3,41</b>	<b>0,70</b>	<b>-0,64</b>	<b>129.632.783,20</b>	<b>50,37</b>		

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	BRADERSCO	BRADERSCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	6,32	0,70	-2,76	21.771.083,22	8,46	1.865.646.887,17	1,17
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,18	0,20	0,70	15.103.863,79	5,87	3.508.946.195,72	0,43
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>3,60</b>	<b>0,47</b>	<b>-1,45</b>	<b>36.874.947,01</b>	<b>14,33</b>		

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	2,77	0,97	0,19	10.135.684,56	3,94	627.648.909,18	1,61
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	0,48	0,47	1,32	3.715.555,52	1,44	218.524.477,56	1,70
<b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b</b>			<b>2,10</b>	<b>0,84</b>	<b>0,49</b>	<b>13.851.240,08</b>	<b>5,38</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>3,33</b>	<b>0,67</b>	<b>-0,71</b>	<b>180.358.970,29</b>	<b>70,08</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

25,95%

## 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	21,99	1,67	-1,27	14.001.083,69	5,44	1.480.903.129,89	0,95
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	22,14	6,93	6,51	9.628.963,59	3,74	1.608.800.534,35	0,60
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	22,16	0,99	-0,48	6.990.223,52	2,72	2.879.178.885,72	0,24
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	22,59	3,51	0,72	4.718.845,31	1,83	1.157.154.321,35	0,41
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>22,69</b>	<b>3,16</b>	<b>0,74</b>	<b>35.339.116,11</b>	<b>13,73</b>		

## 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	17,48	5,42	12,41	26.988.376,06	10,49	1.716.865.745,89	1,57
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>17,48</b>	<b>5,42</b>	<b>12,41</b>	<b>26.988.376,06</b>	<b>10,49</b>		

## 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 FIP	542,13	-1,69	-14,22	9.049,83	0,00	1.267.688,77	0,71
CEF	CEF	FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	11,19	-0,72	-36,70	80.791,38	0,03	2.927.459,72	2,76
<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a</b>			<b>271,02</b>	<b>-0,82</b>	<b>-34,18</b>	<b>89.841,21</b>	<b>0,03</b>		

## 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	27,38	2,47	3,03	3.109.475,07	1,21	64.366.133,81	4,83
BRPP	GERAÇÃO FUTURO	BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	8,39	0,09	-0,02	1.269.218,61	0,49	380.116.251,45	0,33
<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b</b>			<b>19,37</b>	<b>1,77</b>	<b>2,13</b>	<b>4.378.693,68</b>	<b>1,70</b>		

Renda Variável e Investimentos Estruturados

18,14

3,96

4,25

66.796.027,06

25,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,96%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	22,17	2,32	2,00	10.199.579,18	3,96	3.497.472.125,46	0,29
<b>Sub-total Artigo 9º A, III</b>			<b>22,17</b>	<b>2,32</b>	<b>2,00</b>	<b>10.199.579,18</b>	<b>3,96</b>		
Investimentos no Exterior			19,86	2,32	2,00	10.199.579,18	3,96		
Total			6,44	1,54	0,57	257.354.576,53	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
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	129.632.783,20	50,37	15,00	60,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	36.874.947,01	14,33	1,00	10,00	40,00	0,00	45,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	13.851.240,08	5,38	0,00	3,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>180.358.970,29</b>	<b>70,08</b>					100,00
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	35.339.116,11	13,73	2,00	16,00	25,00	0,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	26.988.376,06	10,49	2,00	8,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	89.841,21	0,03	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	4.378.693,68	1,70	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>66.796.027,06</b>	<b>25,95</b>					35,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	10.199.579,18	3,96	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>10.199.579,18</b>	<b>3,96</b>					10,00

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	0,70 338,83	-0,64 -92,46	-0,30 -54,91	3,09 305,73	6,61 308,10	906.534,89	-835.803,73
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,47 227,68	-1,45 -208,67	-0,94 -173,59	2,31 228,70	5,18 241,51	188.050,99	-483.760,24
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,84 403,70	0,49 71,00	0,35 64,91	3,23 319,70	7,92 369,27	115.225,64	67.982,03
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	3,16 1,22	0,74 0,85	3,57 0,25	22,08 -4,47	37,04 -10,64	1.083.083,66	-689.721,27
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	5,42 3,48	12,41 12,51	12,59 9,26	28,40 1,85	43,16 -4,53	1.387.123,51	2.979.042,64
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,82 -2,76	-34,18 -34,08	-33,51 -36,84	-34,85 -61,40	-94,68 -142,37	-741,57	-4.634,56
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	1,77 -0,17	2,13 2,23	3,44 0,12	6,03 -20,51	9,66 -38,02	76.310,07	91.418,85
Artigo 9º A, III % do CDI	2,32 1.116,47	2,00 835,06				231.262,36	199.579,18
<b>DIADEMA (Total)</b>						<b>3.986.849,55</b>	<b>1.324.102,90</b>

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV IPCA I	16.762.499,62	0,00	0,00	0,00	16.830.994,41	68.494,79	184.908,97
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	25.881.830,13	133.852,46	0,00	0,00	26.177.550,84	161.868,25	-328.399,45
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	36.408.996,98	0,00	0,00	0,00	36.650.945,00	241.948,02	175.276,82
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2.158.207,51	0,00	0,00	0,00	2.176.652,88	18.445,37	14.291,22
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	20.372.513,11	0,00	0,00	0,00	20.500.341,08	127.827,97	-474.707,70
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	27.008.348,50	0,00	0,00	0,00	27.296.298,99	287.950,49	-407.173,59
					129.632.783,20	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	21.259.193,86	8.036.046,09	-14.228.729,91	0,00	15.103.863,79	37.353,75	135.005,43
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	21.620.385,98	0,00	0,00	0,00	21.771.083,22	150.697,24	-618.765,67
					36.874.947,01	0,00	0,00

## Artigo 7º VII, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	10.037.911,57	0,00	0,00	0,00	10.135.684,56	97.772,99	19.658,42
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	3.698.102,87	0,00	0,00	0,00	3.715.555,52	17.452,65	48.323,61
					13.851.240,08	0,00	0,00

## Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	9.004.771,52	0,00	0,00	0,00	9.628.963,59	624.192,07	588.376,36
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	6.921.397,96	0,00	0,00	0,00	6.990.223,52	68.825,56	-33.462,73
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	13.771.155,05	0,00	0,00	0,00	14.001.083,69	229.928,64	-180.140,18
OCCAM FIC FIA	4.558.707,92	0,00	0,00	0,00	4.718.845,31	160.137,39	33.598,09
					35.339.116,11	0,00	0,00

## Artigo 8º III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	25.601.252,55	0,00	0,00	0,00	26.988.376,06	1.387.123,51	2.979.042,64
					26.988.376,06	0,00	0,00

## Artigo 8º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	81.377,23	0,00	0,00	0,00	80.791,38	-585,85	-3.134,28
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	9.205,55	0,00	0,00	0,00	9.049,83	-155,72	-1.500,28
					89.841,21	0,00	0,00



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Artigo 8º IV, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	3.059.335,95	0,00	0,00	0,00	25.000,00	3.109.475,07	75.139,12	91.342,38
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	1.276.597,66	0,00	0,00	0,00	8.550,00	1.269.218,61	1.170,95	76,47
						4.378.693,68	0,00	0,00

Artigo 9º A, III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	9.968.316,82	0,00	0,00	0,00	10.199.579,18	231.262,36	199.579,18
					10.199.579,18	0,00	0,00

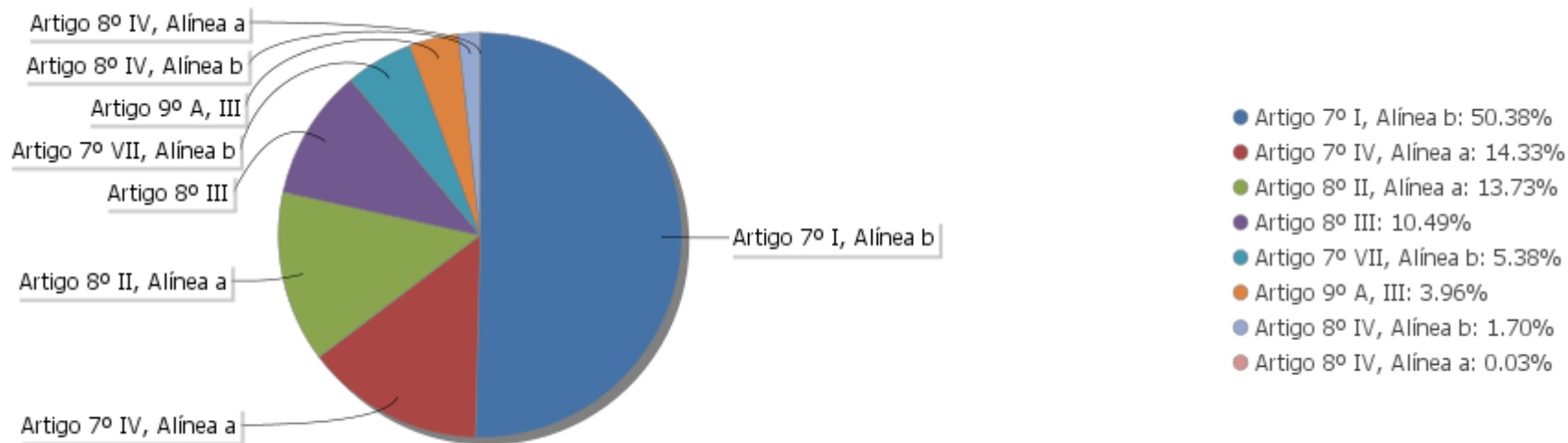
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

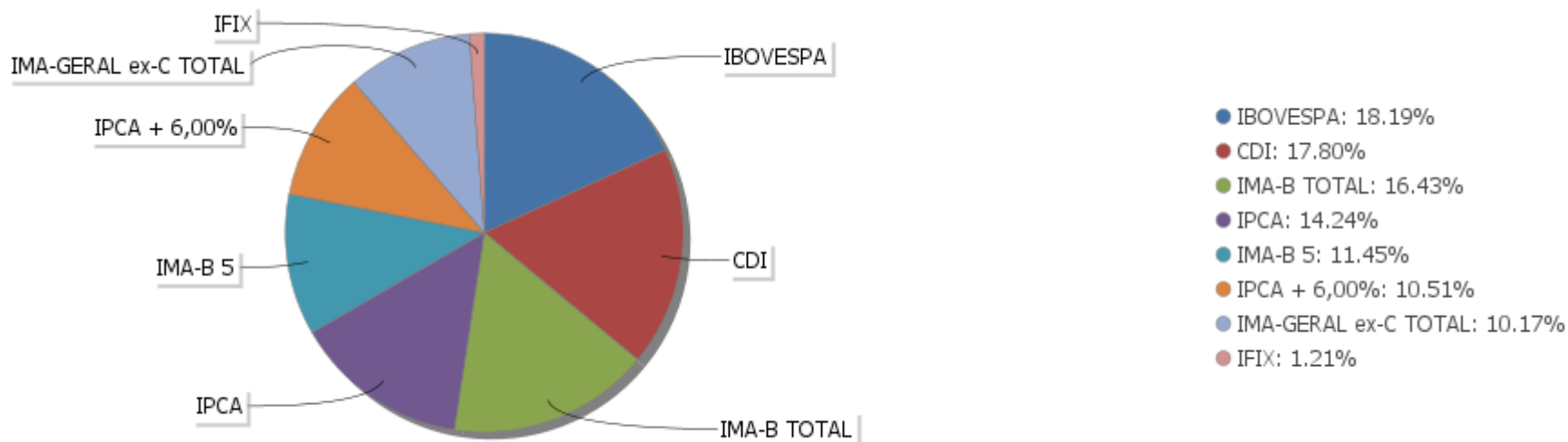
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	220.288.198,97	85,60	220.288.198,97	85,60
de 31 a 365 dias	6.990.223,52	2,72	227.278.422,49	88,31
acima de 365 dias	30.076.154,04	11,69	257.354.576,53	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

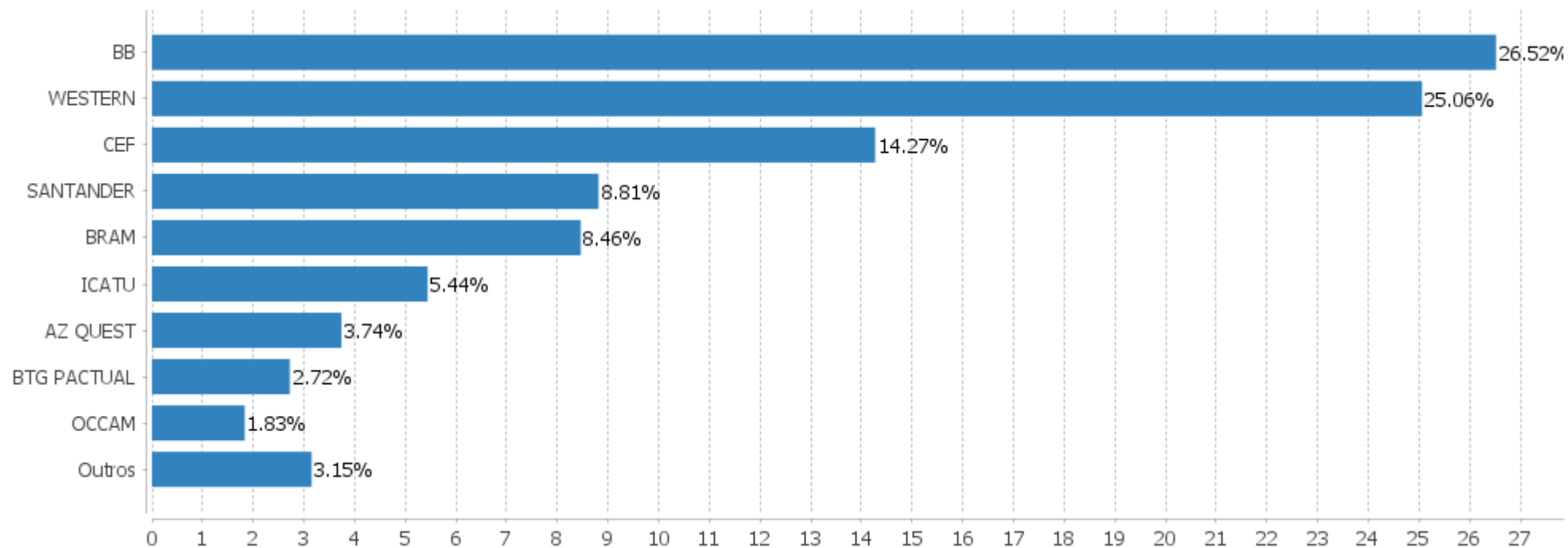


Alocação Por Estratégia



## 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									0,57
IPCA + 5,44%	0,67	1,24	1,42	0,73									4,13
p.p. indexador	-1,49	-2,23	-0,56	0,81									-3,55
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

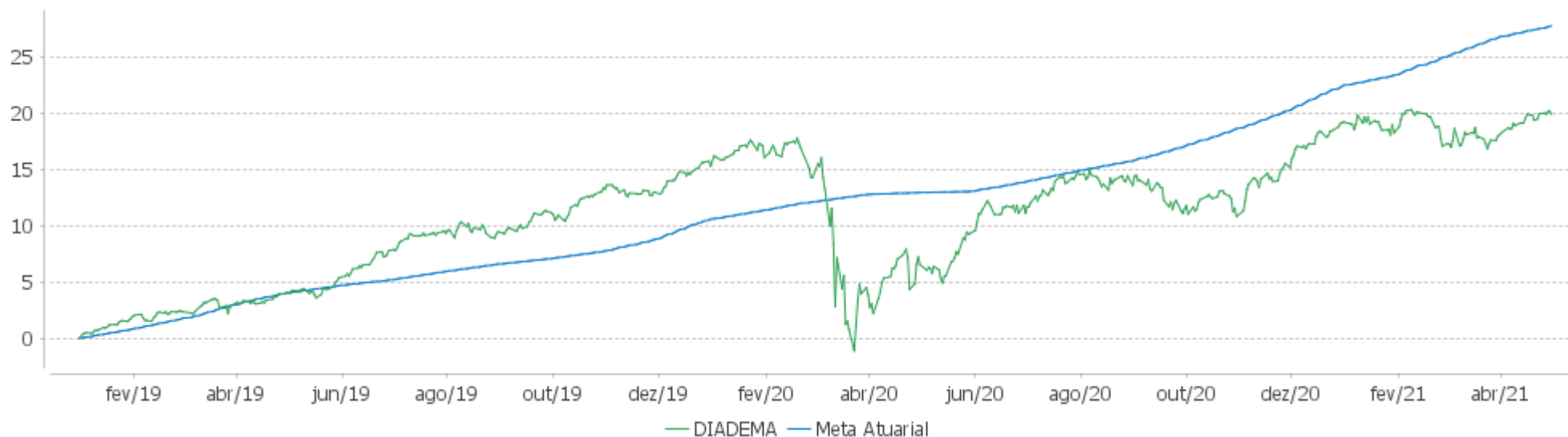
**Performance Sobre a Meta Atuarial**

**Relatório**

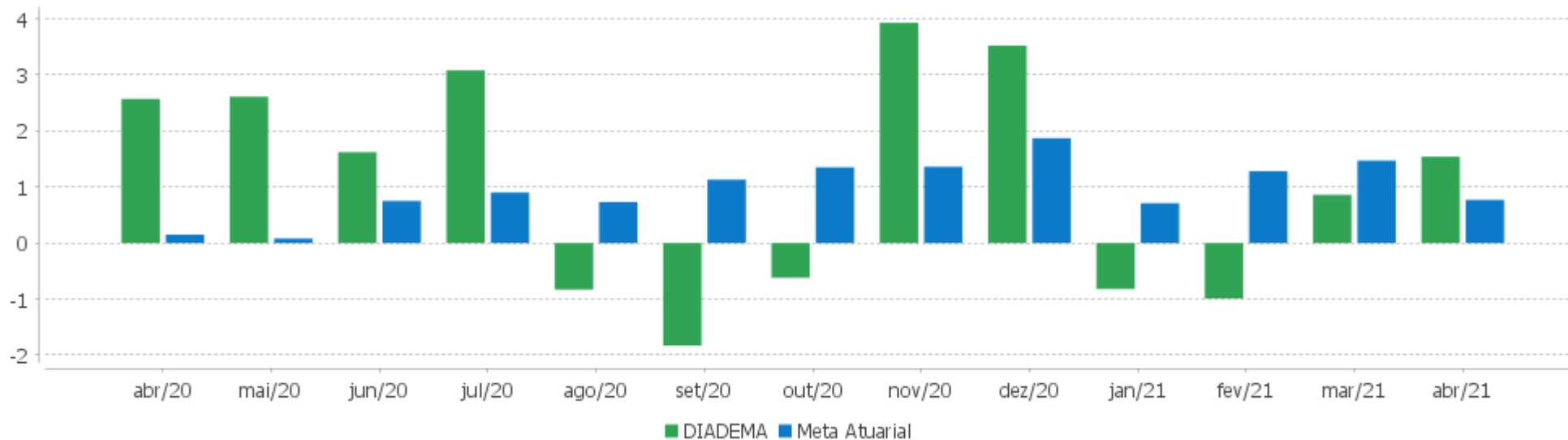
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	15	53,57	03 meses	1,40	3,43	-2,03	5,99
Meses abaixo - Meta Atuarial	13	46,43	06 meses	8,20	7,49	0,71	5,96
			12 meses	12,53	12,83	-0,31	6,44
			24 meses	15,20	22,46	-7,26	9,63
Maior rentabilidade da Carteira	3,93	2020-11	Desde 31/12/2018	19,90	27,40	-7,50	9,00
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.	1,07 0,19	-1,47 -2,19	-0,81 -1,43	3,20 -0,72	8,09 -0,82	20,45 2,09	33,78 3,66
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,85 -0,02	0,66 -0,06	0,58 -0,04	3,81 -0,11	8,67 -0,24	17,88 -0,48	29,34 -0,79
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,41 -0,37	1,09 -3,21	0,80 -2,77	3,53 -4,17	9,45 -3,66	19,60 -3,21	32,07 -4,47
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,62 0,13	-1,27 -0,11	-0,72 0,00	1,94 0,29	4,05 0,23	12,99 0,52	24,29 0,70
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,66 0,35	0,48 -1,89	0,46 -1,66	2,64 -2,03	4,63 -2,13	18,72 9,40	30,38 15,66
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,63 -0,02	-2,26 -0,09	-1,39 -0,06	4,48 -0,14	9,33 -0,34	18,48 -0,98	36,61 -1,48
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,70 0,05	-2,76 -0,59	-1,76 -0,43	4,09 -0,53	9,09 -0,57	18,56 -0,91	36,80 -1,28
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,20 95,99	0,70 101,06	0,54 98,46	1,11 110,26	2,25 104,89	6,90 92,69	13,55 94,98
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,97 0,20	0,19 -4,11	0,10 -3,47	3,57 -4,12	8,69 -4,42	16,62 -6,18	29,15 -7,39
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO % do CDI	0,47 227,12	1,32 189,68	1,06 194,94	2,32 229,35	5,86 273,46	4,74 63,68	11,84 83,00
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO Var. IFIX p.p.	2,47 1,96	3,03 3,34	5,29 5,93	7,07 3,66	13,34 3,45	14,12 0,06	7,79 -14,62
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11 Var. IBOVESPA p.p.	0,09 -1,85	-0,02 0,08	-0,84 -4,16	3,55 -23,00	1,50 -46,18	3,29 -20,11	-4,07 -42,14
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,99 -0,94	-0,48 -0,37	0,14 -3,19	13,82 -12,72	42,42 -5,26	38,03 14,64	65,84 27,78
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	6,93 4,99	6,51 6,61	8,59 5,26	27,10 0,56	48,64 0,96	48,11 24,71	69,17 31,11
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	1,67 -0,27	-1,27 -1,17	2,75 -0,57	21,06 -5,48	27,68 -20,00	12,67 -10,72	39,23 1,16
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,51 1,57	0,72 0,82	3,97 0,64	24,08 -2,47	47,85 0,17	35,85 12,46	55,47 17,40
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	5,42	12,41	12,59	28,40	43,16	40,60	63,28



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

<b>Fundo</b> <b>Varição da Estratégia</b>	<b>No Mês</b>	<b>No Ano</b>	<b>3 meses</b>	<b>6 meses</b>	<b>12 meses</b>	<b>24 meses</b>	<b>36 meses</b>
% do CDI	2.607,47	1.786,11	2.312,17	2.809,12	2.013,00	545,16	443,67
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,72 -1,49	-1,96 -6,27	-1,46 -5,02	-2,94 -10,64	-7,13 -20,24	-70,23 -93,03	-70,60 -107,14
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP % do CDI	-1,69 -814,02	-14,22 -2.047,04	-4,13 -758,43	-15,53 -1.535,86	-99,64 -4.647,85	-99,78 -1.339,83	-99,78 -699,56
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	2,32 0,38	12,07 12,18	8,92 5,60	15,13 -11,42	44,06 -3,62	109,06 85,67	167,07 129,01
DIADEMA Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,54 0,76	0,57 -3,73	1,40 -2,16	8,20 0,51	12,53 -0,59	15,20 -7,61	
CDI	0,21	0,69	0,54	1,01	2,14	7,45	14,26
IBOVESPA	1,94	-0,10	3,33	26,55	47,68	23,39	38,06
INPC + 6,00%	0,85	4,28	3,52	7,85	13,99	23,83	37,86
IPCA + 6,00%	0,77	4,30	3,56	7,69	13,11	22,80	36,54

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,27	0,40	0,36	0,94	2,33	9,09	16,37	26,78	44,35
IRF-M 1+	1,12	-3,70	-2,35	-0,31	1,43	15,56	27,60	45,71	73,67
IRF-M TOTAL	0,84	-1,98	-1,19	0,30	1,94	13,86	24,44	40,36	65,09
IMA-B 5	0,87	0,72	0,62	3,92	8,92	18,36	30,12	45,28	64,42
IMA-B 5+	0,45	-4,67	-3,03	5,14	10,30	19,64	43,74	58,75	88,40
IMA-B TOTAL	0,65	-2,17	-1,33	4,63	9,66	19,46	38,08	53,18	78,59
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,49	-1,16	-0,72	1,64	3,81	12,47	23,58	36,90	58,87
IMA-GERAL TOTAL	0,51	-0,82	-0,58	1,93	4,62	13,48	24,94	38,46	60,37
IDKA 2	1,35	1,30	1,16	4,35	9,41	18,84	30,03	46,02	65,35
IDKA 20	0,37	-6,86	-4,17	7,21	13,61	19,99	56,00	68,62	112,68
CDI	0,21	0,69	0,54	1,01	2,14	7,45	14,26	23,52	40,13

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	1,94	-0,10	3,33	26,55	47,68	23,39	38,06	81,79	120,54
IBRX 100	2,84	2,09	5,28	28,66	51,24	28,38	44,99	90,20	132,38
IBRX 50	2,90	2,08	5,01	29,80	53,43	25,21	38,51	83,01	120,07
SMALL CAP	4,38	3,46	7,14	29,74	55,90	48,74	65,09	118,72	207,37
IFIX	0,51	-0,31	-0,64	3,41	9,89	14,06	22,42	40,54	84,10
Índice Consumo - ICON	0,76	-3,61	-2,36	10,24	29,24	30,56	42,01	63,09	90,95
Índice Dividendos - IDIV	2,03	-1,25	4,03	23,07	37,02	27,18	51,25	79,16	149,56

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,31	2,37	2,11	4,67	6,76	9,32	14,72	17,89	22,70
INPC	0,38	2,35	2,07	4,83	7,59	10,24	15,83	17,79	22,49
IGPM	1,51	9,89	7,13	14,58	32,02	40,84	53,01	55,90	61,15
SELIC	0,21	0,69	0,54	1,01	2,14	7,45	14,27	23,54	40,18

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-0,18	15,75	11,09	19,71	42,94	94,40	145,10	196,28	217,01
MSCI ACWI	-1,13	12,92	7,72	19,25	42,86	83,15	113,74	160,50	172,47
MSCI World	-0,87	13,60	8,95	19,99	42,54	84,75	118,63	164,34	175,43

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,62	3,67	3,09	6,70	11,00	18,22	28,99	37,81	49,15
IPCA + 5,00%	0,70	3,99	3,33	7,20	12,05	20,50	32,73	43,16	56,42
IPCA + 5,50%	0,74	4,15	3,45	7,45	12,58	21,65	34,63	45,89	60,16
IPCA + 5,89%	0,77	4,27	3,54	7,64	13,00	22,55	36,12	48,05	63,13
IPCA + 6,00%	0,77	4,30	3,56	7,69	13,11	22,80	36,54	48,66	63,98
INPC + 4,00%	0,69	3,65	3,05	6,86	11,86	19,21	30,23	37,69	48,89
INPC + 6,00%	0,85	4,28	3,52	7,85	13,99	23,83	37,86	48,54	63,69

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

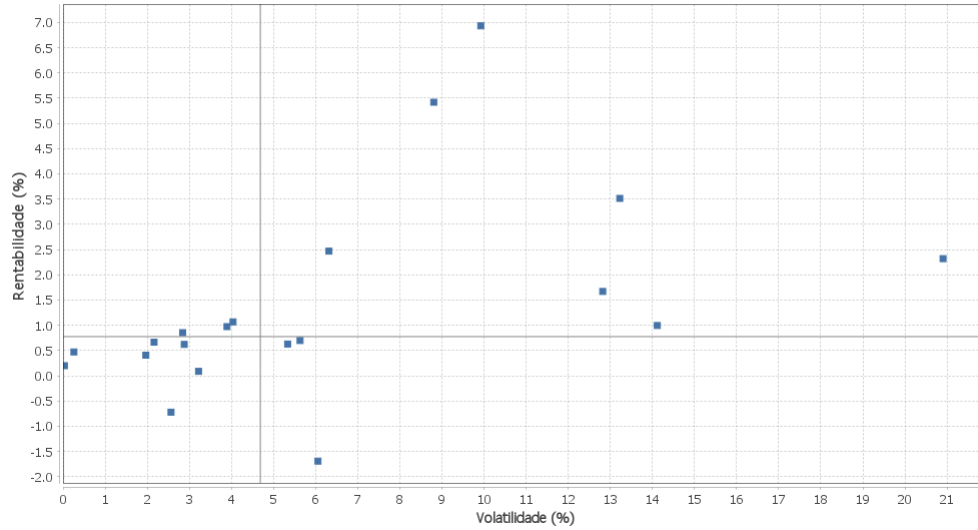
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
75	05/04/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	45.000,00	19.448,78351100	2,3137693920
65	05/04/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.155.087,17	499.223,11791000	2,3137693920
66	06/04/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	119.293,01	0,00	51.554,54222800	2,3139185190
76	09/04/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	4.320,50835000	2,3145424540
64	09/04/2021	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	133.852,46	0,00	89.409,59330800	1,4970704490
67	09/04/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.149.326,45	496.567,45246300	2,3145424540
68	12/04/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	71.013,37	0,00	30.678,82022000	2,3147360130
77	15/04/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	21.594,36610500	2,3154187420
69	15/04/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.567.469,17	2.836.406,67274200	2,3154187420
70	16/04/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	25.010,00	0,00	10.800,35701400	2,3156641920
78	20/04/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.000.000,00	0,00	431.750,38817500	2,3161531000
71	20/04/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	6.326.180,84	0,00	2.731.331,03334100	2,3161531000
72	23/04/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	14.200,86	0,00	6.129,82386800	2,3166832040
79	23/04/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	131.000,00	56.546,35893800	2,3166832040
73	28/04/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	480.348,01	0,00	207.272,43706900	2,3174717140
80	28/04/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	8.000,00	3.452,03781800	2,3174717140
74	30/04/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.067.847,12	2.186.371,89036800	2,3179254830
81	30/04/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	45.000,00	19.413,91141800	2,3179254830
<b>Total</b>						

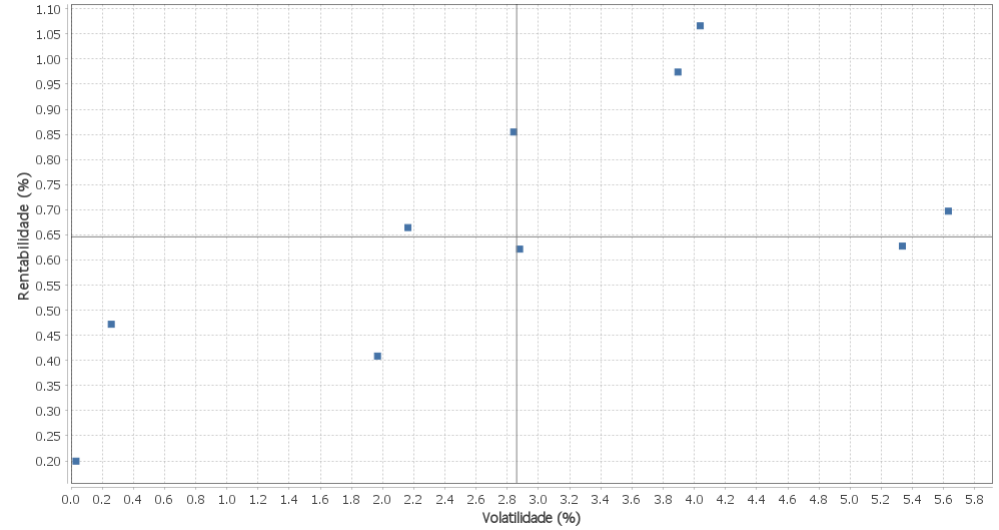
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

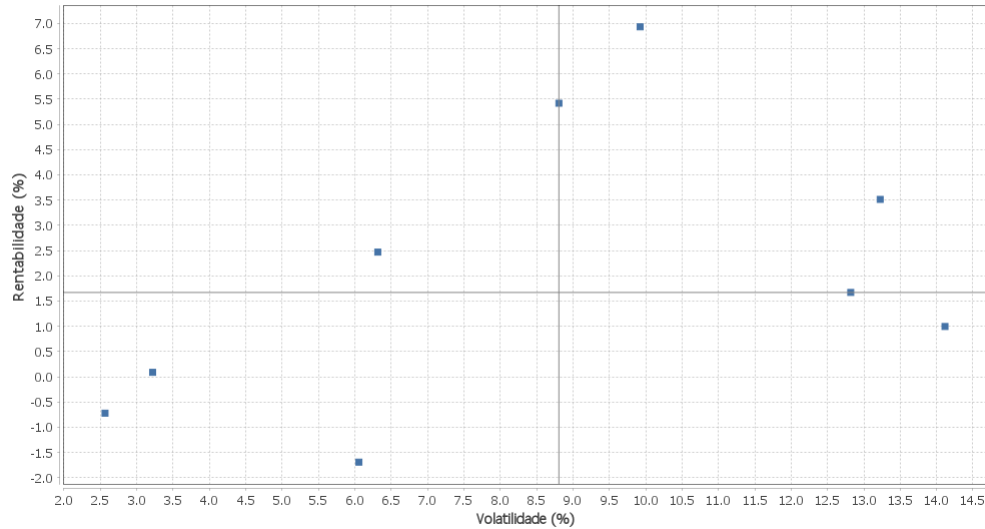
DIADEMA - No Mês



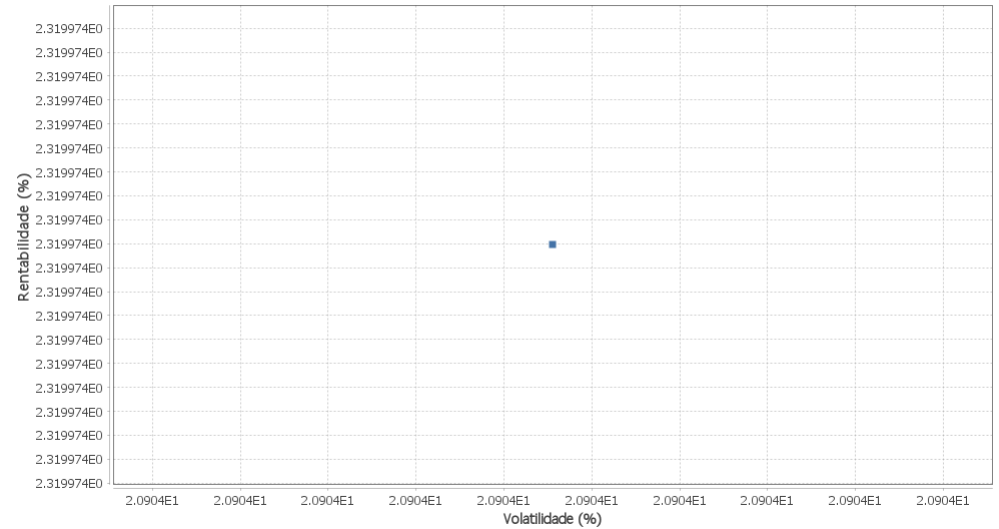
Renda Fixa - No Mês



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\$): 6.115.528,08

Value-At-Risk: 2,38%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,03	0,00	-0,26	0,20	15.103.863,79	5,87
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	Artigo 7º VII, Alínea b	0,26	0,17	0,00	1,02	0,47	3.715.555,52	1,44
BB PREV IPCA I	Artigo 7º I, Alínea b	1,97	0,83	0,03	0,10	0,41	16.830.994,41	6,54
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,16	1,14	0,11	0,21	0,66	36.650.945,00	14,24
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	Artigo 8º IV, Alínea a	2,56	0,10	0,00	-0,36	-0,72	80.791,38	0,03
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,84	1,39	0,01	0,23	0,85	2.176.652,88	0,85
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,88	1,39	0,09	0,14	0,62	26.177.550,84	10,17
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11	Artigo 8º IV, Alínea b	3,22	2,59	-0,00	-0,04	0,09	1.269.218,61	0,49
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	Artigo 7º VII, Alínea b	3,89	1,82	0,05	0,20	0,97	10.135.684,56	3,94
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	4,04	2,11	0,14	0,21	1,07	27.296.298,99	10,61
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	Artigo 7º I, Alínea b	5,34	2,89	0,14	0,08	0,63	20.500.341,08	7,97
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	5,63	3,06	0,16	0,09	0,70	21.771.083,22	8,46
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	Artigo 8º IV, Alínea a	6,06	0,74	0,00	-0,31	-1,69	9.049,83	0,00
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	Artigo 8º IV, Alínea b	6,32	2,76	0,00	0,36	2,47	3.109.475,07	1,21
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	8,81	6,44	0,47	0,59	5,42	26.988.376,06	10,49
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	9,92	12,18	0,38	0,68	6,93	9.628.963,59	3,74
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	12,82	8,09	0,35	0,11	1,67	14.001.083,69	5,44
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	13,22	10,39	0,16	0,25	3,51	4.718.845,31	1,83
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	14,12	10,11	0,22	0,06	0,99	6.990.223,52	2,72
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	20,90	9,71	0,07	0,10	2,32	10.199.579,18	3,96

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Observações**

-Referente ao mês de abril de 2021, vale observar que:

- O Instituto está com 10,49% dos recursos garantidores alocados no Artigo 8º III, limite este, superior ao permitido pela Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010.
- O Instituto está com 10,49% dos recursos garantidores alocados no Artigo 8º III, limite este, superior ao limite máximo estipulado na política de investimentos.