



LDB
EMPRESAS

DIADEMA
DEZEMBRO 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 31.12.2021.

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

72,14%

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
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,61	0,71	1,70	16.791.825,68	6,59	9.277.694.744,55	0,18
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,77	0,77	4,35	23.626.146,46	9,27	1.144.893.205,94	2,06
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,76	0,72	2,29	15.264.790,84	5,99	10.998.710.156,34	0,14
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,80	0,76	3,09	4.123.457,77	1,62	6.458.635.592,00	0,06
BB	BB	BB PREV IPCA I	1,64	0,59	6,64	17.281.139,60	6,78	524.629.076,05	3,29
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,80	0,70	1,34	77.087.360,35	30,24		

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
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,20	0,75	1,15	13.272.489,63	5,21	8.765.736.063,59	0,15
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,15	0,80	4,62	41.405.036,04	16,24	7.206.695.128,79	0,57
BRAM	BRANDESCO	BRANDESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,92	0,77	3,01	22.319.178,50	8,76	1.241.205.562,42	1,80
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC	0,19	0,76	1,08	15.385.903,33	6,04	977.806.287,29	1,57
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			3,14	0,76	0,87	92.382.607,50	36,24		

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	3,28	0,85	4,08	10.528.291,78	4,13	619.522.449,09	1,70
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	0,30	0,84	6,29	3.897.822,41	1,53	777.989.992,71	0,50
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			2,44	0,85	4,66	14.426.114,19	5,66		
Renda Fixa			2,75	0,73	1,50	183.896.082,04	72,14		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

20,28%

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
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	19,16	2,31	-9,66	8.167.196,25	3,20	1.378.837.386,58	0,59
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	23,88	-0,69	-31,79	4.791.074,73	1,88	1.896.702.011,80	0,25
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	20,10	3,49	-12,74	7.372.942,37	2,89	1.010.020.909,77	0,73
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT 30 FIC FIA	17,60	9,08	-7,32	3.707.032,14	1,45	346.277.804,83	1,07
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			18,63	3,04	-15,81	24.038.245,49	9,43		

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	13,39	5,49	32,45	24.027.436,77	9,43	2.586.888.951,12	0,93
Sub-total Artigo 8º III			13,39	5,49	32,45	24.027.436,77	9,43		

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	143,66	315,64	206,81	32.366,70	0,01	1.110.895,52	2,91
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			143,66	315,64	-28,02	32.366,70	0,01		

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	30,48	2,42	8,78	2.393.362,13	0,94	64.937.296,84	3,69
BRPP	GERAÇÃO FUTURO	BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	9,77	7,70	-0,11	1.198.529,97	0,47	354.102.384,87	0,34
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			23,07	4,14	6,76	3.591.892,10	1,41		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			13,81	4,29	3,03	51.689.941,06	20,28		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

7,58%

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	18,54	-0,32	17,39	19.312.124,97	7,58	4.403.177.327,12	0,44
Sub-total Artigo 9º A, III			18,54	-0,32	17,39	19.312.124,97	7,58		
Investimentos no Exterior			17,50	-0,32	17,39	19.312.124,97	7,58		
Total			4,88	1,38	2,73	254.898.148,07	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	77.087.360,35	30,24	15,00	60,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	92.382.607,50	36,24	1,00	10,00	40,00	0,00	45,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	14.426.114,19	5,66	0,00	3,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Fixa	183.896.082,04	72,14					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	24.038.245,49	9,43	2,00	16,00	25,00	0,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	24.027.436,77	9,43	2,00	8,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	32.366,70	0,01	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	3.591.892,10	1,41	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	51.689.941,06	20,28					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	19.312.124,97	7,58	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	19.312.124,97	7,58					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 92,14	1,34 30,39	1,46 79,39	1,39 45,10	1,34 30,39	537.355,71	882.174,01
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,76 98,88	0,87 19,77	1,55 84,37	1,30 42,23	0,87 19,77	533.515,95	875.373,88
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,85 111,45	4,66 106,12	2,27 123,52	3,56 115,29	4,66 106,12	121.730,14	642.856,14
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	3,04 0,19	-15,81 -3,88	-8,57 -3,02	-20,98 -3,64	-15,81 -3,88	709.075,89	-5.446.139,34
Artigo 8º III % do CDI	5,49 718,94	32,45 738,21	13,00 705,66	14,27 462,35	32,45 738,21	1.250.357,03	7.018.103,35
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	315,64 312,79	-28,02 -16,09	183,93 189,47	159,02 176,35	-28,02 -16,09	24.579,55	-40.265,93
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	4,14 1,29	6,76 18,69	2,37 7,92	3,86 21,19	6,76 18,69	144.569,50	273.068,47
Artigo 9º A, III % do CDI	-0,32 -41,46	17,39 443,08	9,93 539,35	20,50 664,19		-61.331,02	2.312.124,97
DIADEMA (Total)						3.259.852,75	6.517.295,55

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV IPCA I	17.180.097,93	0,00	0,00	0,00	17.281.139,60	101.041,67	1.092.397,93
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	-470.179,32
BB PREV RF IDKA2	16.421.721,51	253.749,79	0,00	0,00	16.791.825,68	116.354,38	215.391,49
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4.092.265,83	0,00	0,00	0,00	4.123.457,77	31.191,94	123.457,77
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	15.155.713,47	0,00	0,00	0,00	15.264.790,84	109.077,37	264.790,84
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	23.446.456,11	0,00	0,00	0,00	23.626.146,46	179.690,35	685.825,92
					77.087.360,35	0,00	0,00

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

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	20.518.597,30	44.427.803,81	-23.673.099,17	0,00	41.405.036,04	131.734,10	639.910,83
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	22.148.551,08	0,00	0,00	0,00	22.319.178,50	170.627,42	651.015,64
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	13.173.099,80	0,00	0,00	0,00	13.272.489,63	99.389,83	131.021,69
WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC	21.254.138,73	0,00	-6.000.000,00	0,00	15.385.903,33	131.764,60	175.111,75
					92.382.607,50	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	10.439.213,84	0,00	0,00	0,00	10.528.291,78	89.077,94	412.265,64
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	3.865.170,21	0,00	0,00	0,00	3.897.822,41	32.652,20	230.590,50
					14.426.114,19	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	7.982.440,96	0,00	0,00	0,00	8.167.196,25	184.755,29	-873.390,98
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	4.824.139,44	0,00	0,00	0,00	4.791.074,73	-33.064,71	-2.232.611,52
OCCAM FIC FIA	7.124.114,51	0,00	0,00	0,00	7.372.942,37	248.827,86	-1.312.304,85
TARPON GT 30 FIC FIA	3.398.474,69	0,00	0,00	0,00	3.707.032,14	308.557,45	-292.967,86
					24.038.245,49	0,00	0,00

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	22.777.079,74	0,00	0,00	0,00	24.027.436,77	1.250.357,03	7.018.103,35
					24.027.436,77	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	7.787,15	0,00	0,00	0,00	32.366,70	24.579,55	21.816,59

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					32.366,70	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	2.409.521,59	0,00	0,00	0,00	75.000,00	2.393.362,13	58.840,54	275.730,64
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	1.121.801,01	0,00	0,00	0,00	9.000,00	1.198.529,97	85.728,96	-2.662,17
						3.591.892,10	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	19.373.455,99	0,00	0,00	0,00	19.312.124,97	-61.331,02	2.312.124,97
					19.312.124,97	0,00	0,00

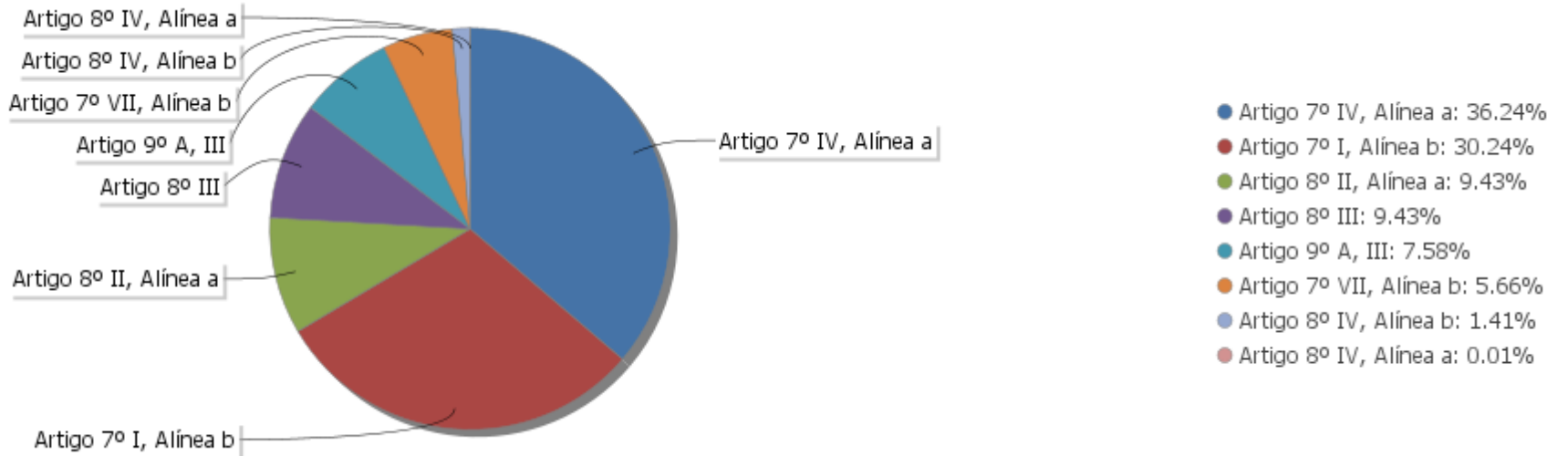
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

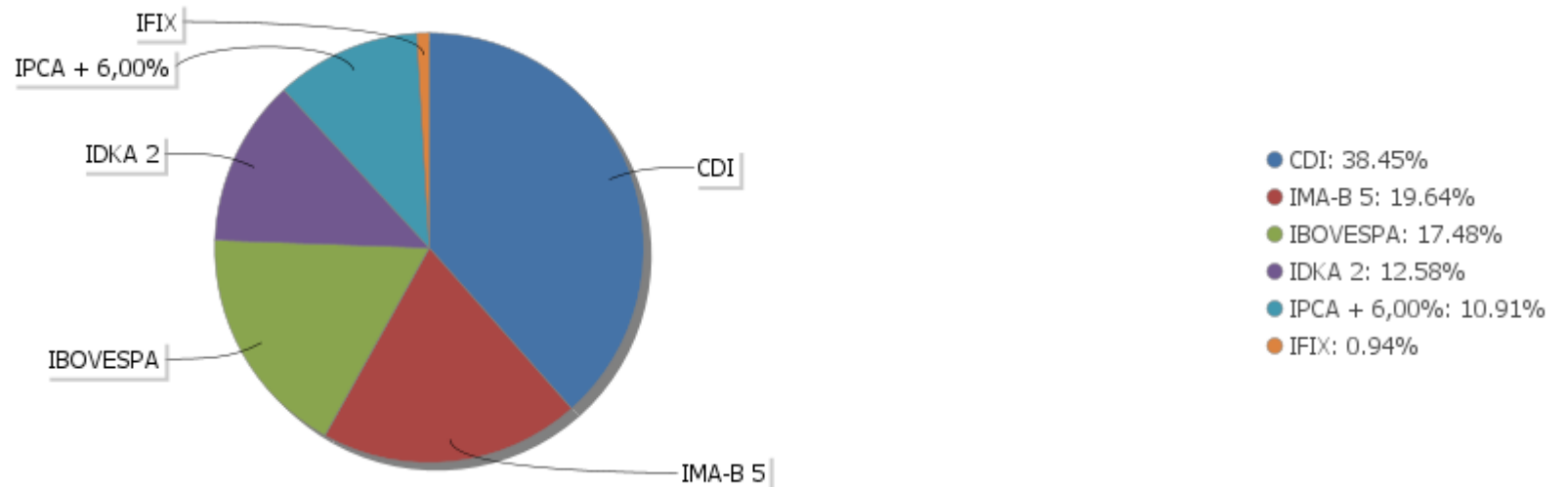
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	219.904.279,83	86,27	219.904.279,83	86,27
de 31 a 365 dias	22.072.214,33	8,66	241.976.494,16	94,93
acima de 365 dias	12.921.653,91	5,07	254.898.148,07	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

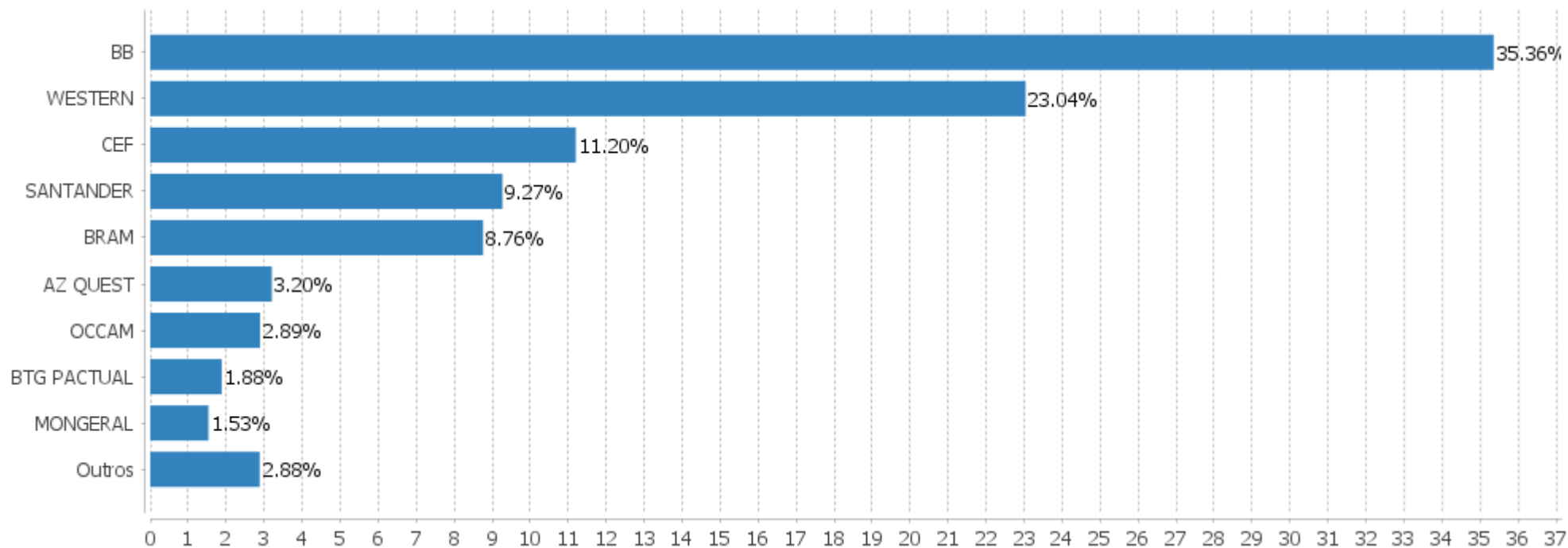


Alocação Por Estratégia



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	-0,08	0,72	1,38	2,73
IPCA + 5,44%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,28	0,97	1,43	1,34	1,61	1,68	1,38	1,22	16,02
p.p. indexador	-1,49	-2,23	-0,56	0,81	-0,38	-0,59	-1,47	-2,13	-1,95	-1,75	-0,65	0,16	-13,30
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

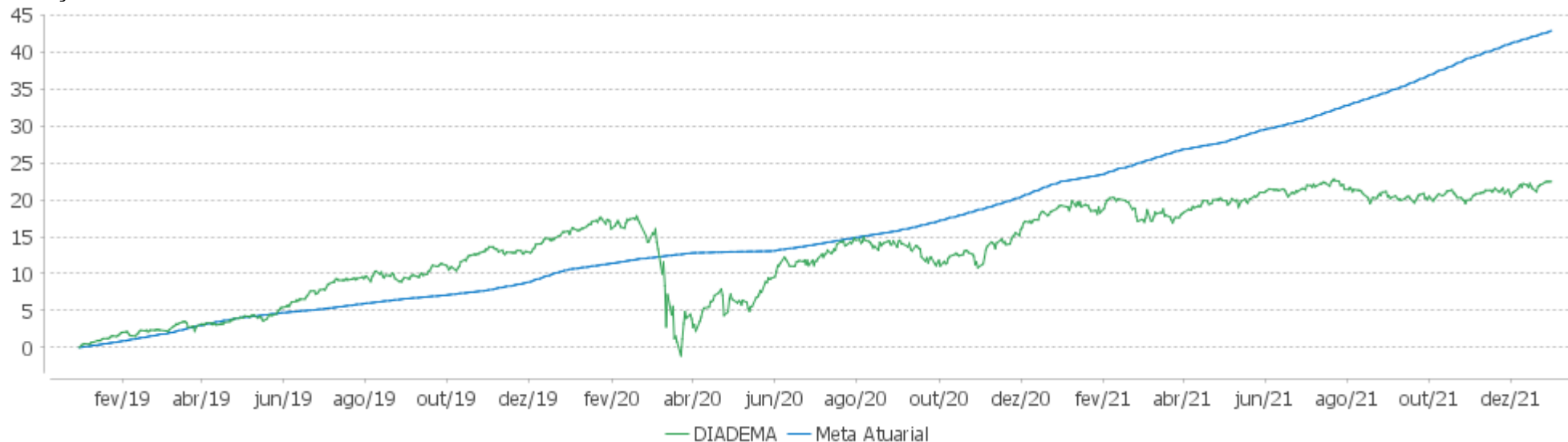
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

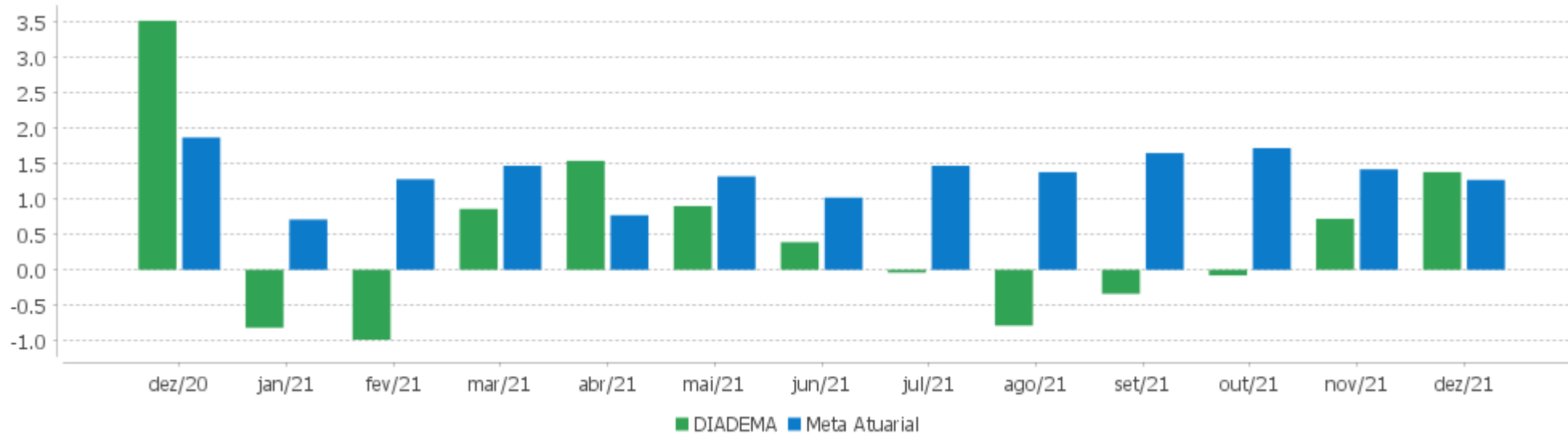
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	16	44,44	03 meses	2,03	4,33	-2,30	4,29
Meses abaixo - Meta Atuarial	20	55,56	06 meses	0,84	8,96	-8,12	4,20
			12 meses	2,73	16,02	-13,30	4,88
			24 meses	6,20	28,37	-22,16	9,72
			36 meses	22,47	41,96	-19,50	8,16
Maior rentabilidade da Carteira	3,93	2020-11	Desde 31/12/2018	22,47	41,96	-19,50	8,16
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
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	0,77 -0,02	3,67 -0,90	1,94 -0,09	2,97 -0,27	3,67 -0,90	11,81 -1,16	26,26 -1,57
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,80 104,63	4,62 105,21	1,93 104,82	3,26 105,62	4,62 105,21	7,13 97,94	13,29 97,07
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,75 98,81	4,60 104,55	1,89 102,69	3,40 110,10	4,60 104,55	7,12 97,76	13,24 96,76
WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC % do CDI	0,76 99,04	4,50 102,47	1,89 102,64	3,27 105,85	4,50 102,47		
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,85 -0,41	4,08 -12,56	2,32 -2,15	3,40 -5,86	4,08 -12,56	12,36 -16,83	26,07 -16,80
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO % do CDI	0,84 110,64	6,29 143,06	2,15 116,84	4,00 129,46	6,29 143,06	6,55 89,94	12,27 89,63
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,77 -0,02	4,35 -0,21	1,98 -0,05	3,12 -0,11	4,35 -0,21	12,52 -0,45	27,04 -0,80
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,59 -0,68	6,64 -10,00	1,84 -2,63	4,32 -4,93	6,64 -10,00	15,55 -13,64	31,90 -10,97
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,71 -0,12	4,65 -0,33	1,86 0,02	3,18 0,13	4,65 -0,33	12,93 -1,09	25,58 -1,92
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,72 -0,11	4,66 -0,31	1,82 -0,02	3,05 0,00	4,66 -0,31	13,07 -0,95	25,72 -1,78
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,76 -0,02	4,27 -0,30	1,94 -0,09	3,06 -0,17	4,27 -0,30	12,38 -0,59	26,87 -0,97
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO Var. IFIX p.p.	2,42 -6,36	8,78 11,06	1,69 -1,59	3,33 1,52	8,78 11,06	9,03 21,31	26,63 7,36
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11 Var. IBOVESPA p.p.	7,70 4,84	-0,11 11,81	3,65 9,19	3,09 20,42	-0,11 11,81	-16,00 -6,64	8,98 -10,28
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP % do CDI	315,64 41.338,47	206,79 4.704,96	308,59 16.756,03	301,23 9.757,49	206,79 4.704,96	-98,74 -1.355,43	-99,23 -724,98
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-0,69 -3,54	-31,79 -19,86	-19,45 -13,90	-34,71 -17,37	-31,79 -19,86	-26,41 -17,06	2,46 -16,81
TARPON GT 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	9,08 6,23	16,51 28,44	-0,97 4,57	-7,32 10,01	16,51 28,44		
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	2,31	-9,66	-8,26	-20,26	-9,66	-12,51	30,94

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Varição da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-0,54	2,27	-2,71	-2,92	2,27	-3,16	11,67
OCCAM FIC FIA	3,49	-12,74	-4,20	-16,60	-12,74	-5,88	27,48
Var. IBOVESPA p.p.	0,64	-0,82	1,34	0,74	-0,82	3,48	8,21
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	5,49	32,45	13,00	14,27	32,45	48,57	96,55
% do CDI	718,94	738,21	705,66	462,35	738,21	666,75	705,39
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	-0,32	29,00	9,93	20,50	29,00	114,15	190,29
Var. IBOVESPA p.p.	-3,17	40,92	15,48	37,84	40,92	123,51	171,02
DIADEMA	1,38	2,73	2,03	0,84	2,73	6,20	22,47
Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,12	-13,91	-2,44	-8,41	-13,91	-22,99	-20,41
CDI	0,76	4,40	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69
IBOVESPA	2,85	-11,93	-5,55	-17,33	-11,93	-9,36	19,27
INPC + 6,00%	1,27	16,74	4,26	9,16	16,74	30,46	44,52
IPCA + 6,00%	1,27	16,64	4,47	9,25	16,64	29,19	42,87

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	D+1 du	D+0	D+27	D+29	20.00000000000000 -	2,00
BB PREV IPCA I	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,15
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	D+0	D+0	D+30 ou D+0 a D+2880 (isento de taxa de resgate de acordo com a data de solicitação)	D+30 ou D+0 a D+2880 (isento de taxa de resgate de acordo com a data de solicitação)	0,00	0,20
BB PREV RF IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,20
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,20
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	Não se aplica	Não se aplica				
BRANCO INST FIC FI RF IMA-B 5	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,20
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	Não se aplica	Não se aplica				
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)	D+4 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)	0,00	3,00
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	0,45
OCCAM FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+15 (isento de taxa de resgate)	D+3 du ou D+17 (isento de taxa de resgate)	0,00	3,00
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	Não se aplica	Não se aplica				
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	0,10
TARPON GT 30 FIC FIA	D+1 du	D+0				
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du	0,00	1,50
WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,15

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	1,00

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	0,88	2,93	1,13	2,10	2,93	6,88	14,10	22,06	35,63
IRF-M 1+	2,29	-4,99	0,93	-1,74	-4,99	3,04	17,72	32,16	54,19
IRF-M TOTAL	1,89	-1,99	0,98	-0,42	-1,99	4,57	17,15	29,72	49,44
IMA-B 5	0,79	4,57	2,03	3,24	4,57	12,97	27,83	40,44	58,11
IMA-B 5+	-0,34	-6,55	0,09	-4,11	-6,55	-1,41	28,53	48,33	67,24
IMA-B TOTAL	0,22	-1,26	1,06	-0,55	-1,26	5,06	29,17	46,04	64,72
IMA-GERAL TOTAL	0,87	0,96	1,34	0,82	0,96	6,35	19,98	32,02	48,95
IDKA 2	0,83	4,97	1,84	3,05	4,97	14,02	27,50	39,94	58,99
IDKA 20	-2,28	-14,50	-2,87	-11,27	-14,50	-12,61	26,07	51,79	70,27
CDI	0,76	4,40	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69	20,99	33,03

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	2,85	-11,93	-5,55	-17,33	-11,93	-9,36	19,27	37,20	74,05
IBRX 100	3,14	-11,17	-5,51	-18,37	-11,17	-8,07	22,63	41,54	80,53
IBRX 50	3,76	-10,54	-4,49	-18,01	-10,54	-7,30	19,73	37,12	73,89
SMALL CAP	3,80	-16,20	-11,28	-24,79	-16,20	-16,75	31,71	42,41	112,70
IFIX	8,78	-2,28	3,28	1,81	-2,28	-12,28	19,27	25,98	50,42
Índice Consumo - ICON									
Índice Dividendos - IDIV	1,60	-6,41	-1,83	-8,30	-6,41	-7,35	34,49	55,95	95,40

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	0,73	10,06	2,96	6,07	10,06	15,03	19,99	24,48	28,15
INPC	0,73	10,16	2,75	5,97	10,16	16,16	21,37	25,53	28,13
IGPM	0,87	17,78	1,54	2,35	17,78	45,04	55,63	67,36	66,49
SELIC	0,76	4,40	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69	21,00	33,06

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	3,63	36,26	13,52	23,73	36,26	104,25	173,82	200,73	264,52
MSCI ACWI	3,17	25,42	9,15	16,96	25,42	84,89	138,58	148,21	206,39
MSCI World									

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,09	14,45	3,97	8,20	14,45	24,38	34,95	45,56	55,77
IPCA + 5,00%	1,18	15,54	4,22	8,73	15,54	26,77	38,87	51,22	63,36
IPCA + 5,50%	1,22	16,09	4,35	8,99	16,09	27,98	40,86	54,11	67,27
IPCA + 5,89%	1,26	16,52	4,44	9,20	16,52	28,92	42,43	56,40	70,37
IPCA + 6,00%	1,27	16,64	4,47	9,25	16,64	29,19	42,87	57,04	71,26
INPC + 4,00%	1,09	14,55	3,77	8,10	14,55	25,60	36,50	46,79	55,74
INPC + 6,00%	1,27	16,74	4,26	9,16	16,74	30,46	44,52	58,37	71,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
867	03/12/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	45.000,00	18.816,70776900	2,3914916760
868	03/12/2021	BB PREV RF IDKA2	253.749,79	0,00	83.994,45954000	3,0210300940
869	03/12/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.273.642,67	532.572,48719800	2,3914916760
870	07/12/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	12.000,00	5.014,89924300	2,3928696110
871	07/12/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.222.236,84	510.782,88360600	2,3928696110
872	08/12/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.032.721,84	0,00	849.182,04597300	2,3937409530
873	08/12/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.715.589,67	716.698,13220600	2,3937409530
874	08/12/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	16.000,00	6.684,09836900	2,3937409530
875	09/12/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.812.200,10	2.845.001,71017300	2,3944449930
876	10/12/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	55.000,00	22.960,64580300	2,3954030070
877	13/12/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	6.000.000,00	0,00	2.503.966,82179800	2,3961978840
878	13/12/2021	WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC	0,00	6.000.000,00	4.172,23060360	1.438,0796677000
879	15/12/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.707.685,12	2.380.230,43976000	2,3979548470
880	15/12/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	40.000,00	16.680,88123100	2,3979548470
881	20/12/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	7.748.249,56	0,00	3.227.715,64517400	2,4005366060
882	21/12/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.060.845,07	441.735,74048800	2,4015377810
883	21/12/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.003.000,00	0,00	417.649,06133700	2,4015377810
884	22/12/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.277.032,53	2.196.597,00020700	2,4023671750
885	24/12/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	320.000,00	133.114,05516000	2,4039535090
886	28/12/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.558.213,00	0,00	1.894.749,50261100	2,4057074530
887	30/12/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	3.198.732,23	0,00	1.328.735,14851500	2,4073512570
888	31/12/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	19.886.887,18	0,00	8.257.987,30365600	2,4082002610
889	31/12/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	115.867,17	48.113,59415400	2,4082002610
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 4.424.559,61

Value-At-Risk: 1,74%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
DIADEMA		1,74	1,74			254.898.148,07	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,70%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IDKA2		1,37	0,04	0,38			16.791.825,68	6,59
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI		1,21	0,05	0,01			23.626.146,46	9,27
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,62	0,04	0,26			15.264.790,84	5,99
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,20	0,01	0,04			4.123.457,77	1,62
BB PREV IPCA I		0,73	0,01	0,74			17.281.139,60	6,78
Sub-total	1,82	1,16	0,14		-0,03	0,70	77.087.360,35	30,24

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,06	0,00	0,06			13.272.489,63	5,21
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,05	0,00	0,03			41.405.036,04	16,24
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5		1,19	0,04	0,03			22.319.178,50	8,76
WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC		0,04	0,00	0,02			15.385.903,33	6,04
Sub-total	0,67	0,30	0,05		-0,01	0,76	92.382.607,50	36,24

Artigo 7º VII, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI		1,22	0,02	1,23			10.528.291,78	4,13
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO		0,06	0,00	0,07			3.897.822,41	1,53

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	1,76	0,90	0,02		0,05	0,85	14.426.114,19	5,66

Renda Variável e Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 6,46%

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		8,30	0,20	5,27			8.167.196,25	3,20
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		15,88	0,20	8,98			4.791.074,73	1,88
OCCAM FIC FIA		9,64	0,20	2,60			7.372.942,37	2,89
TARPON GT 30 FIC FIA		9,82	0,09	7,56			3.707.032,14	1,45
Sub-total	16,80	9,58	0,68		0,14	3,04	24.038.245,49	9,43

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO		6,53	0,52	6,53			24.027.436,77	9,43
Sub-total	16,62	6,53	0,52		0,28	5,49	24.027.436,77	9,43

Artigo 8º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP		6,37	-0,00	6,36			32.366,70	0,01
Sub-total	471,57	6,37	-0,00		0,67	315,64	32.366,70	0,01

Artigo 8º IV, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO		1,11	0,00	3,39			2.393.362,13	0,94
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11		0,15	0,00	10,15			1.198.529,97	0,47
Sub-total	8,73	0,75	0,00		0,39	4,14	3.591.892,10	1,41

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 8,61%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 9º A, III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I		8,61	0,32	13,89			19.312.124,97	7,58
Sub-total	21,77	8,61	0,32		-0,05	-0,32	19.312.124,97	7,58