



LDB
EMPRESAS

DIADEMA
JULHO 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 30.07.2021.

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

70,39%

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 | 2,57 | 0,01 | 1,20 | 22.912.098,46 | 9,36 | 1.304.224.513,42 | 1,76 |
| WESTERN | BNP PARIBAS | WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF | 4,34 | -0,42 | -1,64 | 27.250.067,70 | 11,13 | 1.268.772.712,72 | 2,15 |
| BB | BB | BB PREV IPCA I | 1,74 | 0,66 | 2,90 | 17.131.314,49 | 7,00 | 520.079.165,42 | 3,29 |
| BB | BB | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI | 2,93 | -0,25 | -0,93 | 25.461.818,42 | 10,40 | 8.970.903.955,40 | 0,28 |
| CEF | CEF | FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 2,49 | -0,78 | -0,06 | 28.486.439,50 | 11,63 | 15.935.689.880,46 | 0,18 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b | | | 3,21 | -0,24 | -0,30 | 121.241.738,57 | 49,51 | | |

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 | 5,92 | -0,44 | -1,80 | 21.986.965,22 | 8,98 | 1.762.335.812,16 | 1,25 |
| BB | BB | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,18 | 0,39 | 1,72 | 15.200.442,93 | 6,21 | 4.167.355.289,66 | 0,36 |
| Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a | | | 3,42 | -0,00 | -0,43 | 37.187.408,15 | 15,19 | | |

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 | 2,91 | -0,07 | 0,58 | 10.175.102,27 | 4,16 | 630.089.837,19 | 1,61 |
| MONGERAL | BEM | MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO | 0,40 | 0,48 | 2,69 | 3.765.944,76 | 1,54 | 303.650.985,95 | 1,24 |
| Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b | | | 2,19 | 0,08 | 1,14 | 13.941.047,03 | 5,69 | | |
| Renda Fixa | | | 3,14 | -0,17 | -0,19 | 172.370.193,75 | 70,39 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

25,38%

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 | 20,29 | -4,44 | 8,25 | 9.786.834,07 | 4,00 | 1.704.868.967,48 | 0,57 |
| BTG PACTUAL | BTG PACTUAL | BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA | 20,45 | -4,57 | -0,31 | 7.002.150,45 | 2,86 | 2.947.905.302,72 | 0,24 |
| OCCAM | BEM | OCCAM FIC FIA | 20,74 | -4,12 | 0,31 | 8.476.272,59 | 3,46 | 1.227.059.317,62 | 0,69 |
| TPE | DAYCOVAL | TARPON GT 30 FIC FIA | 17,95 | -1,12 | -1,12 | 3.955.049,13 | 1,62 | 298.552.419,78 | 1,32 |
| Sub-total Artigo 8º II, Alínea a | | | 19,47 | -3,94 | 2,34 | 29.220.306,24 | 11,93 | | |

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 | 14,94 | 2,58 | 18,89 | 28.544.231,65 | 11,66 | 2.212.656.155,75 | 1,29 |
| Sub-total Artigo 8º III | | | 14,94 | 2,58 | 18,89 | 28.544.231,65 | 11,66 | | |

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 | 15,81 | 0,00 | -23,53 | 8.066,96 | 0,00 | 1.110.895,52 | 0,73 |
| CEF | CEF | FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA | 98,52 | -2,58 | -77,20 | 12.793,86 | 0,01 | 2.927.459,72 | 0,44 |
| Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a | | | 128,34 | -2,03 | -72,77 | 20.860,82 | 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 | 27,34 | 1,77 | 7,14 | 3.137.067,48 | 1,28 | 64.937.296,84 | 4,83 |
| BRPP | GERAÇÃO FUTURO | BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11 | 7,72 | 2,29 | -0,89 | 1.232.611,93 | 0,50 | 369.979.755,66 | 0,33 |
| Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b | | | 19,30 | 1,92 | 4,77 | 4.369.679,41 | 1,78 | | |

Renda Variável e Investimentos Estruturados

15,45

-0,64

7,85

62.155.078,12

25,38

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,23%

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 | 20,63 | 6,32 | 3,57 | 10.357.361,14 | 4,23 | 3.624.663.273,63 | 0,29 |
| Sub-total Artigo 9º A, III | | | 20,63 | 6,32 | 3,57 | 10.357.361,14 | 4,23 | | |
| Investimentos no Exterior | | | 16,53 | 6,32 | 3,57 | 10.357.361,14 | 4,23 | | |
| Total | | | 5,79 | -0,04 | 1,83 | 244.882.633,01 | 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 | 121.241.738,57 | 49,51 | 15,00 | 60,00 | 100,00 | 0,00 | 100,00 |
| Artigo 7º IV, Alínea a | Fundos de Renda Fixa | 37.187.408,15 | 15,19 | 1,00 | 10,00 | 40,00 | 0,00 | 45,00 |
| Artigo 7º VII, Alínea b | Fundos Renda Fixa "Crédito Privado" | 13.941.047,03 | 5,69 | 0,00 | 3,00 | 10,00 | 0,00 | 10,00 |
| | Total Renda Fixa | 172.370.193,75 | 70,39 | | | | | 100,00 |
| Renda Variável e Investimentos Estruturados | | | | | | | | |
| Artigo 8º II, Alínea a | Fundos de Ações | 29.220.306,24 | 11,93 | 2,00 | 16,00 | 25,00 | 0,00 | 25,00 |
| Artigo 8º III | Fundos Multimercados | 28.544.231,65 | 11,66 | 2,00 | 8,00 | 10,00 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 8º IV, Alínea a | Fundos de Participações | 20.860,82 | 0,01 | 0,00 | 1,00 | 5,00 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 8º IV, Alínea b | Fundos de Investimentos Imobiliários | 4.369.679,41 | 1,78 | 0,00 | 2,00 | 5,00 | 0,00 | 5,00 |
| | Total Renda Variável e Investimentos Estruturados | 62.155.078,12 | 25,38 | | | | | 35,00 |
| Investimentos no Exterior | | | | | | | | |
| Artigo 9º A, III | Ações - BDR Nível I | 10.357.361,14 | 4,23 | 0,00 | 0,00 | 10,00 | 0,00 | 10,00 |
| | Total Investimentos no Exterior | 10.357.361,14 | 4,23 | | | | | 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 | -0,24 -68,41 | -0,30 -18,34 | 0,35 37,15 | 0,05 3,10 | 1,96 80,75 | -299.874,75 | -426.888,93 |
| Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI | -0,00 -1,23 | -0,43 -26,63 | 1,03 110,73 | 0,08 5,14 | 1,31 53,91 | -41.927,88 | -107.816,43 |
| Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI | 0,08 21,66 | 1,14 70,28 | 0,65 69,66 | 1,00 67,96 | 4,80 197,31 | 10.732,39 | 157.788,98 |
| Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p. | -3,94 0,00 | 2,34 0,00 | 1,58 -0,86 | 5,22 -0,64 | 9,37 -8,99 | -1.199.483,35 | -264.078,59 |
| Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p. | 2,58 6,52 | 18,89 16,55 | 5,76 3,32 | 19,08 13,23 | 34,89 16,53 | 716.806,29 | 4.534.898,23 |
| Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p. | -2,03 1,91 | -72,77 -75,11 | -58,63 -61,08 | -72,50 -78,35 | -72,17 -90,53 | -770,00 | -57.311,29 |
| Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p. | 1,92 5,86 | 4,77 2,43 | 2,59 0,14 | 6,12 0,27 | 7,83 -10,52 | 82.814,87 | 203.054,58 |
| Artigo 9º A, III % do CDI | 6,32 1.776,47 | 3,57 304,91 | 1,55 166,20 | | | 615.437,40 | 357.361,14 |
| DIADEMA (Total) | | | | | | -116.265,03 | 4.397.007,69 |

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 | 17.018.689,87 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 17.131.314,49 | 112.624,62 | 485.229,05 |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI | 25.392.044,15 | 133.531,87 | 0,00 | 0,00 | 25.461.818,42 | -63.757,60 | -244.172,44 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 32.720.691,23 | 0,00 | -4.000.000,00 | 0,00 | 28.486.439,50 | -234.251,73 | 10.771,32 |
| SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI | 22.910.389,78 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 22.912.098,46 | 1.708,68 | -28.222,08 |
| WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF | 27.366.266,42 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 27.250.067,70 | -116.198,72 | -453.404,88 |
| | | | | | 121.241.738,57 | 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 | 13.869.984,29 | 15.650.167,12 | -14.375.163,06 | 0,00 | 15.200.442,93 | 55.454,58 | 295.067,24 |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B | 22.084.347,68 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 21.986.965,22 | -97.382,46 | -402.883,67 |
| | | | | | 37.187.408,15 | 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 | 10.182.280,95 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10.175.102,27 | -7.178,68 | 59.076,13 |
| MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO | 3.748.033,69 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.765.944,76 | 17.911,07 | 98.712,85 |
| | | | | | 13.941.047,03 | 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 | 10.241.912,47 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 9.786.834,07 | -455.078,40 | 746.246,84 |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA | 7.337.719,07 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 7.002.150,45 | -335.568,62 | -21.535,80 |
| OCCAM FIC FIA | 8.840.158,05 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 8.476.272,59 | -363.885,46 | -208.974,63 |
| TARPON GT 30 FIC FIA | 4.000.000,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.955.049,13 | -44.950,87 | -44.950,87 |
| | | | | | 29.220.306,24 | 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 | 27.827.425,36 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 28.544.231,65 | 716.806,29 | 4.534.898,23 |
| | | | | | 28.544.231,65 | 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 | 29.867,52 | 0,00 | 0,00 | 16.303,66 | 12.793,86 | -770,00 | -54.828,14 |
| PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP | 8.066,96 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 8.066,96 | 0,00 | -2.483,15 |
| | | | | | 20.860,82 | 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 | 3.121.962,94 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 40.000,00 | 3.137.067,48 | 55.104,54 | 213.934,79 |
| BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11 | 1.213.451,60 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 8.550,00 | 1.232.611,93 | 27.710,33 | -10.880,21 |
| | | | | | | 4.369.679,41 | 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 | 9.741.923,74 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10.357.361,14 | 615.437,40 | 357.361,14 |
| | | | | | 10.357.361,14 | 0,00 | 0,00 |

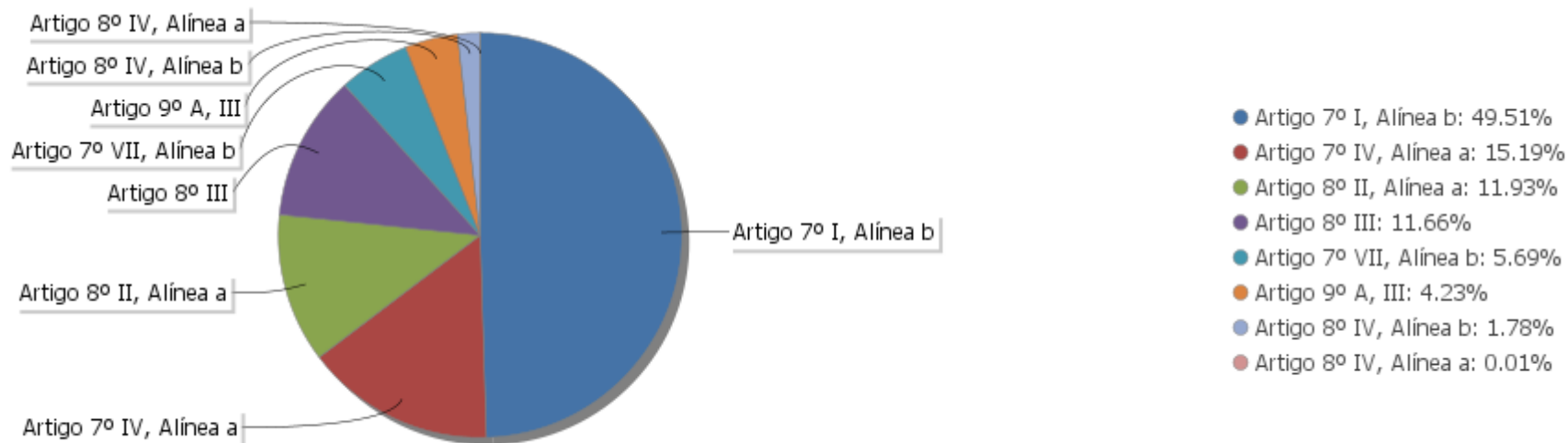
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

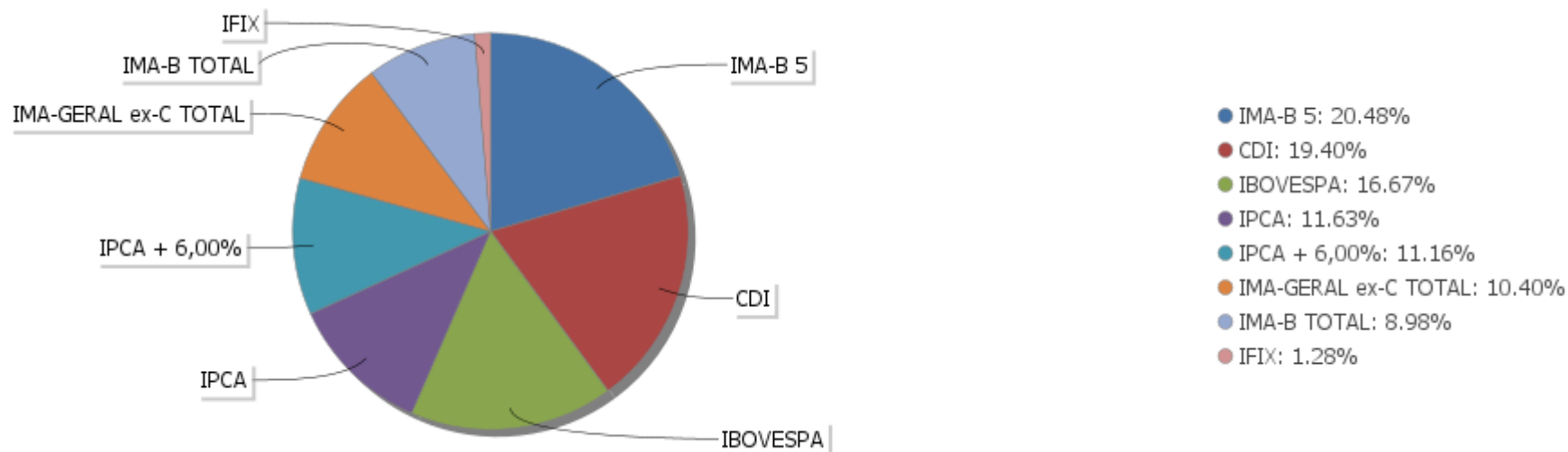
| Período | Valor (R\$) | (%) | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|----------------|-------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias | 207.436.998,32 | 84,71 | 207.436.998,32 | 84,71 |
| de 31 a 365 dias | 7.002.150,45 | 2,86 | 214.439.148,77 | 87,57 |
| acima de 365 dias | 30.443.484,24 | 12,43 | 244.882.633,01 | 100,00 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

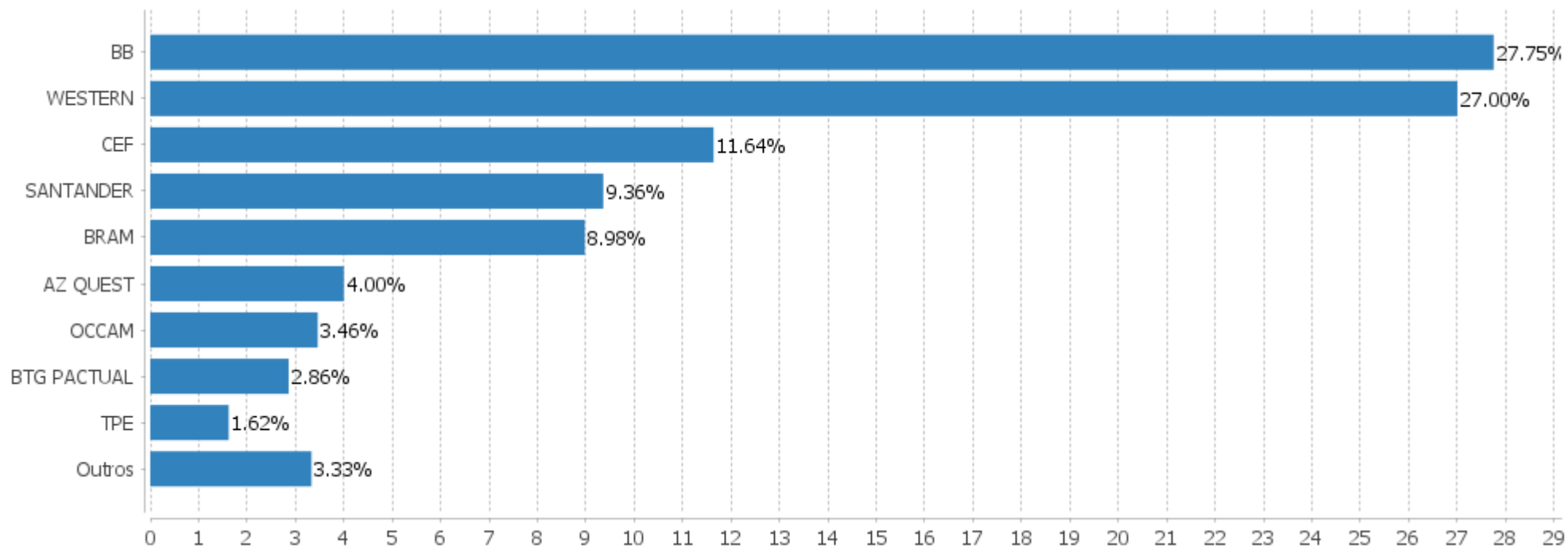


Alocação Por Estratégia



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 | | | | | | 1,83 |
| IPCA + 5,44% | 0,67 | 1,24 | 1,42 | 0,73 | 1,28 | 0,97 | 1,43 | | | | | | 8,00 |
| p.p. indexador | -1,49 | -2,23 | -0,56 | 0,81 | -0,38 | -0,59 | -1,47 | | | | | | -6,18 |
| 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 |

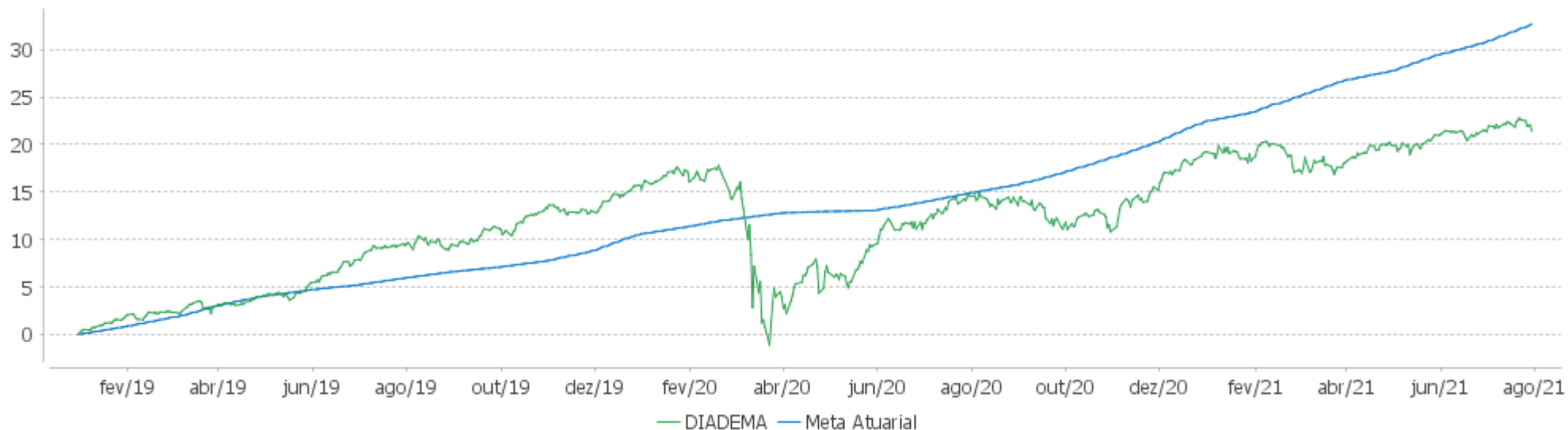
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

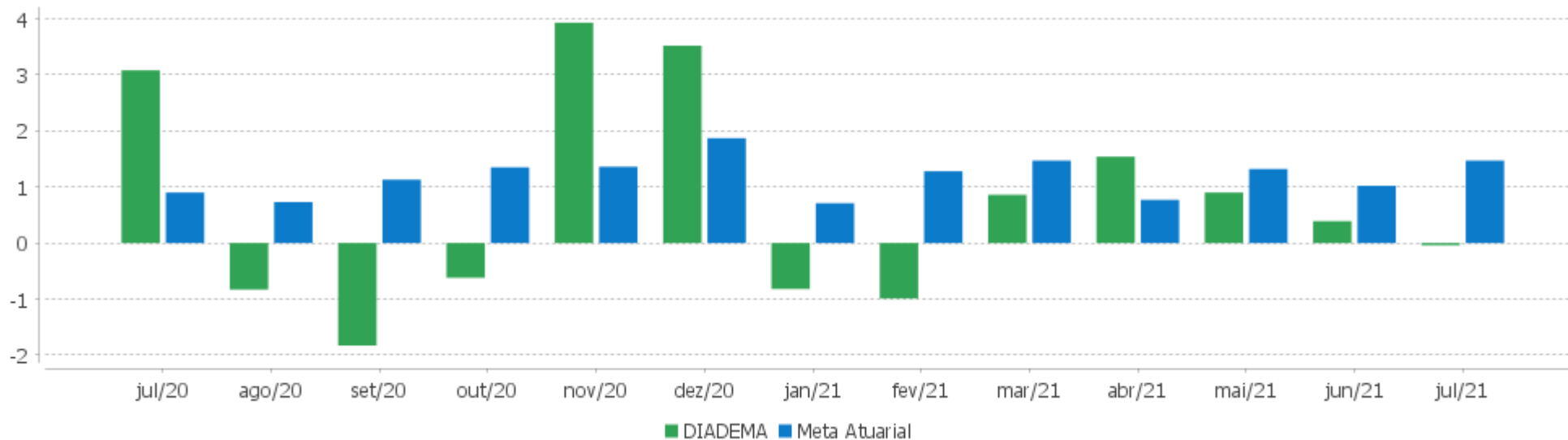
| | Quantidade | Perc. (%) | Período | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima - Meta Atuarial | 15 | 48,39 | 03 meses | 1,25 | 3,72 | -2,48 | 4,08 |
| Meses abaixo - Meta Atuarial | 16 | 51,61 | 06 meses | 2,67 | 7,28 | -4,62 | 5,08 |
| | | | 12 meses | 5,99 | 15,08 | -9,09 | 5,79 |
| | | | 24 meses | 11,02 | 24,74 | -13,72 | 9,68 |
| Maior rentabilidade da Carteira | 3,93 | 2020-11 | Desde 31/12/2018 | 21,40 | 32,15 | -10,75 | 8,63 |
| 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 + 6,00% p.p. | -0,07 -1,55 | 0,58 -7,75 | 0,39 -3,47 | 0,49 -7,08 | 4,73 -10,75 | 13,21 -12,05 | 27,82 -9,17 |
| MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO % do CDI | 0,48 134,38 | 2,69 165,24 | 1,36 145,70 | 2,43 164,61 | 5,00 205,36 | 4,45 65,78 | 11,49 84,83 |
| WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p. | -0,42 -0,45 | -1,64 -2,95 | -0,17 -0,76 | -0,98 -2,19 | 1,59 -3,47 | 13,59 -0,74 | 34,64 4,21 |
| SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p. | 0,01 -0,02 | 1,20 -0,12 | 0,53 -0,06 | 1,11 -0,09 | 4,82 -0,23 | 13,88 -0,46 | 29,65 -0,79 |
| BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6,00% p.p. | 0,66 -0,81 | 2,90 -5,44 | 1,78 -2,08 | 2,60 -4,97 | 6,99 -8,49 | 16,37 -8,89 | 35,29 -1,70 |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p. | -0,25 -0,15 | -0,93 -0,49 | 0,34 -0,38 | -0,38 -0,38 | 0,55 -0,41 | 7,68 -0,42 | 24,46 0,00 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p. | -0,78 -1,74 | -0,06 -4,83 | -0,54 -2,88 | -0,09 -4,59 | 0,90 -8,10 | 10,67 -0,84 | 29,39 14,29 |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p. | -0,44 -0,07 | -1,80 -0,71 | 0,99 -0,11 | -0,79 -0,54 | 1,64 -0,88 | 9,99 -0,90 | 40,23 -1,12 |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI | 0,39 110,56 | 1,72 105,50 | 1,01 108,46 | 1,55 104,99 | 2,51 103,09 | 6,34 93,69 | 12,96 95,68 |
| BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO Var. IFIX p.p. | 1,77 -0,74 | 7,14 8,74 | 3,99 5,28 | 9,49 11,41 | 12,37 9,04 | 12,31 6,12 | 11,47 -19,62 |
| BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11 Var. IBOVESPA p.p. | 2,29 6,24 | -0,89 -3,22 | -0,86 -3,31 | -1,69 -7,54 | -2,13 -20,48 | -1,42 -21,06 | 9,37 -44,38 |
| WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI | 2,58 724,35 | 18,89 1.159,50 | 5,76 619,35 | 19,08 1.291,39 | 34,89 1.433,79 | 46,24 683,21 | 60,64 447,75 |
| FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA Var. IPCA + 6,00% p.p. | -2,58 -4,05 | -64,69 -73,03 | -63,98 -67,85 | -64,51 -72,07 | -63,73 -79,21 | -89,25 -114,51 | -89,39 -126,38 |
| PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP % do CDI | 0,00 0,00 | -23,54 -1.444,87 | -10,86 -1.166,82 | -14,54 -984,30 | -29,16 -1.198,57 | -99,81 -1.474,77 | -99,80 -736,95 |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p. | -4,57 -0,63 | -0,31 -2,65 | 0,17 -2,27 | 0,31 -5,54 | 8,25 -10,10 | 22,05 2,42 | 75,44 21,69 |
| TARPON GT 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p. | -1,12 2,82 | 24,31 21,97 | 7,56 5,11 | 28,74 22,89 | 43,68 25,33 | | |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA | -4,44 | 8,25 | 1,64 | 10,37 | 15,22 | 28,77 | 87,80 |

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. | -0,50 | 5,92 | -0,81 | 4,51 | -3,14 | 9,14 | 34,05 |
| OCCAM FIC FIA | -4,12 | 0,31 | -0,40 | 3,55 | 13,55 | 21,51 | 66,10 |
| Var. IBOVESPA p.p. | -0,17 | -2,03 | -2,85 | -2,30 | -4,80 | 1,88 | 12,35 |
| WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I | 6,32 | 13,81 | 1,55 | 10,61 | 31,05 | 114,09 | 137,95 |
| Var. IBOVESPA p.p. | 10,26 | 11,47 | -0,90 | 4,76 | 12,70 | 94,46 | 84,20 |
| DIADEMA | -0,04 | 1,83 | 1,25 | 2,67 | 5,99 | 11,02 | |
| Var. IPCA + 6,00% p.p. | -1,52 | -6,50 | -2,62 | -4,90 | -9,49 | -14,24 | |
| CDI | 0,36 | 1,63 | 0,93 | 1,48 | 2,43 | 6,77 | 13,54 |
| IBOVESPA | -3,94 | 2,34 | 2,44 | 5,85 | 18,35 | 19,63 | 53,75 |
| INPC + 6,00% | 1,54 | 8,59 | 4,13 | 7,80 | 16,39 | 26,73 | 38,51 |
| IPCA + 6,00% | 1,47 | 8,33 | 3,86 | 7,56 | 15,48 | 25,26 | 36,99 |

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 | 0,19 | 1,00 | 0,60 | 0,96 | 1,99 | 7,60 | 15,44 | 23,97 | 40,68 |
| IRF-M 1+ | -0,83 | -4,11 | -0,42 | -2,76 | -3,34 | 8,28 | 28,38 | 38,97 | 66,27 |
| IRF-M TOTAL | -0,47 | -2,04 | -0,06 | -1,25 | -1,40 | 8,27 | 24,82 | 34,87 | 59,02 |
| IMA-B 5 | 0,03 | 1,31 | 0,59 | 1,21 | 5,06 | 14,34 | 30,43 | 41,23 | 60,61 |
| IMA-B 5+ | -0,76 | -3,29 | 1,44 | -1,63 | 0,34 | 8,18 | 49,88 | 56,72 | 81,63 |
| IMA-B TOTAL | -0,37 | -1,09 | 1,10 | -0,24 | 2,53 | 10,89 | 41,35 | 50,46 | 72,98 |
| IMA-GERAL ex-C TOTAL | -0,10 | -0,44 | 0,72 | -0,00 | 0,96 | 8,10 | 24,45 | 33,52 | 54,06 |
| IMA-GERAL TOTAL | -0,10 | 0,04 | 0,87 | 0,28 | 1,67 | 9,12 | 25,92 | 35,34 | 55,62 |
| IDKA 2 | -0,18 | 1,68 | 0,38 | 1,54 | 5,88 | 15,07 | 29,57 | 41,20 | 61,95 |
| IDKA 20 | -1,44 | -5,02 | 1,98 | -2,27 | -1,21 | 3,68 | 67,33 | 69,21 | 99,56 |
| CDI | 0,36 | 1,63 | 0,93 | 1,48 | 2,43 | 6,77 | 13,54 | 21,60 | 36,83 |

Renda Variável

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IBOVESPA | -3,94 | 2,34 | 2,44 | 5,85 | 18,35 | 19,63 | 53,75 | 84,77 | 112,54 |
| IBRX 100 | -3,99 | 4,47 | 2,33 | 7,73 | 20,73 | 23,34 | 61,40 | 92,00 | 121,47 |
| IBRX 50 | -3,85 | 4,91 | 2,77 | 7,91 | 22,23 | 22,51 | 54,85 | 86,08 | 113,55 |
| SMALL CAP | -5,80 | 4,96 | 1,45 | 8,69 | 20,13 | 29,57 | 86,53 | 106,58 | 160,32 |
| IFIX | 2,51 | -1,60 | -1,29 | -1,92 | 3,33 | 6,19 | 31,08 | 36,68 | 62,68 |
| Índice Consumo - ICON | -5,22 | -2,08 | 1,59 | -0,81 | 2,95 | 15,45 | 58,99 | 62,68 | 71,63 |
| Índice Dividendos - IDIV | -1,72 | 0,31 | 1,58 | 5,67 | 14,21 | 18,21 | 67,31 | 86,37 | 136,91 |

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 | 0,96 | 4,76 | 2,34 | 4,50 | 8,99 | 11,51 | 15,10 | 20,26 | 23,52 |
| INPC | 1,02 | 5,01 | 2,60 | 4,73 | 9,85 | 12,81 | 16,38 | 20,58 | 23,08 |
| IGPM | 0,78 | 15,98 | 5,54 | 13,06 | 33,83 | 46,23 | 55,58 | 68,40 | 65,60 |
| SELIC | 0,36 | 1,64 | 0,94 | 1,49 | 2,44 | 6,76 | 13,54 | 21,59 | 36,81 |

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 | 4,72 | 15,33 | -0,37 | 10,68 | 32,26 | 100,62 | 112,87 | 191,07 | 219,74 |
| MSCI ACWI | 2,99 | 10,44 | -2,20 | 5,36 | 29,16 | 87,89 | 90,03 | 148,07 | 175,22 |
| MSCI World | 4,15 | 12,45 | -1,01 | 7,85 | 31,07 | 90,86 | 94,44 | 156,03 | 181,87 |

Meta Atuarial

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA + 4,00% | 1,31 | 7,15 | 3,36 | 6,55 | 13,32 | 20,59 | 29,41 | 40,58 | 50,15 |
| IPCA + 5,00% | 1,39 | 7,74 | 3,61 | 7,06 | 14,40 | 22,91 | 33,17 | 46,04 | 57,47 |
| IPCA + 5,50% | 1,43 | 8,04 | 3,74 | 7,31 | 14,94 | 24,08 | 35,07 | 48,83 | 61,23 |
| IPCA + 5,89% | 1,47 | 8,27 | 3,84 | 7,51 | 15,36 | 25,00 | 36,57 | 51,03 | 64,22 |
| IPCA + 6,00% | 1,47 | 8,33 | 3,86 | 7,56 | 15,48 | 25,26 | 36,99 | 51,65 | 65,07 |
| INPC + 4,00% | 1,37 | 7,41 | 3,63 | 6,79 | 14,21 | 22,00 | 30,85 | 40,95 | 49,61 |
| INPC + 6,00% | 1,54 | 8,59 | 4,13 | 7,80 | 16,39 | 26,73 | 38,51 | 52,05 | 64,49 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

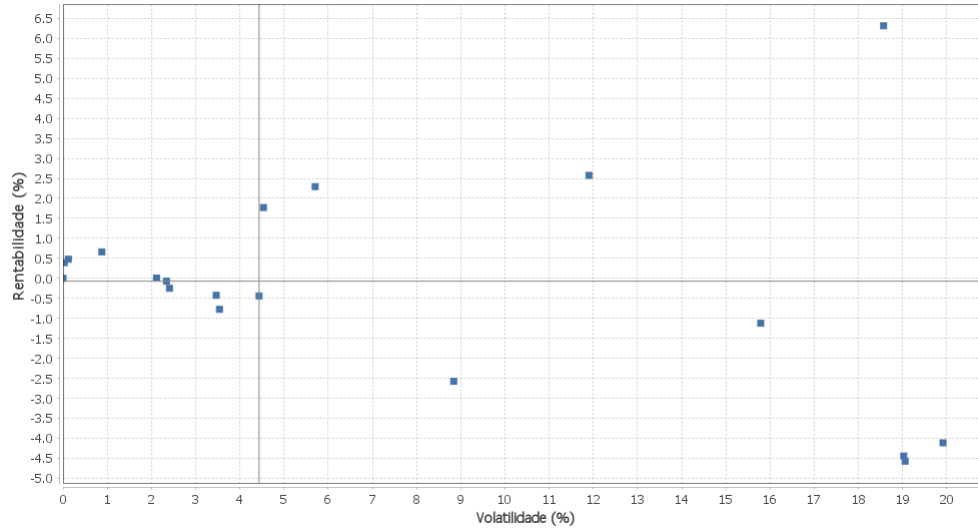
| APR | Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|-----|------------|--|--------------|--------------|--------------------|--------------|
| 132 | 05/07/2021 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 45.000,00 | 19.285,88425800 | 2,3333127690 |
| 147 | 05/07/2021 | BB PREV RF 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 |

Total

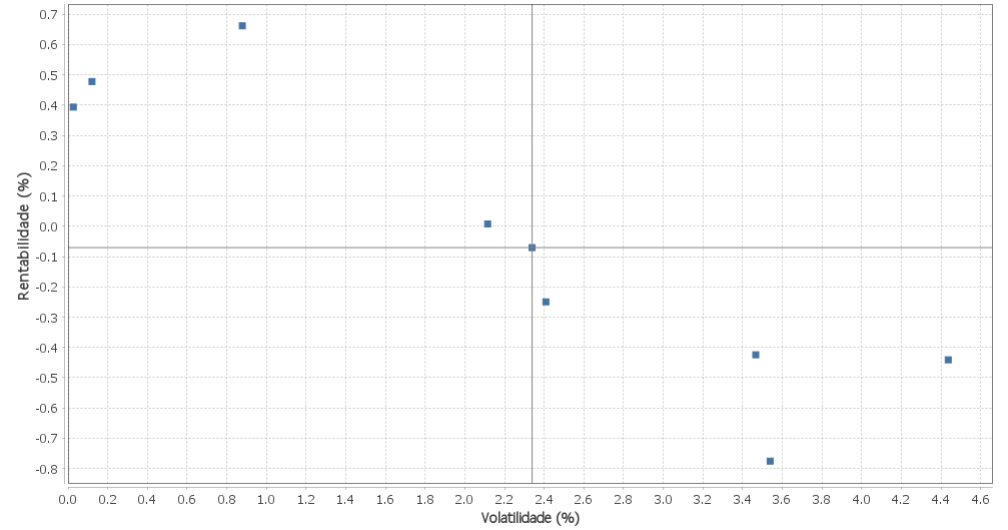
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

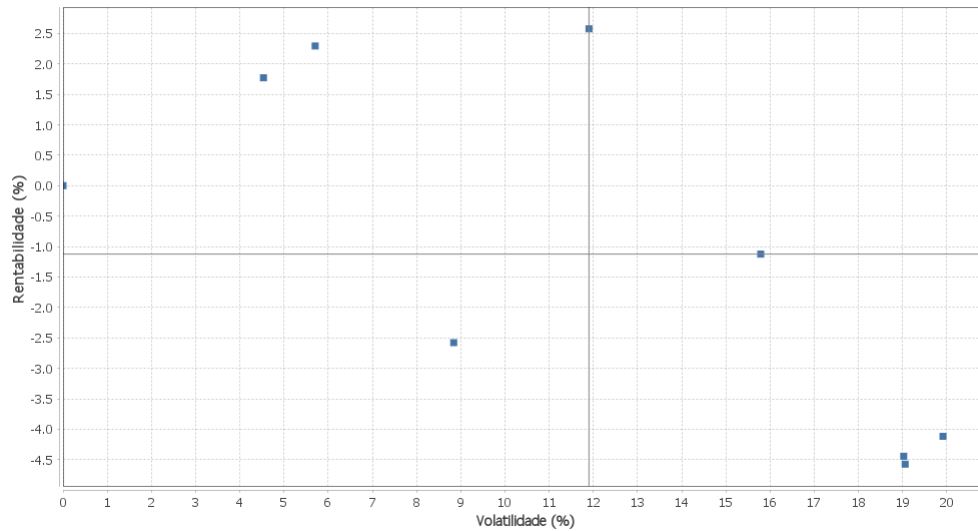
DIADEMA - No Mês



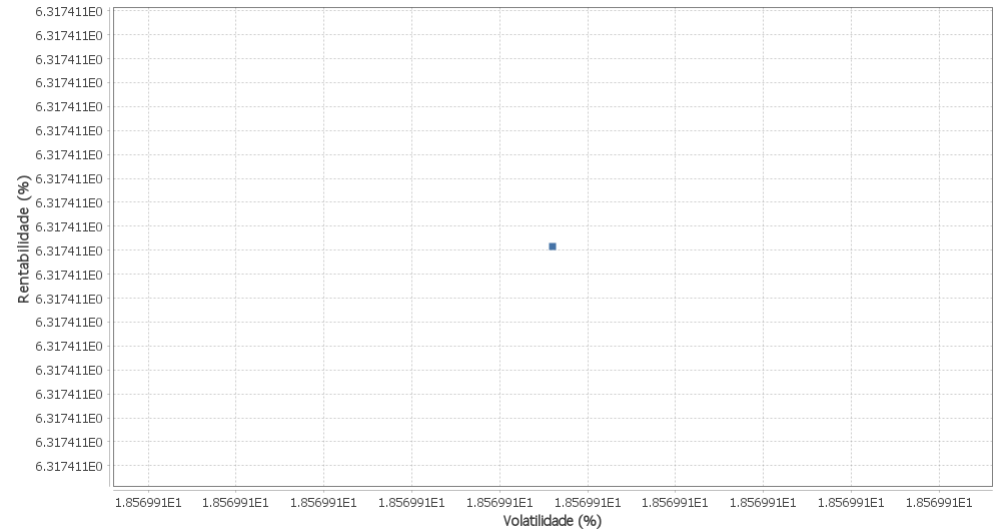
Renda Fixa - No Mês



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\$): 4.887.490,63

Value-At-Risk: 2,00%

| Ativo | Estratégia | Volatilidade | VaR | CVaR | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|-------------------------|--------------|------|-------|--------|-------|---------------|------------|
| PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP | Artigo 8º IV, Alínea a | 0,00 | 0,68 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 8.066,96 | 0,00 |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,03 | 0,03 | 0,00 | 1,42 | 0,39 | 15.200.442,93 | 6,21 |
| MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO | Artigo 7º VII, Alínea b | 0,12 | 0,12 | 0,00 | 1,01 | 0,48 | 3.765.944,76 | 1,54 |
| BB PREV IPCA I | Artigo 7º I, Alínea b | 0,88 | 0,77 | 0,03 | 0,35 | 0,66 | 17.131.314,49 | 7,00 |
| SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI | Artigo 7º I, Alínea b | 2,12 | 1,34 | 0,08 | -0,16 | 0,01 | 22.912.098,46 | 9,36 |
| BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI | Artigo 7º VII, Alínea b | 2,34 | 1,67 | 0,05 | -0,18 | -0,07 | 10.175.102,27 | 4,16 |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI | Artigo 7º I, Alínea b | 2,41 | 1,20 | 0,09 | -0,25 | -0,25 | 25.461.818,42 | 10,40 |
| WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF | Artigo 7º I, Alínea b | 3,47 | 1,85 | 0,14 | -0,23 | -0,42 | 27.250.067,70 | 11,13 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | Artigo 7º I, Alínea b | 3,54 | 1,03 | 0,08 | -0,32 | -0,78 | 28.486.439,50 | 11,63 |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B | Artigo 7º IV, Alínea a | 4,44 | 2,53 | 0,16 | -0,18 | -0,44 | 21.986.965,22 | 8,98 |
| BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO | Artigo 8º IV, Alínea b | 4,53 | 3,34 | -0,00 | 0,31 | 1,77 | 3.137.067,48 | 1,28 |
| BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11 | Artigo 8º IV, Alínea b | 5,71 | 0,27 | -0,00 | 0,34 | 2,29 | 1.232.611,93 | 0,50 |
| FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA | Artigo 8º IV, Alínea a | 8,84 | 4,73 | 0,00 | -0,33 | -2,58 | 12.793,86 | 0,01 |
| WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO | Artigo 8º III | 11,90 | 6,34 | 0,58 | 0,19 | 2,58 | 28.544.231,65 | 11,66 |
| TARPON GT 30 FIC FIA | Artigo 8º II, Alínea a | 15,79 | 7,39 | 0,08 | -0,09 | -1,12 | 3.955.049,13 | 1,62 |
| WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I | Artigo 9º A, III | 18,57 | 8,99 | 0,10 | 0,32 | 6,32 | 10.357.361,14 | 4,23 |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA | Artigo 8º II, Alínea a | 19,03 | 7,51 | 0,24 | -0,25 | -4,44 | 9.786.834,07 | 4,00 |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA | Artigo 8º II, Alínea a | 19,06 | 8,33 | 0,18 | -0,26 | -4,57 | 7.002.150,45 | 2,86 |
| OCCAM FIC FIA | Artigo 8º II, Alínea a | 19,91 | 7,63 | 0,20 | -0,22 | -4,12 | 8.476.272,59 | 3,46 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

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

- O Instituto está com 11,66% 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 11,66% dos recursos garantidores alocados no Artigo 8º III, limite este, superior ao limite máximo estipulado na política de investimentos.