



LDB
EMPRESAS

DIADEMA
JUNHO 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 30.06.2021.

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 70,78%

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	2,54	-0,15	1,19	22.910.389,78	9,25	1.293.639.877,69	1,77
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	5,72	0,32	-0,94	0,00	0,00	1.164.792.331,10	0,00
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	4,32	-0,28	-1,22	27.366.266,42	11,05	1.358.777.143,52	2,01
BB	BB	BB PREV IPCA I	1,78	0,36	2,22	17.018.689,87	6,87	516.660.063,12	3,29
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,94	0,11	-0,68	25.392.044,15	10,25	9.201.718.777,36	0,28
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,33	-0,00	0,72	32.720.691,23	13,21	16.058.908.177,46	0,20
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,22	0,04	-0,06	125.408.081,45	50,64		

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	6,00	0,44	-1,36	22.084.347,68	8,92	1.784.600.519,94	1,24
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,18	0,33	1,32	13.869.984,29	5,60	3.920.215.063,90	0,35
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			3,46	0,26	-0,43	35.954.331,97	14,52		

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	2,88	-0,07	0,65	10.182.280,95	4,11	630.534.374,83	1,61
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	0,42	0,44	2,20	3.748.033,69	1,51	253.805.808,65	1,48
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			2,18	0,07	1,07	13.930.314,64	5,62		
Renda Fixa			3,15	0,10	-0,02	175.292.728,06	70,78		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

25,29%

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	20,71	1,61	13,29	10.241.912,47	4,14	1.762.410.329,14	0,58
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	20,44	1,29	4,47	7.337.719,07	2,96	3.144.220.101,84	0,23
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	21,02	-0,48	4,62	8.840.158,05	3,57	1.268.903.313,44	0,70
TPE	DAYCOVAL	TARPON GT 30 FIC FIA	17,67	0,00	0,00	4.000.000,00	1,62	257.441.518,79	1,55
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			19,71	0,82	6,54	30.419.789,59	12,28		

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	15,06	2,69	15,90	27.827.425,36	11,24	1.940.724.929,23	1,43
Sub-total Artigo 8º III			15,06	2,69	15,90	27.827.425,36	11,24		

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	15,80	-9,01	-23,53	8.066,96	0,00	1.110.895,52	0,73
CEF	CEF	FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	98,30	-62,36	-76,60	29.867,52	0,01	2.927.459,72	1,02
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			128,07	-57,00	-72,21	37.934,48	0,02		

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	27,28	0,64	5,27	3.121.962,94	1,26	64.779.558,74	4,82
BRPP	GERAÇÃO FUTURO	BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	8,22	-1,58	-3,11	1.213.451,60	0,49	371.794.835,59	0,33
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			19,27	0,01	2,80	4.335.414,54	1,75		

Renda Variável e Investimentos Estruturados

15,82 1,53 8,55 62.620.563,97 25,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,93%

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	20,55	-0,46	-2,58	9.741.923,74	3,93	3.350.369.820,93	0,29
Sub-total Artigo 9º A, III			20,55	-0,46	-2,58	9.741.923,74	3,93		
Investimentos no Exterior			15,72	-0,46	-2,58	9.741.923,74	3,93		
Total			5,88	0,39	1,87	247.655.215,77	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	125.408.081,45	50,64	15,00	60,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	35.954.331,97	14,52	1,00	10,00	40,00	0,00	45,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	13.930.314,64	5,62	0,00	3,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Fixa	175.292.728,06	70,78					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	30.419.789,59	12,28	2,00	16,00	25,00	0,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	27.827.425,36	11,24	2,00	8,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	37.934,48	0,02	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	4.335.414,54	1,75	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	62.620.563,97	25,29					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	9.741.923,74	3,93	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	9.741.923,74	3,93					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	0,04 13,23	-0,06 -4,35	1,30 164,83	-0,06 -4,35	4,21 185,14	2.656,80	-127.014,18
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,26 84,99	-0,43 -33,62	1,51 192,04	-0,43 -33,62	3,74 164,15	166.164,06	-65.888,55
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,07 22,11	1,07 83,51	1,41 179,53	1,07 83,51	5,75 252,43	9.473,30	147.056,59
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	0,82 0,35	6,54 -0,00	9,10 0,38	6,54 -0,00	22,20 -11,20	170.309,88	935.404,76
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	2,69 2,22	15,90 9,36	8,70 -0,02	15,90 9,36	38,91 5,51	728.314,50	3.818.091,94
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-57,00 -57,46	-72,21 -78,75	-58,12 -66,84	-72,21 -78,75	-71,80 -105,20	-50.279,32	-56.541,29
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	0,01 -0,46	2,80 -3,75	2,43 -6,29	2,80 -3,75	6,22 -27,18	584,08	120.239,71
Artigo 9º A, III % do CDI	-0,46 -149,99	-2,58 -314,99	-2,27 -288,24			-45.181,56	-258.076,26
DIADEMA (Total)						982.041,74	4.513.272,72

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	16.957.174,17	0,00	0,00	0,00	17.018.689,87	61.515,70	372.604,43
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	25.231.635,21	132.656,24	0,00	0,00	25.392.044,15	27.752,70	-180.414,84
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	36.738.426,85	0,00	-4.000.000,00	0,00	32.720.691,23	-17.735,62	245.023,05
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2.191.419,96	20.777.958,88	0,00	0,00	22.910.389,78	-58.989,06	-29.930,76
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	20.711.176,39	0,00	-20.777.958,88	0,00	0,00	66.782,49	-197.089,90
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	27.442.935,83	0,00	0,00	0,00	27.366.266,42	-76.669,41	-337.206,16
					125.408.081,45	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	28.011.405,56	19.447.326,56	-33.657.444,97	0,00	13.869.984,29	68.697,14	239.612,66
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	21.986.880,76	0,00	0,00	0,00	22.084.347,68	97.466,92	-305.501,21
					35.954.331,97	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	10.189.374,52	0,00	0,00	0,00	10.182.280,95	-7.093,57	66.254,81
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	3.731.466,82	0,00	0,00	0,00	3.748.033,69	16.566,87	80.801,78
					13.930.314,64	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	10.079.756,64	0,00	0,00	0,00	10.241.912,47	162.155,83	1.201.325,24
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	7.244.422,00	0,00	0,00	0,00	7.337.719,07	93.297,07	314.032,82
OCCAM FIC FIA	4.925.301,07	4.000.000,00	0,00	0,00	8.840.158,05	-85.143,02	154.910,83
TARPON GT 30 FIC FIA	0,00	4.000.000,00	0,00	0,00	4.000.000,00	0,00	0,00
					30.419.789,59	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	27.099.110,86	0,00	0,00	0,00	27.827.425,36	728.314,50	3.818.091,94
					27.827.425,36	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	79.347,79	0,00	0,00	0,00	29.867,52	-49.480,27	-54.058,14
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	8.866,01	0,00	0,00	0,00	8.066,96	-799,05	-2.483,15
					37.934,48	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	3.129.447,28	0,00	0,00	0,00	27.500,00	3.121.962,94	20.015,66	158.830,25
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	1.241.433,18	0,00	0,00	0,00	8.550,00	1.213.451,60	-19.431,58	-38.590,54
						4.335.414,54	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	9.787.105,30	0,00	0,00	0,00	9.741.923,74	-45.181,56	-258.076,26
					9.741.923,74	0,00	0,00

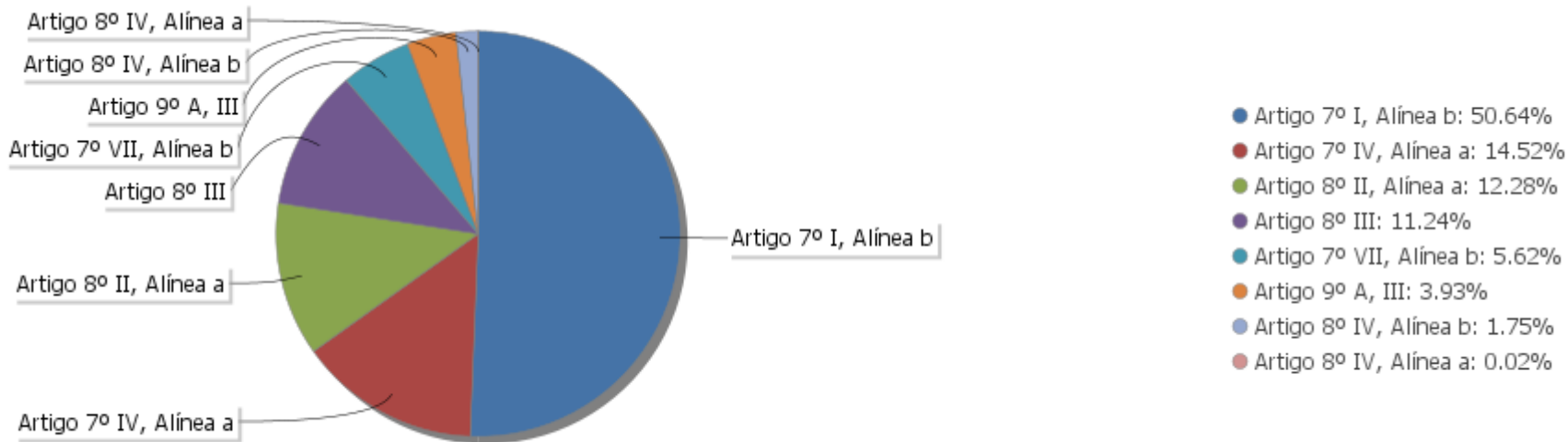
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

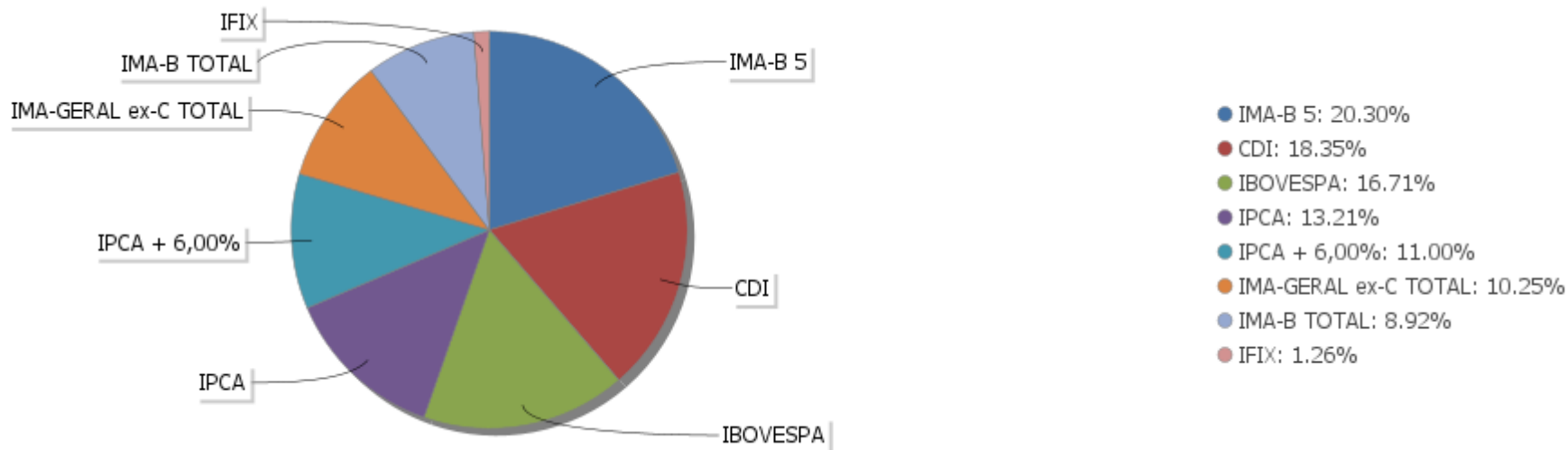
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	209.994.562,94	84,79	209.994.562,94	84,79
de 31 a 365 dias	7.337.719,07	2,96	217.332.282,01	87,76
acima de 365 dias	30.322.933,76	12,24	247.655.215,77	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

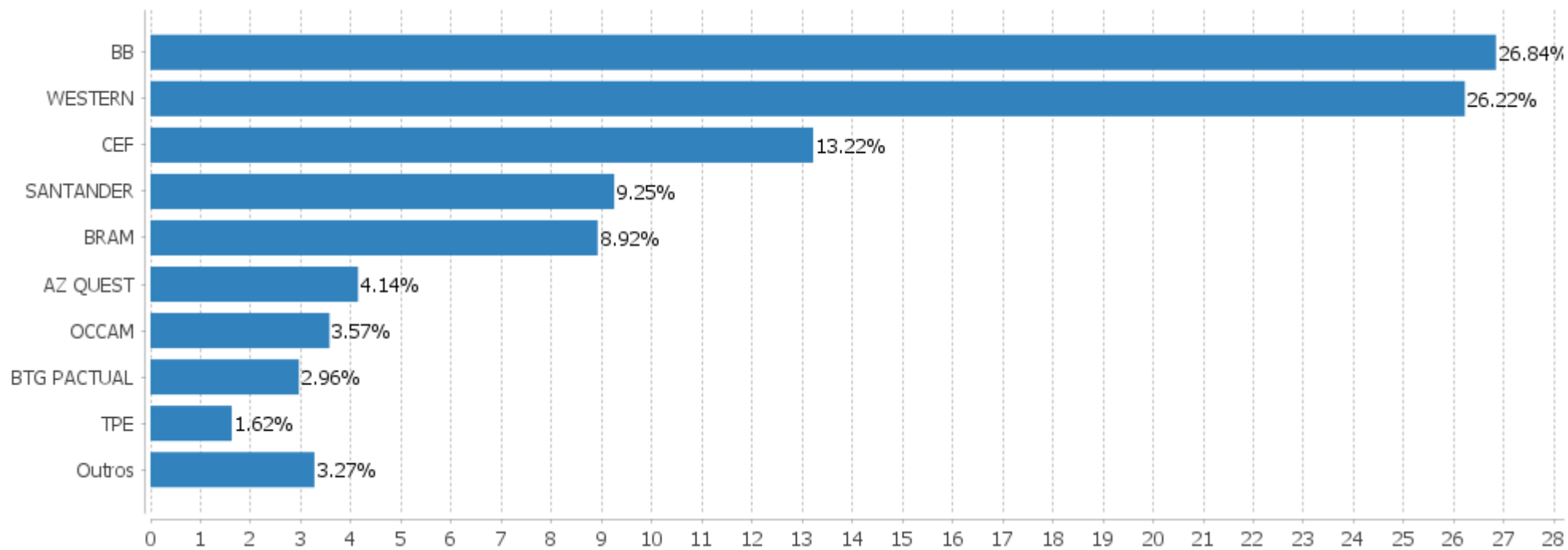


Alocação Por Estratégia



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							1,87
IPCA + 5,44%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,28	0,97							6,48
p.p. indexador	-1,49	-2,23	-0,56	0,81	-0,38	-0,59							-4,61
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

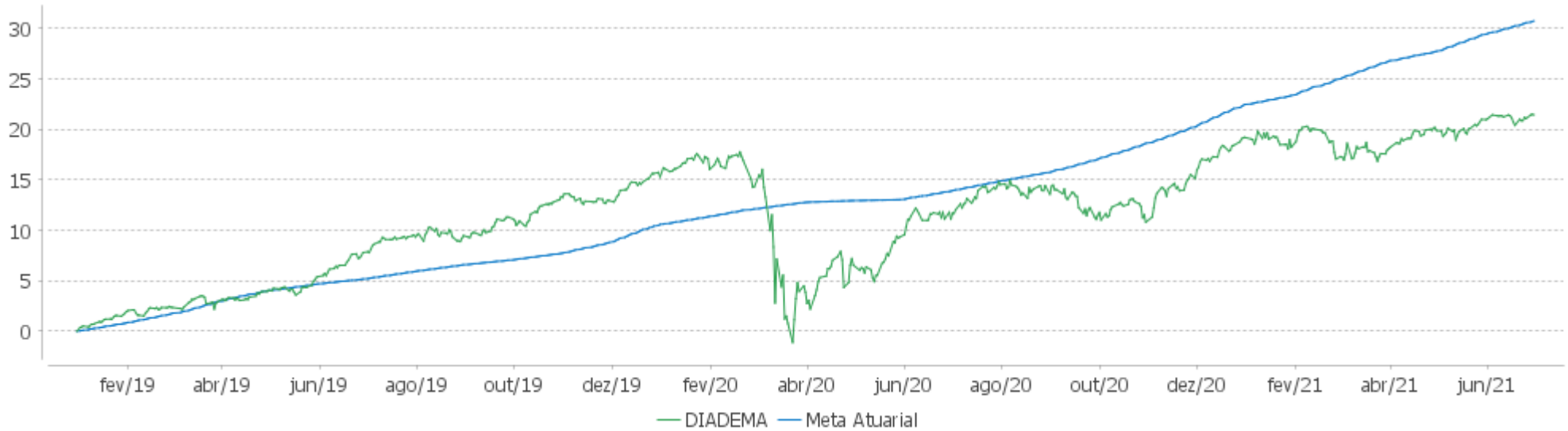
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

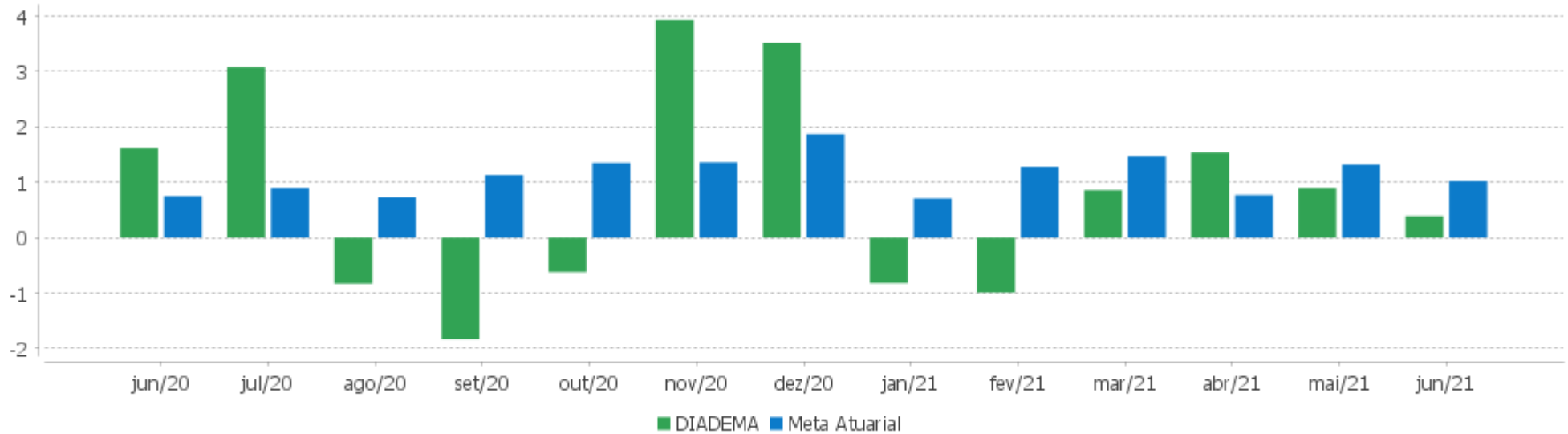
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	15	50,00	03 meses	2,85	3,01	-0,16	3,86
Meses abaixo - Meta Atuarial	15	50,00	06 meses	1,87	6,48	-4,61	5,51
			12 meses	9,30	14,46	-5,16	5,88
			24 meses	12,66	23,87	-11,21	9,64
Maior rentabilidade da Carteira	3,93	2020-11	Desde 31/12/2018	21,45	30,29	-8,84	8,75
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 -1,09	0,65 -6,10	1,44 -1,71	0,65 -6,10	5,83 -8,99	14,23 -10,10	31,29 -4,85
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO % do CDI	0,44 144,25	2,20 172,45	1,35 171,36	2,20 172,45	5,51 242,05	4,58 65,53	11,58 84,28
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	-0,28 -0,15	-1,22 -2,50	1,33 -0,11	-1,22 -2,50	3,85 -2,22	15,35 -0,07	37,98 5,66
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	-0,15 -0,02	1,19 -0,10	1,38 -0,05	1,19 -0,10	5,83 -0,24	14,95 -0,46	31,53 -0,80
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,36 -0,66	2,22 -4,54	1,53 -1,62	2,22 -4,54	7,12 -7,70	16,78 -7,56	37,07 0,93
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,11 -0,21	-0,68 -0,34	1,22 -0,10	-0,68 -0,34	2,58 -0,16	9,05 -0,18	26,47 0,17
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,00 -0,53	0,72 -3,05	0,90 -0,78	0,72 -3,05	2,68 -5,67	12,77 2,11	31,64 17,26
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,40 -0,02	-0,86 -0,14	2,07 -0,08	-0,86 -0,14	7,11 -0,31	11,83 -0,91	43,63 -1,53
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,44 0,02	-1,36 -0,64	2,15 0,00	-1,36 -0,64	6,66 -0,76	11,84 -0,90	44,15 -1,01
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,33 106,86	1,32 103,34	0,81 103,39	1,32 103,34	2,35 103,14	6,51 93,15	13,10 95,32
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA Var. IPCA + 6,00% p.p.	-62,36 -63,38	-63,76 -70,52	-63,30 -66,44	-63,76 -70,52	-63,03 -77,85	-88,98 -113,31	-89,10 -125,24
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP % do CDI	-9,01 -2.928,28	-23,54 -1.842,21	-12,37 -1.569,75	-23,54 -1.842,21	-29,79 -1.308,78	-99,81 -1.429,03	-99,80 -726,14
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	1,29 0,82	4,47 -2,07	6,01 -2,70	4,47 -2,07	22,94 -10,46	33,78 8,20	91,40 17,13
TARPON GT 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,08 2,62	25,72 19,18	20,52 11,81	25,72 19,18	58,95 25,56		
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	1,61 1,14	13,29 6,75	13,74 5,02	13,29 6,75	37,58 4,18	47,53 21,95	100,39 26,12
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-0,48 -0,94	4,62 -1,92	7,52 -1,19	4,62 -1,92	30,15 -3,25	35,00 9,42	87,85 13,59
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	2,69	15,90	8,70	15,90	38,91	44,64	62,63

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Varição da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	873,23	1.244,68	1.103,60	1.244,68	1.709,11	639,12	455,68
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO Var. IFIX p.p.	0,64 2,82	5,27 9,29	4,70 7,93	5,27 9,29	12,15 13,99	11,77 6,86	13,17 -16,46
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11 Var. IBOVESPA p.p.	-1,58 -2,05	-3,11 -9,65	-3,00 -11,72	-3,11 -9,65	-6,91 -40,30	-3,11 -28,69	10,87 -63,40
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	-0,46 -0,93	7,05 0,51	-2,27 -10,99	7,05 0,51	26,43 -6,97	103,88 78,30	127,63 53,36
DIADEMA Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,39 -0,63	1,87 -4,89	2,85 -0,30	1,87 -4,89	9,30 -5,52	12,66 -11,67	
CDI	0,31	1,28	0,79	1,28	2,28	6,98	13,74
IBOVESPA	0,46	6,54	8,72	6,54	33,40	25,59	74,27
INPC + 6,00%	1,09	6,95	3,42	6,95	15,75	25,60	37,46
IPCA + 6,00%	1,02	6,76	3,15	6,76	14,82	24,33	36,14

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	0,21	0,81	0,68	0,81	2,04	8,17	15,99	25,04	41,88
IRF-M 1+	0,22	-3,30	1,54	-3,30	-1,09	10,57	31,78	44,01	70,12
IRF-M TOTAL	0,21	-1,58	1,26	-1,58	0,14	9,97	27,26	38,64	61,89
IMA-B 5	-0,13	1,29	1,44	1,29	6,07	15,42	32,32	45,20	62,50
IMA-B 5+	0,83	-2,55	2,69	-2,55	8,52	10,66	55,78	65,31	89,15
IMA-B TOTAL	0,42	-0,72	2,14	-0,72	7,42	12,74	45,16	57,06	77,99
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,32	-0,34	1,32	-0,34	2,74	9,23	26,31	36,75	56,76
IMA-GERAL TOTAL	0,35	0,14	1,48	0,14	3,55	10,30	27,83	38,65	58,38
IDKA 2	-0,32	1,87	1,91	1,87	7,06	16,45	31,87	45,03	63,71
IDKA 20	1,07	-3,63	3,85	-3,63	12,34	7,07	77,65	82,49	113,49
CDI	0,31	1,28	0,79	1,28	2,28	6,98	13,74	22,11	37,80

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,46	6,54	8,72	6,54	33,40	25,59	74,27	101,60	146,09
IBRX 100	0,63	8,82	9,61	8,82	36,33	29,97	82,97	109,81	156,78
IBRX 50	0,66	9,11	9,99	9,11	37,48	27,96	75,42	102,75	146,44
SMALL CAP	1,29	11,42	12,41	11,42	39,64	46,83	108,08	137,16	216,68
IFIX	-2,19	-4,02	-3,23	-4,02	-1,83	4,90	29,63	32,82	68,17
Índice Consumo - ICON	0,64	3,32	8,00	3,32	16,90	33,24	78,77	81,45	99,34
Índice Dividendos - IDIV	-2,17	2,06	5,45	2,06	23,79	23,60	82,61	98,77	171,68

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	0,53	3,77	1,68	3,77	8,35	10,66	14,38	19,40	22,99
INPC	0,60	3,95	1,95	3,95	9,22	11,78	15,49	19,56	22,62
IGPM	0,60	15,08	6,30	15,08	35,75	45,68	55,16	65,90	64,61
SELIC	0,31	1,28	0,79	1,28	2,28	6,98	13,75	22,12	37,84

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	-2,27	10,13	-5,03	10,13	26,62	90,69	105,09	168,14	219,09
MSCI ACWI	-3,25	7,23	-6,11	7,23	25,29	79,54	84,88	134,07	181,00
MSCI World	-3,06	7,96	-5,78	7,96	25,18	80,80	87,35	138,06	184,42

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,86	5,77	2,66	5,77	12,66	19,69	28,60	39,56	49,47
IPCA + 5,00%	0,94	6,27	2,91	6,27	13,74	22,00	32,33	44,97	56,75
IPCA + 5,50%	0,98	6,51	3,03	6,51	14,28	23,16	34,23	47,73	60,50
IPCA + 5,89%	1,01	6,71	3,12	6,71	14,70	24,08	35,71	49,92	63,47
IPCA + 6,00%	1,02	6,76	3,15	6,76	14,82	24,33	36,14	50,54	64,32
INPC + 4,00%	0,93	5,96	2,94	5,96	13,57	20,91	29,85	39,74	49,03
INPC + 6,00%	1,09	6,95	3,42	6,95	15,75	25,60	37,46	50,74	63,83

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
101	01/06/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.997.000,00	1.719.273,47121400	2,3248192140
102	01/06/2021	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	0,00	20.777.958,88	732.517,98822086	28,3651176000
103	02/06/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.000.000,00	0,00	1.720.271,65607900	2,3252141520
104	02/06/2021	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	20.777.958,88	0,00	747.949,25788154	27,7799044000
105	04/06/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	35.000,00	15.049,81814900	2,3256094960
106	04/06/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.180.471,53	507.596,62446800	2,3256094960
107	07/06/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.000.000,00	1.719.748,14861000	2,3259219690
108	08/06/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	12.000,00	5.158,57537400	2,3262236430
109	08/06/2021	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	132.656,24	0,00	87.170,54472300	1,5218012050
110	08/06/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.176.056,94	505.564,86412600	2,3262236430
111	08/06/2021	OCCAM FIC FIA	4.000.000,00	0,00	1.075.319,69254459	3,7198240000
112	09/06/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.000,00	1.289,47704200	2,3265245540
113	15/06/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	21.479,61836500	2,3277880990
114	15/06/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.616.691,45	2.842.480,14363600	2,3277880990
115	16/06/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	27.500,00	0,00	11.811,83034500	2,3281743130
116	18/06/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	7.255.040,35	0,00	3.115.314,75285300	2,3288306080
117	21/06/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	7.000,00	3.005,22603600	2,3292757070
118	21/06/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.000,00	2.146,59002600	2,3292757070
119	22/06/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	45.000,00	19.316,32616800	2,3296355430
120	22/06/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	7.237.916,25	3.106.887,80129000	2,3296355430
121	23/06/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.000.000,00	0,00	1.716.728,10114700	2,3300137030
122	23/06/2021	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	4.000.000,00	2.633.457,01803128	1,5189160000
123	25/06/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	140.000,00	60.064,47803300	2,3308285460
124	28/06/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.000.000,00	0,00	428.941,17200100	2,3313220210
125	28/06/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	3.164.786,21	0,00	1.357.507,10605000	2,3313220210
126	29/06/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.000.000,00	1.715.437,96465500	2,3317660460
127	30/06/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	45.000,00	19.295,44614800	2,3321564920
128	30/06/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.107.308,80	2.189.951,15358600	2,3321564920

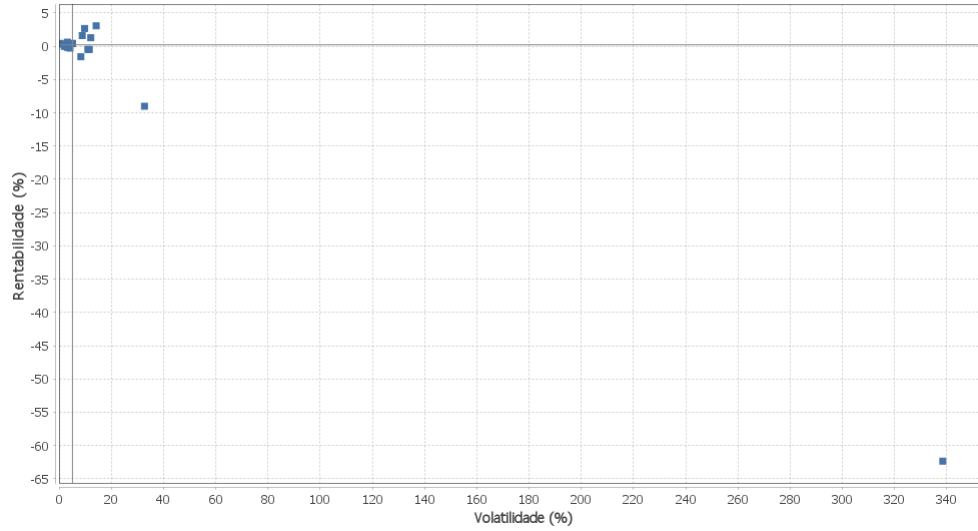
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
129	30/06/2021	TARPON GT 30 FIC FIA	4.000.000,00	0,00	2.671.340,94343160	1,4973753200
Total						

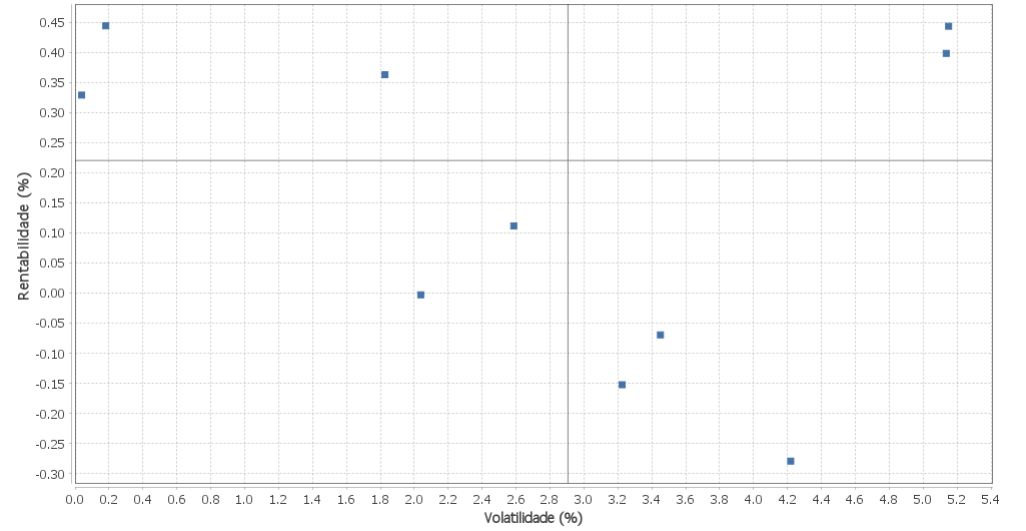
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

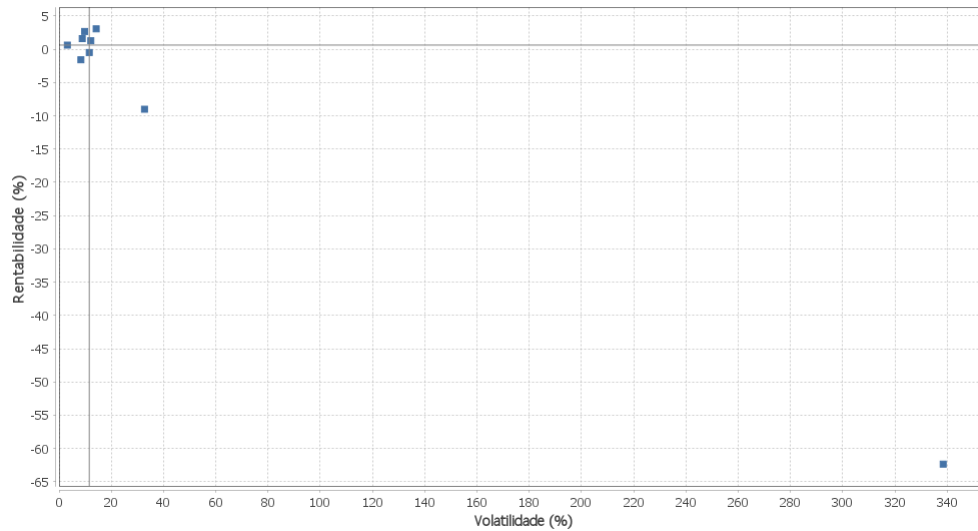
DIADEMA - No Mês



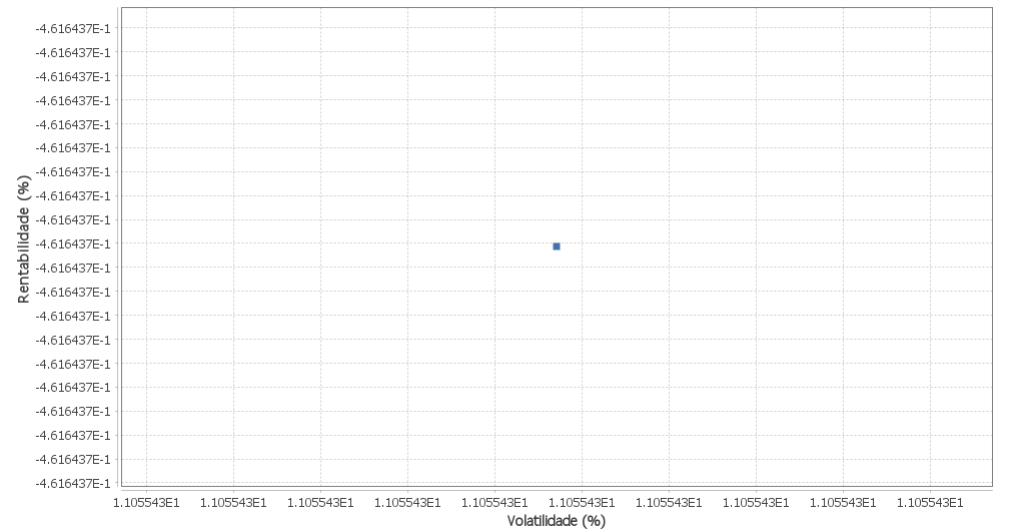
Renda Fixa - No Mês



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\$): 5.568.195,13

Value-At-Risk: 2,25%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,04	0,00	0,55	0,33	13.869.984,29	5,60
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	Artigo 7º VII, Alínea b	0,18	0,16	0,00	0,75	0,44	3.748.033,69	1,51
BB PREV IPCA I	Artigo 7º I, Alínea b	1,83	0,94	0,04	0,03	0,36	17.018.689,87	6,87
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,04	1,15	0,11	-0,15	-0,00	32.720.691,23	13,21
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,59	1,24	0,09	-0,08	0,11	25.392.044,15	10,25
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	Artigo 8º IV, Alínea b	3,18	2,64	0,00	0,10	0,64	3.121.962,94	1,26
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,23	1,44	0,10	-0,14	-0,15	22.910.389,78	9,25
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	Artigo 7º VII, Alínea b	3,45	1,82	0,05	-0,11	-0,07	10.182.280,95	4,11
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	4,22	2,06	0,16	-0,14	-0,28	27.366.266,42	11,05
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	Artigo 7º I, Alínea b	5,14	NaN	0,00	0,02	0,40	0,00	0,00
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	5,15	2,94	0,17	0,03	0,44	22.084.347,68	8,92
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11	Artigo 8º IV, Alínea b	8,36	0,33	-0,00	-0,23	-1,58	1.213.451,60	0,49
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	8,88	10,22	0,34	0,15	1,61	10.241.912,47	4,14
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	9,81	6,42	0,55	0,24	2,69	27.827.425,36	11,24
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	11,06	9,77	0,12	-0,07	-0,46	9.741.923,74	3,93
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	11,57	8,24	0,23	-0,07	-0,48	8.840.158,05	3,57
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	12,16	9,29	0,20	0,08	1,29	7.337.719,07	2,96
TARPON GT 30 FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	14,21	7,32	0,07	0,20	3,08	4.000.000,00	1,62
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	Artigo 8º IV, Alínea a	32,72	0,72	0,00	-0,28	-9,01	8.066,96	0,00
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	Artigo 8º IV, Alínea a	338,47	4,63	0,00	-0,19	-62,36	29.867,52	0,01

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

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

- O Instituto está com 11,24% 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 11,24% dos recursos garantidores alocados no Artigo 8º III, limite este, superior ao limite máximo estipulado na política de investimentos.