



LDB
EMPRESAS

DIADEMA
MAIO 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 31.05.2021.

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 75,23%

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	2,43	0,68	1,34	2.191.419,96	0,85	1.251.943.442,66	0,18
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	5,82	1,03	-1,26	20.711.176,39	8,07	1.180.044.595,00	1,76
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	4,27	0,54	-0,94	27.442.935,83	10,69	1.324.212.496,97	2,07
BB	BB	BB PREV IPCA I	1,78	0,75	1,85	16.957.174,17	6,60	514.792.545,56	3,29
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,94	0,48	-0,79	25.231.635,21	9,83	9.352.083.339,26	0,27
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,36	0,24	0,72	36.738.426,85	14,31	15.989.068.973,83	0,23
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,26	0,55	-0,10	129.272.768,41	50,34		

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	6,11	0,99	-1,80	21.986.880,76	8,56	1.859.083.226,91	1,18
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,28	0,99	28.011.405,56	10,91	3.866.862.013,76	0,72
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			3,50	0,77	-0,69	49.998.286,32	19,47		

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	2,76	0,53	0,73	10.189.374,52	3,97	630.973.641,92	1,61
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	0,44	0,43	1,75	3.731.466,82	1,45	199.306.452,67	1,87
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			2,09	0,50	1,00	13.920.841,34	5,42		
Renda Fixa			3,19	0,59	-0,12	193.191.896,07	75,23		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

20,95%

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	19,51	3,88	2,56	0,00	0,00	1.544.528.590,29	0,00
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	21,98	4,68	11,49	10.079.756,64	3,93	1.699.650.837,45	0,59
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	21,11	3,64	3,14	7.244.422,00	2,82	3.105.254.686,62	0,23
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	21,82	4,38	5,12	4.925.301,07	1,92	1.227.137.752,21	0,40
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			20,94	4,90	5,68	22.249.479,71	8,66		

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	16,69	0,41	12,87	27.099.110,86	10,55	1.790.312.458,24	1,51
Sub-total Artigo 8º III			16,69	0,41	12,87	27.099.110,86	10,55		

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	541,04	-2,03	-15,96	8.866,01	0,00	1.267.688,77	0,70
CEF	CEF	FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	8,95	-1,79	-37,83	79.347,79	0,03	2.927.459,72	2,71
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			270,48	-1,81	-35,38	88.213,80	0,03		

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	27,27	1,53	4,61	3.129.447,28	1,22	64.779.558,74	4,83
BRPP	GERAÇÃO FUTURO	BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	8,63	-1,53	-1,55	1.241.433,18	0,48	371.794.835,59	0,33
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			19,26	0,64	2,79	4.370.880,46	1,70		

Renda Variável e Investimentos Estruturados

17,09 2,56 6,91 53.807.684,83 20,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,81%

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	21,38	-4,04	-2,13	9.787.105,30	3,81	3.430.574.736,66	0,29
Sub-total Artigo 9º A, III			21,38	-4,04	-2,13	9.787.105,30	3,81		
Investimentos no Exterior			17,64	-4,04	-2,13	9.787.105,30	3,81		
Total			6,14	0,90	1,48	256.786.686,20	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	129.272.768,41	50,34	15,00	60,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	49.998.286,32	19,47	1,00	10,00	40,00	0,00	45,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	13.920.841,34	5,42	0,00	3,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Fixa	193.191.896,07	75,23					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	22.249.479,71	8,66	2,00	16,00	25,00	0,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	27.099.110,86	10,55	2,00	8,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	88.213,80	0,03	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	4.370.880,46	1,70	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	53.807.684,83	20,95					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	9.787.105,30	3,81	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	9.787.105,30	3,81					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	0,55 203,30	-0,10 -9,96	1,16 170,54	2,41 212,33	5,42 248,69	706.132,75	-129.670,98
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,77 285,41	-0,69 -71,29	0,70 102,60	1,93 170,04	4,77 218,82	251.707,63	-232.052,61
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,50 185,89	1,00 103,24	1,59 233,16	2,55 224,87	6,61 303,30	69.601,26	137.583,29
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	4,90 -1,26	5,68 -0,37	12,06 -2,65	13,74 -2,17	33,33 -11,08	1.454.816,15	765.094,88
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	0,41 -5,75	12,87 6,82	10,11 -4,59	16,47 0,56	36,42 -7,99	110.734,80	3.089.777,44
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-1,81 -7,97	-35,38 -41,42	-34,45 -49,16	-35,59 -51,50	-94,74 -139,15	-1.627,41	-6.261,97
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	0,64 -5,51	2,79 -3,26	3,86 -10,84	3,80 -12,11	7,80 -36,61	28.236,78	119.655,63
Artigo 9º A, III % do CDI	-4,04 -1.496,01	-2,13 -417,47				-412.473,88	-212.894,70
DIADEMA (Total)						2.207.128,08	3.531.230,98

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	16.830.994,41	0,00	0,00	0,00	16.957.174,17	126.179,76	311.088,73
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	26.177.550,84	133.852,46	-1.200.000,00	0,00	25.231.635,21	120.231,91	-208.167,54
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	36.650.945,00	0,00	0,00	0,00	36.738.426,85	87.481,85	262.758,67
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2.176.652,88	0,00	0,00	0,00	2.191.419,96	14.767,08	29.058,30
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	20.500.341,08	0,00	0,00	0,00	20.711.176,39	210.835,31	-263.872,39
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	27.296.298,99	0,00	0,00	0,00	27.442.935,83	146.636,84	-260.536,75
					129.272.768,41	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	15.103.863,79	25.966.044,11	-13.094.412,43	0,00	28.011.405,56	35.910,09	170.915,52
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	21.771.083,22	0,00	0,00	0,00	21.986.880,76	215.797,54	-402.968,13
					49.998.286,32	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	10.135.684,56	0,00	0,00	0,00	10.189.374,52	53.689,96	73.348,38
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	3.715.555,52	0,00	0,00	0,00	3.731.466,82	15.911,30	64.234,91
					13.920.841,34	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	9.628.963,59	0,00	0,00	0,00	10.079.756,64	450.793,05	1.039.169,41
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	6.990.223,52	0,00	0,00	0,00	7.244.422,00	254.198,48	220.735,75
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	14.001.083,69	0,00	-14.544.452,55	0,00	0,00	543.368,86	363.228,68
OCCAM FIC FIA	4.718.845,31	0,00	0,00	0,00	4.925.301,07	206.455,76	240.053,85
					22.249.479,71	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	26.988.376,06	0,00	0,00	0,00	27.099.110,86	110.734,80	3.089.777,44
					27.099.110,86	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	80.791,38	0,00	0,00	0,00	79.347,79	-1.443,59	-4.577,87
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	9.049,83	0,00	0,00	0,00	8.866,01	-183,82	-1.684,10
					88.213,80	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	3.109.475,07	0,00	0,00	0,00	27.500,00	3.129.447,28	47.472,21	138.814,59
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	1.269.218,61	0,00	0,00	0,00	8.550,00	1.241.433,18	-19.235,43	-19.158,96
						4.370.880,46	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	10.199.579,18	0,00	0,00	0,00	9.787.105,30	-412.473,88	-212.894,70
					9.787.105,30	0,00	0,00

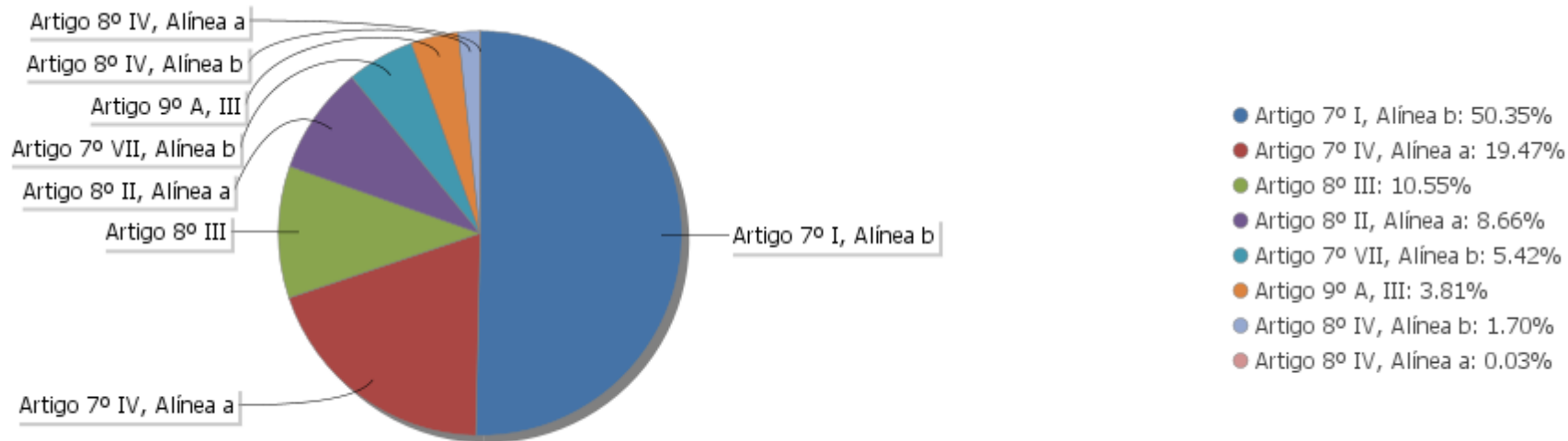
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

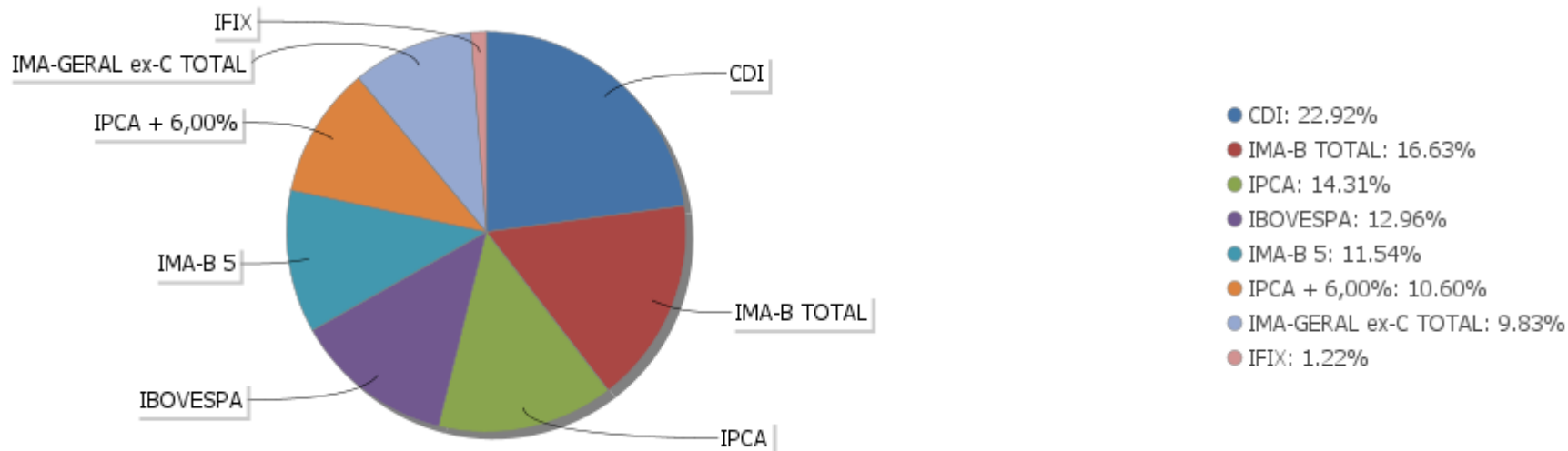
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	219.266.268,23	85,39	219.266.268,23	85,39
de 31 a 365 dias	7.244.422,00	2,82	226.510.690,23	88,21
acima de 365 dias	30.275.995,97	11,79	256.786.686,20	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

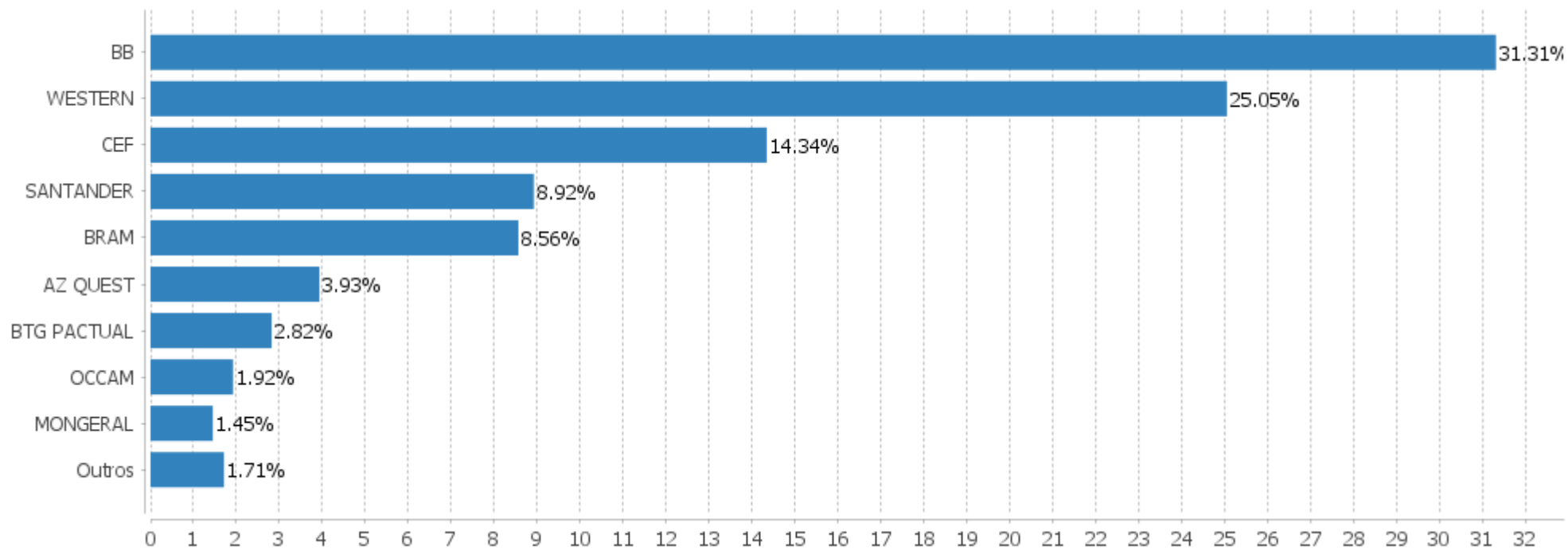


Alocação Por Estratégia



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								1,48
IPCA + 5,44%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,28								5,46
p.p. indexador	-1,49	-2,23	-0,56	0,81	-0,38								-3,98
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

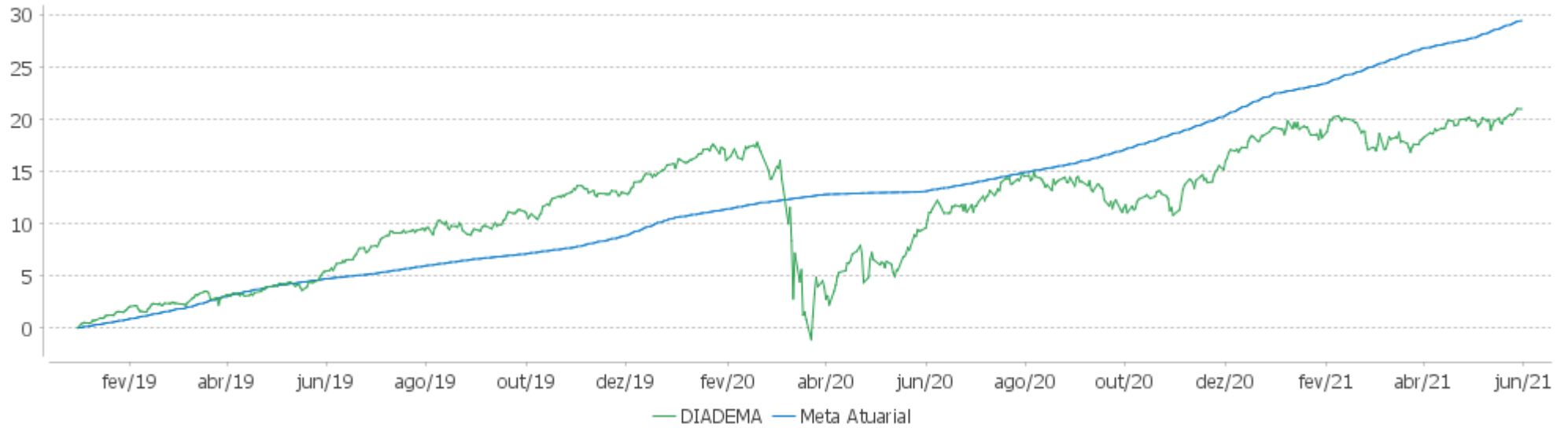
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

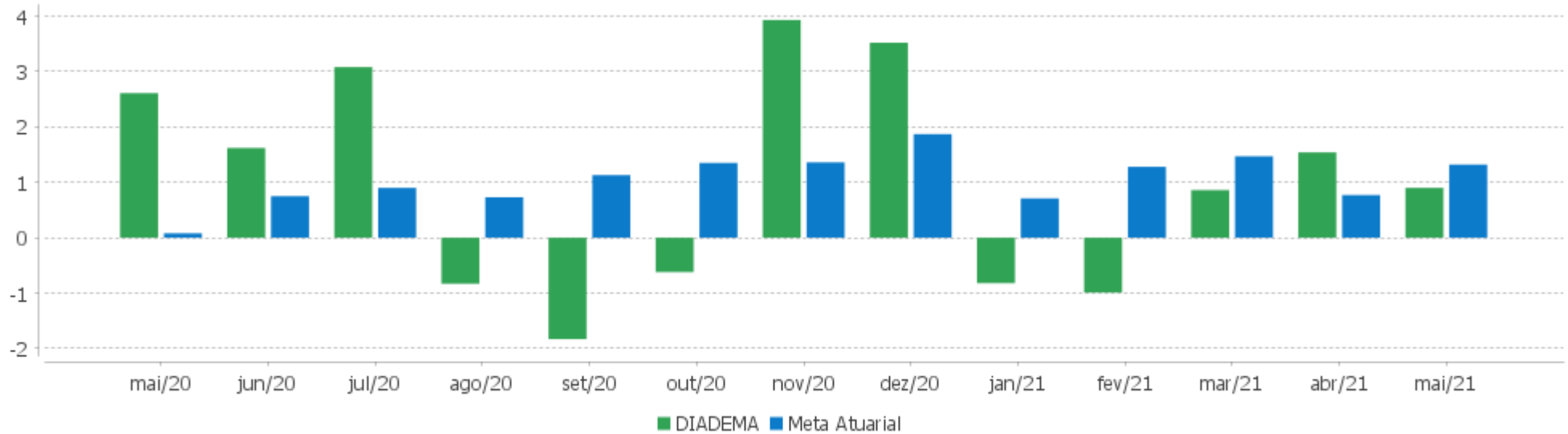
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	15	51,72	03 meses	3,33	3,47	-0,13	5,51
Meses abaixo - Meta Atuarial	14	48,28	06 meses	5,05	7,41	-2,36	5,66
			12 meses	10,65	14,19	-3,54	6,14
			24 meses	14,76	23,23	-8,47	9,67
Maior rentabilidade da Carteira	3,93	2020-11	Desde 31/12/2018	20,98	29,03	-8,05	8,88
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.	0,53 -0,79	0,73 -4,96	1,72 -1,89	2,62 -5,03	6,94 -7,57	15,80 -7,83	31,54 -5,59
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO % do CDI	0,43 158,42	1,75 181,16	1,23 181,13	2,34 206,64	5,71 262,09	4,61 64,48	11,68 83,57
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,99 -0,07	-1,80 -0,66	0,95 -0,29	3,06 -0,61	8,41 -0,76	15,49 -0,97	42,90 -1,19
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,28 105,11	0,99 102,20	0,73 106,60	1,24 109,65	2,28 104,53	6,64 92,82	13,30 95,08
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	0,54 -0,15	-0,94 -2,36	1,25 -0,67	2,27 -1,00	5,61 -1,78	18,51 0,96	37,93 4,84
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,68 -0,01	1,34 -0,07	1,86 -0,05	3,18 -0,10	7,13 -0,26	17,09 -0,46	32,30 -0,79
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,75 -0,57	1,85 -3,83	1,56 -2,04	3,09 -4,57	8,00 -6,51	18,47 -5,16	36,99 -0,13
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,48 -0,02	-0,79 -0,13	0,68 0,07	1,57 0,12	3,44 0,10	11,29 0,29	26,57 0,54
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,24 -0,59	0,72 -2,50	1,21 -0,87	2,05 -2,56	3,45 -4,60	15,85 5,77	32,24 17,02
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,03 -0,03	-1,26 -0,12	1,17 -0,08	3,51 -0,15	8,82 -0,34	15,51 -0,95	42,54 -1,55
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	0,41 151,78	12,87 1.330,98	10,11 1.485,51	16,47 1.453,65	36,42 1.671,18	50,88 711,01	58,63 419,33
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,64 -2,52	3,14 -2,91	6,47 -8,23	8,54 -7,37	33,85 -10,56	38,48 8,40	88,97 24,53
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	4,68 -1,48	11,49 5,45	12,76 -1,95	19,22 3,31	47,09 2,68	53,19 23,11	92,09 27,65
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	4,38 -1,78	5,12 -0,92	12,29 -2,41	15,75 -0,16	42,51 -1,90	40,28 10,20	83,28 18,84
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,26 -0,90	3,92 -2,13	12,44 -2,27	12,20 -3,71	27,00 -17,40	15,90 -14,18	63,78 -0,66
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA Var. IPCA + 6,00% p.p.	-1,79 -3,11	-3,72 -9,40	-2,85 -6,45	-4,01 -11,66	-2,27 -16,78	-70,73 -94,36	-71,09 -108,21
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	-2,03	-15,96	-5,23	-16,60	-99,65	-99,79	-99,79

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Varição da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	-751,41	-1.650,96	-767,64	-1.465,36	-4.573,14	-1.394,46	-713,65
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO Var. IFIX p.p.	1,53 3,09	4,61 6,48	6,60 9,02	5,14 4,85	12,03 6,06	13,70 3,36	11,45 -15,76
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11 Var. IBOVESPA p.p.	-1,53 -7,69	-1,55 -7,60	-2,48 -17,18	0,54 -15,37	-1,52 -45,93	0,69 -29,39	-2,14 -66,58
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	-4,04 -10,20	7,54 1,49	2,44 -12,27	7,30 -8,60	32,48 -11,92	111,75 81,67	135,75 71,31
DIADEMA Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,90 -0,42	1,48 -4,20	3,33 -0,27	5,05 -2,60	10,65 -3,87	14,76 -8,88	
CDI	0,27	0,97	0,68	1,13	2,18	7,16	13,98
IBOVESPA	6,16	6,05	14,70	15,91	44,41	30,08	64,44
INPC + 6,00%	1,45	5,80	3,74	7,89	15,40	24,81	38,59
IPCA + 6,00%	1,32	5,68	3,61	7,65	14,51	23,63	37,13

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	0,20	0,60	0,52	0,91	2,11	8,57	16,37	25,88	43,11
IRF-M 1+	0,20	-3,51	-0,14	-0,57	-0,28	13,33	31,30	45,86	74,27
IRF-M TOTAL	0,20	-1,79	0,19	0,13	0,71	12,10	27,04	40,22	64,99
IMA-B 5	0,69	1,42	1,92	3,27	7,39	17,55	33,09	46,16	64,24
IMA-B 5+	1,38	-3,35	0,65	3,91	10,69	15,30	52,84	63,86	92,42
IMA-B TOTAL	1,06	-1,14	1,25	3,66	9,17	16,46	44,09	56,66	80,66
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,50	-0,66	0,61	1,45	3,33	11,00	26,04	37,48	59,06
IMA-GERAL TOTAL	0,61	-0,21	0,73	1,81	4,20	12,11	27,53	39,29	60,68
IDKA 2	0,88	2,19	2,53	3,96	8,47	18,26	32,51	46,64	65,76
IDKA 20	2,37	-4,65	0,81	6,18	15,79	13,16	71,22	79,58	122,22
CDI	0,27	0,97	0,68	1,13	2,18	7,16	13,98	22,72	38,97

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,16	6,05	14,70	15,91	44,41	30,08	64,44	101,27	160,39
IBRX 100	5,92	8,14	15,50	18,03	47,63	34,45	72,38	109,11	171,70
IBRX 50	6,18	8,39	15,91	18,61	49,33	32,34	65,03	102,41	160,17
SMALL CAP	6,32	10,00	16,04	18,26	57,75	55,08	97,90	135,01	241,15
IFIX	-1,56	-1,87	-2,43	0,28	5,97	10,33	27,21	36,94	74,68
Índice Consumo - ICON	6,51	2,66	9,81	7,79	27,87	37,71	69,55	74,93	108,51
Índice Dividendos - IDIV	5,64	4,32	15,93	13,64	37,85	30,26	78,57	100,70	199,05

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	0,83	3,22	2,08	4,61	8,06	10,08	15,21	18,50	22,77
INPC	0,96	3,33	2,22	4,84	8,90	11,13	16,44	18,49	22,46
IGPM	4,10	14,39	8,77	15,49	37,04	45,96	57,11	63,81	66,39
SELIC	0,27	0,97	0,68	1,13	2,18	7,16	13,99	22,73	39,01

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	-2,64	12,69	4,37	13,92	33,16	102,83	116,09	181,17	191,78
MSCI ACWI	-1,84	10,84	2,43	12,92	34,65	91,95	95,33	147,44	157,20
MSCI World	-1,95	11,37	3,24	13,05	33,59	93,08	98,36	151,08	158,61

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,16	4,87	3,11	6,65	12,36	19,03	29,54	38,50	49,22
IPCA + 5,00%	1,24	5,28	3,36	7,15	13,44	21,32	33,30	43,87	56,50
IPCA + 5,50%	1,28	5,48	3,48	7,40	13,97	22,47	35,20	46,62	60,24
IPCA + 5,89%	1,31	5,64	3,58	7,60	14,39	23,38	36,70	48,78	63,21
IPCA + 6,00%	1,32	5,68	3,61	7,65	14,51	23,63	37,13	49,40	64,06
INPC + 4,00%	1,29	4,99	3,24	6,88	13,23	20,16	30,92	38,49	48,86
INPC + 6,00%	1,45	5,80	3,74	7,89	15,40	24,81	38,59	49,39	63,66

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

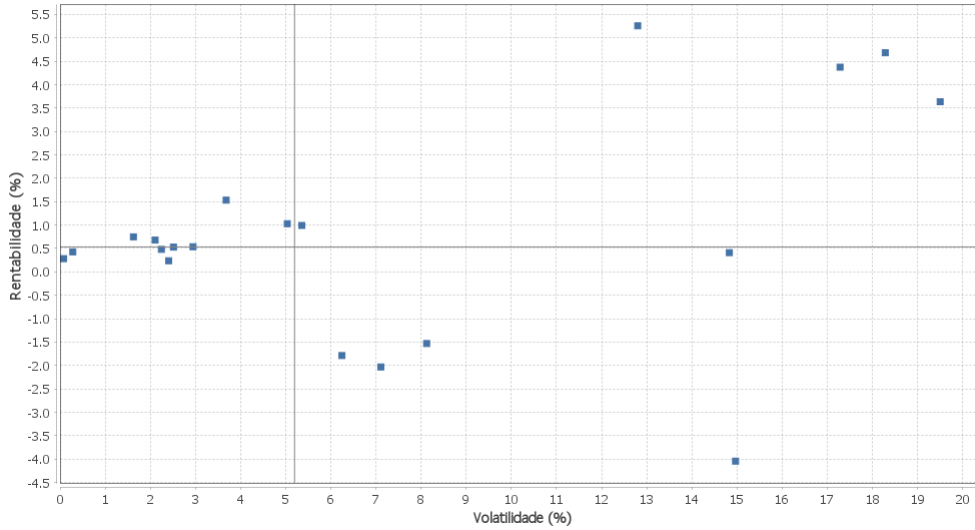
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
82	05/05/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	35.000,00	15.096,08599646	2,3184817580
83	05/05/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.143.832,45	493.354,08659300	2,3184817580
84	07/05/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	4.312,82538071	2,3186656350
85	07/05/2021	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	133.852,46	0,00	88.853,49129300	1,5064400740
86	07/05/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.168.995,12	504.167,18234600	2,3186656350
87	12/05/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	22.000,00	9.483,62219000	2,3197887430
88	13/05/2021	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	0,00	1.200.000,00	795.946,57467800	1,5076388770
89	13/05/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.373.782,72	2.316.115,96473600	2,3201699750
90	14/05/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	21.546,82838300	2,3205271380
91	17/05/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	27.500,54	0,00	11.849,02813500	2,3209110220
92	20/05/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	7.285.788,80	0,00	3.137.538,61245300	2,3221351830
93	21/05/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.000,00	2.152,83526100	2,3225186300
94	25/05/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	84.000,00	36.156,73324500	2,3232187330
95	25/05/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	14.200,86	0,00	6.112,57984300	2,3232187330
96	26/05/2021	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	0,00	14.544.452,55	2.620.956,52457851	5,5492918000
97	28/05/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	40.000,00	17.210,17673300	2,3242062310
98	28/05/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.143.325,25	2.212.938,41372500	2,3242062310
99	28/05/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	18.638.553,91	0,00	8.019.320,17107600	2,3242062310
100	31/05/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	18.476,89	7.948,72047500	2,3245112290
Total						

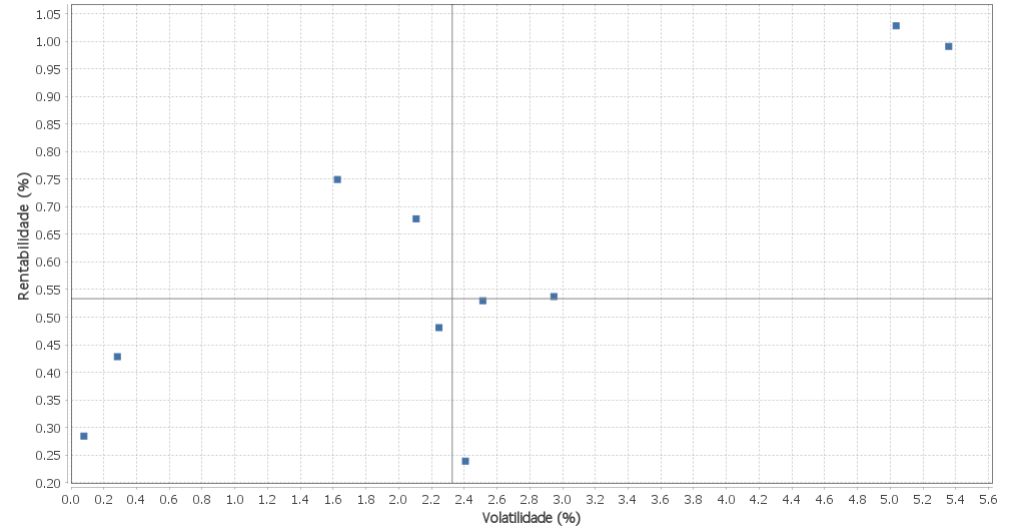
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

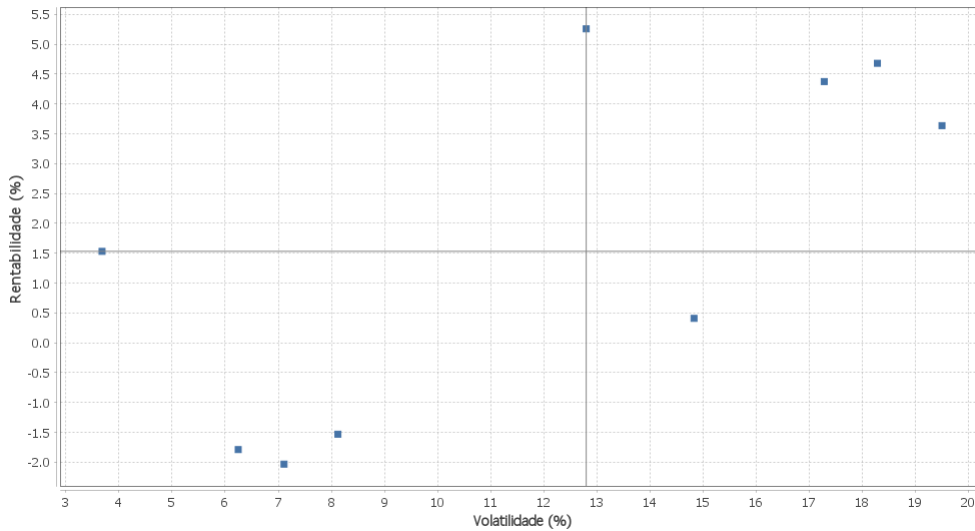
DIADEMA - No Mês



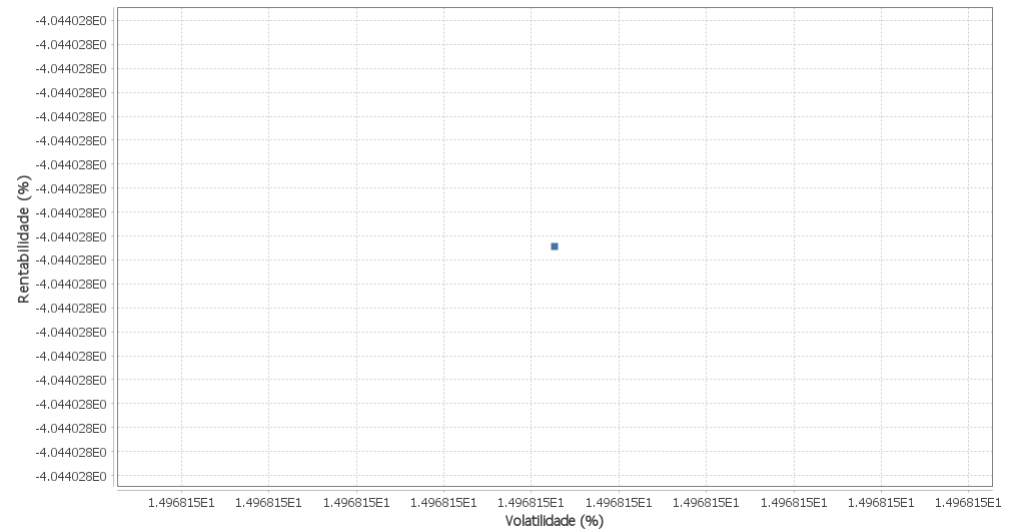
Renda Fixa - No Mês



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\$): 5.907.642,22

Value-At-Risk: 2,30%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,08	0,04	0,00	0,18	0,28	28.011.405,56	10,91
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	Artigo 7º VII, Alínea b	0,28	0,17	0,00	0,56	0,43	3.731.466,82	1,45
BB PREV IPCA I	Artigo 7º I, Alínea b	1,63	0,83	0,03	0,29	0,75	16.957.174,17	6,60
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,11	1,37	0,01	0,19	0,68	2.191.419,96	0,85
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,25	1,42	0,09	0,09	0,48	25.231.635,21	9,83
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,41	1,16	0,11	-0,01	0,24	36.738.426,85	14,31
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	Artigo 7º VII, Alínea b	2,51	1,79	0,05	0,10	0,53	10.189.374,52	3,97
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,95	2,06	0,14	0,09	0,54	27.442.935,83	10,69
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	Artigo 8º IV, Alínea b	3,68	2,75	0,00	0,34	1,53	3.129.447,28	1,22
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	Artigo 7º I, Alínea b	5,04	2,97	0,15	0,15	1,03	20.711.176,39	8,07
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	5,36	3,14	0,17	0,13	0,99	21.986.880,76	8,56
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	Artigo 8º IV, Alínea a	6,25	0,17	0,00	-0,33	-1,79	79.347,79	0,03
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	Artigo 8º IV, Alínea a	7,11	0,80	0,00	-0,32	-2,03	8.866,01	0,00
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	Artigo 8º IV, Alínea b	8,12	0,96	-0,00	-0,22	-1,53	1.241.433,18	0,48
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	12,80	NaN	0,00	0,39	5,26	0,00	0,00
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	14,83	6,76	0,53	0,01	0,41	27.099.110,86	10,55
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	14,97	9,85	0,10	-0,29	-4,04	9.787.105,30	3,81
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	17,28	13,71	0,21	0,24	4,38	4.925.301,07	1,92
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	18,29	13,83	0,44	0,24	4,68	10.079.756,64	3,93
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	19,50	11,73	0,26	0,17	3,64	7.244.422,00	2,82

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

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

- O Instituto está com 10,55% 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 10,55% dos recursos garantidores alocados no Artigo 8º III, limite este, superior ao limite máximo estipulado na política de investimentos.