



**LDB**  
EMPRESAS

**DIADEMA**  
MARÇO 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 31.03.2021.

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

71,38%

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	3,02	0,32	-0,19	2.158.207,51	0,83	1.185.685.562,02	0,18
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	7,90	-0,49	-2,87	20.372.513,11	7,85	1.193.793.207,38	1,71
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	5,97	-0,36	-2,51	27.008.348,50	10,41	1.185.329.734,14	2,28
BB	BB	BB PREV IPCA I	2,57	0,40	0,68	16.762.499,62	6,46	508.882.539,13	3,29
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	4,08	-0,42	-1,88	25.881.830,13	9,98	9.507.617.903,00	0,27
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	3,78	0,30	-0,18	36.408.996,98	14,03	15.491.489.347,05	0,24
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>4,60</b>	<b>-0,10</b>	<b>-1,34</b>	<b>128.592.395,85</b>	<b>49,56</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	8,28	-0,73	-3,44	21.620.385,98	8,33	1.934.702.835,78	1,12
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,19	0,24	0,50	21.259.193,86	8,19	3.129.027.750,94	0,68
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>4,93</b>	<b>-0,54</b>	<b>-1,91</b>	<b>42.879.579,84</b>	<b>16,53</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3,05	0,21	-0,77	10.037.911,57	3,87	621.594.348,57	1,61
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	1,12	0,33	0,84	3.698.102,87	1,43	210.839.800,39	1,75
<b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b</b>			<b>2,35</b>	<b>0,24</b>	<b>-0,34</b>	<b>13.736.014,44</b>	<b>5,29</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>4,53</b>	<b>-0,15</b>	<b>-1,37</b>	<b>185.207.990,13</b>	<b>71,38</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

24,78%

## 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	25,30	5,06	-2,89	13.771.155,05	5,31	1.500.771.290,94	0,92
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	26,23	0,73	-0,40	9.004.771,52	3,47	1.471.825.306,87	0,61
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	26,44	1,73	-1,46	6.921.397,96	2,67	2.831.568.584,73	0,24
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	25,55	3,94	-2,70	4.558.707,92	1,76	1.109.023.441,48	0,41
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	30,40	2,05	-5,18	0,00	0,00	1.088.808.596,09	0,00
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>26,61</b>	<b>3,55</b>	<b>-2,34</b>	<b>34.256.032,45</b>	<b>13,20</b>		

## Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	20,90	4,03	6,63	25.601.252,55	9,87	1.455.516.681,87	1,76
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>20,90</b>	<b>4,03</b>	<b>6,63</b>	<b>25.601.252,55</b>	<b>9,87</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
PÁTRIA	PÁTRIA	PÁTRIA SPECIAL OPORTUNIDADES I FIC FIP	542,13	-1,60	-12,74	9.205,55	0,00	1.299.916,55	0,71
CEF	CEF	FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	11,18	-35,66	-36,24	81.377,23	0,03	7.976.174,46	1,02
<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a</b>			<b>271,02</b>	<b>-32,69</b>	<b>-33,64</b>	<b>90.582,78</b>	<b>0,03</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
RIO BRAVO	RIO BRAVO	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	27,33	2,46	0,54	3.059.335,95	1,18	62.200.155,62	4,92
BRPP	GERAÇÃO FUTURO	BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	8,49	-1,05	-0,11	1.276.597,66	0,49	382.326.190,25	0,33
<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b</b>			<b>19,36</b>	<b>1,40</b>	<b>0,35</b>	<b>4.335.933,61</b>	<b>1,67</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável e Investimentos Estruturados	20,99	3,50	0,27	64.283.801,39	24,78
---	-------	------	------	---------------	-------

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,84%

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	23,96	-0,32	-0,32	9.968.316,82	3,84	3.092.130.666,10	0,32
<b>Sub-total Artigo 9º A, III</b>			<b>23,96</b>	<b>-0,32</b>	<b>-0,32</b>	<b>9.968.316,82</b>	<b>3,84</b>		
Investimentos no Exterior			13,05	-0,32	-0,32	9.968.316,82	3,84		
Total			7,57	0,86	-0,95	259.460.108,34	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 1	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	128.592.395,85	49,56	15,00	60,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	42.879.579,84	16,53	1,00	10,00	40,00	0,00	45,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	13.736.014,44	5,29	0,00	3,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>185.207.990,13</b>	<b>71,38</b>					100,00
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	34.256.032,45	13,20	2,00	16,00	25,00	0,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	25.601.252,55	9,87	2,00	8,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	90.582,78	0,03	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	4.335.933,61	1,67	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>64.283.801,39</b>	<b>24,78</b>					35,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	9.968.316,82	3,84	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>9.968.316,82</b>	<b>3,84</b>					10,00

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Rentabilidades por Artigo**

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,10 -47,43	-1,34 -275,17	-1,34 -275,17	2,37 247,00	6,85 308,17	-123.388,37	-1.742.338,62
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,54 -270,08	-1,91 -393,85	-1,91 -393,85	2,01 209,34	5,87 264,18	-118.503,06	-671.811,23
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,24 118,57	-0,34 -70,54	-0,34 -70,54	2,69 280,59	6,97 313,56	32.673,47	-47.243,61
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	3,55 -2,45	-2,34 -0,34	-2,34 -0,34	15,20 -8,09	45,54 -14,19	1.422.566,84	-1.772.804,93
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	4,03 -1,97	6,63 8,63	6,63 8,63	18,95 -4,34	51,79 -7,94	990.824,62	1.591.919,13
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-32,69 -38,69	-33,64 -31,64	-33,64 -31,64	-31,59 -54,88	-94,65 -154,38	-879,32	-3.892,99
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	1,40 -4,60	0,35 2,36	0,35 2,36	3,53 -19,76	9,64 -50,09	60.052,41	15.108,78
Artigo 9º A, III % do CDI	-0,32 -1.017,39	-0,32 -1.017,39				-31.683,18	-31.683,18
<b>DIADEMA (Total)</b>						<b>2.231.663,41</b>	<b>-2.662.746,65</b>

**RESULTADO POR ATIVO**

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV IPCA I	16.696.237,48	0,00	0,00	0,00	16.762.499,62	66.262,14	116.414,18
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	25.857.770,93	133.852,46	0,00	0,00	25.881.830,13	-109.793,26	-490.267,70
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	36.299.716,93	0,00	0,00	0,00	36.408.996,98	109.280,05	-66.671,20
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2.151.302,99	0,00	0,00	0,00	2.158.207,51	6.904,52	-4.154,15
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	20.471.882,39	0,00	0,00	0,00	20.372.513,11	-99.369,28	-602.535,67
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	27.105.021,04	0,00	0,00	0,00	27.008.348,50	-96.672,54	-695.124,08
					128.592.395,85	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	17.071.060,48	19.130.137,44	-14.982.272,81	0,00	21.259.193,86	40.268,75	97.651,68
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	21.779.157,79	0,00	0,00	0,00	21.620.385,98	-158.771,81	-769.462,91
					42.879.579,84	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	10.017.323,46	0,00	0,00	0,00	10.037.911,57	20.588,11	-78.114,57
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	3.686.017,51	0,00	0,00	0,00	3.698.102,87	12.085,36	30.870,96
					13.736.014,44	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	8.939.358,94	0,00	0,00	0,00	9.004.771,52	65.412,58	-35.815,71
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	6.803.989,52	0,00	0,00	0,00	6.921.397,96	117.408,44	-102.288,29
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	13.107.272,53	0,00	0,00	0,00	13.771.155,05	663.882,52	-410.068,82
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	19.702.345,96	0,00	-20.105.610,15	0,00	0,00	403.264,19	-1.098.092,81
OCCAM FIC FIA	4.386.108,81	0,00	0,00	0,00	4.558.707,92	172.599,11	-126.539,30
					34.256.032,45	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	24.610.427,93	0,00	0,00	0,00	25.601.252,55	990.824,62	1.591.919,13
					25.601.252,55	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	201.400,26	0,00	0,00	119.293,01	81.377,23	-730,02	-2.548,43
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	9.354,85	0,00	0,00	0,00	9.205,55	-149,30	-1.344,56

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					90.582,78	0,00	0,00

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	3.004.838,44	0,00	0,00	0,00	19.000,00	3.059.335,95	73.497,51	16.203,26
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11	1.298.580,71	0,00	0,00	0,00	8.537,95	1.276.597,66	-13.445,10	-1.094,48
						4.335.933,61	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	0,00	10.000.000,00	0,00	0,00	9.968.316,82	-31.683,18	-31.683,18
					9.968.316,82	0,00	0,00

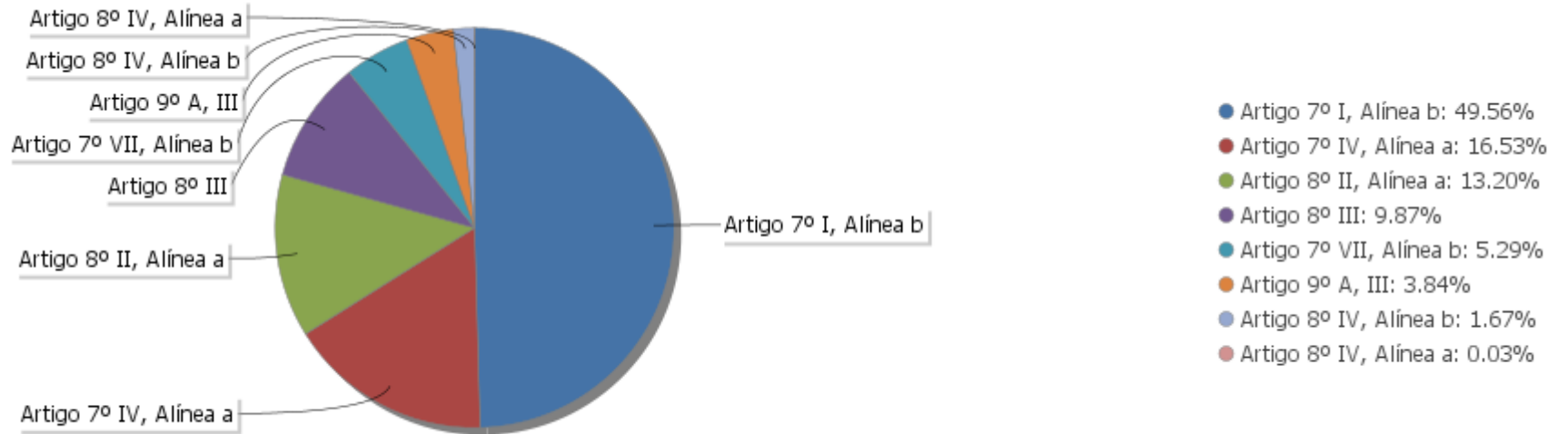
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

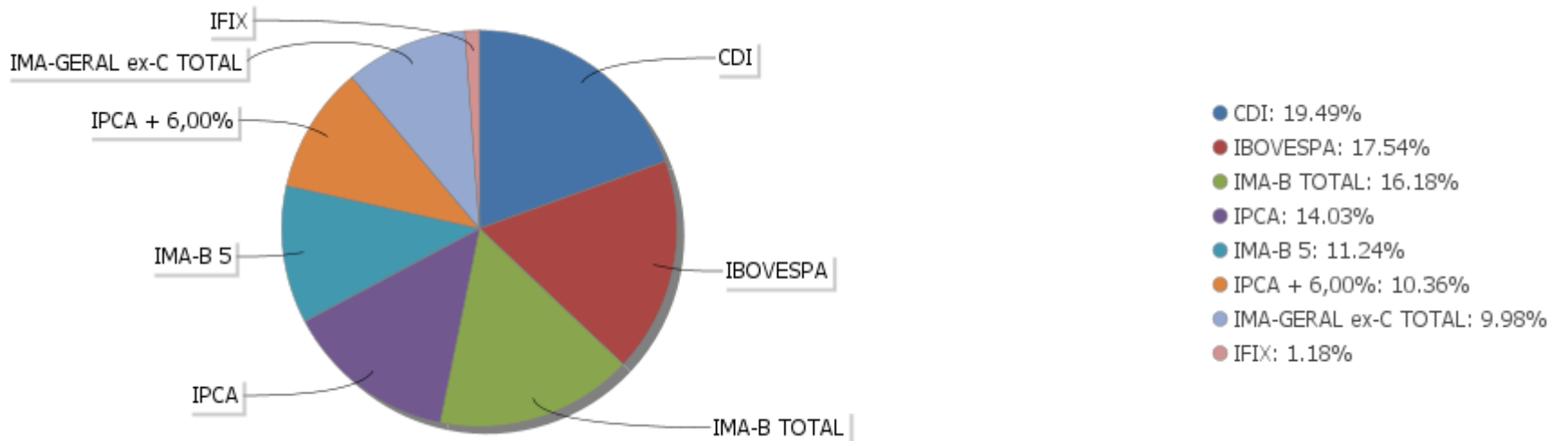
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	222.678.963,24	85,82	222.678.963,24	85,82
de 31 a 365 dias	6.921.397,96	2,67	229.600.361,20	88,49
acima de 365 dias	29.859.747,14	11,51	259.460.108,34	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

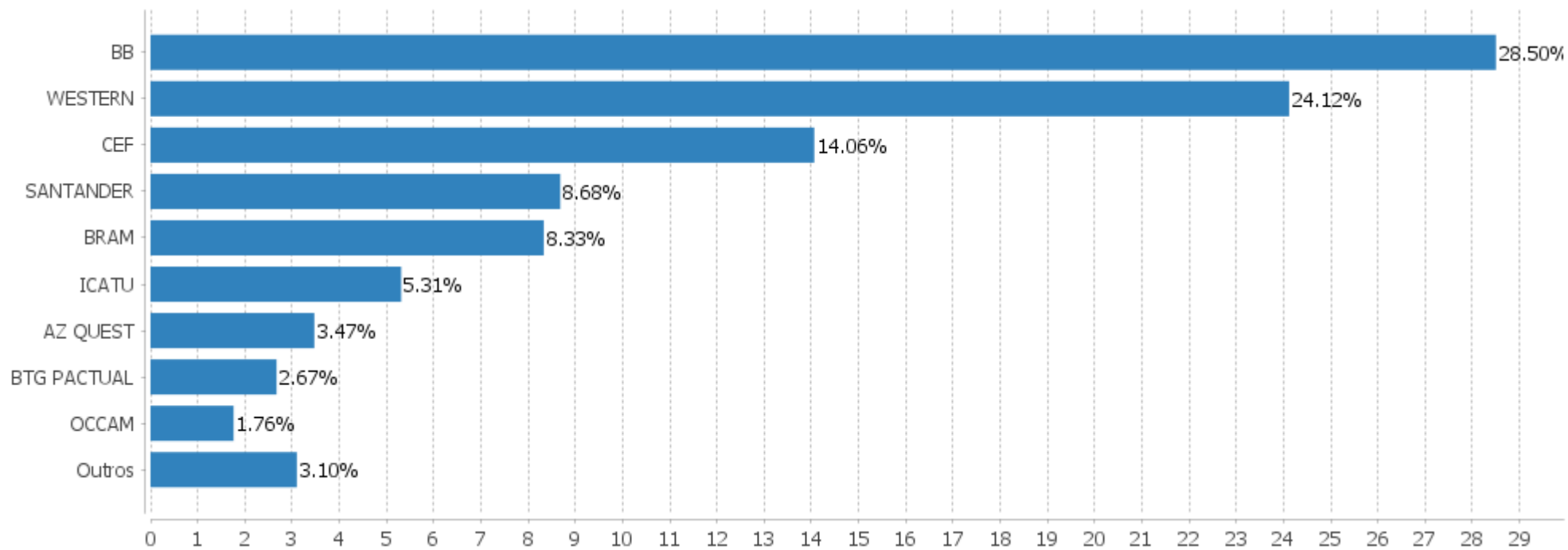


Alocação Por Estratégia



## 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										-0,95
IPCA + 5,44%	0,67	1,24	1,42										3,37
p.p. indexador	-1,49	-2,23	-0,56										-4,32
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

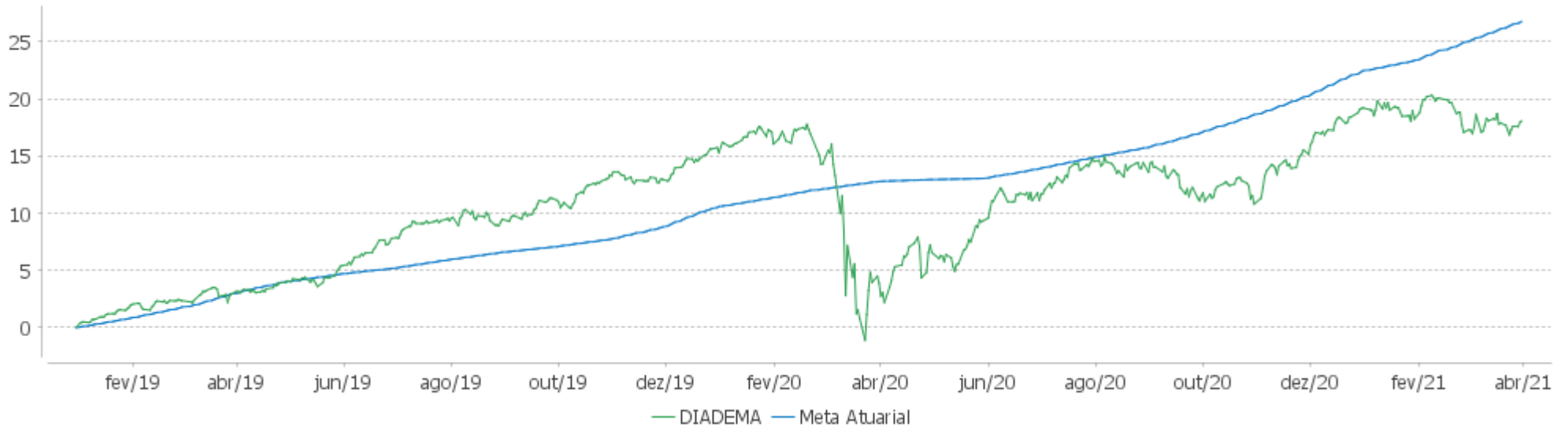
**Performance Sobre a Meta Atuarial**

**Relatório**

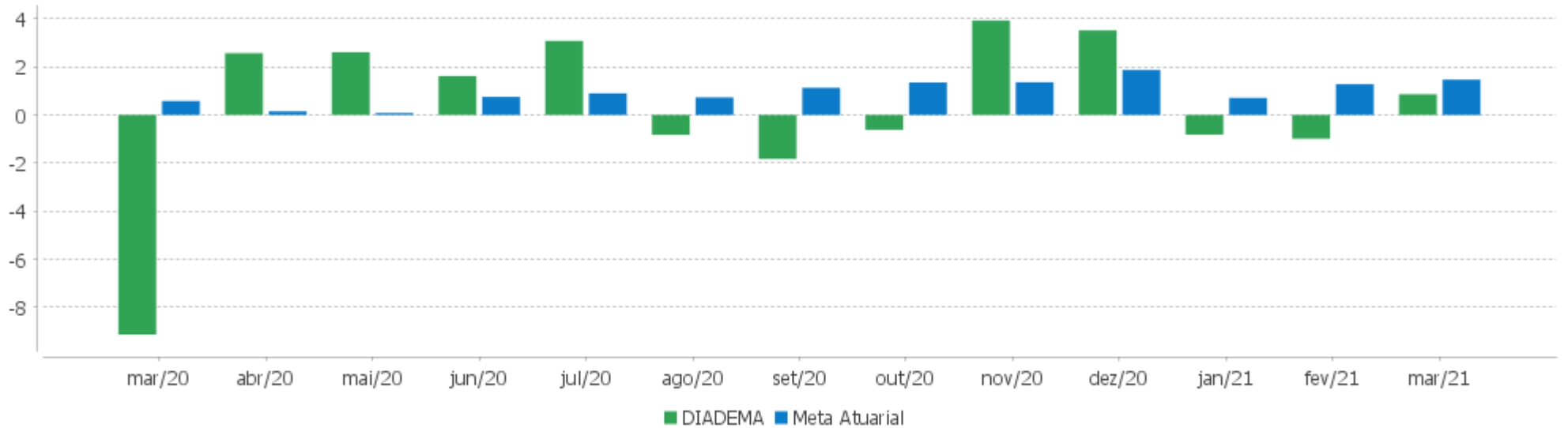
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	14	51,85	03 meses	-0,95	3,37	-4,32	6,79
Meses abaixo - Meta Atuarial	13	48,15	06 meses	5,90	8,14	-2,24	6,36
			12 meses	13,67	12,17	1,50	7,57
			24 meses	14,73	22,85	-8,13	9,61
Maior rentabilidade da Carteira	3,93	2020-11	Desde 31/12/2018	18,08	26,48	-8,39	9,13
Menor rentabilidade da Carteira	-9,14	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	-0,36 -0,70	-2,51 -2,36	-2,51 -2,36	1,81 -1,41	7,91 -0,59	20,52 1,88	32,97 3,43
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,32 -0,02	-0,19 -0,04	-0,19 -0,04	3,12 -0,11	8,28 -0,22	18,15 -0,48	28,75 -0,78
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,40 -1,07	0,68 -2,82	0,68 -2,82	3,62 -4,69	9,51 -2,91	20,61 -2,54	31,78 -4,67
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,42 -0,04	-1,88 -0,24	-1,88 -0,24	1,24 0,09	4,35 0,17	13,27 0,41	23,79 0,44
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,30 -0,63	-0,18 -2,24	-0,18 -2,24	1,85 -3,39	5,09 -1,01	19,24 9,64	29,94 15,33
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,49 -0,02	-2,87 -0,07	-2,87 -0,07	4,03 -0,14	10,01 -0,38	19,49 -0,98	35,53 -1,46
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,21 -1,26	-0,77 -4,27	-0,77 -4,27	2,89 -5,41	8,10 -4,31	16,81 -6,34	28,52 -7,93
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO % do CDI	0,33 163,05	0,84 173,25	0,84 173,25	2,15 224,03	4,00 180,12	4,82 61,93	11,93 81,61
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,73 -0,27	-3,44 -0,63	-3,44 -0,63	3,47 -0,70	9,81 -0,58	19,48 -1,00	35,61 -1,39
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,24 119,51	0,50 103,23	0,50 103,23	1,07 111,93	2,31 103,88	7,23 92,95	13,91 95,15
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	4,03 2.002,13	6,63 1.364,61	6,63 1.364,61	18,95 1.974,28	51,79 2.330,12	39,36 505,90	55,80 381,78
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO Var. IFIX p.p.	2,46 3,83	0,54 1,36	0,54 1,36	5,80 3,95	11,42 -2,72	10,40 -4,26	4,70 -16,05
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11 Var. IBOVESPA p.p.	-1,05 -7,04	-0,11 1,89	-0,11 1,89	-1,59 -24,87	3,49 -56,23	4,22 -18,02	-5,05 -41,68
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,36 -1,83	-1,25 -4,76	-1,25 -4,76	2,30 -6,01	-7,01 -19,42	-70,04 -93,19	-70,43 -106,88
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP % do CDI	-1,60 -793,70	-12,74 -2.622,98	-12,74 -2.622,98	-18,40 -1.917,24	-99,64 -4.483,18	-99,78 -1.282,45	-99,78 -682,64
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	1,73 -4,27	-1,46 0,55	-1,46 0,55	10,75 -12,53	64,29 4,56	42,15 19,91	62,62 25,99
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	3,58	-3,76	-3,76	13,44	41,69	0,30	19,51



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

<b>Fundo</b> <b>Varição da Estratégia</b>	<b>No Mês</b>	<b>No Ano</b>	<b>3 meses</b>	<b>6 meses</b>	<b>12 meses</b>	<b>24 meses</b>	<b>36 meses</b>
Var. IBOVESPA p.p.	-2,42	-1,75	-1,75	-9,84	-18,04	-21,93	-17,12
<b>AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA</b>	<b>0,73</b>	<b>-0,40</b>	<b>-0,40</b>	<b>16,48</b>	<b>54,84</b>	<b>42,03</b>	<b>59,89</b>
Var. IBOVESPA p.p.	-5,27	1,61	1,61	-6,81	-4,89	19,80	23,26
<b>ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA</b>	<b>5,06</b>	<b>-2,89</b>	<b>-2,89</b>	<b>16,68</b>	<b>33,22</b>	<b>14,82</b>	<b>35,48</b>
Var. IBOVESPA p.p.	-0,93	-0,89	-0,89	-6,61	-26,51	-7,42	-1,15
<b>OCCAM FIC FIA</b>	<b>3,94</b>	<b>-2,70</b>	<b>-2,70</b>	<b>19,50</b>	<b>57,43</b>	<b>32,44</b>	<b>50,37</b>
Var. IBOVESPA p.p.	-2,06	-0,70	-0,70	-3,79	-2,30	10,20	13,74
<b>WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I</b>	<b>4,33</b>	<b>9,53</b>	<b>9,53</b>	<b>10,01</b>	<b>68,68</b>	<b>116,58</b>	<b>180,95</b>
Var. IBOVESPA p.p.	-1,66	11,54	11,54	-13,27	8,96	94,34	144,32
<b>DIADEMA</b>	<b>0,86</b>	<b>-0,95</b>	<b>-0,95</b>	<b>5,90</b>	<b>13,67</b>	<b>14,73</b>	
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,61	-4,45	-4,45	-2,41	1,26	-8,42	
<b>CDI</b>	<b>0,20</b>	<b>0,49</b>	<b>0,49</b>	<b>0,96</b>	<b>2,22</b>	<b>7,78</b>	<b>14,62</b>
<b>IBOVESPA</b>	<b>6,00</b>	<b>-2,00</b>	<b>-2,00</b>	<b>23,29</b>	<b>59,73</b>	<b>22,24</b>	<b>36,63</b>
<b>INPC + 6,00%</b>	<b>1,40</b>	<b>3,41</b>	<b>3,41</b>	<b>8,43</b>	<b>13,30</b>	<b>24,13</b>	<b>37,66</b>
<b>IPCA + 6,00%</b>	<b>1,47</b>	<b>3,50</b>	<b>3,50</b>	<b>8,31</b>	<b>12,41</b>	<b>23,15</b>	<b>36,45</b>

**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	0,04	0,13	0,13	0,83	2,51	9,33	16,64	27,53	45,49
IRF-M 1+	-1,45	-4,77	-4,77	-2,02	1,81	15,01	26,76	44,69	79,99
IRF-M TOTAL	-0,84	-2,80	-2,80	-0,87	2,25	13,59	23,98	39,93	69,38
IMA-B 5	0,34	-0,15	-0,15	3,23	8,50	18,63	29,54	45,04	65,50
IMA-B 5+	-1,17	-5,10	-5,10	4,90	12,01	21,24	42,19	56,75	97,62
IMA-B TOTAL	-0,46	-2,81	-2,81	4,17	10,39	20,48	36,99	51,70	84,40
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,38	-1,64	-1,64	1,15	4,18	12,86	23,35	36,70	62,69
IMA-GERAL TOTAL	-0,39	-1,32	-1,32	1,50	4,98	13,88	24,71	38,15	64,18
IDKA 2	0,29	-0,05	-0,05	3,00	8,57	18,47	29,35	45,40	65,85
IDKA 20	-1,89	-7,21	-7,21	7,55	15,19	22,04	53,40	63,82	131,50
CDI	0,20	0,49	0,49	0,96	2,22	7,78	14,62	24,23	41,32

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,00	-2,00	-2,00	23,29	59,73	22,24	36,63	79,48	133,01
IBRX 100	6,04	-0,72	-0,72	24,43	62,17	26,16	42,14	86,58	142,11
IBRX 50	6,08	-0,80	-0,80	25,46	64,73	22,50	35,45	78,91	129,35
SMALL CAP	4,56	-0,88	-0,88	21,46	64,58	44,87	61,92	116,69	210,83
IFIX	-1,38	-0,81	-0,81	1,86	14,14	14,65	20,75	40,04	91,60
Índice Consumo - ICON	2,32	-4,34	-4,34	6,29	50,94	40,41	39,42	72,50	90,80
Índice Dividendos - IDIV	7,57	-3,21	-3,21	21,41	39,35	28,51	46,14	77,21	174,91

**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	0,93	2,05	2,05	5,25	6,10	9,60	14,62	17,69	23,07
INPC	0,86	1,96	1,96	5,36	6,94	10,48	15,64	17,44	22,80
IGPM	2,94	8,26	8,26	16,52	31,10	40,02	51,60	51,90	59,27
SELIC	0,20	0,49	0,49	0,96	2,22	7,78	14,62	24,25	41,36

**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	7,39	15,96	15,96	19,32	68,46	104,94	157,87	202,36	208,78
MSCI ACWI	5,55	14,22	14,22	20,33	66,81	93,57	128,33	169,72	170,64
MSCI World	6,22	14,59	14,59	19,97	66,32	95,04	133,33	172,75	173,11

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,29	3,03	3,03	7,30	10,31	18,55	28,89	37,53	49,60
IPCA + 5,00%	1,38	3,26	3,26	7,81	11,36	20,84	32,63	42,86	56,89
IPCA + 5,50%	1,42	3,38	3,38	8,06	11,89	21,99	34,53	45,58	60,64
IPCA + 5,89%	1,46	3,48	3,48	8,25	12,30	22,90	36,03	47,73	63,62
IPCA + 6,00%	1,47	3,50	3,50	8,31	12,41	23,15	36,45	48,34	64,47
INPC + 4,00%	1,22	2,93	2,93	7,42	11,18	19,49	30,03	37,24	49,27
INPC + 6,00%	1,40	3,41	3,41	8,43	13,30	24,13	37,66	48,02	64,11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

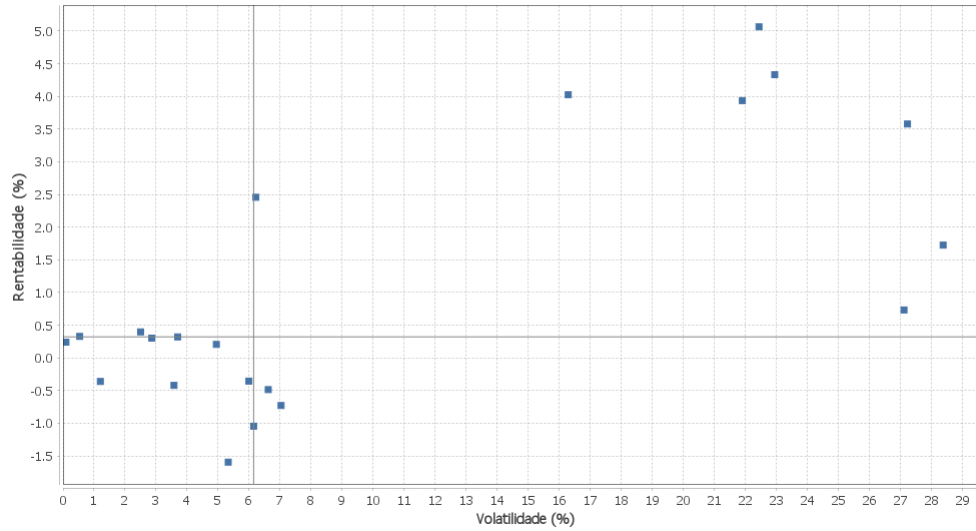
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
42	01/03/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.800,00	2.946,36083000	2,3079318500
43	04/03/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.500,00	649,67817300	2,3088354540
45	05/03/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	30.000,00	12.991,69388900	2,3091677080
44	05/03/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	12.000,00	5.196,67755500	2,3091677080
59	05/03/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.103.231,95	477.761,72608800	2,3091677080
40	08/03/2021	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	133.852,46	0,00	88.686,66536400	1,5092737950
52	08/03/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	13.557,09	0,00	5.870,99745400	2,3091629840
46	09/03/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.010.000,00	437.371,29529600	2,3092507690
60	09/03/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	132.786,29	57.501,89272800	2,3092507690
51	10/03/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.000.000,00	0,00	433.001,52413500	2,3094606930
61	10/03/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	971.774,26	420.779,72703600	2,3094607405
53	12/03/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	19.000,00	0,00	8.225,99512900	2,3097509420
47	15/03/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	52.000,00	22.511,84472400	2,3098951080
62	15/03/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.500.463,82	2.814.181,38749500	2,3098951080
54	19/03/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	7.242.279,71	0,00	3.134.562,43098000	2,3104595520
55	19/03/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	121.689,64	0,00	52.669,01984700	2,3104595520
48	22/03/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	4.327,35415900	2,3108808830
56	23/03/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	14.203,86	0,00	6.145,58518500	2,3112298620
41	23/03/2021	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	0,00	20.105.610,15	923.016,81818282	21,7824960000
49	25/03/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	85.000,00	36.765,29253700	2,3119631080
57	25/03/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	10.236.667,95	0,00	4.427.695,19746100	2,3119631080
50	26/03/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	43.000,00	18.596,03952900	2,3123203160
63	26/03/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.023.716,49	2.172.586,75419600	2,3123203160
39	26/03/2021	WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	10.000.000,00	0,00	1.525,84011480	6.553,7666122000
58	30/03/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	482.739,19	0,00	208.711,39873700	2,3129507680

**Total**

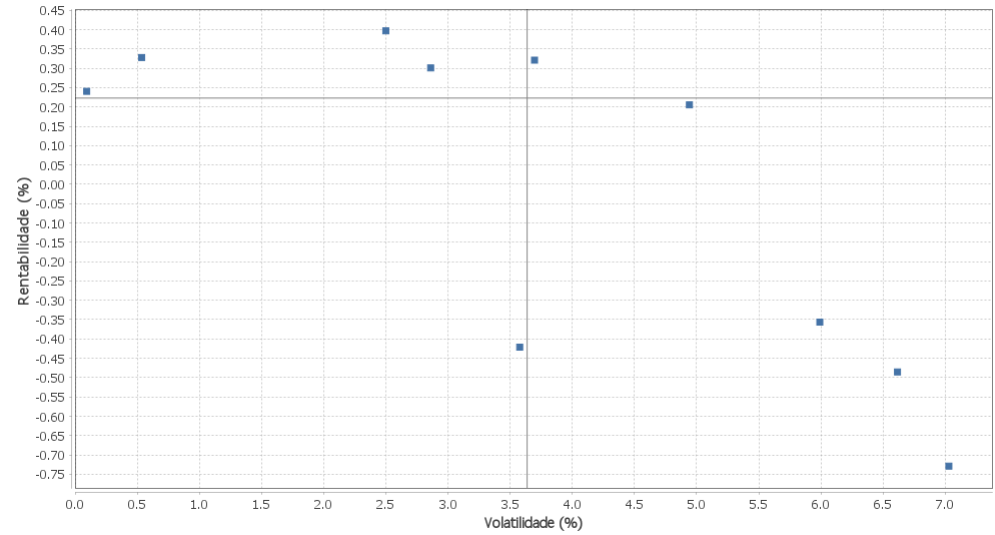
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

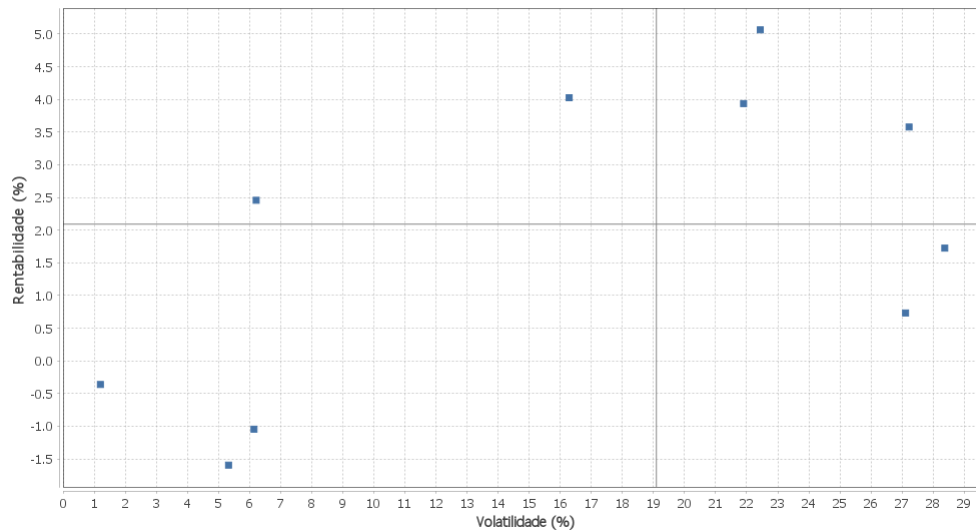
DIADEMA - No Mês



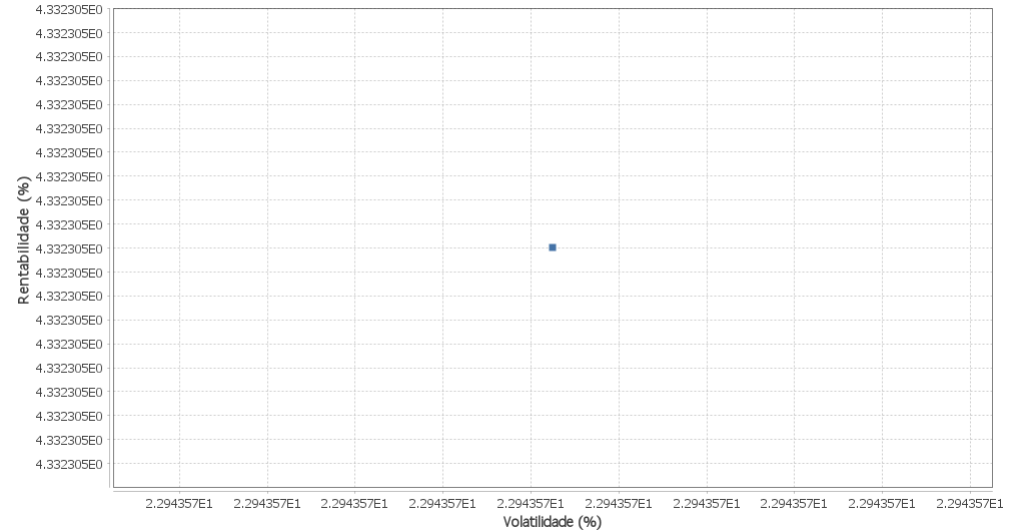
Renda Fixa - No Mês



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\$): 6.234.324,27

Value-At-Risk: 2,40%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,09	0,03	0,00	0,42	0,24	21.259.193,86	8,19
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	Artigo 7º VII, Alínea b	0,54	0,17	0,00	0,24	0,33	3.698.102,87	1,43
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	Artigo 8º IV, Alínea a	1,20	0,10	0,00	-0,47	-0,36	81.377,23	0,03
BB PREV IPCA I	Artigo 7º I, Alínea b	2,50	0,80	0,03	0,08	0,40	16.762.499,62	6,46
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,86	0,94	0,09	0,03	0,30	36.408.996,98	14,03
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,58	1,36	0,09	-0,17	-0,42	25.881.830,13	9,98
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,70	1,42	0,01	0,03	0,32	2.158.207,51	0,83
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	Artigo 7º VII, Alínea b	4,94	1,84	0,05	0,00	0,21	10.037.911,57	3,87
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	Artigo 8º IV, Alínea a	5,33	0,70	0,00	-0,34	-1,60	9.205,55	0,00
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	5,99	2,18	0,15	-0,09	-0,36	27.008.348,50	10,41
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	Artigo 8º IV, Alínea b	6,14	2,55	-0,00	-0,20	-1,05	1.276.597,66	0,49
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	Artigo 8º IV, Alínea b	6,21	2,72	0,00	0,36	2,46	3.059.335,95	1,18
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	Artigo 7º I, Alínea b	6,62	2,82	0,14	-0,10	-0,49	20.372.513,11	7,85
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	7,03	3,04	0,16	-0,13	-0,73	21.620.385,98	8,33
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	16,29	6,78	0,48	0,23	4,03	25.601.252,55	9,87
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	21,90	10,55	0,15	0,17	3,94	4.558.707,92	1,76
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	22,44	9,22	0,41	0,22	5,06	13.771.155,05	5,31
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	22,94	9,96	0,07	0,18	4,33	9.968.316,82	3,84
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	27,11	12,18	0,35	0,02	0,73	9.004.771,52	3,47
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	27,22	NaN	0,00	0,12	3,58	0,00	0,00
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	28,37	10,10	0,22	0,05	1,73	6.921.397,96	2,67