



LDB
EMPRESAS

DIADEMA
3º TRIMESTRE 2022



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 30.09.2022.

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

81,23%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC	0,14	0,05	1,10	3,36	16.764.772,74	8,35	1.247.500.153,02	1,34
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,83	0,00	0,00	-0,26	0,00	0,00	8.749.817.040,89	0,00
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,69	0,00	-0,02	-0,03	0,00	0,00	889.444.204,66	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,92	0,00	-0,20	-0,60	0,00	0,00	8.482.726.221,67	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,71	0,00	-0,13	-0,12	0,00	0,00	6.260.416.458,58	0,00
BB	BB	BB PREV RF IPCA	2,24	0,06	0,08	0,08	9.649.482,31	4,81	3.601.305.672,83	0,27
BB	BB	BB PREV IPCA I	1,66	0,05	1,05	3,12	18.571.398,99	9,25	280.371.556,62	6,62
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,69	0,16	0,84	0,84	16.283.125,54	8,11	5.850.800.339,33	0,28
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,04	0,08	0,75	1,39	61.268.779,58	30,53		

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,16	0,05	1,11	3,34	14.482.787,51	7,22	13.954.428.357,23	0,10
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,14	0,05	1,09	3,35	26.558.044,01	13,23	11.863.594.899,56	0,22
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,72	0,00	-0,12	-0,15	0,00	0,00	1.080.164.977,54	0,00
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,14	0,05	0,80	0,80	25.355.855,18	12,64	2.713.701.445,40	0,93
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,14	0,05	0,90	0,90	23.904.891,77	11,91	7.044.059.635,23	0,34
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,91	0,05	0,98	2,18	90.301.578,47	45,00		

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BB	BB	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3,04	0,11	0,45	0,33	7.158.718,95	3,57	550.126.022,42	1,30
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	0,16	0,06	1,19	3,60	4.278.980,12	2,13	1.207.515.787,08	0,35
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			1,94	0,09	0,73	1,53	11.437.699,07	5,70		
Renda Fixa			1,75	0,07	0,86	1,69	163.008.057,12	81,23		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

11,47%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	17,31	1,45	-2,18	7,57	4.786.715,07	2,39	1.083.847.526,25	0,44
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	24,68	1,51	-0,31	14,37	4.755.772,54	2,37	1.434.568.432,69	0,33
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	18,57	1,86	-0,13	10,62	4.842.429,58	2,41	989.847.865,28	0,49
GUEPARDO	DAYCOVAL	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	22,95	1,87	1,40	21,02	4.145.577,02	2,07	165.379.411,36	2,51
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT 30 FIC FIA	18,70	1,94	3,71	25,28	4.479.451,74	2,23	580.073.029,04	0,77
Sub-total Artigo 8º I			17,48	1,72	0,39	15,13	23.009.945,95	11,47		
Renda Variável			16,56	1,72	0,39	15,13	23.009.945,95	11,47		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

5,92%

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	26,71	-1,32	-7,36	-2,28	11.885.124,22	5,92	1.555.672.315,14	0,76
Sub-total Artigo 9º III			26,71	-1,32	-7,36	-2,28	11.885.124,22	5,92		
Investimentos no Exterior			26,71	-1,32	-7,36	-2,28	11.885.124,22	5,92		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

0,01%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	21,97	0,00	0,18	6,77	0,00	0,00	1.063.171.502,82	0,00
Sub-total Artigo 10º I			21,97	0,00	0,18	6,77	0,00	0,00		

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
PÁTRIA	PÁTRIA	PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	184,71	0,54	0,54	1,60	18.073,19	0,01	2.488.843,03	0,73
Sub-total Artigo 10º II			184,71	0,54	0,54	1,60	18.073,19	0,01		
Investimentos Estruturados			22,32	0,54	0,73	7,33	18.073,19	0,01		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

1,37%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
PLURAL	GENIAL	BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPF11	9,93	0,00	0,41	5,86	1.183.062,80	0,59	354.313.584,35	0,33
RIO BRAVO	BB	BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII	48,55	0,00	40,34	-10,84	1.561.354,37	0,78	32.320.035,33	4,83
Sub-total Artigo 11º			34,26	0,00	23,08	-5,61	2.744.417,17	1,37		
Fundos Imobiliários			34,26	0,00	23,08	-5,61	2.744.417,17	1,37		
Total			4,55	0,16	0,63	2,91	200.665.617,65	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	61.268.779,58	30,53	15,00	35,00	70,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	90.301.578,47	45,00	0,00	35,00	65,00	0,00	65,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	11.437.699,07	5,70	0,00	4,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	163.008.057,12	81,23					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	23.009.945,95	11,47	0,00	10,00	35,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	23.009.945,95	11,47					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	11.885.124,22	5,92	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	11.885.124,22	5,92					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	0,00	0,00	0,00	9,00	15,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	18.073,19	0,01	0,00	0,50	15,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	18.073,19	0,01					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	2.744.417,17	1,37	0,00	1,50	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	2.744.417,17	1,37					5,00
Total		200.665.617,65	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,75 70,36	1,39 41,88	1,39 41,88	4,12 65,31	9,48 87,00	472.042,79	1.086.234,21
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,98 91,36	2,18 65,82	2,18 65,82	5,06 80,15		809.449,81	1.471.729,02
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,73 67,76	1,53 46,20	1,53 46,20	4,36 68,99		82.476,50	172.291,64
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	0,39 -0,08	15,13 3,46	15,13 3,46	-4,21 4,09		89.436,22	3.023.349,30
Artigo 9º III % do CDI	-7,36 -687,00	-2,28 -68,81	-2,28 -68,81	-18,47 -292,52	-32,34 -296,85	-944.866,56	-277.017,41
Artigo 10º I % do CDI	0,18 17,24	6,77 204,37	6,77 204,37	-9,37 -148,35		19.806,74	680.309,38
Artigo 10º II % do CDI	0,54 50,39	1,60 48,34	1,60 48,34	10,58 167,66		97,11	284,66
Artigo 11º % do CDI	23,08 2.153,27	-5,61 -169,44	-5,61 -169,44	-2,87 -45,54		629.277,85	-210.176,63
DIADEMA (Total)						1.157.720,46	5.947.004,17

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV IPCA I	18.377.549,24	0,00	0,00	0,00	18.571.398,99	193.849,75	561.087,18
BB PREV RF IDKA2	17.828.594,16	0,00	-17.822.033,36	0,00	0,00	-6.560,80	-53.995,70
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4.390.486,22	0,00	-4.384.993,54	0,00	0,00	-5.492,68	-5.356,45
BB PREV RF IPCA	0,00	9.641.845,32	0,00	0,00	9.649.482,31	7.636,99	7.636,99
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	16.178.562,89	0,00	-16.146.710,19	0,00	0,00	-31.852,70	-96.972,21
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	16.146.710,19	0,00	0,00	16.283.125,54	136.415,35	136.415,35
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	25.157.862,75	0,00	-25.154.065,84	0,00	0,00	-3.796,91	-7.238,32
WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC	16.582.928,95	0,00	0,00	0,00	16.764.772,74	181.843,79	544.657,37

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
					61.268.779,58	0,00	0,00

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	9.116.606,35	26.336.488,88	-9.160.504,22	0,00	26.558.044,01	265.453,00	626.244,33
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	23.692.347,12	0,00	0,00	23.904.891,77	212.544,65	212.544,65
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	23.720.908,70	0,00	-23.692.347,12	0,00	0,00	-28.561,58	-36.262,65
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	14.324.480,84	0,00	0,00	0,00	14.482.787,51	158.306,67	467.495,62
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	25.154.148,11	0,00	0,00	25.355.855,18	201.707,07	201.707,07
					90.301.578,47	0,00	0,00

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	7.126.704,16	0,00	0,00	0,00	7.158.718,95	32.014,79	23.600,61
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	4.228.518,41	0,00	0,00	0,00	4.278.980,12	50.461,71	148.691,03
					11.437.699,07	0,00	0,00

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	4.893.613,98	0,00	0,00	0,00	4.786.715,07	-106.898,91	336.997,97
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	4.770.758,74	0,00	0,00	0,00	4.755.772,54	-14.986,20	597.704,34
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	4.088.177,43	0,00	0,00	0,00	4.145.577,02	57.399,59	720.110,20
OCCAM FIC FIA	4.848.546,86	0,00	0,00	0,00	4.842.429,58	-6.117,28	464.734,53
TARPON GT 30 FIC FIA	4.319.412,72	0,00	0,00	0,00	4.479.451,74	160.039,02	903.802,26
					23.009.945,95	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	12.829.990,78	0,00	0,00	0,00	11.885.124,22	-944.866,56	-277.017,41
					11.885.124,22	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	10.716.807,82	0,00	-10.736.614,56	0,00	0,00	19.806,74	680.309,38
					0,00	0,00	0,00

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	17.976,08	0,00	0,00	0,00	18.073,19	97,11	284,66
					18.073,19	0,00	0,00

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII	1.559.961,44	0,00	0,00	0,00	623.001,20	1.561.354,37	624.394,13	-276.779,90
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPFF11	1.188.679,08	0,00	0,00	0,00	10.500,00	1.183.062,80	4.883,72	66.603,27
						2.744.417,17	0,00	0,00

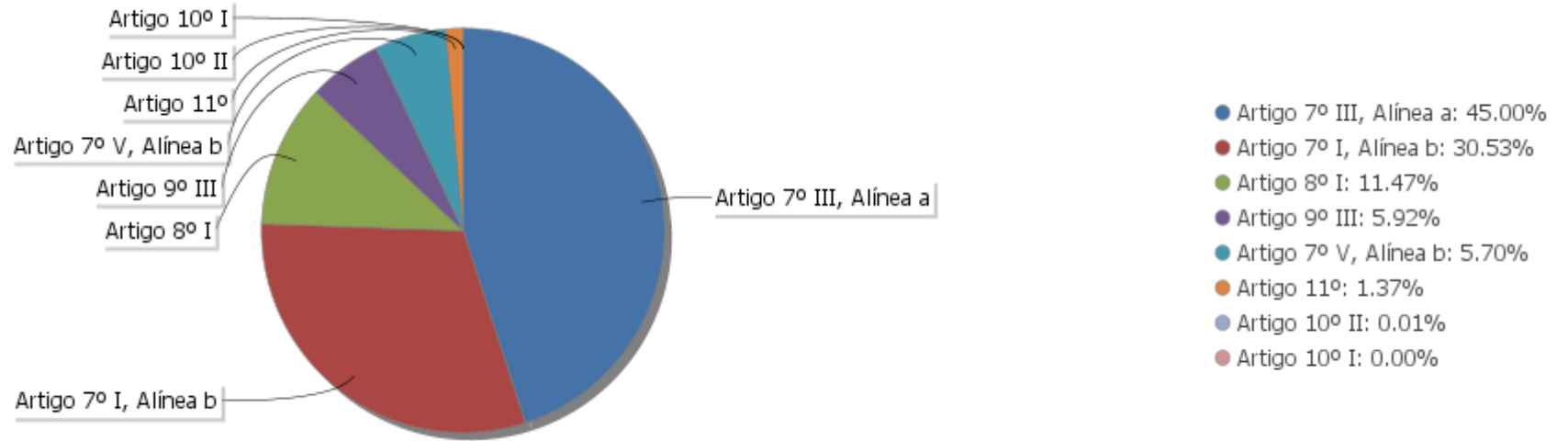
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

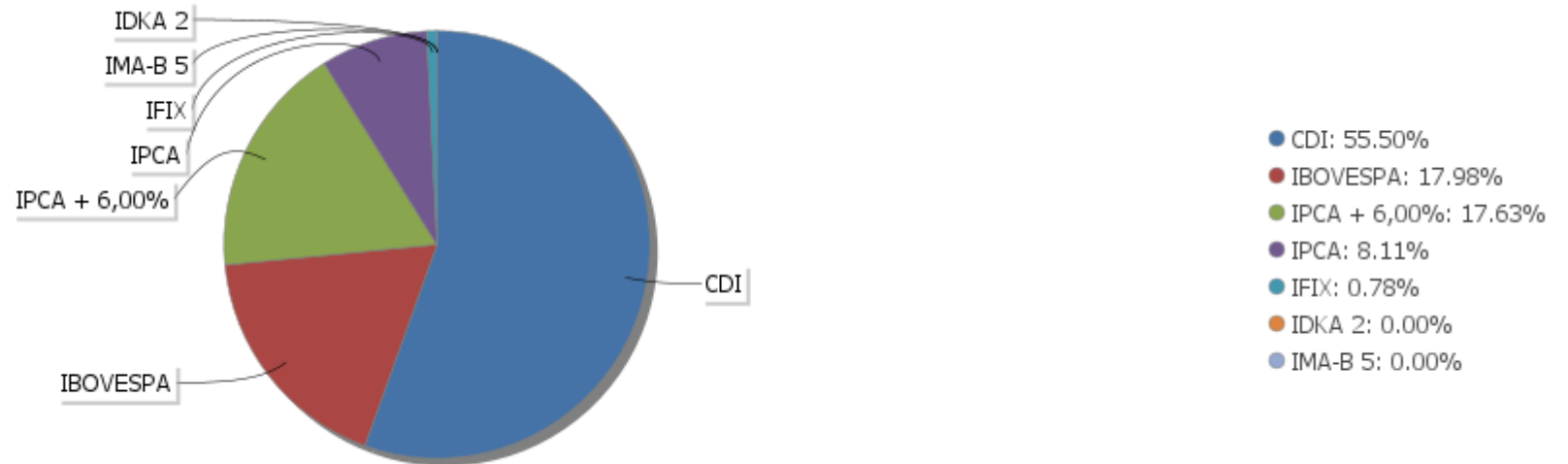
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	168.915.260,72	84,18	168.915.260,72	84,18	
de 31 dias a 365 dias	23.030.283,61	11,48	191.945.544,33	95,65	
acima de 365 dias	8.720.073,32	4,35	200.665.617,65	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

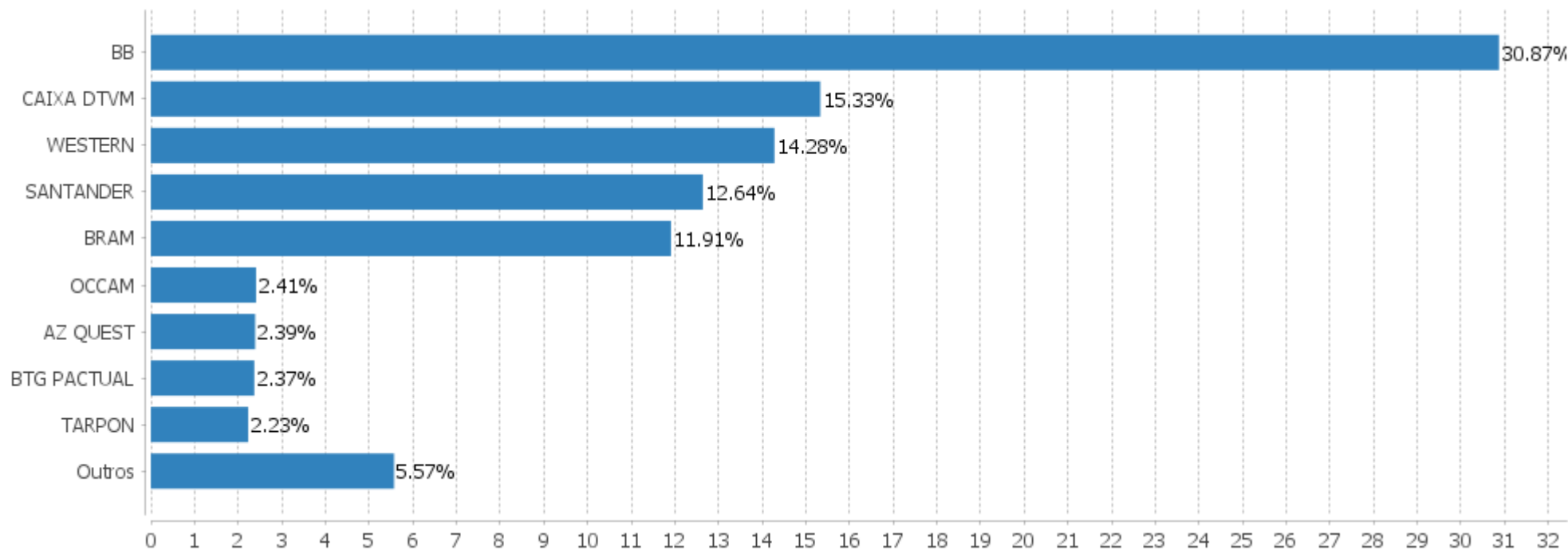


Alocação Por Estratégia



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
2022	-0,88	-0,07	2,24	-1,55	0,28	-0,99	1,83	0,42	0,63				1,86
IPCA + 4,89%	0,94	1,37	2,04	1,42	0,89	1,07	-0,28	0,08	0,11				7,88
p.p. indexador	-1,82	-1,44	0,20	-2,97	-0,61	-2,06	2,12	0,35	0,52				-6,02
2021	-0,82	-0,99	0,86	1,54	0,90	0,39	-0,04	-0,79	-0,34	-0,08	0,72	1,38	2,73
IPCA + 5,44%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,28	0,97	1,43	1,34	1,61	1,68	1,38	1,22	16,02
p.p. indexador	-1,49	-2,23	-0,56	0,81	-0,38	-0,59	-1,47	-2,13	-1,95	-1,75	-0,65	0,16	-13,30
2020	0,65	-1,49	-9,14	2,57	2,61	1,62	3,08	-0,83	-1,83	-0,62	3,93	3,52	3,39
IPCA + 5,88%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,64
p.p. indexador	-0,06	-2,15	-9,71	2,43	2,54	0,89	2,20	-1,55	-2,95	-1,96	2,58	1,66	-7,25
2019	1,96	0,42	0,53	1,12	1,29	2,25	1,43	0,12	1,52	1,92	-0,27	2,07	15,31
IPCA + 6,00%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	1,12	-0,47	-0,67	0,06	0,65	1,80	0,71	-0,50	1,07	1,28	-1,24	0,43	4,72

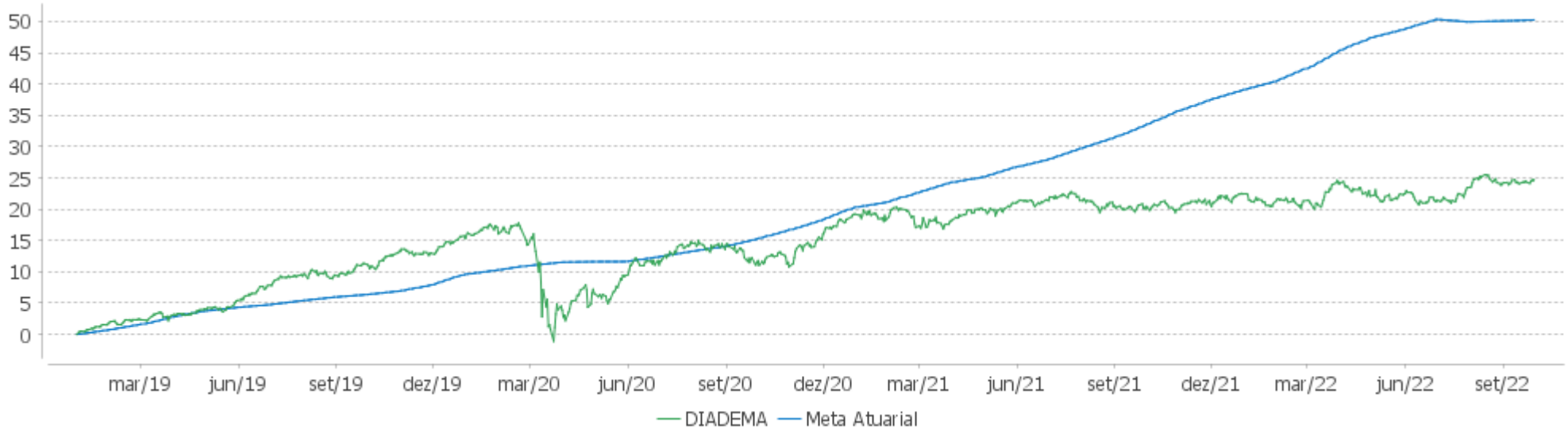
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	20	44,44	03 meses	2,91	-0,10	3,01	3,81
Meses abaixo - Meta Atuarial	25	55,56	06 meses	0,59	3,32	-2,73	4,55
			12 meses	3,94	12,56	-8,62	4,55
			24 meses	11,88	30,95	-19,07	4,93
			36 meses	12,24	43,04	-30,80	8,32
Maior rentabilidade da Carteira	3,93	2020-11	Desde 31/12/2018	24,75	53,15	-28,40	7,59
Menor rentabilidade da Carteira	-9,14	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

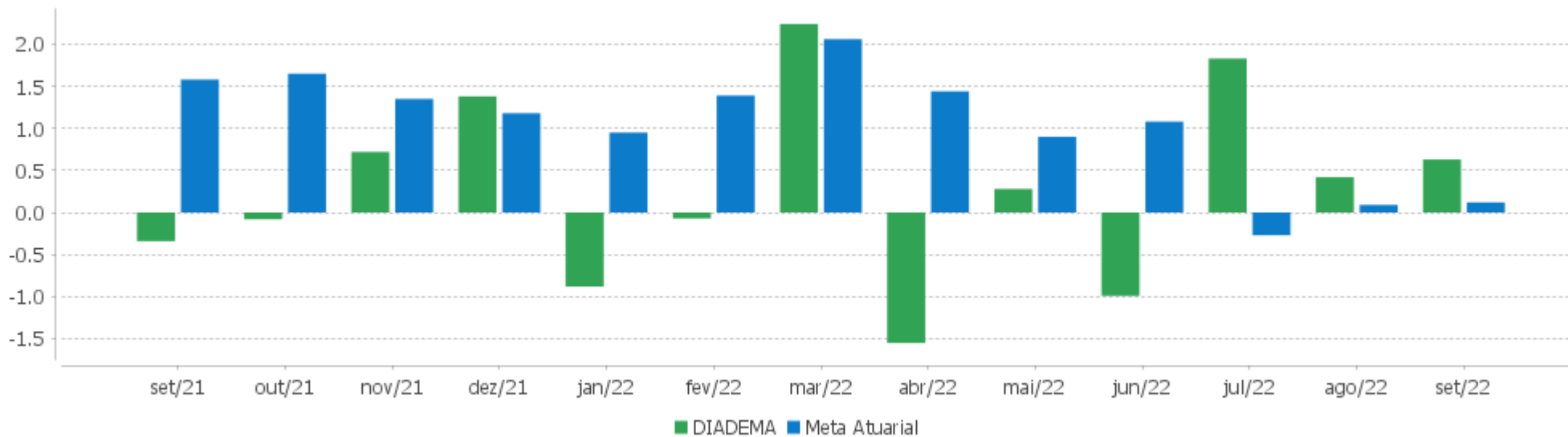


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,45 0,25	0,33 0,16	0,33 0,16	2,85 -1,02	9,19 -4,41	15,17 -17,55	22,82 -22,27
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO % do CDI	1,19 111,32	3,60 108,75	3,60 108,75	6,88 108,93	12,14 111,43	18,20 128,02	17,61 96,38
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,40 -0,02	0,39 -0,05	0,39 -0,05	3,03 -0,10	9,03 -0,22	15,26 -0,48	23,38 -0,75
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,05 0,86	3,12 2,95	3,12 2,95	6,25 2,39	12,58 -1,02	21,33 -11,39	30,87 -14,23
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,53 -0,09	0,26 0,18	0,26 0,18	2,81 -0,13	8,72 -0,19	15,30 -0,38	23,69 -1,24
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,08 -0,11	0,02 -0,15	0,02 -0,15	3,10 -0,76	8,79 -4,81	15,18 -17,55	24,85 -20,25
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	1,24 1,53	3,54 4,86	3,54 4,86	5,84 4,98	9,44 2,28	10,38 -7,77	17,45 -4,40
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,51 -0,11	0,11 0,02	0,11 0,02	2,60 -0,34	8,47 -0,45	14,89 -0,79	23,34 -1,60
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,40 -0,02	0,40 -0,03	0,40 -0,03	3,05 -0,09	8,97 -0,27	15,18 -0,56	23,19 -0,94
WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC % do CDI	1,10 102,29	3,36 101,44	3,36 101,44	6,27 99,25	11,02 101,15	14,30 100,59	
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	0,41 -0,01	0,38 -0,05	0,38 -0,05	2,94 -0,20	8,79 -0,46	14,20 -1,54	22,35 -1,78
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,12 104,02	3,44 103,94	3,44 103,94	6,62 104,79	11,58 106,31	15,22 107,12	18,56 101,56
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,09 101,93	3,35 101,16	3,35 101,16	6,35 100,55	11,18 102,63	14,77 103,93	18,19 99,53
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	1,11 103,09	3,34 100,77	3,34 100,77	6,40 101,38	11,18 102,63	14,86 104,57	18,19 99,54
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	1,12 104,49	3,41 103,01	3,41 103,01	6,53 103,43	11,54 105,92	15,48 108,94	18,47 101,05
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-0,31 -0,78	14,37 2,71	14,37 2,71	-9,67 -1,36	-20,04 -19,19	-23,90 -40,21	-19,68 -24,73
TARPON GT 30 FIC FIA	3,71	25,28	25,28	5,18	19,66	73,30	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	3,24	13,61	13,61	13,48	20,51	56,98	
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	1,40 0,93	21,02 9,36	21,02 9,36	2,79 11,09	10,29 11,14		
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,18 -2,65	7,57 -4,09	7,57 -4,09	-10,89 -2,59	-13,12 -12,27	0,05 -16,27	-0,91 -5,96
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-0,13 -0,60	10,62 -1,05	10,62 -1,05	-5,02 3,28	1,71 2,56	13,78 -2,54	7,08 2,02
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	-7,36 -7,83	-2,28 -13,94	-2,28 -13,94	-18,47 -10,16	-32,34 -31,50	-20,27 -36,58	38,99 33,94
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	-8,61 -803,31	-2,61 -78,81	-2,61 -78,81	-17,32 -274,40	-9,32 -85,56	18,56 130,62	29,75 162,76
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP % do CDI	0,54 50,38	1,60 48,34	1,60 48,34	10,58 167,65	128,15 1.176,16	60,20 423,57	-99,57 -544,82
BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII Var. IFIX p.p.	40,34 39,85	-10,84 -17,82	-10,84 -17,82	-7,49 -15,07	-1,73 -11,86	10,61 3,60	11,39 -0,03
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPFF11 Var. IBOVESPA p.p.	0,41 -0,06	5,86 -5,81	5,86 -5,81	7,00 15,30	10,51 11,36	4,92 -11,39	5,28 0,23
DIADEMA Var. IPCA + 5,06% p.p.	0,63 0,52	2,91 3,01	2,91 3,01	0,59 -2,73	3,94 -8,47	11,88 -18,08	12,24 -28,35
CDI	1,07	3,31	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28
IBOVESPA	0,47	11,66	11,66	-8,30	-0,85	16,31	5,05
INPC + 6,00%	0,17	0,27	0,27	3,88	13,62	33,40	46,90
IPCA + 6,00%	0,20	0,17	0,17	3,87	13,60	32,72	45,10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	D+1 du	D+0	D+27	D+29	-	2,00
BB PREV IPCA I	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	D+0	D+0	D+30 ou D+0 a D+2880 (isento de taxa de resgate de acordo com a data de solicitação)	D+30 ou D+0 a D+2880 (isento de taxa de resgate de acordo com a data de solicitação)		0,20
BB PREV RF IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IPCA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII	Não se aplica	Não se aplica				
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPFF11	Não se aplica	Não se aplica				
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)	D+4 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)		3,00
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+2		
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,45
OCCAM FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+15 (isento de taxa de resgate)	D+3 du ou D+17 (isento de taxa de resgate)	-	3,00
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	Não se aplica	Não se aplica				
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,10
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
TARPON GT 30 FIC FIA	D+1 du	D+1 du	D+30	D+32	O fundo cobrara 20.00 % do que exceder 100.00 % o índice IBOV_FEC. A taxa de performance sera paga no(s) mes(es) de Janeiro	
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50
WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	1,11	3,43	3,43	6,17	9,81	12,55	17,67	26,42	34,96
IRF-M 1+	1,58	5,47	5,47	5,41	7,24	3,87	11,78	35,04	42,24
IRF-M TOTAL	1,40	4,66	4,66	5,53	8,01	6,91	13,92	33,10	40,74
IMA-B 5	0,42	0,43	0,43	3,14	9,25	15,75	24,13	43,24	52,60
IMA-B 5+	2,39	3,01	3,01	3,14	5,19	8,56	6,75	54,62	53,36
IMA-B TOTAL	1,48	1,70	1,70	3,16	7,25	12,30	14,67	50,64	54,48
IMA-GERAL TOTAL	1,26	3,17	3,17	5,13	9,24	11,95	16,81	36,41	43,76
IDKA 2	0,62	0,09	0,09	2,94	8,91	15,68	24,94	40,99	52,99
IDKA 20	5,00	6,75	6,75	3,59	0,98	3,03	-6,12	61,55	50,87
CDI	1,07	3,31	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28	25,70	34,07

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,47	11,66	11,66	-8,30	-0,85	16,31	5,05	38,69	48,11
IBRX 100	-0,05	10,77	10,77	-9,10	-1,33	16,26	6,28	43,30	51,68
IBRX 50	0,48	11,70	11,70	-8,80	0,58	19,15	7,21	38,32	48,42
SMALL CAP	-1,84	14,47	14,47	-13,82	-18,43	-5,58	-7,27	45,86	34,71
Índice Consumo - ICON	-1,18	15,08	15,08	-17,92	-27,77	-28,97	-29,71	8,70	-9,15
Índice Dividendos - IDIV	-1,80	4,42	4,42	-5,43	7,21	28,20	15,63	76,72	67,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-5,36	-2,23	-2,23	-9,68	-17,26	2,19	56,39	66,16	142,89

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,49	6,98	6,98	7,58	10,13	7,01	11,42	40,10	34,66

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-5,78	-4,29	-4,29	-11,25	-22,48	-6,15	37,99	42,53	93,97

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	-0,29	-1,32	-1,32	0,86	7,17	18,15	21,85	25,38	31,05
INPC	-0,32	-1,23	-1,23	0,87	7,19	18,75	23,37	26,97	32,02
IGPM	-0,95	-1,43	-1,43	1,07	8,25	35,16	59,40	64,77	81,31
SELIC	1,07	3,31	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28	25,70	34,08

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,04	-0,32	-0,32	2,87	11,46	27,77	37,05	46,63	59,32
IPCA + 5,00%	0,12	-0,07	-0,07	3,37	12,53	30,23	41,03	52,34	67,10
IPCA + 5,50%	0,16	0,05	0,05	3,62	13,06	31,48	43,06	55,26	71,10
IPCA + 5,89%	0,19	0,14	0,14	3,81	13,48	32,45	44,65	57,56	74,27
IPCA + 6,00%	0,20	0,17	0,17	3,87	13,60	32,72	45,10	58,22	75,18
INPC + 4,00%	0,01	-0,22	-0,22	2,89	11,48	28,42	38,75	48,49	60,50
INPC + 6,00%	0,17	0,27	0,27	3,88	13,62	33,40	46,90	60,23	76,47

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1002	05/07/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.347.432,66	529.346,81405500	2,5454628690
993	05/07/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	19.642,79291200	2,5454628690
1003	07/07/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.388.047,64	544.757,28776500	2,5480111440
994	07/07/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	16.000,00	6.279,40738700	2,5480111440
991	08/07/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	81.597,80	0,00	32.008,40946300	2,5492613150
992	14/07/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.000.000,00	782.990,60830900	2,5543090540
1004	15/07/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.780.000,00	2.261.889,43643000	2,5553857350
995	15/07/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	70.000,00	27.393,12466300	2,5553857350
1000	20/07/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	6.280.000,00	0,00	2.453.953,90057400	2,5591352790
996	22/07/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	3.903,69156000	2,5616777980
997	25/07/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	150.000,00	58.525,93245800	2,5629664270
998	27/07/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	3.897,90159000	2,5654829320
1001	28/07/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	6.750.365,53	0,00	2.629.929,10675100	2,5667480970
1005	29/07/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	20.000,00	7.788,09816000	2,5680210480
1006	29/07/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.080.000,00	2.367.581,84078500	2,5680210480
999	29/07/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	19.470,24540100	2,5680210480
1009	03/08/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.000,00	1.944,16452700	2,5717988010
1010	05/08/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	19.422,55867600	2,5743261140
1007	05/08/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.870.223,78	0,00	726.490,62208100	2,5743261140
1021	05/08/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.369.534,46	531.997,26816000	2,5743261140
1011	08/08/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	3.882,53010200	2,5756400430
1022	08/08/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.502.349,37	583.291,66534100	2,5756400430
1012	11/08/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	8.000,00	3.101,27586600	2,5795834830
1014	15/08/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	55.000,00	21.298,83358900	2,5823010340
1013	15/08/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	8.000,00	3.098,01215800	2,5823010340
1008	15/08/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.200.000,00	851.953,34356200	2,5823010340
1023	15/08/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.596.230,60	2.167.148,80500600	2,5823010340
1015	19/08/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	12.000,00	4.637,43654500	2,5876364850

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1019	19/08/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	6.625.961,24	0,00	2.560.622,89985800	2,5876364850
1020	22/08/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	131.686,75	0,00	50.864,09028600	2,5889925340
1016	25/08/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	140.000,00	53.990,81236400	2,5930337750
1017	29/08/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.000,00	1.926,24612300	2,5957222910
1018	30/08/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	19.252,53129200	2,5970610950
1024	30/08/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.140.156,62	2.364.271,14934700	2,5970610950
1025	31/08/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	294.264,52	113.247,97884000	2,5984085810
1029	01/09/2022	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	0,00	10.736.614,56	2.359.687,20989113	4,5500160000
1040	02/09/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	3.844,51539600	2,6011080640
1059	02/09/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	10.736.614,56	0,00	4.127.707,99821700	2,6011080640
1041	05/09/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	3.842,53649400	2,6024476320
1042	05/09/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	19.212,68247100	2,6024476320
1060	05/09/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.489.470,45	572.334,45610400	2,6024476320
1043	06/09/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.265.675,40	0,00	1.638.285,48602600	2,6037436310
1026	06/09/2022	BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	21.388.438,06	0,00	1.530.818,40937626	13,9718976000
1032	06/09/2022	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	5.380.483,99	2.027.403,19105884	2,6538796100
1031	06/09/2022	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	5.409.999,56	2.038.524,85983718	2,6538796100
1072	06/09/2022	BRANCO INST FIC FI RF IMA-B 5	0,00	23.692.347,12	10.494.788,96977162	2,2575344000
1073	06/09/2022	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	5.356.226,64	2.018.262,85556337	2,6538796100
1074	06/09/2022	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,00	4.384.993,54	191.551,46694492	22,8919862110
1044	08/09/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	110.000,00	0,00	42.225,13575200	2,6050833950
1068	08/09/2022	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	0,00	1.850.042,47	60.819,09100447	30,4187787000
1038	08/09/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.633.937,41	0,00	627.211,17225500	2,6050833950
1061	08/09/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.236.678,10	474.717,27867700	2,6050833950
1027	08/09/2022	BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	2.303.909,06	0,00	164.808,12018769	13,9793419000
1030	08/09/2022	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	16.146.710,19	0,00	9.940.158,02346195	1,6243917000
1070	08/09/2022	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	0,00	552.320,42	18.157,21878407	30,4187787000
1071	08/09/2022	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	0,00	22.751.702,95	747.949,25773927	30,4187787000
1076	09/09/2022	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	22.751.702,95	0,00	106.923,14186675	212,7855818000
1075	09/09/2022	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	2.402.445,16	0,00	11.290,45088336	212,7855818000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1045	15/09/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	55.000,00	21.059,77853800	2,6116134080
1036	15/09/2022	BB PREV RF IDKA2	0,00	7.887.392,76	2.457.486,22739100	3,2095369130
1062	16/09/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	53.594,93	0,00	20.511,31736500	2,6129443100
1046	19/09/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	12.000,00	4.590,11207600	2,6143152500
1037	19/09/2022	BB PREV RF IDKA2	0,00	9.934.640,60	3.092.429,44761800	3,2125682320
1035	19/09/2022	BB PREV RF IPCA	9.641.845,32	0,00	3.487.342,29764600	2,7648118530
1063	20/09/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	6.695.874,37	0,00	2.559.896,97952400	2,6156811870
1039	21/09/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	292.795,28	0,00	111.879,93783800	2,6170490050
1047	22/09/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	7.000,00	2.673,34487100	2,6184425650
1048	23/09/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	80.000,00	30.536,76677800	2,6197927430
1064	27/09/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	627.915,78	0,00	239.430,82548100	2,6225352510
1065	28/09/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.920.081,15	0,00	731.773,52137200	2,6238734990
1049	30/09/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	55.000,00	20.938,02285300	2,6268000750
1066	30/09/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.155.355,67	2.343.290,50337000	2,6268000750
Total			122.711.374,72	141.514.284,70		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 2.887.821,45

Value-At-Risk: 1,44%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
DIADEMA		1,44	1,44			200.665.617,65	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,26%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC		0,02	-0,00	0,01			16.764.772,74	8,35
BB PREV RF IDKA2		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BB PREV RF IPCA		0,99	0,01	1,00			9.649.482,31	4,81
BB PREV IPCA I		0,88	0,01	0,92			18.571.398,99	9,25
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,25	0,04	1,27			16.283.125,54	8,11
Sub-total	1,10	0,56	0,06		-0,29	0,75	61.268.779,58	30,53

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,03	-0,00	0,03			14.482.787,51	7,22
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,01	-0,00	0,01			26.558.044,01	13,23
BRADERCO INST FIC FI RF IMA-B 5		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,01	-0,00	0,01			25.355.855,18	12,64
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,01	-0,00	0,01			23.904.891,77	11,91
Sub-total	0,60	0,01	-0,00		-0,16	0,98	90.301.578,47	45,00

Artigo 7º V, Alínea b

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI		1,41	0,02	1,41			7.158.718,95	3,57
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO		0,03	0,00	0,02			4.278.980,12	2,13
Sub-total	1,70	0,88	0,02		-0,20	0,73	11.437.699,07	5,70

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,60%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		8,43	0,16	5,15			4.786.715,07	2,39
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		9,50	0,19	6,02			4.755.772,54	2,37
OCCAM FIC FIA		10,13	0,17	2,32			4.842.429,58	2,41
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA		9,68	0,16	6,14			4.145.577,02	2,07
TARPON GT 30 FIC FIA		9,42	0,16	7,61			4.479.451,74	2,23
Sub-total	20,39	8,60	0,84		-0,03	0,39	23.009.945,95	11,47

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 12,95%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I		12,95	0,52	15,03			11.885.124,22	5,92
Sub-total	22,63	12,95	0,52		-0,37	-7,36	11.885.124,22	5,92

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 0,31%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPFF11		0,21	0,00	10,32			1.183.062,80	0,59
BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII		0,51	-0,00	2,48			1.561.354,37	0,78
Sub-total	69,49	0,31	-0,00		0,32	23,08	2.744.417,17	1,37

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,45%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
Sub-total	0,64	NaN	0,00		-1,39	0,18	0,00	0,00

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP		0,45	0,00	0,45			18.073,19	0,01
Sub-total	1,87	0,45	0,00		-0,28	0,54	18.073,19	0,01

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

-Referente ao mês de setembro de 2022, vale observar que:

- O Instituto está com 5,70% do total da carteira alocados no Artigo 7º V, Alínea b, "FI RF Credito Privado", percentual este, superior ao permitido na Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021;