



**LDB**  
EMPRESAS

**DIADEMA**  
AGOSTO 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 31.08.2022.

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 76,13%

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
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC	0,16	1,19	7,78	16.582.928,95	8,04	1.218.068.677,73	1,36
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,74	-0,04	6,17	17.828.594,16	8,64	9.083.863.850,50	0,20
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,62	-0,01	6,48	25.157.862,75	12,20	1.027.616.539,87	2,45
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,82	-0,11	5,99	16.178.562,89	7,84	9.773.675.955,20	0,17
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,65	0,01	6,48	4.390.486,22	2,13	6.457.640.882,23	0,07
BB	BB	BB PREV IPCA I	1,70	1,20	9,39	18.377.549,24	8,91	283.274.789,95	6,49
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>2,05</b>	<b>0,39</b>	<b>7,09</b>	<b>98.515.984,21</b>	<b>47,76</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,18	1,19	7,93	14.324.480,84	6,94	14.286.717.843,06	0,10
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,16	1,18	7,90	9.116.606,35	4,42	11.325.025.814,75	0,08
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,65	-0,02	6,28	23.720.908,70	11,50	1.169.481.458,66	2,03
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,94</b>	<b>0,61</b>	<b>7,11</b>	<b>47.161.995,89</b>	<b>22,86</b>		

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - 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	2,99	0,06	6,24	7.126.704,16	3,46	549.807.283,80	1,30
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	0,18	1,27	8,48	4.228.518,41	2,05	1.167.245.726,65	0,36
<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea b</b>			<b>1,97</b>	<b>0,50</b>	<b>7,21</b>	<b>11.355.222,57</b>	<b>5,51</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>1,78</b>	<b>0,47</b>	<b>7,08</b>	<b>157.033.202,67</b>	<b>76,13</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

11,11%

Artigo 8º I (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	16,91	5,97	-3,19	4.893.613,98	2,37	1.116.195.129,84	0,44
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	25,29	5,74	-0,42	4.770.758,74	2,31	1.448.736.263,86	0,33
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	18,84	7,11	6,31	4.848.546,86	2,35	994.643.888,31	0,49
GUEPARDO	DAYCOVAL	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	24,15	11,23	2,20	4.088.177,43	1,98	144.693.251,97	2,83
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT 30 FIC FIA	19,26	10,14	16,52	4.319.412,72	2,09	533.763.056,70	0,81
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>17,15</b>	<b>7,84</b>	<b>4,76</b>	<b>22.920.509,73</b>	<b>11,11</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>16,12</b>	<b>7,84</b>	<b>4,76</b>	<b>22.920.509,73</b>	<b>11,11</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

6,22%

Artigo 9º 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	26,24	-4,46	-33,57	12.829.990,78	6,22	1.758.618.657,06	0,73
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>26,24</b>	<b>-4,46</b>	<b>-33,57</b>	<b>12.829.990,78</b>	<b>6,22</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>26,24</b>	<b>-4,46</b>	<b>-33,57</b>	<b>12.829.990,78</b>	<b>6,22</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

5,20%

Artigo 10º I (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	21,09	-3,22	-12,19	10.716.807,82	5,20	1.230.075.683,87	0,87
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>21,09</b>	<b>-3,22</b>	<b>-12,19</b>	<b>10.716.807,82</b>	<b>5,20</b>		

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

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	184,72	1,69	-44,46	17.976,08	0,01	2.449.645,25	0,73
<b>Sub-total Artigo 10º II</b>			<b>184,72</b>	<b>1,69</b>	<b>-44,46</b>	<b>17.976,08</b>	<b>0,01</b>		

<b>Investimentos Estruturados</b>			<b>23,66</b>	<b>-3,21</b>	<b>-12,23</b>	<b>10.734.783,90</b>	<b>5,20</b>		
-----------------------------------	--	--	--------------	--------------	---------------	----------------------	-------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

1,33%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
PLURAL	GENIAL	BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	10,00	5,37	6,19	1.188.679,08	0,58	355.995.596,04	0,33
RIO BRAVO	BB	BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII	41,04	-27,49	-31,15	1.559.961,44	0,76	51.224.954,10	3,05
<b>Sub-total Artigo 11º</b>			<b>26,62</b>	<b>-16,22</b>	<b>-18,84</b>	<b>2.748.640,52</b>	<b>1,33</b>		
<b>Fundos Imobiliários</b>			<b>26,62</b>	<b>-16,22</b>	<b>-18,84</b>	<b>2.748.640,52</b>	<b>1,33</b>		
<b>Total</b>			<b>4,62</b>	<b>0,42</b>	<b>1,23</b>	<b>206.267.127,60</b>	<b>100,00</b>		

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	98.515.984,21	47,76	15,00	35,00	70,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	47.161.995,89	22,86	0,00	35,00	65,00	0,00	65,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	11.355.222,57	5,51	0,00	4,00	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>157.033.202,67</b>	<b>76,13</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	22.920.509,73	11,11	0,00	10,00	35,00	0,00	35,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>22.920.509,73</b>	<b>11,11</b>					35,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	12.829.990,78	6,22	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>12.829.990,78</b>	<b>6,22</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	10.716.807,82	5,20	0,00	9,00	15,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	17.976,08	0,01	0,00	0,50	15,00	0,00	5,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>10.734.783,90</b>	<b>5,20</b>					15,00
<b>Fundos Imobiliários</b>								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	2.748.640,52	1,33	0,00	1,50	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Fundos Imobiliários</b>	<b>2.748.640,52</b>	<b>1,33</b>					5,00
<b>Total</b>		<b>206.267.127,60</b>	<b>100,00</b>					



**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	0,39 33,64	7,09 91,70	1,04 32,04	5,69 92,36	9,32 91,40	385.472,08	6.530.013,92
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,61 52,53	7,11 91,91	1,96 60,28	5,57 90,48		339.640,01	4.527.903,42
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,50 43,19	7,21 93,17	1,42 43,57	5,91 95,99		56.976,01	929.108,38
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	7,84 1,68	4,76 0,28	2,07 3,71	0,47 3,67		1.666.838,80	882.264,24
Artigo 9º III % do CDI	-4,46 -382,24	-33,57 -433,90	6,72 206,71	-15,34 -249,21	-26,60 -260,79	-599.351,12	-6.482.134,19
Artigo 10º I % do CDI	-3,22 -275,36	-12,19 -157,59	-1,71 -52,47	-5,39 -87,55		-355.997,28	-3.310.628,95
Artigo 10º II % do CDI	1,69 145,04	-44,46 -574,76	-0,82 -25,11	-43,94 -713,72		299,35	-14.390,62
Artigo 11º % do CDI	-16,22 -1.388,97	-18,84 -243,60	-22,62 -696,04	-19,12 -310,55		-533.583,18	-636.001,58
<b>DIADEMA (Total)</b>						<b>960.294,67</b>	<b>2.426.134,62</b>

**RESULTADO POR ATIVO**

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV IPCA I	18.159.617,12	0,00	0,00	0,00	18.377.549,24	217.932,12	1.583.703,03
BB PREV RF IDKA2	17.836.542,14	0,00	0,00	0,00	17.828.594,16	-7.947,98	1.036.768,48
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4.390.217,78	0,00	0,00	0,00	4.390.486,22	268,44	267.028,45
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	16.196.176,37	0,00	0,00	0,00	16.178.562,89	-17.613,48	913.772,05
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	25.159.468,14	0,00	0,00	0,00	25.157.862,75	-1.605,39	1.531.716,29
WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC	16.388.490,58	0,00	0,00	0,00	16.582.928,95	194.438,37	1.197.025,62
					98.515.984,21	0,00	0,00

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

**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	17.757.920,96	8.627.871,77	-17.445.535,57	0,00	9.116.606,35	176.349,19	2.074.182,01
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	23.725.688,02	0,00	0,00	0,00	23.720.908,70	-4.779,32	1.401.730,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	14.156.410,70	0,00	0,00	0,00	14.324.480,84	168.070,14	1.051.991,21
					47.161.995,89	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 Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	7.122.723,15	0,00	0,00	0,00	7.126.704,16	3.981,01	598.412,38
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	4.175.523,41	0,00	0,00	0,00	4.228.518,41	52.995,00	330.696,00
					11.355.222,57	0,00	0,00

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	4.617.781,98	0,00	0,00	0,00	4.893.613,98	275.832,00	-273.582,27
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	4.511.873,77	0,00	0,00	0,00	4.770.758,74	258.884,97	-20.315,99
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	3.675.581,99	0,00	0,00	0,00	4.088.177,43	412.595,44	88.177,43
OCCAM FIC FIA	4.526.860,71	0,00	0,00	0,00	4.848.546,86	321.686,15	475.604,49
TARPON GT 30 FIC FIA	3.921.572,48	0,00	0,00	0,00	4.319.412,72	397.840,24	612.380,58
					22.920.509,73	0,00	0,00

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	13.429.341,90	0,00	0,00	0,00	12.829.990,78	-599.351,12	-6.482.134,19
					12.829.990,78	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	11.072.805,10	0,00	0,00	0,00	10.716.807,82	-355.997,28	-3.310.628,95

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					10.716.807,82	0,00	0,00

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	17.676,73	0,00	0,00	0,00	17.976,08	299,35	-14.390,62
					17.976,08	0,00	0,00

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII	2.163.703,56	0,00	0,00	0,00	9.000,00	1.559.961,44	-594.742,12	-706.400,69
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11	1.138.770,14	0,00	0,00	0,00	11.250,00	1.188.679,08	61.158,94	70.399,11
						2.748.640,52	0,00	0,00

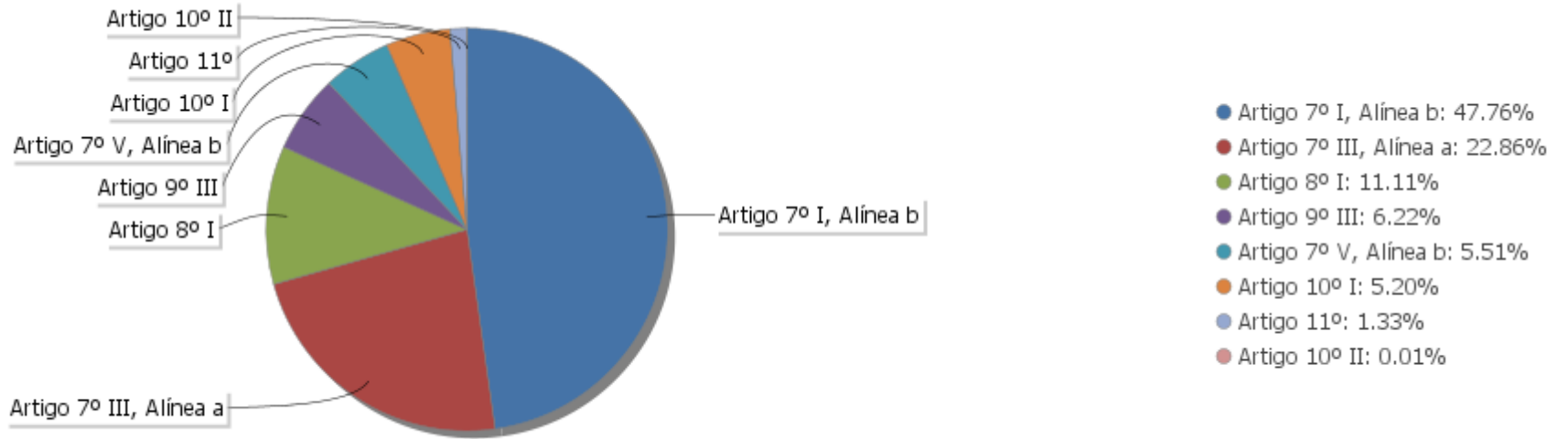
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

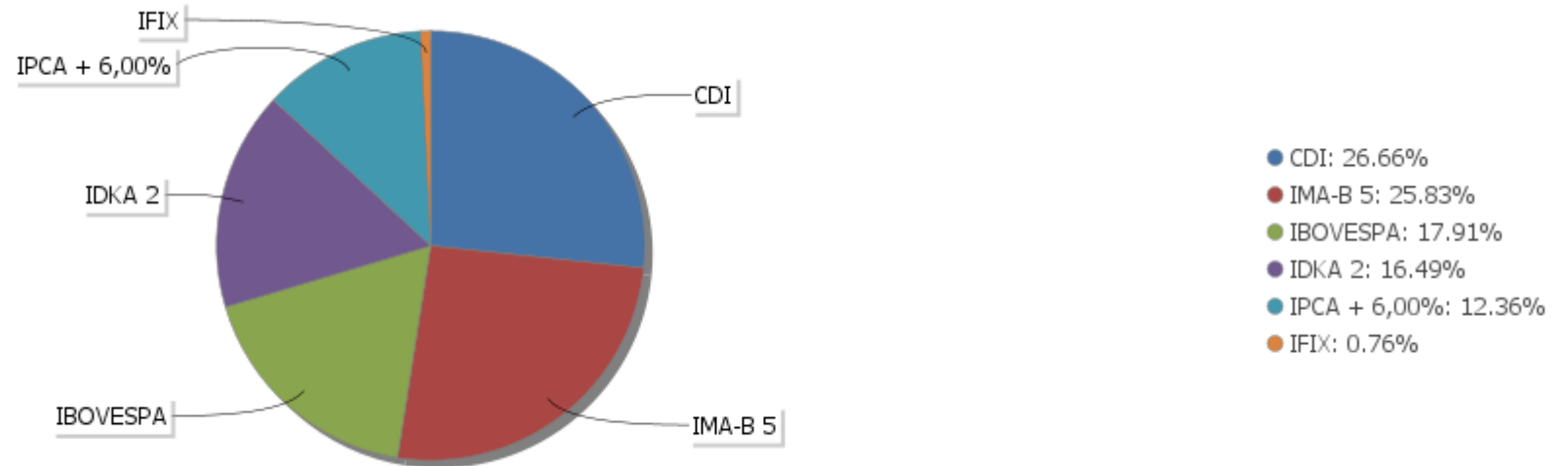
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	184.402.113,11	89,40	184.402.113,11	89,40
de 31 a 365 dias	13.178.348,89	6,39	197.580.462,00	95,79
acima de 365 dias	8.686.665,60	4,21	206.267.127,60	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

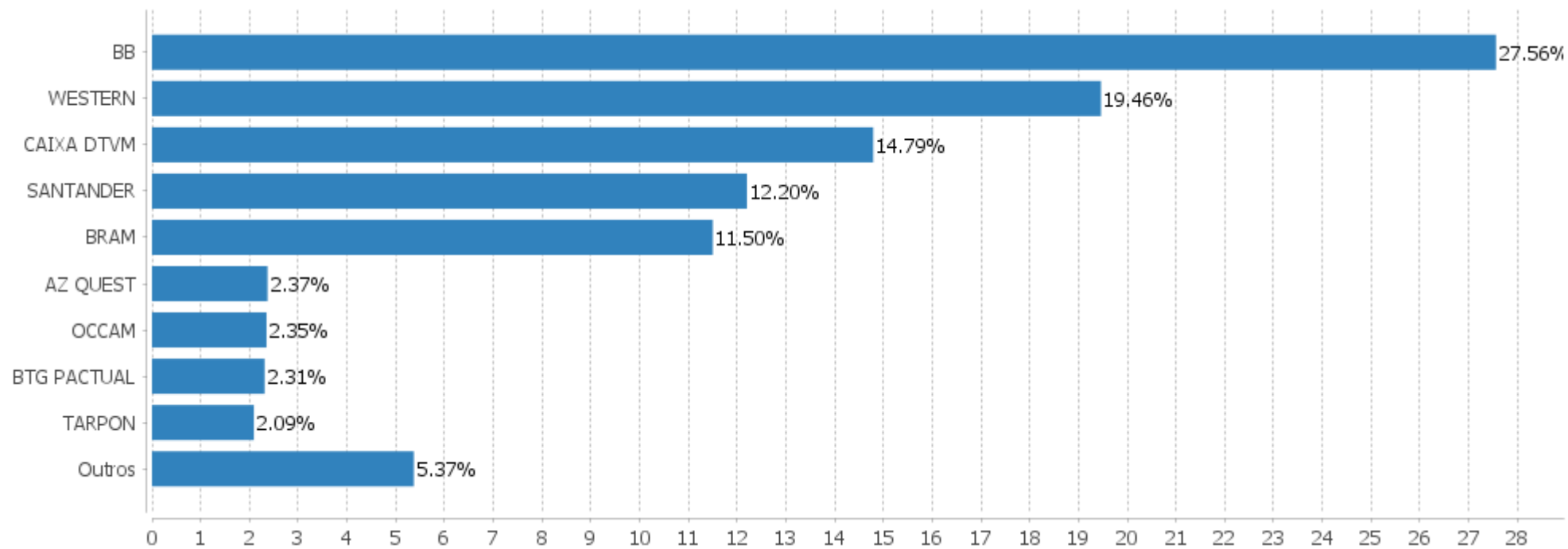


Alocação Por Estratégia



## 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					1,23
IPCA + 4,89%	0,94	1,37	2,04	1,42	0,89	1,07	-0,28	0,08					7,77
p.p. indexador	-1,82	-1,44	0,20	-2,97	-0,61	-2,06	2,12	0,35					-6,54
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

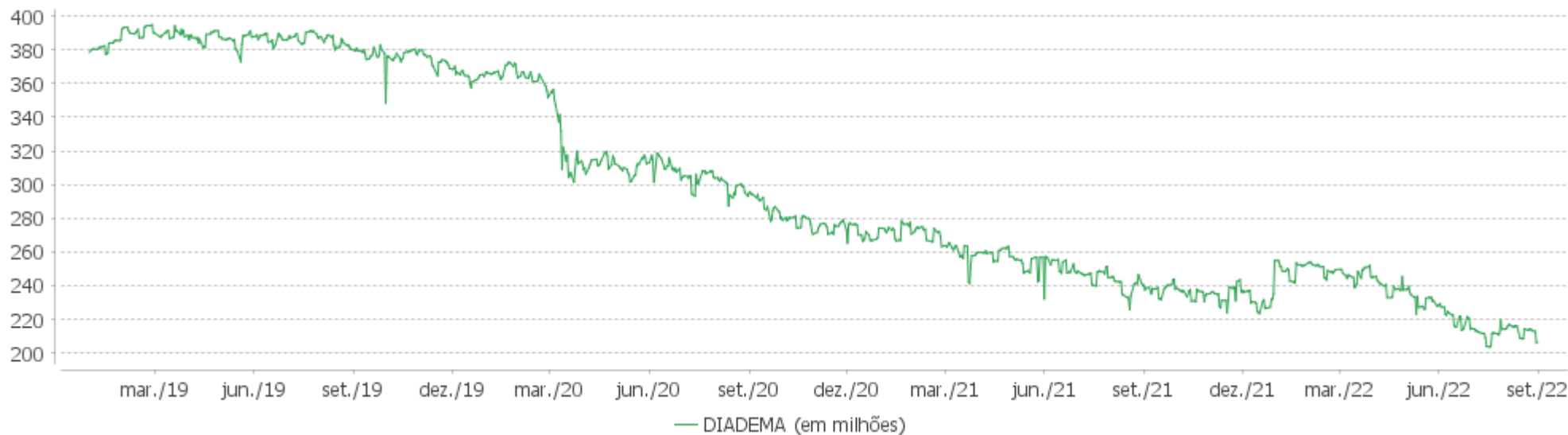
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	19	43,18	03 meses	1,25	0,86	0,39	4,24
Meses abaixo - Meta Atuarial	25	56,82	06 meses	2,20	5,32	-3,11	5,01
			12 meses	2,94	14,24	-11,31	4,62
			24 meses	9,14	32,27	-23,13	5,15
Maior rentabilidade da Carteira	3,93	2020-11	36 meses	13,24	43,52	-30,28	8,32
Menor rentabilidade da Carteira	-9,14	2020-03	Desde 31/12/2018	23,97	52,99	-29,02	7,66

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



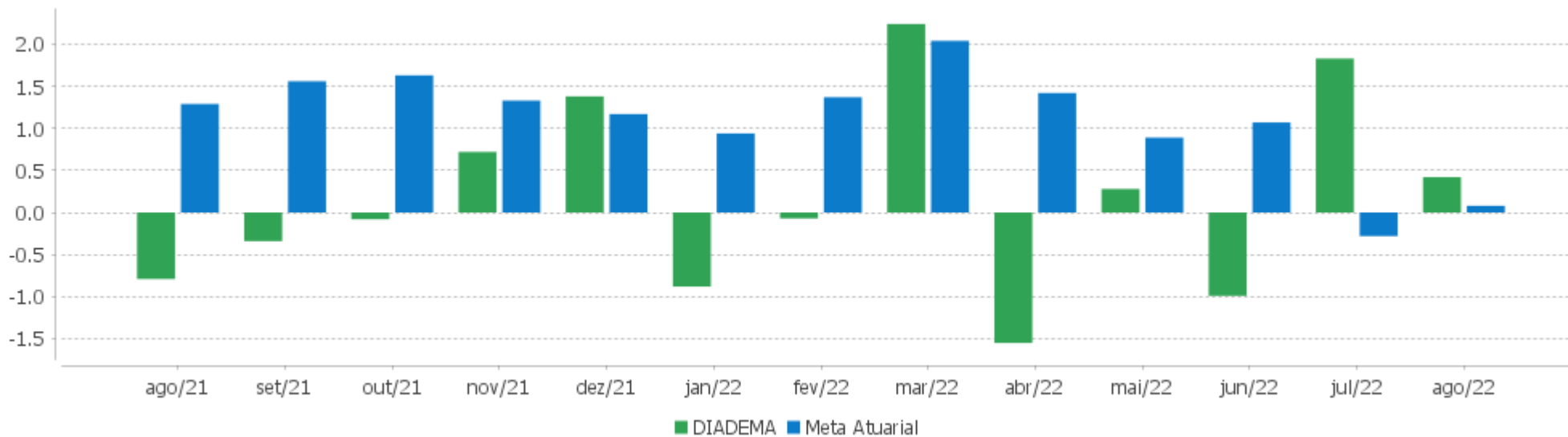
Patrimônio Líquido





EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No 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.	0,06 -0,12	6,24 -2,29	0,22 -0,91	5,13 -0,75	9,71 -5,54	14,56 -19,40	24,30 -21,16
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO % do CDI	1,27 108,70	8,48 109,68	3,49 107,40	6,68 108,45	11,43 112,05	17,24 130,81	16,73 95,24
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	-0,01 -0,01	6,48 -0,14	0,31 -0,04	5,28 -0,10	9,66 -0,22	14,64 -0,48	25,00 -0,75
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,20 1,03	9,39 0,87	2,36 1,23	7,56 1,68	12,85 -2,40	20,30 -13,66	31,86 -13,60
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	-0,04 0,32	6,17 -0,10	0,00 0,07	4,95 0,05	9,27 -0,16	14,82 -0,16	24,78 -1,36
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,01 0,01	6,48 -0,15	0,32 -0,02	5,28 -0,10	9,60 -0,28	14,55 -0,57	24,81 -0,95
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	-0,11 0,25	5,99 -0,29	-0,18 -0,11	4,77 -0,14	9,08 -0,34	14,35 -0,63	24,46 -1,68
WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC % do CDI	1,19 101,61	7,78 100,57	3,30 101,40	6,08 98,78	10,33 101,29	12,95 98,23	
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02 -0,02	6,28 -0,34	0,24 -0,10	5,11 -0,28	9,37 -0,51	13,52 -1,60	23,99 -1,77
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,18 101,35	7,90 102,10	3,28 100,92	6,21 100,89	10,49 102,80	13,56 102,88	17,44 99,27
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	1,19 101,68	7,93 102,46	3,29 101,22	6,21 100,92	10,55 103,42	13,60 103,23	17,42 99,18
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,74 -0,43	-0,42 -4,91	2,42 4,06	-3,15 0,05	-26,88 -19,08	-25,92 -36,14	-18,41 -26,71
TARPON GT 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	10,14 3,98	16,52 12,04	8,26 9,90	9,52 12,72	16,64 24,44	61,12 50,90	
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	11,23 5,06	8,76 4,27	2,93 4,58	7,67 10,87	7,92 15,71		
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,97 -0,19	-3,19 -7,67	-2,30 -0,65	-4,27 -1,07	-14,90 -7,11	-3,83 -14,04	2,07 -6,23
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	7,11 0,94	6,31 1,82	0,88 2,52	-1,24 1,96	-5,22 2,58	7,40 -2,82	8,06 -0,24
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	-4,46	-33,57	6,72	-15,34	-26,60	-15,12	50,92

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-10,63	-38,05	8,36	-12,14	-18,81	-25,34	42,63
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	-3,22 -275,36	-12,19 -157,59	-1,71 -52,47	-5,39 -87,55	-5,34 -52,40	23,41 177,64	45,10 256,78
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP % do CDI	1,69 145,04	-44,46 -574,76	-0,82 -25,11	-43,94 -713,72	125,32 1.228,58	58,88 446,82	-99,57 -566,84
BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII Var. IFIX p.p.	-27,49 -33,25	-31,15 -37,26	-35,49 -41,02	-31,84 -40,41	-14,03 -22,27	-5,25 -12,23	-10,41 -22,44
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11 Var. IBOVESPA p.p.	5,37 -0,79	6,19 1,70	4,94 6,58	7,26 10,46	9,72 17,52	3,18 -7,04	6,05 -2,25
DIADEMA Var. IPCA + 4,89% p.p.	0,42 0,35	1,23 -6,54	1,25 0,39	2,20 -3,11	2,94 -11,11	9,14 -22,03	13,24 -27,71
CDI	1,17	7,74	3,25	6,16	10,20	13,18	17,57
IBOVESPA	6,16	4,48	-1,64	-3,20	-7,79	10,22	8,29
INPC + 6,00%	0,22	8,80	1,22	6,02	15,36	34,99	47,30
IPCA + 6,00%	0,17	8,53	1,13	5,88	15,25	33,96	45,46

## 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 REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII	Não se aplica	Não se aplica				
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11	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
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
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	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du	de performance sera paga no(s) mes(es) de Janeiro	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 Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	1,23	7,40	3,25	5,94	9,04	11,48	17,12	25,79	34,47
IRF-M 1+	2,60	4,60	3,92	4,62	4,80	1,32	12,10	35,02	42,44
IRF-M TOTAL	2,05	5,49	3,60	4,96	6,17	4,85	13,97	32,97	40,86
IMA-B 5	0,00	6,62	0,35	5,38	9,88	15,12	25,75	43,90	53,48
IMA-B 5+	2,49	2,65	-0,51	4,31	1,44	3,27	8,13	49,44	53,36
IMA-B TOTAL	1,10	4,57	-0,15	4,78	5,54	8,99	16,23	48,22	54,99
IMA-GERAL TOTAL	1,40	6,45	2,32	5,44	7,87	9,89	17,04	35,56	43,86
IDKA 2	-0,36	6,28	-0,07	4,90	9,42	14,98	26,14	42,02	53,43
IDKA 20	5,45	-0,98	-1,32	2,60	-6,74	-6,09	-6,32	50,07	49,07
CDI	1,17	7,74	3,25	6,16	10,20	13,18	17,57	24,95	33,50

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,16	4,48	-1,64	-3,20	-7,79	10,22	8,29	42,84	54,62
IBRX 100	6,15	4,48	-2,00	-3,64	-8,18	10,99	9,74	48,00	58,88
IBRX 50	6,33	4,81	-1,81	-4,31	-7,38	13,10	10,63	42,79	55,02
SMALL CAP	10,90	-6,34	-2,42	-4,48	-22,25	-9,05	-3,57	45,68	42,28
IFIX	5,76	6,11	5,52	8,58	8,23	6,98	12,03	39,12	42,81
Índice Consumo - ICON	6,66		-0,20	-12,18	-31,25	-30,97	-26,99	10,55	-1,44
Índice Dividendos - IDIV	4,27	11,21	-2,58	5,93	4,28	24,51	19,98	80,27	80,79

**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	-0,36	4,39	-0,37	2,79	8,73	19,25	22,16	26,35	31,65
INPC	-0,31	4,65	-0,29	2,93	8,83	20,17	23,70	27,76	32,42
IGPM	-0,70	7,63	0,09	3,81	8,59	42,37	60,92	68,88	83,90
SELIC	1,17	7,74	3,25	6,16	10,20	13,18	17,57	24,95	33,51

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-4,42	-22,99	4,82	-9,10	-11,94	6,95	69,12	70,71	163,33
MSCI ACWI	-4,03	-24,62	2,86	-11,55	-16,72	-0,77	50,18	46,85	110,90

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	-0,00	7,16	0,64	4,86	13,08	28,96	37,39	47,72	60,02
IPCA + 5,00%	0,08	7,84	0,89	5,37	14,16	31,45	41,39	53,46	67,82
IPCA + 5,50%	0,13	8,19	1,01	5,63	14,71	32,70	43,41	56,39	71,84
IPCA + 5,89%	0,16	8,45	1,11	5,83	15,13	33,68	45,01	58,71	75,02
IPCA + 6,00%	0,17	8,53	1,13	5,88	15,25	33,96	45,46	59,36	75,93
INPC + 4,00%	0,05	7,43	0,72	5,00	13,18	29,95	39,12	49,37	60,95
INPC + 6,00%	0,22	8,80	1,22	6,02	15,36	34,99	47,30	61,15	76,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
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
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
<b>Total</b>			<b>8.627.871,77</b>	<b>17.445.535,57</b>		



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 4.955.180,25

Value-At-Risk: 2,40%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
DIADEMA		2,40	2,40			206.267.127,60	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,80%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC		0,06	0,00	0,05			16.582.928,95	8,04
BB PREV RF IDKA2		1,38	0,06	0,34			17.828.594,16	8,64
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI		1,12	0,07	0,01			25.157.862,75	12,20
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,49	0,06	0,44			16.178.562,89	7,84
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,10	0,01	0,03			4.390.486,22	2,13
BB PREV IPCA I		0,92	0,01	0,94			18.377.549,24	8,91
<b>Sub-total</b>	<b>1,86</b>	<b>0,91</b>	<b>0,20</b>		<b>-0,42</b>	<b>0,39</b>	<b>98.515.984,21</b>	<b>47,76</b>

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,04	0,00	0,03			14.324.480,84	6,94
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,04	0,00	0,02			9.116.606,35	4,42
BRAPRES INST FIC FI RF IMA-B 5		1,13	0,06	0,04			23.720.908,70	11,50
<b>Sub-total</b>	<b>1,24</b>	<b>0,57</b>	<b>0,06</b>		<b>-0,45</b>	<b>0,61</b>	<b>47.161.995,89</b>	<b>22,86</b>

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI		1,37	0,02	1,36			7.126.704,16	3,46
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO		0,03	0,00	0,03			4.228.518,41	2,05

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
<b>Sub-total</b>	2,08	0,86	0,02		-0,32	0,50	11.355.222,57	5,51

**Renda Variável**

Value-At-Risk: 8,37%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		8,11	0,16	5,24			4.893.613,98	2,37
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		10,08	0,20	6,11			4.770.758,74	2,31
OCCAM FIC FIA		9,22	0,15	2,44			4.848.546,86	2,35
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA		10,01	0,15	6,47			4.088.177,43	1,98
TARPON GT 30 FIC FIA		9,19	0,14	7,74			4.319.412,72	2,09
<b>Sub-total</b>	18,01	8,37	0,79		0,37	7,84	22.920.509,73	11,11

**Investimentos no Exterior**

Value-At-Risk: 13,47%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I		13,47	0,64	13,71			12.829.990,78	6,22
<b>Sub-total</b>	25,92	13,47	0,64		-0,22	-4,46	12.829.990,78	6,22

**Investimentos Estruturados**

Value-At-Risk: 14,56%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO		14,58	0,69	14,58			10.716.807,82	5,20
<b>Sub-total</b>	18,99	14,58	0,69		-0,23	-3,22	10.716.807,82	5,20

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP		2,65	0,00	2,65			17.976,08	0,01
	5,56	2,65	0,00		0,09	1,69	17.976,08	0,01

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
<b>Sub-total</b>								
<b>Fundos Imobiliários</b>								<b>Value-At-Risk: 1,09%</b>
Artigo 11º								
Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11		0,23	0,00	9,99			1.188.679,08	0,58
BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII		1,91	-0,00	2,91			1.559.961,44	0,76
<b>Sub-total</b>	65,20	1,09	-0,00		-0,27	-16,22	2.748.640,52	1,33