



LDB
EMPRESAS

DIADEMA
FEVEREIRO 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 25.02.2022.

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 73,51%

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
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,63	1,16	1,17	16.987.689,89	6,81	9.012.864.987,26	0,19
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,74	1,05	1,15	23.896.808,88	9,58	1.207.319.730,40	1,98
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,75	1,15	1,17	15.442.668,25	6,19	10.680.932.817,60	0,14
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,77	1,05	1,13	4.170.134,66	1,67	6.375.804.434,87	0,07
BB	BB	BB PREV IPCA I	1,66	1,13	1,71	17.085.864,91	6,85	518.702.341,68	3,29
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,66	1,11	1,28	77.583.166,59	31,10		

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	0,22	0,82	1,61	13.486.502,32	5,41	10.660.917.138,14	0,13
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,17	0,80	1,59	39.523.723,03	15,84	7.639.104.845,31	0,52
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,85	1,04	1,12	22.568.748,78	9,05	1.292.134.068,48	1,75
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC	0,19	0,82	1,60	15.632.256,39	6,27	1.168.438.844,18	1,34
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,55	0,86	1,48	91.211.230,52	36,56		

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	3,21	1,02	1,05	10.638.977,92	4,26	614.226.993,42	1,73
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	0,28	0,90	1,69	3.963.860,15	1,59	791.197.374,19	0,50
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			1,83	0,99	1,23	14.602.838,07	5,85		
Renda Fixa			2,56	0,97	1,38	183.397.235,18	73,51		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

10,05%

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	17,37	-1,47	1,13	8.259.237,88	3,31	1.428.707.503,72	0,58
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	24,10	-2,08	2,82	4.925.947,86	1,97	1.853.554.335,79	0,27
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	18,25	1,05	7,64	7.936.102,65	3,18	1.097.636.218,28	0,72
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT 30 FIC FIA	17,68	4,98	6,39	3.943.812,62	1,58	429.115.559,21	0,92
Sub-total Artigo 8º I			16,05	0,16	4,27	25.065.101,01	10,05		
Renda Variável			13,45	0,16	4,27	25.065.101,01	10,05		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

6,07%

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	20,54	-8,91	-21,52	15.155.313,63	6,07	2.929.429.687,57	0,52
Sub-total Artigo 9º III			20,54	-8,91	-21,52	15.155.313,63	6,07		
Investimentos no Exterior			20,21	-8,91	-21,52	15.155.313,63	6,07		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

8,95%

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	14,34	-2,09	-7,19	22.300.468,66	8,94	2.009.407.146,67	1,11
Sub-total Artigo 10º I			14,34	-2,09	-7,19	22.300.468,66	8,94		

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	142,62	-1,08	-0,93	32.066,77	0,01	4.457.194,50	0,72
Sub-total Artigo 10º II			142,62	-1,08	-0,93	32.066,77	0,01		

Investimentos Estruturados			19,74	-2,09	-7,18	22.332.535,43	8,95		
-----------------------------------	--	--	--------------	--------------	--------------	----------------------	-------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

1,41%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
RIO BRAVO	BB	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	30,28	0,40	1,01	2.357.991,49	0,95	64.937.296,84	3,63
BRPP	GENIAL	BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	10,08	-0,65	0,31	1.168.752,68	0,47	350.027.870,92	0,33
Sub-total Artigo 11º			4,98	0,05	0,79	3.526.744,17	1,41		
Fundos Imobiliários			4,98	0,05	0,79	3.526.744,17	1,41		
Total			4,48	-0,07	-0,95	249.476.929,42	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	77.583.166,59	31,10	15,00	35,00	70,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	91.211.230,52	36,56	0,00	35,00	65,00	0,00	65,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	14.602.838,07	5,85	0,00	4,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	183.397.235,18	73,51					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	25.065.101,01	10,05	0,00	10,00	35,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	25.065.101,01	10,05					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	15.155.313,63	6,07	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	15.155.313,63	6,07					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	22.300.468,66	8,94	0,00	9,00	15,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	32.066,77	0,01	0,00	0,50	15,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	22.332.535,43	8,95					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	3.526.744,17	1,41	0,00	1,50	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	3.526.744,17	1,41					5,00

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	1,11 147,91	1,28 85,91	1,99 87,98	3,39 88,90	3,92 69,45	854.204,28	983.099,63
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,86 114,60	1,48 99,61				784.605,99	1.329.184,03
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,99 132,35	1,23 82,36				143.442,63	176.723,88
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	0,16 -0,73	4,27 -3,66				40.945,51	1.026.855,52
Artigo 9º III % do CDI	-8,91 -1.188,44	-21,52 -1.447,17	-21,77 -962,44	-13,30 -349,14		-1.482.103,05	-4.156.811,34
Artigo 10º I % do CDI	-2,09 -278,70	-7,19 -483,24				-475.814,85	-1.726.968,11
Artigo 10º II % do CDI	-1,08 -143,99	-0,93 -62,30				-349,87	-299,93
Artigo 11º % do CDI	0,05 7,01	0,79 52,92				1.953,68	28.852,07
DIADEMA (Total)						-133.115,68	-2.339.364,25

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	17.379.424,52	0,00	-487.293,39	0,00	17.085.864,91	193.733,78	292.018,70
BB PREV RF IDKA2	16.793.442,99	0,00	0,00	0,00	16.987.689,89	194.246,90	195.864,21
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4.126.625,12	0,00	0,00	0,00	4.170.134,66	43.509,54	46.676,89
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	15.267.662,57	0,00	0,00	0,00	15.442.668,25	175.005,68	177.877,41
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	23.649.100,50	0,00	0,00	0,00	23.896.808,88	247.708,38	270.662,42
					77.583.166,59	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	42.413.543,54	12.368.678,31	-15.574.231,20	0,00	39.523.723,03	315.732,38	619.248,00
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	22.335.967,01	0,00	0,00	0,00	22.568.748,78	232.781,77	249.570,28
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	13.376.935,65	0,00	0,00	0,00	13.486.502,32	109.566,67	214.012,69
WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC	15.505.731,22	0,00	0,00	0,00	15.632.256,39	126.525,17	246.353,06
					91.211.230,52	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	10.531.036,24	0,00	0,00	0,00	10.638.977,92	107.941,68	110.686,14
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	3.928.359,20	0,00	0,00	0,00	3.963.860,15	35.500,95	66.037,74
					14.602.838,07	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	8.382.755,34	0,00	0,00	0,00	8.259.237,88	-123.517,46	92.041,63
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	5.030.800,18	0,00	0,00	0,00	4.925.947,86	-104.852,32	134.873,13
OCCAM FIC FIA	7.853.787,32	0,00	0,00	0,00	7.936.102,65	82.315,33	563.160,28
TARPON GT 30 FIC FIA	3.756.812,66	0,00	0,00	0,00	3.943.812,62	186.999,96	236.780,48
					25.065.101,01	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	16.637.416,68	0,00	0,00	0,00	15.155.313,63	-1.482.103,05	-4.156.811,34
					15.155.313,63	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	22.776.283,51	0,00	0,00	0,00	22.300.468,66	-475.814,85	-1.726.968,11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					22.300.468,66	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	32.416,64	0,00	0,00	0,00	32.066,77	-349,87	-299,93
					32.066,77	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 RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	2.363.426,58	0,00	0,00	0,00	15.000,00	2.357.991,49	9.564,91	24.629,36
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11	1.185.363,91	0,00	0,00	0,00	9.000,00	1.168.752,68	-7.611,23	4.222,71
						3.526.744,17	0,00	0,00

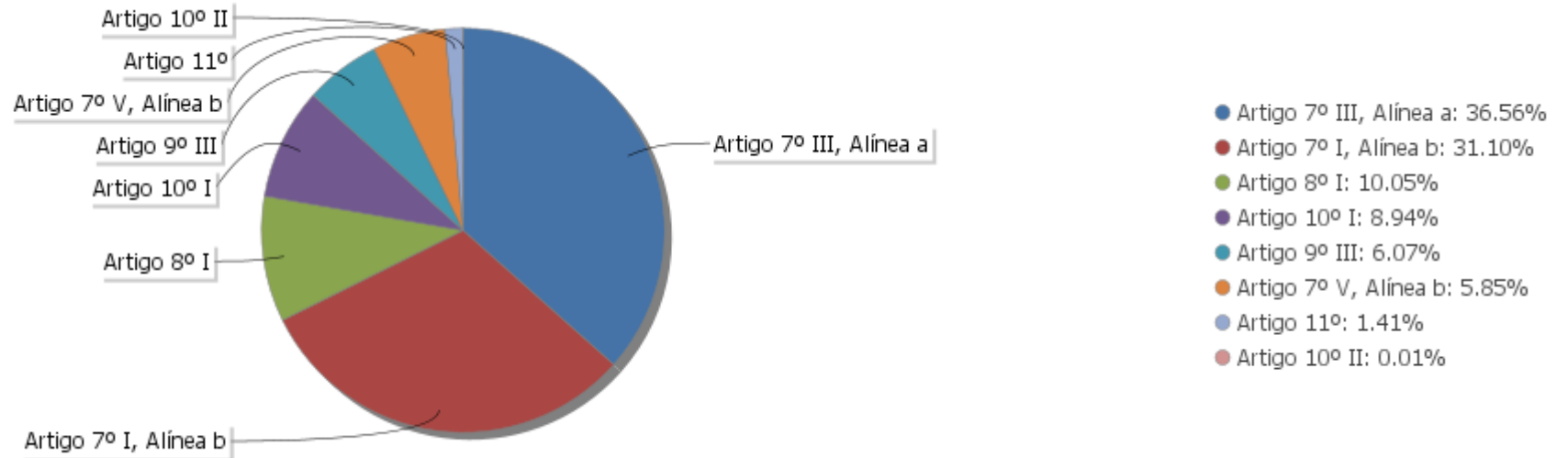
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

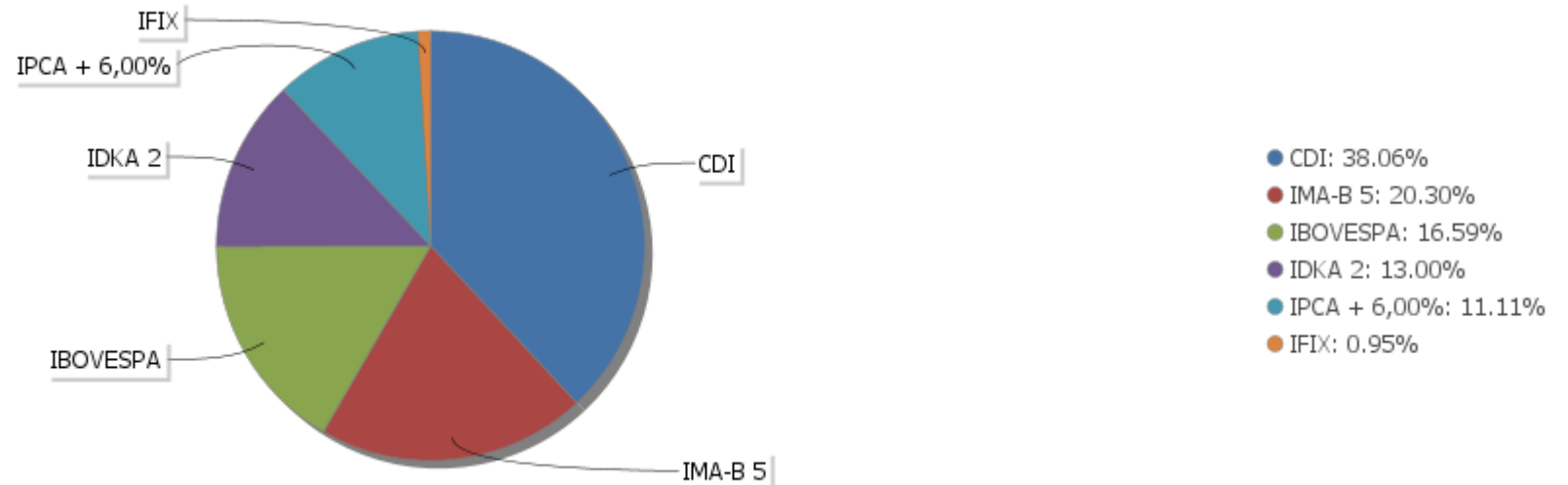
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	214.468.147,24	85,97	214.468.147,24	85,97
de 31 a 365 dias	22.011.812,77	8,82	236.479.960,01	94,79
acima de 365 dias	12.996.969,41	5,21	249.476.929,42	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

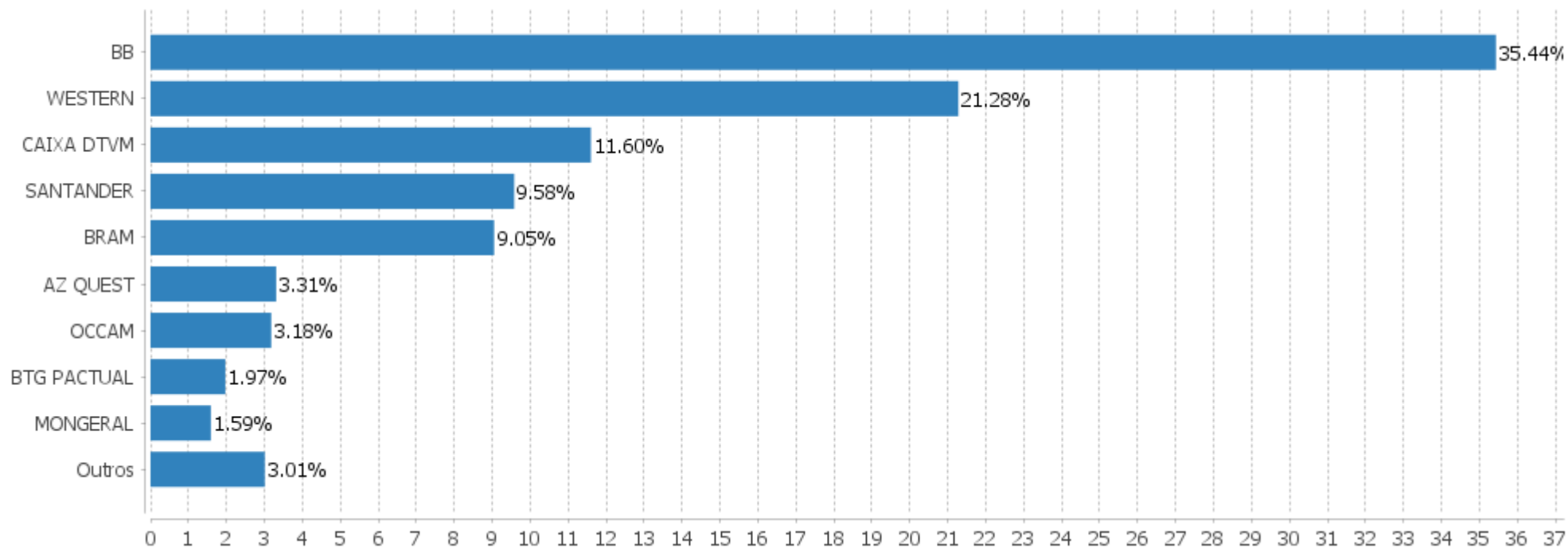


Alocação Por Estratégia



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											-0,95
IPCA + 4,93%	0,94	1,38											2,33
p.p. indexador	-1,82	-1,45											-3,28
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

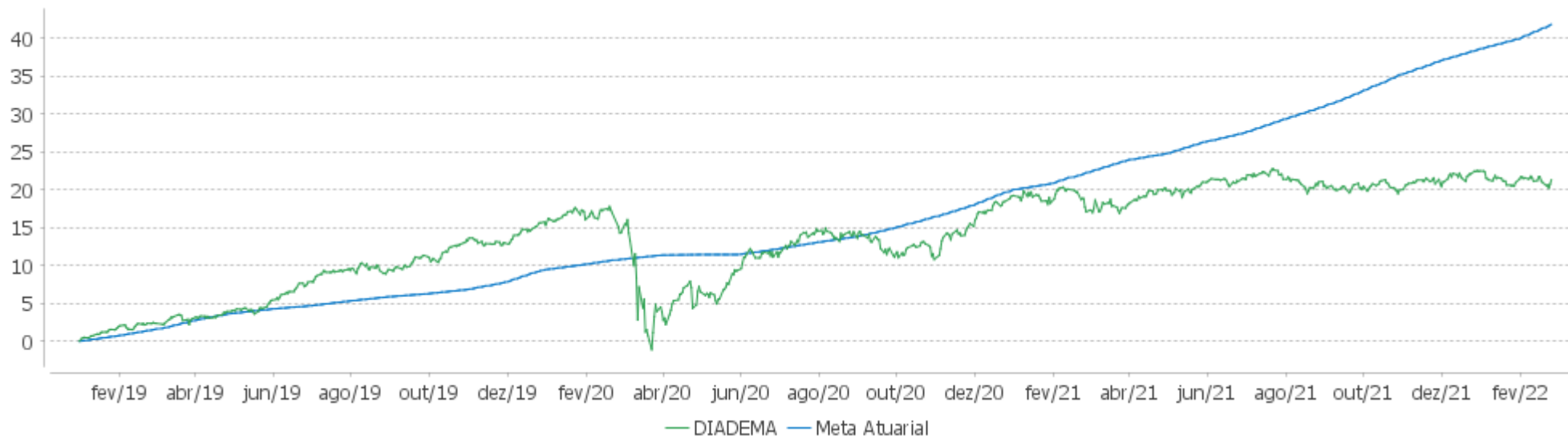
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	16	42,11	03 meses	0,42	3,58	-3,16	4,30
Meses abaixo - Meta Atuarial	22	57,89	06 meses	0,72	8,48	-7,76	4,20
			12 meses	3,61	16,49	-12,88	4,48
			24 meses	6,10	29,58	-23,48	9,61
Maior rentabilidade da Carteira	3,93	2020-11	36 meses	18,48	42,80	-24,32	8,21
Menor rentabilidade da Carteira	-9,14	2020-03	Desde 31/12/2018	21,31	45,27	-23,97	8,01

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

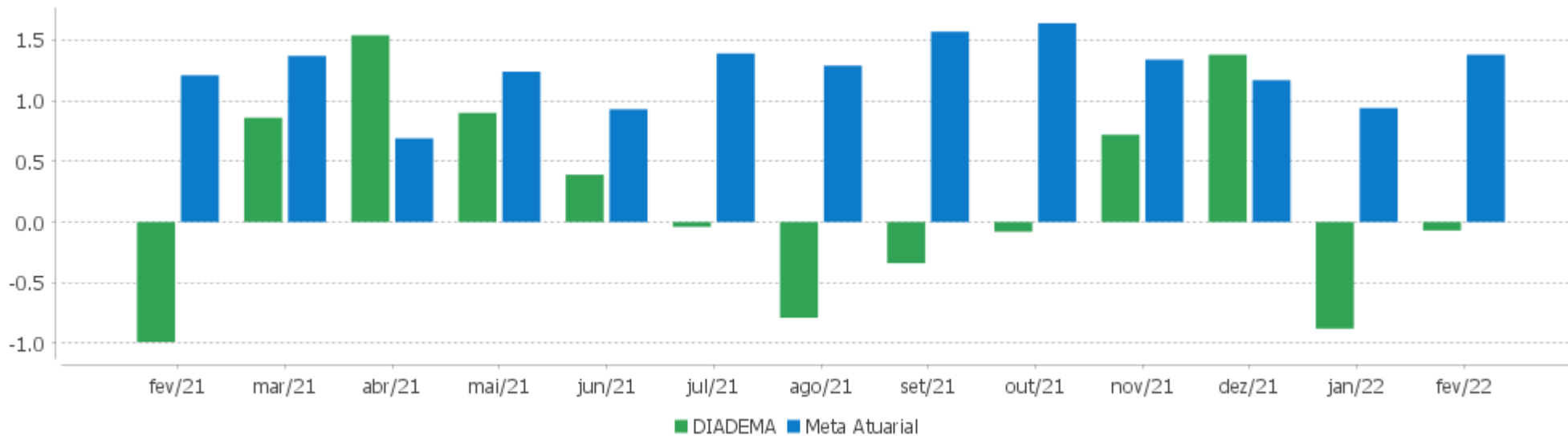


Patrimônio Líquido



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.	1,02 -0,43	1,05 -1,45	1,91 -1,88	4,35 -4,50	6,21 -11,00	12,25 -18,35	24,80 -19,15
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO % do CDI	0,90 120,56	1,69 113,91	2,55 112,87	4,46 116,96	7,54 133,47	7,85 96,23	12,90 90,89
BRANCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	1,04 -0,02	1,12 -0,06	1,90 -0,08	4,06 -0,21	5,68 -0,64	11,70 -1,24	25,08 -1,61
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,80 106,50	1,59 106,76	2,40 106,07	4,02 105,65	6,01 106,40	8,16 100,10	13,93 98,13
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,82 109,27	1,61 108,41	2,38 105,17	4,08 107,18	6,03 106,73	8,15 99,97	13,91 98,05
WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC % do CDI	0,82 108,86	1,60 107,65	2,37 104,74	4,01 105,20	5,96 105,47		
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,05 -0,02	1,15 -0,03	1,92 -0,05	4,16 -0,10	6,09 -0,23	12,50 -0,44	25,90 -0,78
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,13 -0,32	1,71 -0,79	2,30 -1,49	4,92 -3,93	8,15 -9,05	15,93 -14,67	30,95 -12,99
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,16 -0,10	1,17 -0,14	1,88 -0,27	4,11 -0,20	6,26 -0,44	13,10 -1,02	24,76 -2,13
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,15 -0,11	1,17 -0,14	1,89 -0,26	4,12 -0,19	6,30 -0,40	13,18 -0,93	24,90 -1,99
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,05 -0,01	1,13 -0,04	1,90 -0,07	4,10 -0,17	6,00 -0,32	12,29 -0,65	25,72 -0,96
BGT PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,08 -2,97	2,82 -5,12	2,11 -8,91	-24,50 -19,75	-27,60 -30,43	-20,16 -28,77	-0,27 -18,64
TARPON GT 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	4,98 4,09	6,39 -1,55	16,05 5,03	6,50 11,25	22,45 19,63	62,96 54,35	
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-1,47 -2,36	1,13 -6,81	3,47 -7,55	-11,11 -6,36	-7,61 -10,43	-11,59 -20,20	28,08 9,71
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	1,05 0,16	7,64 -0,30	11,40 0,38	-4,03 0,72	0,33 -2,50	10,91 2,30	27,43 9,06
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	-8,91 -9,80	-21,52 -29,46	-21,77 -32,79	-13,30 -8,55	-3,58 -6,40	59,64 51,03	113,99 95,62
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	-1,08	-0,93	311,79	301,94	242,78	-98,74	-99,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Varição da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	-143,99	-62,30	13.782,30	7.926,36	4.298,86	-1.211,15	-699,26
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-2,09	-7,19	-2,09	0,05	19,92	48,53	63,83
% do CDI	-278,70	-483,24	-92,50	1,27	352,78	595,26	449,79
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	0,40	1,01	3,46	26,12	11,97	21,22	21,94
Var. IFIX p.p.	1,69	3,28	-2,85	26,43	17,01	28,73	9,35
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11	-0,65	0,31	8,03	3,65	-0,75	-9,43	7,04
Var. IBOVESPA p.p.	-1,54	-7,63	-2,99	8,39	-3,57	-18,04	-11,33
DIADEMA	-0,07	-0,95	0,42	0,72	3,61	6,10	18,48
Var. IPCA + 4,93% p.p.	-1,45	-3,28	-3,11	-7,58	-12,40	-21,89	-21,17
CDI	0,75	1,49	2,26	3,81	5,65	8,15	14,19
IBOVESPA	0,89	7,94	11,02	-4,75	2,82	8,61	18,37
INPC + 6,00%	1,44	2,62	3,92	8,81	17,47	32,17	45,56
IPCA + 6,00%	1,45	2,50	3,80	8,85	17,20	30,60	43,95

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 RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	Não se aplica	Não se aplica				
BRANCO 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
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+0			O fundo cobrará 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	0,74	1,38	2,27	2,93	4,26	7,47	14,48	22,35	34,40
IRF-M 1+	0,48	-0,02	2,26	0,18	-1,69	1,08	15,45	28,42	46,68
IRF-M TOTAL	0,58	0,50	2,40	1,16	0,48	3,51	15,79	27,30	43,94
IMA-B 5	1,06	1,18	1,97	4,26	6,32	12,94	26,68	39,47	55,81
IMA-B 5+	0,01	-1,60	-1,93	-2,75	-4,23	-3,33	17,98	38,31	53,22
IMA-B TOTAL	0,54	-0,19	0,03	0,73	0,92	4,12	22,86	40,19	55,41
IMA-GERAL TOTAL	0,74	0,95	1,83	2,30	2,88	6,29	18,28	30,05	44,43
IDKA 2	1,26	1,31	2,15	4,31	6,70	14,12	26,89	39,82	57,21
IDKA 20	-0,58	-3,49	-5,69	-9,10	-12,75	-14,41	8,86	34,44	45,63
CDI	0,75	1,49	2,26	3,81	5,65	8,15	14,19	21,51	32,41

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,89	7,94	11,02	-4,75	2,82	8,61	18,37	32,56	69,72
IBRX 100	1,46	8,43	11,83	-4,71	2,87	9,99	22,25	38,00	76,75
IBRX 50	1,74	9,53	13,65	-3,21	4,78	13,29	20,78	33,87	72,89
SMALL CAP	-5,19	-1,95	1,77	-18,60	-13,32	-11,41	20,21	34,33	77,03
IFIX	-1,29	-2,27	6,31	-0,32	-5,04	-7,51	12,59	18,59	35,11
Índice Consumo - ICON	-2,51		-0,33	-21,72	-21,21	-20,40	7,27	6,67	33,15
Índice Dividendos - IDIV	-2,32	4,98	6,66	-1,56	9,19	5,34	28,12	49,91	76,56

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	1,01	1,56	2,30	5,77	10,54	16,29	20,94	25,65	29,22
INPC	1,00	1,68	2,42	5,73	10,80	17,68	22,30	27,12	29,42
IGPM	1,83	3,68	4,59	4,61	16,12	49,73	59,94	72,10	71,38
SELIC	0,75	1,49	2,26	3,81	5,65	8,15	14,19	21,52	32,43

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	-6,85	-15,28	-12,20	-3,13	6,92	69,56	116,47	155,90	207,13
MSCI ACWI	-6,59	-14,77	-12,07	-5,84	-1,21	55,63	90,73	113,55	160,11

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,31	2,19	3,30	7,83	14,98	25,74	35,98	46,92	57,07
IPCA + 5,00%	1,38	2,35	3,55	8,34	16,09	28,16	39,93	52,64	64,73
IPCA + 5,50%	1,42	2,42	3,68	8,60	16,65	29,37	41,93	55,56	68,67
IPCA + 5,89%	1,45	2,48	3,77	8,79	17,08	30,33	43,50	57,86	71,80
IPCA + 6,00%	1,45	2,50	3,80	8,85	17,20	30,60	43,95	58,52	72,69
INPC + 4,00%	1,30	2,31	3,43	7,79	15,25	27,25	37,51	48,64	57,31
INPC + 6,00%	1,44	2,62	3,92	8,81	17,47	32,17	45,56	60,37	72,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
914	04/02/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	45.000,00	18.512,02158400	2,4308528270
909	04/02/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.304.436,39	536.616,76902500	2,4308528270
915	07/02/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	4.112,21371300	2,4317802280
910	07/02/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	356.618,31	146.649,07046000	2,4317802280
921	07/02/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	125.770,79	0,00	51.719,63673000	2,4317802280
916	14/02/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.000,00	1.641,56001900	2,4367065190
917	15/02/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	60.000,00	24.611,97591500	2,4378375880
906	15/02/2022	BB PREV IPCA I	0,00	487.293,39	185.302,17603200	2,6297229770
911	15/02/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	7.021.683,73	2.880.291,84739900	2,4378375880
912	16/02/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	358.338,06	146.927,91399200	2,4388698530
907	18/02/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	5.998.987,58	0,00	2.457.594,94409500	2,4409993170
918	23/02/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	4.090,92234600	2,4444365240
919	24/02/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.000,00	2.044,61966100	2,4454425900
920	25/02/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	235.000,00	96.057,91491400	2,4464407770
913	25/02/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.164.154,71	2.519.641,90915700	2,4464407770
908	25/02/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	6.243.919,94	0,00	2.552.246,51203500	2,4464407770
Total			12.368.678,31	16.061.524,59		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 4.697.883,22

Value-At-Risk: 1,88%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
DIADEMA		1,88	1,88			249.476.929,42	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,70%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IDKA2		1,35	0,03	0,37			16.987.689,89	6,81
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI		1,17	0,04	0,01			23.896.808,88	9,58
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,60	0,03	0,25			15.442.668,25	6,19
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,16	0,01	0,03			4.170.134,66	1,67
BB PREV IPCA I		0,77	0,01	0,78			17.085.864,91	6,85
Sub-total	1,89	1,14	0,12		0,19	1,11	77.583.166,59	31,10

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		0,07	0,00	0,06			13.486.502,32	5,41
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,06	0,00	0,03			39.523.723,03	15,84
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5		1,16	0,04	0,03			22.568.748,78	9,05
WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC		0,04	-0,00	0,02			15.632.256,39	6,27
Sub-total	0,54	0,31	0,04		0,20	0,86	91.211.230,52	36,56

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI		1,20	0,02	1,21			10.638.977,92	4,26
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO		0,07	0,00	0,06			3.963.860,15	1,59

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	1,96	0,88	0,02		0,12	0,99	14.602.838,07	5,85

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,05%

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		8,83	0,20	5,78			8.259.237,88	3,31
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		16,86	0,20	10,16			4.925.947,86	1,97
OCCAM FIC FIA		8,15	0,15	3,25			7.936.102,65	3,18
TARPON GT 30 FIC FIA		7,67	0,07	7,52			3.943.812,62	1,58
Sub-total	11,48	9,05	0,61		-0,05	0,16	25.065.101,01	10,05

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 8,68%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO		8,70	0,66	8,70			22.300.468,66	8,94
Sub-total	22,01	8,70	0,66		-0,13	-2,09	22.300.468,66	8,94

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP		6,41	0,00	6,41			32.066,77	0,01
Sub-total	3,95	6,41	0,00		-0,46	-1,08	32.066,77	0,01

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 11,41%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I		11,41	0,43	15,73			15.155.313,63	6,07
Sub-total	34,27	11,41	0,43		-0,28	-8,91	15.155.313,63	6,07

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 1,23%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO		1,04	-0,00	3,62			2.357.991,49	0,95
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11		3,02	0,00	10,00			1.168.752,68	0,47
Sub-total	2,24	1,23	-0,00		-0,31	0,05	3.526.744,17	1,41