



LDB
EMPRESAS

DIADEMA
JUNHO 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 30.06.2022.

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 78,60%

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	2,59	0,27	6,46	17.876.029,06	8,35	9.717.321.383,29	0,18
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,58	0,32	6,50	25.161.304,16	11,75	1.328.159.744,16	1,89
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,67	0,22	6,41	16.243.682,40	7,58	11.226.926.091,22	0,14
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,61	0,32	6,47	4.390.349,99	2,05	6.996.220.208,06	0,06
BB	BB	BB PREV IPCA I	1,69	0,32	7,21	18.010.311,81	8,41	546.767.222,62	3,29
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,39	0,29	6,63	81.681.677,42	38,13		

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	0,20	1,06	5,60	14.015.291,89	6,54	12.613.402.228,26	0,11
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,18	1,03	5,54	21.432.995,79	10,01	9.838.414.136,64	0,22
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,61	0,28	6,31	23.728.609,77	11,08	1.352.871.181,17	1,75
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC	0,17	1,04	5,42	16.220.115,37	7,57	1.369.472.106,39	1,18
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,67	0,82	5,76	75.397.012,82	35,20		

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	2,90	0,34	6,36	7.135.118,34	3,33	631.676.972,36	1,13
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	0,21	1,09	5,96	4.130.289,09	1,93	970.577.086,20	0,43
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			1,95	0,61	6,36	11.265.407,43	5,26		
Renda Fixa			2,04	0,56	6,20	168.344.097,67	78,60		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

9,33%

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	17,34	-11,16	-11,97	4.449.717,10	2,08	1.032.154.255,89	0,43
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	24,94	-10,74	-13,21	4.158.068,20	1,94	1.325.317.998,19	0,31
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	18,87	-8,92	-4,02	4.377.695,05	2,04	914.122.528,22	0,48
GUEPARDO	DAYCOVAL	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	23,92	-13,75	-14,36	3.425.466,82	1,60	115.519.115,57	2,97
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT 30 FIC FIA	18,48	-10,38	-3,54	3.575.649,48	1,67	432.625.672,05	0,83
Sub-total Artigo 8º I			17,14	-11,00	-8,65	19.986.596,65	9,33		
Renda Variável			15,23	-11,00	-8,65	19.986.596,65	9,33		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

5,68%

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	24,52	1,16	-37,02	12.162.141,63	5,68	1.869.646.059,30	0,65
Sub-total Artigo 9º III			24,52	1,16	-37,02	12.162.141,63	5,68		
Investimentos no Exterior			24,52	1,16	-37,02	12.162.141,63	5,68		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

4,70%

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	19,96	-7,76	-17,60	10.056.305,18	4,70	1.345.144.413,16	0,75
Sub-total Artigo 10º I			19,96	-7,76	-17,60	10.056.305,18	4,70		

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	-1,85	-45,04	17.788,53	0,01	2.255.009,57	0,79
Sub-total Artigo 10º II			184,72	-1,85	-45,04	17.788,53	0,01		

Investimentos Estruturados			25,00	-7,75	-17,63	10.074.093,71	4,70		
-----------------------------------	--	--	--------------	--------------	---------------	----------------------	-------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

1,69%

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	9,29	-0,46	0,72	1.150.209,53	0,54	344.474.413,13	0,33
RIO BRAVO	BB	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	30,38	1,53	8,38	2.474.635,47	1,16	51.224.954,10	4,83
Sub-total Artigo 11º			4,19	0,89	5,82	3.624.845,00	1,69		
Fundos Imobiliários			4,19	0,89	5,82	3.624.845,00	1,69		
Total			4,61	-0,99	-1,01	214.191.774,66	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	81.681.677,42	38,13	15,00	35,00	70,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	75.397.012,82	35,20	0,00	35,00	65,00	0,00	65,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	11.265.407,43	5,26	0,00	4,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	168.344.097,67	78,60					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	19.986.596,65	9,33	0,00	10,00	35,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	19.986.596,65	9,33					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	12.162.141,63	5,68	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	12.162.141,63	5,68					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	10.056.305,18	4,70	0,00	9,00	15,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	17.788,53	0,01	0,00	0,50	15,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	10.074.093,71	4,70					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	3.624.845,00	1,69	0,00	1,50	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	3.624.845,00	1,69					5,00
Total		214.191.774,66	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,29 28,47	6,63 122,71	2,68 92,09	6,63 122,71	8,11 93,73	235.012,71	5.081.610,46
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,82 80,55	5,76 106,69	2,81 96,74	5,76 106,69		656.483,99	4.699.836,25
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,61 60,57	6,36 117,74	2,78 95,77	6,36 117,74		68.740,30	839.293,24
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-11,00 0,50	-8,65 -2,66	-16,79 1,09	-8,65 -2,66		-2.532.206,76	-2.051.648,84
Artigo 9º III % do CDI	1,16 114,84	-37,02 -685,43	-16,57 -569,97	-37,02 -685,43	-24,11 -278,56	139.939,47	-7.149.983,34
Artigo 10º I % do CDI	-7,76 -765,99	-17,60 -325,88	-15,11 -519,81	-17,60 -325,88		-846.454,25	-3.971.131,59
Artigo 10º II % do CDI	-1,85 -182,63	-45,04 -833,86	8,84 304,23	-45,04 -833,86		-335,48	-14.578,17
Artigo 11º % do CDI	0,89 88,25	5,82 107,83	2,90 99,65	5,82 107,83		32.228,74	203.452,90
DIADEMA (Total)						-2.246.591,28	-2.363.149,09

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	17.953.553,82	0,00	0,00	0,00	18.010.311,81	56.757,99	1.216.465,60
BB PREV RF IDKA2	17.828.586,13	0,00	0,00	0,00	17.876.029,06	47.442,93	1.084.203,38
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4.376.446,48	0,00	0,00	0,00	4.390.349,99	13.903,51	266.892,22
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	16.207.323,29	0,00	0,00	0,00	16.243.682,40	36.359,11	978.891,56
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	25.080.754,99	0,00	0,00	0,00	25.161.304,16	80.549,17	1.535.157,70
					81.681.677,42	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	29.900.046,97	16.089.355,47	-24.833.984,24	0,00	21.432.995,79	277.577,59	1.713.390,68
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	23.663.093,96	0,00	0,00	0,00	23.728.609,77	65.515,81	1.409.431,27
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	13.868.204,17	0,00	0,00	0,00	14.015.291,89	147.087,72	742.802,26
WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC	16.053.812,50	0,00	0,00	0,00	16.220.115,37	166.302,87	834.212,04
					75.397.012,82	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	7.110.786,27	0,00	0,00	0,00	7.135.118,34	24.332,07	606.826,56
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	4.085.880,86	0,00	0,00	0,00	4.130.289,09	44.408,23	232.466,68
					11.265.407,43	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	8.092.713,49	0,00	-3.000.000,00	0,00	4.449.717,10	-642.996,39	-717.479,15
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	4.658.211,61	0,00	0,00	0,00	4.158.068,20	-500.143,41	-633.006,53
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	3.971.647,14	0,00	0,00	0,00	3.425.466,82	-546.180,32	-574.533,18
OCCAM FIC FIA	4.806.452,90	0,00	0,00	0,00	4.377.695,05	-428.757,85	4.752,68
TARPON GT 30 FIC FIA	3.989.778,27	0,00	0,00	0,00	3.575.649,48	-414.128,79	-131.382,66
					19.986.596,65	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	12.022.202,16	0,00	0,00	0,00	12.162.141,63	139.939,47	-7.149.983,34
					12.162.141,63	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	10.902.759,43	0,00	0,00	0,00	10.056.305,18	-846.454,25	-3.971.131,59
					10.056.305,18	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	18.124,01	0,00	0,00	0,00	17.788,53	-335,48	-14.578,17
					17.788,53	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	2.449.594,12	0,00	0,00	0,00	12.500,00	2.474.635,47	37.541,35	194.773,34
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11	1.166.772,14	0,00	0,00	0,00	11.250,00	1.150.209,53	-5.312,61	8.679,56
						3.624.845,00	0,00	0,00

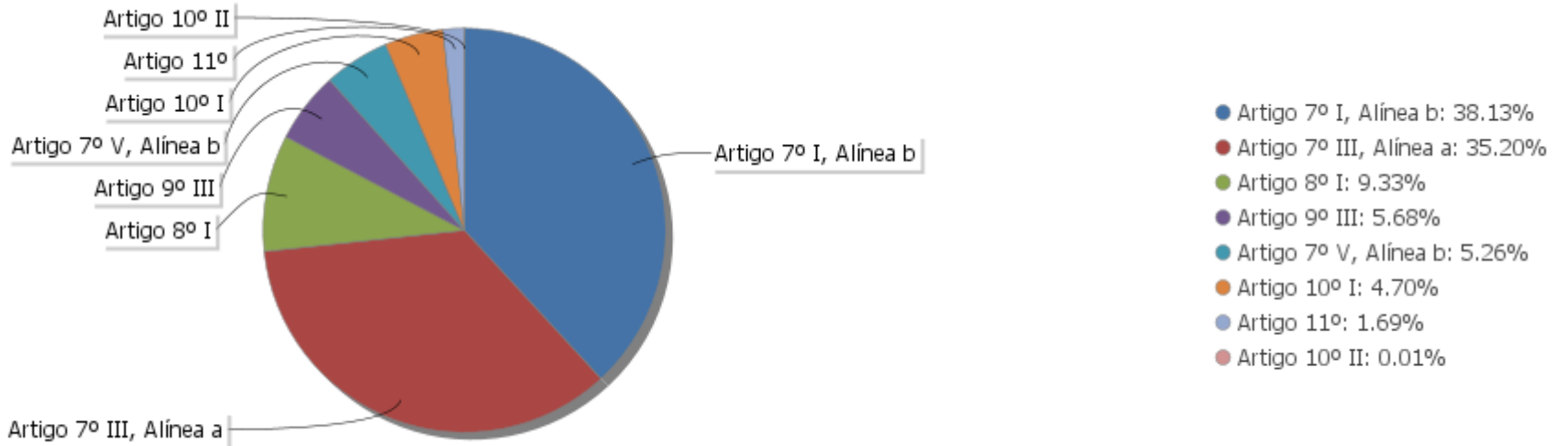
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

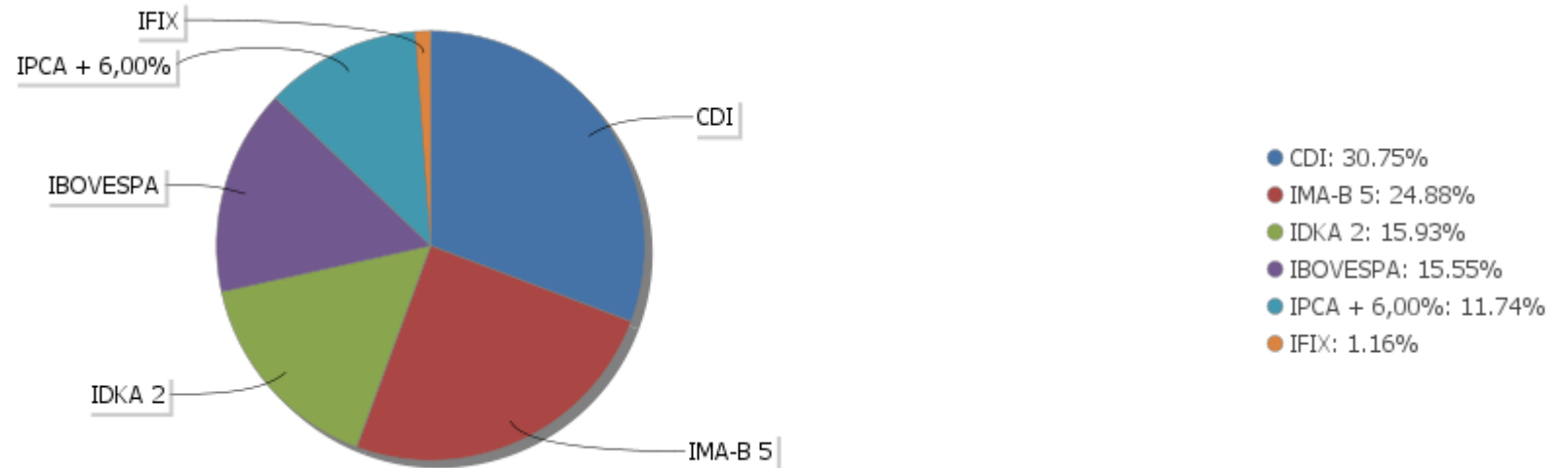
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	175.412.524,54	81,90	175.412.524,54	81,90
de 31 a 365 dias	29.169.496,31	13,62	204.582.020,85	95,51
acima de 365 dias	9.609.753,81	4,49	214.191.774,66	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

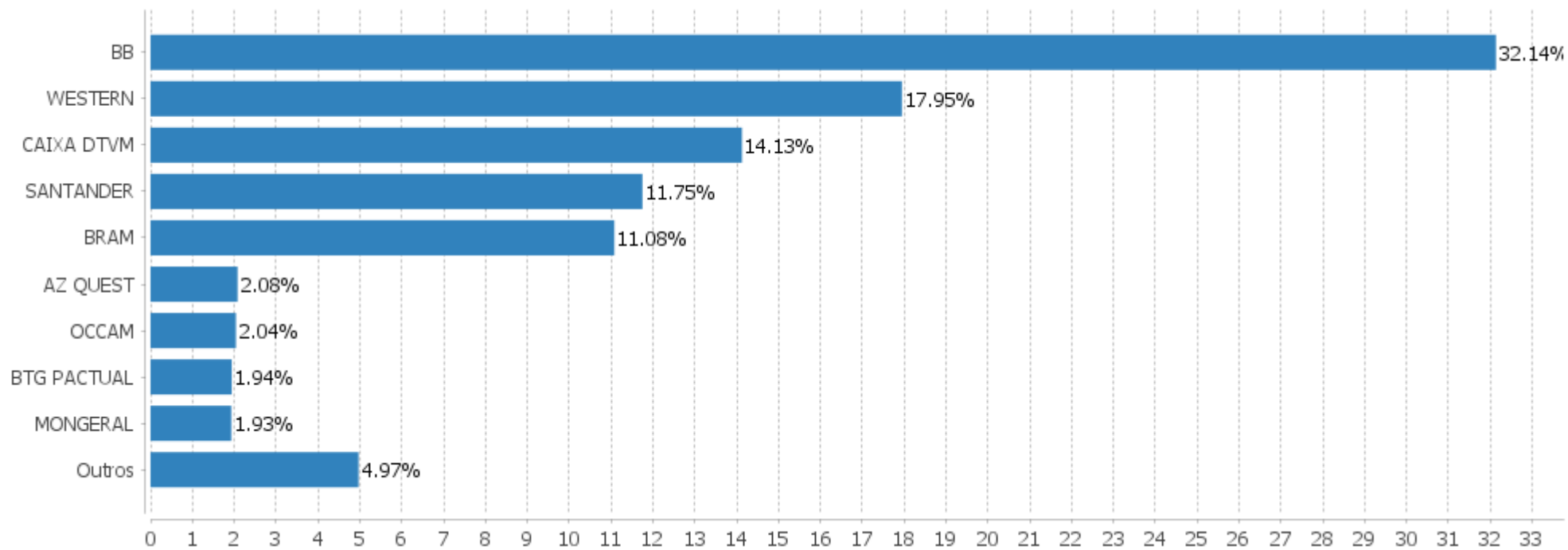


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

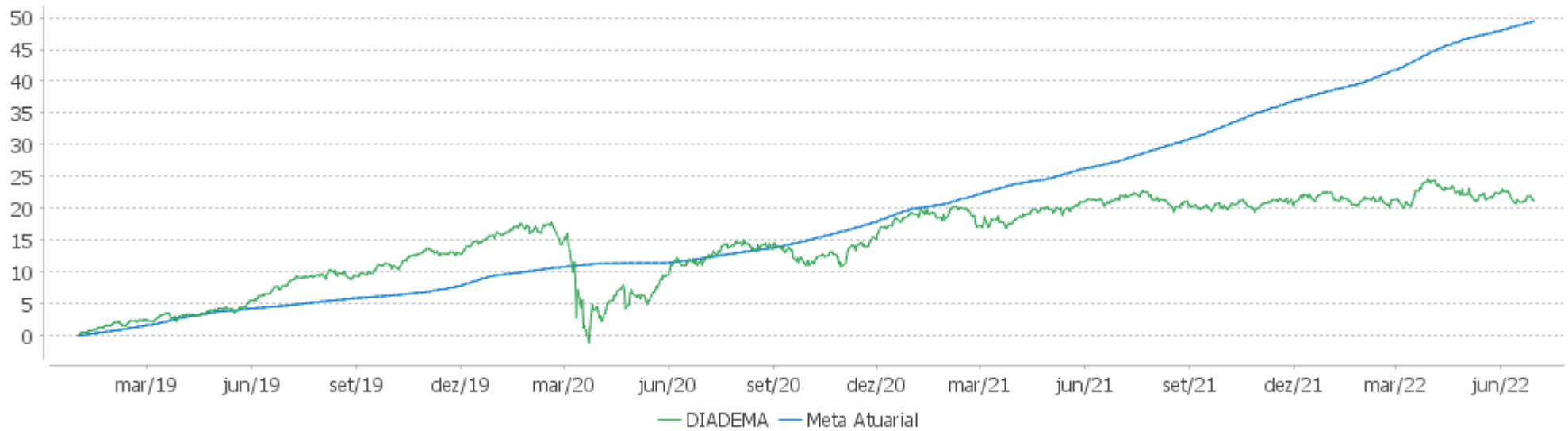
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2022	-0,88	-0,07	2,24	-1,55	0,28	-0,99							-1,01
IPCA + 4,89%	0,94	1,37	2,04	1,42	0,89	1,07							7,99
p.p. indexador	-1,82	-1,44	0,20	-2,97	-0,61	-2,06							-9,01
2021	-0,82	-0,99	0,86	1,54	0,90	0,39	-0,04	-0,79	-0,34	-0,08	0,72	1,38	2,73
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	17	40,48	03 meses	-2,25	3,42	-5,68	5,18
Meses abaixo - Meta Atuarial	25	59,52	06 meses	-1,01	7,99	-9,01	5,01
			12 meses	-0,18	17,67	-17,85	4,61
			24 meses	9,10	34,68	-25,58	5,28
			36 meses	12,46	45,76	-33,31	8,31
Maior rentabilidade da Carteira	3,93	2020-11	Desde 31/12/2018	21,22	53,31	-32,08	7,79
Menor rentabilidade da Carteira	-9,14	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

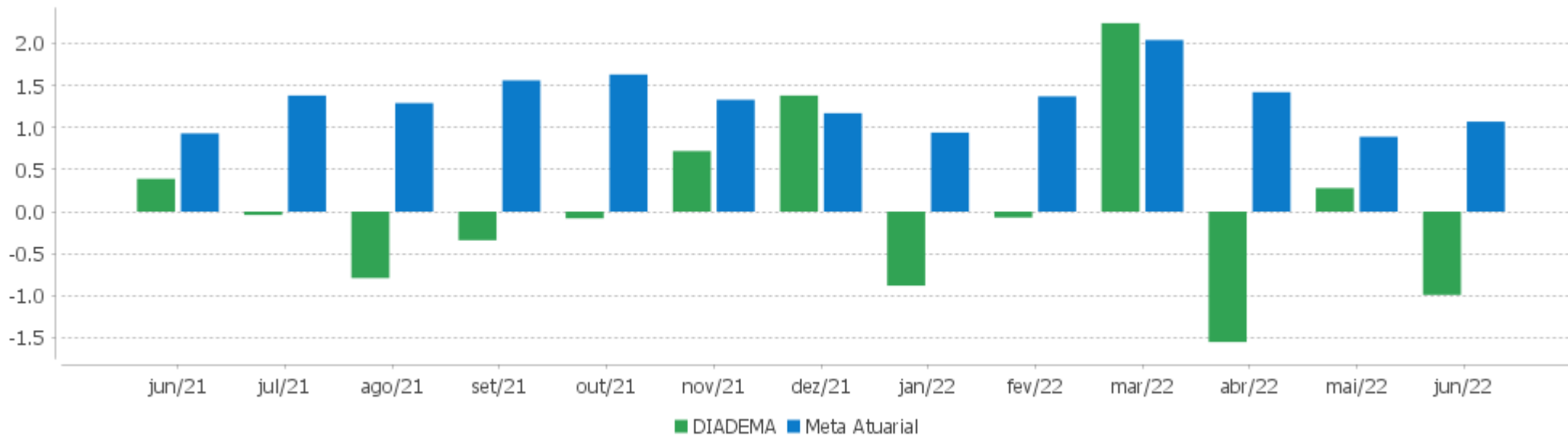


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No 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.	0,34 -0,82	6,36 -2,19	2,51 -1,18	6,36 -2,19	9,98 -8,62	16,39 -19,78	25,63 -21,83
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO % do CDI	1,09 107,23	5,96 110,41	3,16 108,83	5,96 110,41	10,20 117,83	16,27 146,32	15,24 93,78
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,32 -0,01	6,50 -0,11	2,64 -0,06	6,50 -0,11	9,82 -0,24	16,23 -0,51	26,25 -0,78
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,32 -0,84	7,21 -1,35	3,04 -0,65	7,21 -1,35	11,84 -6,76	19,81 -16,37	30,60 -16,86
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,27 -0,21	6,46 -0,39	2,54 -0,31	6,46 -0,39	9,84 -0,26	16,85 -1,03	26,41 -1,81
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,32 -0,02	6,47 -0,14	2,63 -0,06	6,47 -0,14	9,74 -0,33	16,08 -0,66	26,05 -0,98
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,22 -0,25	6,41 -0,43	2,50 -0,36	6,41 -0,43	9,66 -0,45	16,68 -1,21	26,24 -1,99
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	0,28 -0,06	6,31 -0,29	2,55 -0,15	6,31 -0,29	9,47 -0,59	15,15 -1,59	25,23 -1,80
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,03 101,22	5,54 102,62	2,90 99,83	5,54 102,62	8,98 103,80	11,54 103,80	16,07 98,90
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	1,06 104,64	5,60 103,61	2,97 102,04	5,60 103,61	9,19 106,13	11,59 104,22	16,08 98,96
WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC % do CDI	1,04 102,21	5,42 100,38	2,81 96,79	5,42 100,38	8,87 102,44	10,80 97,09	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-10,74 0,77	-13,21 -7,22	-21,02 -3,14	-13,21 -7,22	-43,33 -21,05	-30,33 -34,00	-24,19 -21,79
TARPON GT 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-10,38 1,12	-3,54 2,45	-16,04 1,84	-3,54 2,45	-10,61 11,68	42,09 38,42	
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-13,75 -2,25	-8,87 -2,88	-15,07 2,81	-8,87 -2,88	-14,94 7,35		
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-11,16 0,34	-11,97 -5,98	-17,17 0,72	-11,97 -5,98	-29,80 -7,51	-3,42 -7,09	3,57 5,97
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-8,92 2,58	-4,02 1,97	-14,14 3,74	-4,02 1,97	-19,95 2,34	4,19 0,52	8,07 10,47
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	1,16	-37,02	-16,57	-37,02	-24,11	-4,05	54,73

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.	12,67	-31,03	1,32	-31,03	-1,82	-7,72	57,13
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	-7,76 -765,99	-17,60 -325,88	-15,11 -519,81	-17,60 -325,88	-5,84 -67,49	30,79 276,90	36,19 222,64
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP % do CDI	-1,85 -182,63	-45,04 -833,86	8,84 304,23	-45,04 -833,86	120,51 1.392,33	54,81 492,93	-99,57 -612,61
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO Var. IFIX p.p.	1,53 2,41	8,38 8,70	3,76 3,19	8,38 8,70	11,99 10,51	25,60 25,98	25,17 18,71
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11 Var. IBOVESPA p.p.	-0,46 11,05	0,72 6,72	1,08 18,96	0,72 6,72	3,84 26,12	-3,33 -7,00	0,61 3,01
DIADEMA Var. IPCA + 4,89% p.p.	-0,99 -2,06	-1,01 -9,01	-2,25 -5,68	-1,01 -9,01	-0,18 -17,54	9,10 -24,25	12,46 -30,42
CDI	1,01	5,40	2,91	5,40	8,66	11,12	16,25
IBOVESPA	-11,50	-5,99	-17,88	-5,99	-22,29	3,67	-2,40
INPC + 6,00%	1,11	8,68	3,60	8,68	18,63	37,32	49,01
IPCA + 6,00%	1,16	8,56	3,69	8,56	18,60	36,18	47,46

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 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
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 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
					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 Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,93	4,99	2,65	4,99	7,19	9,37	15,94	24,32	34,03
IRF-M 1+	0,09	0,73	-0,06	0,73	-1,02	-2,10	9,44	30,43	42,54
IRF-M TOTAL	0,37	2,19	0,83	2,19	1,76	1,90	11,90	29,50	41,08
IMA-B 5	0,33	6,61	2,69	6,61	10,06	16,74	27,03	45,64	59,81
IMA-B 5+	-1,10	2,03	0,12	2,03	-2,16	6,18	8,27	52,42	61,74
IMA-B TOTAL	-0,36	4,35	1,43	4,35	3,78	11,48	17,00	50,64	62,99
IMA-GERAL TOTAL	0,43	4,49	1,90	4,49	5,34	9,08	16,19	34,66	46,06
IDKA 2	0,47	6,85	2,86	6,85	10,11	17,88	28,22	45,20	59,68
IDKA 20	-2,95	-2,61	-2,97	-2,61	-13,58	-2,92	-7,47	53,52	57,70
CDI	1,01	5,40	2,91	5,40	8,66	11,12	16,25	23,60	32,71

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-11,50	-5,99	-17,88	-5,99	-22,29	3,67	-2,40	35,43	56,67
IBRX 100	-11,56	-5,72	-17,94	-5,72	-23,04	4,91	0,02	40,80	61,46
IBRX 50	-11,67	-5,71	-18,35	-5,71	-22,70	6,28	-1,09	35,60	56,73
SMALL CAP	-16,33	-19,69	-24,72	-19,69	-39,59	-15,65	-11,30	25,69	43,26
IFIX	-0,88	-0,33	0,56	-0,33	1,48	-0,38	6,46	31,54	34,78
Índice Consumo - ICON	-14,29		-28,67		-46,23	-37,15	-28,35	-3,87	-2,44
Índice Dividendos - IDIV	-8,38	4,58	-9,43	4,58	-4,10	18,72	18,53	75,13	90,63

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	0,67	5,49	2,22	5,49	11,89	21,23	23,81	27,98	33,60
INPC	0,62	5,61	2,12	5,61	11,92	22,24	25,11	29,26	33,82
IGPM	0,59	8,16	2,54	8,16	10,70	50,28	61,27	71,77	83,66
SELIC	1,01	5,40	2,91	5,40	8,66	11,12	16,25	23,60	32,72

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	1,47	-25,45	-7,62	-25,45	-7,76	16,79	75,88	89,17	147,32
MSCI ACWI	1,26	-25,79	-7,28	-25,79	-13,20	8,75	55,83	60,47	103,16

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,00	7,54	3,21	7,54	16,36	31,10	39,27	49,65	62,39
IPCA + 5,00%	1,08	8,05	3,45	8,05	17,48	33,63	43,33	55,47	70,31
IPCA + 5,50%	1,12	8,30	3,57	8,30	18,04	34,90	45,38	58,44	74,39
IPCA + 5,89%	1,15	8,50	3,66	8,50	18,48	35,90	47,00	60,79	77,62
IPCA + 6,00%	1,16	8,56	3,69	8,56	18,60	36,18	47,46	61,46	78,54
INPC + 4,00%	0,95	7,67	3,11	7,67	16,40	32,20	40,73	51,14	62,66
INPC + 6,00%	1,11	8,68	3,60	8,68	18,63	37,32	49,01	63,07	78,83

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
974	03/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	40.000,00	15.876,25770400	2,5194854320
982	03/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.330.516,34	528.090,50733200	2,5194854320
975	07/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	15.000,00	5.947,92178400	2,5218892490
983	07/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.422.906,58	564.222,46954900	2,5218892490
973	07/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	155.846,69	0,00	61.797,59482300	2,5218892490
990	07/06/2022	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	0,00	3.000.000,00	499.350,68598051	6,0078019000
984	09/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	3.018.142,26	0,00	1.195.620,65936400	2,5243309710
976	15/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	47.000,00	18.583,86094800	2,5290761770
985	15/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	7.445.474,16	2.943.950,13788500	2,5290761770
977	17/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	17.000,00	6.718,50201000	2,5303259530
986	20/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	6.189.271,29	0,00	2.444.809,56828200	2,5315964770
978	21/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.000,00	1.974,04032200	2,5328763270
979	22/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	19.730,49241200	2,5341486140
987	22/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	8.213.813,12	3.241.251,54879300	2,5341486140
980	24/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	170.000,00	67.016,47128000	2,5366898130
988	27/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	6.726.095,23	0,00	2.650.213,59737500	2,5379445780
981	30/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	52.000,00	20.458,87873000	2,5416837690
989	30/06/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.025.274,04	2.370.583,67114300	2,5416837690
Total			16.089.355,47	27.833.984,24		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 4.585.143,20

Value-At-Risk: 2,14%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
DIADEMA		2,14	2,14			214.191.774,66	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,74%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IDKA2		1,29	0,05	0,28			17.876.029,06	8,35
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI		1,12	0,07	0,01			25.161.304,16	11,75
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,39	0,05	0,37			16.243.682,40	7,58
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,14	0,01	0,03			4.390.349,99	2,05
BB PREV IPCA I		0,81	0,01	0,78			18.010.311,81	8,41
Sub-total	2,60	1,07	0,20		-0,28	0,29	81.681.677,42	38,13

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		0,04	0,00	0,04			14.015.291,89	6,54
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,03	0,00	0,02			21.432.995,79	10,01
BRANCO INST FIC FI RF IMA-B 5		1,16	0,07	0,05			23.728.609,77	11,08
WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC		0,05	-0,00	0,04			16.220.115,37	7,57
Sub-total	0,77	0,36	0,07		-0,26	0,82	75.397.012,82	35,20

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		1,38	0,02	1,36			7.135.118,34	3,33
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO		0,03	0,00	0,03			4.130.289,09	1,93

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	1,86	0,87	0,02		-0,21	0,61	11.265.407,43	5,26

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,47%

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		8,66	0,15	5,54			4.449.717,10	2,08
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		10,13	0,16	5,84			4.158.068,20	1,94
OCCAM FIC FIA		9,31	0,13	3,03			4.377.695,05	2,04
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA		10,07	0,12	6,23			3.425.466,82	1,60
TARPON GT 30 FIC FIA		9,41	0,11	8,07			3.575.649,48	1,67
Sub-total	15,40	8,47	0,66		-0,78	-11,00	19.986.596,65	9,33

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 13,38%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I		13,38	0,58	13,43			12.162.141,63	5,68
Sub-total	29,68	13,38	0,58		0,01	1,16	12.162.141,63	5,68

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 14,15%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO		14,17	0,61	14,17			10.056.305,18	4,70
Sub-total	28,94	14,17	0,61		-0,30	-7,76	10.056.305,18	4,70

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP		2,75	0,00	2,75			17.788,53	0,01
	6,47	2,75	0,00		-0,44	-1,85	17.788,53	0,01

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total								
Fundos Imobiliários								Value-At-Risk: 1,40%
Artigo 11º								
Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11		0,05	-0,00	10,31			1.150.209,53	0,54
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO		2,05	-0,00	2,52			2.474.635,47	1,16
Sub-total	3,65	1,40	-0,00		-0,03	0,89	3.624.845,00	1,69

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

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

- O Instituto está com 5,26% do patrimônio líquido alocado 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;