



**LDB**  
EMPRESAS

**DIADEMA**  
OUTUBRO 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 31.10.2022.

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 79,93%

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	0,13	1,04	10,10	16.939.440,15	8,55	1.220.173.850,13	1,39
BB	BB	BB PREV RF IPCA	2,01	2,24	2,32	9.865.876,81	4,98	3.736.730.846,68	0,26
BB	BB	BB PREV IPCA I	1,54	1,01	11,66	18.758.449,53	9,47	278.055.961,45	6,75
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,59	0,99	1,84	16.443.664,56	8,30	5.839.461.409,01	0,28
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>1,76</b>	<b>1,21</b>	<b>9,20</b>	<b>62.007.431,05</b>	<b>31,30</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	0,14	1,03	10,25	14.632.274,71	7,39	14.020.474.735,38	0,10
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,12	1,04	10,21	27.585.080,03	13,93	12.427.649.222,70	0,22
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,12	1,05	1,86	25.621.940,32	12,93	2.800.691.599,83	0,91
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,12	1,07	1,99	24.161.616,91	12,20	7.181.883.753,28	0,34
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,87</b>	<b>1,05</b>	<b>9,30</b>	<b>92.000.911,97</b>	<b>46,44</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	2,79	1,47	8,29	0,00	0,00	538.020.375,78	0,00
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	0,15	1,15	11,04	4.328.095,22	2,18	1.267.842.103,65	0,34
<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea b</b>			<b>1,86</b>	<b>1,39</b>	<b>9,48</b>	<b>4.328.095,22</b>	<b>2,18</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>1,43</b>	<b>1,13</b>	<b>9,22</b>	<b>158.336.438,24</b>	<b>79,93</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

12,59%

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	18,71	8,89	3,12	5.212.370,29	2,63	1.146.083.351,86	0,45
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	24,46	7,78	6,99	5.125.923,77	2,59	1.534.573.593,33	0,33
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	19,53	6,75	13,34	5.169.171,43	2,61	1.054.252.592,18	0,49
GUEPARDO	DAYCOVAL	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	22,34	7,19	11,09	4.443.634,25	2,24	189.658.293,19	2,34
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT 30 FIC FIA	19,07	11,14	34,30	4.978.489,45	2,51	664.363.552,27	0,75
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>18,62</b>	<b>8,34</b>	<b>13,95</b>	<b>24.929.589,19</b>	<b>12,59</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>17,88</b>	<b>8,34</b>	<b>13,95</b>	<b>24.929.589,19</b>	<b>12,59</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

6,10%

Artigo 9º III (Fundos de 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	27,77	1,59	-37,48	12.074.472,38	6,10	1.513.382.963,69	0,80
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>27,77</b>	<b>1,59</b>	<b>-37,48</b>	<b>12.074.472,38</b>	<b>6,10</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>27,77</b>	<b>1,59</b>	<b>-37,48</b>	<b>12.074.472,38</b>	<b>6,10</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

0,01%

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	184,71	0,31	-43,99	18.128,90	0,01	2.488.843,03	0,73
<b>Sub-total Artigo 10º II</b>			<b>184,71</b>	<b>0,31</b>	<b>-43,99</b>	<b>18.128,90</b>	<b>0,01</b>		
<b>Investimentos Estruturados</b>			<b>21,23</b>	<b>0,31</b>	<b>-11,32</b>	<b>18.128,90</b>	<b>0,01</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

1,38%

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 FII - BPFF11	9,84	0,13	6,76	1.174.148,39	0,59	351.643.821,51	0,33
RIO BRAVO	BB	BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII	48,36	1,19	-2,22	1.554.982,32	0,78	32.188.134,15	4,83
<b>Sub-total Artigo 11º</b>			<b>32,58</b>	<b>0,74</b>	<b>0,63</b>	<b>2.729.130,71</b>	<b>1,38</b>		
<b>Fundos Imobiliários</b>			<b>32,58</b>	<b>0,74</b>	<b>0,63</b>	<b>2.729.130,71</b>	<b>1,38</b>		
<b>Total</b>			<b>4,51</b>	<b>2,02</b>	<b>3,92</b>	<b>198.087.759,42</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	62.007.431,05	31,30	15,00	35,00	70,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	92.000.911,97	46,44	0,00	35,00	65,00	0,00	65,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	4.328.095,22	2,18	0,00	4,00	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>158.336.438,24</b>	<b>79,93</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	24.929.589,19	12,59	0,00	10,00	35,00	0,00	35,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>24.929.589,19</b>	<b>12,59</b>					35,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	12.074.472,38	6,10	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>12.074.472,38</b>	<b>6,10</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º II	Fundo de Participação	18.128,90	0,01	0,00	0,50	15,00	0,00	5,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>18.128,90</b>	<b>0,01</b>					15,00
<b>Fundos Imobiliários</b>								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	2.729.130,71	1,38	0,00	1,50	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Fundos Imobiliários</b>	<b>2.729.130,71</b>	<b>1,38</b>					5,00
<b>Total</b>		<b>198.087.759,42</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	1,21 118,12	9,20 92,00	2,37 71,90	3,86 59,37	12,13 105,51	738.651,47	7.740.708,18
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,05 102,96	9,30 92,94	2,67 80,91	5,04 77,40		918.714,98	6.256.068,21
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	1,39 135,72	9,48 94,80	2,64 80,00	4,53 69,59		154.450,24	1.166.035,12
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	8,34 2,89	13,95 3,25	17,30 4,82	12,99 5,42		1.919.643,24	2.891.343,70
Artigo 9º III % do CDI	1,59 156,09	-37,48 -374,70	-10,09 -306,12	-7,62 -117,00	-37,87 -329,51	189.348,16	-7.237.652,59
Artigo 10º I % do CDI	0,00 0,00	-12,03 -120,26	-3,04 -92,12	-0,64 -9,90		0,00	-3.290.822,21
Artigo 10º II % do CDI	0,31 30,20	-43,99 -439,80	2,56 77,61	10,71 164,53		55,71	-14.237,80
Artigo 11º % do CDI	0,74 72,42	0,63 6,27	3,88 117,85	-3,10 -47,65		20.213,54	13.489,81
<b>DIADEMA (Total)</b>						<b>3.941.077,34</b>	<b>7.524.932,42</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	18.571.398,99	0,00	0,00	0,00	18.758.449,53	187.050,54	1.964.603,32
BB PREV RF IPCA	9.649.482,31	0,00	0,00	0,00	9.865.876,81	216.394,50	224.031,49
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	16.283.125,54	0,00	0,00	0,00	16.443.664,56	160.539,02	296.954,37
WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC	16.764.772,74	0,00	0,00	0,00	16.939.440,15	174.667,41	1.553.536,82
					62.007.431,05	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	26.558.044,01	18.558.139,76	-17.777.521,24	0,00	27.585.080,03	246.417,50	2.586.052,51
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	23.904.891,77	0,00	0,00	0,00	24.161.616,91	256.725,14	469.269,79
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	14.482.787,51	0,00	0,00	0,00	14.632.274,71	149.487,20	1.359.785,08
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	25.355.855,18	0,00	0,00	0,00	25.621.940,32	266.085,14	467.792,21
					92.000.911,97	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	7.158.718,95	0,00	-7.264.054,09	0,00	0,00	105.335,14	735.762,31
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	4.278.980,12	0,00	0,00	0,00	4.328.095,22	49.115,10	430.272,81
					4.328.095,22	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	4.786.715,07	0,00	0,00	0,00	5.212.370,29	425.655,22	45.174,04
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	4.755.772,54	0,00	0,00	0,00	5.125.923,77	370.151,23	334.849,04
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	4.145.577,02	0,00	0,00	0,00	4.443.634,25	298.057,23	443.634,25
OCCAM FIC FIA	4.842.429,58	0,00	0,00	0,00	5.169.171,43	326.741,85	796.229,06
TARPON GT 30 FIC FIA	4.479.451,74	0,00	0,00	0,00	4.978.489,45	499.037,71	1.271.457,31
					24.929.589,19	0,00	0,00

## Artigo 9º III (Fundos de 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	11.885.124,22	0,00	0,00	0,00	12.074.472,38	189.348,16	-7.237.652,59
					12.074.472,38	0,00	0,00

## Artigo 10º II (Fundo de Participação)

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	18.073,19	0,00	0,00	0,00	18.128,90	55,71	-14.237,80
					18.128,90	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 FI IMOBILIARIO - FII	1.561.354,37	0,00	0,00	0,00	25.000,00	1.554.982,32	18.627,95	-63.378,61
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPFF11	1.183.062,80	0,00	0,00	0,00	10.500,00	1.174.148,39	1.585,59	76.868,42
						2.729.130,71	0,00	0,00

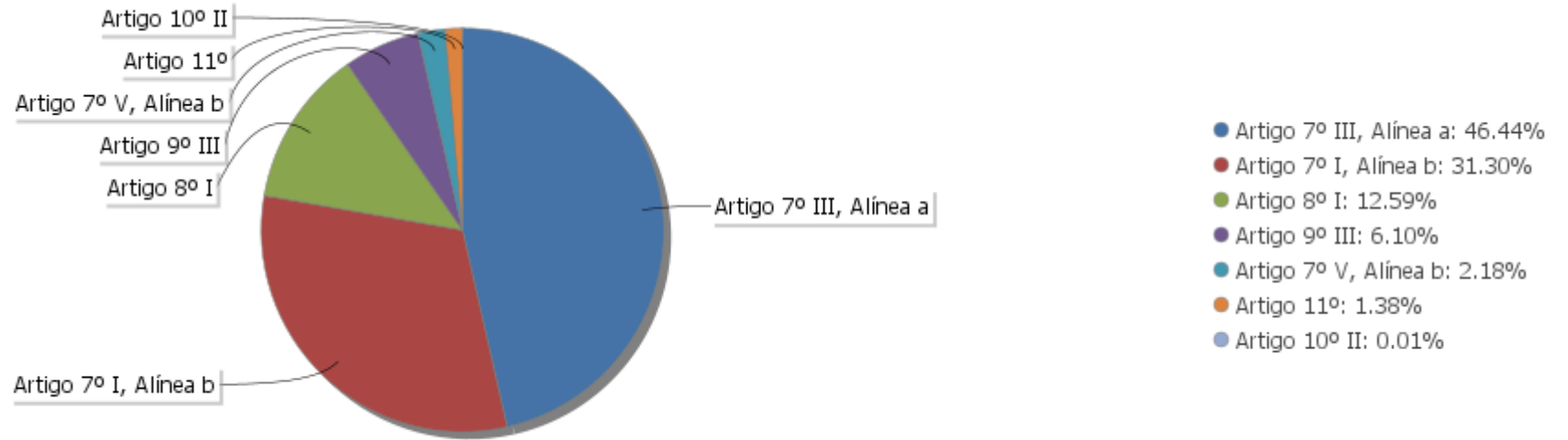
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

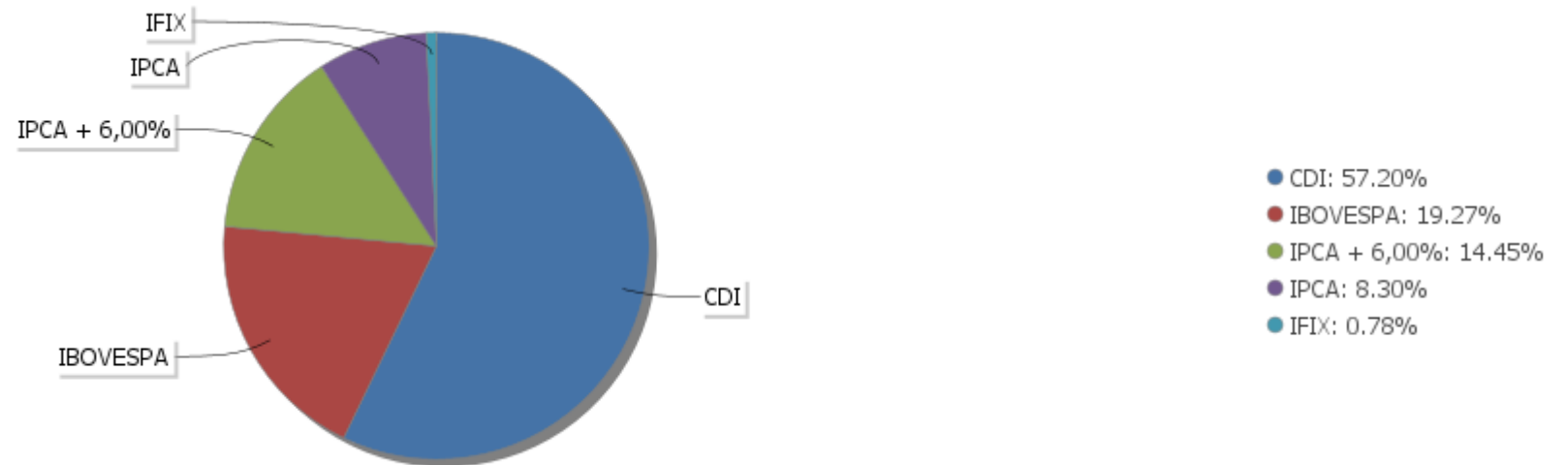
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	172.118.852,82	86,89	172.118.852,82	86,89
de 31 a 365 dias	24.413.924,28	12,32	196.532.777,10	99,22
acima de 365 dias	1.554.982,32	0,78	198.087.759,42	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

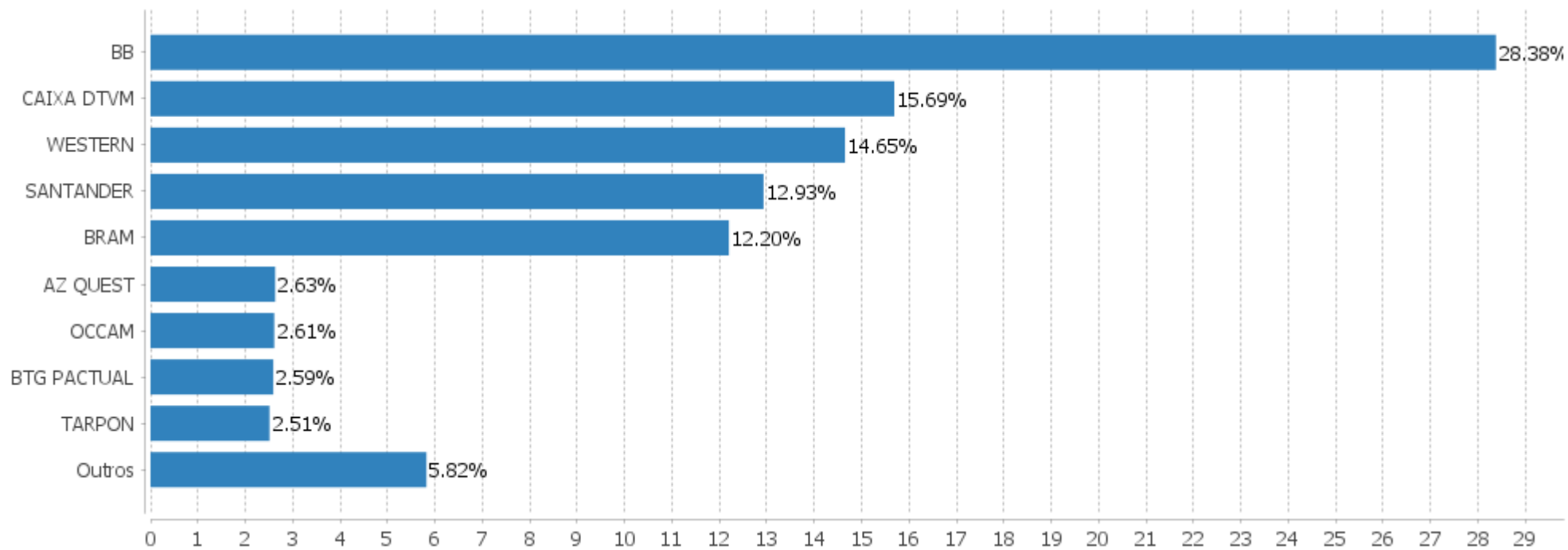


Alocação Por Estratégia



## 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	2,24	-1,55	0,28	-0,99	1,83	0,42	0,63	2,02			3,92
IPCA + 4,89%	0,94	1,37	2,04	1,42	0,89	1,07	-0,28	0,08	0,11	0,97			8,93
p.p. indexador	-1,82	-1,44	0,20	-2,97	-0,61	-2,06	2,12	0,35	0,52	1,05			-5,01
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

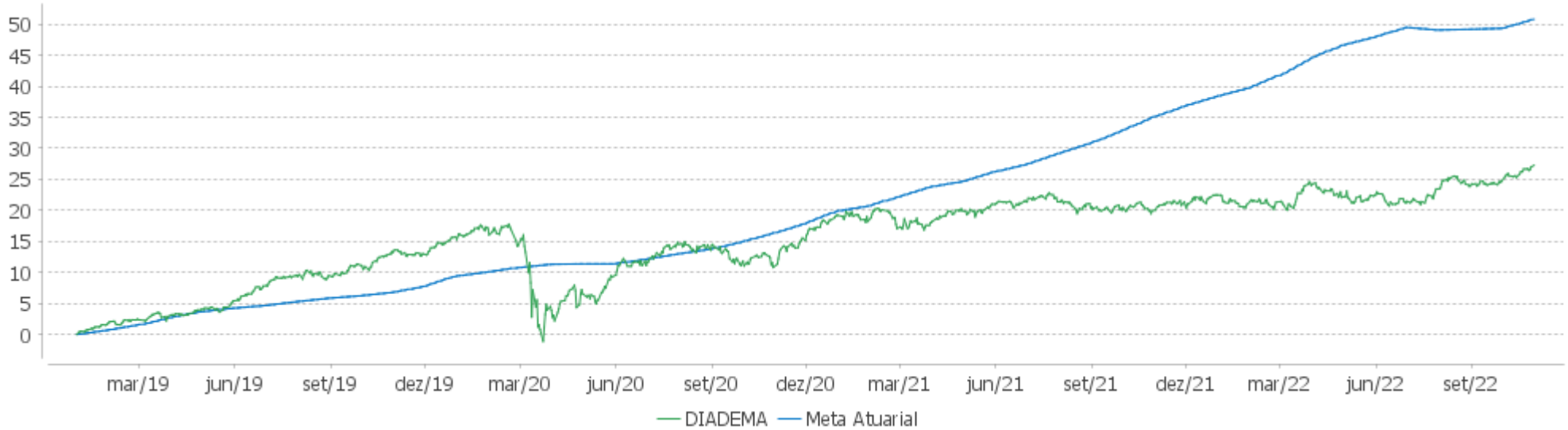
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

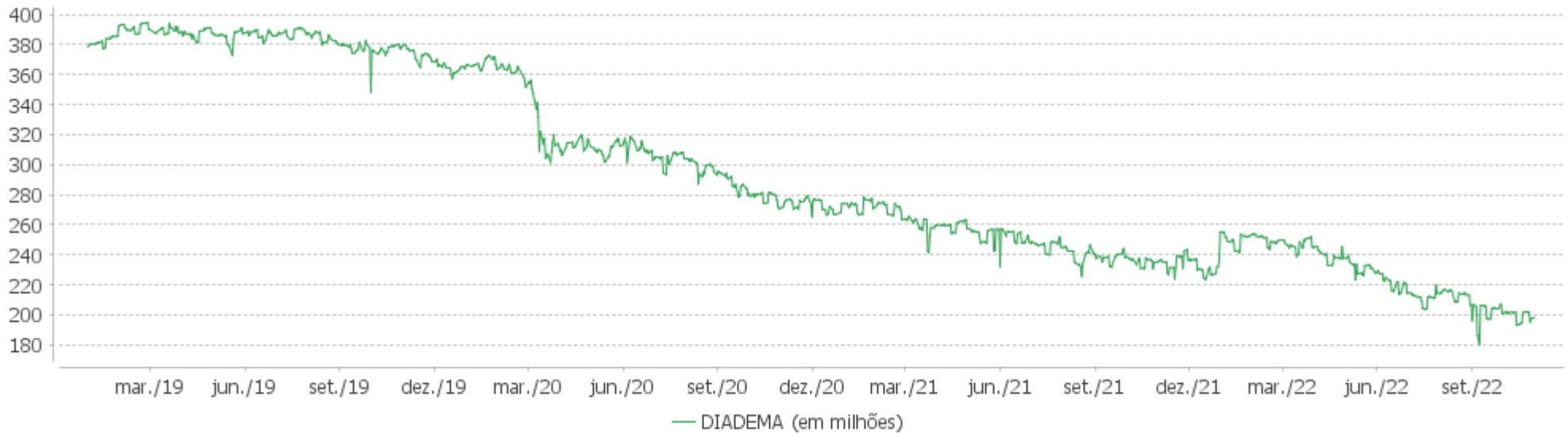
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	21	45,65	03 meses	3,09	1,16	1,94	3,51
Meses abaixo - Meta Atuarial	25	54,35	06 meses	4,23	2,86	1,38	4,17
			12 meses	6,12	11,78	-5,66	4,51
			24 meses	14,85	30,47	-15,62	4,81
Maior rentabilidade da Carteira	3,93	2020-11	36 meses	12,35	43,52	-31,17	8,33
Menor rentabilidade da Carteira	-9,14	2020-03	Desde 31/12/2018	27,27	54,64	-27,38	7,52

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



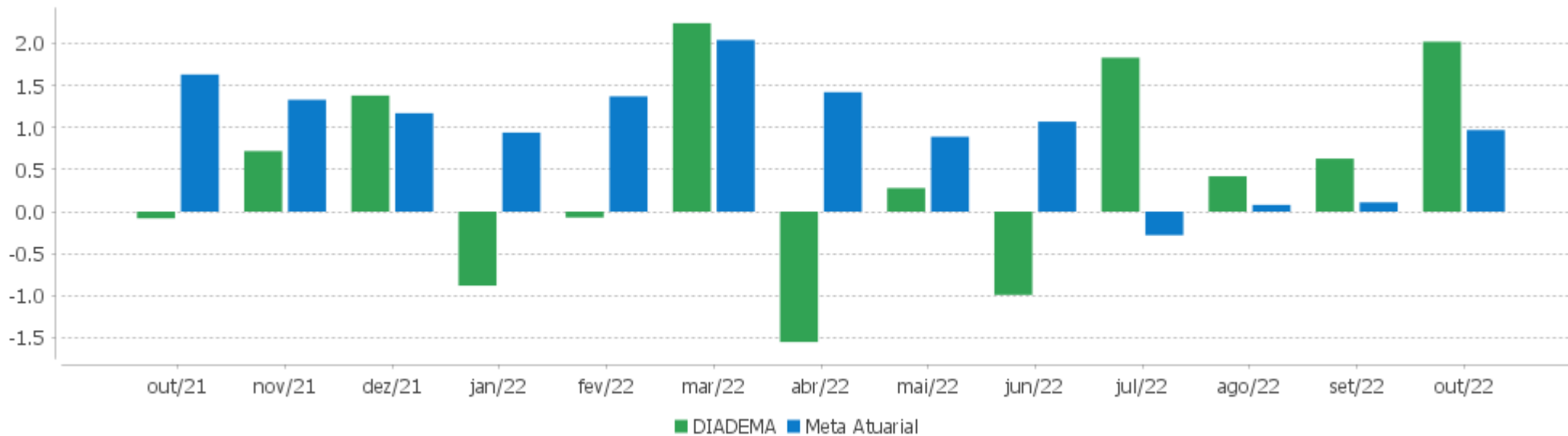
Patrimônio Líquido





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.	1,83 0,77	8,67 -1,22	2,34 0,92	3,34 -0,06	12,54 -0,32	16,91 -15,43	23,21 -22,50
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO % do CDI	1,15 112,46	11,04 110,37	3,65 110,87	7,14 109,65	12,74 110,86	19,19 126,25	18,74 99,11
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,01 -0,05	11,66 1,77	3,30 1,87	5,17 1,76	14,28 1,42	21,94 -10,39	30,05 -15,65
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6,00% p.p.	2,24 1,19	9,55 -0,34	2,18 0,76	3,12 -0,29	12,46 -0,40	18,19 -14,14	25,17 -20,53
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,99 0,40	9,36 4,65	3,75 3,81	5,92 5,53	11,26 4,79	11,59 -6,24	16,62 -5,83
WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC % do CDI	1,04 102,08	10,10 100,95	3,36 102,00	6,64 102,04	11,58 100,79	15,43 101,55	
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,07 105,22	10,52 105,23	3,44 104,29	6,84 105,03	12,13 105,57	16,28 107,15	19,29 102,00
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,04 101,81	10,21 102,09	3,35 101,70	6,62 101,68	11,79 102,61	15,78 103,83	18,90 99,93
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	1,03 101,13	10,25 102,43	3,36 101,99	6,65 102,09	11,77 102,40	15,91 104,68	18,88 99,83
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	1,05 102,81	10,45 104,43	3,41 103,62	6,76 103,88	12,04 104,79	16,48 108,43	19,21 101,60
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	7,78 2,33	6,99 -3,71	13,61 1,13	9,35 1,78	-0,87 -12,98	-16,53 -40,04	-15,40 -23,63
TARPON GT 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	11,14 5,69	34,30 23,60	26,95 14,47	24,90 17,33	36,48 24,37	96,45 72,95	
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	7,19 1,74	18,22 7,52	20,90 8,42	22,39 14,82	30,15 18,04	61,55 38,04	
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	8,89 3,44	3,12 -7,58	12,88 0,40	3,14 -4,43	1,30 -10,81	11,17 -12,34	4,12 -4,10
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	6,75 1,29	13,34 2,64	14,19 1,71	11,04 3,48	14,16 2,05	21,83 -1,68	13,23 5,01
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	1,59 -3,86	-37,48 -48,18	-10,09 -22,57	-7,62 -15,18	-37,87 -49,98	-17,15 -40,66	43,21 34,99
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	0,31	-43,99	2,56	10,71	130,39	69,22	-99,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	30,21	-439,80	77,61	164,53	1.134,59	455,44	-526,51
BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII Var. IFIX p.p.	1,19 1,17	-2,22 -8,87	2,98 -3,32	-7,14 -13,48	2,28 -9,52	10,55 2,42	6,80 -0,34
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPPF11 Var. IBOVESPA p.p.	0,13 -5,32	6,76 -3,93	5,95 -6,53	5,76 -1,80	11,19 -0,92	10,45 -13,06	1,35 -6,88
DIADEMA Var. IPCA + 4,89% p.p.	2,02 1,05	3,92 -5,01	3,09 1,94	4,23 1,38	6,12 -5,56	14,85 -14,74	12,35 -28,85
CDI	1,02	10,00	3,30	6,51	11,49	15,20	18,91
IBOVESPA	5,45	10,70	12,48	7,57	12,11	23,51	8,22
INPC + 6,00%	0,94	10,00	1,33	3,32	12,85	32,81	47,43
IPCA + 6,00%	1,06	9,89	1,43	3,41	12,86	32,34	45,71

## 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 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				
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRASIL PLURAL ABSOLUTO 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 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 REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
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	

## 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		1,50
WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15

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	1,00	9,68	3,38	6,44	11,52	13,50	18,11	26,53	35,47
IRF-M 1+	0,92	7,22	5,18	6,95	12,08	5,46	10,35	30,15	43,64
IRF-M TOTAL	0,93	7,95	4,44	6,64	11,95	8,26	13,06	29,67	41,90
IMA-B 5	1,91	9,12	2,35	3,50	12,73	17,73	24,45	41,60	54,77
IMA-B 5+	0,65	5,79	5,62	3,73	10,15	9,03	2,65	40,63	55,93
IMA-B TOTAL	1,23	7,43	3,86	3,57	11,40	13,44	12,30	42,33	56,98
IMA-GERAL TOTAL	1,01	8,88	3,72	5,61	11,80	12,98	15,99	33,17	45,02
IDKA 2	1,78	8,84	2,04	3,22	12,50	17,69	25,62	40,76	54,48
IDKA 20	-0,33	3,63	10,36	4,51	7,43	2,00	-11,54	37,24	53,99
CDI	1,02	10,00	3,30	6,51	11,49	15,20	18,91	26,30	34,57

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	5,45	10,70	12,48	7,57	12,11	23,51	8,22	32,73	56,16
IBRX 100	5,57	10,25	12,01	6,76	11,78	23,41	9,78	37,01	60,34
IBRX 50	5,32	10,92	12,53	7,34	13,01	26,17	10,50	32,80	56,33
SMALL CAP	7,30	-1,35	16,81	0,91	0,06	3,68	-2,72	39,01	46,73
IFIX	0,02	6,66	6,30	6,34	11,80	8,12	7,14	33,40	34,37
Índice Consumo - ICON	6,28		12,02	1,65	-14,96	-22,29	-23,79	10,51	-0,91
Índice Dividendos - IDIV	4,03	13,61	6,51	3,76	16,46	32,51	18,49	64,97	73,53

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	0,59	4,70	-0,06	0,39	6,47	17,83	22,45	25,55	31,28
INPC	0,47	4,81	-0,16	0,30	6,46	18,26	23,90	27,06	32,15
IGPM	-0,97	5,58	-2,59	-1,31	6,52	29,66	56,80	61,74	79,20
SELIC	1,02	10,00	3,30	6,51	11,49	15,20	18,91	26,30	34,58

**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	5,00	-23,47	-5,01	0,15	-21,68	7,85	67,36	101,91	141,21
MSCI ACWI	3,03	-26,82	-6,84	-4,13	-26,70	-3,07	44,06	71,11	89,42

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,90	8,17	0,94	2,41	10,73	27,41	37,65	46,79	59,57
IPCA + 5,00%	0,98	9,03	1,18	2,91	11,79	29,86	41,64	52,49	67,35
IPCA + 5,50%	1,02	9,46	1,31	3,16	12,33	31,10	43,66	55,41	71,35
IPCA + 5,89%	1,05	9,79	1,40	3,35	12,74	32,06	45,25	57,71	74,53
IPCA + 6,00%	1,06	9,89	1,43	3,41	12,86	32,34	45,71	58,36	75,43
INPC + 4,00%	0,78	8,27	0,84	2,32	10,72	27,87	39,28	48,55	60,63
INPC + 6,00%	0,94	10,00	1,33	3,32	12,85	32,81	47,43	60,26	76,60

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1088	05/10/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.492.379,66	567.260,65616700	2,6308534600
1078	05/10/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	40.000,00	15.204,19157100	2,6308534600
1077	07/10/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.666.288,41	0,00	1.012.418,25409400	2,6335838960
1089	07/10/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.525.381,77	579.203,78853900	2,6335838960
1079	07/10/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	20.000,00	7.594,21411700	2,6335838960
1091	14/10/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	8.124.276,08	3.078.465,73307100	2,6390665950
1090	14/10/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10,00	3,78921900	2,6390665950
1080	14/10/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	60.000,00	22.735,31108100	2,6390665950
1092	19/10/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	57.000,00	0,00	21.564,60445500	2,6432202880
1081	19/10/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	3.783,26394000	2,6432202880
1093	20/10/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	6.676.584,14	0,00	2.524.607,55569300	2,6446027720
1082	21/10/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	8.000,00	3.023,47324400	2,6459635510
1083	24/10/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.000,00	1.133,21817900	2,6473278110
1084	25/10/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	210.000,00	79.285,26346600	2,6486637090
1095	27/10/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.214.473,73	2.343.858,65202300	2,6513858780
1094	27/10/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	20.000,00	7.543,22491000	2,6513858780
1085	27/10/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	18.858,06227400	2,6513858780
1087	28/10/2022	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	0,00	7.264.054,09	2.728.461,26678000	2,6623262660
1096	28/10/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.936.957,61	0,00	3.368.963,88224200	2,6527317960
1097	31/10/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	221.309,60	0,00	83.384,19790500	2,6540952070
<b>Total</b>			<b>18.558.139,76</b>	<b>25.041.575,33</b>		



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 3.066.719,90

Value-At-Risk: 1,55%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
DIADEMA		1,55	1,55			198.087.759,42	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,14%

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		0,01	-0,00	0,01			16.939.440,15	8,55
BB PREV RF IPCA		0,79	0,01	0,75			9.865.876,81	4,98
BB PREV IPCA I		0,41	0,00	0,44			18.758.449,53	9,47
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,01	0,03	1,02			16.443.664,56	8,30
<b>Sub-total</b>	0,25	0,37	0,04		0,74	1,21	62.007.431,05	31,30

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		0,03	-0,00	0,03			14.632.274,71	7,39
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,01	0,00	0,01			27.585.080,03	13,93
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,01	-0,00	0,01			25.621.940,32	12,93
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,01	0,00	0,01			24.161.616,91	12,20
<b>Sub-total</b>	0,02	0,01	-0,00		1,50	1,05	92.000.911,97	46,44

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		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO		0,03	0,00	0,02			4.328.095,22	2,18
<b>Sub-total</b>	0,72	0,03	0,00		0,51	1,39	4.328.095,22	2,18

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,77%

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		8,80	0,18	4,90			5.212.370,29	2,63
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		10,92	0,24	5,83			5.125.923,77	2,59
OCCAM FIC FIA		10,40	0,19	1,97			5.169.171,43	2,61
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA		11,00	0,20	6,32			4.443.634,25	2,24
TARPON GT 30 FIC FIA		11,49	0,22	8,05			4.978.489,45	2,51
<b>Sub-total</b>	27,14	9,77	1,03		0,27	8,34	24.929.589,19	12,59

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 13,83%

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		13,83	0,48	17,25			12.074.472,38	6,10
<b>Sub-total</b>	35,27	13,83	0,48		0,02	1,59	12.074.472,38	6,10

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 0,26%

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 FII - BPFF11		0,27	0,00	10,39			1.174.148,39	0,59
BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII		0,40	-0,00	1,94			1.554.982,32	0,78
<b>Sub-total</b>	2,41	0,26	-0,00		-0,12	0,74	2.729.130,71	1,38

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,00%

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		0,00	0,00	0,01			18.128,90	0,01
<b>Sub-total</b>	1,09	0,00	0,00		-0,65	0,31	18.128,90	0,01

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS