



LDB
EMPRESAS

DIADEMA
4º TRIMESTRE 2023



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 29.12.2023.

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 66,59%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
MONGERAL	BEM	MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RF LONGO PRAZO	4,50	0,10	2,68	4,65	5.716.084,53	5,41	208.971.148,71	2,74
BB	BB	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,04	0,04	0,90	2,80	12.545.625,10	11,88	31.713.195.919,09	0,04
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,30	0,08	1,21	2,93	15.868.666,00	15,02	5.290.529.627,75	0,30
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,69	0,07	1,30	3,20	34.130.375,63	32,31		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,04	0,90	2,83	12.536.955,12	11,87	16.475.113.370,57	0,08
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,10	0,04	0,94	2,93	9.339.239,05	8,84	2.799.591.858,55	0,33
BRAM	BRDESCO	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,07	0,04	0,94	3,01	10.892.355,54	10,31	10.327.922.782,38	0,11
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,06	0,04	0,93	2,91	32.768.549,71	31,02		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO	1,08	0,06	1,11	3,45	3.439.969,27	3,26	2.789.770.644,39	0,12
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			1,08	0,06	1,11	3,45	3.439.969,27	3,26		
Renda Fixa			0,35	0,06	1,14	3,09	70.338.894,61	66,59		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

16,53%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	18,67	-0,00	9,85	11,54	6.611.627,98	6,26	934.426.001,03	0,71
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	17,45	-0,01	4,83	12,81	5.289.585,22	5,01	1.435.426.948,17	0,37
GUEPARDO	DAYCOVAL	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	18,84	-0,00	2,67	12,52	5.558.696,11	5,26	474.190.468,78	1,17
Sub-total Artigo 8º I			15,85	-0,01	5,95	12,23	17.459.909,31	16,53		
Renda Variável			15,85	-0,01	5,95	12,23	17.459.909,31	16,53		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

15,18%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	16,37	-0,01	2,77	12,06	16.036.379,33	15,18	1.398.458.692,08	1,15
Sub-total Artigo 9º III			16,37	-0,01	2,77	12,06	16.036.379,33	15,18		
Investimentos no Exterior			16,37	-0,01	2,77	12,06	16.036.379,33	15,18		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

0,00%

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
PÁTRIA	PÁTRIA	PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	440,93	0,00	0,00	0,00	0,00	2.615.006,70	0,00	
Sub-total Artigo 10º II			440,93	0,00	0,00	0,00	0,00			
Investimentos Estruturados				0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

1,70%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
PLURAL	GENIAL	BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPF11	7,68	0,00	3,16	2,76	1.170.710,48	1,11	350.614.208,13	0,33
RIO BRAVO	BB	BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII	77,04	0,00	-0,67	-19,65	624.322,56	0,59	12.923.477,03	4,83
Sub-total Artigo 11º			38,59	0,00	1,76	-6,72	1.795.033,04	1,70		
Fundos Imobiliários			38,59	0,00	1,76	-6,72	1.795.033,04	1,70		
Total			2,40	0,04	2,18	5,41	105.630.216,29	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	34.130.375,63	32,31	0,00	31,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	32.768.549,71	31,02	0,00	45,00	60,00	0,00	65,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	3.439.969,27	3,26	0,00	4,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	70.338.894,61	66,59					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	17.459.909,31	16,53	0,00	9,00	30,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	17.459.909,31	16,53					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	16.036.379,33	15,18	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	16.036.379,33	15,18					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º II	Fundo de Participação	0,00	0,00	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	0,00	0,00					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	1.795.033,04	1,70	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	1.795.033,04	1,70					5,00
Total		105.630.216,29	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,30 144,78	3,20 112,73	3,20 112,73	5,75 93,45	13,24 101,46	483.155,18	1.335.502,27
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,93 103,69	2,91 102,68	2,91 102,68	6,44 104,69	13,27 101,74	279.266,50	1.163.610,14
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	1,11 123,68	3,45 121,61	3,45 121,61	8,10 131,77	10,47 80,25	37.716,82	114.765,88
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	5,95 0,57	12,23 -2,88	12,23 -2,88	16,67 3,03	33,89 11,61	981.015,19	1.903.308,47
Artigo 9º III % do CDI	2,77 309,27	12,06 425,06	12,06 425,06	10,48 170,41	32,50 249,11	432.547,45	1.726.278,21
Artigo 10º II % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	-100,00 -1.626,21	-100,00 -766,43	0,00	0,00
Artigo 11º % do CDI	1,76 196,37	-6,72 -236,84	-6,72 -236,84	-8,86 -144,05	-0,85 -6,48	31.776,24	-136.014,12
DIADEMA (Total)						2.245.477,38	6.107.450,85

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	19.690.976,56	0,00	-7.289.927,49	0,00	12.545.625,10	144.576,03	540.351,13
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	15.679.351,16	0,00	0,00	0,00	15.868.666,00	189.314,84	498.667,50
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RF LONGO PRAZO	5.566.820,22	0,00	0,00	0,00	5.716.084,53	149.264,31	253.932,43
	40.937.147,94	0,00	-7.289.927,49	0,00	34.130.375,63	483.155,18	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	12.839.015,58	10.561.149,99	-10.944.272,00	0,00	12.536.955,12	81.061,55	387.066,23
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	10.791.164,97	0,00	0,00	0,00	10.892.355,54	101.190,57	318.356,97

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	14.246.723,82	0,00	-5.004.499,15	0,00	9.339.239,05	97.014,38	458.186,94
	37.876.904,37	10.561.149,99	-15.948.771,15	0,00	32.768.549,71	279.266,50	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO	3.402.252,45	0,00	0,00	0,00	3.439.969,27	37.716,82	114.765,88
	3.402.252,45	0,00	0,00	0,00	3.439.969,27	37.716,82	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	5.045.816,14	0,00	0,00	0,00	5.289.585,22	243.769,08	600.852,44
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	5.414.143,49	0,00	0,00	0,00	5.558.696,11	144.552,62	618.617,54
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	6.018.934,49	0,00	0,00	0,00	6.611.627,98	592.693,49	683.838,49
	16.478.894,12	0,00	0,00	0,00	17.459.909,31	981.015,19	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	15.603.831,88	0,00	0,00	0,00	16.036.379,33	432.547,45	1.726.278,21
	15.603.831,88	0,00	0,00	0,00	16.036.379,33	432.547,45	

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII	660.229,08	0,00	0,00	0,00	31.500,00	624.322,56	-4.406,52	-167.567,89
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPFF11	1.143.827,72	0,00	0,00	0,00	9.300,00	1.170.710,48	36.182,76	31.553,77
	1.804.056,80	0,00	0,00	0,00	40.800,00	1.795.033,04	31.776,24	

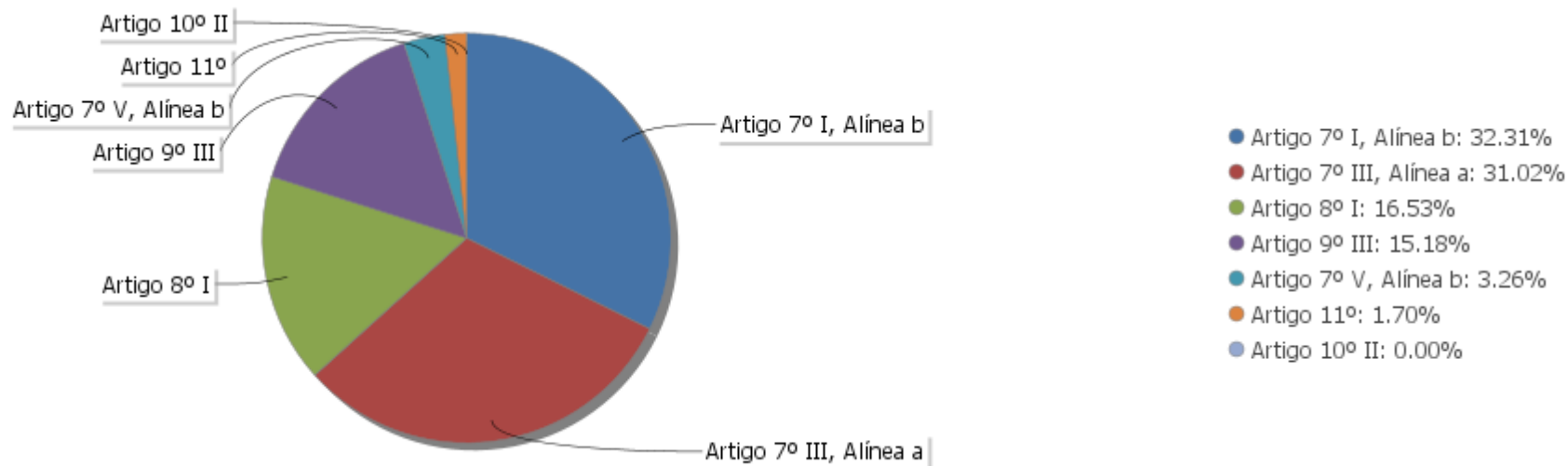
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

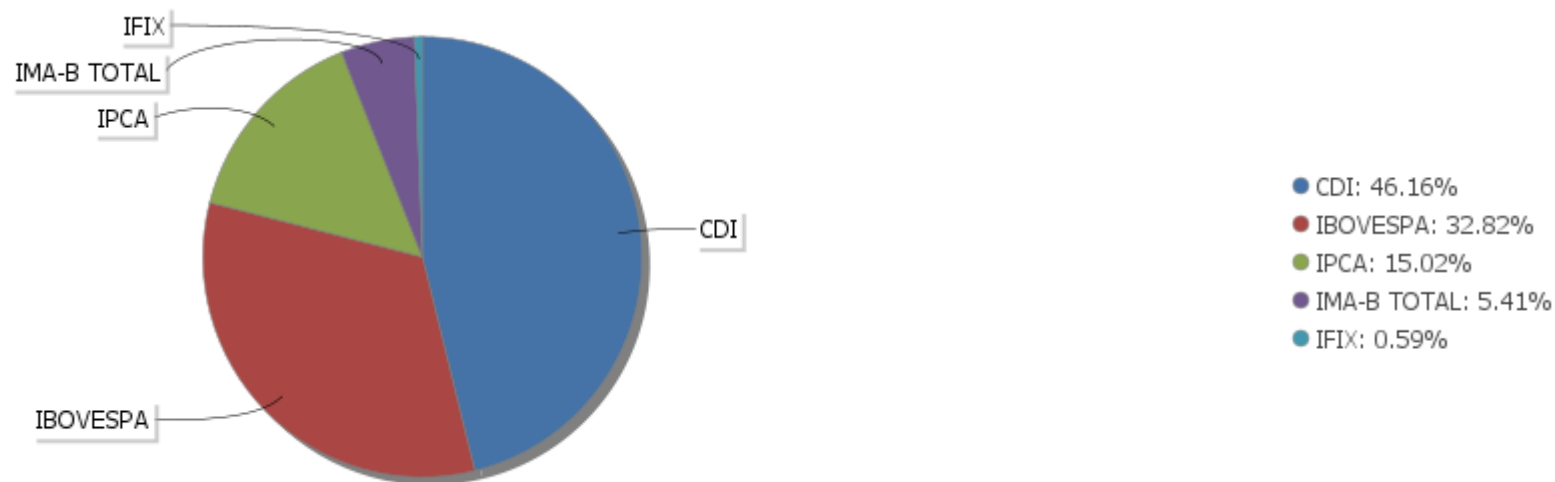
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	84.106.015,15	79,62		84.106.015,15	79,62	
de 31 dias a 365 dias	21.524.201,14	20,38		105.630.216,29	100,00	
acima de 365 dias	0,00	0,00		105.630.216,29	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

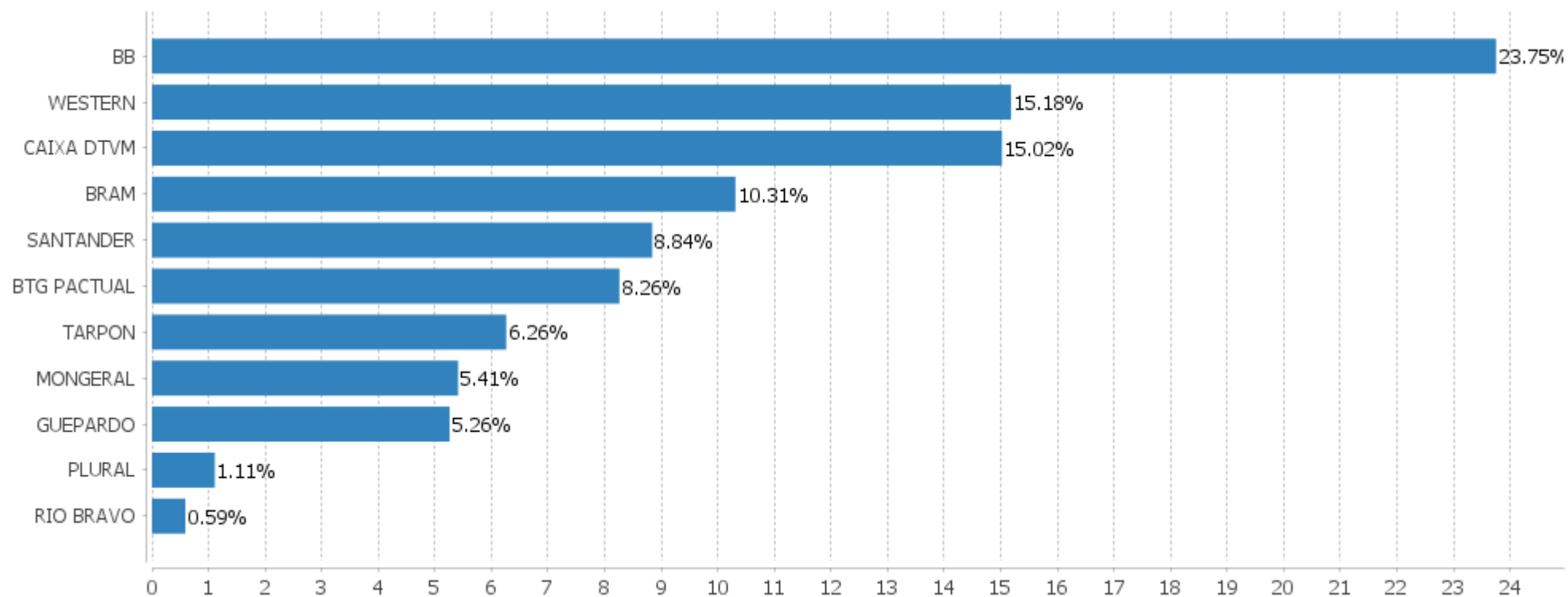


Alocação Por Estratégia



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
2023	1,47	0,21	0,79	0,91	2,49	1,90	1,38	0,21	0,83	-0,07	3,24	2,18	16,62
IPCA + 5,06%	0,96	1,20	1,16	0,97	0,66	0,33	0,53	0,68	0,65	0,65	0,67	0,95	9,85
p.p. indexador	0,50	-0,98	-0,38	-0,06	1,83	1,57	0,85	-0,48	0,18	-0,73	2,56	1,23	6,77
2022	-0,88	-0,07	2,24	-1,55	0,28	-0,99	1,83	0,42	0,63	2,02	-0,13	0,25	4,05
IPCA + 4,89%	0,94	1,37	2,04	1,42	0,89	1,07	-0,28	0,08	0,11	0,97	0,79	1,04	10,94
p.p. indexador	-1,82	-1,44	0,20	-2,97	-0,61	-2,06	2,12	0,35	0,52	1,05	-0,92	-0,79	-6,89
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

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	28	46,67
Meses abaixo - Meta Atuarial	32	53,33

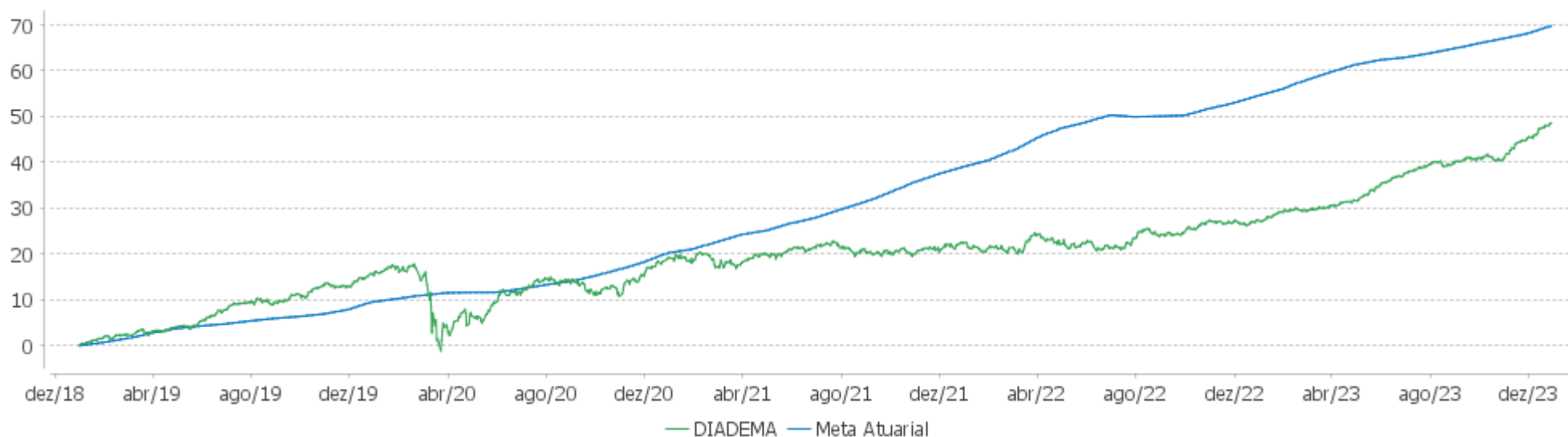
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,93	2020-11
Menor rentabilidade da Carteira	-9,14	2020-03

Relatório

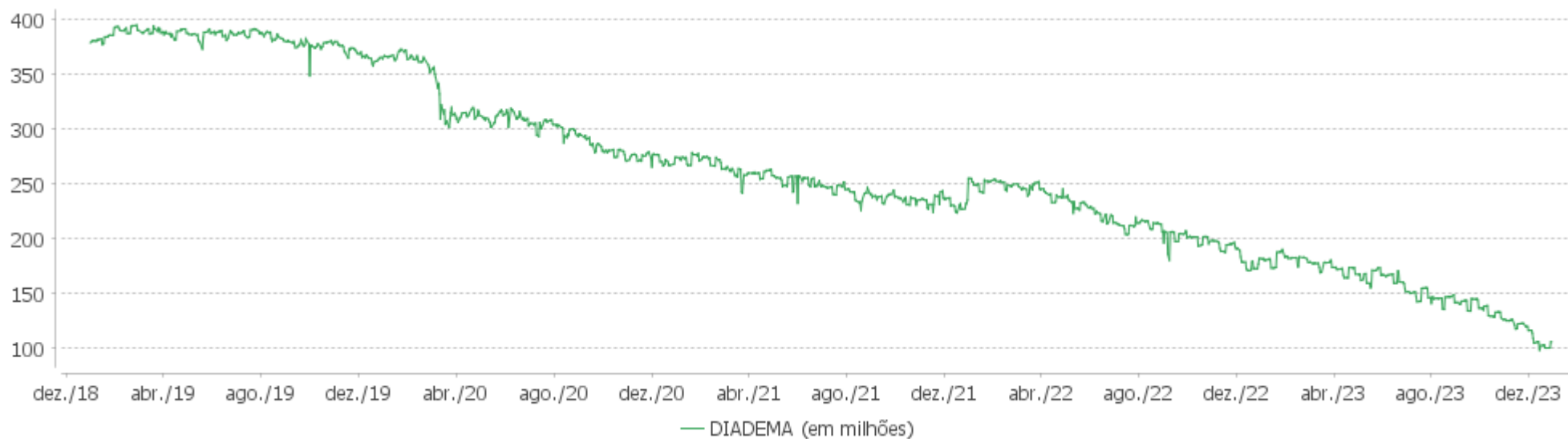
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	5,41	2,30	3,11	2,96
06 meses	7,98	4,22	3,76	2,68
12 meses	16,62	9,85	6,77	2,40
24 meses	21,35	21,86	-0,52	3,47
36 meses	24,66	41,39	-16,74	4,00
48 meses	28,88	56,43	-27,56	7,30
60 meses	48,61	73,00	-24,39	6,70
Desde 31/12/2018	48,61	73,00	-24,39	6,70

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

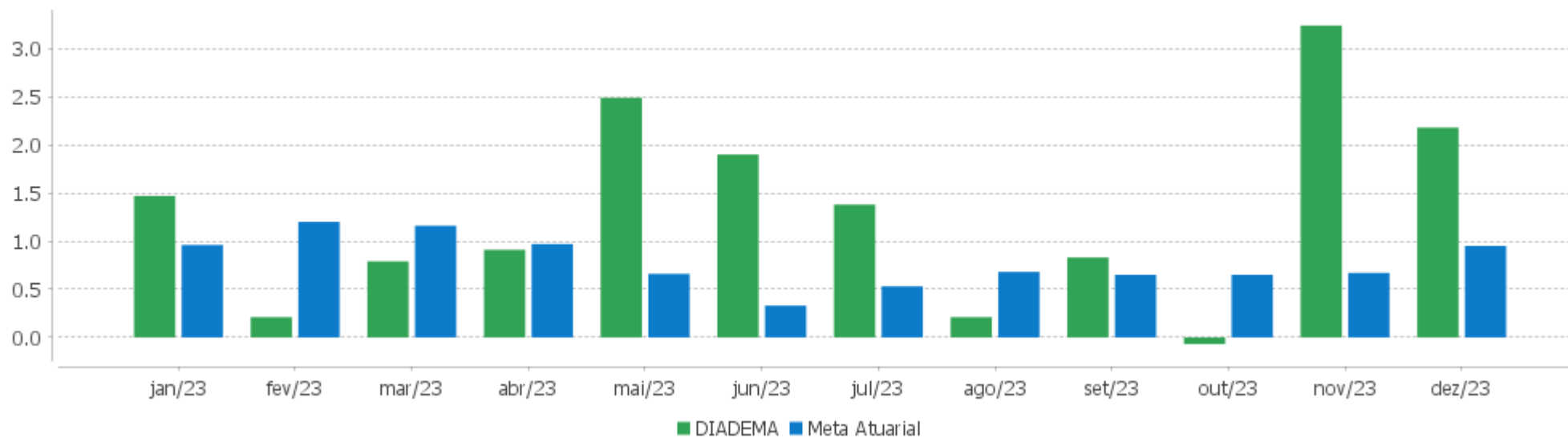


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO % do CDI	1,11 123,68	3,45 121,61	3,45 121,61	8,65 140,63	13,15 100,81	29,26 108,24	39,81 122,04
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RF LONGO PRAZO Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,68 -0,07	4,65 -0,11	4,65 -0,11	3,91 -0,30	15,83 -0,22	22,61 -0,84	20,38 -1,51
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	1,21 0,65	2,92 1,84	2,92 1,84	4,92 3,22	13,59 8,96	25,74 15,07	25,60 3,79
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO % do CDI	0,90 99,89	2,80 98,82	2,80 98,82	6,10 99,24	12,98 99,51	26,98 99,81	32,56 99,81
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,94 104,62	3,01 106,08	3,01 106,08	6,66 108,27	13,63 104,43	28,40 105,03	34,74 106,51
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,90 100,65	2,83 99,76	2,83 99,76	6,15 99,95	12,98 99,47	27,20 100,61	33,08 101,42
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	0,94 105,16	2,93 103,08	2,93 103,08	6,55 106,52	13,34 102,25	27,93 103,31	34,33 105,25
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	4,83 -0,55	12,81 -2,30	12,81 -2,30	8,59 -5,04	15,82 -6,46	10,40 -17,61	-24,69 -37,43
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	9,85 4,46	11,54 -3,58	11,54 -3,58	24,45 10,82	55,36 33,08	78,35 50,34	107,80 95,06
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	2,67 -2,71	12,52 -2,59	12,52 -2,59	16,24 2,61	41,44 19,16	47,88 19,87	62,60 49,86
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	2,77 -2,61	12,06 -3,05	12,06 -3,05	10,48 -3,15	32,50 10,22	-16,96 -44,97	7,11 -5,63
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	-98,75 -1.605,90	-98,70 -756,45	-99,27 -367,18	-97,75 -299,69
BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII Var. IFIX p.p.	-0,67 -4,91	-19,65 -22,52	-19,65 -22,52	-25,78 -30,73	-20,59 -36,09	-22,79 -40,85	-16,01 -31,39
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPFF11 Var. IBOVESPA p.p.	3,16 -2,22	2,76 -12,35	2,76 -12,35	5,39 -8,25	17,25 -5,04	19,50 -8,52	19,36 6,62
DIADEMA Var. IPCA + 5,06% p.p.	2,18 1,23	5,41 3,11	5,41 3,11	7,98 3,76	16,62 6,77	21,35 -0,71	24,66 -16,46
CDI	0,90	2,84	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62
IBOVESPA	5,38	15,12	15,12	13,63	22,28	28,01	12,74
INPC + 6,00%	1,02	2,20	2,20	3,95	9,85	23,32	43,97

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IPCA + 6,00%	1,03	2,52	2,52	4,68	10,82	24,24	44,91

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
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				
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPFF11	Não se aplica	Não se aplica				
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)	D+4 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)		3,00
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO			D+30	D+31	O fundo cobrara 20.00 % do que exceder 104.00 % o indice CDIE. A taxa de performance sera paga no(s) mes (es) de Janeiro e Julho	0,50
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+32		
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RF LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+2 du	D+3 du	-	0,50
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 INSTITUCIONAL I FIC FIA	D+1 du	D+1 du	D+30	D+32	O fundo cobrara 20.00 % do que exceder 100.00 % o indice IBOV_FEC. A taxa de performance sera paga no(s) mes(es) de Janeiro	
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,91	2,89	2,89	6,16	13,25	26,86	30,57	35,59	44,75
IRF-M 1+	1,73	5,05	5,05	6,37	18,52	27,30	20,95	31,18	49,86
IRF-M TOTAL	1,48	4,38	4,38	6,28	16,51	26,79	24,26	32,58	48,53
IMA-B 5	1,46	2,97	2,97	4,75	12,13	23,09	28,71	39,06	57,35
IMA-B 5+	3,94	6,42	6,42	3,80	19,28	23,21	15,14	21,47	58,36
IMA-B TOTAL	2,75	4,76	4,76	4,21	16,05	23,45	21,89	29,69	59,46
IMA-GERAL TOTAL	1,63	3,81	3,81	5,67	14,80	25,89	27,10	33,88	51,04
IDKA 2	1,45	2,89	2,89	5,00	12,13	22,60	28,70	39,79	56,32
IDKA 20	6,58	10,28	10,28	3,92	27,13	24,70	6,62	8,97	57,20
CDI	0,90	2,84	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62	36,29	44,42

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	5,38	15,12	15,12	13,63	22,28	28,01	12,74	16,03	52,68
IBRX 100	5,48	14,95	14,95	13,77	21,27	26,15	12,05	15,97	54,69
IBRX 50	5,31	14,43	14,43	14,39	20,06	26,93	13,55	17,66	51,96
SMALL CAP	7,05	11,48	11,48	3,40	17,12	-0,52	-16,63	-17,18	31,02
Índice Consumo - ICON	5,98	12,32	12,32	-1,29	6,98	-20,15	-40,99	-40,51	-7,65
Índice Dividendos - IDIV	6,90	14,61	14,61	16,04	26,84	42,88	33,72	32,38	92,17

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	2,43	7,54	7,54	7,67	15,27	-13,18	18,31	77,33	137,73

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	4,25	2,86	2,86	4,95	15,50	18,06	15,37	3,56	40,82

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	2,70	7,01	7,01	6,95	11,43	-16,44	4,80	54,48	99,34

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,56	1,08	1,08	1,70	4,62	10,67	21,81	27,31	32,79
INPC	0,55	0,77	0,77	0,99	3,71	9,86	21,02	27,61	33,33
IGPM	0,74	1,84	1,84	1,34	-3,18	2,10	20,25	48,08	58,89
SELIC	0,90	2,84	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62	36,29	44,42

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,87	2,05	2,05	3,70	8,76	19,63	36,91	48,80	61,44
IPCA + 5,00%	0,95	2,28	2,28	4,19	9,79	21,92	40,87	54,57	69,32
IPCA + 5,50%	0,99	2,40	2,40	4,44	10,30	23,08	42,88	57,51	73,37
IPCA + 5,89%	1,02	2,49	2,49	4,63	10,71	23,98	44,46	59,84	76,59
IPCA + 6,00%	1,03	2,52	2,52	4,68	10,82	24,24	44,91	60,50	77,50
INPC + 4,00%	0,86	1,73	1,73	2,98	7,80	18,75	36,03	49,15	62,09
INPC + 6,00%	1,02	2,20	2,20	3,95	9,85	23,32	43,97	60,89	78,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1347	05/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.647.598,14	552.050,06014896	2,9845085780
1338	05/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	65.000,00	21.779,12989734	2,9845085780
1353	06/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	3.392.886,29	0,00	1.136.287,02476658	2,9859412420
1354	10/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.947,80	0,00	1.655,46774645	2,9887625480
1339	10/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	20.000,00	6.691,73267491	2,9887625480
1348	11/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.167.767,64	390.541,57946031	2,9901237190
1346	11/10/2023	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,00	8.000.000,00	2.428.362,65069963	3,2944008580
1340	11/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	60.000,00	20.066,05934689	2,9901237190
1349	20/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.374.539,53	0,00	1.458.970,75964964	2,9983736830
1341	23/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	15.000,00	5.000,21255904	2,9998724700
1350	24/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	19.639,82	0,00	6.543,85388983	3,0012619980
1342	25/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	135.000,00	44.960,51786129	3,0026344540
1343	27/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	105.000,00	34.936,40730738	3,0054607240
1357	27/10/2023	WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC	0,00	4.938.832,22	2.741,61995605	1.801,4284617000
1351	30/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.859.236,64	618.331,23474788	3,0068619140
1344	30/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	45.000,00	14.965,76872735	3,0068619140
1352	31/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.850.640,01	0,00	615.179,07522757	3,0082947950
1345	31/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	12.000,00	3.988,97076841	3,0082947950
1355	31/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.733.790,55	576.336,65187391	3,0082947950
1364	01/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	3.322,52890900	3,0097556030
1365	03/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	16.604,56850838	3,0112194710
1376	03/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.147.907,02	713.301,38526459	3,0112194710
1366	06/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	15.000,00	4.979,12645628	3,0125766300
1361	08/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	179.133,64	0,00	59.408,57673610	3,0152824700
1377	09/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	12.461,42	0,00	4.130,92379846	3,0166182210
1367	10/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	15.000,00	4.970,22379679	3,0179727540
1358	13/11/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	5.000.000,00	20.216,16198400	247,3268667000
1383	14/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.288.279,93	1.088.583,97795400	3,0206947710

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1368	14/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	70.000,00	23.173,47673523	3,0206947710
1379	14/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	900.000,00	297.944,70088153	3,0206947710
1378	14/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	54.256,31	17.961,53339321	3,0206947710
1369	17/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.000,00	1.653,74697186	3,0234371310
1380	17/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.376.306,08	0,00	1.447.460,58554640	3,0234371310
1370	21/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	8.000,00	2.643,57886927	3,0262006150
1371	24/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	85.000,00	28.050,34070168	3,0302662240
1360	27/11/2023	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	3.000.000,00	1.597.357,33227000	1,8781019997
1372	27/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.000.000,00	0,00	329.853,06671064	3,0316528810
1359	27/11/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.000.000,00	4.026,79827500	248,3362542000
1375	30/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	70.000,00	23.058,14234414	3,0358039670
1382	30/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.115.553,14	1.355.671,57324292	3,0358039670
1381	30/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	245.591,49	0,00	80.898,33621329	3,0358039670
1400	05/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	80.000,00	26.315,62712200	3,0400187550
1392	05/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	500.000,00	164.472,66951100	3,0400187550
1388	05/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.676.672,97	551.533,75854700	3,0400187550
1385	06/12/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	5.000.000,00	20.064,52250500	249,1960623000
1401	07/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	65.000,00	21.361,37668500	3,0428750430
1390	07/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	29.024,90	9.538,64341800	3,0428750430
1389	07/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.383.574,13	1.440.602,74183300	3,0428750430
1387	11/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	702.394,54	0,00	230.621,59336100	3,0456581700
1391	13/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.000.000,00	328.035,11657400	3,0484541120
1402	14/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	16.394,25822400	3,0498482650
1394	14/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	31.500,00	0,00	10.328,38268100	3,0498482650
1384	14/12/2023	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,00	7.289.927,49	2.169.976,79196300	3,3594495190
1395	15/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.178.956,92	0,00	1.369.615,38321900	3,0511901160
1396	19/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	301.709,52	0,00	98.795,68510000	3,0538734530
1403	21/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	60.000,00	19.630,22200010	3,0565115360
1393	21/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.000.000,00	981.511,10004500	3,0565115360
1397	21/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	200.000,00	0,00	65.434,07333600	3,0565115360

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1404	22/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	90.000,00	29.432,47001500	3,0578473350
1386	22/12/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	4.499,15	17,95416800	250,5908485000
1398	27/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	31.443,17	0,00	10.273,74280000	3,0605370030
1405	28/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	3.265,99020200	3,0618585430
1399	28/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	5.115.145,84	0,00	1.670.601,61929800	3,0618585430
Total			26.017.296,07	62.876.920,23		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.844.561,45

Value-At-Risk: 1,75%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,34	0,33		0,12	0,65	1,12	70.338.894,61	66,59
Artigo 8º	12,01	7,87		1,09	0,42	5,95	17.459.909,31	16,53
Artigo 9º	9,29	6,32		0,53	0,20	2,77	16.036.379,33	15,18
Artigo 10º	NaN	NaN		0,00	NaN	NaN	0,00	0,00
Artigo 11º	7,15	0,51		-0,00	0,12	1,76	1.795.033,04	1,70
DIADEMA		1,75		1,75			105.630.216,29	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,33%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RF LONGO PRAZO	3,06	2,17	0,07	0,06	0,58	2,68	5.716.084,53	5,41
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,02	0,02	-0,00	0,01	-0,05	0,90	12.545.625,10	11,88
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,60	0,72	0,06	0,71	0,52	1,21	15.868.666,00	15,02
Sub-total	0,63	0,68	0,12		0,63	1,30	34.130.375,63	32,31

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,02	0,02	0,00	0,01	0,27	0,90	12.536.955,12	11,87
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,04	0,03	-0,00	0,03	1,15	0,94	9.339.239,05	8,84
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,03	0,03	-0,00	0,02	1,38	0,94	10.892.355,54	10,31
Sub-total	0,03	0,02	-0,00		1,25	0,93	32.768.549,71	31,02

Artigo 7º V, Alínea b

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO	0,40	0,19	-0,00	0,19	0,53	1,11	3.439.969,27	3,26
Sub-total	0,40	0,19	-0,00		0,53	1,11	3.439.969,27	3,26

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,87%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	10,89	8,64	0,42	5,07	0,82	9,85	6.611.627,98	6,26
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	14,17	8,35	0,35	3,61	0,28	4,83	5.289.585,22	5,01
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	13,42	8,01	0,33	3,93	0,13	2,67	5.558.696,11	5,26
Sub-total	12,01	7,87	1,09		0,42	5,95	17.459.909,31	16,53

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,32%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	9,29	6,32	0,53	9,14	0,20	2,77	16.036.379,33	15,18
Sub-total	9,29	6,32	0,53		0,20	2,77	16.036.379,33	15,18

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 0,51%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPFF11	11,05	0,16	0,00	7,22	0,21	3,16	1.170.710,48	1,11
BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII	2,38	1,43	-0,00	2,65	-0,66	-0,67	624.322,56	0,59
Sub-total	7,15	0,51	-0,00		0,12	1,76	1.795.033,04	1,70

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: NaN%

Artigo 10º II

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)

(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)