



LDB
EMPRESAS

DIADEMA
FEVEREIRO 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 28.02.2023.

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 79,17%

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	Ano				
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC	0,08	0,05	0,92	2,04	17.653.225,74	9,89	725.833.248,79	2,43
BB	BB	BB PREV RF IPCA	1,84	0,08	0,91	2,43	9.983.087,76	5,59	3.864.016.961,46	0,26
BB	BB	BB PREV IPCA I	1,27	0,05	0,90	2,02	15.411.326,17	8,64	177.537.393,20	8,68
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,78	0,05	0,97	2,01	16.980.215,30	9,51	5.085.339.032,83	0,33
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,45	0,06	0,93	2,09	60.027.854,97	33,63		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,08	0,05	0,80	1,90	10.497.401,75	5,88	15.513.886.886,32	0,07
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,09	0,05	0,85	1,99	29.358.037,25	16,45	13.891.144.708,98	0,21
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,09	0,05	0,81	1,87	23.185.722,09	12,99	2.976.038.258,45	0,78
BRAM	BRANDESCO	BRANDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,06	0,05	0,88	2,02	9.779.456,26	5,48	8.371.920.489,79	0,12
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,75	0,05	0,83	1,94	72.820.617,35	40,80		

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	Ano				
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	1,15	0,01	-0,09	-0,57	5.411.237,31	3,03	936.050.292,26	0,58
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO	0,99	0,02	0,08	-0,32	3.030.400,85	1,70	2.865.606.379,69	0,11
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			1,86	0,01	-0,03	-0,48	8.441.638,16	4,73		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

1,17

0,05

0,82

1,85

141.290.110,48

79,17

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

12,07%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	19,82	-1,11	-5,37	-2,86	4.483.110,93	2,51	876.824.136,01	0,51
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	22,48	-0,92	-6,29	-1,93	4.479.139,60	2,51	1.337.859.374,92	0,33
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	19,75	-0,63	-6,44	-3,86	4.583.026,32	2,57	901.055.650,43	0,51
GUEPARDO	DAYCOVAL	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	23,42	1,06	-3,69	-4,58	3.749.976,46	2,10	188.530.137,50	1,99
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT 30 FIC FIA	21,82	0,67	-2,53	-0,24	4.245.591,28	2,38	590.438.062,23	0,72
Sub-total Artigo 8º I			19,66	-0,25	-4,96	-2,69	21.540.844,59	12,07		
Renda Variável			19,66	-0,25	-4,96	-2,69	21.540.844,59	12,07		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

7,31%

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	Ano				
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	29,30	0,46	2,51	7,75	13.040.101,36	7,31	1.429.443.520,56	0,91
Sub-total Artigo 9º III			29,30	0,46	2,51	7,75	13.040.101,36	7,31		
Investimentos no Exterior			29,30	0,46	2,51	7,75	13.040.101,36	7,31		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

0,01%

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
PÁTRIA	PÁTRIA	PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	117,52	0,53	0,53	1,23	18.435,45	0,01	2.507.814,62	0,74
Sub-total Artigo 10º II			117,52	0,53	0,53	1,23	18.435,45	0,01		
Investimentos Estruturados			17,73	0,53	0,53	1,23	18.435,45	0,01		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

1,45%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
PLURAL	GENIAL	BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPF11	7,29	0,00	0,12	-1,41	1.068.095,88	0,60	319.882.325,95	0,33
RIO BRAVO	BB	BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII	48,32	0,00	1,97	2,91	1.515.275,70	0,85	30.913.214,77	4,90
Sub-total Artigo 11º			29,76	0,00	1,20	1,08	2.583.371,58	1,45		
Fundos Imobiliários			29,76	0,00	1,20	1,08	2.583.371,58	1,45		
Total			4,00	0,04	0,21	1,68	178.472.863,46	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	60.027.854,97	33,63	0,00	31,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	72.820.617,35	40,80	0,00	45,00	60,00	0,00	65,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	8.441.638,16	4,73	0,00	4,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	141.290.110,48	79,17					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	21.540.844,59	12,07	0,00	9,00	30,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	21.540.844,59	12,07					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	13.040.101,36	7,31	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	13.040.101,36	7,31					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º II	Fundo de Participação	18.435,45	0,01	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	18.435,45	0,01					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	2.583.371,58	1,45	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	2.583.371,58	1,45					5,00
Total		178.472.863,46	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	0,93 100,97	2,09 101,96	3,21 100,44	6,00 93,14	12,03 92,56	551.399,42	1.229.997,78
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,83 90,70	1,94 94,40	3,10 96,83	6,30 97,69	12,22 93,99	627.892,94	1.464.815,06
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	-0,03 -2,84	-0,48 -23,37	0,73 22,69	3,98 61,70	10,12 77,87	-2.205,37	-40.671,10
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-4,96 2,53	-2,69 1,69	-5,69 1,02	-6,02 -1,83	-5,58 1,68	-1.124.563,71	-594.405,76
Artigo 9º III % do CDI	2,51 273,10	7,75 377,50	3,69 115,46	1,64 25,41	-13,96 -107,38	318.973,69	937.412,26
Artigo 10º II % do CDI	0,53 57,57	1,23 60,09	1,46 45,79	2,56 39,65	-42,51 -327,04	96,94	224,52
Artigo 11º % do CDI	1,20 130,63	1,08 52,70	1,20 37,61	22,48 348,79	-0,94 -7,23	30.711,67	27.619,27
DIADEMA (Total)						402.305,58	3.024.992,03

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	15.273.205,81	0,00	0,00	0,00	15.411.326,17	138.120,36	305.276,73
BB PREV RF IPCA	9.892.583,67	0,00	0,00	0,00	9.983.087,76	90.504,09	236.770,15
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	16.817.922,34	0,00	0,00	0,00	16.980.215,30	162.292,96	334.714,94
WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC	17.492.743,73	0,00	0,00	0,00	17.653.225,74	160.482,01	353.235,96
					60.027.854,97	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	33.207.381,57	11.799.022,85	-15.913.083,91	0,00	29.358.037,25	264.716,74	624.438,35
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	9.694.270,12	0,00	0,00	0,00	9.779.456,26	85.186,14	193.276,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.414.152,18	0,00	0,00	0,00	10.497.401,75	83.249,57	195.969,46
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	24.201.190,14	0,00	-1.210.208,54	0,00	23.185.722,09	194.740,49	451.130,96
					72.820.617,35	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\$)
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO	3.027.960,26	0,00	0,00	0,00	3.030.400,85	2.440,59	-9.697,58
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	5.415.883,27	0,00	0,00	0,00	5.411.237,31	-4.645,96	-30.973,52
					8.441.638,16	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	4.737.648,37	0,00	0,00	0,00	4.483.110,93	-254.537,44	-132.139,18
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	4.779.863,41	0,00	0,00	0,00	4.479.139,60	-300.723,81	-87.988,50
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	3.893.733,32	0,00	0,00	0,00	3.749.976,46	-143.756,86	-180.012,85
OCCAM FIC FIA	4.898.421,39	0,00	0,00	0,00	4.583.026,32	-315.395,07	-184.105,11
TARPON GT 30 FIC FIA	4.355.741,81	0,00	0,00	0,00	4.245.591,28	-110.150,53	-10.160,12
					21.540.844,59	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	12.721.127,67	0,00	0,00	0,00	13.040.101,36	318.973,69	937.412,26
					13.040.101,36	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	18.338,51	0,00	0,00	0,00	18.435,45	96,94	224,52
					18.435,45	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 Financ. Ano (R\$)
BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII	1.493.392,03	0,00	0,00	0,00	7.500,00	1.515.275,70	29.383,67	43.209,31
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPFF11	1.076.067,88	0,00	0,00	0,00	9.300,00	1.068.095,88	1.328,00	-15.590,04
						2.583.371,58	0,00	0,00

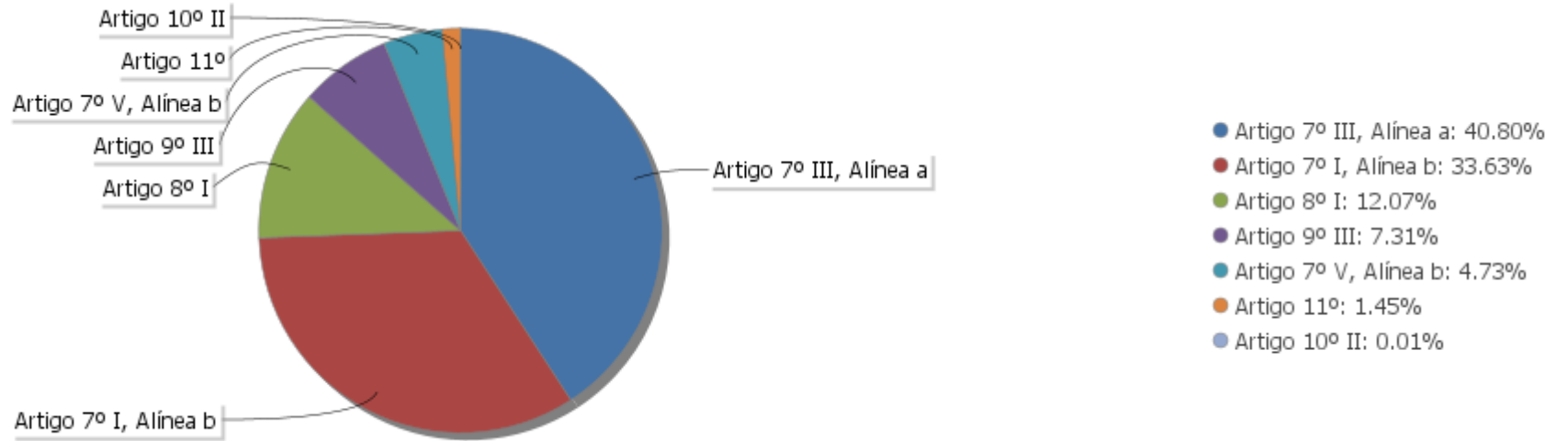
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

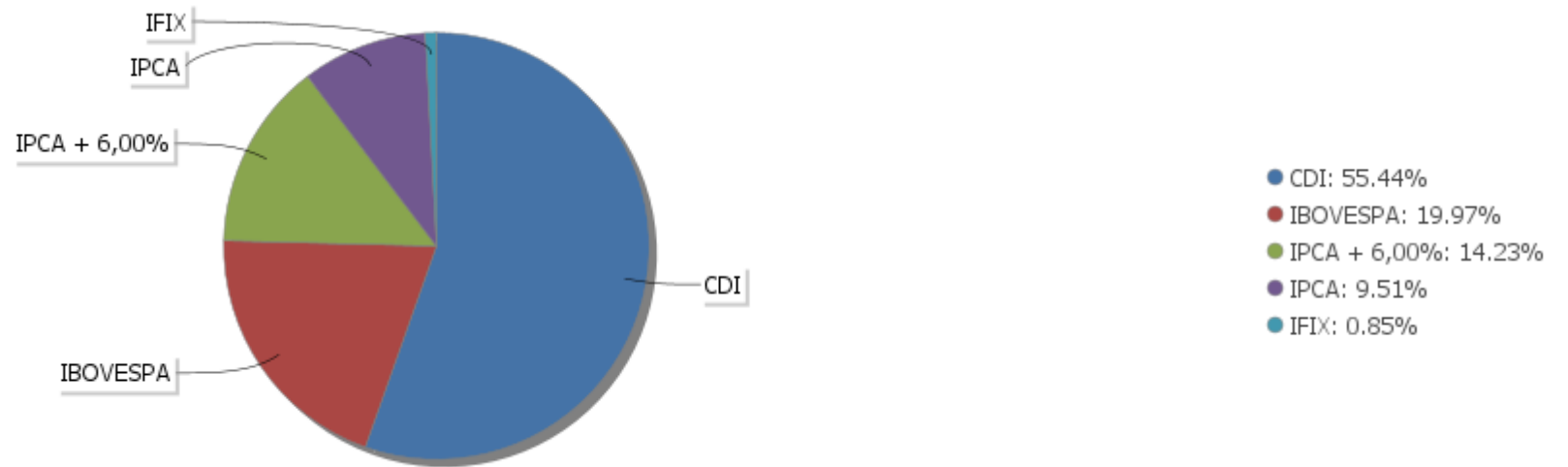
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	151.469.391,81	84,87	151.469.391,81	84,87
de 31 a 365 dias	25.488.195,95	14,28	176.957.587,76	99,15
acima de 365 dias	1.515.275,70	0,85	178.472.863,46	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

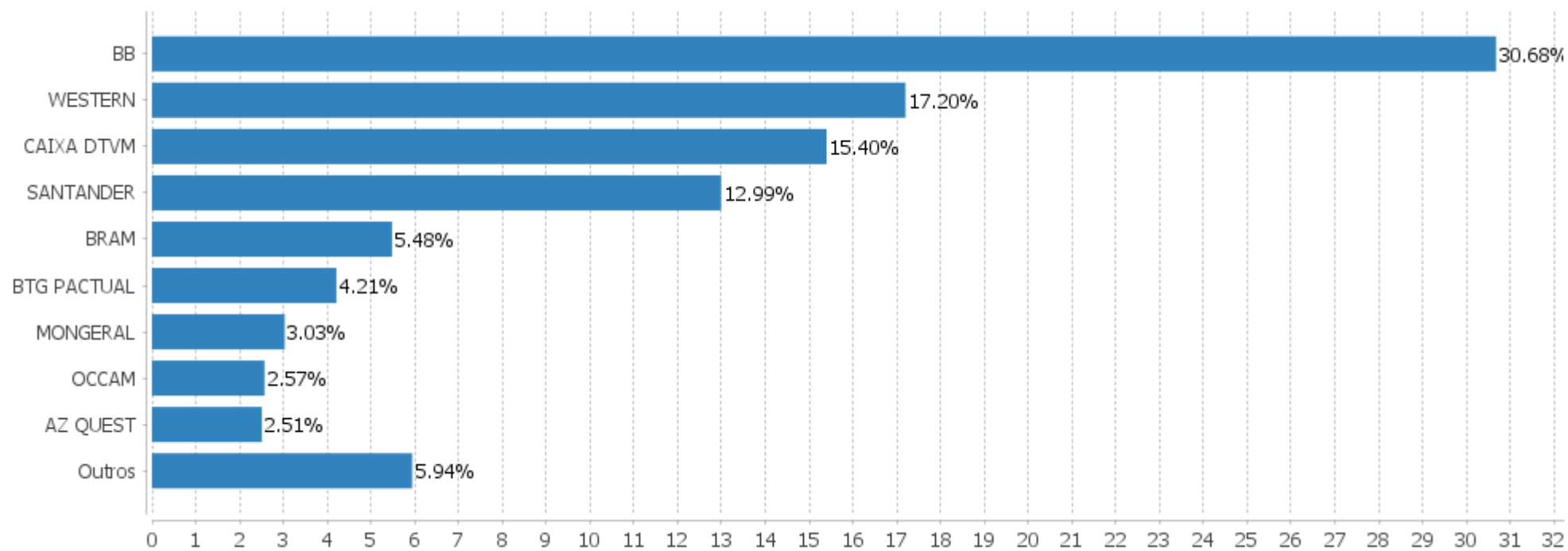


Alocação Por Estratégia



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											1,68
IPCA + 5,06%	0,96	1,20											2,17
p.p. indexador	0,50	-0,98											-0,49
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	22	44,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	28	56,00

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

Relatório

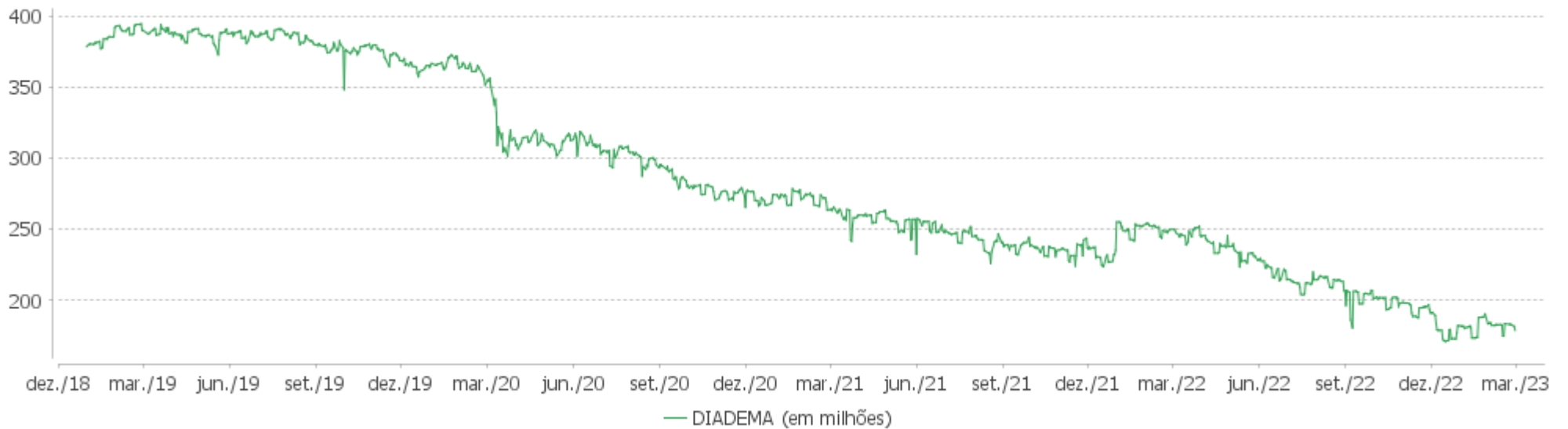
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,94	3,23	-1,29	2,10
06 meses	4,52	5,18	-0,66	2,57
12 meses	6,82	10,77	-3,95	4,00
24 meses	10,67	29,03	-18,36	4,24
36 meses	13,33	43,52	-30,20	8,17
48 meses	26,55	58,16	-31,61	7,39
Desde 31/12/2018	29,57	60,91	-31,34	7,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

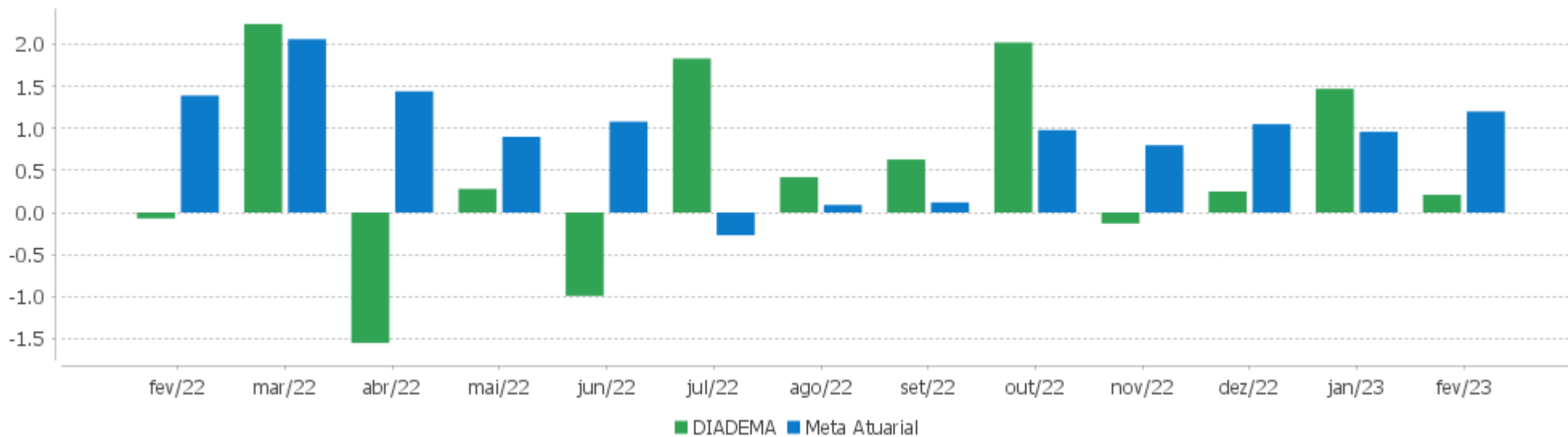


Patrimônio Líquido



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
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO % do CDI	0,08 8,78	-0,32 -15,55	0,87 27,29	4,46 69,23	11,83 91,03	21,69 111,93	
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO % do CDI	-0,09 -9,34	-0,57 -27,74	0,64 20,11	4,13 64,13	11,09 85,29	19,46 100,41	19,80 89,15
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,90 -0,36	2,02 -0,30	3,16 -0,32	6,36 0,67	14,40 2,49	23,72 -7,44	32,62 -13,53
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,91 -0,35	2,43 0,11	3,41 -0,07	6,59 0,90	12,46 0,55	19,86 -11,30	27,66 -18,49
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,97 0,13	2,01 0,64	3,17 1,17	5,58 2,85	11,28 5,68	13,35 -3,38	18,61 -4,18
WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC % do CDI	0,92 99,92	2,04 99,52	3,19 99,61	6,45 100,15	12,93 99,46	19,65 101,42	
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,88 95,71	2,02 98,27	3,21 100,23	6,59 102,33	13,45 103,47	20,58 106,19	22,79 102,60
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,85 93,00	1,99 96,86	3,13 97,93	6,42 99,60	13,03 100,24	19,82 102,28	22,25 100,19
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,80 87,07	1,90 92,72	3,07 96,12	6,38 99,03	12,99 99,95	19,80 102,18	22,20 99,96
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	0,81 87,91	1,87 90,90	3,02 94,56	6,37 98,90	13,14 101,09	20,38 105,16	22,46 101,12
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-6,29 1,20	-1,93 2,45	-4,93 1,78	-6,11 -1,92	-9,07 -1,81	-34,17 -29,53	-27,40 -28,13
TARPON GT 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,53 4,96	-0,24 4,14	-4,99 1,72	-1,71 2,48	7,65 14,91	31,82 36,46	75,43 74,70
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,69 3,80	-4,58 -0,20	-7,72 -1,00	-8,27 -4,08	-1,24 6,02	19,59 24,23	
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-5,37 2,12	-2,86 1,51	-4,61 2,10	-8,39 -4,20	-12,30 -5,04	-18,97 -14,33	-22,46 -23,19
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-6,44 1,05	-3,86 0,51	-6,42 0,29	-5,48 -1,28	-6,65 0,61	-6,34 -1,71	3,54 2,81
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	2,51 10,00	7,75 12,12	3,69 10,41	1,64 5,83	-13,96 -6,70	-17,03 -12,40	37,36 36,63
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	0,53	1,23	1,46	2,56	-42,51	97,07	-99,28

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	57,57	60,08	45,79	39,65	-327,04	500,88	-446,98
BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII Var. IFIX p.p.	1,97 2,42	2,91 4,95	3,30 5,35	45,31 50,95	-0,95 -3,40	10,91 13,62	20,07 25,31
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPF11 Var. IBOVESPA p.p.	0,12 7,62	-1,41 2,96	-1,65 5,07	-5,37 -1,18	1,50 8,76	-0,58 4,06	-9,27 -10,00
DIADEMA Var. IPCA + 5,06% p.p.	0,21 -0,98	1,68 -0,49	1,94 -1,31	4,52 -0,72	6,82 -4,10	10,67 -18,17	13,33 -28,98
CDI	0,92	2,05	3,20	6,44	13,00	19,38	22,21
IBOVESPA	-7,49	-4,38	-6,72	-4,19	-7,26	-4,64	0,73
INPC + 6,00%	1,19	2,17	3,40	5,43	11,77	31,30	47,73
IPCA + 6,00%	1,26	2,32	3,48	5,69	11,91	31,16	46,15

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 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				
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
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 indice	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					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
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	0,98	2,09	3,30	6,49	12,81	17,61	21,23	29,14	38,03
IRF-M 1+	0,79	1,51	3,16	4,25	9,06	7,22	10,24	25,91	40,07
IRF-M TOTAL	0,86	1,71	3,21	4,93	10,13	10,66	13,99	27,51	40,19
IMA-B 5	1,41	2,82	3,79	5,87	11,57	18,62	26,01	41,34	55,61
IMA-B 5+	1,17	-0,11	-1,30	0,52	4,86	0,42	1,37	23,71	45,02
IMA-B TOTAL	1,28	1,28	1,08	3,02	7,94	8,94	12,38	32,61	51,33
IMA-GERAL TOTAL	1,03	1,74	2,52	4,81	10,51	13,70	17,46	30,71	43,72
IDKA 2	1,62	3,08	4,36	6,05	11,25	18,71	26,96	41,17	55,55
IDKA 20	0,79	-3,83	-7,02	-4,75	-2,27	-14,73	-16,36	6,39	31,39
CDI	0,92	2,05	3,20	6,44	13,00	19,38	22,21	29,03	37,30

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-7,49	-4,38	-6,72	-4,19	-7,26	-4,64	0,73	9,78	22,94
IBRX 100	-7,59	-4,34	-6,85	-4,76	-8,23	-5,60	0,93	12,19	26,64
IBRX 50	-7,54	-4,41	-6,85	-3,59	-7,74	-3,34	4,52	11,43	23,50
SMALL CAP	-10,52	-7,90	-10,68	-16,48	-20,21	-30,84	-29,32	-4,09	7,17
Índice Consumo - ICON	-9,78		-12,01	-20,80	-30,44	-45,20	-44,63	-25,38	-25,80
Índice Dividendos - IDIV	-7,55	-2,11	-3,69	-0,84	5,04	14,70	10,65	34,58	57,47

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-0,54	3,21	-4,28	0,94	-8,25	-1,90	55,57	98,62	134,79

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-0,45	-2,05	-2,05	-5,64	2,45	-2,71	-5,24	15,36	21,50

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,92	3,71	-1,93	3,17	-8,75	-9,86	42,01	74,04	94,86

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,84	1,37	2,00	2,73	5,60	16,73	22,79	27,71	32,68
INPC	0,77	1,23	1,93	2,47	5,47	16,86	24,12	28,99	34,07
IGPM	-0,06	0,15	0,60	-1,88	1,86	18,28	52,51	62,91	75,30
SELIC	0,92	2,05	3,20	6,44	13,00	19,38	22,21	29,03	37,31

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,12	2,01	2,99	4,71	9,80	26,26	38,06	49,31	61,33
IPCA + 5,00%	1,19	2,16	3,23	5,20	10,85	28,69	42,07	55,11	69,21
IPCA + 5,50%	1,23	2,24	3,36	5,45	11,38	29,92	44,10	58,08	73,26
IPCA + 5,89%	1,25	2,30	3,45	5,64	11,79	30,89	45,70	60,42	76,48
IPCA + 6,00%	1,26	2,32	3,48	5,69	11,91	31,16	46,15	61,08	77,39
INPC + 4,00%	1,05	1,87	2,92	4,45	9,67	26,39	39,56	50,81	63,02
INPC + 6,00%	1,19	2,17	3,40	5,43	11,77	31,30	47,73	62,70	79,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1176	03/02/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.529.083,18	557.240,09576300	2,7440293540
1179	03/02/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	18.221,37942000	2,7440293540
1173	07/02/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	35.367,99	0,00	12.875,73235000	2,7468721030
1186	08/02/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	221.964,36	0,00	80.764,72274800	2,7482835630
1180	08/02/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	15.000,00	5.457,95208400	2,7482835630
1187	14/02/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	500.000,00	181.572,15907000	2,7537261360
1177	15/02/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	8.008.215,53	2.906.652,77314300	2,7551331910
1181	15/02/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	72.000,00	26.133,03786400	2,7551331910
1182	16/02/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	12.000,00	4.353,34143300	2,7565032940
1174	17/02/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.962.700,47	0,00	3.249.814,69898500	2,7579112350
1183	22/02/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	3.624,02951800	2,7593594230
1184	24/02/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	170.000,00	61.544,46197300	2,7622306630
1172	27/02/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	1.210.208,54	5.366,21181900	225,5238110000
1178	28/02/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.486.785,20	1.984.227,29533900	2,7651999410
1175	28/02/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.578.990,03	0,00	932.659,51288400	2,7651999410
1185	28/02/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	60.000,00	21.698,25013700	2,7651999410
Total			11.799.022,85	17.123.292,45		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 2.055.779,82

Value-At-Risk: 1,15%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
DIADEMA		1,15	1,15			178.472.863,46	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,09%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC		0,01	0,00	0,01			17.653.225,74	9,89
BB PREV RF IPCA		0,80	0,01	0,80			9.983.087,76	5,59
BB PREV IPCA I		0,00	-0,00	0,08			15.411.326,17	8,64
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,40	0,01	0,40			16.980.215,30	9,51
Sub-total	0,26	0,19	0,01		0,04	0,93	60.027.854,97	33,63

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			10.497.401,75	5,88
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,01	0,00	0,01			29.358.037,25	16,45
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,07	-0,00	0,07			23.185.722,09	12,99
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,03	0,00	0,03			9.779.456,26	5,48
Sub-total	0,11	0,03	-0,00		-0,75	0,83	72.820.617,35	40,80

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO		0,94	0,00	0,94			5.411.237,31	3,03
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO		0,38	0,00	0,38			3.030.400,85	1,70

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	1,21	0,73	0,00		-0,78	-0,03	8.441.638,16	4,73

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,87%

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		10,89	0,15	6,05			4.483.110,93	2,51
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		9,74	0,15	5,30			4.479.139,60	2,51
OCCAM FIC FIA		8,70	0,13	2,91			4.583.026,32	2,57
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA		12,33	0,16	6,34			3.749.976,46	2,10
TARPON GT 30 FIC FIA		11,25	0,16	7,52			4.245.591,28	2,38
Sub-total	15,27	9,87	0,75		-0,38	-4,96	21.540.844,59	12,07

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 14,16%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I		14,16	0,39	20,78			13.040.101,36	7,31
Sub-total	20,33	14,16	0,39		0,08	2,51	13.040.101,36	7,31

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 0,15%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPFF11		0,27	0,00	10,58			1.068.095,88	0,60
BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII		0,16	0,00	2,87			1.515.275,70	0,85
Sub-total	4,26	0,15	0,00		0,07	1,20	2.583.371,58	1,45

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,09%

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		0,09	0,00	0,09			18.435,45	0,01
Sub-total	1,97	0,09	0,00		-0,20	0,53	18.435,45	0,01