



LDB
EMPRESAS

DIADEMA
MAIO 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 31.05.2023.

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 81,55%

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	0,03	0,05	1,15	5,31	14.522.134,50	8,72	599.435.794,01	2,42
BB	BB	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,02	0,05	0,36	0,36	26.163.579,62	15,71	28.911.825.239,48	0,09
BB	BB	BB PREV RF IPCA	1,46	0,00	0,64	5,29	0,00	0,00	241.807.690,53	0,00
BB	BB	BB PREV IPCA I	0,98	0,00	0,75	4,92	0,00	0,00	146.538.181,29	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,62	0,04	1,81	6,03	17.649.038,84	10,60	5.078.181.389,68	0,35
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,12	0,05	1,34	5,61	58.334.752,96	35,02		

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	0,07	0,05	1,18	5,25	4.740.872,96	2,85	15.982.419.153,18	0,03
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,05	1,15	5,29	30.104.237,40	18,07	15.420.425.695,62	0,20
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,08	0,06	1,19	5,16	23.936.733,37	14,37	3.184.616.150,75	0,75
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,05	0,06	1,16	5,34	10.098.067,03	6,06	8.436.127.357,01	0,12
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,60	0,06	1,17	5,24	68.879.910,76	41,35		

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	1,20	0,07	0,73	1,12	5.503.073,95	3,30	391.001.908,94	1,41
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO	1,02	0,07	1,54	2,75	3.123.705,58	1,88	2.375.453.512,69	0,13

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea b	1,56	0,07	1,03	1,70	8.626.779,53	5,18		
		Renda Fixa	0,90	0,05	1,23	5,18	135.841.443,25	81,55		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

8,19%

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	18,39	0,00	2,47	-1,44	0,00	0,00	786.555.266,23	0,00
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	21,32	-0,32	7,44	-2,50	4.453.145,78	2,67	1.350.305.370,46	0,33
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	19,26	0,00	-0,46	-5,92	0,00	0,00	839.965.227,23	0,00
GUEPARDO	DAYCOVAL	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	22,76	-0,28	11,17	11,07	4.365.070,62	2,62	227.709.629,41	1,92
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT 30 FIC FIA	22,28	0,09	13,28	13,36	4.824.140,42	2,90	680.339.527,08	0,71
Sub-total Artigo 8º I			19,20	-0,16	8,84	4,61	13.642.356,82	8,19		
Renda Variável			19,20	-0,16	8,84	4,61	13.642.356,82	8,19		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

8,65%

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	26,91	1,09	7,09	19,05	14.408.017,00	8,65	1.435.315.451,49	1,00
Sub-total Artigo 9º III			26,91	1,09	7,09	19,05	14.408.017,00	8,65		
Investimentos no Exterior			26,91	1,09	7,09	19,05	14.408.017,00	8,65		

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	3,18	0,70	0,70	3,65	18.875,06	0,01	2.568.863,85	0,73
Sub-total Artigo 10º II			3,18	0,70	0,70	3,65	18.875,06	0,01		
Investimentos Estruturados			11,74	0,70	0,70	3,65	18.875,06	0,01		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

1,60%

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	8,75	2,42	3,28	6,63	1.126.025,54	0,68	337.231.586,24	0,33
RIO BRAVO	BB	BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII	48,26	0,63	0,96	5,80	1.537.687,27	0,92	31.366.206,76	4,90
Sub-total Artigo 11º			29,80	1,38	1,93	6,15	2.663.712,81	1,60		
Fundos Imobiliários			29,80	1,38	1,93	6,15	2.663.712,81	1,60		
Total			3,02	0,15	2,49	5,99	166.574.404,94	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	58.334.752,96	35,02	0,00	31,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	68.879.910,76	41,35	0,00	45,00	60,00	0,00	65,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	8.626.779,53	5,18	0,00	4,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	135.841.443,25	81,55					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	13.642.356,82	8,19	0,00	9,00	30,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	13.642.356,82	8,19					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	14.408.017,00	8,65	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	14.408.017,00	8,65					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º II	Fundo de Participação	18.875,06	0,01	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	18.875,06	0,01					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	2.663.712,81	1,60	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	2.663.712,81	1,60					5,00
Total		166.574.404,94	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	1,34 119,26	5,61 104,52	3,45 106,06	6,77 103,32	10,80 80,13	755.495,01	3.179.272,95
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,17 103,96	5,24 97,67	3,24 99,80	6,44 98,30	11,89 88,25	800.341,77	3.700.835,06
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	1,03 91,34	1,70 31,72	2,19 67,47	2,93 44,79	7,76 57,59	87.612,86	144.470,27
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	8,84 5,11	4,61 5,89	7,50 4,26	1,38 5,07	3,12 5,83	1.401.280,48	541.132,75
Artigo 9º III % do CDI	7,09 631,46	19,05 354,78	10,49 322,72	14,57 222,35	19,85 147,25	954.309,16	2.305.327,90
Artigo 10º II % do CDI	0,70 62,47	3,65 67,92	2,38 73,36	3,88 59,27	4,14 30,75	131,52	664,13
Artigo 11º % do CDI	1,93 171,93	6,15 114,55	5,01 154,28	6,28 95,81	-0,48 -3,56	50.529,60	155.860,50
DIADEMA (Total)						4.049.700,40	10.027.563,56

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	15.730.560,14	0,00	-15.849.139,88	0,00	0,00	118.579,74	743.090,44
BB PREV RF IPCA	10.197.353,67	0,00	-10.262.337,85	0,00	0,00	64.984,18	516.020,24
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,00	26.069.100,55	0,00	0,00	26.163.579,62	94.479,07	94.479,07
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	17.336.112,72	0,00	0,00	0,00	17.649.038,84	312.926,12	1.003.538,48
WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC	14.357.608,60	0,00	0,00	0,00	14.522.134,50	164.525,90	822.144,72
					58.334.752,96	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	25.602.691,74	31.956.383,62	-27.802.223,38	0,00	30.104.237,40	347.385,42	1.547.365,09

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	9.982.182,54	0,00	0,00	0,00	10.098.067,03	115.884,49	511.887,06
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.685.581,57	0,00	0,00	0,00	4.740.872,96	55.291,39	439.440,67
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	23.654.952,90	0,00	0,00	0,00	23.936.733,37	281.780,47	1.202.142,24
					68.879.910,76	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	3.076.195,47	0,00	0,00	0,00	3.123.705,58	47.510,11	83.607,15
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	5.462.971,20	0,00	0,00	0,00	5.503.073,95	40.102,75	60.863,12
					8.626.779,53	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	4.439.420,12	0,00	-4.549.004,50	0,00	0,00	109.584,38	-66.245,61
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	4.144.890,29	0,00	0,00	0,00	4.453.145,78	308.255,49	-113.982,32
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	3.926.606,08	0,00	0,00	0,00	4.365.070,62	438.464,54	435.081,31
OCCAM FIC FIA	4.505.547,67	0,00	-4.485.021,78	0,00	0,00	-20.525,89	-282.109,65
TARPON GT 30 FIC FIA	4.258.638,46	0,00	0,00	0,00	4.824.140,42	565.501,96	568.389,02
					13.642.356,82	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	13.453.707,84	0,00	0,00	0,00	14.408.017,00	954.309,16	2.305.327,90
					14.408.017,00	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	18.743,54	0,00	0,00	0,00	18.875,06	131,52	664,13

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					18.875,06	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	1.528.022,54	0,00	0,00	0,00	5.000,00	1.537.687,27	14.664,73	85.620,88
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPFF11	1.099.460,67	0,00	0,00	0,00	9.300,00	1.126.025,54	35.864,87	70.239,62
						2.663.712,81	0,00	

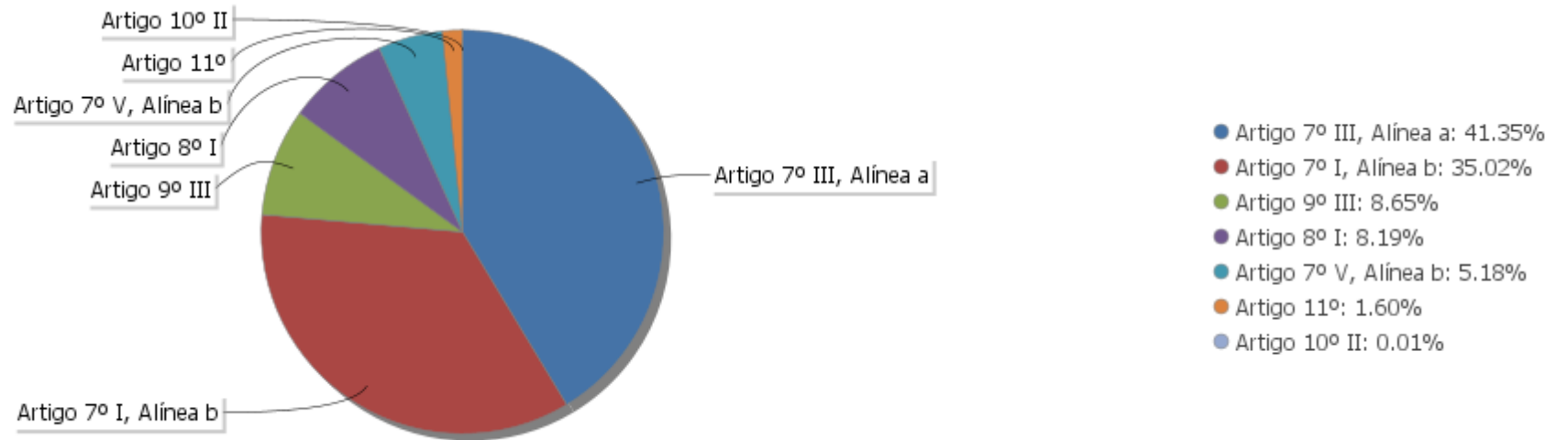
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

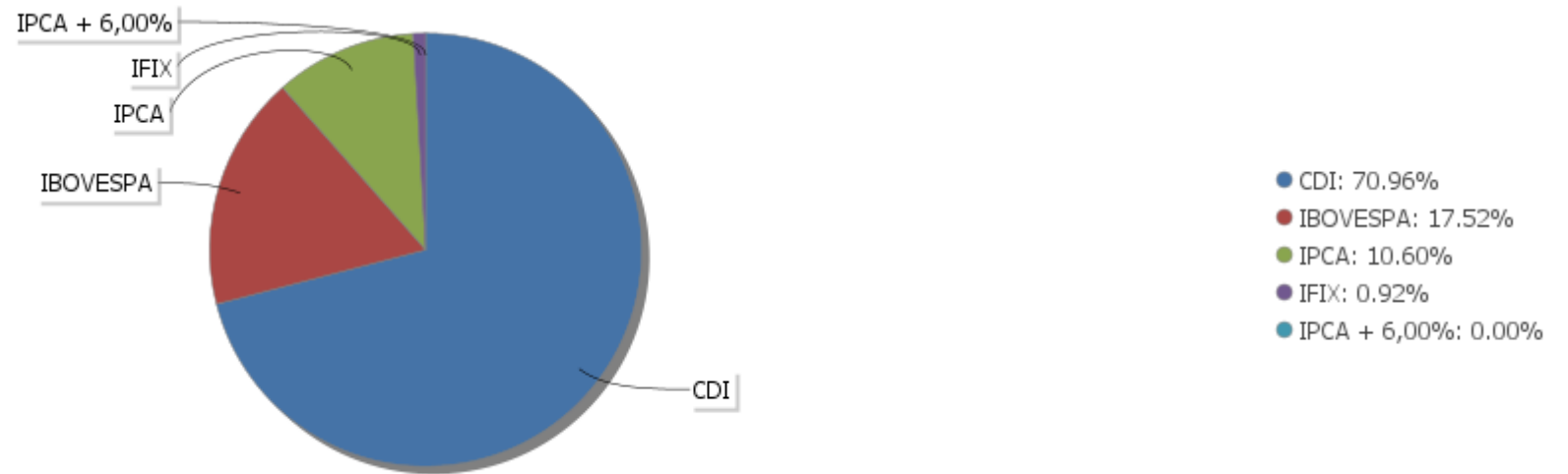
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	148.270.655,27	89,01	148.270.655,27	89,01	
de 31 dias a 365 dias	16.766.062,40	10,07	165.036.717,67	99,08	
acima de 365 dias	1.537.687,27	0,92	166.574.404,94	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

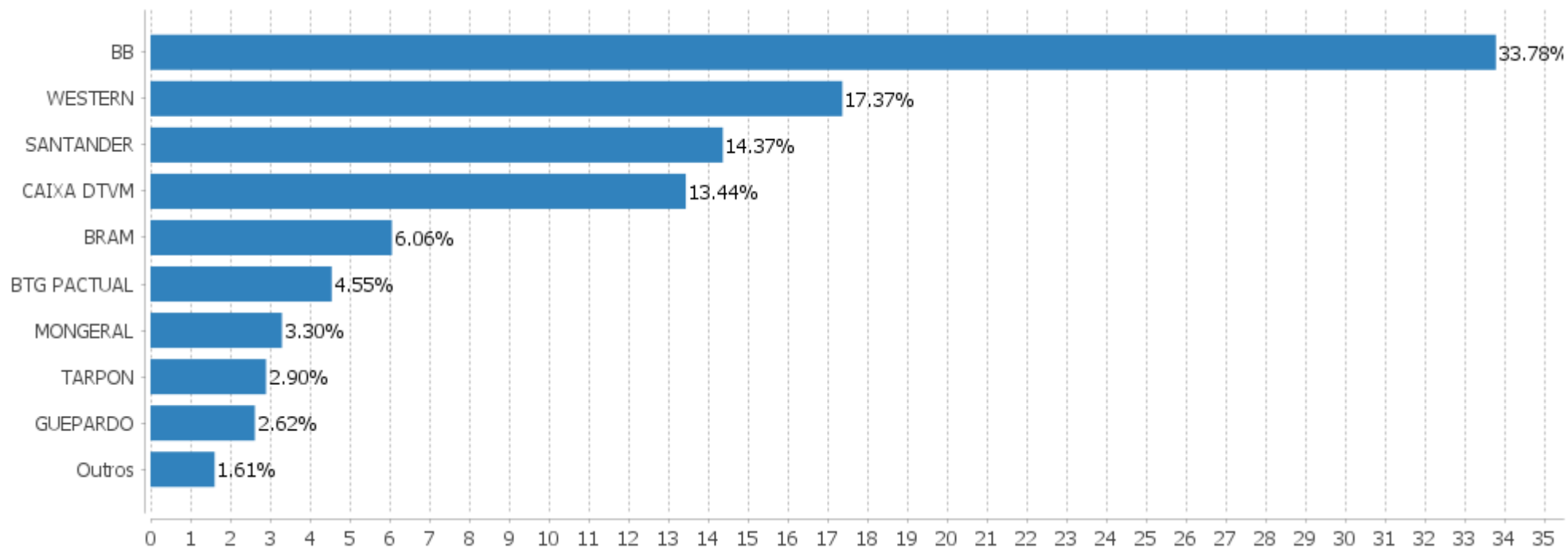


Alocação Por Estratégia



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								5,99
IPCA + 5,06%	0,96	1,20	1,16	0,97	0,66								5,05
p.p. indexador	0,50	-0,98	-0,38	-0,06	1,83								0,94
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	23	43,40
Meses abaixo - Meta Atuarial	30	56,60
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,93	2020-11
Menor rentabilidade da Carteira	-9,14	2020-03

Relatório

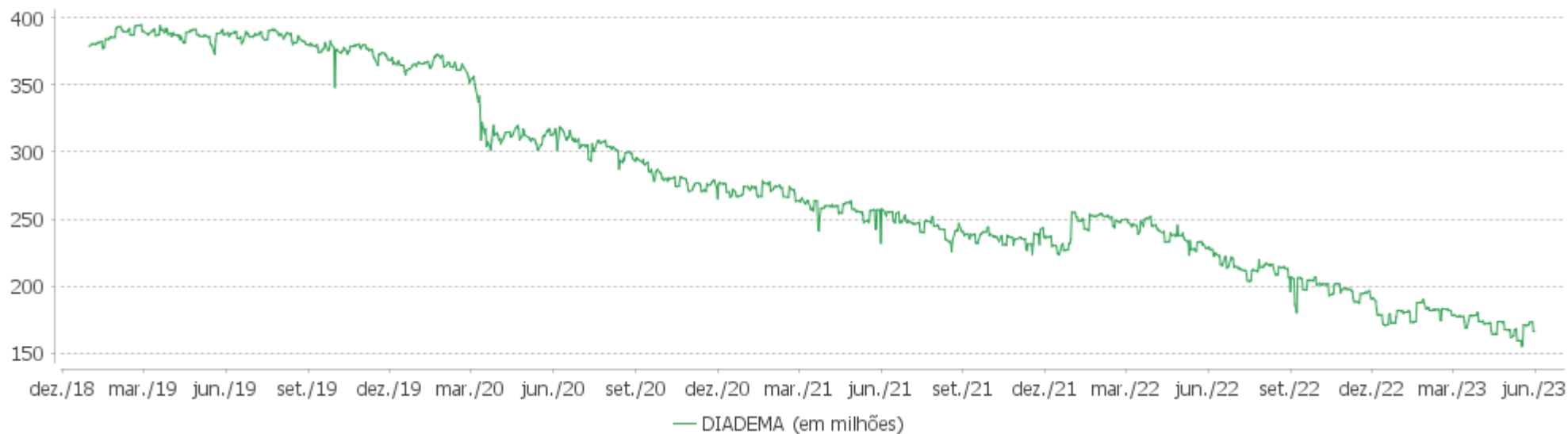
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	4,24	2,82	1,42	2,21
06 meses	6,26	6,14	0,12	2,17
12 meses	10,31	9,07	1,24	3,02
24 meses	11,64	28,22	-16,58	3,86
36 meses	23,53	46,42	-22,89	4,74
48 meses	28,12	58,01	-29,89	7,36
Desde 31/12/2018	35,06	65,44	-30,38	7,06

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

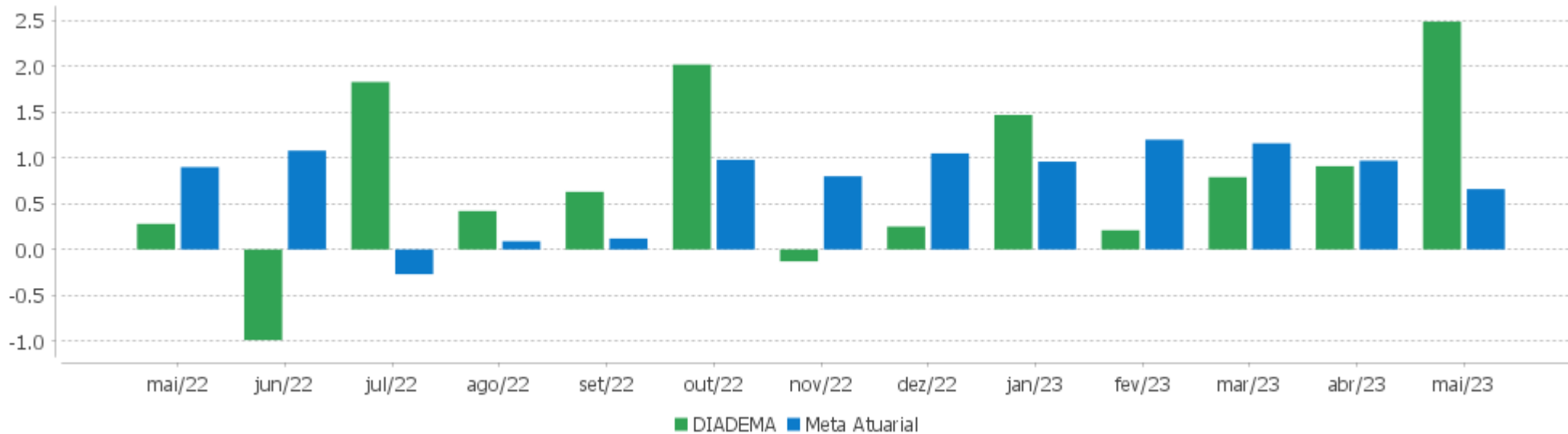


Patrimônio Líquido



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	1,54 137,49	2,75 51,22	3,08 94,72	3,98 60,72	11,52 85,47	23,49 104,70	32,96 131,33
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO % do CDI	0,73 65,35	1,12 20,83	1,70 52,21	2,35 35,88	9,60 71,21	20,01 89,18	26,86 107,02
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,11 0,37	5,29 -0,15	3,20 0,15	6,46 -0,17	12,35 2,21	25,72 -4,73	35,78 -13,61
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,19 0,45	5,87 0,44	3,36 0,31	6,88 0,25	10,46 0,32	21,15 -9,30	30,14 -19,25
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	1,81 1,58	6,03 3,08	3,94 2,38	7,24 3,65	12,48 8,55	16,41 0,28	20,43 -5,06
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO % do CDI	1,14 101,50	5,35 99,55	3,22 99,09	6,52 99,49	13,46 99,89	22,52 100,39	24,92 99,27
WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC % do CDI	1,15 102,01	5,31 98,90	3,20 98,54	6,49 99,06	13,48 100,06	22,72 101,26	24,69 98,39
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,16 103,35	5,34 99,46	3,26 100,23	6,57 100,23	13,81 102,50	23,57 105,06	26,44 105,36
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,15 102,46	5,29 98,46	3,23 99,51	6,47 98,71	13,47 99,91	22,81 101,66	25,60 102,01
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	1,18 105,05	5,25 97,76	3,28 101,03	6,46 98,57	13,49 100,10	22,99 102,48	25,62 102,07
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	1,19 106,04	5,16 96,19	3,24 99,65	6,36 97,08	13,50 100,16	23,20 103,43	26,17 104,25
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	7,44 3,70	-2,50 -1,22	-0,58 -3,82	-5,48 -1,79	-4,40 -1,69	-38,53 -24,36	-17,72 -41,67
TARPON GT 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	13,28 9,54	13,36 14,63	13,63 10,38	7,95 11,64	20,91 23,62	24,32 38,49	138,12 114,17
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	11,17 7,43	11,07 12,35	16,40 13,16	7,42 11,11	9,91 12,61	13,90 28,07	
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	4,56 0,82	0,58 1,85	3,54 0,30	-1,23 2,46	-7,32 -4,61	-25,59 -11,42	9,45 -14,50
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,44 -3,30	-5,07 -3,80	-1,26 -4,50	-7,60 -3,91	-5,85 -3,14	-17,65 -3,48	17,36 -6,59
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	7,09	19,05	10,49	14,57	19,85	-10,51	18,56

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.	3,36	20,32	7,25	18,26	22,55	3,66	-5,39
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP % do CDI	0,70 62,48	3,65 67,92	2,38 73,36	3,88 59,27	4,14 30,75	112,89 503,22	-99,26 -395,46
BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII Var. IFIX p.p.	0,96 -4,47	5,80 0,70	2,81 -4,49	6,20 1,10	-3,63 -10,47	6,97 -0,02	19,84 6,45
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPF11 Var. IBOVESPA p.p.	3,28 -0,46	6,63 7,90	8,16 4,91	6,37 10,06	7,40 10,11	10,26 24,43	8,58 -15,37
DIADEMA Var. IPCA + 5,06% p.p.	2,49 1,83	5,99 0,94	4,24 1,42	6,26 0,10	10,31 1,13	11,64 -16,51	23,53 -21,93
CDI	1,12	5,37	3,25	6,55	13,48	22,43	25,10
IBOVESPA	3,74	-1,28	3,24	-3,69	-2,71	-14,17	23,95
INPC + 6,00%	0,87	5,27	3,03	6,53	9,94	30,40	50,49
IPCA + 6,00%	0,74	5,43	3,05	6,63	10,15	30,45	49,38

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				
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
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	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					20.00 % do que exceder 100.00 % o índice 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	1,14	5,42	3,26	6,67	13,53	20,82	23,37	31,17	40,60
IRF-M 1+	2,85	8,54	6,92	10,30	15,84	14,80	14,48	30,11	50,74
IRF-M TOTAL	2,20	7,34	5,54	8,93	14,73	16,57	17,40	30,67	48,09
IMA-B 5	0,57	5,93	3,02	6,92	9,45	19,90	28,76	40,94	59,58
IMA-B 5+	4,13	11,16	11,29	9,84	11,30	11,03	22,89	28,01	69,69
IMA-B TOTAL	2,53	8,76	7,39	8,55	10,47	15,54	26,13	34,56	66,49
IMA-GERAL TOTAL	1,77	6,78	4,95	7,60	12,55	18,47	23,45	32,82	51,09
IDKA 2	0,29	5,76	2,60	7,07	8,74	18,79	28,85	40,48	57,41
IDKA 20	7,14	15,51	20,12	11,68	12,90	1,60	17,65	14,97	73,96
CDI	1,12	5,37	3,25	6,55	13,48	22,43	25,10	31,21	39,57

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,74	-1,28	3,24	-3,69	-2,71	-14,17	23,95	11,65	41,15
IBRX 100	3,59	-2,09	2,36	-4,66	-4,47	-16,34	23,50	12,48	44,21
IBRX 50	2,92	-3,51	0,95	-5,97	-4,44	-15,81	25,71	11,41	38,93
SMALL CAP	13,54	4,71	13,69	1,56	-7,34	-32,24	6,89	5,09	34,10
Índice Consumo - ICON	12,26		6,51	-6,28	-15,80	-46,84	-32,02	-26,79	-9,87
Índice Dividendos - IDIV	0,84	0,48	2,64	-1,14	-0,85	1,55	39,98	32,28	81,33

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	2,16	6,32	3,02	-1,39	9,00	-3,17	28,94	96,40	109,24

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	5,43	5,10	7,30	5,10	6,84	6,99	13,39	18,05	36,10

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	0,56	4,28	0,55	-1,39	6,70	-11,51	19,15	69,85	72,84

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,23	2,95	1,56	3,59	3,94	16,13	25,48	27,84	33,80
INPC	0,36	2,79	1,54	3,50	3,74	16,08	26,41	29,00	35,17
IGPM	-1,84	-2,58	-2,73	-2,14	-4,47	5,78	44,96	54,39	66,19
SELIC	1,12	5,37	3,25	6,55	13,48	22,43	25,10	31,21	39,57

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,57	4,62	2,56	5,63	8,08	25,59	41,11	49,48	62,68
IPCA + 5,00%	0,66	5,03	2,80	6,13	9,11	28,01	45,21	55,30	70,63
IPCA + 5,50%	0,70	5,23	2,93	6,38	9,63	29,23	47,29	58,27	74,72
IPCA + 5,89%	0,73	5,39	3,02	6,57	10,03	30,18	48,92	60,62	77,96
IPCA + 6,00%	0,74	5,43	3,05	6,63	10,15	30,45	49,38	61,28	78,88
INPC + 4,00%	0,70	4,45	2,54	5,53	7,87	25,54	42,15	50,84	64,35
INPC + 6,00%	0,87	5,27	3,03	6,53	9,94	30,40	50,49	62,75	80,72

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1241	02/05/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	3.541,65225700	2,8235409000
1242	05/05/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	55.000,00	19.448,77847000	2,8279411010
1232	05/05/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.596.261,89	564.460,79779900	2,8279411010
1220	05/05/2023	OCCAM FIC FIA	0,00	4.485.021,78	1.493.075,02184506	3,0038824000
1224	08/05/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	737.443,24	0,00	260.636,93071500	2,8293889050
1233	09/05/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.537.613,35	0,00	1.603.012,06366500	2,8306794770
1243	12/05/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	65.000,00	22.923,50348800	2,8355177050
1234	12/05/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.000.000,00	2.116.015,70655700	2,8355177050
1225	12/05/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.643.701,66	932.352,37266800	2,8355177050
1222	16/05/2023	BB PREV RF IPCA	0,00	10.262.337,85	3.387.584,73014600	3,0293966550
1226	16/05/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	9.949.484,00	0,00	3.505.315,80649300	2,8383987490
1221	17/05/2023	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	0,00	4.549.004,50	810.952,89473619	5,6094559000
1227	17/05/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	312.853,85	0,00	110.165,39796800	2,8398558510
1235	19/05/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	15.141.201,00	0,00	5.326.287,54733200	2,8427306760
1229	22/05/2023	BB PREV IPCA I	0,00	15.849.139,88	5.094.788,01308400	3,1108536480
1228	22/05/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.200.000,00	3.586.336,87839900	2,8441276840
1230	22/05/2023	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	15.365.971,15	0,00	4.902.115,65426700	3,1345590830
1223	22/05/2023	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	10.200.000,00	0,00	3.254.046,17680300	3,1345590830
1231	23/05/2023	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	503.129,40	0,00	160.429,24763800	3,1361451070
1236	24/05/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	13.590,74	4.773,56281900	2,8470851890
1244	25/05/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	140.000,00	49.146,42175200	2,8486305820
1237	26/05/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.277.788,18	0,00	448.324,29001400	2,8501426500
1246	30/05/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	55.000,00	19.277,32696100	2,8530926570
1245	30/05/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	14.000,00	4.906,95595340	2,8530926570
1238	30/05/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.990.171,85	2.450.033,24124400	2,8530926570
1239	31/05/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	0,04	0,01401200	2,8546429770
1240	31/05/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	19.497,20	6.829,99596000	2,8546429770
Total			58.025.484,17	62.947.727,39		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.587.120,41

Value-At-Risk: 0,95%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
DIADEMA		0,95	0,95			166.574.404,94	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,06%

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		0,02	0,00	0,02			14.522.134,50	8,72
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO		0,01	-0,00	0,01			26.163.579,62	15,71
BB PREV RF IPCA		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BB PREV IPCA I		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,30	0,01	0,33			17.649.038,84	10,60
Sub-total	0,38	0,09	0,01		0,58	1,34	58.334.752,96	35,02

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			4.740.872,96	2,85
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	0,00	0,02			30.104.237,40	18,07
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,07	0,00	0,07			23.936.733,37	14,37
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,03	0,00	0,03			10.098.067,03	6,06
Sub-total	0,03	0,03	0,00		1,43	1,17	68.879.910,76	41,35

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		0,85	0,00	0,85			5.503.073,95	3,30

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		0,36	0,00	0,36			3.123.705,58	1,88
Sub-total	0,49	0,66	0,00		-0,20	1,03	8.626.779,53	5,18

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 8,76%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I		8,76	0,52	13,55			14.408.017,00	8,65
Sub-total	19,60	8,76	0,52		0,30	7,09	14.408.017,00	8,65

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,36%

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		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		8,82	0,14	4,18			4.453.145,78	2,67
OCCAM FIC FIA		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA		9,95	0,14	6,19			4.365.070,62	2,62
TARPON GT 30 FIC FIA		8,93	0,14	7,12			4.824.140,42	2,90
Sub-total	13,67	8,36	0,42		0,56	8,84	13.642.356,82	8,19

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 0,47%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPPF11		0,29	0,00	8,80			1.126.025,54	0,68
BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII		0,77	0,00	2,30			1.537.687,27	0,92
Sub-total	4,74	0,47	0,00		0,17	1,93	2.663.712,81	1,60

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,16%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP		0,16	0,00	0,16			18.875,06	0,01
Sub-total	2,37	0,16	0,00		-0,18	0,70	18.875,06	0,01