



DIADEMA
4º TRIMESTRE 2024



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 31.12.2024.

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										85,14%
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.				
BB	BB	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,03	0,05	0,51	2,26	23.762.850,11	67,53	29.925.966.987,52	0,08
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,03	0,05	0,51	2,26	23.762.850,11	67,53		
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	0,06	0,04	0,80	2,56	5.250.836,57	14,92	20.140.019.415,30	0,03
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM RF REFERENCIADO DI CIC FIF RESP LIMITADA	0,08	0,04	0,84	2,58	943.834,27	2,68	3.156.991.525,99	0,03
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,06	0,04	0,80	2,56	6.194.670,84	17,60		
Renda Fixa			0,26	0,04	0,81	2,57	29.957.520,95	85,14		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

REND A VARIÁVEL

11,97%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	14,87	-0,20	-7,33	-12,73	4.211.311,04	11,97	823.495.575,02	0,51
Sub-total Artigo 8º I			14,87	-0,20	-7,33	-12,73	4.211.311,04	11,97		
Renda Variável			14,52	-0,20	-7,33	-12,73	4.211.311,04	11,97		

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 *	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	2.615.006,70	0,00
Sub-total Artigo 10º II			0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		
Investimentos Estruturados			0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

2,89%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
RIO BRAVO	BB	BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII	430,98	0,00	0,00	-100,00	0,00	0,00	0,00	
PLURAL	GENIAL	BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPFF11 *	28,18	-1,01	-0,14	-4,79	1.018.185,68	2,89	304.934.799,98	0,33
Sub-total Artigo 11º			48,73	-1,01	-0,14	-4,96	1.018.185,68	2,89		
Fundos Imobiliários			48,73	-1,01	-0,14	-4,96	1.018.185,68	2,89		
Total			2,95	-0,03	-0,68	-0,07	35.187.017,67	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								Pró-Gestão Nível 1
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	23.762.850,11	67,53	0,00	50,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	6.194.670,84	17,60	0,00	25,00	60,00	0,00	65,00
	Total Renda Fixa	29.957.520,95	85,14					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	4.211.311,04	11,97	0,00	12,00	30,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	4.211.311,04	11,97					35,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º II	Fundo de Participação	0,00	0,00	0,00	0,00	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	0,00	0,00					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	1.018.185,68	2,89	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	1.018.185,68	2,89					5,00
Total		35.187.017,67	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	Atribuição Desemp. (%)	No Trimestre (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,51 55,08	2,26 84,64	2,26 84,64	4,95 92,19	8,68 79,78	0,40	389.740,27
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,80 86,00	2,56 95,77	2,56 95,77	5,40 100,57	11,14 102,46	0,52	476.308,14
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,00 0,00	0,85 31,68	0,85 31,68	3,94 73,27	11,01 101,21	0,00	32.034,57
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-7,33 -3,04	-12,73 -3,98	-12,73 -3,98	-11,74 -8,82	-16,93 -6,57	-1,59	-614.505,45
Artigo 9º III % do CDI	0,00 0,00	-0,41 -15,54	-0,41 -15,54	1,78 33,05	36,63 336,85	0,00	-35.789,59
Artigo 11º % do CDI	-0,14 -14,97	-4,96 -185,63	-4,96 -185,63	-20,26 -377,11	-18,77 -172,60	-0,01	-53.541,10
DIADEMA (Total)						-0,68	194.246,84

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	17.386.678,45	34.569.130,46	-28.582.699,07	0,00	23.762.850,11	389.740,27
	17.386.678,45	34.569.130,46	-28.582.699,07	0,00	23.762.850,11	389.740,27

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	7.604.301,40	54.874.995,04	-57.509.368,68	0,00	5.250.836,57	280.908,81
BRADESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA	11.836.436,97	0,00	-12.008.101,70	0,00	0,00	171.664,73
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM RF REFERENCIADO DI CIC FIF RESP LIMITADA	920.099,67	0,00	0,00	0,00	943.834,27	23.734,60
	20.360.838,04	54.874.995,04	-69.517.470,38	0,00	6.194.670,84	476.308,14

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO	3.786.508,28	0,00	-3.818.542,85	0,00	0,00	32.034,57
	3.786.508,28	0,00	-3.818.542,85	0,00	0,00	32.034,57

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	4.825.816,49	0,00	0,00	0,00	4.211.311,04	-614.505,45
	4.825.816,49	0,00	0,00	0,00	4.211.311,04	-614.505,45

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	8.627.327,01	0,00	-8.591.537,42	0,00	0,00	-35.789,59
	8.627.327,01	0,00	-8.591.537,42	0,00	0,00	-35.789,59

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	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

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII	6.636,18	0,00	0,00	0,00	4.840,47	0,00	-1.795,71
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPFF11	1.097.231,07	0,00	0,00	0,00	27.300,00	1.018.185,68	-51.745,39
	1.103.867,25	0,00	0,00	0,00	32.140,47	1.018.185,68	-53.541,10

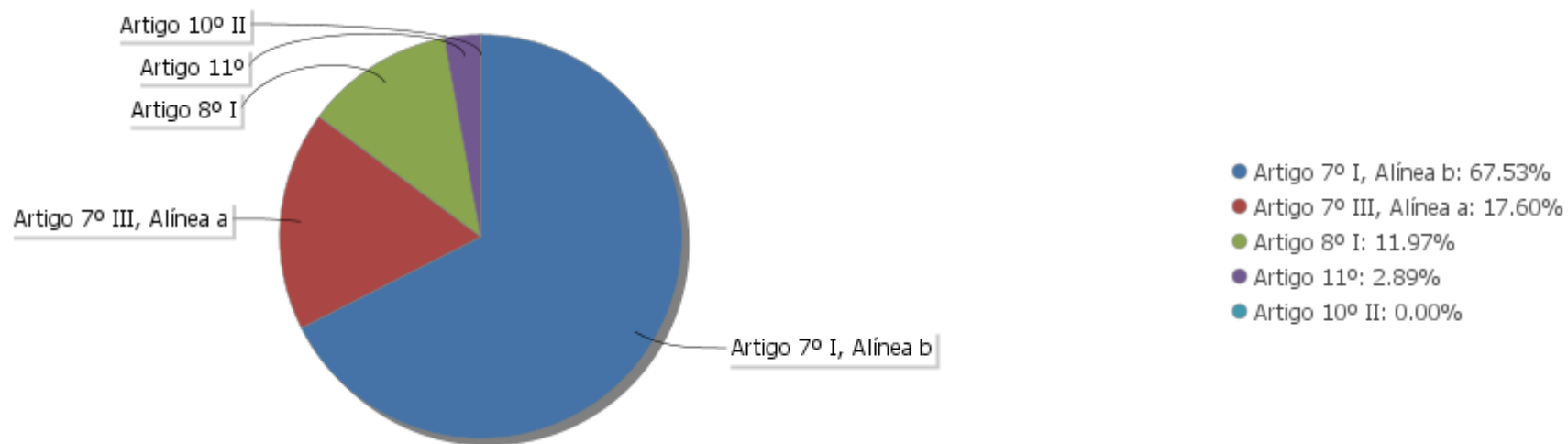
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

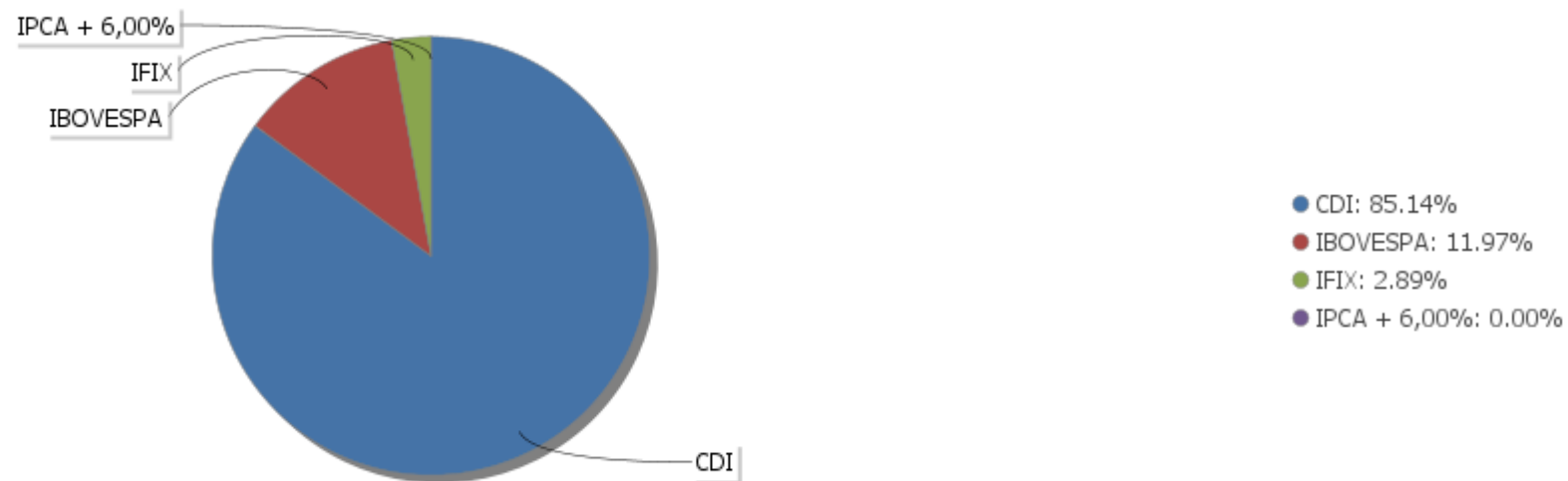
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	30.975.706,63	88,03	30.975.706,63	88,03	85,54
de 31 dias a 365 dias	4.211.311,04	11,97	35.187.017,67	100,00	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	35.187.017,67	100,00	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

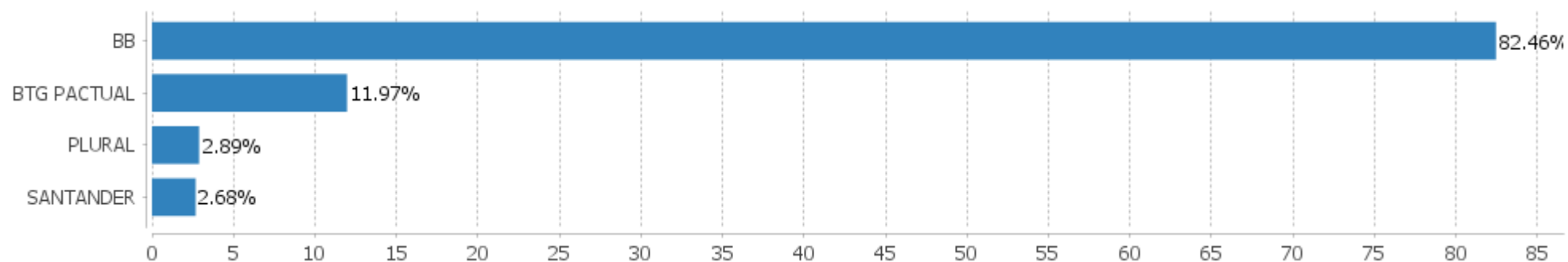


Alocação Por Estratégia



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
2024	0,92	1,51	1,25	-0,76	0,47	1,81	1,44	1,08	-0,00	0,52	0,08	-0,68	7,88
IPCA + 5,05%	0,85	1,21	0,55	0,81	0,87	0,60	0,83	0,41	0,85	1,01	0,76	0,93	10,15
p.p. indexador	0,06	0,30	0,70	-1,57	-0,41	1,21	0,61	0,67	-0,86	-0,49	-0,68	-1,61	-2,27
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

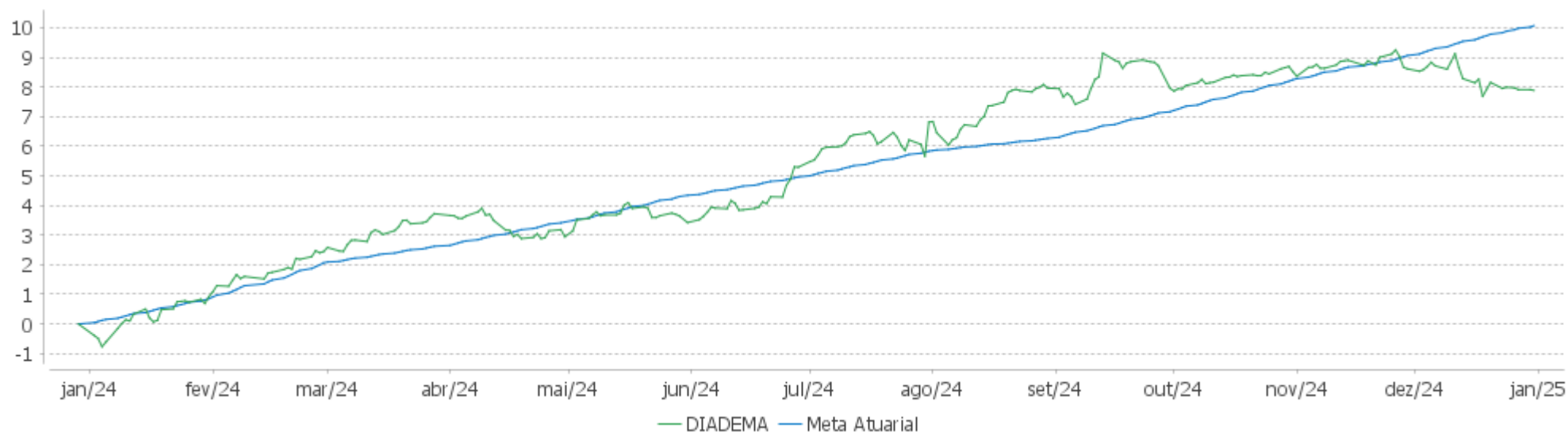
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	34	47,22
Meses abaixo - Meta Atuarial	38	52,78
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,93	2020-11
Menor rentabilidade da Carteira	-9,14	2020-03

Relatório

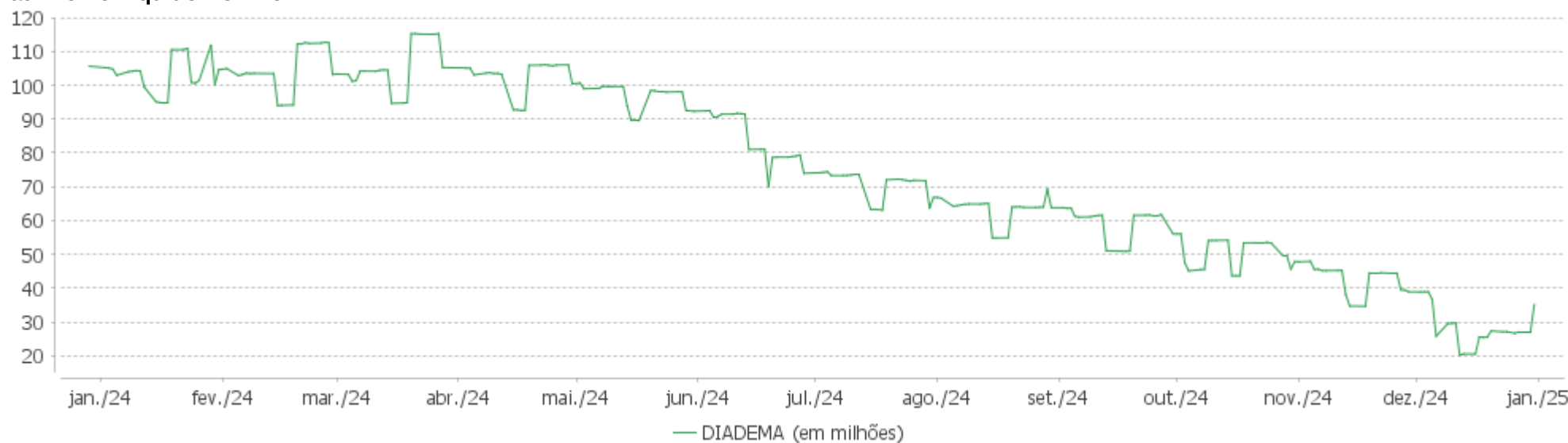
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	-0,07	2,73	-2,81	2,48
06 meses	2,46	4,90	-2,45	3,33
12 meses	7,88	10,15	-2,27	2,95
24 meses	25,81	21,00	4,81	2,70
36 meses	30,90	34,23	-3,33	3,31
48 meses	34,47	55,74	-21,27	3,76
60 meses	39,03	72,31	-33,28	6,66
Desde 31/12/2018	60,31	90,55	-30,24	6,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução No Ano

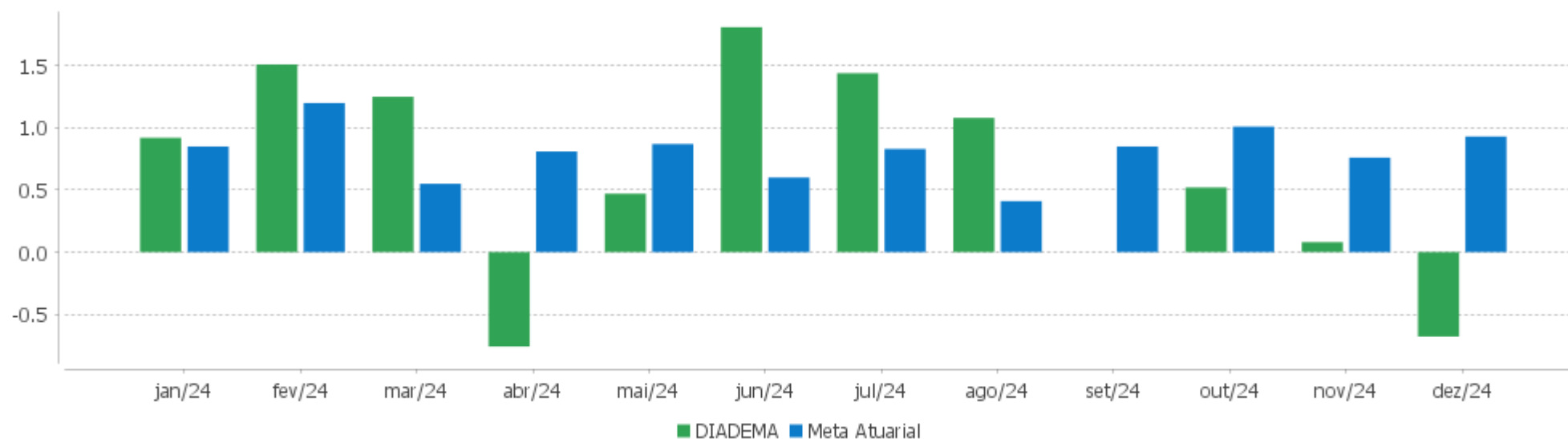


Patrimônio Líquido No Ano



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
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO % do CDI	0,89 95,66	2,64 98,98	2,64 98,98	5,35 99,51	10,82 99,51	25,21 99,48	40,72 99,69
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,80 85,86	2,56 95,76	2,56 95,76	5,36 99,72	10,88 100,04	25,27 99,72	41,04 100,46
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM RF REFERENCIADO DI CIC FIF RESP LIMITADA % do CDI	0,84 90,01	2,58 96,60	2,58 96,60	5,40 100,45	11,18 102,77	26,01 102,63	42,23 103,37
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-7,33 -3,04	-12,73 -3,98	-12,73 -3,98	-11,80 -8,88	-20,38 -10,02	-7,79 -17,40	-12,10 -26,85
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	-98,70 -389,49	-99,27 -243,01
BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,00 -1,01	72,94 69,97	72,94 69,97	-96,08 -101,46	-95,99 -107,13	-96,81 -119,99	-96,90 -134,99
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPFF11 Var. IFIX p.p.	-0,14 0,53	-4,79 0,94	-4,79 0,94	-5,59 1,31	-4,13 1,77	12,41 3,72	14,57 3,46
DIADEMA Var. IPCA + 4,98% p.p.	-0,68 -1,61	-0,07 -2,81	-0,07 -2,81	2,46 -2,45	7,88 -2,27	25,81 4,82	30,90 -3,52
CDI	0,93	2,67	2,67	5,37	10,87	25,34	40,85
IBOVESPA	-4,28	-8,75	-8,75	-2,92	-10,36	9,61	14,75
INPC + 6,00%	0,97	2,91	2,91	5,12	11,08	22,02	36,99
IPCA + 6,00%	1,01	2,97	2,97	5,39	11,15	23,17	38,09

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
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
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	Não se aplica	Não se aplica				
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM RF REFERENCIADO DI CIC FIF RESP LIMITADA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20

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	0,70	2,13	2,13	4,74	9,46	23,96	38,86	42,92	48,41
IRF-M 1+	-2,96	-4,20	-4,20	-2,02	-1,81	16,38	25,01	18,77	28,81
IRF-M TOTAL	-1,66	-1,97	-1,97	0,34	1,86	18,67	29,15	26,57	35,05
IMA-B 5	-0,28	0,82	0,82	2,75	6,16	19,03	30,68	36,64	47,63
IMA-B 5+	-4,37	-6,17	-6,17	-3,78	-8,63	8,98	12,58	5,20	10,99
IMA-B TOTAL	-2,62	-3,23	-3,23	-1,36	-2,44	13,22	20,43	18,91	26,53
IMA-GERAL TOTAL	-0,59	0,10	0,10	2,61	5,10	20,65	32,31	33,58	40,70
IDKA 2	-0,24	0,79	0,79	2,55	5,84	18,67	29,76	36,21	47,96
IDKA 20	-8,35	-12,95	-12,95	-10,03	-20,91	0,55	-1,38	-15,68	-13,82
CDI	0,93	2,67	2,67	5,37	10,87	25,34	40,85	47,04	51,11

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-4,28	-8,75	-8,75	-2,92	-10,36	9,61	14,75	1,06	4,01
IBRX 100	-4,38	-8,59	-8,59	-2,71	-9,71	9,50	13,89	1,17	4,71
IBRX 50	-4,02	-7,92	-7,92	-2,14	-8,13	10,30	16,61	4,32	8,10
SMALL CAP	-7,83	-13,16	-13,16	-11,95	-25,03	-12,20	-25,42	-37,50	-37,91
Índice Consumo - ICON	-7,28	-12,77	-12,77	-9,92	-22,56	-17,15	-38,16	-54,30	-53,93
Índice Dividendos - IDIV	-4,89	-6,59	-6,59	0,81	-2,62	23,51	39,14	30,22	28,91

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	-0,26	16,01	16,01	19,99	57,72	81,80	36,93	86,59	179,68

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-0,67	-5,74	-5,74	-6,90	-5,89	8,69	11,11	8,58	-2,54

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,22	12,27	12,27	16,86	48,02	64,93	23,68	55,12	128,67

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,52	1,48	1,48	2,29	4,83	9,68	16,02	27,69	33,46
INPC	0,48	1,43	1,43	2,04	4,77	8,65	15,10	26,79	33,70
IGPM	0,94	3,80	3,80	5,38	6,54	3,15	8,77	28,11	57,76
SELIC	0,93	2,67	2,67	5,37	10,87	25,34	40,85	47,04	51,11

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,85	2,48	2,48	4,36	9,04	18,59	30,45	49,29	62,25
IPCA + 5,00%	0,93	2,72	2,72	4,88	10,09	20,87	34,23	55,09	70,17
IPCA + 5,50%	0,97	2,84	2,84	5,13	10,62	22,02	36,15	58,05	74,24
IPCA + 5,89%	1,00	2,94	2,94	5,33	11,03	22,92	37,66	60,40	77,48
IPCA + 6,00%	1,01	2,97	2,97	5,39	11,15	23,17	38,09	61,06	78,40
INPC + 4,00%	0,81	2,43	2,43	4,10	8,98	17,48	29,41	48,24	62,54
INPC + 6,00%	0,97	2,91	2,91	5,12	11,08	22,02	36,99	59,92	78,71

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1616	02/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	3.017,02833700	3,3145197470
1630	03/10/2024	WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	0,00	8.591.537,42	984,26547807	8.728,8822085000
1623	04/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.279.555,50	687.136,35032400	3,3174718510
1615	04/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	137.000,00	41.296,50714600	3,3174718510
1622	07/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	33.543,79	0,00	10.106,70973100	3,3189624410
1627	07/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	341.794,77	0,00	102.982,41576275	3,3189624410
1628	07/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	3.012,98980563	3,3189624410
1614	08/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.000,00	1.505,82243900	3,3204446100
1621	09/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.603.995,32	0,00	2.590.245,81643000	3,3216906540
1620	15/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.548.789,19	3.171.054,11974500	3,3265875610
1619	18/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	3.365.068,45	0,00	1.010.423,10918400	3,3303557880
1613	18/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	6.365.000,00	0,00	1.911.207,21183400	3,3303557880
1612	22/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	20.000,00	6.000,55715800	3,3330238300
1618	24/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	95.818,51	0,00	28.724,51106300	3,3357751430
1611	25/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	170.000,00	50.941,47912700	3,3371626210
1629	28/10/2024	BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO	0,00	3.818.542,85	1.096.304,54341000	3,4831041000
1617	30/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.442.009,41	1.628.726,88478900	3,3412657830
1625	30/10/2024	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,00	2.300.000,00	625.785,29490600	3,6753819860
1626	30/10/2024	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	3.823.383,32	0,00	1.040.268,28627900	3,6753819860
1610	30/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	62.000,00	18.555,84201500	3,3412657830
1624	31/10/2024	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	2.301.868,52	0,00	626.035,01812700	3,6769005780
1609	31/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	15.000,00	4.487,48857300	3,3426268960
1645	04/11/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.598,10	776,61062742	3,3454345180
1651	05/11/2024	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,00	2.298.620,23	624.391,20593608	3,6813782900
1636	05/11/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	80.000,00	23.903,48306586	3,3467925900
1646	06/11/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	32.000,00	0,00	9.557,47015430	3,3481663540
1642	07/11/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	371.108,18	110.795,30921141	3,3494936080
1641	07/11/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	409,59	122,28415633	3,3494936080

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1647	11/11/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	12.157,90	0,00	3.626,75538422	3,3522801270
1637	11/11/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	2.983,04426276	3,3522801270
1643	13/11/2024	BRADESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,00	7.201.857,44	395.186,76261222	18,2239339000
1652	14/11/2024	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,00	3.291.772,23	891.547,03432134	3,6922025460
1638	14/11/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	70.000,00	20.853,87988537	3,3566895170
1648	19/11/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	9.739.126,45	0,00	2.898.886,87853292	3,3596090010
1649	22/11/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	30.266,14	0,00	9.001,16350221	3,3624697510
1639	25/11/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	190.000,00	56.482,10322034	3,3638973970
1644	27/11/2024	BRADESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,00	4.806.244,26	262.830,62498389	18,2864697000
1650	29/11/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.110.040,72	1.516.524,52421785	3,3695734150
1635	29/11/2024	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	4.701.675,09	0,00	1.268.580,05769205	3,7062501980
1640	29/11/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	70.000,00	20.774,14300825	3,3695734150
1680	02/12/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	2.966,58251358	3,3708821360
1661	05/12/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.272.501,31	673.292,39329800	3,3752071650
1679	05/12/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	80.000,00	23.702,24880700	3,3752071650
1659	06/12/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.190.000,00	648.584,48637800	3,3765840010
1660	06/12/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	47.179,53	0,00	13.972,56220600	3,3765840010
1670	06/12/2024	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,00	8.586.608,60	2.311.927,13581939	3,7140481060
1678	06/12/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	60.000,00	17.769,43798300	3,3765840010
1658	09/12/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	271.046,12	0,00	80.239,09383800	3,3779808200
1681	09/12/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	3.502.219,06	0,00	1.036.778,84707469	3,3779808200
1682	12/12/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.596.328,65	1.359.042,39617519	3,3820347790
1657	12/12/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	7.332.646,59	0,00	2.168.116,84951600	3,3820347790
1671	12/12/2024	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,00	12.105.698,01	3.254.046,17633163	3,7201985940
1656	13/12/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	507.550,04	0,00	150.008,34487200	3,3834787020
1677	13/12/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	14.777,69018300	3,3834787020
1655	17/12/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	5.006.459,55	0,00	1.478.369,10611800	3,3864746830
1654	20/12/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	9.589.122,82	0,00	2.829.486,44850500	3,3889976130
1683	20/12/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	7.735.409,66	2.282.506,67109573	3,3889976130
1676	20/12/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	65.000,00	19.179,71253500	3,3889976130

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1675	23/12/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	182.000,00	53.688,55164300	3,3899219560
1684	26/12/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	15.544.618,37	4.582.098,26528717	3,3924672650
1663	26/12/2024	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	15.106.845,74	0,00	4.045.610,50991200	3,7341325130
1669	27/12/2024	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	408.108,89	0,00	109.243,35686392	3,7357776410
1674	27/12/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	60.000,00	17.680,80605800	3,3935104430
1673	30/12/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	40.000,00	11.782,40369000	3,3948930160
1672	30/12/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	20.000,00	5.891,20184500	3,3948930160
1662	31/12/2024	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	8.227.248,90	0,00	2.200.302,16078500	3,7391450350
Total			89.444.125,50	110.510.249,72		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 333.255,48

Value-At-Risk: 0,95%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,29	0,02		-0,00	-1,21	0,57	29.957.520,95	85,14
Artigo 8º	20,64	7,92		0,95	-0,40	-7,33	4.211.311,04	11,97
Artigo 10º	NaN	NaN		0,00	NaN	NaN	0,00	0,00
Artigo 11º	4,73	0,33		0,00	-0,23	-0,14	1.018.185,68	2,89
DIADEMA		0,95		0,95			35.187.017,67	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,02%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,05	0,02	-0,00	0,02	-0,81	0,89	23.762.850,11	67,53
Sub-total	0,34	0,02	-0,00		-1,22	0,51	23.762.850,11	67,53

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	0,12	0,04	0,00	0,05	-1,14	0,80	5.250.836,57	14,92
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM RF REFERENCIADO DI CIC FIF RESP LIMITADA	0,10	0,03	-0,00	0,04	-0,94	0,84	943.834,27	2,68
Sub-total	0,11	0,04	0,00		-1,17	0,80	6.194.670,84	17,60

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,92%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	20,64	7,92	0,95	4,09	-0,40	-7,33	4.211.311,04	11,97
Sub-total	20,64	7,92	0,95		-0,40	-7,33	4.211.311,04	11,97

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: NaN%

Artigo 10º II

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

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 0,33%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII	0,00	NaN	0,00	NaN	0,00	0,00	0,00	0,00
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPFF11	4,73	0,33	0,00	4,70	-0,23	-0,14	1.018.185,68	2,89
Sub-total	4,73	0,33	0,00		-0,23	-0,14	1.018.185,68	2,89

(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 (%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

-Referente ao mês de dezembro de 2024, vale observar que:

- O fundo BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPFF11 não está aderente à Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021.