



DIADEMA
AGOSTO 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 30.08.2024.

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										75,90%
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				
BB	BB	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,05	0,04	0,87	7,07	17.243.020,18	27,03	32.995.563.494,35	0,05
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,05	0,04	0,87	5,40	17.243.020,18	27,03		
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				
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,06	0,04	0,89	7,21	14.783.578,20	23,17	20.250.525.135,03	0,07
BRABESCO	BRABESCO	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,10	0,04	0,91	7,71	11.732.603,54	18,39	15.057.333.281,43	0,08
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,08	0,04	0,91	7,44	912.106,26	1,43	3.601.057.030,35	0,03
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,06	0,04	0,90	7,44	27.428.288,00	42,99		
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				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO	0,31	0,04	0,97	9,05	3.751.400,67	5,88	3.341.865.807,69	0,11
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			0,31	0,04	0,97	9,05	3.751.400,67	5,88		
		Renda Fixa	0,39	0,04	0,90	6,55	48.422.708,85	75,90		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

7,95%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	14,95	-0,16	3,98	-4,12	5.071.508,89	7,95	1.069.944.307,95	0,47
GUEPARDO	DAYCOVAL	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	14,80	0,00	0,00	-2,23	0,00	0,00	677.135.355,32	0,00
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	16,07	0,00	0,00	-0,99	0,00	0,00	876.052.553,75	0,00
Sub-total Artigo 8º I			14,07	-0,16	3,61	0,04	5.071.508,89	7,95		
Renda Variável			14,07	-0,16	3,61	0,04	5.071.508,89	7,95		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

13,68%

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	15,98	0,78	1,93	38,83	8.729.624,83	13,68	1.844.965.501,46	0,47
Sub-total Artigo 9º III			15,98	0,78	1,93	38,83	8.729.624,83	13,68		
Investimentos no Exterior			15,98	0,78	1,93	38,83	8.729.624,83	13,68		

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	Ano				
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

2,47%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
RIO BRAVO	BB	BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII	64,79	-26,28	-25,97	-22,50	446.922,20	0,70	12.548.782,67	3,56
PLURAL	GENIAL	BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPFF11	28,00	-0,09	0,73	2,84	1.129.771,62	1,77	338.353.496,14	0,33
Sub-total Artigo 11º			34,74	-9,23	-8,61	-5,79	1.576.693,82	2,47		
Fundos Imobiliários			34,74	-9,23	-8,61	-5,79	1.576.693,82	2,47		
Total			2,87	-0,11	1,08	7,96	63.800.536,39	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	17.243.020,18	27,03	0,00	50,00	100,00	0,00	100,00	
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	27.428.288,00	42,99	0,00	25,00	60,00	0,00	65,00	
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	3.751.400,67	5,88	0,00	3,00	5,00	0,00	5,00	
Total Renda Fixa		48.422.708,85	75,90						100,00
Renda Variável									
Artigo 8º I	Fundos de Ações	5.071.508,89	7,95	0,00	12,00	30,00	0,00	35,00	
Total Renda Variável		5.071.508,89	7,95						35,00
Investimentos no Exterior									
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	8.729.624,83	13,68	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00	
Total Investimentos no Exterior		8.729.624,83	13,68						10,00
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	1.576.693,82	2,47	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00	
Total Fundos Imobiliários		1.576.693,82	2,47						5,00
Total		63.800.536,39	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	0,87 100,31	5,40 76,03	2,42 93,77	4,08 77,98	9,42 84,04	148.748,59	1.468.994,02
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,90 103,76	7,44 104,83	2,72 105,37	5,46 104,52	11,69 104,25	237.912,04	2.332.189,65
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,97 111,51	9,05 127,57	3,07 118,69	6,22 119,01	14,32 127,77	35.942,35	311.431,40
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	3,61 -2,93	0,04 -1,32	7,41 -3,98	1,47 -3,95	16,19 -1,32	194.270,18	-407.894,59
Artigo 9º III % do CDI	1,93 222,41	38,83 547,08	15,72 608,15	21,12 404,10	47,75 425,95	165.242,74	3.001.887,59
Artigo 11º % do CDI	-8,61 -992,72	-5,79 -81,65	-8,41 -325,28	-9,14 -174,76	9,72 86,72	-148.512,55	-93.439,22
DIADEMA (Total)						633.603,35	6.613.168,85

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	17.094.271,59	0,00	0,00	0,00	17.243.020,18	148.748,59	1.253.722,13
	17.094.271,59	0,00	0,00	0,00	17.243.020,18	148.748,59	

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	6.317.156,16	28.945.273,90	-20.602.206,96	0,00	14.783.578,20	123.355,10	960.040,74
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	11.626.266,68	0,00	0,00	0,00	11.732.603,54	106.336,86	840.248,00
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	903.886,18	0,00	0,00	0,00	912.106,26	8.220,08	531.900,91
	18.847.309,02	28.945.273,90	-20.602.206,96	0,00	27.428.288,00	237.912,04	

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	3.715.458,32	0,00	0,00	0,00	3.751.400,67	35.942,35	311.431,40
	3.715.458,32	0,00	0,00	0,00	3.751.400,67	35.942,35	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	4.877.238,71	0,00	0,00	0,00	5.071.508,89	194.270,18	-218.076,33
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	5.434.485,24	0,00	-5.434.485,24	0,00	0,00	0,00	-124.210,87
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	6.546.020,59	0,00	-6.546.020,59	0,00	0,00	0,00	-65.607,39
	16.857.744,54	0,00	-11.980.505,83	0,00	5.071.508,89	194.270,18	

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	8.564.382,09	0,00	0,00	0,00	8.729.624,83	165.242,74	3.001.887,59
	8.564.382,09	0,00	0,00	0,00	8.729.624,83	165.242,74	

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	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	

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	606.221,39	0,00	0,00	0,00	2.500,00	446.922,20	-156.799,19	-126.900,36
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPFF11	1.130.784,98	0,00	0,00	0,00	9.300,00	1.129.771,62	8.286,64	33.461,14
	1.737.006,37	0,00	0,00	0,00	11.800,00	1.576.693,82	-148.512,55	

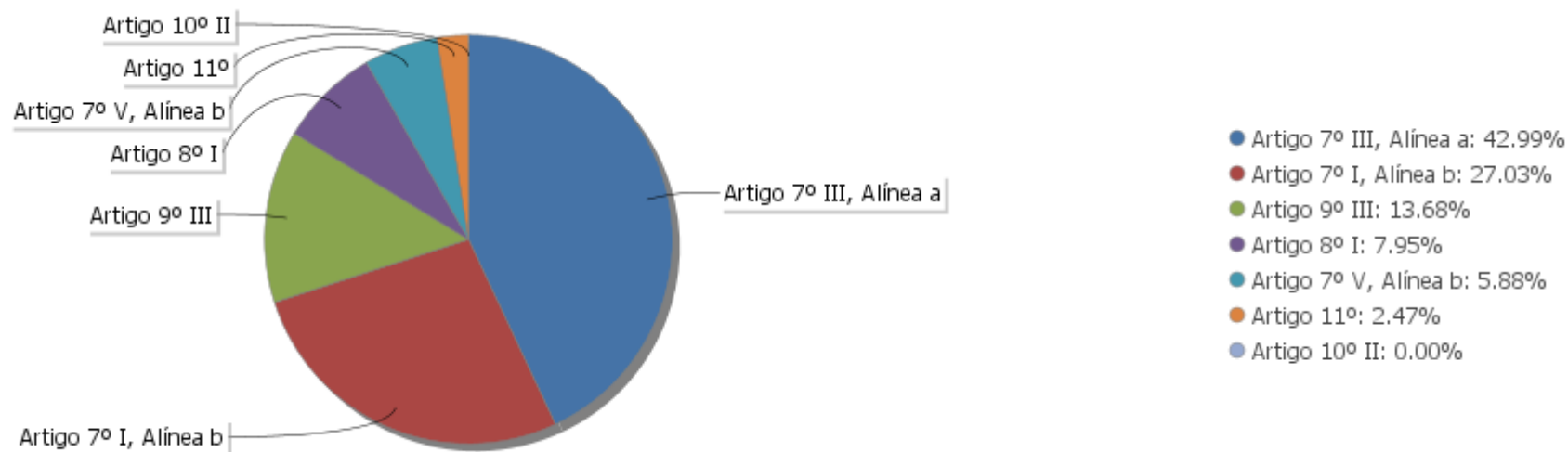
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

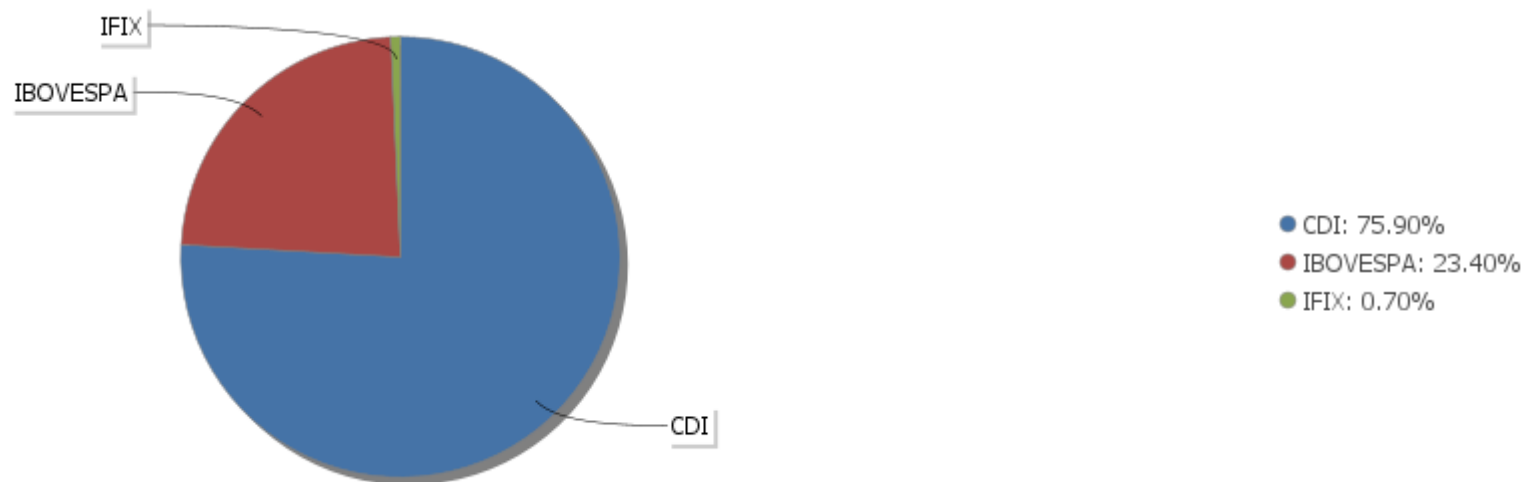
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	54.977.626,83	86,17	85,54	54.977.626,83	86,17	85,54
de 31 dias a 365 dias	8.822.909,56	13,83	14,46	63.800.536,39	100,00	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	0,00	63.800.536,39	100,00	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

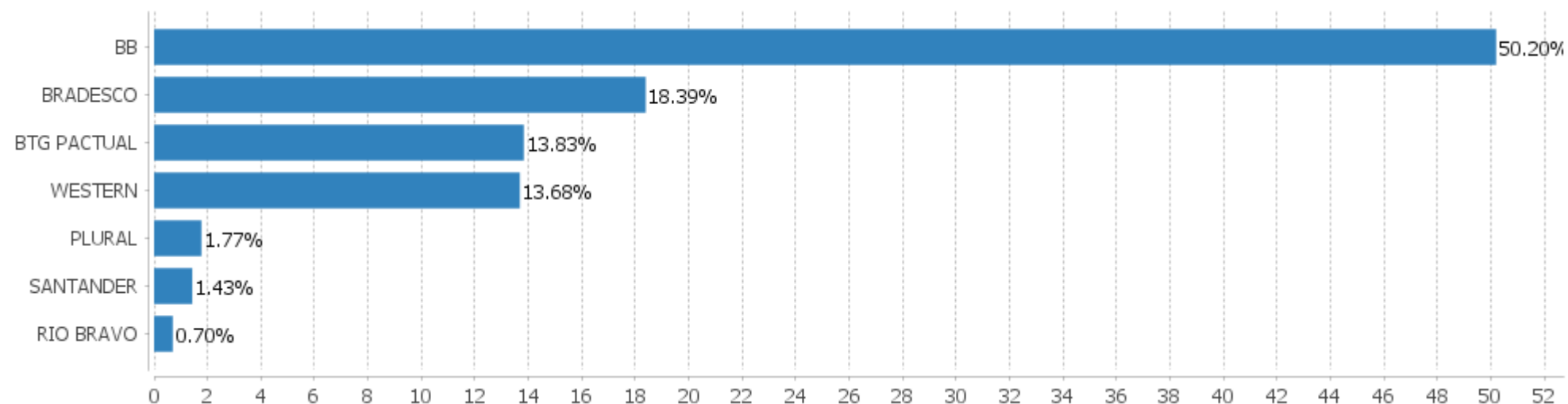


Alocação Por Estratégia



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					7,96
IPCA + 5,05%	0,85	1,21	0,55	0,81	0,87	0,60	0,83	0,41					6,31
p.p. indexador	0,06	0,30	0,70	-1,57	-0,41	1,21	0,61	0,67					1,65
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

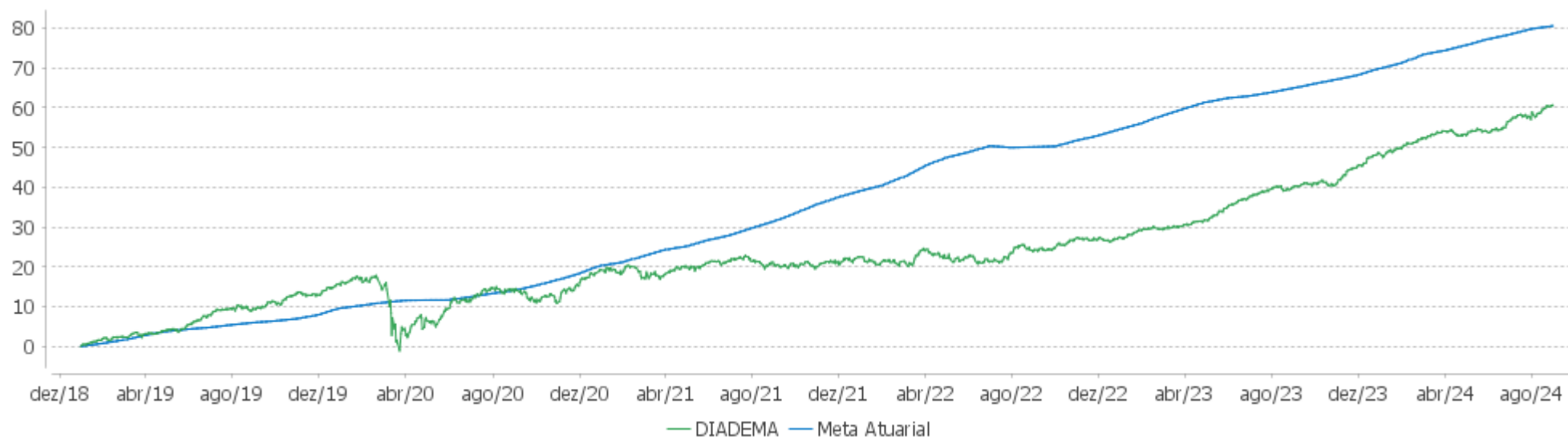
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	34	50,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	34	50,00
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,93	2020-11
Menor rentabilidade da Carteira	-9,14	2020-03

Relatório

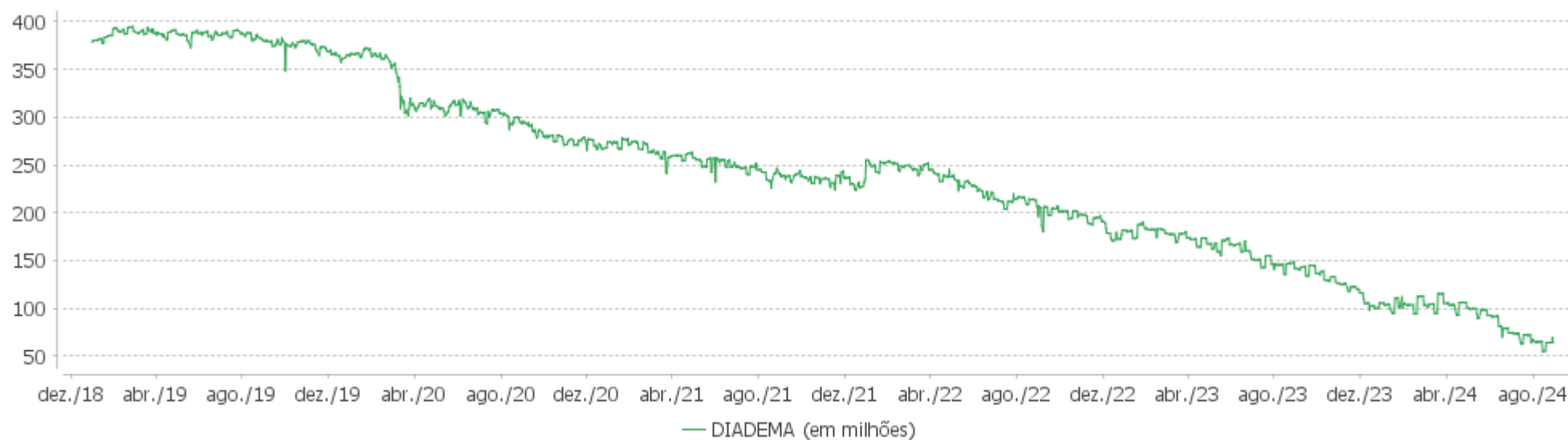
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	4,39	1,86	2,54	3,40
06 meses	5,39	4,15	1,23	2,91
12 meses	14,75	9,46	5,28	2,87
24 meses	29,41	20,21	9,20	2,64
36 meses	33,21	37,33	-4,12	3,44
48 meses	41,25	59,01	-17,76	4,10
60 meses	46,54	72,53	-25,99	6,67
Desde 31/12/2018	60,44	83,91	-23,48	6,36

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

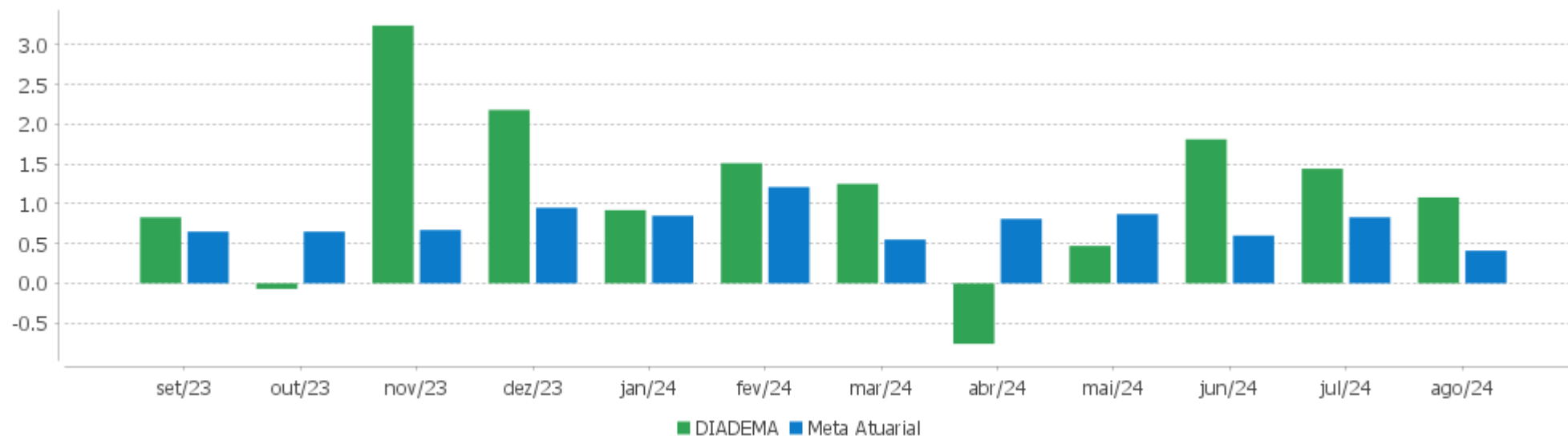


Patrimônio Líquido



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	0,97 111,51	9,05 127,57	3,07 118,69	6,22 119,01	14,32 127,77	29,31 111,54	45,22 115,47
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO % do CDI	0,87 100,31	7,07 99,68	2,59 100,05	5,21 99,68	11,15 99,47	26,18 99,62	39,14 99,95
BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,91 105,43	7,71 108,70	2,77 107,16	5,61 107,31	12,12 108,13	27,88 106,10	41,82 106,78
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,89 102,80	7,21 101,61	2,68 103,55	5,34 102,13	11,32 100,95	26,39 100,41	39,64 101,22
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	0,91 104,83	7,44 104,81	2,69 103,90	5,42 103,75	11,71 104,46	27,16 103,34	40,97 104,60
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,98 -2,56	-4,12 -5,48	8,50 -2,89	-3,13 -8,55	8,84 -8,67	6,30 -17,87	-22,27 -36,77
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,91 -2,63	2,88 1,53	6,31 -5,08	7,23 1,82	23,53 6,03	57,48 33,30	83,69 69,19
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,70 -0,84	3,34 1,99	10,71 -0,68	1,94 -3,47	18,03 0,52	40,51 16,33	51,64 37,14
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	1,93 -4,61	38,83 37,47	15,72 4,33	21,12 15,71	47,75 30,24	73,52 49,34	27,36 12,86
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	-98,68 -375,47	-97,03 -247,75
BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII Var. IFIX p.p.	-25,97 -26,83	-22,50 -24,98	-25,28 -25,61	-27,70 -28,70	-4,81 -10,43	-13,09 -27,11	-25,29 -48,70
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPFF11 Var. IBOVESPA p.p.	0,73 -5,81	2,84 1,49	0,49 -10,90	1,03 -4,38	5,98 -11,52	15,73 -8,44	26,99 12,49
DIADEMA Var. IPCA + 5,06% p.p.	1,08 0,67	7,96 1,65	4,39 2,54	5,39 1,23	14,75 5,29	29,41 9,15	33,21 -4,15
CDI	0,87	7,10	2,58	5,23	11,21	26,28	39,16
IBOVESPA	6,54	1,36	11,39	5,41	17,51	24,18	14,50
INPC + 6,00%	0,37	6,90	1,89	4,44	9,88	21,17	39,78
IPCA + 6,00%	0,49	6,95	2,09	4,63	10,44	22,43	41,11

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
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32		1,90
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 Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,77	6,30	2,36	4,62	10,39	25,57	36,92	39,98	47,06
IRF-M 1+	0,60	2,39	1,43	1,43	7,39	24,61	30,60	26,26	39,69
IRF-M TOTAL	0,66	3,54	1,70	2,39	8,26	24,46	32,14	30,49	41,85
IMA-B 5	0,59	4,88	1,91	3,56	8,14	21,08	33,04	39,39	52,27
IMA-B 5+	0,77	-1,21	1,69	-0,25	3,11	18,58	20,29	22,46	28,23
IMA-B TOTAL	0,52	1,49	1,63	1,40	5,32	19,81	26,45	30,58	39,25
IMA-GERAL TOTAL	0,79	4,63	2,21	3,49	8,81	23,74	33,48	35,98	44,83
IDKA 2	0,60	4,60	1,53	3,33	7,94	20,67	32,05	38,75	52,22
IDKA 20	0,42	-6,26	1,27	-3,24	-0,28	18,04	10,08	10,85	10,58
CDI	0,87	7,10	2,58	5,23	11,21	26,28	39,16	42,92	48,46

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,54	1,36	11,39	5,41	17,51	24,18	14,50	36,87	34,48
IBRX 100	6,60	1,79	11,34	5,58	18,00	22,90	12,85	36,41	34,88
IBRX 50	6,51	3,14	11,66	6,63	19,46	24,91	15,69	41,27	38,19
SMALL CAP	4,51	-9,69	5,65	-3,81	-2,18	-4,07	-25,42	-12,75	-7,50
Índice Consumo - ICON	6,25	-6,83	9,13	1,55	0,43	-15,02	-41,58	-41,33	-37,96
Índice Dividendos - IDIV	6,69	5,00	10,87	7,85	21,94	34,91	40,69	67,98	61,87

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	2,18	38,35	15,49	25,80	44,00	55,98	37,34	66,82	163,79

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,86	2,48	0,33	1,00	5,63	14,02	23,41	21,98	27,74

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	2,29	33,98	14,52	24,30	39,63	48,51	23,68	47,36	123,03

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	-0,02	2,85	0,57	1,58	4,24	9,04	18,56	30,03	33,20
INPC	-0,14	2,80	0,37	1,40	3,71	7,92	17,44	29,68	33,49
IGPM	0,29	2,00	1,72	2,46	4,26	-3,24	5,07	37,76	55,70
SELIC	0,87	7,10	2,58	5,23	11,21	26,28	39,16	42,92	48,46

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,32	5,59	1,59	3,62	8,37	17,88	33,30	52,03	61,96
IPCA + 5,00%	0,41	6,27	1,84	4,13	9,41	20,15	37,17	57,93	69,87
IPCA + 5,50%	0,45	6,61	1,97	4,38	9,92	21,29	39,13	60,95	73,94
IPCA + 5,89%	0,48	6,88	2,07	4,58	10,33	22,18	40,67	63,33	77,17
IPCA + 6,00%	0,49	6,95	2,09	4,63	10,44	22,43	41,11	64,01	78,09
INPC + 4,00%	0,20	5,54	1,39	3,44	7,82	16,67	32,04	51,61	62,31
INPC + 6,00%	0,37	6,90	1,89	4,44	9,88	21,17	39,78	63,57	78,48

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1576	02/08/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	11.980.505,83	0,00	3.677.581,22576583	3,2577134520
1590	02/08/2024	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	0,00	5.434.485,24	820.280,79426690	6,6251523600
1591	02/08/2024	TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	0,00	6.546.020,59	2.671.340,94225367	2,4504624200
1570	05/08/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	75.000,00	23.013,14446958	3,2590070470
1577	05/08/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	39.624,53	0,00	12.158,46711239	3,2590070470
1578	05/08/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.060.050,48	632.109,85747832	3,2590070470
1579	06/08/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	32.000,00	0,00	9.815,07330516	3,2602914930
1568	07/08/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	209.745,89	0,00	64.307,09487800	3,2616290690
1580	09/08/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	15.871,60	0,00	4.862,17914331	3,2642976600
1571	15/08/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	75.000,00	22.939,25746407	3,2695042600
1581	15/08/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.354.223,40	3.166.909,28550740	3,2695042600
1572	20/08/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	3.054,89345254	3,2734365880
1582	20/08/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.903.361,31	0,00	2.719.882,01715548	3,2734365880
1583	22/08/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	28.720,88	0,00	8.766,77667626	3,2761048970
1589	23/08/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	160.000,00	48.819,06629806	3,2774080320
1584	28/08/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	32.000,00	0,00	9.751,79814777	3,2814461000
1585	29/08/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	5.269.553,74	0,00	1.605.244,04690654	3,2827119030
1574	30/08/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	15.000,00	4.567,48415406	3,2840836430
1575	30/08/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	55.000,00	16.747,44189821	3,2840836430
1587	30/08/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	7.797.933,08	2.374.462,38515308	3,2840836430
1586	30/08/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.433.890,12	0,00	741.116,97038771	3,2840836430
Total			28.945.273,90	32.582.712,79		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 847.941,37

Value-At-Risk: 1,33%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,04	0,02		0,00	0,61	0,89	48.422.708,85	75,90
Artigo 8º	14,44	6,75		0,18	0,19	3,61	5.071.508,89	7,95
Artigo 9º	19,27	8,81		1,10	0,06	1,93	8.729.624,83	13,68
Artigo 10º	NaN	NaN		0,00	NaN	NaN	0,00	0,00
Artigo 11º	32,93	4,90		0,04	-0,29	-8,61	1.576.693,82	2,47
DIADEMA		1,33		1,33			63.800.536,39	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	0,01	0,00	-0,00	0,00	0,19	0,87	17.243.020,18	27,03
Sub-total	0,01	0,00	-0,00		0,19	0,87	17.243.020,18	27,03

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	0,02	1,07	0,89	14.783.578,20	23,17
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,08	0,05	0,00	0,05	0,58	0,91	11.732.603,54	18,39
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,08	0,02	0,00	0,02	0,51	0,91	912.106,26	1,43
Sub-total	0,04	0,03	0,00		0,86	0,90	27.428.288,00	42,99

Artigo 7º V, Alínea b

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	0,23	0,10	0,00	0,10	0,43	0,97	3.751.400,67	5,88
Sub-total	0,23	0,10	0,00		0,43	0,97	3.751.400,67	5,88

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 8,81%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	19,27	8,81	1,10	10,79	0,06	1,93	8.729.624,83	13,68
Sub-total	19,27	8,81	1,10		0,06	1,93	8.729.624,83	13,68

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,75%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	14,36	6,75	0,18	3,87	0,22	3,98	5.071.508,89	7,95
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	13,68	NaN	0,00	NaN	0,35	5,70	0,00	0,00
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	18,41	NaN	0,00	NaN	0,17	3,91	0,00	0,00
Sub-total	14,44	6,75	0,18		0,19	3,61	5.071.508,89	7,95

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 4,90%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII	103,25	1,96	-0,00	3,19	-0,26	-25,97	446.922,20	0,70
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPFF11	2,80	6,78	0,04	9,01	-0,05	0,73	1.129.771,62	1,77
Sub-total	32,93	4,90	0,04		-0,29	-8,61	1.576.693,82	2,47

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

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

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

- (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 (%)