



DIADEMA
NOVEMBRO 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 29.11.2024.

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	85,69%
------------	--------

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	0,03	0,04	0,80	9,85	20.628.889,70	52,98	31.890.085.235,30	0,06
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,03	0,04	0,80	8,12	20.628.889,70	52,98		

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	0,05	0,04	0,81	10,00	11.800.196,01	30,31	19.993.814.988,50	0,06
BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,09	0,00	0,72	10,47	0,00	0,00	15.384.948.340,63	0,00
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM RF REFERENCIADO DI CIC FIF RESP LIMITADA	0,07	0,04	0,80	10,25	936.017,29	2,40	3.329.852.546,29	0,03
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,05	0,04	0,81	10,26	12.736.213,30	32,71		
Renda Fixa			0,29	0,04	0,80	9,34	33.365.103,00	85,69		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

REND A VARIÁVEL

11,67%

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	14,26	-0,10	-4,60	-14,09	4.544.178,61	11,67	894.324.493,83	0,51
Sub-total Artigo 8º I			14,26	-0,10	-4,60	-10,37	4.544.178,61	11,67		
Renda Variável			13,74	-0,10	-4,60	-10,37	4.544.178,61	11,67		

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

2,64%

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	431,84	0,00	0,00	-100,00	0,00	0,00	0,00	
PLURAL	GENIAL	BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPFF11 *	28,38	-2,67	-1,84	-3,99	1.028.523,97	2,64	308.030.998,04	0,33
Sub-total Artigo 11º			48,85	-2,67	-1,84	-18,66	1.028.523,97	2,64		
Fundos Imobiliários			48,85	-2,67	-1,84	-18,66	1.028.523,97	2,64		
Total			2,88	-0,05	0,08	8,61	38.937.805,58	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	20.628.889,70	52,98	0,00	50,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	12.736.213,30	32,71	0,00	25,00	60,00	0,00	65,00
	Total Renda Fixa	33.365.103,00	85,69					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	4.544.178,61	11,67	0,00	12,00	30,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	4.544.178,61	11,67					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	1.028.523,97	2,64	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	1.028.523,97	2,64					5,00
Total		38.937.805,58	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	Atribuição Desemp. (%)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,80 100,89	8,12 82,43	2,59 100,49	5,07 97,09	9,53 87,89	142.565,13	0,19	1.918.329,07
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,81 102,18	10,26 104,13	2,63 101,99	5,42 103,73	11,29 104,12	157.995,08	0,21	2.899.380,51
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,00 0,00	11,01 111,67	1,79 69,50	4,91 94,00	12,24 112,88	0,00	0,00	378.573,58
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-4,60 -1,48	-10,37 -4,02	-10,40 -2,80	-3,76 -6,68	-5,03 -3,72	-218.888,59	-0,29	-935.224,87
Artigo 9º III % do CDI	0,00 0,00	36,63 371,70	-1,58 -61,43	13,89 265,75	40,42 372,87	0,00	0,00	2.863.800,18
Artigo 11º % do CDI	-1,84 -232,39	-18,66 -189,31	-13,65 -530,15	-20,91 -400,11	-17,22 -158,90	-19.189,38	-0,03	-154.668,60
DIADEMA (Total)						62.482,24	0,08	6.970.189,87

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	21.375.041,94	4.701.675,09	-5.590.392,46	0,00	20.628.889,70	142.565,13	1.703.057,18
	21.375.041,94	4.701.675,09	-5.590.392,46	0,00	20.628.889,70	142.565,13	

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	7.802.119,86	9.813.550,49	-5.904.156,59	0,00	11.800.196,01	88.682,25	1.227.822,41
BRDESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA	11.946.234,94	0,00	-12.008.101,70	0,00	0,00	61.866,76	1.115.746,16
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM RF REFERENCIADO DI CIC FIF RESP LIMITADA	928.571,22	0,00	0,00	0,00	936.017,29	7.446,07	555.811,94
	20.676.926,02	9.813.550,49	-17.912.258,29	0,00	12.736.213,30	157.995,08	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	4.763.067,20	0,00	0,00	0,00	4.544.178,61	-218.888,59	-745.406,61
	4.763.067,20	0,00	0,00	0,00	4.544.178,61	-218.888,59	

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	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	-114.482,09
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPFF11	1.056.713,35	0,00	0,00	0,00	9.000,00	1.028.523,97	-19.189,38	-40.186,51
	1.056.713,35	0,00	0,00	0,00	9.000,00	1.028.523,97	-19.189,38	

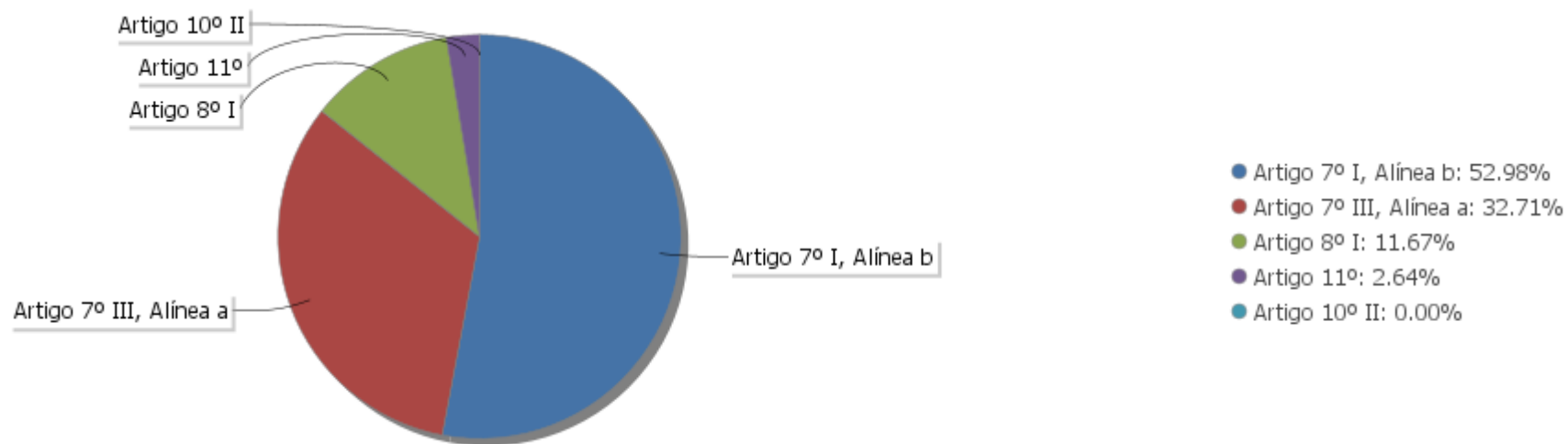
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

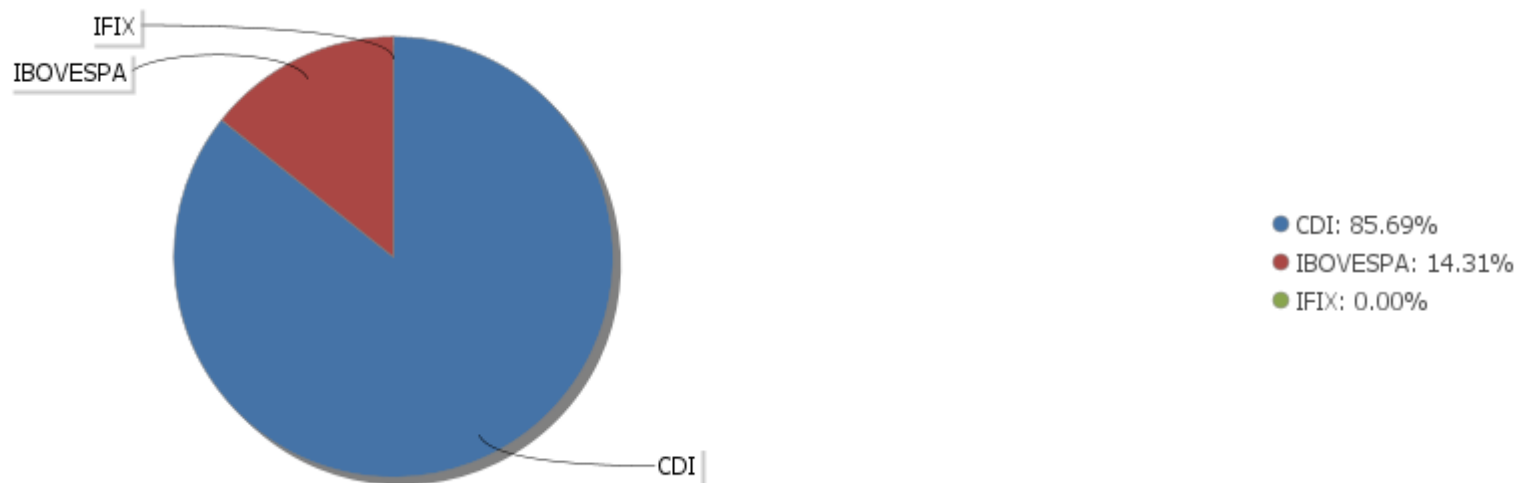
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	34.393.626,97	88,33	85,54	34.393.626,97	88,33	85,54
de 31 dias a 365 dias	4.544.178,61	11,67	14,46	38.937.805,58	100,00	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	0,00	38.937.805,58	100,00	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

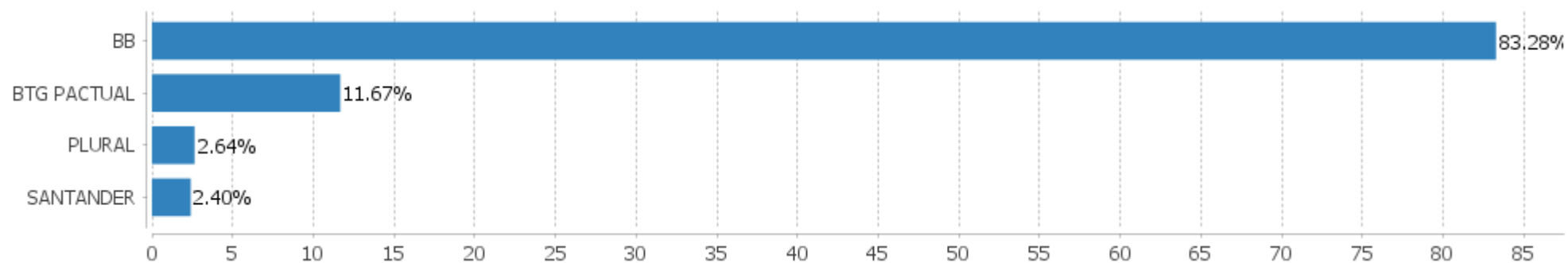


Alocação Por Estratégia



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		8,61
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		9,13
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		-0,52
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

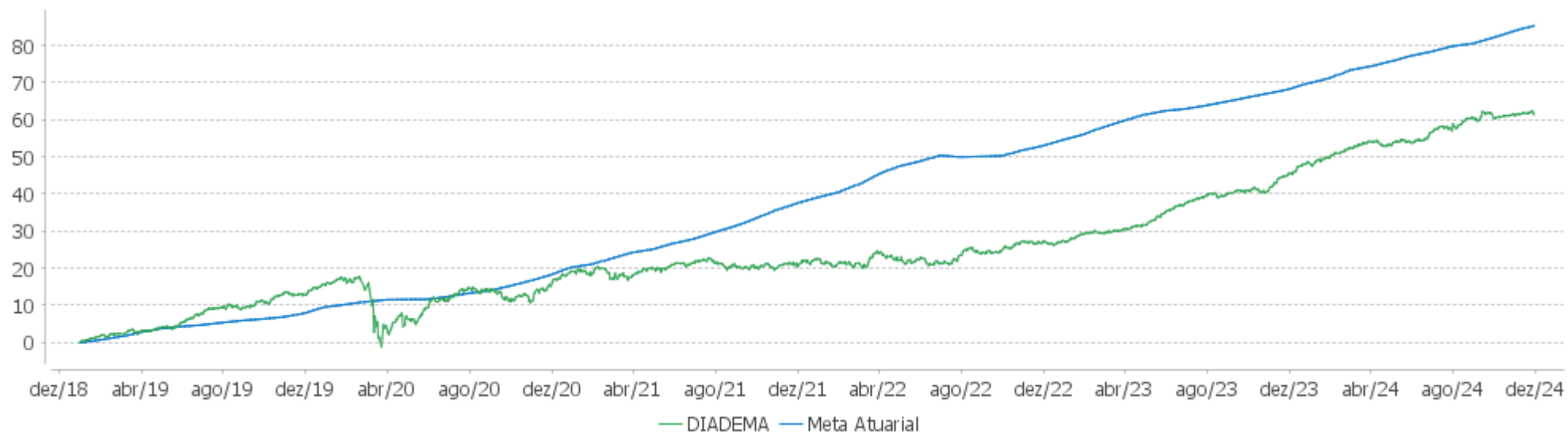
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	34	47,89	03 meses	0,60	2,65	-2,05	2,95
Meses abaixo - Meta Atuarial	37	52,11	06 meses	5,02	4,56	0,46	3,21
			12 meses	10,98	10,17	0,81	2,88
			24 meses	26,99	21,12	5,86	2,64
			36 meses	33,62	34,61	-0,99	3,34
			48 meses	40,16	57,16	-17,01	3,78
			60 meses	42,88	73,52	-30,64	6,66
			Desde 31/12/2018	61,41	88,79	-27,39	6,26

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

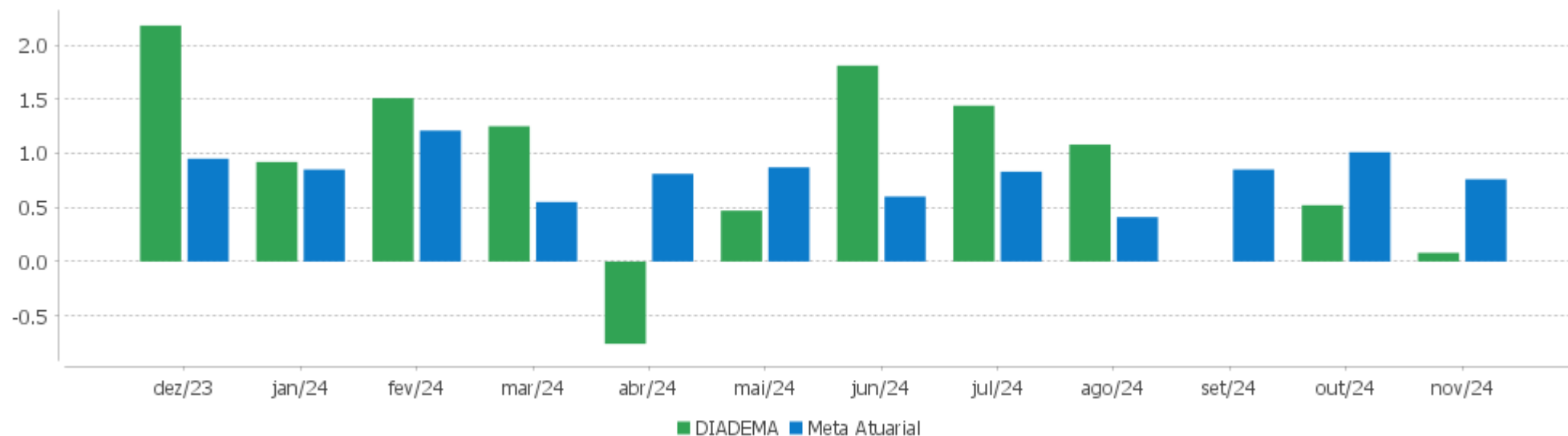


Patrimônio Líquido



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
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO % do CDI	0,80 100,89	9,85 99,90	2,59 100,49	5,24 100,27	10,83 99,90	25,49 99,64	40,54 99,81
BRABESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA % do CDI	0,81 102,19	10,56 107,18	2,64 102,68	5,49 104,99	11,60 107,01	27,09 105,90	43,11 106,12
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,81 101,89	10,00 101,50	2,60 101,09	5,35 102,35	10,99 101,43	25,67 100,35	41,04 101,03
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM RF REFERENCIADO DI CIC FIF RESP LIMITADA % do CDI	0,80 101,35	10,25 104,06	2,62 101,80	5,38 102,89	11,29 104,20	26,39 103,14	42,19 103,87
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-4,60 -1,48	-14,09 -7,74	-10,40 -2,80	-2,78 -5,71	-9,94 -8,64	-3,55 -15,27	-5,80 -29,11
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	-98,69 -385,78	-96,95 -238,69
BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII Var. IFIX p.p.	0,00 2,11	-95,99 -90,73	-94,82 -87,27	-96,13 -88,89	-96,01 -94,78	-96,80 -106,22	-96,83 -118,50
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPFF11 Var. IBOVESPA p.p.	-1,84 1,28	-3,99 2,36	-6,65 0,95	-6,19 -9,11	-0,96 0,35	12,30 0,58	23,56 0,25
DIADEMA Var. IPCA + 5,06% p.p.	0,08 -0,68	8,61 -0,52	0,60 -2,05	5,02 0,46	10,98 0,81	26,99 5,86	33,62 -1,14
CDI	0,79	9,85	2,58	5,23	10,84	25,58	40,62
IBOVESPA	-3,12	-6,35	-7,60	2,92	-1,31	11,72	23,31
INPC + 6,00%	0,77	10,01	2,91	4,86	11,13	22,31	37,39
IPCA + 6,00%	0,83	10,04	2,88	5,04	11,17	23,33	38,44

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
BRANCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA	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
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 Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,57	8,70	2,25	4,67	9,69	24,55	39,10	42,37	47,99
IRF-M 1+	-1,13	1,19	-1,16	0,25	2,94	21,88	31,77	26,13	33,70
IRF-M TOTAL	-0,52	3,57	0,03	1,73	5,11	22,46	33,80	31,22	38,18
IMA-B 5	0,36	6,46	1,51	3,44	8,02	20,49	32,08	39,53	49,87
IMA-B 5+	-0,23	-4,45	-3,28	-1,64	-0,68	12,61	17,33	18,28	19,09
IMA-B TOTAL	0,02	0,19	-1,29	0,32	2,94	16,04	23,95	28,04	32,54
IMA-GERAL TOTAL	0,32	5,72	1,04	3,28	7,44	22,31	34,25	37,09	42,81
IDKA 2	0,22	6,09	1,42	2,97	7,63	20,43	31,15	38,90	50,09
IDKA 20	-0,82	-13,71	-7,94	-6,77	-8,03	6,06	5,14	2,45	-2,26
CDI	0,79	9,85	2,58	5,23	10,84	25,58	40,62	45,93	50,28

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,12	-6,35	-7,60	2,92	-1,31	11,72	23,31	15,40	16,11
IBRX 100	-2,91	-5,57	-7,24	3,28	-0,40	11,51	22,85	15,49	17,47
IBRX 50	-2,62	-4,28	-7,20	3,62	0,80	11,99	26,06	18,92	20,01
SMALL CAP	-4,48	-18,66	-9,94	-4,85	-12,93	-7,61	-16,01	-27,09	-24,11
Índice Consumo - ICON	-5,91	-16,48	-10,36	-2,17	-11,49	-15,37	-33,32	-48,25	-46,33
Índice Dividendos - IDIV	-0,07	2,38	-2,50	8,11	9,45	27,77	48,64	49,15	49,07

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	10,77	58,14	14,30	32,01	61,98	69,06	42,28	89,11	175,24

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-2,11	-5,26	-7,55	-7,24	-1,23	9,42	21,68	11,71	8,55

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	8,57	48,34	10,72	26,80	52,35	56,31	27,87	58,39	126,10

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,39	4,29	1,40	1,98	4,87	9,78	16,26	28,75	34,30
INPC	0,33	4,27	1,43	1,80	4,84	8,88	15,38	28,03	34,68
IGPM	1,30	5,55	3,48	5,25	6,33	2,65	8,70	28,14	59,57
SELIC									

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,69	8,12	2,40	4,03	9,07	18,72	30,76	50,55	63,27
IPCA + 5,00%	0,76	9,08	2,64	4,53	10,12	21,01	34,56	56,40	71,24
IPCA + 5,50%	0,80	9,56	2,76	4,79	10,64	22,17	36,49	59,39	75,34
IPCA + 5,89%	0,82	9,93	2,86	4,98	11,05	23,07	38,01	61,76	78,59
IPCA + 6,00%	0,83	10,04	2,88	5,04	11,17	23,33	38,44	62,43	79,51
INPC + 4,00%	0,63	8,10	2,43	3,85	9,03	17,74	29,77	49,70	63,73
INPC + 6,00%	0,77	10,01	2,91	4,86	11,13	22,31	37,39	61,52	80,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
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
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
Total			14.515.225,58	23.502.650,75		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 341.128,85

Value-At-Risk: 0,88%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,02	0,01		-0,00	0,59	0,80	33.365.103,00	85,69
Artigo 8º	22,84	7,16		0,81	-0,24	-4,60	4.544.178,61	11,67
Artigo 10º	NaN	NaN		0,00	NaN	NaN	0,00	0,00
Artigo 11º	10,48	7,36		0,06	-0,25	-1,84	1.028.523,97	2,64
DIADEMA		0,88		0,88			38.937.805,58	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,01%

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	0,02	0,01	-0,00	0,01	0,46	0,80	20.628.889,70	52,98
Sub-total	0,02	0,01	-0,00		0,46	0,80	20.628.889,70	52,98

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	0,03	0,02	0,00	0,02	0,58	0,81	11.800.196,01	30,31
BRDESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,03	NaN	0,00	NaN	0,55	0,81	0,00	0,00
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM RF REFERENCIADO DI CIC FIF RESP LIMITADA	0,04	0,03	-0,00	0,03	0,27	0,80	936.017,29	2,40
Sub-total	0,02	0,02	0,00		0,72	0,81	12.736.213,30	32,71

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,16%

Artigo 8º I

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	22,84	7,16	0,81	3,99	-0,24	-4,60	4.544.178,61	11,67
Sub-total	22,84	7,16	0,81		-0,24	-4,60	4.544.178,61	11,67

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: 7,36%

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	10,48	7,36	0,06	8,94	-0,25	-1,84	1.028.523,97	2,64
Sub-total	10,48	7,36	0,06		-0,25	-1,84	1.028.523,97	2,64

(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 novembro de 2024, vale observar que:

- O Instituto está com 30,31% do patrimônio total alocado no mesmo fundo BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI, percentual este superior ao permitido no Artigo 18 da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021;
- O fundo PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP não está aderente à Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021;
- O fundo BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPFF11 não está aderente à Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021.