



DIADEMA
OUTUBRO 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 31.10.2024.

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										87,84%
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	0,04	0,04	0,93	8,98	21.375.041,94	44,65	30.241.561.842,62	0,07
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,04	0,04	0,93	7,27	21.375.041,94	44,65		
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	0,93	9,12	7.802.119,86	16,30	20.409.457.658,47	0,04
BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,10	0,04	0,93	9,68	11.946.234,94	24,95	15.416.999.740,59	0,08
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM RF REFERENCIADO DI CIC FIF RESP LIMITADA	0,08	0,04	0,92	9,38	928.571,22	1,94	3.555.599.377,38	0,03
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,06	0,04	0,93	9,38	20.676.926,02	43,19		
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	0,28	0,00	0,85	11,01	0,00	0,00	3.517.529.593,29	0,00
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			0,28	0,00	0,85	11,01	0,00	0,00		
Renda Fixa			0,32	0,04	0,93	8,47	42.051.967,96	87,84		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

REND A VARIÁVEL

9,95%

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	13,87	-0,88	-1,30	-9,95	4.763.067,20	9,95	973.064.809,21	0,49
Sub-total Artigo 8º I			13,87	-0,88	-1,30	-6,05	4.763.067,20	9,95		
Renda Variável			13,23	-0,88	-1,30	-6,05	4.763.067,20	9,95		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

0,00%

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	16,00	0,00	-0,41	36,63	0,00	0,00	1.887.417.257,23	0,00
Sub-total Artigo 9º III			16,00	0,00	-0,41	36,63	0,00	0,00		
Investimentos no Exterior			15,38	0,00	-0,41	36,63	0,00	0,00		

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

2,21%

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	430,99	-100,00	-100,00	-100,00	0,00	0,00	0,00	
PLURAL	GENIAL	BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPFF11 *	28,20	-3,69	-2,88	-2,19	1.056.713,35	2,21	316.473.391,74	0,33
Sub-total Artigo 11º			48,68	-4,27	-3,04	-17,13	1.056.713,35	2,21		
Fundos Imobiliários			48,68	-4,27	-3,04	-17,13	1.056.713,35	2,21		
Total			2,95	-0,16	0,52	8,52	47.871.748,51	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	21.375.041,94	44,65	0,00	50,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	20.676.926,02	43,19	0,00	25,00	60,00	0,00	65,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	0,00	0,00	0,00	3,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	42.051.967,96	87,84					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	4.763.067,20	9,95	0,00	12,00	30,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	4.763.067,20	9,95					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	0,00	0,00	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	0,00	0,00					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	1.056.713,35	2,21	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	1.056.713,35	2,21					5,00
Total		47.871.748,51	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	0,93 100,71	7,27 80,81	2,66 100,31	5,13 97,36	10,13 92,27	163.111,65	0,31	1.775.763,94
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,93 100,16	9,38 104,28	2,72 102,52	5,47 103,72	11,44 104,16	210.221,24	0,40	2.741.385,43
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,85 91,17	11,01 122,38	2,77 104,59	5,90 111,94	13,49 122,91	32.034,57	0,06	378.573,58
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-1,30 0,30	-6,05 -2,71	-2,69 -4,31	-2,20 -5,20	10,33 -4,31	-62.749,29	-0,12	-716.336,28
Artigo 9º III % do CDI	-0,41 -44,71	36,63 407,34	0,32 11,95	19,87 376,95	52,82 481,12	-35.789,59	-0,07	2.863.800,18
Artigo 11º % do CDI	-3,04 -327,81	-17,13 -190,51	-19,61 -739,23	-19,21 -364,57	-14,80 -134,77	-33.013,43	-0,06	-135.479,22
DIADEMA (Total)						273.815,15	0,52	6.907.707,63

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	17.386.678,45	6.125.251,84	-2.300.000,00	0,00	21.375.041,94	163.111,65	1.560.492,05
	17.386.678,45	6.125.251,84	-2.300.000,00	0,00	21.375.041,94	163.111,65	

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	7.604.301,40	18.805.220,84	-18.699.354,10	0,00	7.802.119,86	91.951,72	1.139.140,16
BRDESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA	11.836.436,97	0,00	0,00	0,00	11.946.234,94	109.797,97	1.053.879,40
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM RF REFERENCIADO DI CIC FIF RESP LIMITADA	920.099,67	0,00	0,00	0,00	928.571,22	8.471,55	548.365,87
	20.360.838,04	18.805.220,84	-18.699.354,10	0,00	20.676.926,02	210.221,24	

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	3.786.508,28	0,00	-3.818.542,85	0,00	0,00	32.034,57	378.573,58
	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 Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	4.825.816,49	0,00	0,00	0,00	4.763.067,20	-62.749,29	-526.518,02
	4.825.816,49	0,00	0,00	0,00	4.763.067,20	-62.749,29	

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	8.627.327,01	0,00	-8.591.537,42	0,00	0,00	-35.789,59	2.863.800,18
	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 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	6.636,18	0,00	0,00	0,00	4.840,47	0,00	-1.795,71	-114.482,09
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPFF11	1.097.231,07	0,00	0,00	0,00	9.300,00	1.056.713,35	-31.217,72	-20.997,13
	1.103.867,25	0,00	0,00	0,00	14.140,47	1.056.713,35	-33.013,43	

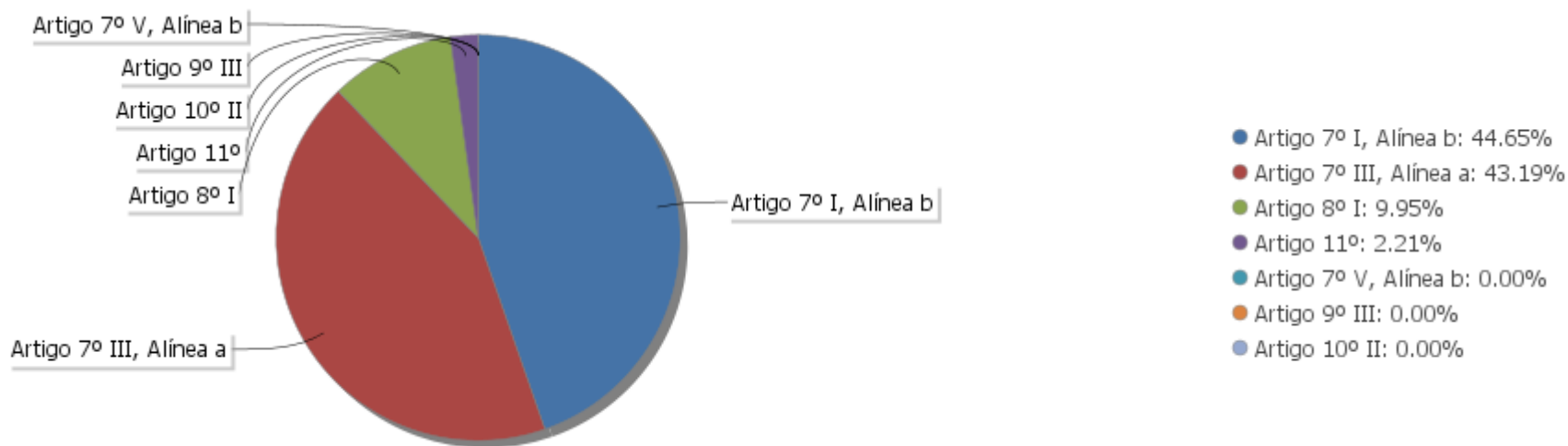
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

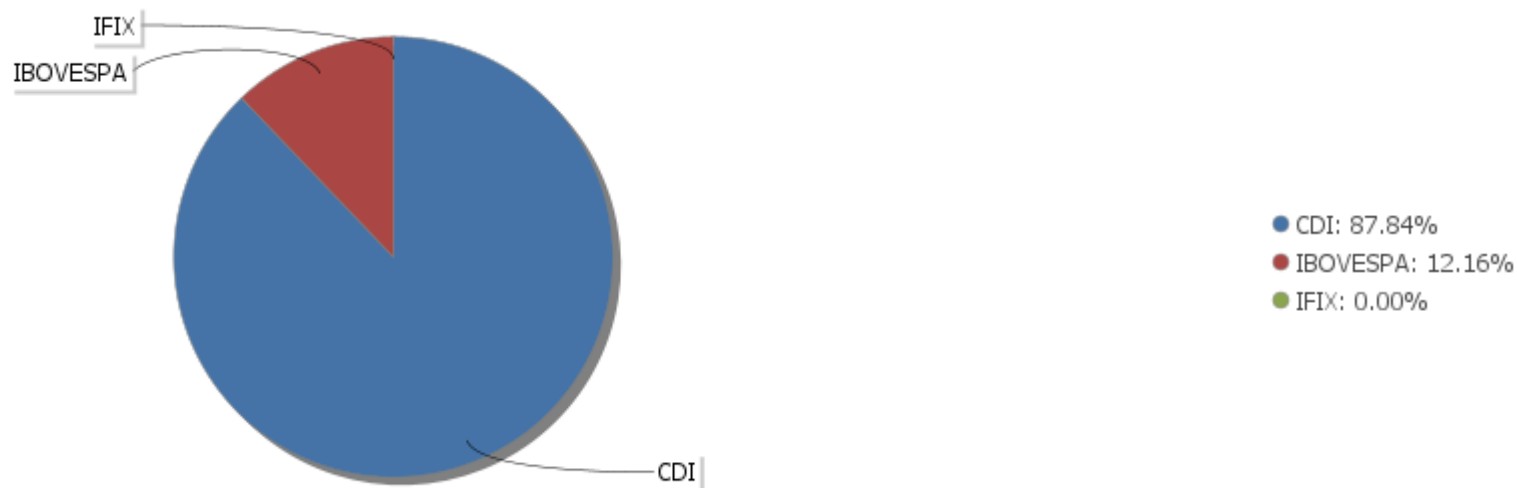
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	43.108.681,31	90,05	85,54	43.108.681,31	90,05	85,54
de 31 dias a 365 dias	4.763.067,20	9,95	14,46	47.871.748,51	100,00	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	0,00	47.871.748,51	100,00	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

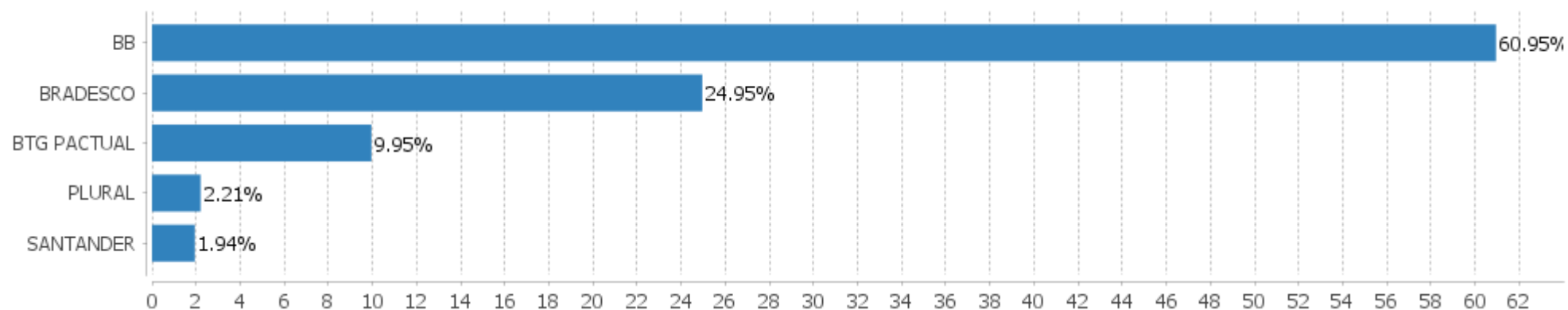


Alocação Por Estratégia



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			8,52
IPCA + 5,05%	0,85	1,21	0,55	0,81	0,87	0,60	0,83	0,41	0,85	1,01			8,30
p.p. indexador	0,06	0,30	0,70	-1,57	-0,41	1,21	0,61	0,67	-0,86	-0,49			0,22
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

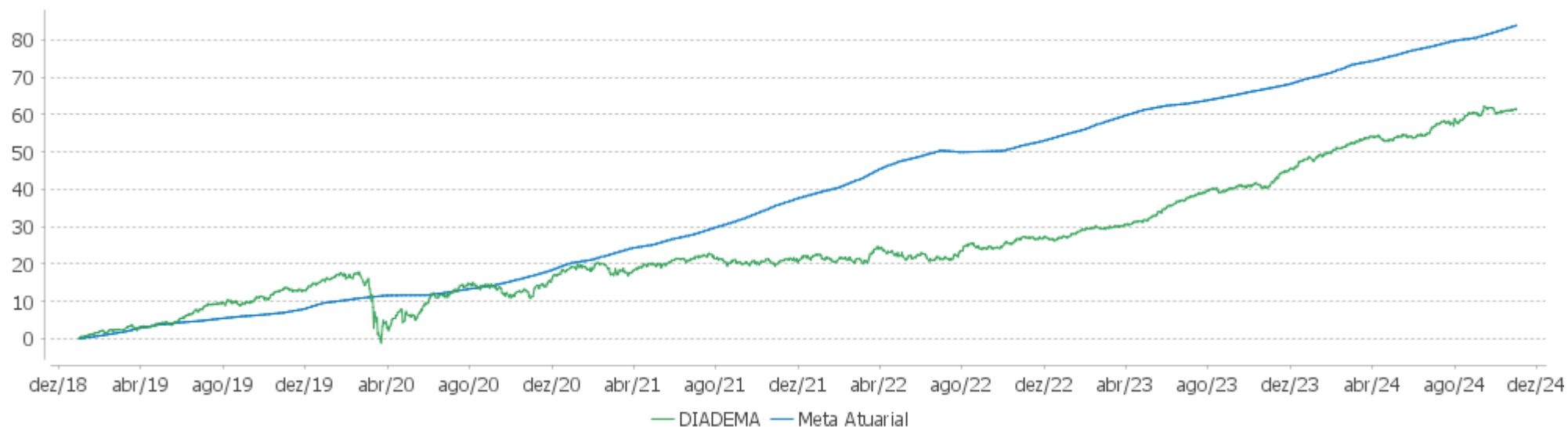
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	34	48,57	03 meses	1,60	2,29	-0,69	3,04
Meses abaixo - Meta Atuarial	36	51,43	06 meses	5,43	4,67	0,75	3,18
			12 meses	14,48	10,07	4,40	2,95
			24 meses	26,72	21,16	5,56	2,65
			36 meses	34,47	35,43	-0,96	3,39
			48 meses	45,54	58,08	-12,54	3,88
			60 meses	42,37	73,88	-31,51	6,66
			Desde 31/12/2018	61,27	87,36	-26,09	6,29

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

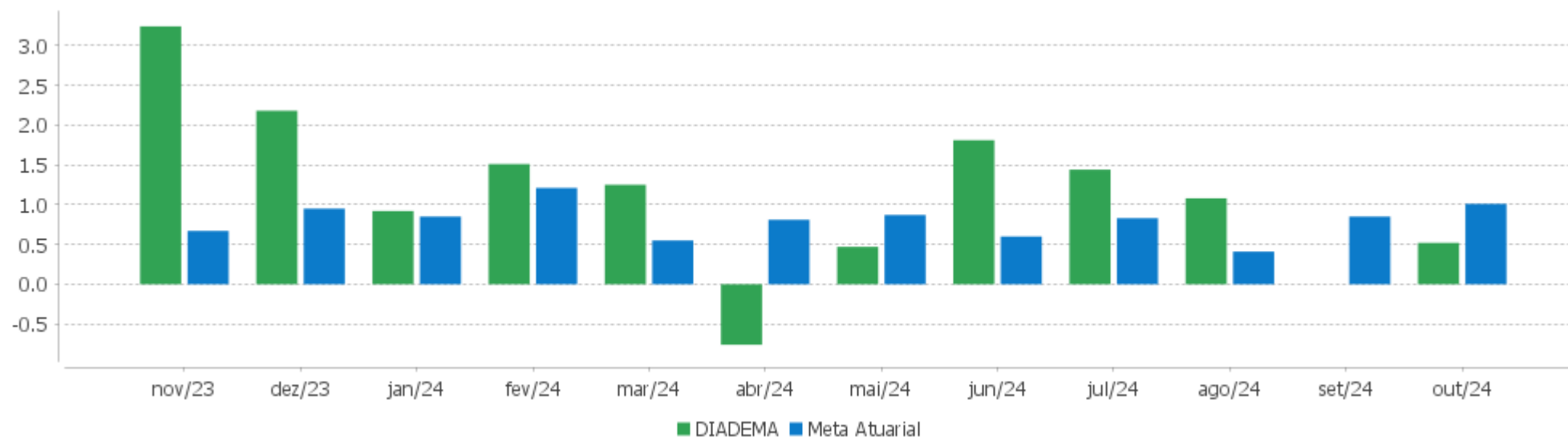


Patrimônio Líquido



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
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO % do CDI	0,97 104,53	11,14 123,90	2,90 109,35	6,03 114,41	13,63 124,18	28,67 110,84	45,61 113,08
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO % do CDI	0,93 100,71	8,98 99,81	2,66 100,31	5,27 99,94	10,95 99,71	25,75 99,55	40,24 99,77
BRABESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA % do CDI	0,93 99,97	9,68 107,60	2,75 103,74	5,56 105,54	11,80 107,47	27,41 105,95	42,87 106,28
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,93 100,55	9,12 101,45	2,69 101,41	5,38 102,04	11,11 101,23	25,94 100,28	40,79 101,14
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM RF REFERENCIADO DI CIC FIF RESP LIMITADA % do CDI	0,92 99,22	9,38 104,29	2,73 102,95	5,41 102,73	11,45 104,29	26,69 103,18	41,95 104,01
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-1,30 0,30	-9,95 -6,62	-2,34 -3,96	-2,10 -5,11	5,66 -8,98	-7,08 -18,86	-7,89 -33,21
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	6,42 8,02	46,01 49,34	7,20 5,59	28,10 25,09	63,31 48,67	93,92 82,13	20,49 -4,84
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 -381,51	-96,99 -240,46
BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII Var. IFIX p.p.	72,94 76,00	-95,99 -92,77	-96,17 -91,41	-96,08 -90,85	-95,98 -97,54	-96,83 -103,96	-96,76 -116,53
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPFF11 Var. IBOVESPA p.p.	-2,88 -1,28	-2,19 1,14	-4,20 -5,82	-4,65 -7,66	2,11 -12,53	9,47 -2,32	21,72 -3,60
DIADEMA Var. IPCA + 5,06% p.p.	0,52 -0,49	8,52 0,22	1,60 -0,69	5,43 0,75	14,48 4,41	26,72 5,54	34,47 -1,06
CDI	0,93	8,99	2,65	5,27	10,98	25,87	40,33
IBOVESPA	-1,60	-3,33	1,61	3,01	14,64	11,79	25,33
INPC + 6,00%	1,15	9,17	2,50	5,04	10,90	22,40	38,12
IPCA + 6,00%	1,10	9,13	2,54	5,16	11,07	23,38	39,24

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
BRABESCO 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
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 índice CDIE. A taxa de performance sera paga no(s) mes (es) de Janeiro e Julho	0,50
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
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	0,84	8,08	2,45	4,88	10,15	25,01	39,40	41,88	47,64
IRF-M 1+	-0,14	2,35	0,56	2,01	7,39	21,52	36,19	28,16	34,10
IRF-M TOTAL	0,21	4,12	1,21	2,94	8,27	22,29	36,91	32,39	38,26
IMA-B 5	0,74	6,08	1,74	4,16	9,57	19,66	34,90	40,87	48,92
IMA-B 5+	-1,66	-4,23	-2,31	0,15	2,92	11,54	22,86	21,61	14,50
IMA-B TOTAL	-0,65	0,16	-0,80	1,63	5,62	15,10	28,22	30,57	29,26
IMA-GERAL TOTAL	0,38	5,39	1,52	3,92	9,08	21,85	36,23	37,66	41,34
IDKA 2	0,81	5,86	1,81	3,85	9,37	19,24	34,15	40,34	49,79
IDKA 20	-4,24	-13,00	-6,80	-4,11	-2,93	4,69	12,47	6,78	-7,39
CDI	0,93	8,99	2,65	5,27	10,98	25,87	40,33	45,00	49,67

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-1,60	-3,33	1,61	3,01	14,64	11,79	25,33	38,06	20,98
IBRX 100	-1,53	-2,74	1,84	2,99	15,29	11,28	24,40	37,33	22,16
IBRX 50	-1,49	-1,71	1,51	3,10	15,95	12,48	27,12	41,91	24,29
SMALL CAP	-1,37	-14,85	-1,46	-3,76	2,51	-14,14	-14,08	-10,98	-16,47
Índice Consumo - ICON	-0,02	-11,24	1,22	1,62	9,43	-22,91	-34,44	-40,10	-41,26
Índice Dividendos - IDIV	-1,72	2,45	4,09	7,11	21,24	28,86	50,07	70,74	52,68

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	5,00	42,76	5,43	26,58	55,42	61,95	26,85	74,67	171,04

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-3,06	-3,22	-4,75	-5,23	1,56	7,13	19,78	15,83	14,79

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	3,63	36,63	4,32	22,90	49,35	56,01	14,35	51,21	124,74

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,56	3,88	0,98	2,05	4,76	9,81	16,91	29,39	34,46
INPC	0,61	3,92	0,95	1,93	4,60	8,93	15,97	28,82	34,96
IGPM	1,52	4,20	2,45	4,83	5,59	0,76	7,33	30,65	58,00
SELIC	0,93	8,99	2,65	5,27	10,98	25,87	40,33	45,00	49,67

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,92	7,39	2,02	4,13	8,97	18,77	31,51	51,32	63,49
IPCA + 5,00%	1,01	8,26	2,28	4,65	10,02	21,06	35,34	57,21	71,47
IPCA + 5,50%	1,05	8,69	2,41	4,90	10,54	22,22	37,28	60,22	75,58
IPCA + 5,89%	1,09	9,03	2,51	5,10	10,95	23,12	38,81	62,60	78,84
IPCA + 6,00%	1,10	9,13	2,54	5,16	11,07	23,38	39,24	63,27	79,77
INPC + 4,00%	0,97	7,43	1,99	4,02	8,80	17,82	30,45	50,65	64,10
INPC + 6,00%	1,15	9,17	2,50	5,04	10,90	22,40	38,12	62,56	80,45

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
Total			24.930.472,68	33.409.434,37		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 322.606,91

Value-At-Risk: 0,67%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,05	0,02		-0,00	0,08	0,93	42.051.967,96	87,84
Artigo 8º	11,40	6,55		0,64	-0,20	-1,30	4.763.067,20	9,95
Artigo 9º	NaN	NaN		0,00	NaN	NaN	0,00	0,00
Artigo 10º	NaN	NaN		0,00	NaN	NaN	0,00	0,00
Artigo 11º	14,96	6,24		0,04	-0,27	-3,04	1.056.713,35	2,21
DIADEMA		0,67		0,67			47.871.748,51	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	0,06	0,01	-0,00	0,01	0,12	0,93	21.375.041,94	44,65
Sub-total	0,06	0,01	-0,00		0,12	0,93	21.375.041,94	44,65

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	0,05	0,02	0,00	0,02	0,10	0,93	7.802.119,86	16,30
BRADESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,05	0,03	-0,00	0,03	-0,01	0,93	11.946.234,94	24,95
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM RF REFERENCIADO DI CIC FIF RESP LIMITADA	0,07	0,02	-0,00	0,03	-0,11	0,92	928.571,22	1,94
Sub-total	0,04	0,02	-0,00		0,03	0,93	20.676.926,02	43,19

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	0,10	NaN	0,00	NaN	0,43	0,97	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	0,25	NaN	0,00		-0,33	0,85	0,00	0,00

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,55%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	11,40	6,55	0,64	3,88	-0,20	-1,30	4.763.067,20	9,95
Sub-total	11,40	6,55	0,64		-0,20	-1,30	4.763.067,20	9,95

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 6,24%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII	181,32	NaN	0,00	NaN	0,40	72,94	0,00	0,00
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPFF11	12,89	6,24	0,04	7,86	-0,30	-2,88	1.056.713,35	2,21
Sub-total	14,96	6,24	0,04		-0,27	-3,04	1.056.713,35	2,21

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: NaN%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	15,46	NaN	0,00	NaN	0,36	6,42	0,00	0,00
Sub-total	3,03	NaN	0,00		-0,44	-0,41	0,00	0,00

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

- (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 outubro de 2024, vale observar que:

- O Instituto está com 24,95% do patrimônio total alocado no mesmo fundo BRADESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA, 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.