



DIADEMA
FEVEREIRO 2025



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 28.02.2025.

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 **93,81%**

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	0,06	0,05	0,98	2,03	9.873.764,68	60,92	33.604.538.927,95	0,03
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,06	0,05	0,98	2,03	9.873.764,68	60,92		

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 PREVIDENCIÁRIO RF REFERENCIADO DI LP PERFIL FIC FIF RESP LIMITADA	0,08	0,05	1,00	2,11	4.366.796,00	26,94	21.522.738.493,95	0,02
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM RF REFERENCIADO DI CIC FIF RESP LIMITADA	0,08	0,05	1,01	2,10	963.611,17	5,95	3.786.347.567,44	0,03
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,08	0,05	1,00	2,11	5.330.407,17	32,89		
Renda Fixa			0,23	0,05	0,99	2,05	15.204.171,85	93,81		

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

6,19%

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	430,08	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
PLURAL	GENIAL	BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPFF11 *	28,49	2,49	3,43	0,39	1.003.996,35	6,19	300.685.260,57	0,33
Sub-total Artigo 11º			48,78	2,49	3,43	0,39	1.003.996,35	6,19		
Fundos Imobiliários			48,78	2,49	3,43	0,39	1.003.996,35	6,19		
Total			2,74	0,14	1,07	1,73	16.208.168,20	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								Pró-Gestão Nível
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	9.873.764,68	60,92	0,00	75,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	5.330.407,17	32,89	0,00	10,00	60,00	0,00	65,00
	Total Renda Fixa	15.204.171,85	93,81					100,00
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	1.003.996,35	6,19	0,00	3,00	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	1.003.996,35	6,19					5,00
Total		16.208.168,20	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	0,98 99,37	2,03 101,12	2,55 86,36	5,20 92,86	9,49 85,33	143.502,60	0,66	384.451,24
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,00 101,60	2,11 105,02	2,92 98,95	5,62 100,37	11,39 102,44	55.284,32	0,25	120.736,33
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	0,00 2,64	-1,55 -3,64	-8,76 -6,48	-18,25 -8,54	-17,05 -12,23	0,00	0,00	-65.278,76
Artigo 11º % do CDI	3,43 348,53	0,39 19,55	0,25 8,56	-13,43 -239,78	-21,34 -191,88	33.415,76	0,15	3.810,67
DIADEMA (Total)						232.202,68	1,07	443.719,48

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	15.623.476,00	18.093.527,37	-23.986.741,29	0,00	9.873.764,68	143.502,60	384.451,24
	15.623.476,00	18.093.527,37	-23.986.741,29	0,00	9.873.764,68	143.502,60	384.451,24

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREVIDENCIÁRIO RF REFERENCIADO DI LP PERFIL FIC FIF RESP LIMITADA	4.746.131,21	0,00	-425.000,00	0,00	4.366.796,00	45.664,79	100.959,43
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM RF REFERENCIADO DI CIC FIF RESP LIMITADA	953.991,64	0,00	0,00	0,00	963.611,17	9.619,53	19.776,90
	5.700.122,85	0,00	-425.000,00	0,00	5.330.407,17	55.284,32	120.736,33

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	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	0,00
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPFF11	979.580,59	0,00	0,00	0,00	9.000,00	1.003.996,35	33.415,76	3.810,67
	979.580,59	0,00	0,00	0,00	9.000,00	1.003.996,35	33.415,76	3.810,67

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

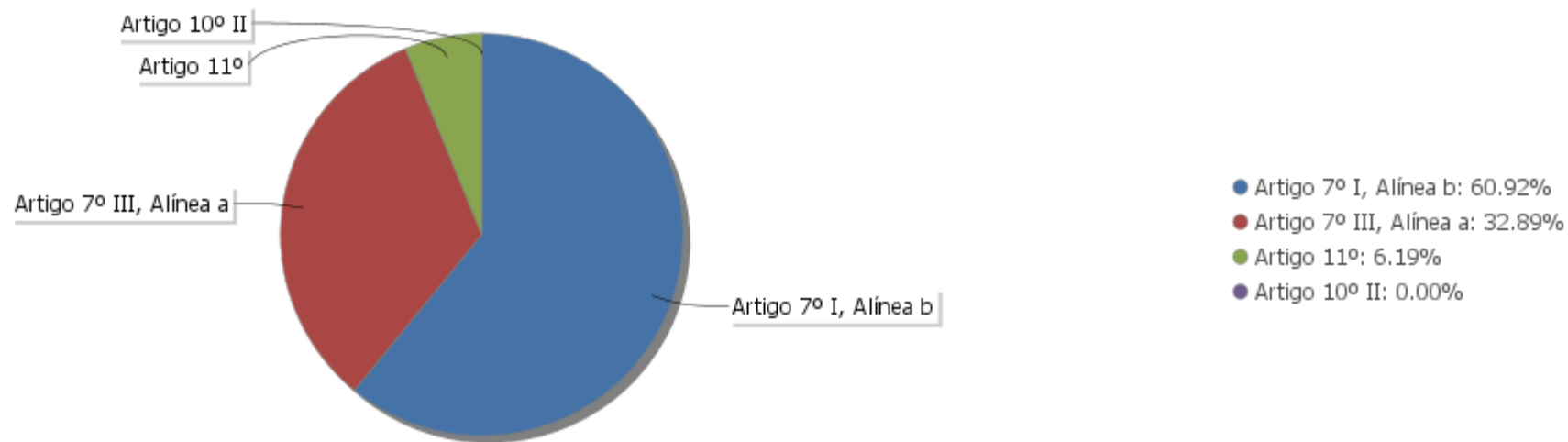
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	16.208.168,20	100,00	16.208.168,20	100,00	90,00
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	16.208.168,20	100,00	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	16.208.168,20	100,00	100,00

DE 0 A 30 DIAS

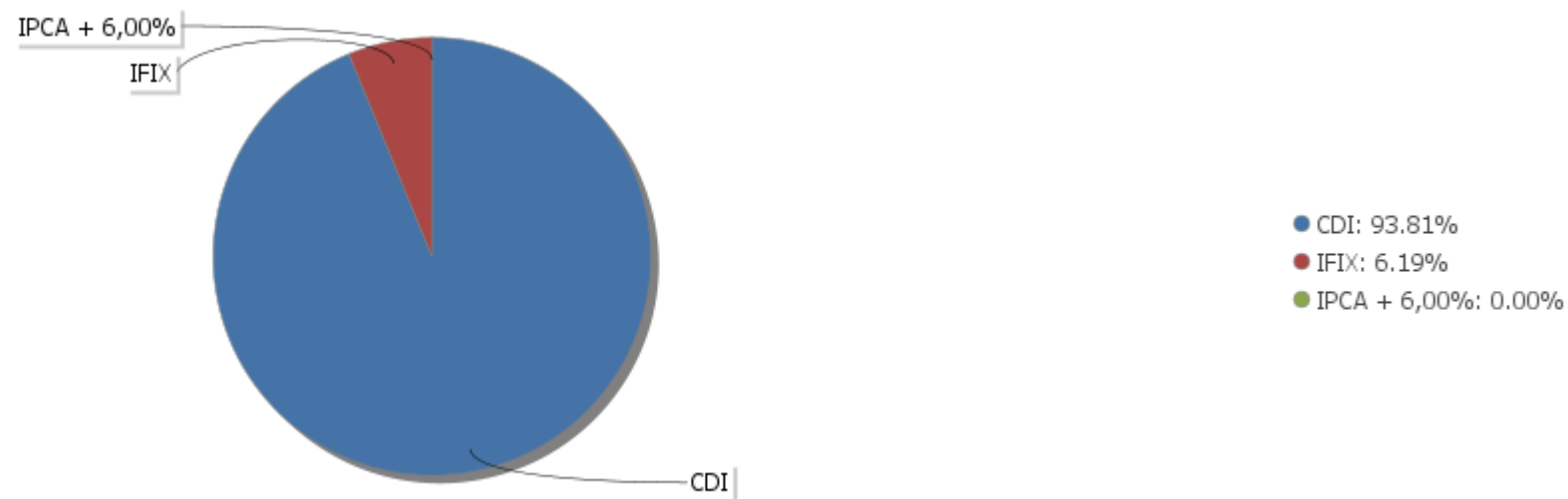
Ativo	Liquidação	Vencimento	Valor (R\$)
BB PREVIDENCIÁRIO RF REFERENCIADO DI LP PERFIL FIC FIF RESP LIMITADA	D+0		4.366.796,00
BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII			0,00
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	D+0		9.873.764,68
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPFF11			1.003.996,35
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP			0,00
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM RF REFERENCIADO DI CIC FIF RESP LIMITADA	D+0		963.611,17

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

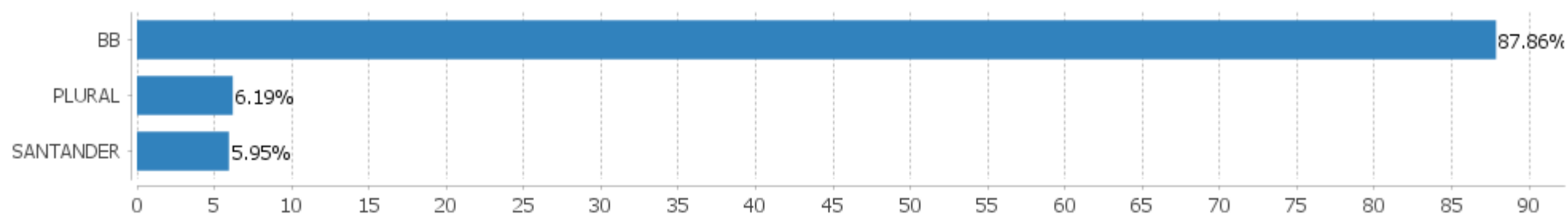


Alocação Por Estratégia



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
2025	0,65	1,07											1,73
IPCA + 4,98%	0,59	1,70											2,30
p.p. indexador	0,07	-0,63											-0,57
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

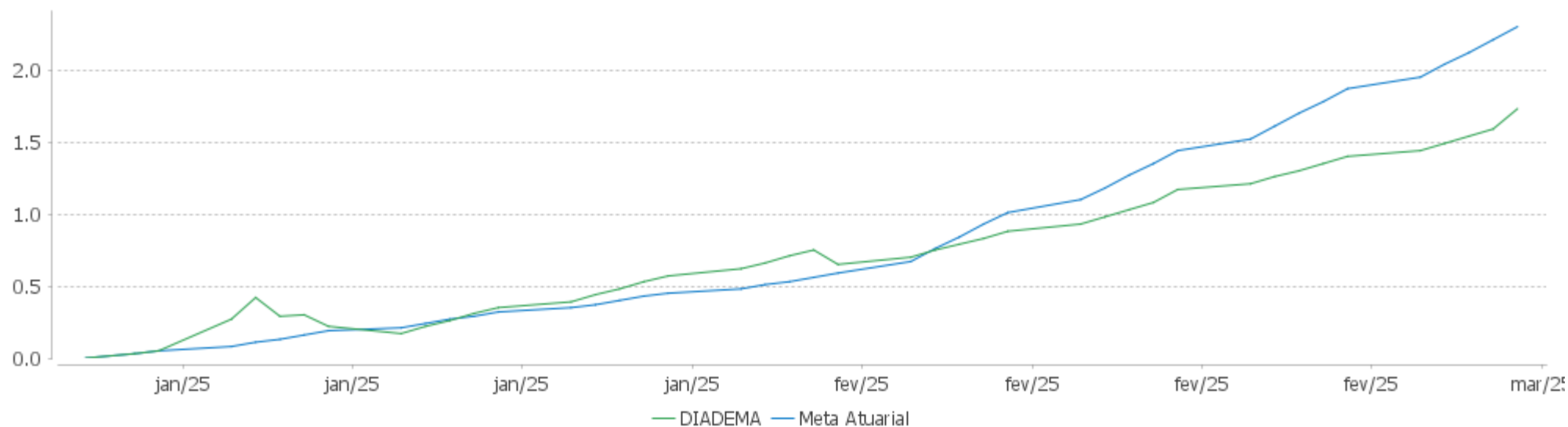
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	35	47,30
Meses abaixo - Meta Atuarial	39	52,70
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,93	2020-11
Menor rentabilidade da Carteira	-9,14	2020-03

Relatório

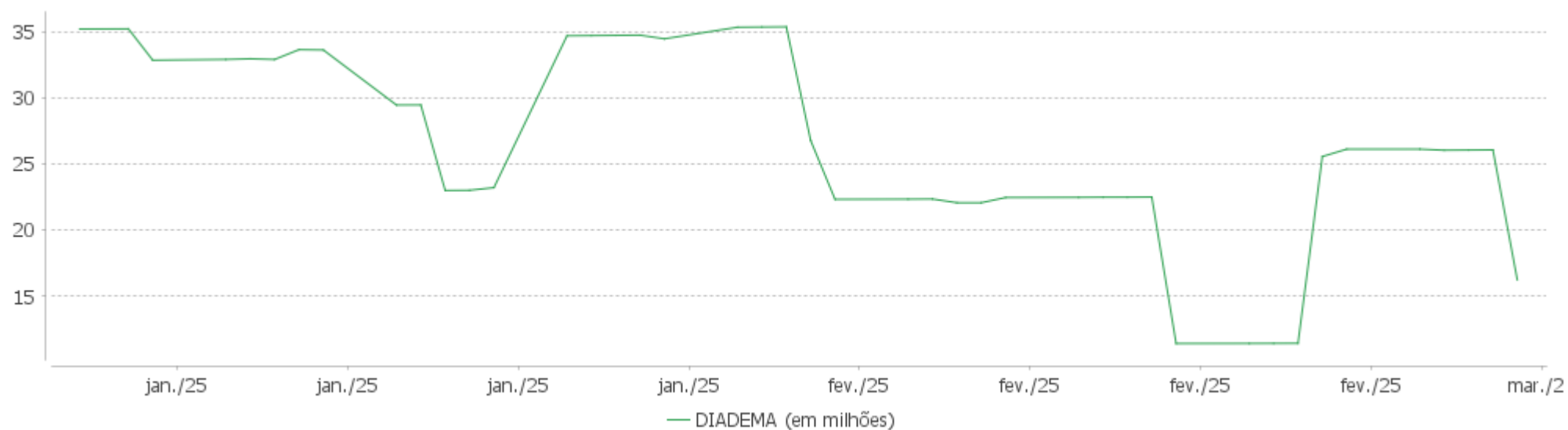
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,04	3,25	-2,21	2,12
06 meses	1,65	5,99	-4,34	2,56
12 meses	7,13	10,39	-3,26	2,74
24 meses	25,87	21,15	4,72	2,65
36 meses	34,45	34,19	0,26	3,16
48 meses	39,30	56,31	-17,01	3,54
60 meses	42,64	73,87	-31,23	6,55
Desde 31/12/2018	63,09	94,93	-31,84	6,14

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução No Ano

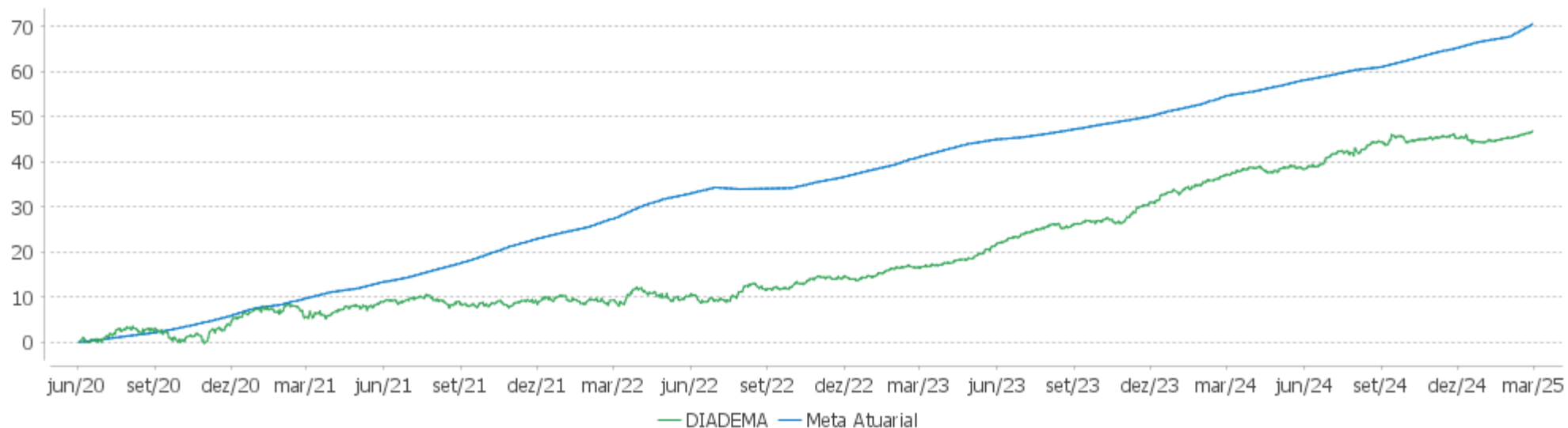


Patrimônio Líquido No Ano



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

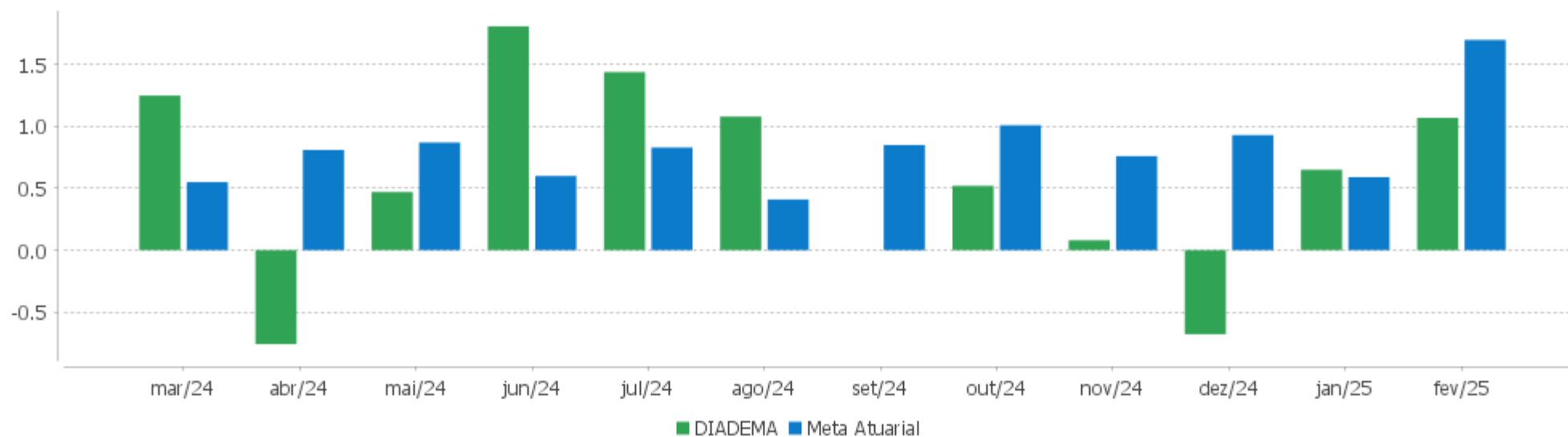


Patrimônio Líquido



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	0,98 99,37	2,03 101,12	2,93 99,38	5,60 99,90	11,10 99,79	25,17 99,56	41,37 99,51
BB PREVIDENCIÁRIO RF REFERENCIADO DI LP PERFIL FIC FIF RESP LIMITADA % do CDI	1,00 101,45	2,11 105,12	2,92 98,97	5,60 99,96	11,24 101,03	25,42 100,53	41,76 100,46
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM RF REFERENCIADO DI CIC FIF RESP LIMITADA % do CDI	1,01 102,34	2,10 104,51	2,95 99,89	5,65 100,79	11,38 102,28	26,29 103,99	42,89 103,17
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	-98,71 -390,44	-99,26 -238,80
BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,00 -1,78	0,00 -2,46	0,00 -3,50	-94,82 -101,30	-96,26 -107,67	-96,90 -120,25	-96,93 -134,97
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPFF11 Var. IFIX p.p.	3,43 0,10	0,39 0,23	0,25 0,76	-6,41 1,61	-5,45 1,65	14,47 3,32	16,19 2,31
DIADEMA Var. IPCA + 4,98% p.p.	1,07 -0,63	1,73 -0,57	1,04 -2,20	1,65 -4,31	7,13 -3,20	25,87 4,88	34,45 0,36
CDI	0,99	2,00	2,95	5,60	11,12	25,28	41,57
IBOVESPA	-2,64	2,09	-2,28	-9,71	-4,82	17,03	8,54
INPC + 6,00%	1,95	2,47	3,46	6,48	11,21	22,38	36,79
IPCA + 6,00%	1,78	2,46	3,50	6,48	11,41	23,35	38,04

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB PREVIDENCIÁRIO RF REFERENCIADO DI LP PERFIL FIC FIF RESP LIMITADA	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				
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	1,01	2,31	3,02	5,34	10,21	24,22	40,13	46,10	50,59
IRF-M 1+	0,36	3,78	0,71	-0,47	0,96	18,98	29,76	27,56	31,16
IRF-M TOTAL	0,61	3,20	1,49	1,52	3,94	20,42	32,61	33,25	37,27
IMA-B 5	0,65	2,55	2,26	3,80	7,49	18,71	32,45	40,82	49,59
IMA-B 5+	0,41	0,84	-3,57	-6,73	-6,96	10,03	15,37	10,49	11,53
IMA-B TOTAL	0,50	1,58	-1,08	-2,36	-1,00	13,55	22,57	23,70	27,62
IMA-GERAL TOTAL	0,79	2,20	1,60	2,66	6,23	21,20	33,94	37,81	42,37
IDKA 2	0,61	2,68	2,44	3,89	7,36	18,22	31,52	40,33	50,08
IDKA 20	0,69	-1,67	-9,88	-17,04	-19,73	2,80	0,47	-12,34	-14,01
CDI	0,99	2,00	2,95	5,60	11,12	25,28	41,57	49,56	53,11

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-2,64	2,09	-2,28	-9,71	-4,82	17,03	8,54	11,60	17,88
IBRX 100	-2,68	2,10	-2,37	-9,44	-4,38	16,87	7,25	10,33	17,97
IBRX 50	-2,79	1,90	-2,19	-9,23	-3,21	17,59	8,49	13,67	22,91
SMALL CAP	-3,87	2,01	-5,98	-15,33	-18,55	-2,75	-22,41	-32,75	-31,27
Índice Consumo - ICON	-5,51	-3,74	-10,75	-19,99	-18,75	-14,15	-40,29	-52,95	-52,47
Índice Dividendos - IDIV	-2,78	0,63	-4,29	-6,68	0,64	26,97	33,37	45,62	40,48

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	-1,11	-4,38	-4,63	9,01	37,13	68,44	54,55	65,24	162,05

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	3,34	0,17	-0,51	-8,02	-7,10	11,15	13,87	8,14	5,32

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,38	-3,12	-3,33	7,04	33,04	54,07	40,59	38,88	118,80

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	1,31	1,47	2,00	3,42	5,06	9,78	15,93	28,15	34,81
INPC	1,48	1,48	1,97	3,42	4,87	8,92	14,87	27,28	35,19
IGPM	1,06	1,33	2,28	5,84	8,44	4,36	6,30	23,44	59,17
SELIC	0,99	2,00	2,95	5,60	11,12	25,28	41,56	49,56	53,11

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,63	2,14	3,00	5,47	9,29	18,74	30,38	49,91	63,93
IPCA + 5,00%	1,70	2,30	3,25	5,98	10,35	21,03	34,17	55,76	71,95
IPCA + 5,50%	1,74	2,38	3,37	6,23	10,88	22,19	36,10	58,75	76,07
IPCA + 5,89%	1,77	2,44	3,47	6,43	11,30	23,09	37,61	61,11	79,34
IPCA + 6,00%	1,78	2,46	3,50	6,48	11,41	23,35	38,04	61,78	80,27
INPC + 4,00%	1,80	2,15	2,97	5,47	9,10	17,80	29,20	48,90	64,40
INPC + 6,00%	1,95	2,47	3,46	6,48	11,21	22,38	36,79	60,69	80,79

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
21	05/02/2025	BB PREVIDENCIÁRIO RF REFERENCIADO DI LP PERFIL FIC FIF RESP LIMITADA	0,00	50.000,00	14.541,16750900	3,4385134460
20	05/02/2025	BB PREVIDENCIÁRIO RF REFERENCIADO DI LP PERFIL FIC FIF RESP LIMITADA	0,00	63.000,00	18.321,87106100	3,4385134460
31	05/02/2025	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	2.166.403,65	0,00	572.628,02067600	3,7832651770
30	05/02/2025	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,00	2.342.000,00	619.041,98897800	3,7832651770
29	06/02/2025	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,00	10.549,86	2.787,29473300	3,7849818590
19	07/02/2025	BB PREVIDENCIÁRIO RF REFERENCIADO DI LP PERFIL FIC FIF RESP LIMITADA	0,00	35.000,00	10.168,81760200	3,4418947580
28	07/02/2025	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	418.364,92	0,00	110.479,94117500	3,7867952820
18	12/02/2025	BB PREVIDENCIÁRIO RF REFERENCIADO DI LP PERFIL FIC FIF RESP LIMITADA	0,00	10.000,00	2.900,68157600	3,4474656170
17	14/02/2025	BB PREVIDENCIÁRIO RF REFERENCIADO DI LP PERFIL FIC FIF RESP LIMITADA	0,00	55.000,00	15.938,11980800	3,4508461890
27	14/02/2025	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,00	11.036.319,57	2.907.044,29973100	3,7964057070
26	20/02/2025	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	14.128.403,58	0,00	3.714.304,36084000	3,8037818680
25	21/02/2025	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	546.029,71	0,00	143.479,69595000	3,8056235510
16	24/02/2025	BB PREVIDENCIÁRIO RF REFERENCIADO DI LP PERFIL FIC FIF RESP LIMITADA	0,00	10.000,00	2.889,22818900	3,4611319520
15	25/02/2025	BB PREVIDENCIÁRIO RF REFERENCIADO DI LP PERFIL FIC FIF RESP LIMITADA	0,00	132.000,00	38.117,63076800	3,4629644430
24	25/02/2025	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	37.388,09	0,00	9.814,81282000	3,8093533400
14	28/02/2025	BB PREVIDENCIÁRIO RF REFERENCIADO DI LP PERFIL FIC FIF RESP LIMITADA	0,00	70.000,00	20.184,57670800	3,4679944500
23	28/02/2025	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	796.937,42	0,00	208.898,36274900	3,8149529250
22	28/02/2025	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,00	10.597.871,86	2.777.982,34168300	3,8149529250
Total			18.093.527,37	24.411.741,29		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 7.604,76 Value-At-Risk: 0,05%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,03	0,04	5,00	0,03	0,05	0,99	15.204.171,85	93,81
Artigo 10º	NaN	NaN	20,00	0,00	NaN	NaN	0,00	0,00
Artigo 11º	9,16	0,44	20,00	0,02	0,27	3,43	1.003.996,35	6,19
DIADEMA		0,05		0,05			16.208.168,20	100,00

Renda Fixa Value-At-Risk: 0,04%

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	0,03	0,04	0,02	0,03	-0,20	0,98	9.873.764,68	60,92
Sub-total	0,03	0,04	0,02		-0,20	0,98	9.873.764,68	60,92

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREVIDENCIÁRIO RF REFERENCIADO DI LP PERFIL FIC FIF RESP LIMITADA	0,04	0,06	0,01	0,05	0,33	1,00	4.366.796,00	26,94
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM RF REFERENCIADO DI CIC FIF RESP LIMITADA	0,04	0,05	0,00	0,04	0,61	1,01	963.611,17	5,95
Sub-total	0,04	0,05	0,01		0,43	1,00	5.330.407,17	32,89

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

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 0,44%

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	9,16	0,44	0,02	5,04	0,27	3,43	1.003.996,35	6,19
Sub-total	9,16	0,44	0,02		0,27	3,43	1.003.996,35	6,19

(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 fevereiro de 2025, vale observar que:

- O Instituto está com 26,94% do patrimônio total alocado no mesmo fundo BB PREVIDENCIÁRIO RF REFERENCIADO DI LP PERFIL FIC FIF RESP LIMITADA, percentual este superior ao permitido no Artigo 18 da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021;
- O Instituto está com 6,19% do patrimônio total alocado no Artigo 11º, percentual este superior ao limite máximo estabelecido na Política de Investimentos;
- O Instituto está com 6,19% do patrimônio total alocado no Artigo 11º, percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021;
- O Instituto está com 6,19% do patrimônio total alocado no Fundos Imobiliários, percentual este superior ao permitido na 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.