



LDB
EMPRESAS

DIADEMA
AGOSTO 2021



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 31.08.2021.

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

70,30%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,62	0,13	1,33	22.941.512,45	9,56	1.397.138.568,06	1,64
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	4,33	-0,47	-2,10	27.121.528,49	11,30	1.250.576.163,16	2,17
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,64	0,15	0,15	4.005.902,01	1,67	5.975.243.184,05	0,07
BB	BB	BB PREV IPCA I	1,69	0,46	3,37	16.751.259,61	6,98	508.542.726,73	3,29
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,91	-0,45	-1,37	24.244.486,06	10,10	8.803.716.462,71	0,28
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,62	-1,45	-1,51	28.073.504,70	11,69	15.341.053.159,31	0,18
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,16	-0,43	-0,73	123.138.193,32	51,29		

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	5,99	-1,16	-2,94	21.731.233,74	9,05	1.490.439.966,72	1,46
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,19	0,45	2,17	9.920.288,64	4,13	4.685.526.156,09	0,21
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			3,61	-0,90	-1,33	31.651.522,38	13,18		

Artigo 7º VII, Alínea b (Fundos Renda Fixa "Crédito Privado")

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	2,99	0,20	0,78	10.195.332,65	4,25	631.342.597,15	1,61
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	0,39	0,77	3,48	3.794.788,86	1,58	398.522.414,15	0,95
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			2,25	0,35	1,50	13.990.121,51	5,83		
Renda Fixa			3,12	-0,44	-0,62	168.779.837,21	70,30		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

22,42%

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	20,16	-5,06	2,78	9.291.577,72	3,87	1.643.916.306,81	0,57
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	20,42	-6,82	-7,11	6.524.498,16	2,72	2.748.098.825,53	0,24
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	20,26	-2,44	-2,14	8.269.421,45	3,44	1.191.393.271,47	0,69
TPE	DAYCOVAL	TARPON GT 30 FIC FIA	18,22	-6,37	-7,42	3.703.171,15	1,54	287.203.809,16	1,29
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			19,08	-4,90	-2,67	27.788.668,48	11,57		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	14,91	3,35	22,87	22.289.696,54	9,28	2.395.278.402,52	0,93
Sub-total Artigo 8º III			14,91	3,35	22,87	22.289.696,54	9,28		

Artigo 8º IV, Alínea a (Fundos de Participações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
PÁTRIA	PÁTRIA	PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	15,80	-1,10	-24,38	7.977,94	0,00	1.110.895,52	0,72
CEF	CEF	FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	98,41	-4,32	-78,18	12.241,51	0,01	2.927.459,72	0,42
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			128,11	-3,07	-73,61	20.219,45	0,01		

Artigo 8º IV, Alínea b (Fundos de Investimentos Imobiliários)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
RIO BRAVO	RIO BRAVO	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	28,60	-18,68	-12,87	2.539.030,23	1,06	64.937.296,84	3,91
BRPP	GERAÇÃO FUTURO	BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	8,28	-2,47	-3,33	1.194.158,17	0,50	369.979.755,66	0,32
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			20,93	-14,11	-10,01	3.733.188,40	1,55		

Renda Variável e Investimentos Estruturados

15,11 -2,07 5,62 53.831.772,87 22,42

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

7,28%

Artigo 9º A, III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	19,76	2,59	6,26	17.480.161,37	7,28	3.804.473.022,27	0,46
Sub-total Artigo 9º A, III			19,76	2,59	6,26	17.480.161,37	7,28		
Investimentos no Exterior			15,86	2,59	6,26	17.480.161,37	7,28		
Total			5,63	-0,79	1,02	240.091.771,45	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 1	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	123.138.193,32	51,29	15,00	60,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	31.651.522,38	13,18	1,00	10,00	40,00	0,00	45,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	13.990.121,51	5,83	0,00	3,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Fixa	168.779.837,21	70,30					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	27.788.668,48	11,57	2,00	16,00	25,00	0,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	22.289.696,54	9,28	2,00	8,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	20.219,45	0,01	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	3.733.188,40	1,55	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	53.831.772,87	22,42					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	17.480.161,37	7,28	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	17.480.161,37	7,28					10,00

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	-0,43 -102,24	-0,73 -35,49	-0,64 -58,37	0,52 29,26	2,23 82,57	-548.733,35	-975.622,28
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,90 -212,10	-1,33 -64,54	-0,64 -59,23	0,05 2,78	1,47 54,24	-217.329,30	-325.145,73
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,35 83,00	1,50 72,85	0,50 45,72	2,09 118,18	4,64 171,61	49.074,48	206.863,46
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-4,90 -2,42	-2,67 -2,48	-7,90 -2,01	3,20 -4,75	7,66 -11,88	-1.431.637,76	-1.695.716,35
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	3,35 5,83	22,87 23,07	8,86 14,75	19,87 11,92	30,38 10,84	745.464,89	5.280.363,12
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-3,07 -0,60	-73,61 -73,41	-59,17 -53,27	-73,23 -81,18	-72,93 -92,47	-641,37	-57.952,66
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-14,11 -11,63	-10,01 -9,82	-12,45 -6,56	-9,08 -17,02	5,35 -14,19	-613.241,01	-410.186,43
Artigo 9º A, III % do CDI	2,59 611,11	6,26 390,86	8,57 787,25			122.800,23	480.161,37
DIADEMA (Total)						-1.894.243,19	2.502.764,50

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV IPCA I	17.131.314,49	0,00	-457.343,77	0,00	16.751.259,61	77.288,89	562.517,94
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	25.461.818,42	133.531,87	-1.231.000,00	0,00	24.244.486,06	-119.864,23	-364.036,67
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,00	4.000.000,00	0,00	0,00	4.005.902,01	5.902,01	5.902,01
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	28.486.439,50	0,00	0,00	0,00	28.073.504,70	-412.934,80	-402.163,48
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	22.912.098,46	0,00	0,00	0,00	22.941.512,45	29.413,99	1.191,91
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	27.250.067,70	0,00	0,00	0,00	27.121.528,49	-128.539,21	-581.944,09
					123.138.193,32	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	15.200.442,93	13.253.858,66	-18.572.415,13	0,00	9.920.288,64	38.402,18	333.469,42
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	21.986.965,22	0,00	0,00	0,00	21.731.233,74	-255.731,48	-658.615,15
					31.651.522,38	0,00	0,00

Artigo 7º VII, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	10.175.102,27	0,00	0,00	0,00	10.195.332,65	20.230,38	79.306,51
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	3.765.944,76	0,00	0,00	0,00	3.794.788,86	28.844,10	127.556,95
					13.990.121,51	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	9.786.834,07	0,00	0,00	0,00	9.291.577,72	-495.256,35	250.990,49
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	7.002.150,45	0,00	0,00	0,00	6.524.498,16	-477.652,29	-499.188,09
OCCAM FIC FIA	8.476.272,59	0,00	0,00	0,00	8.269.421,45	-206.851,14	-415.825,77
TARPON GT 30 FIC FIA	3.955.049,13	0,00	0,00	0,00	3.703.171,15	-251.877,98	-296.828,85
					27.788.668,48	0,00	0,00

Artigo 8º III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	28.544.231,65	0,00	-7.000.000,00	0,00	22.289.696,54	745.464,89	5.280.363,12
					22.289.696,54	0,00	0,00

Artigo 8º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	12.793,86	0,00	0,00	0,00	12.241,51	-552,35	-55.380,49
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	8.066,96	0,00	0,00	0,00	7.977,94	-89,02	-2.572,17
					20.219,45	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 8º IV, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	3.137.067,48	0,00	0,00	0,00	15.000,00	2.539.030,23	-583.037,25	-369.102,46
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	1.232.611,93	0,00	0,00	0,00	8.250,00	1.194.158,17	-30.203,76	-41.083,97
						3.733.188,40	0,00	0,00

Artigo 9º A, III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	10.357.361,14	7.000.000,00	0,00	0,00	17.480.161,37	122.800,23	480.161,37
					17.480.161,37	0,00	0,00

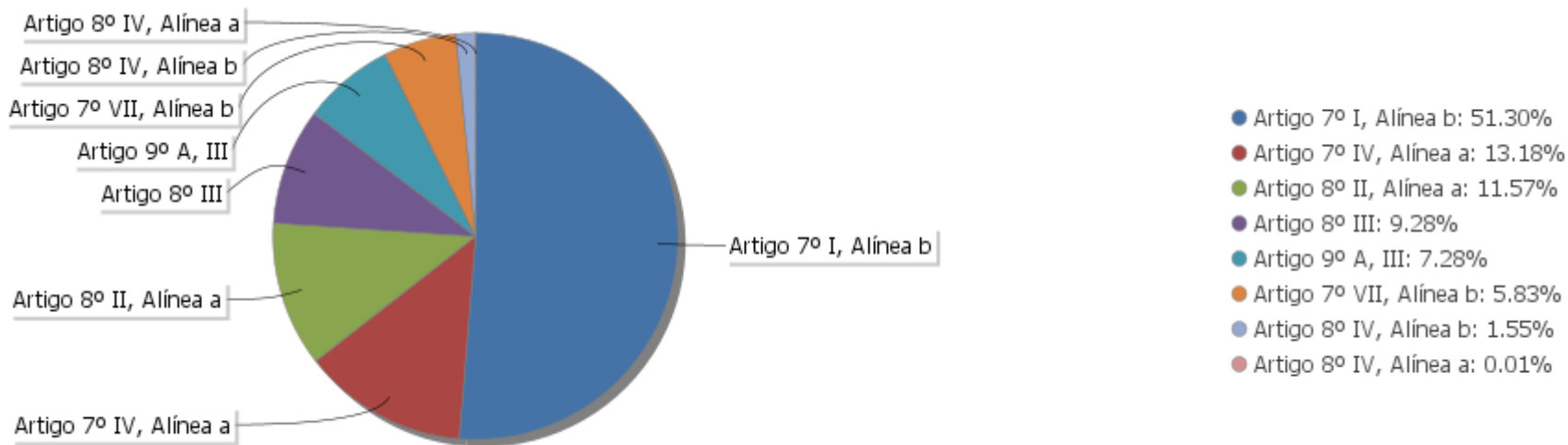
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

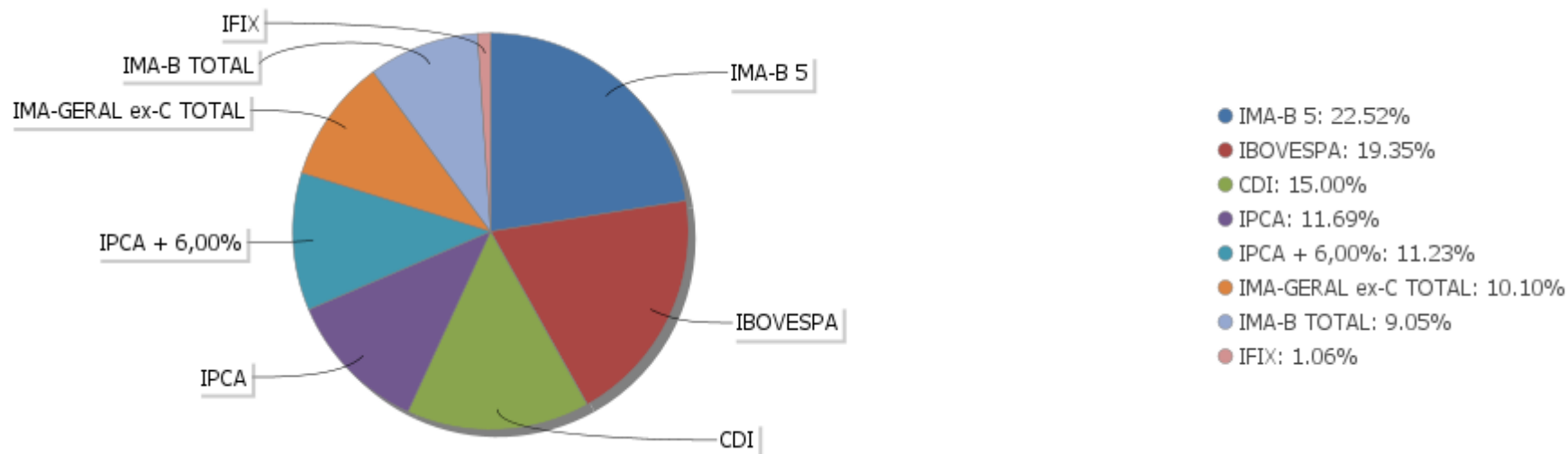
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	204.081.650,80	85,00	204.081.650,80	85,00
de 31 a 365 dias	23.275.757,77	9,69	227.357.408,57	94,70
acima de 365 dias	12.734.362,88	5,30	240.091.771,45	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

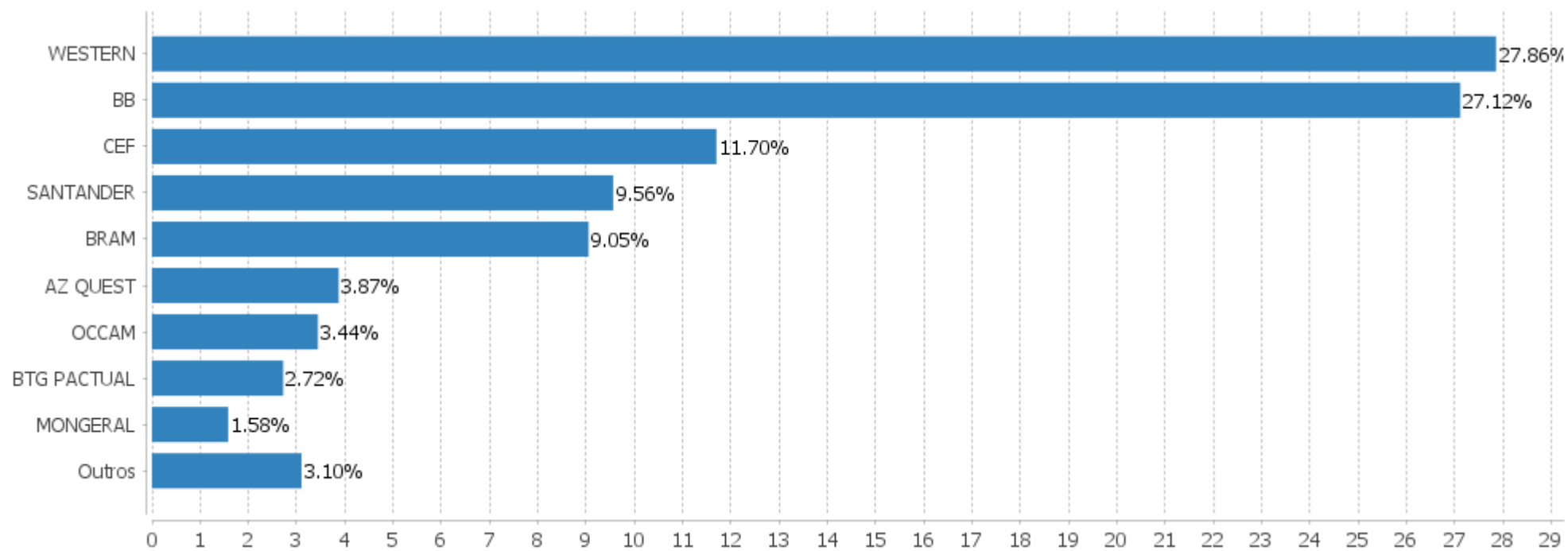


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

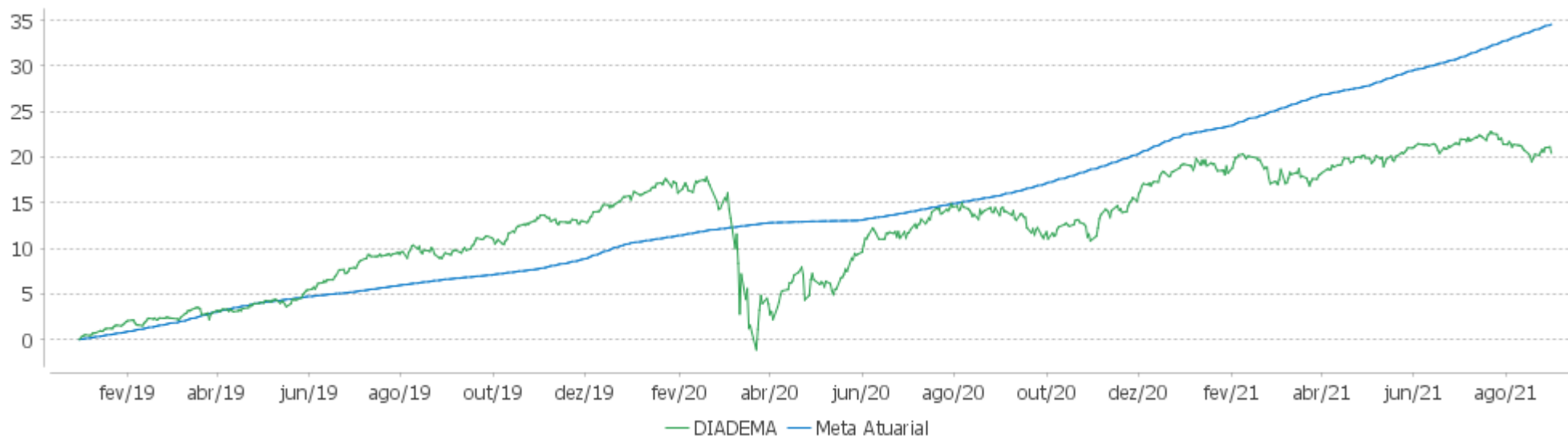
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2021	-0,82	-0,99	0,86	1,54	0,90	0,39	-0,04	-0,79					1,02
IPCA + 5,44%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,28	0,97	1,43	1,34					9,45
p.p. indexador	-1,49	-2,23	-0,56	0,81	-0,38	-0,59	-1,47	-2,13					-8,43
2020	0,65	-1,49	-9,14	2,57	2,61	1,62	3,08	-0,83	-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

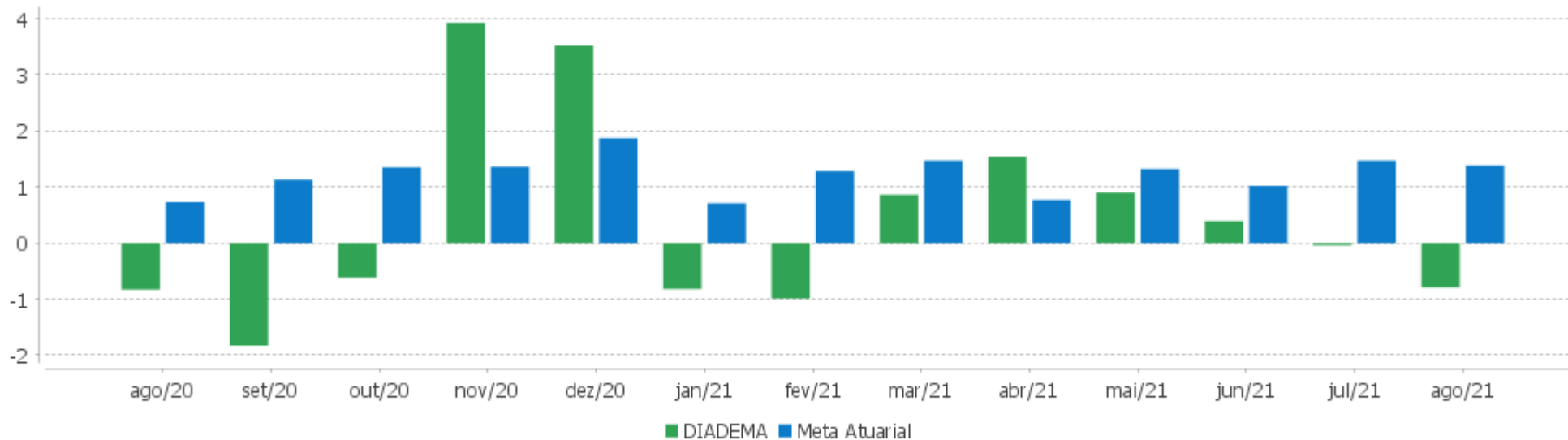
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	15	46,88	03 meses	-0,45	3,79	-4,24	3,85
Meses abaixo - Meta Atuarial	17	53,13	06 meses	2,87	7,38	-4,51	4,75
			12 meses	6,03	15,78	-9,75	5,63
			24 meses	10,01	25,63	-15,62	9,66
Maior rentabilidade da Carteira	3,93	2020-11	Desde 31/12/2018	20,44	33,92	-13,48	8,53
Menor rentabilidade da Carteira	-9,14	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



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
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,16 -0,07	-2,94 -0,77	-1,16 -0,12	-0,22 -0,41	2,34 -0,93	9,19 -0,93	39,49 -0,95
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,45 105,42	2,17 105,51	1,17 107,82	1,91 107,74	2,78 102,89	6,29 94,15	12,84 95,94
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,20 -1,19	0,78 -9,05	0,06 -3,87	1,78 -5,90	4,42 -11,81	13,30 -12,91	28,54 -9,73
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO % do CDI	0,77 180,58	3,48 168,85	1,70 155,89	2,95 166,65	5,21 192,91	4,76 71,16	11,61 86,75
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	-0,47 -0,62	-2,10 -3,57	-1,17 -1,22	0,06 -1,91	1,41 -3,36	13,32 -1,14	34,97 4,00
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,13 -0,02	1,33 -0,14	-0,02 -0,07	1,85 -0,12	4,54 -0,23	13,99 -0,46	30,17 -0,79
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,46 -0,93	3,37 -6,47	1,49 -2,44	3,08 -4,60	6,59 -9,64	16,84 -9,37	36,83 -1,45
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,45 -0,11	-1,37 -0,59	-0,59 -0,47	0,09 -0,40	0,99 -0,31	7,10 -0,44	24,38 0,06
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-1,45 -2,32	-1,51 -7,19	-2,22 -4,60	-1,04 -5,55	-0,01 -9,69	9,20 -3,15	27,34 11,13
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,10 -0,05	1,30 -0,17	-0,06 -0,11	1,82 -0,14	4,51 -0,25	13,87 -0,58	30,03 -0,93
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA Var. IPCA + 6,00% p.p.	-4,32 -5,70	-66,22 -76,05	-64,91 -68,84	-65,91 -73,59	-65,18 -81,41	-91,18 -117,39	-89,83 -128,11
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP % do CDI	-1,10 -260,19	-24,38 -1.183,50	-10,02 -920,18	-14,72 -831,20	-29,49 -1.091,11	-99,81 -1.493,43	-99,81 -745,84
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-6,82 -4,34	-7,11 -6,91	-9,94 -4,05	-4,11 -12,06	1,31 -18,23	11,58 -5,87	71,44 16,53
TARPON GT 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-6,37 -3,89	16,39 16,59	-4,57 1,32	14,98 7,03	38,13 18,60		
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-5,06 -2,58	2,78 2,97	-7,82 -1,93	3,94 -4,01	13,02 -6,52	19,94 2,50	87,03 32,12
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,44 0,04	-2,14 -1,94	-6,91 -1,01	4,54 -3,41	13,32 -6,22	14,01 -3,44	66,42 11,51
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	3,35	22,87	8,86	19,87	30,38	53,30	60,08

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Varição da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	789,03	1.110,02	813,73	1.121,87	1.124,17	797,49	448,98
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO Var. IFIX p.p.	-18,68 -16,05	-12,87 -8,68	-16,71 -14,34	-11,21 -6,48	10,21 11,37	4,21 0,70	-8,00 -36,53
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11 Var. IBOVESPA p.p.	-2,47 0,01	-3,33 -3,14	-1,81 4,08	-4,24 -12,19	-5,97 -25,50	-3,35 -20,80	6,56 -48,35
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	2,59 5,07	16,76 16,96	8,57 14,46	11,21 3,27	15,64 -3,90	105,62 88,17	116,98 62,07
DIADEMA Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,79 -2,18	1,02 -8,81	-0,45 -4,38	2,87 -4,81	6,03 -10,20	10,01 -16,20	
CDI	0,42	2,06	1,09	1,77	2,70	6,68	13,38
IBOVESPA	-2,48	-0,20	-5,89	7,95	19,54	17,45	54,91
INPC + 6,00%	1,39	10,11	4,07	7,96	17,02	27,69	39,70
IPCA + 6,00%	1,38	9,83	3,93	7,68	16,23	26,21	38,28

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	0,37	1,37	0,77	1,29	2,24	7,41	15,36	23,32	39,53
IRF-M 1+	-1,11	-5,18	-1,73	-1,87	-3,32	6,96	28,83	35,92	63,00
IRF-M TOTAL	-0,60	-2,63	-0,86	-0,67	-1,25	7,35	25,24	32,67	56,55
IMA-B 5	0,15	1,47	0,05	1,97	4,77	14,45	30,97	39,69	59,11
IMA-B 5+	-2,22	-5,44	-2,16	-1,52	1,80	6,60	47,32	51,19	76,06
IMA-B TOTAL	-1,09	-2,17	-1,04	0,19	3,27	10,12	40,44	46,85	69,60
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,34	-0,78	-0,12	0,49	1,31	7,55	24,32	31,67	51,95
IMA-GERAL TOTAL	-0,41	-0,37	-0,16	0,57	1,87	8,50	25,67	33,36	53,41
IDKA 2	0,26	1,95	-0,23	2,29	5,08	15,28	29,79	40,22	60,31
IDKA 20	-4,42	-9,21	-4,78	-4,01	0,70	0,45	60,91	59,85	88,93
CDI	0,42	2,06	1,09	1,77	2,70	6,68	13,38	21,14	35,76

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-2,48	-0,20	-5,89	7,95	19,54	17,45	54,91	67,69	105,15
IBRX 100	-3,25	1,07	-6,53	7,96	20,88	19,52	61,19	73,03	111,89
IBRX 50	-3,50	1,23	-6,61	8,25	22,12	19,45	54,17	67,38	104,18
SMALL CAP	-3,82	0,95	-8,23	6,49	16,98	24,03	87,36	82,99	149,92
IFIX	-2,63	-4,19	-2,37	-4,74	-1,16	3,51	28,53	31,95	55,61
Índice Consumo - ICON	-3,90	-5,90	-8,34	0,65	0,42	6,20	60,80	43,37	64,23
Índice Dividendos - IDIV	-0,50	-0,20	-4,33	10,92	19,40	15,05	72,87	73,37	131,37

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,87	5,67	2,38	4,51	9,68	12,35	16,21	21,08	24,05
INPC	0,88	5,94	2,52	4,79	10,42	13,67	17,40	21,68	23,78
IGPM	0,66	16,75	2,06	11,01	31,12	48,19	55,53	69,35	66,46
SELIC	0,41	2,05	1,08	1,76	2,69	6,66	13,35	21,11	35,72

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	3,34	19,17	5,75	10,37	21,46	92,07	93,87	199,05	230,68
MSCI ACWI	2,79	13,52	2,42	4,91	19,14	80,33	76,32	153,23	182,42
MSCI World	2,78	15,58	3,77	7,14	20,26	82,56	79,59	161,97	189,98

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,22	8,46	3,42	6,63	14,05	21,50	30,63	41,51	50,76
IPCA + 5,00%	1,30	9,15	3,67	7,15	15,14	23,85	34,42	47,00	58,11
IPCA + 5,50%	1,34	9,49	3,80	7,41	15,69	25,03	36,34	49,80	61,89
IPCA + 5,89%	1,38	9,76	3,90	7,62	16,11	25,95	37,85	52,02	64,89
IPCA + 6,00%	1,38	9,83	3,93	7,68	16,23	26,21	38,28	52,65	65,74
INPC + 4,00%	1,23	8,73	3,56	6,92	14,82	22,92	31,98	42,21	50,44
INPC + 6,00%	1,39	10,11	4,07	7,96	17,02	27,69	39,70	53,40	65,38

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

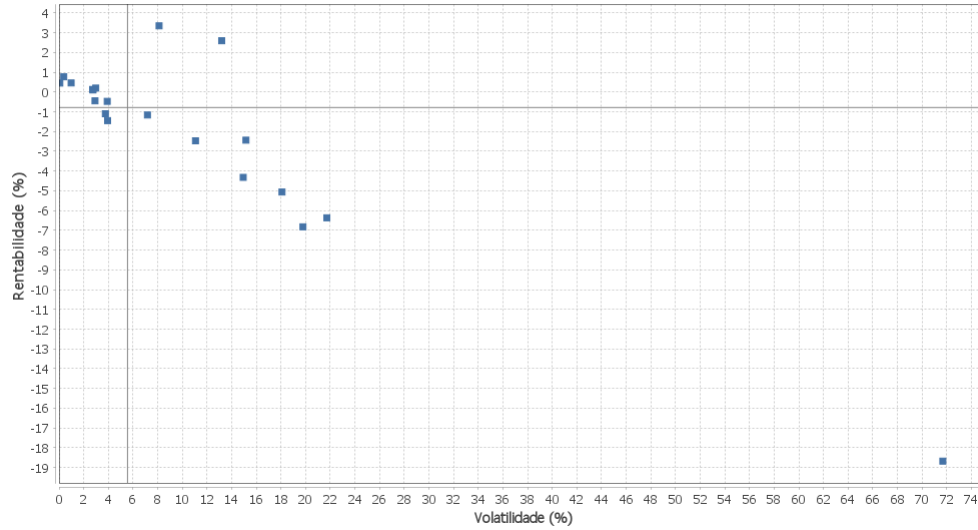
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
154	02/08/2021	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4.000.000,00	0,00	191.551,46681500	20,8821162610
156	02/08/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.000.000,00	1.708.014,09976900	2,3419010420
157	05/08/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	40.000,00	17.072,14513700	2,3429978880
172	05/08/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.230,92	952,16475100	2,3429978880
173	05/08/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.198.402,87	511.482,69323600	2,3429978880
158	06/08/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	15.000,00	6.400,90436600	2,3434188580
166	06/08/2021	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	133.531,87	0,00	88.443,92962300	1,5097912380
174	06/08/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.193.148,43	509.148,59967400	2,3434188580
159	12/08/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.286.000,00	548.293,40771300	2,3454595330
175	12/08/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.483.440,78	2.337.896,13681100	2,3454595330
165	16/08/2021	BB PREV IPCA I	0,00	457.343,77	181.965,34540500	2,5133564250
155	17/08/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.231.000,00	0,00	524.502,35593500	2,3469865980
167	17/08/2021	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	0,00	1.231.000,00	820.454,35550500	1,5003881590
168	17/08/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	475.453,43	0,00	202.580,37706900	2,3469865980
164	19/08/2021	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	0,00	7.000.000,00	1.502.646,98643270	4,6584461000
170	20/08/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	125.745,23	0,00	53.544,60381300	2,3484202150
169	20/08/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	7.122.596,49	0,00	3.032.931,00804700	2,3484202150
160	23/08/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	4.257,21425100	2,3489538960
163	23/08/2021	WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	7.000.000,00	0,00	984,26547850	7.111,9023809000
161	25/08/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	128.000,00	54.467,74270100	2,3500147730
171	27/08/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.299.063,51	0,00	1.828.822,97310100	2,3507269830
162	30/08/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	45.000,00	19.138,57610900	2,3512720980
176	30/08/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.171.192,13	2.199.316,75895700	2,3512720980
Total						

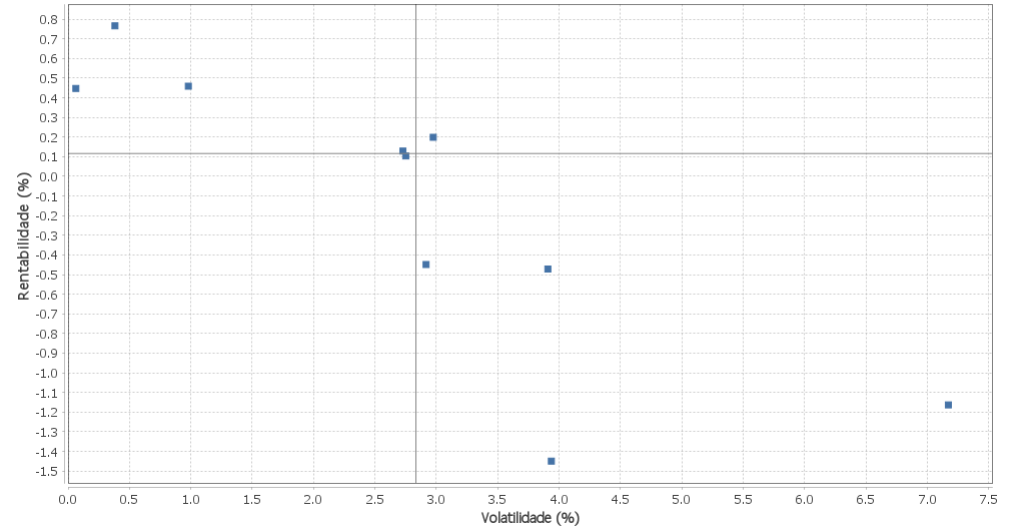
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

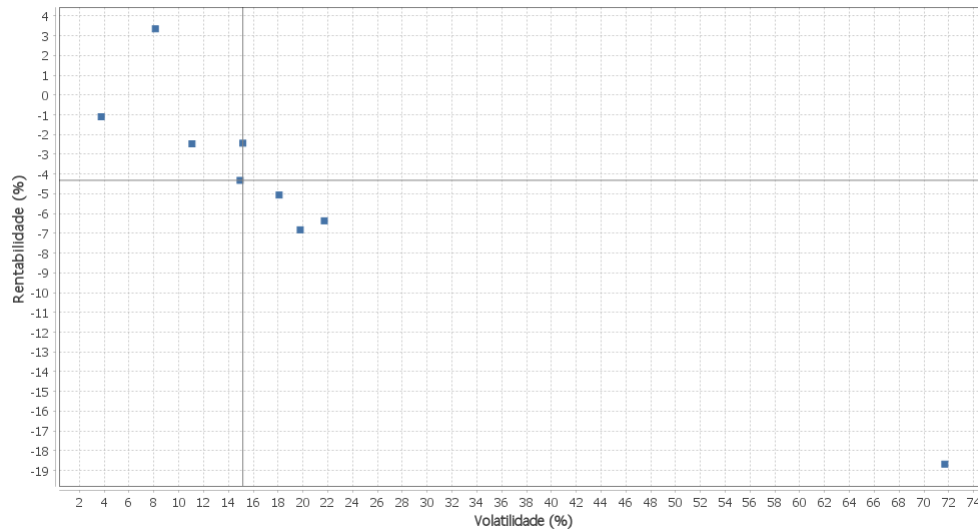
DIADEMA - No Mês



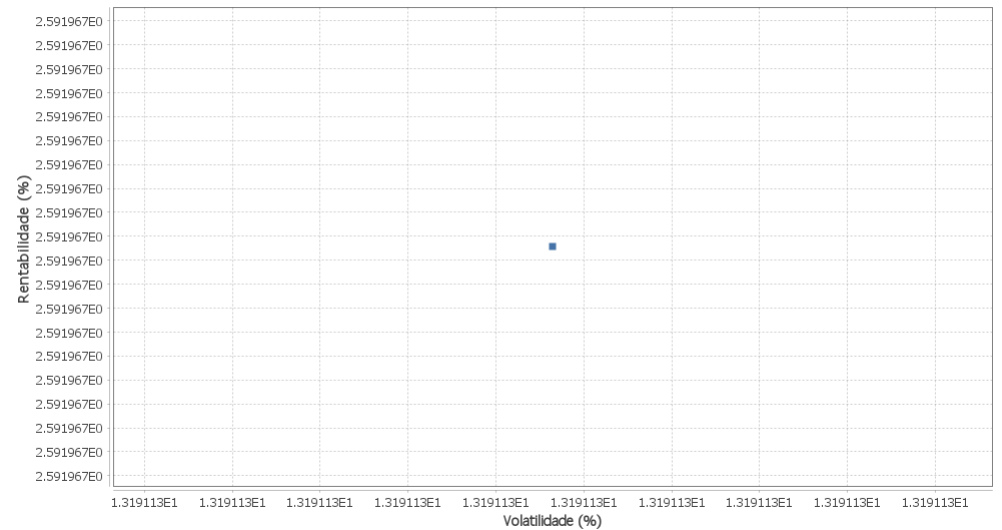
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 4.396.508,58

Value-At-Risk: 1,83%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,06	0,03	-0,00	0,36	0,45	9.920.288,64	4,13
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	Artigo 7º VII, Alínea b	0,38	0,10	0,00	0,89	0,77	3.794.788,86	1,58
BB PREV IPCA I	Artigo 7º I, Alínea b	0,98	0,62	0,02	0,03	0,46	16.751.259,61	6,98
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,73	1,25	0,08	-0,11	0,13	22.941.512,45	9,56
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,75	1,27	0,01	-0,12	0,10	4.005.902,01	1,67
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,92	1,21	0,09	-0,30	-0,45	24.244.486,06	10,10
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	Artigo 7º VII, Alínea b	2,97	1,35	0,04	-0,08	0,20	10.195.332,65	4,25
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	Artigo 8º IV, Alínea a	3,76	0,66	0,00	-0,41	-1,10	7.977,94	0,00
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,91	1,55	0,12	-0,23	-0,47	27.121.528,49	11,30
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,94	1,48	0,12	-0,48	-1,45	28.073.504,70	11,69
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	Artigo 7º IV, Alínea a	7,17	3,10	0,21	-0,22	-1,16	21.731.233,74	9,05
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	8,11	5,52	0,37	0,36	3,35	22.289.696,54	9,28
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	Artigo 8º IV, Alínea b	11,07	0,33	0,00	-0,26	-2,47	1.194.158,17	0,50
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	13,19	6,85	0,11	0,16	2,59	17.480.161,37	7,28
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	Artigo 8º IV, Alínea a	14,94	4,92	0,00	-0,32	-4,32	12.241,51	0,01
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	15,16	7,07	0,19	-0,19	-2,44	8.269.421,45	3,44
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	18,08	6,92	0,22	-0,30	-5,06	9.291.577,72	3,87
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	19,78	8,41	0,17	-0,37	-6,82	6.524.498,16	2,72
TARPON GT 30 FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	21,72	7,90	0,07	-0,31	-6,37	3.703.171,15	1,54
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	Artigo 8º IV, Alínea b	71,68	3,63	0,01	-0,27	-18,68	2.539.030,23	1,06