



DIADEMA
NOVEMBRO 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 30.11.2021.

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

70,84%

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
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,57	0,99	0,99	16.421.721,51	6,94	9.400.574.561,59	0,17
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,75	2,48	3,56	23.446.456,11	9,90	1.116.384.945,96	2,10
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,73	1,56	1,56	15.155.713,47	6,40	10.904.431.852,46	0,14
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	4,06	1,94	-1,35	0,00	0,00	992.682.489,28	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,78	2,47	2,31	4.092.265,83	1,73	6.334.560.730,61	0,06
BB	BB	BB PREV IPCA I	1,67	1,74	6,01	17.180.097,93	7,26	521.561.604,76	3,29
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,88	1,73	-1,30	0,00	0,00	7.834.893.808,79	0,00
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,36	0,72	-1,11	0,00	0,00	13.063.702.370,09	0,00
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,86	1,96	0,63	76.296.254,85	32,23		

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
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,21	0,39	0,39	13.173.099,80	5,56	8.064.205.057,36	0,16
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,13	0,63	3,79	20.518.597,30	8,67	6.797.782.473,23	0,30
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,91	2,47	2,22	22.148.551,08	9,36	1.234.041.082,90	1,79
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC	0,18	0,32	0,32	21.254.138,73	8,98	909.490.901,23	2,34
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			3,25	1,62	0,11	77.094.386,91	32,57		

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	3,25	2,69	3,19	10.439.213,84	4,41	614.778.380,64	1,70
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	0,32	0,68	5,40	3.865.170,21	1,63	720.160.597,52	0,54

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
		Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b	2,42	2,14	3,78	14.304.384,05	6,04		
		Renda Fixa	2,83	1,84	0,76	167.695.025,81	70,84		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

20,97%

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	18,92	-3,98	-11,70	7.982.440,96	3,37	1.374.450.791,66	0,58
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	23,46	-6,71	-31,32	4.824.139,44	2,04	1.947.793.507,85	0,25
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	19,99	-2,67	-15,69	7.124.114,51	3,01	981.231.017,58	0,73
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT 30 FIC FIA	17,39	-6,84	-15,04	3.398.474,69	1,44	314.117.814,39	1,08
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			18,44	-4,59	-18,29	23.329.169,60	9,86		

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	12,74	-0,50	25,55	22.777.079,74	9,62	2.433.254.492,54	0,94
Sub-total Artigo 8º III			12,74	-0,50	25,55	22.777.079,74	9,62		

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	15,04	-1,04	-26,18	7.787,15	0,00	1.110.895,52	0,70
CEF	CEF	FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	112,06	-22,16	-90,13	0,00	0,00	1.127.496,83	0,00
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			131,07	-11,45	-82,68	7.787,15	0,00		

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	30,39	2,12	6,21	2.409.521,59	1,02	64.937.296,84	3,71
BRPP	GERAÇÃO FUTURO	BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	7,31	-3,30	-7,25	1.121.801,01	0,47	354.102.384,87	0,32
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			22,96	0,34	2,52	3.531.322,60	1,49		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			13,59	-2,41	-1,21	49.645.359,09	20,97		
--	--	--	--------------	--------------	--------------	----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 8,18%

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	17,94	-0,31	17,77	19.373.455,99	8,18	4.392.298.272,66	0,44
Sub-total Artigo 9º A, III			17,94	-0,31	17,77	19.373.455,99	8,18		
Investimentos no Exterior			16,91	-0,31	17,77	19.373.455,99	8,18		
Total			4,88	0,72	1,33	236.713.840,89	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	76.296.254,85	32,23	15,00	60,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	77.094.386,91	32,57	1,00	10,00	40,00	0,00	45,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	14.304.384,05	6,04	0,00	3,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Fixa	167.695.025,81	70,84					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	23.329.169,60	9,86	2,00	16,00	25,00	0,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	22.777.079,74	9,62	2,00	8,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	7.787,15	0,00	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	3.531.322,60	1,49	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	49.645.359,09	20,97					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	19.373.455,99	8,18	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	19.373.455,99	8,18					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	1,96 333,90	0,63 17,42	1,37 90,49	0,72 27,69	3,15 83,40	1.979.213,20	344.818,30
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	1,62 275,52	0,11 3,13	1,46 96,63	0,81 30,85	2,75 72,85	691.489,41	341.857,93
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	2,14 364,35	3,78 104,91	2,25 148,48	2,76 105,24	5,37 142,35	299.402,87	521.126,00
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-4,59 -3,06	-18,29 -3,92	-16,05 -1,85	-22,68 -3,43	-12,06 -5,66	-1.122.581,40	-6.155.215,23
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-0,50 1,03	25,55 39,92	2,19 16,39	11,24 30,49	29,56 35,97	-115.387,42	5.767.746,32
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-11,45 -9,92	-82,68 -68,31	-34,37 -20,18	-73,20 -53,95	-82,74 -76,33	-1.658,42	-64.845,48
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	0,34 1,87	2,52 16,89	13,93 28,13	-0,26 18,99	3,53 9,93	12.738,25	128.498,97
Artigo 9º A, III % do CDI	-0,31 -52,67	17,77 566,15	10,83 715,93	20,33 776,54		-60.053,02	2.373.455,99
DIADEMA (Total)						1.683.163,47	3.257.442,80

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	16.885.912,26	0,00	0,00	0,00	17.180.097,93	294.185,67	991.356,26
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	25.256.144,99	0,00	-25.563.748,17	0,00	0,00	307.603,18	-470.179,32
BB PREV RF IDKA2	0,00	16.322.684,40	0,00	0,00	16.421.721,51	99.037,11	99.037,11
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	3.993.498,24	0,00	0,00	0,00	4.092.265,83	98.767,59	92.265,83
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	15.000.000,00	0,00	0,00	15.155.713,47	155.713,47	155.713,47
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	27.986.863,31	0,00	-28.135.928,46	0,00	0,00	149.065,15	-339.739,72
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	22.878.146,79	0,00	0,00	0,00	23.446.456,11	568.309,32	506.135,57
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	20.904.259,87	0,00	-21.210.791,58	0,00	0,00	306.531,71	-492.681,00
					76.296.254,85	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	11.113.356,54	22.226.212,63	-12.902.582,81	0,00	20.518.597,30	81.610,94	508.176,73
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	21.613.651,62	0,00	0,00	0,00	22.148.551,08	534.899,46	480.388,22
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	13.141.467,94	0,00	0,00	13.173.099,80	31.631,86	31.631,86
WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC	0,00	21.210.791,58	0,00	0,00	21.254.138,73	43.347,15	43.347,15
					77.094.386,91	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	10.165.987,63	0,00	0,00	0,00	10.439.213,84	273.226,21	323.187,70
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	3.838.993,55	0,00	0,00	0,00	3.865.170,21	26.176,66	197.938,30
					14.304.384,05	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	8.313.454,05	0,00	0,00	0,00	7.982.440,96	-331.013,09	-1.058.146,27
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	5.170.921,81	0,00	0,00	0,00	4.824.139,44	-346.782,37	-2.199.546,81
OCCAM FIC FIA	7.319.552,66	0,00	0,00	0,00	7.124.114,51	-195.438,15	-1.561.132,71
TARPON GT 30 FIC FIA	3.647.822,48	0,00	0,00	0,00	3.398.474,69	-249.347,79	-601.525,31
					23.329.169,60	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	22.892.467,16	0,00	0,00	0,00	22.777.079,74	-115.387,42	5.767.746,32
					22.777.079,74	0,00	0,00

Artigo 8º IV, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	7.116,28	0,00	-5.539,48	0,00	0,00	-1.576,80	-62.082,52
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	7.868,77	0,00	0,00	0,00	7.787,15	-81,62	-2.762,96
					7.787,15	0,00	0,00

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	2.403.605,19	0,00	0,00	0,00	45.000,00	2.409.521,59	50.916,40	216.890,10
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	1.168.529,16	0,00	0,00	0,00	8.550,00	1.121.801,01	-38.178,15	-88.391,13
						3.531.322,60	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	19.433.509,01	0,00	0,00	0,00	19.373.455,99	-60.053,02	2.373.455,99
					19.373.455,99	0,00	0,00

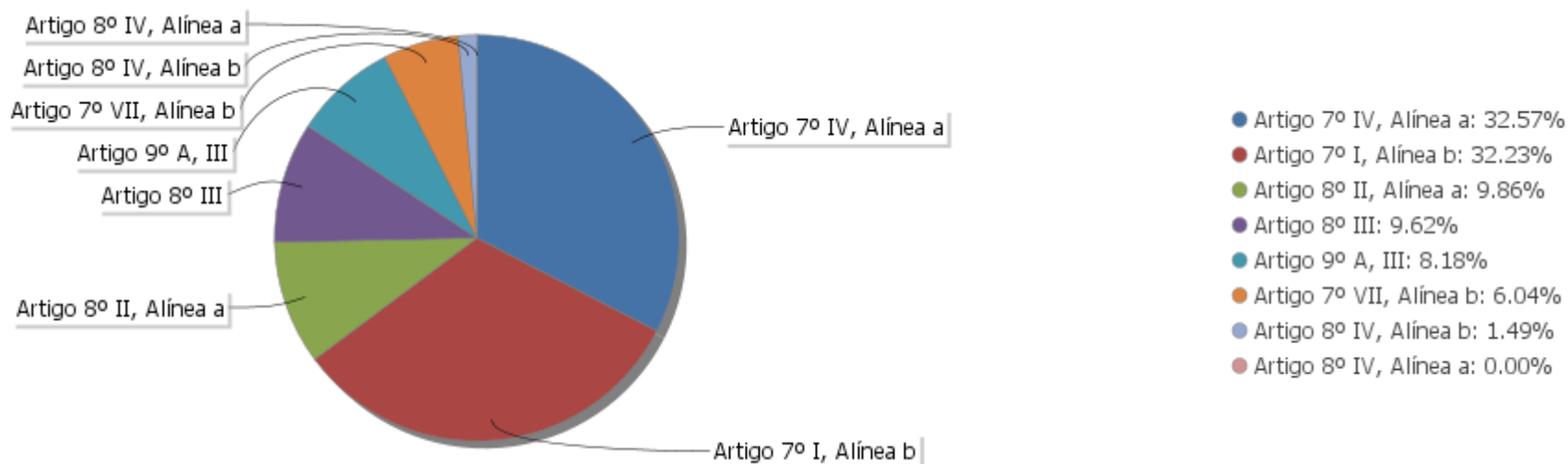
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

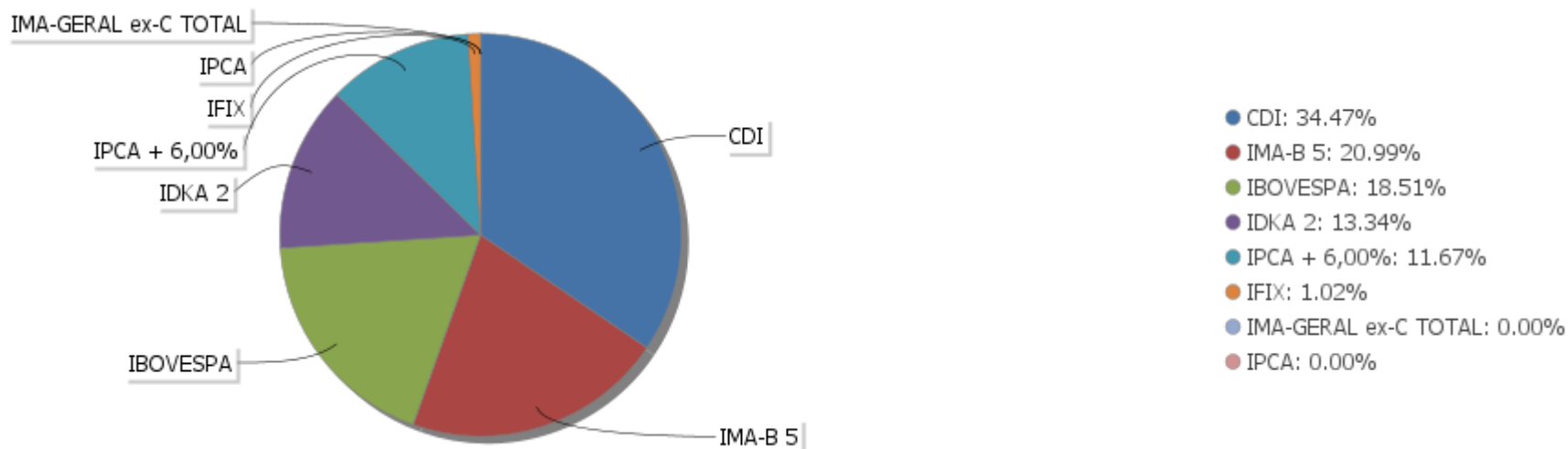
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	201.860.868,09	85,28	201.860.868,09	85,28
de 31 a 365 dias	22.004.237,37	9,30	223.865.105,46	94,57
acima de 365 dias	12.848.735,43	5,43	236.713.840,89	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

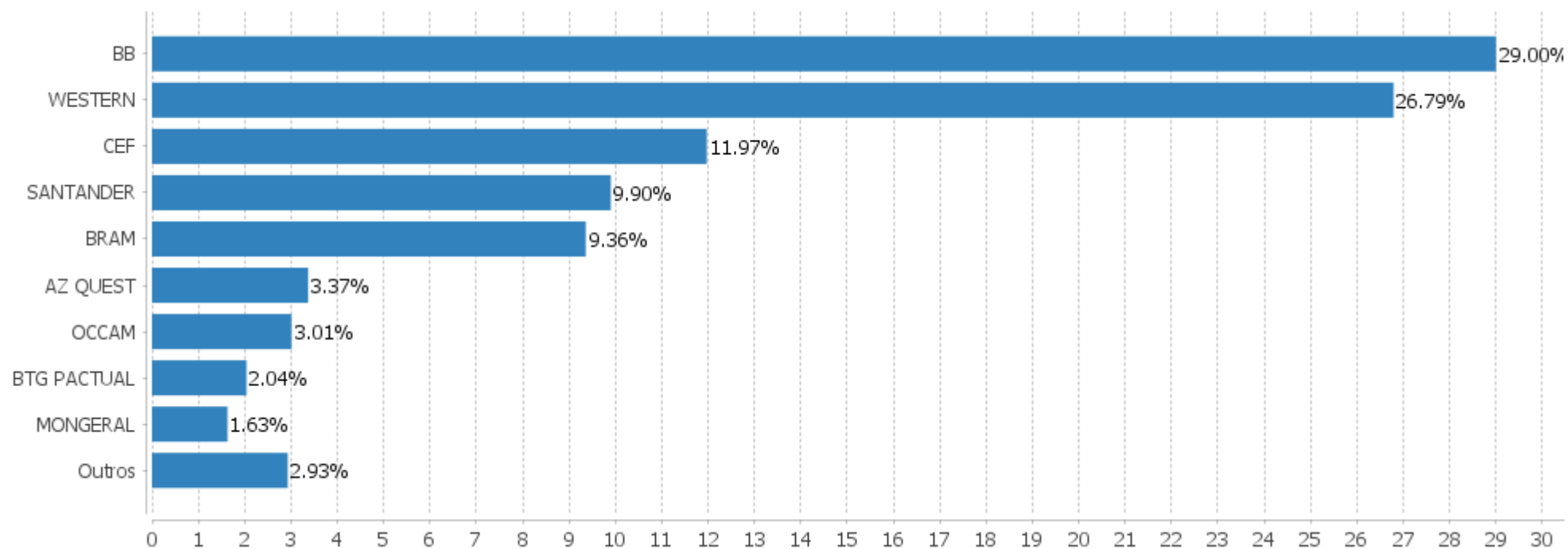


Alocação Por Estratégia



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	-0,34	-0,08	0,72		1,33
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		14,63
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		-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

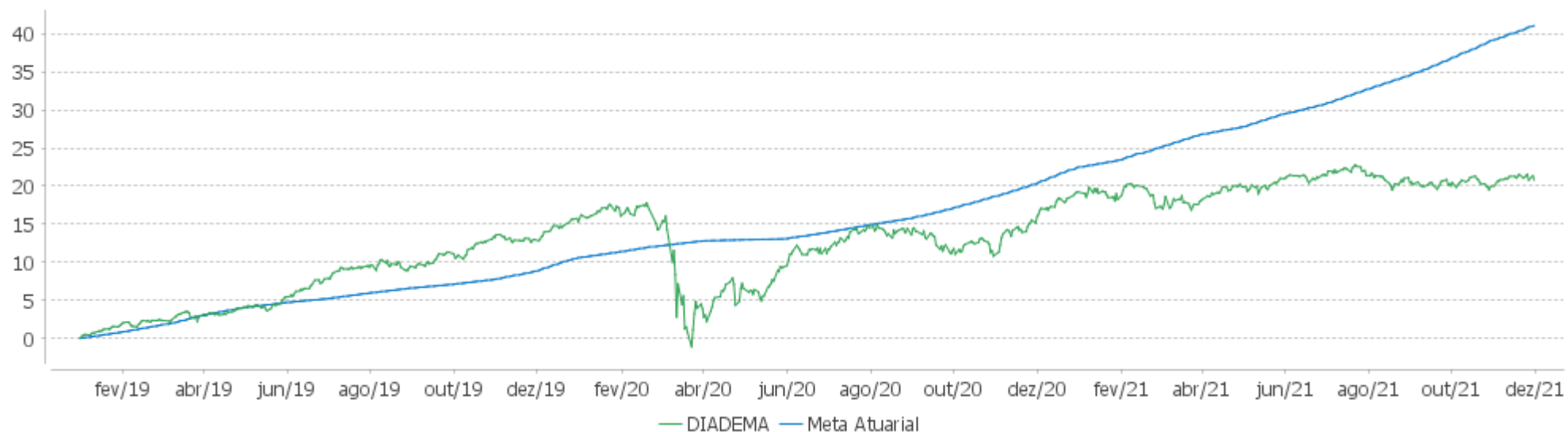
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

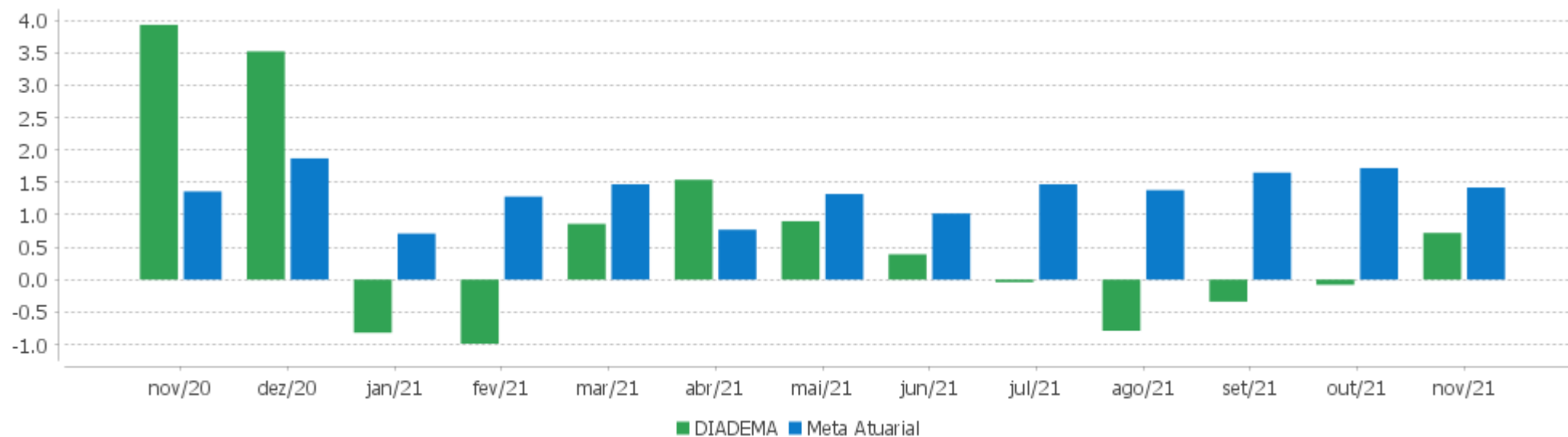
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	15	42,86	03 meses	0,30	4,73	-4,43	4,12
Meses abaixo - Meta Atuarial	20	57,14	06 meses	-0,15	8,70	-8,85	3,97
			12 meses	4,89	16,76	-11,86	4,88
			24 meses	6,93	28,90	-21,98	9,72
			Desde 31/12/2018	20,80	40,25	-19,46	8,25
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	3,93	2020-11					
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 INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	2,47 -0,03	2,87 -0,88	2,12 -0,13	2,04 -0,26	4,70 -0,95	12,32 -1,16	27,00 -1,56
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,63 107,47	3,79 105,29	1,59 104,89	2,78 106,16	4,06 107,46	6,66 96,93	12,91 96,50
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,62 106,07	3,81 105,76	1,66 109,99	2,94 112,24	4,19 110,97	6,69 97,39	12,94 96,67
WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC % do CDI	0,59 100,41	3,72 103,20	1,60 105,75	2,86 109,14	3,95 104,66		
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	2,51 0,01	-0,80 -4,55	1,33 -0,92	0,14 -2,16	2,41 -3,23	10,84 -2,64	29,42 0,86
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	2,48 -0,02	3,56 -0,19	2,20 -0,05	2,18 -0,11	5,43 -0,22	13,03 -0,45	27,77 -0,80
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,74 0,32	6,01 -9,16	2,56 -2,31	4,09 -4,90	7,30 -10,02	16,23 -13,44	33,27 -8,68
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	2,43 -0,08	3,91 -0,20	2,19 0,08	2,36 0,48	5,50 -0,42	13,43 -1,01	26,22 -1,81
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	1,73	-1,30	0,07	-0,51	1,05	4,72	18,65
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,91 -0,04	-0,93 -10,19	0,59 -2,80	-1,64 -7,49	0,38 -10,36	6,30 -9,21	24,67 5,38
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	2,47 -0,03	3,48 -0,27	2,16 -0,09	2,09 -0,20	5,35 -0,30	12,86 -0,61	27,60 -0,96
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	2,42 -0,09	3,91 -0,19	2,18 0,07	2,03 0,15	5,63 -0,28	13,49 -0,95	26,27 -1,77
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	2,69 1,27	3,19 -11,98	2,39 -2,47	2,45 -6,53	5,14 -12,19	12,64 -17,03	26,38 -15,57
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO % do CDI	0,68 116,21	5,40 149,76	1,85 122,59	3,58 136,87	6,01 159,18	5,94 86,48	11,97 89,46
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO Var. IFIX p.p.	2,12 5,76	6,21 16,37	21,90 28,13	1,53 9,98	6,75 14,94	7,31 18,10	24,23 12,15
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11 Var. IBOVESPA p.p.	-3,30 -1,76	-7,25 7,12	-4,05 10,15	-5,79 13,46	-5,28 1,13	-14,28 -8,45	5,26 -8,61
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	-22,16	-84,71	-54,75	-84,12	-84,76	-85,87	-95,38

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-23,58	-99,89	-59,61	-93,11	-102,09	-115,54	-137,33
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP % do CDI	-1,04 -176,77	-26,19 -726,65	-2,39 -158,07	-12,17 -464,82	-26,75 -708,71	-99,81 -1.452,35	-99,81 -745,86
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO % do CDI	-0,50 -85,90	25,55 709,01	2,19 144,53	11,24 429,28	29,56 783,10	44,52 647,84	71,29 532,72
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-6,71 -5,17	-31,32 -16,95	-26,06 -11,86	-33,41 -14,16	-27,72 -21,31	-20,58 -14,74	6,14 -7,73
TARPON GT 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-6,84 -5,30	6,81 21,18	-8,23 5,97	-12,42 6,83	14,24 20,65		
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,98 -2,45	-11,70 2,66	-14,09 0,11	-20,81 -1,55	-5,59 0,82	-5,24 0,60	34,00 20,13
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,67 -1,14	-15,69 -1,32	-13,85 0,35	-19,80 -0,55	-7,17 -0,76	-2,33 3,51	23,31 9,44
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	-0,31 1,22	29,40 43,77	10,83 25,03	20,33 39,58	29,12 35,52	111,44 117,27	170,79 156,92
DIADEMA Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,72 -0,70	1,33 -13,85	0,30 -4,57	-0,15 -9,14	4,89 -12,44	6,93 -22,74	
CDI	0,59	3,60	1,51	2,62	3,77	6,87	13,38
IBOVESPA	-1,53	-14,37	-14,20	-19,25	-6,41	-5,84	13,87
INPC + 6,00%	1,31	15,28	4,70	8,96	17,56	31,03	43,57
IPCA + 6,00%	1,42	15,18	4,87	8,99	17,33	29,67	41,95

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	0,79	2,03	0,65	1,42	2,35	6,40	13,74	21,69	36,07
IRF-M 1+	2,19	-7,11	-2,04	-3,73	-4,28	1,46	17,30	31,09	53,93
IRF-M TOTAL	1,79	-3,81	-1,21	-2,06	-1,93	3,27	16,74	28,91	49,37
IMA-B 5	2,50	3,75	2,25	2,30	5,65	13,47	28,56	40,58	59,06
IMA-B 5+	4,47	-6,23	-0,84	-2,98	0,81	1,50	31,39	50,00	74,04
IMA-B TOTAL	3,47	-1,49	0,70	-0,35	3,30	6,93	31,01	46,92	69,13
IMA-GERAL TOTAL	1,80	0,09	0,46	0,31	2,12	6,38	20,34	32,04	50,44
IDKA 2	2,51	4,11	2,12	1,88	5,91	14,44	28,04	40,40	59,70
IDKA 20	6,09	-12,50	-3,62	-8,23	-2,56	-7,04	31,71	56,52	86,71
CDI	0,59	3,60	1,51	2,62	3,77	6,87	13,38	20,72	33,50

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-1,53	-14,37	-14,20	-19,25	-6,41	-5,84	13,87	41,61	64,63
IBRX 100	-1,69	-13,88	-14,79	-20,36	-6,00	-4,38	17,37	45,94	70,57
IBRX 50	-1,81	-13,79	-14,84	-20,46	-5,66	-4,80	12,95	40,34	62,89
SMALL CAP	-2,29	-19,26	-20,02	-26,60	-13,19	-9,64	29,55	46,85	103,82
IFIX	-3,64	-10,16	-6,23	-8,45	-8,19	-10,79	12,08	16,51	40,35
Índice Consumo - ICON	-7,50	-26,09	-21,46	-28,01	-22,40	-19,51	15,50	11,72	36,98
Índice Dividendos - IDIV	0,89	-7,89	-7,71	-11,70	0,34	0,29	33,23	61,08	90,61

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	0,95	9,26	3,40	5,86	10,74	15,51	19,30	24,12	27,60
INPC	0,84	9,36	3,23	5,84	10,96	16,73	20,66	24,95	27,38
IGPM	0,02	16,77	0,02	2,08	17,89	46,79	52,62	67,39	65,94
SELIC	0,59	3,60	1,51	2,62	3,77	6,87	13,38	20,73	33,53

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	-1,24	31,49	10,34	16,68	32,92	93,45	140,69	197,22	243,65
MSCI ACWI	-2,91	21,57	7,09	9,69	23,86	76,81	115,31	147,67	190,75
MSCI World									

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,26	13,21	4,38	7,95	15,13	24,86	34,11	45,07	55,08
IPCA + 5,00%	1,34	14,19	4,63	8,47	16,23	27,25	37,99	50,70	62,64
IPCA + 5,50%	1,38	14,69	4,75	8,73	16,78	28,46	39,96	53,57	66,52
IPCA + 5,89%	1,41	15,07	4,84	8,93	17,21	29,40	41,51	55,84	69,61
IPCA + 6,00%	1,42	15,18	4,87	8,99	17,33	29,67	41,95	56,48	70,48
INPC + 4,00%	1,15	13,31	4,22	7,93	15,36	26,17	35,64	46,04	54,81
INPC + 6,00%	1,31	15,28	4,70	8,96	17,56	31,03	43,57	57,53	70,19

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
222	05/11/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	45.000,00	18.930,07143700	2,3771701100
223	05/11/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.262.700,86	531.178,16629500	2,3771701100
224	08/11/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	15.000,00	6.308,28893900	2,3778238670
225	08/11/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	702.220,27	295.320,55748300	2,3778238670
226	10/11/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPKA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.000.000,00	0,00	2.038.524,85817900	2,4527540000
227	10/11/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.000.000,00	0,00	1.034.431,83960500	3,8668570000
228	10/11/2021	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	9.000.000,00	6.033.607,19091900	1,4916450000
229	10/11/2021	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	0,00	7.000.000,00	2.922.465,08092590	2,3952382000
230	11/11/2021	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	0,00	1.478.613,05	988.278,40637900	1,4961503160
231	12/11/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	55.000,00	23.099,58501400	2,3809951550
232	12/11/2021	BB PREV RF IDKA2	2.491.299,07	0,00	837.432,84984700	2,9749239840
233	12/11/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.313.803,39	2.231.757,33005700	2,3809951550
234	12/11/2021	WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC	7.000.000,00	0,00	4.896,67345190	1.429,5419265000
235	16/11/2021	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	0,00	8.000.000,00	5.343.073,25719400	1,4972656400
236	16/11/2021	BB PREV RF IDKA2	4.000.000,00	0,00	1.344.105,71789300	2,9759563900
237	16/11/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	73.225,74	0,00	30.743,66491900	2,3818155770
238	16/11/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.000.000,00	0,00	1.679.391,14960200	2,3818155770
239	16/11/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.539,48	0,00	1.431,23485300	3,8704200000
240	16/11/2021	FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	0,00	5.539,48	1.228,49639000	4,5091570000
241	17/11/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPKA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.000.000,00	0,00	2.027.403,19251100	2,4662090000
242	17/11/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.000.000,00	0,00	1.033.370,90497700	3,8708270000
243	17/11/2021	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	9.000.000,00	6.020.924,72091200	1,4947870000
244	17/11/2021	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	0,00	7.000.000,00	2.908.340,08729630	2,4068712000
245	18/11/2021	WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC	7.000.000,00	0,00	4.892,34763220	1.430,8059292000
246	19/11/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	7.000,00	2.936,37550200	2,3838912960
247	19/11/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	7.632.979,88	0,00	3.201.899,30338100	2,3838912960
248	22/11/2021	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	0,00	8.000.000,00	5.345.818,08876100	1,4964968630
249	22/11/2021	BB PREV RF IDKA2	4.000.000,00	0,00	1.343.423,36529000	2,9774679400

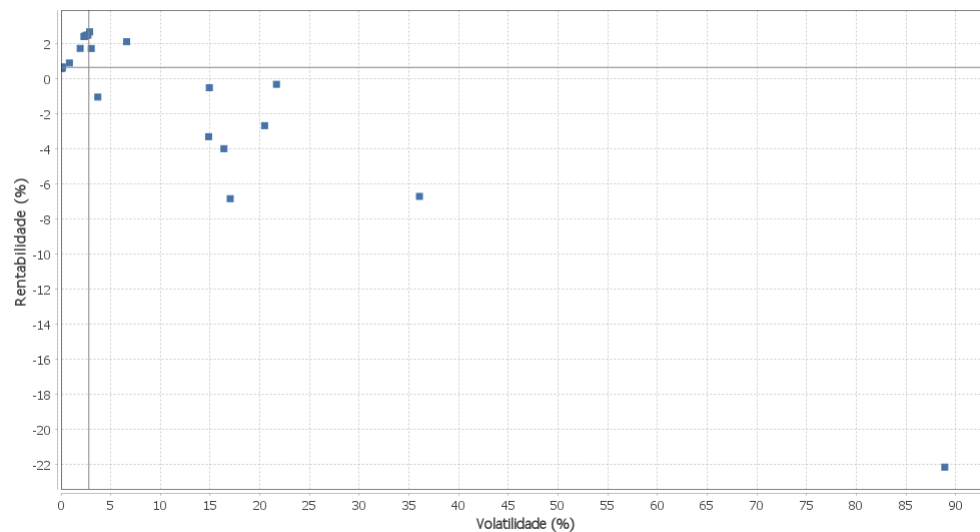
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
250	22/11/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.000.000,00	0,00	1.677.501,90871100	2,3844980320
251	23/11/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.000,00	2.096,20423100	2,3852637670
252	23/11/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	15.818,95	0,00	6.631,94998300	2,3852637670
253	25/11/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	135.000,00	56.562,24148400	2,3867512400
254	25/11/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.000.000,00	0,00	2.018.262,85693900	2,4773780000
255	25/11/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.117.864,49	0,00	1.061.769,12078800	3,8783050000
256	25/11/2021	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	10.135.928,46	6.768.277,32200600	1,4975640000
257	25/11/2021	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	0,00	7.210.791,58	2.981.990,17098180	2,4181138000
258	26/11/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.504.188,06	0,00	1.886.550,89522300	2,3875253360
259	26/11/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.018.063,97	0,00	262.415,01239100	3,8795950000
260	26/11/2021	WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC	7.210.791,58	0,00	5.030,73749380	1.433,3468182000
261	30/11/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	20.928,25874400	2,3891141930
262	30/11/2021	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	0,00	8.085.135,12	5.361.564,62776300	1,5079805395
263	30/11/2021	BB PREV RF IDKA2	5.831.385,33	0,00	1.940.959,28243900	3,0043831330
264	30/11/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.000.000,00	0,00	837.130,34975800	2,3891141930
265	30/11/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	60.550,47	25.344,31806500	2,3891141930
266	30/11/2021	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.251.307,82	2.198.014,57602400	2,3891141930
Total						

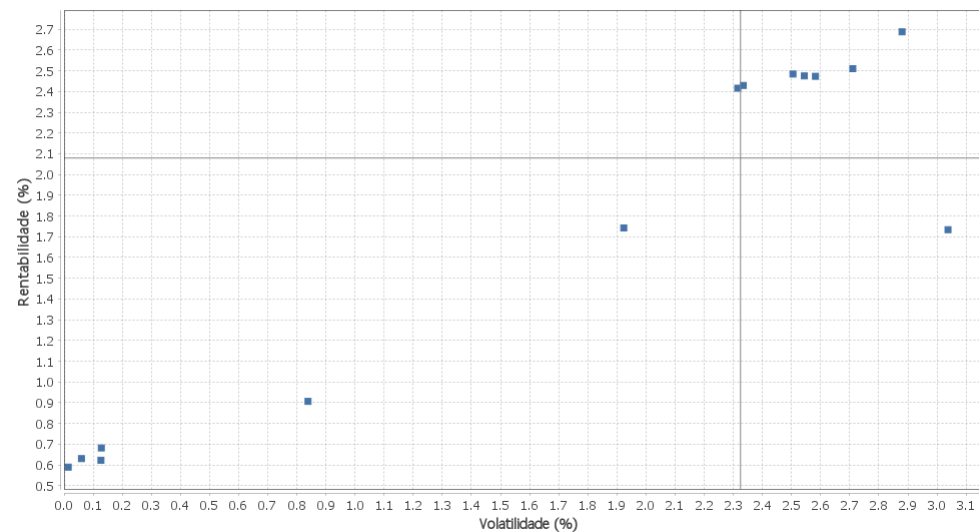
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

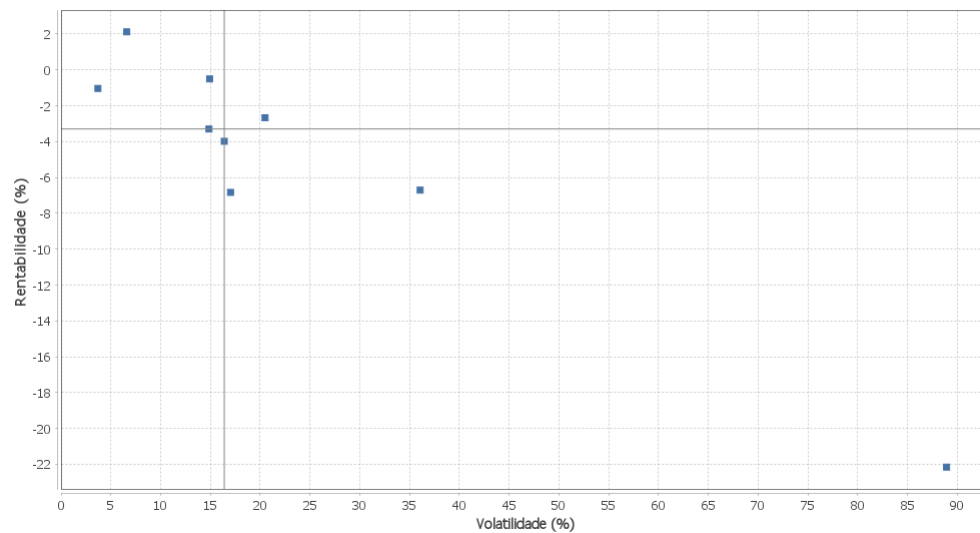
DIADEMA - No Mês



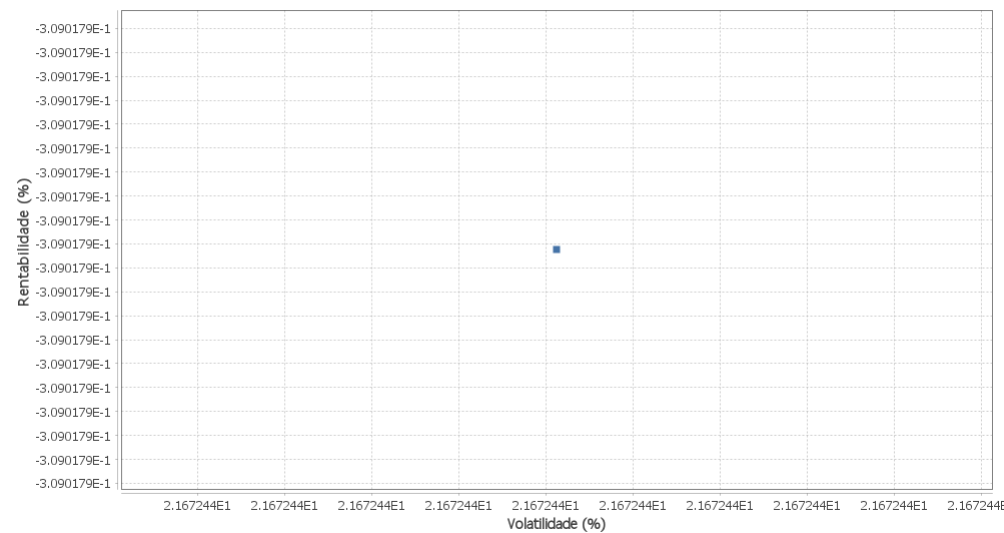
Renda Fixa - No Mês



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\$): 4.348.115,84

Value-At-Risk: 1,84%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,03	0,00	0,17	0,59	21.254.138,73	8,98
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,06	0,05	0,00	0,73	0,63	20.518.597,30	8,67
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,13	0,07	0,00	0,28	0,62	13.173.099,80	5,56
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	Artigo 7º VII, Alínea b	0,13	0,07	0,00	0,74	0,68	3.865.170,21	1,63
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,84	NaN	0,00	0,38	0,91	0,00	0,00
BB PREV IPCA I	Artigo 7º I, Alínea b	1,92	0,76	0,01	0,60	1,74	17.180.097,93	7,26
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,32	1,64	0,04	0,79	2,42	15.155.713,47	6,40
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	2,33	1,34	0,04	0,79	2,43	16.421.721,51	6,94
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,50	1,54	0,07	0,76	2,48	23.446.456,11	9,90
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	Artigo 7º IV, Alínea a	2,54	1,55	0,06	0,74	2,47	22.148.551,08	9,36
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,58	1,55	0,01	0,73	2,47	4.092.265,83	1,73
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,71	NaN	0,00	0,71	2,51	0,00	0,00
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	Artigo 7º VII, Alínea b	2,88	1,63	0,03	0,73	2,69	10.439.213,84	4,41
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,04	NaN	0,00	0,38	1,73	0,00	0,00
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	Artigo 8º IV, Alínea a	3,70	0,16	0,00	-0,44	-1,04	7.787,15	0,00
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	Artigo 8º IV, Alínea b	6,60	2,15	0,00	0,23	2,12	2.409.521,59	1,02
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	Artigo 8º IV, Alínea b	14,85	3,26	0,00	-0,26	-3,30	1.121.801,01	0,47
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	14,92	7,19	0,55	-0,07	-0,50	22.777.079,74	9,62
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	16,39	8,71	0,22	-0,28	-3,98	7.982.440,96	3,37
TARPON GT 30 FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	17,02	9,97	0,08	-0,44	-6,84	3.398.474,69	1,44
OCCAM FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	20,48	10,34	0,22	-0,16	-2,67	7.124.114,51	3,01
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	21,67	8,18	0,27	-0,04	-0,31	19.373.455,99	8,18
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	36,06	15,60	0,21	-0,20	-6,71	4.824.139,44	2,04
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	Artigo 8º IV, Alínea a	88,91	NaN	0,00	-0,26	-22,16	0,00	0,00