



LDB
EMPRESAS

DIADEMA
AGOSTO 2023



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 31.08.2023.

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 77,20%

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				
MONGERAL	BEM	MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	5,06	-0,64	-0,65	-0,65	5.515.375,24	3,90	225.866.363,08	2,44
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC	0,04	0,06	1,17	8,84	10.326.999,86	7,31	375.680.745,19	2,75
BB	BB	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,02	0,05	1,14	3,69	27.031.813,43	19,14	29.293.680.703,24	0,09
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,45	-0,19	0,63	9,92	18.296.113,30	12,95	5.643.739.686,42	0,32
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,57	-0,08	0,84	9,07	61.170.301,83	43,30		

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				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,00	0,44	8,11	0,00	0,00	14.797.589.893,96	0,00
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,04	1,16	8,81	14.463.605,45	10,24	14.734.335.445,36	0,10
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,10	0,07	1,33	9,01	19.684.775,48	13,93	2.938.953.438,08	0,67
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,06	0,05	1,27	9,16	10.464.187,77	7,41	9.013.672.474,30	0,12
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,18	0,06	1,26	8,97	44.612.568,70	31,58		

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				
MONGERAL	BEM	MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	1,36	0,00	0,08	2,01	0,00	0,00	187.171.598,33	0,00
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO	1,06	0,09	1,98	7,94	3.281.402,52	2,32	2.608.104.218,67	0,13
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			1,30	0,09	1,98	5,38	3.281.402,52	2,32		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

0,34

-0,02

1,05

8,71

109.064.273,05

77,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

10,64%

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	20,26	-1,34	-7,18	2,03	4.659.676,27	3,30	1.370.470.559,17	0,34
GUEPARDO	DAYCOVAL	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	22,25	-2,56	-3,34	23,84	4.867.024,22	3,45	341.392.227,27	1,43
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT 30 FIC FIA	21,57	-2,20	-2,13	29,38	5.506.285,30	3,90	786.608.043,15	0,70
Sub-total Artigo 8º I			18,87	-2,05	-4,14	15,28	15.032.985,79	10,64		
Renda Variável			18,87	-2,05	-4,14	15,28	15.032.985,79	10,64		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

10,67%

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	24,14	1,32	3,20	24,50	15.067.982,17	10,67	1.481.298.362,51	1,02
Sub-total Artigo 9º III			24,14	1,32	3,20	24,50	15.067.982,17	10,67		
Investimentos no Exterior			24,14	1,32	3,20	24,50	15.067.982,17	10,67		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

0,00%

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
PÁTRIA	PÁTRIA	PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	439,18	0,00	0,00	-98,70	0,00	0,00	2.615.006,70	0,00
Sub-total Artigo 10º II			439,18	0,00	0,00	-98,70	0,00	0,00		
Investimentos Estruturados			439,18	0,00	0,00	-98,70	0,00	0,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

1,49%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
PLURAL	GENIAL	BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPFF11	8,01	0,60	0,60	13,77	1.172.997,36	0,83	351.299.101,59	0,33
RIO BRAVO	BB	BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII	61,83	0,00	-40,47	-35,35	928.354,91	0,66	19.216.946,54	4,83
Sub-total Artigo 11º			33,52	0,33	-22,87	-14,78	2.101.352,27	1,49		
Fundos Imobiliários			33,52	0,33	-22,87	-14,78	2.101.352,27	1,49		
Total			2,40	-0,09	0,21	9,73	141.266.593,28	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	61.170.301,83	43,30	0,00	31,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	44.612.568,70	31,58	0,00	45,00	60,00	0,00	65,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	3.281.402,52	2,32	0,00	4,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	109.064.273,05	77,20					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	15.032.985,79	10,64	0,00	9,00	30,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	15.032.985,79	10,64					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	15.067.982,17	10,67	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	15.067.982,17	10,67					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º II	Fundo de Participação	0,00	0,00	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	0,00	0,00					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	2.101.352,27	1,49	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	2.101.352,27	1,49					5,00
Total		141.266.593,28	100,00					

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	0,84 73,81	9,07 102,32	3,28 98,72	6,84 102,39	13,25 97,77	503.794,46	5.063.294,74
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,26 110,18	8,97 101,14	3,54 106,61	6,90 103,29	13,63 100,55	597.749,87	5.601.718,32
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	1,98 173,94	5,38 60,66	3,61 108,88	5,89 88,15	10,10 74,50	68.065,82	350.620,34
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-4,14 0,95	15,28 9,80	10,19 3,36	18,46 8,16	11,33 5,65	-648.833,18	1.931.761,72
Artigo 9º III % do CDI	3,20 281,16	24,50 276,33	4,58 138,00	15,55 232,88	17,44 128,71	467.681,58	2.965.293,07
Artigo 10º II % do CDI	0,00 0,00	-98,70 -1.113,15	-98,74 -2.974,84	-98,71 -1.478,25	-98,68 -728,13	0,00	-17.973,75
Artigo 11º % do CDI	-22,87 -2.007,77	-14,78 -166,68	-19,72 -594,00	-15,69 -234,97	3,26 24,06	-627.484,21	-363.100,04
DIADEMA (Total)						360.974,34	15.531.614,40

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	26.726.185,58	0,00	0,00	0,00	27.031.813,43	305.627,85	962.712,88
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	18.181.443,64	0,00	0,00	0,00	18.296.113,30	114.669,66	1.650.612,94
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,00	5.551.527,08	0,00	0,00	5.515.375,24	-36.151,84	-36.151,84
WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC	10.207.351,07	0,00	0,00	0,00	10.326.999,86	119.648,79	1.227.010,08
					61.170.301,83	503.794,46	

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	14.655.095,08	17.882.519,64	-18.261.681,28	0,00	14.463.605,45	187.672,01	2.205.124,39

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	10.333.263,83	0,00	0,00	0,00	10.464.187,77	130.923,94	878.007,80
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.848.454,69	0,00	-4.869.834,07	0,00	0,00	21.379,38	568.401,78
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	19.427.000,94	0,00	0,00	0,00	19.684.775,48	257.774,54	1.950.184,35
					44.612.568,70	597.749,87	

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

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	3.217.672,69	0,00	0,00	0,00	3.281.402,52	63.729,83	241.304,09
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	5.547.191,09	0,00	-5.551.527,08	0,00	0,00	4.335,99	109.316,25
					3.281.402,52	68.065,82	

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	5.020.353,57	0,00	0,00	0,00	4.659.676,27	-360.677,30	92.548,17
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	5.035.081,63	0,00	0,00	0,00	4.867.024,22	-168.057,41	937.034,91
TARPON GT 30 FIC FIA	5.626.383,77	0,00	0,00	0,00	5.506.285,30	-120.098,47	1.250.533,90
					15.032.985,79	-648.833,18	

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	14.600.300,59	0,00	0,00	0,00	15.067.982,17	467.681,58	2.965.293,07
					15.067.982,17	467.681,58	

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	237,18	0,00	-237,18	0,00	0,00	0,00	-17.973,75
					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	1.567.833,75	0,00	0,00	0,00	5.000,00	928.354,91	-634.478,84	-508.211,48
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPF11	1.175.302,73	0,00	0,00	0,00	9.300,00	1.172.997,36	6.994,63	145.111,44
						2.101.352,27	-627.484,21	

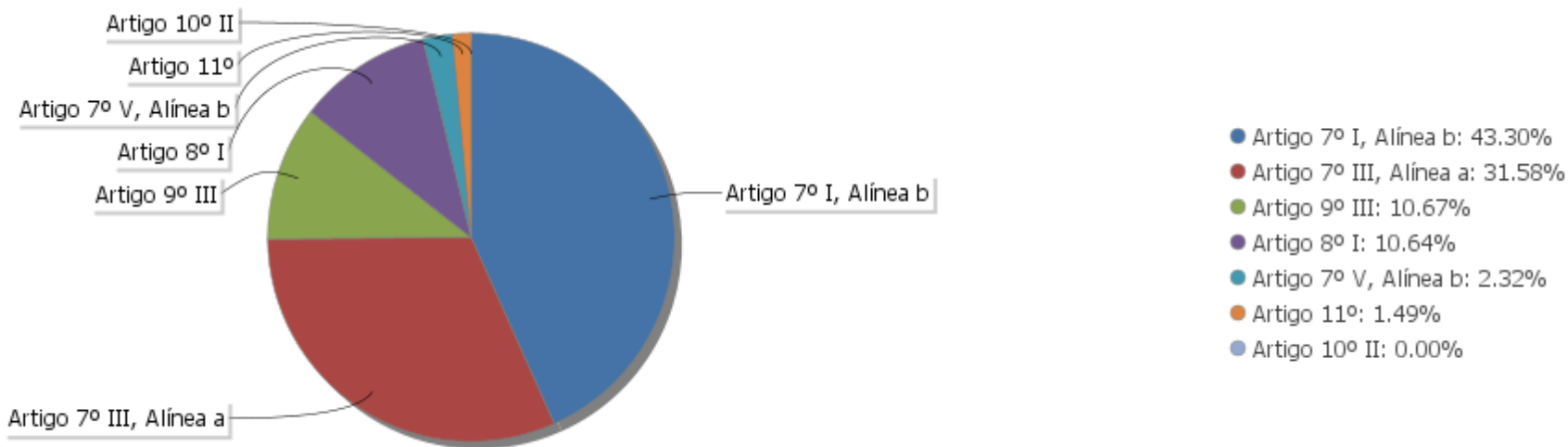
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

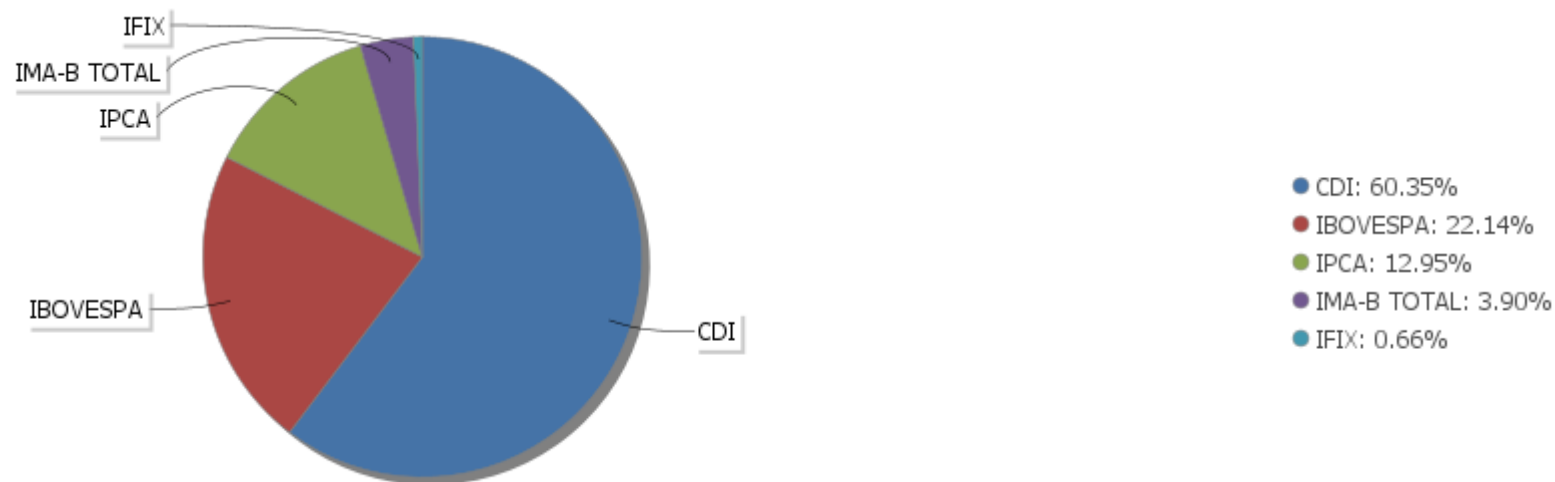
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	122.023.850,06	86,38	122.023.850,06	86,38	
de 31 dias a 365 dias	19.242.743,22	13,62	141.266.593,28	100,00	
acima de 365 dias	0,00	0,00	141.266.593,28	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

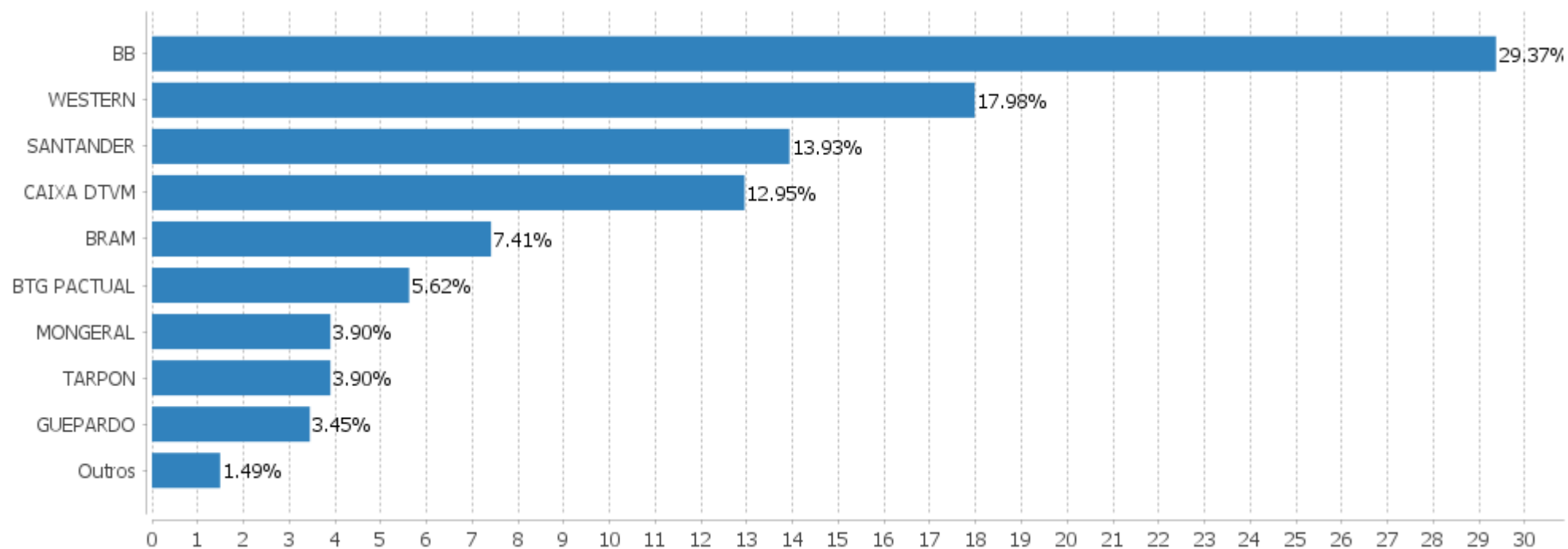


Alocação Por Estratégia



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
2023	1,47	0,21	0,79	0,91	2,49	1,90	1,38	0,21					9,73
IPCA + 5,06%	0,96	1,20	1,16	0,97	0,66	0,33	0,53	0,68					6,68
p.p. indexador	0,50	-0,98	-0,38	-0,06	1,83	1,57	0,85	-0,48					3,04
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

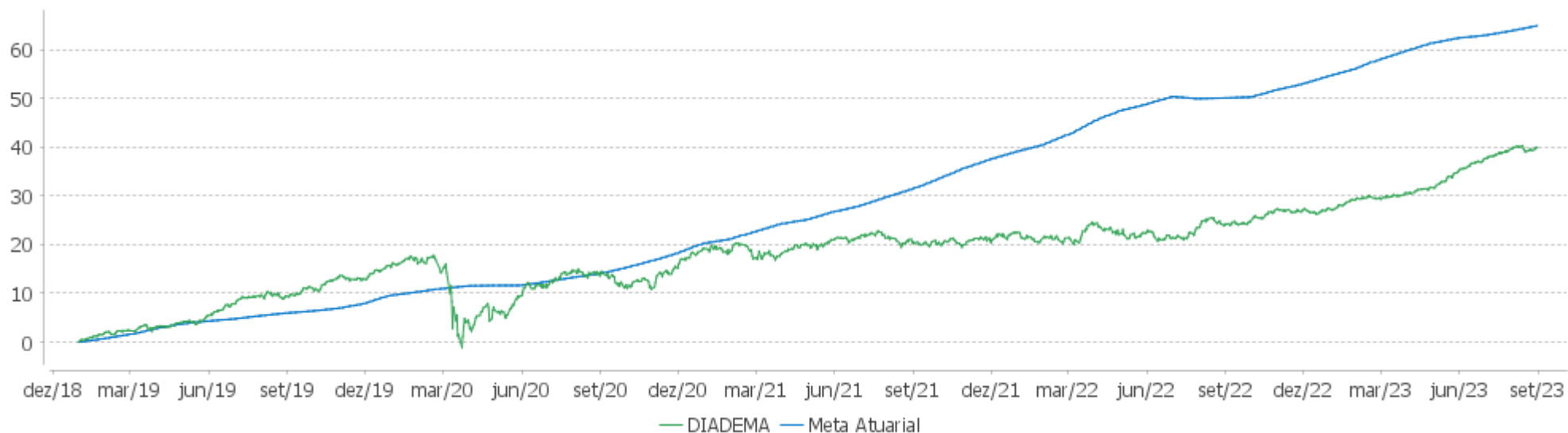
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	25	44,64
Meses abaixo - Meta Atuarial	31	55,36
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,93	2020-11
Menor rentabilidade da Carteira	-9,14	2020-03

Relatório

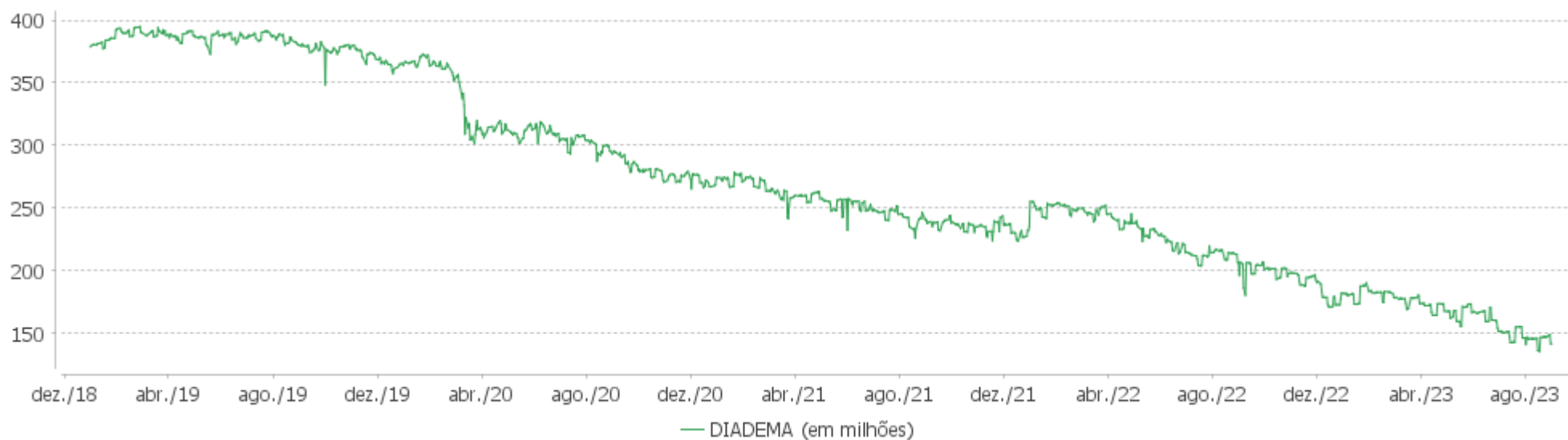
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	3,52	1,55	1,97	2,21
06 meses	7,91	4,42	3,49	2,21
12 meses	12,78	9,82	2,96	2,40
24 meses	16,09	25,46	-9,37	3,69
36 meses	23,09	45,26	-22,17	4,43
48 meses	27,71	57,62	-29,90	7,31
Desde 31/12/2018	39,82	68,01	-28,19	6,88

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

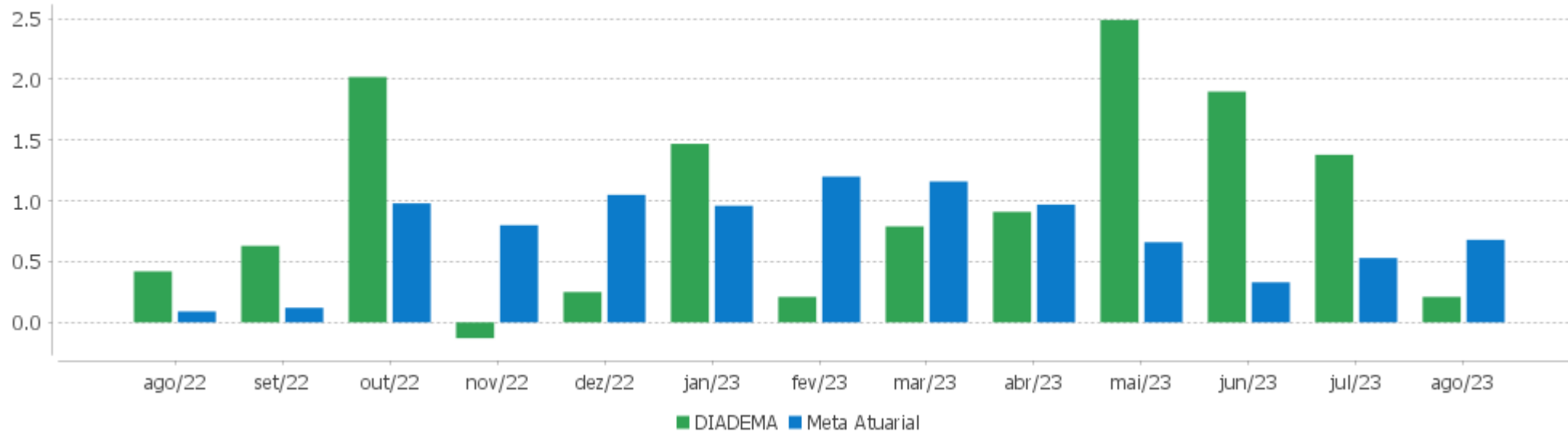


Patrimônio Líquido



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	1,98 173,85	7,94 89,52	5,05 152,09	8,28 124,04	13,11 96,76	27,03 107,53	35,52 124,55
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO % do CDI	1,37 120,03	3,32 37,48	2,18 65,68	3,91 58,62	8,21 60,57	20,58 81,86	26,86 94,20
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,43 -0,05	11,76 -0,08	2,78 -0,05	10,43 -0,00	13,29 -0,48	19,18 -0,89	22,32 -1,67
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,63 0,40	9,92 6,69	3,67 3,40	7,75 5,92	13,76 9,15	23,41 9,67	23,40 -1,35
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO % do CDI	1,14 100,38	8,84 99,71	3,32 99,98	6,65 99,53	13,52 99,79	25,18 100,19	28,37 99,47
WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC % do CDI	1,17 102,89	8,84 99,68	3,35 100,92	6,66 99,73	13,54 99,94	25,28 100,56	28,24 99,04
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,27 111,21	9,16 103,30	3,63 109,23	7,00 104,85	14,06 103,73	26,49 105,38	30,12 105,63
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,16 101,39	8,81 99,38	3,35 100,89	6,69 100,21	13,54 99,91	25,45 101,24	28,93 101,46
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	1,24 108,60	8,97 101,16	3,53 106,48	6,93 103,85	13,76 101,52	25,76 102,49	29,23 102,51
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	1,33 116,47	9,01 101,59	3,65 110,08	7,01 104,99	13,83 102,06	26,19 104,20	30,06 105,40
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-7,18 -2,10	2,03 -3,45	4,64 -2,20	4,03 -6,27	-2,33 -8,01	-28,58 -26,02	-27,65 -44,13
TARPON GT 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,13 2,95	29,38 23,91	14,14 7,30	29,69 19,39	27,48 21,80	48,69 51,25	105,39 88,92
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,34 1,75	23,84 18,37	11,50 4,66	29,79 19,49	19,05 13,37	28,48 31,04	
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	3,20 8,29	24,50 19,03	4,58 -2,26	15,55 5,25	17,44 11,77	-13,80 -11,24	-0,32 -16,79
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP % do CDI	0,00 0,00	-98,70 -1.113,15	-98,74 -2.974,84	-98,71 -1.478,25	-98,68 -728,13	-97,03 -386,01	-97,90 -343,31
BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII Var. IFIX p.p.	-40,47 -40,96	-35,35 -47,40	-38,89 -45,51	-37,17 -51,57	-8,70 -16,65	-21,52 -38,35	-13,50 -28,98
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPF11	0,60	13,77	6,70	15,40	9,20	19,82	12,67

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	5,68	8,30	-0,13	5,10	3,52	22,38	-3,81
DIADEMA	0,21	9,73	3,52	7,91	12,78	16,09	23,09
Var. IPCA + 5,06% p.p.	-0,48	3,04	1,97	3,49	2,90	-9,42	-21,51
CDI	1,14	8,87	3,32	6,68	13,55	25,14	28,52
IBOVESPA	-5,09	5,47	6,84	10,30	5,68	-2,56	16,48
INPC + 6,00%	0,73	6,87	1,52	4,60	10,27	27,21	48,86
IPCA + 6,00%	0,76	7,32	1,79	4,89	10,86	27,77	48,51

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
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPF11	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 indice CDIE. A taxa de performance sera paga no(s) mes (es) de Janeiro e Julho	0,50
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+2		
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+2 du	D+3 du	-	0,50
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,45
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	Não se aplica	Não se aplica				
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
TARPON GT 30 FIC FIA	D+1 du	D+1 du	D+30	D+32	O fundo cobrara 20.00 % do que exceder 100.00 % o indice IBOV_FEC. A taxa de performance	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance sera paga no(s) mes(es) de Janeiro	Administração
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50
WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15

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	1,15	9,05	3,44	6,81	13,74	24,03	26,80	33,22	43,08
IRF-M 1+	0,59	12,99	4,10	11,31	16,04	21,61	17,57	30,08	56,68
IRF-M TOTAL	0,76	11,43	3,81	9,56	14,96	22,06	20,53	31,03	52,86
IMA-B 5	0,61	8,75	2,66	5,76	11,97	23,03	28,90	40,81	61,13
IMA-B 5+	-1,27	14,28	2,80	14,40	15,00	16,66	18,76	24,36	71,86
IMA-B TOTAL	-0,38	11,84	2,83	10,43	13,76	20,07	23,99	32,22	68,62
IMA-GERAL TOTAL	0,63	10,39	3,38	8,50	13,72	22,67	24,97	33,10	54,16
IDKA 2	0,77	8,66	2,75	5,42	11,80	22,33	28,55	41,03	58,78
IDKA 20	-3,05	19,50	3,45	24,26	18,37	10,39	11,16	10,89	77,63
CDI	1,14	8,87	3,32	6,68	13,55	25,14	28,52	33,50	41,88

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-5,09	5,47	6,84	10,30	5,68	-2,56	16,48	14,44	50,95
IBRX 100	-5,01	4,62	6,85	9,37	4,16	-4,36	15,60	14,31	54,15
IBRX 50	-4,76	3,66	7,43	8,45	4,56	-3,16	18,26	15,68	49,30
SMALL CAP	-7,43	8,13	3,26	17,40	-1,94	-23,76	-10,81	-5,44	42,85
Índice Consumo - ICON	-10,42	-0,75	0,30	6,83	-15,38	-41,83	-41,59	-38,22	-6,46
Índice Dividendos - IDIV	-2,83	9,22	8,71	11,58	10,64	15,38	37,76	32,74	99,45

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	1,97	10,75	4,16	7,31	8,32	-4,62	15,85	83,19	84,91

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,49	12,06	6,62	14,40	7,95	16,84	15,48	20,93	50,17

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	0,73	6,92	2,53	3,09	6,36	-11,42	5,54	59,73	56,19

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,23	3,23	0,27	1,83	4,61	13,74	24,75	27,79	32,17
INPC	0,20	2,80	0,01	1,55	4,06	13,24	25,04	28,72	32,95
IGPM	-0,14	-5,28	-2,77	-5,42	-7,20	0,77	32,13	49,34	56,73
SELIC	1,14	8,87	3,32	6,68	13,55	25,14	28,52	33,50	41,88

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,59	5,97	1,29	3,88	8,78	23,00	40,28	49,45	60,68
IPCA + 5,00%	0,68	6,64	1,54	4,39	9,82	25,37	44,35	55,27	68,52
IPCA + 5,50%	0,72	6,98	1,66	4,64	10,34	26,57	46,42	58,24	72,56
IPCA + 5,89%	0,75	7,25	1,76	4,84	10,74	27,50	48,05	60,59	75,76
IPCA + 6,00%	0,76	7,32	1,79	4,89	10,86	27,77	48,51	61,26	76,67
INPC + 4,00%	0,56	5,52	1,03	3,59	8,20	22,46	40,61	50,54	61,62
INPC + 6,00%	0,73	6,87	1,52	4,60	10,27	27,21	48,86	62,43	77,71

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1315	01/08/2023	MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO	0,00	5.551.527,08	2.707.120,96858429	2,0507126000
1317	02/08/2023	MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	5.551.527,08	0,00	1.655.334,34743126	3,3537195000
1304	02/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	3.425,14753445	2,9195822660
1287	04/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.663.867,77	569.309,08570856	2,9226088460
1286	04/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	30.049,85	0,00	10.281,85829285	2,9226088460
1305	04/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	35.000,00	11.975,60188320	2,9226088460
1302	07/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	403.611,44	0,00	138.028,77288610	2,9241109050
1306	07/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	15.000,00	5.129,76439244	2,9241109050
1288	09/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	43.740,17	0,00	14.943,30620997	2,9270744630
1307	09/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.000,00	1.708,19022994	2,9270744630
1300	10/08/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	4.869.834,07	1.022.154,23090768	4,7642850000
1289	10/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.623.851,62	0,00	1.578.899,94023570	2,9285273260
1290	11/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	245.982,45	0,00	83.953,68357246	2,9299780490
1291	15/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.021.897,09	2.053.263,14678520	2,9328423390
1303	15/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.000.000,00	1.022.898,49000983	2,9328423390
1308	15/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	65.000,00	22.162,80061688	2,9328423390
1292	18/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	11.086.831,91	0,00	3.774.760,04691502	2,9370958080
1309	21/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.000,00	2.041,83771279	2,9385293270
1293	22/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	25.627,80	0,00	8.717,12094258	2,9399385610
1310	23/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.000,00	1.699,87878504	2,9413862000
1311	24/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.500,00	849,51916536	2,9428412000
1299	25/08/2023	PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	0,00	237,18	2.779,00000000	0,0853471700
1312	25/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	135.000,00	45.850,89406019	2,9443264470
1294	28/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.422.824,40	0,00	483.006,47136473	2,9457667430
1313	29/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	12.000,00	4.071,40480642	2,9473856250
1295	30/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	7.191.227,13	2.438.555,75886404	2,9489697350
1314	30/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	55.000,00	18.650,58136990	2,9489697350
1297	31/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	16.508,18	5.595,53789340	2,9502400510

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1296	31/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	22.681,11	7.687,88627634	2,9502400510
Total			23.434.046,72	28.683.279,61		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.506.294,96

Value-At-Risk: 1,07%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
DIADEMA		1,07	1,07			141.266.593,28	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,23%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO		1,99	0,03	0,20			5.515.375,24	3,90
WESTERN ASSET SOBERANO II FI RF REFERENCIADO SELIC		0,02	0,00	0,02			10.326.999,86	7,31
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO		0,01	0,00	0,01			27.031.813,43	19,14
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,83	0,04	0,85			18.296.113,30	12,95
Sub-total	0,68	0,41	0,06		-0,44	0,84	61.170.301,83	43,30

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	0,00	0,02			14.463.605,45	10,24
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,03	-0,00	0,03			19.684.775,48	13,93
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,03	-0,00	0,03			10.464.187,77	7,41
Sub-total	0,05	0,02	-0,00		2,32	1,26	44.612.568,70	31,58

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO FI RF LONGO PRAZO		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF		0,22	-0,00	0,22			3.281.402,52	2,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CREDITO PRIVADO								
Sub-total	0,33	0,22	-0,00		2,53	1,98	3.281.402,52	2,32

Investimentos no Exterior Value-At-Risk: 7,22%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I		7,22	0,45	11,45			15.067.982,17	10,67
Sub-total	17,85	7,22	0,45		0,12	3,20	15.067.982,17	10,67

Renda Variável Value-At-Risk: 7,37%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		7,58	0,16	3,74			4.659.676,27	3,30
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA		9,08	0,20	5,03			4.867.024,22	3,45
TARPON GT 30 FIC FIA		7,91	0,20	6,45			5.506.285,30	3,90
Sub-total	14,35	7,37	0,56		-0,37	-4,14	15.032.985,79	10,64

Fundos Imobiliários Value-At-Risk: 1,98%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPFF11		2,33	0,00	8,18			1.172.997,36	0,83
BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII		3,24	0,00	3,60			928.354,91	0,66
Sub-total	87,13	1,98	0,00		-0,28	-22,87	2.101.352,27	1,49

Investimentos Estruturados Value-At-Risk: NaN%

Artigo 10º II

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
Sub-total	0,00	NaN	0,00		0,00	0,00	0,00	0,00