



**LDB**  
EMPRESAS

**DIADEMA**  
DEZEMBRO 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 29.12.2023.

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 66,59%

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	4,50	0,10	2,68	2,96	5.716.084,53	5,41	208.971.148,71	2,74
BB	BB	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,04	0,04	0,90	7,64	12.545.625,10	11,88	31.713.195.919,09	0,04
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,30	0,08	1,21	13,60	15.868.666,00	15,02	5.290.529.627,75	0,30
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>0,69</b>	<b>0,07</b>	<b>1,30</b>	<b>13,24</b>	<b>34.130.375,63</b>	<b>32,31</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,04	0,90	12,98	12.536.955,12	11,87	16.475.113.370,57	0,08
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,10	0,04	0,94	13,34	9.339.239,05	8,84	2.799.591.858,55	0,33
BRAM	BRDESCO	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,07	0,04	0,94	13,63	10.892.355,54	10,31	10.327.922.782,38	0,11
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,06</b>	<b>0,04</b>	<b>0,93</b>	<b>13,27</b>	<b>32.768.549,71</b>	<b>31,02</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO	1,08	0,06	1,11	13,15	3.439.969,27	3,26	2.789.770.644,39	0,12
<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea b</b>			<b>1,08</b>	<b>0,06</b>	<b>1,11</b>	<b>10,47</b>	<b>3.439.969,27</b>	<b>3,26</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>0,35</b>	<b>0,06</b>	<b>1,14</b>	<b>12,98</b>	<b>70.338.894,61</b>	<b>66,59</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

16,53%

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	17,45	-0,01	4,83	15,82	5.289.585,22	5,01	1.435.426.948,17	0,37
GUEPARDO	DAYCOVAL	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	18,84	-0,00	2,67	41,44	5.558.696,11	5,26	474.190.468,78	1,17
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT 30 FIC FIA	18,67	-0,00	9,85	55,36	6.611.627,98	6,26	934.426.001,03	0,71
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>15,85</b>	<b>-0,01</b>	<b>5,95</b>	<b>33,89</b>	<b>17.459.909,31</b>	<b>16,53</b>		
Renda Variável			15,85	-0,01	5,95	33,89	17.459.909,31	16,53		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

15,18%

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	16,37	-0,01	2,77	32,50	16.036.379,33	15,18	1.398.458.692,08	1,15
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>16,37</b>	<b>-0,01</b>	<b>2,77</b>	<b>32,50</b>	<b>16.036.379,33</b>	<b>15,18</b>		
Investimentos no Exterior			16,37	-0,01	2,77	32,50	16.036.379,33	15,18		

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	440,93	0,00	0,00	-100,00	0,00	0,00	2.615.006,70	0,00
<b>Sub-total Artigo 10º II</b>			<b>440,93</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>-100,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>		
Investimentos Estruturados				0,00	0,00	-100,00	0,00	0,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

1,70%

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 - BPF11	7,68	0,00	3,16	17,25	1.170.710,48	1,11	350.614.208,13	0,33
RIO BRAVO	BB	BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII	77,04	0,00	-0,67	-20,59	624.322,56	0,59	12.923.477,03	4,83
<b>Sub-total Artigo 11º</b>			<b>38,59</b>	<b>0,00</b>	<b>1,76</b>	<b>-0,85</b>	<b>1.795.033,04</b>	<b>1,70</b>		
Fundos Imobiliários			38,59	0,00	1,76	-0,85	1.795.033,04	1,70		
Total			2,40	0,04	2,18	16,62	105.630.216,29	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
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	34.130.375,63	32,31	0,00	31,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	32.768.549,71	31,02	0,00	45,00	60,00	0,00	65,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	3.439.969,27	3,26	0,00	4,00	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>70.338.894,61</b>	<b>66,59</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	17.459.909,31	16,53	0,00	9,00	30,00	0,00	35,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>17.459.909,31</b>	<b>16,53</b>					35,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	16.036.379,33	15,18	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>16.036.379,33</b>	<b>15,18</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º II	Fundo de Participação	0,00	0,00	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>					15,00
<b>Fundos Imobiliários</b>								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	1.795.033,04	1,70	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Fundos Imobiliários</b>	<b>1.795.033,04</b>	<b>1,70</b>					5,00
<b>Total</b>		<b>105.630.216,29</b>	<b>100,00</b>					



## 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	1,30 144,78	13,24 101,46	3,20 112,73	5,75 93,45	13,24 101,46	483.155,18	6.752.128,25
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,93 103,69	13,27 101,74	2,91 102,68	6,44 104,69	13,27 101,74	279.266,50	7.248.075,57
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	1,11 123,68	10,47 80,25	3,45 121,61	8,10 131,77	10,47 80,25	37.716,82	509.187,09
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	5,95 0,57	33,89 11,61	12,23 -2,88	16,67 3,03	33,89 11,61	981.015,19	4.358.685,24
Artigo 9º III % do CDI	2,77 309,27	32,50 249,11	12,06 425,06	10,48 170,41	32,50 249,11	432.547,45	3.933.690,23
Artigo 10º II % do CDI	0,00 0,00	-100,00 -766,43	0,00 0,00	-100,00 -1.626,21	-100,00 -766,43	0,00	-18.210,93
Artigo 11º % do CDI	1,76 196,37	-0,85 -6,48	-6,72 -236,84	-8,86 -144,05	-0,85 -6,48	31.776,24	44.781,93
<b>DIADEMA (Total)</b>						<b>2.245.477,38</b>	<b>22.828.337,38</b>

### 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	19.690.976,56	0,00	-7.289.927,49	0,00	12.545.625,10	144.576,03	1.766.452,04
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	15.679.351,16	0,00	0,00	0,00	15.868.666,00	189.314,84	2.223.165,64
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	5.566.820,22	0,00	0,00	0,00	5.716.084,53	149.264,31	164.557,45
	40.937.147,94	0,00	-7.289.927,49	0,00	34.130.375,63	483.155,18	

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	12.839.015,58	10.561.149,99	-10.944.272,00	0,00	12.536.955,12	81.061,55	2.764.351,15
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	10.791.164,97	0,00	0,00	0,00	10.892.355,54	101.190,57	1.306.175,57

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	14.246.723,82	0,00	-5.004.499,15	0,00	9.339.239,05	97.014,38	2.609.147,07
	37.876.904,37	10.561.149,99	-15.948.771,15	0,00	32.768.549,71	279.266,50	

## 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	3.402.252,45	0,00	0,00	0,00	3.439.969,27	37.716,82	399.870,84
	3.402.252,45	0,00	0,00	0,00	3.439.969,27	37.716,82	

## 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	5.045.816,14	0,00	0,00	0,00	5.289.585,22	243.769,08	722.457,12
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	5.414.143,49	0,00	0,00	0,00	5.558.696,11	144.552,62	1.628.706,80
TARPON GT 30 FIC FIA	6.018.934,49	0,00	0,00	0,00	6.611.627,98	592.693,49	2.355.876,58
	16.478.894,12	0,00	0,00	0,00	17.459.909,31	981.015,19	

## 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	15.603.831,88	0,00	0,00	0,00	16.036.379,33	432.547,45	3.933.690,23
	15.603.831,88	0,00	0,00	0,00	16.036.379,33	432.547,45	

## 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	-18.210,93
	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	

## Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII	660.229,08	0,00	0,00	0,00	31.500,00	624.322,56	-4.406,52	-135.242,63
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPFF11	1.143.827,72	0,00	0,00	0,00	9.300,00	1.170.710,48	36.182,76	180.024,56
	1.804.056,80	0,00	0,00	0,00	40.800,00	1.795.033,04	31.776,24	

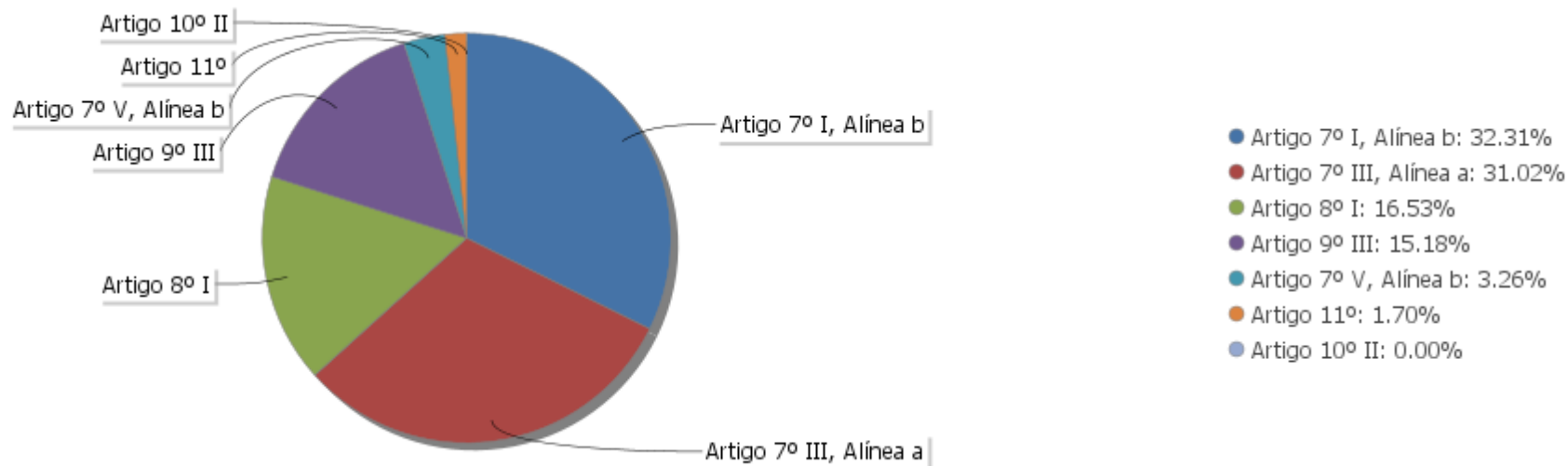
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

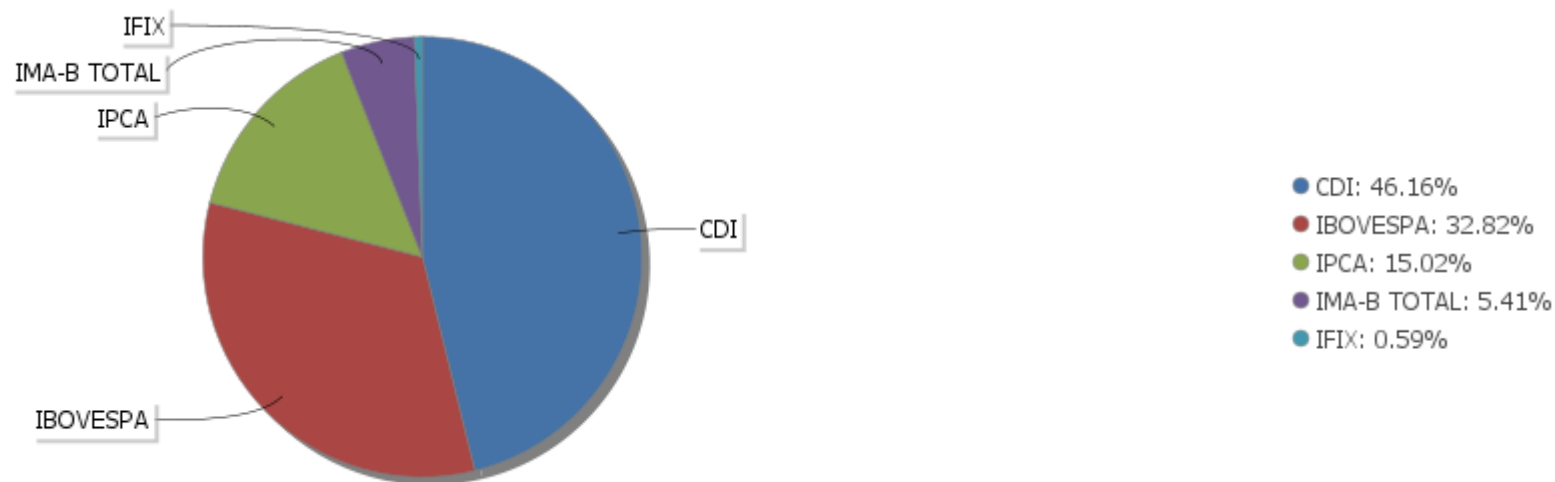
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo P.I.
de 0 a 30 dias	84.106.015,15	79,62	84.106.015,15	79,62	
de 31 dias a 365 dias	21.524.201,14	20,38	105.630.216,29	100,00	
acima de 365 dias	0,00	0,00	105.630.216,29	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

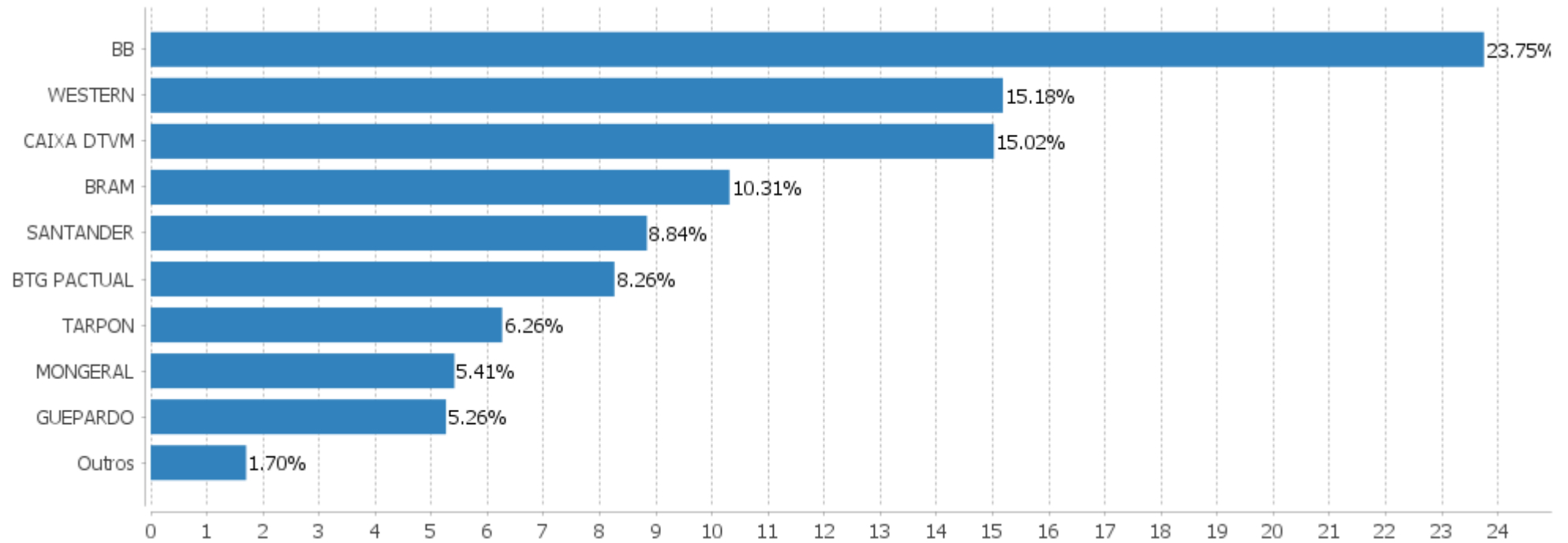


Alocação Por Estratégia



## 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	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	28	46,67
Meses abaixo - Meta Atuarial	32	53,33

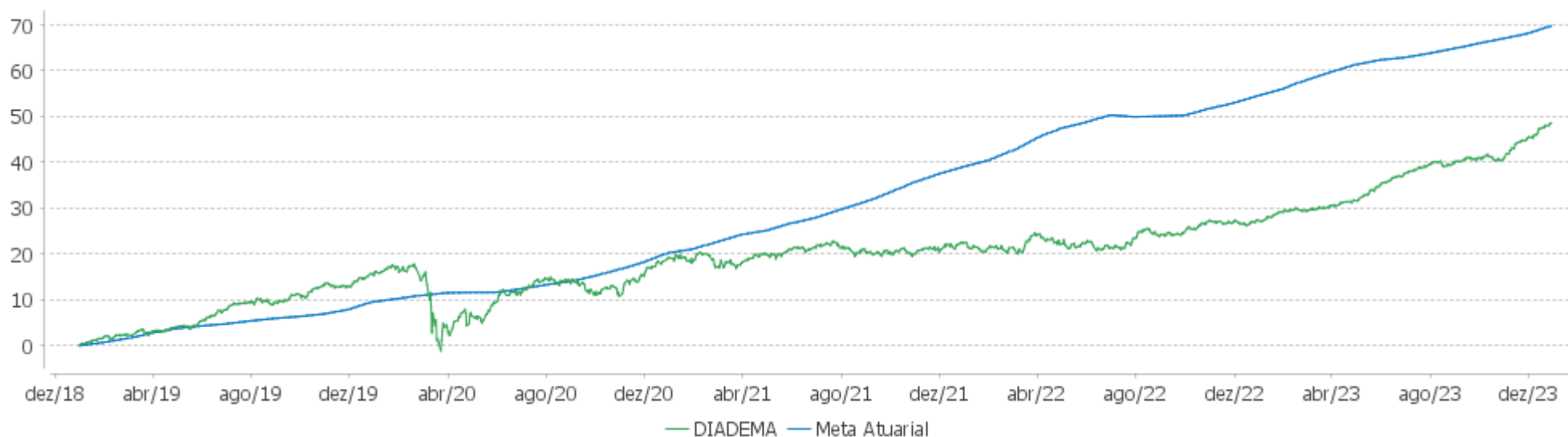
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,93	2020-11
Menor rentabilidade da Carteira	-9,14	2020-03

**Relatório**

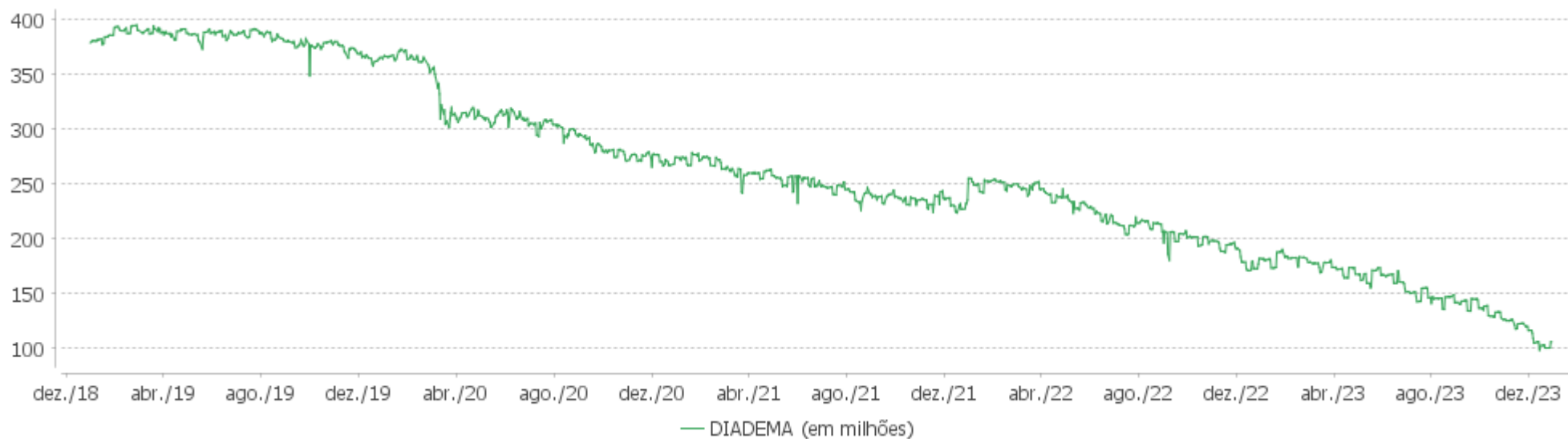
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	5,41	2,30	3,11	2,96
06 meses	7,98	4,22	3,76	2,68
12 meses	16,62	9,85	6,77	2,40
24 meses	21,35	21,86	-0,52	3,47
36 meses	24,66	41,39	-16,74	4,00
48 meses	28,88	56,43	-27,56	7,30
60 meses	48,61	73,00	-24,39	6,70
Desde 31/12/2018	48,61	73,00	-24,39	6,70

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



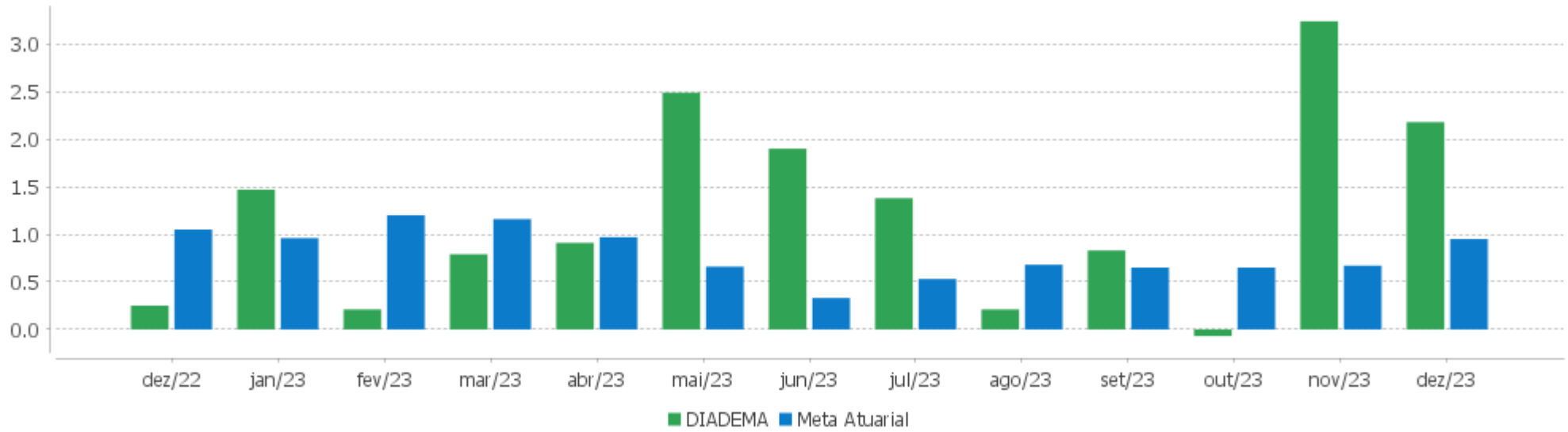
Patrimônio Líquido





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	1,11 123,68	13,15 100,81	3,45 121,61	8,65 140,63	13,15 100,81	29,26 108,24	39,81 122,04
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,68 -0,07	15,83 -0,22	4,65 -0,11	3,91 -0,30	15,83 -0,22	22,61 -0,84	20,38 -1,51
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	1,21 0,65	13,59 8,97	2,92 1,84	4,92 3,22	13,59 8,97	25,74 15,07	25,60 3,79
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO % do CDI	0,90 99,89	12,98 99,51	2,80 98,82	6,10 99,24	12,98 99,51	26,98 99,81	32,56 99,81
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,94 104,62	13,63 104,43	3,01 106,08	6,66 108,27	13,63 104,43	28,40 105,03	34,74 106,51
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,90 100,65	12,98 99,47	2,83 99,76	6,15 99,95	12,98 99,47	27,20 100,61	33,08 101,42
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	0,94 105,16	13,34 102,25	2,93 103,08	6,55 106,52	13,34 102,25	27,93 103,31	34,33 105,25
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	4,83 -0,55	15,82 -6,46	12,81 -2,30	8,59 -5,04	15,82 -6,46	10,40 -17,61	-24,69 -37,43
TARPON GT 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	9,85 4,46	55,36 33,08	11,54 -3,58	24,45 10,82	55,36 33,08	78,35 50,34	107,80 95,06
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	2,67 -2,71	41,44 19,16	12,52 -2,59	16,24 2,61	41,44 19,16	47,88 19,87	62,60 49,86
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	2,77 -2,61	32,50 10,22	12,06 -3,05	10,48 -3,15	32,50 10,22	-16,96 -44,97	7,11 -5,63
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP % do CDI	0,00 0,00	-98,70 -756,45	0,00 0,00	-98,75 -1.605,90	-98,70 -756,45	-99,27 -367,18	-97,75 -299,69
BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII Var. IFIX p.p.	-0,67 -4,91	-20,59 -36,09	-19,65 -22,52	-25,78 -30,73	-20,59 -36,09	-22,79 -40,85	-16,01 -31,39
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPFF11 Var. IBOVESPA p.p.	3,16 -2,22	17,25 -5,04	2,76 -12,35	5,39 -8,25	17,25 -5,04	19,50 -8,52	19,36 6,62
DIADEMA Var. IPCA + 5,06% p.p.	2,18 1,23	16,62 6,77	5,41 3,11	7,98 3,76	16,62 6,77	21,35 -0,71	24,66 -16,46
CDI	0,90	13,05	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62
IBOVESPA	5,38	22,28	15,12	13,63	22,28	28,01	12,74
INPC + 6,00%	1,02	9,85	2,20	3,95	9,85	23,32	43,97

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Varição da Estratégia							
IPCA + 6,00%	1,03	10,82	2,52	4,68	10,82	24,24	44,91

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 - BPFF11	Não se aplica	Não se aplica				
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)	D+4 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)		3,00
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO			D+30	D+31	O fundo cobrara 20.00 % do que exceder 104.00 % o indice CDIE. A taxa de performance sera paga no(s) mes (es) de Janeiro e Julho	0,50
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
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 sera paga no(s) mes(es) de Janeiro	
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Indexadores**

**Renda Fixa**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,91	13,25	2,89	6,16	13,25	26,86	30,57	35,59	44,75
IRF-M 1+	1,73	18,52	5,05	6,37	18,52	27,30	20,95	31,18	49,86
IRF-M TOTAL	1,48	16,51	4,38	6,28	16,51	26,79	24,26	32,58	48,53
IMA-B 5	1,46	12,13	2,97	4,75	12,13	23,09	28,71	39,06	57,35
IMA-B 5+	3,94	19,28	6,42	3,80	19,28	23,21	15,14	21,47	58,36
IMA-B TOTAL	2,75	16,05	4,76	4,21	16,05	23,45	21,89	29,69	59,46
IMA-GERAL TOTAL	1,63	14,80	3,81	5,67	14,80	25,89	27,10	33,88	51,04
IDKA 2	1,45	12,13	2,89	5,00	12,13	22,60	28,70	39,79	56,32
IDKA 20	6,58	27,13	10,28	3,92	27,13	24,70	6,62	8,97	57,20
CDI	0,90	13,05	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62	36,29	44,42

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	5,38	22,28	15,12	13,63	22,28	28,01	12,74	16,03	52,68
IBRX 100	5,48	21,27	14,95	13,77	21,27	26,15	12,05	15,97	54,69
IBRX 50	5,31	20,06	14,43	14,39	20,06	26,93	13,55	17,66	51,96
SMALL CAP	7,05	17,12	11,48	3,40	17,12	-0,52	-16,63	-17,18	31,02
Índice Consumo - ICON	5,98	6,98	12,32	-1,29	6,98	-20,15	-40,99	-40,51	-7,65
Índice Dividendos - IDIV	6,90	26,84	14,61	16,04	26,84	42,88	33,72	32,38	92,17

**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	2,43	15,27	7,54	7,67	15,27	-13,18	18,31	77,33	137,73

**Investimentos Imobiliários**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	4,25	15,50	2,86	4,95	15,50	18,06	15,37	3,56	40,82

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	2,70	11,43	7,01	6,95	11,43	-16,44	4,80	54,48	99,34

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,56	4,62	1,08	1,70	4,62	10,67	21,81	27,31	32,79
INPC	0,55	3,71	0,77	0,99	3,71	9,86	21,02	27,61	33,33
IGPM	0,74	-3,18	1,84	1,34	-3,18	2,10	20,25	48,08	58,89
SELIC	0,90	13,05	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62	36,29	44,42

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,87	8,75	2,05	3,70	8,75	19,63	36,91	48,80	61,44
IPCA + 5,00%	0,95	9,79	2,28	4,19	9,79	21,92	40,87	54,57	69,32
IPCA + 5,50%	0,99	10,30	2,40	4,44	10,30	23,08	42,88	57,51	73,37
IPCA + 5,89%	1,02	10,71	2,49	4,63	10,71	23,98	44,46	59,84	76,59
IPCA + 6,00%	1,03	10,82	2,52	4,68	10,82	24,24	44,91	60,50	77,50
INPC + 4,00%	0,86	7,80	1,73	2,98	7,80	18,75	36,03	49,15	62,09
INPC + 6,00%	1,02	9,85	2,20	3,95	9,85	23,32	43,97	60,89	78,22

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Movimentações**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1400	05/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	80.000,00	26.315,62712200	3,0400187550
1392	05/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	500.000,00	164.472,66951100	3,0400187550
1388	05/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.676.672,97	551.533,75854700	3,0400187550
1385	06/12/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	5.000.000,00	20.064,52250500	249,1960623000
1401	07/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	65.000,00	21.361,37668500	3,0428750430
1390	07/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	29.024,90	9.538,64341800	3,0428750430
1389	07/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.383.574,13	1.440.602,74183300	3,0428750430
1387	11/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	702.394,54	0,00	230.621,59336100	3,0456581700
1391	13/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.000.000,00	328.035,11657400	3,0484541120
1402	14/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	50.000,00	16.394,25822400	3,0498482650
1394	14/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	31.500,00	0,00	10.328,38268100	3,0498482650
1384	14/12/2023	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,00	7.289.927,49	2.169.976,79196300	3,3594495190
1395	15/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.178.956,92	0,00	1.369.615,38321900	3,0511901160
1396	19/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	301.709,52	0,00	98.795,68510000	3,0538734530
1403	21/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	60.000,00	19.630,22200010	3,0565115360
1393	21/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.000.000,00	981.511,10004500	3,0565115360
1397	21/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	200.000,00	0,00	65.434,07333600	3,0565115360
1404	22/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	90.000,00	29.432,47001500	3,0578473350
1386	22/12/2023	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	4.499,15	17,95416800	250,5908485000
1398	27/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	31.443,17	0,00	10.273,74280000	3,0605370030
1405	28/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	3.265,99020200	3,0618585430
1399	28/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	5.115.145,84	0,00	1.670.601,61929800	3,0618585430
<b>Total</b>			<b>10.561.149,99</b>	<b>23.238.698,64</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.844.561,45

Value-At-Risk: 1,75%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	Limite <sup>(5)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
DIADEMA		1,75		1,75			105.630.216,29	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,33%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO		2,17	0,07	0,06			5.716.084,53	5,41
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO		0,02	-0,00	0,01			12.545.625,10	11,88
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,72	0,06	0,71			15.868.666,00	15,02
<b>Sub-total</b>	0,63	0,68	0,12		0,63	1,30	34.130.375,63	32,31

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	0,00	0,01			12.536.955,12	11,87
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,03	-0,00	0,03			9.339.239,05	8,84
BRAPRECO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,03	-0,00	0,02			10.892.355,54	10,31
<b>Sub-total</b>	0,03	0,02	-0,00		1,25	0,93	32.768.549,71	31,02

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO		0,19	-0,00	0,19			3.439.969,27	3,26
<b>Sub-total</b>	0,40	0,19	-0,00		0,53	1,11	3.439.969,27	3,26

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,87%



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		8,35	0,35	3,61			5.289.585,22	5,01
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA		8,01	0,33	3,93			5.558.696,11	5,26
TARPON GT 30 FIC FIA		8,64	0,42	5,07			6.611.627,98	6,26
<b>Sub-total</b>	12,01	7,87	1,09		0,42	5,95	17.459.909,31	16,53

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,32%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I		6,32	0,53	9,14			16.036.379,33	15,18
<b>Sub-total</b>	9,29	6,32	0,53		0,20	2,77	16.036.379,33	15,18

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 0,51%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPF11		0,16	0,00	7,22			1.170.710,48	1,11
BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII		1,43	-0,00	2,65			624.322,56	0,59
<b>Sub-total</b>	7,15	0,51	-0,00		0,12	1,76	1.795.033,04	1,70

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: NaN%

Artigo 10º II

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

(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 (%)