



**LDB**  
EMPRESAS

**DIADEMA**  
1º TRIMESTRE 2024



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 28.03.2024.

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 74,46%

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	Trim.				
MONGERAL	BEM	MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RF LONGO PRAZO	3,98	-0,00	0,03	0,05	5.718.888,50	5,43	195.751.344,33	2,92
BB	BB	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,06	0,04	0,83	2,62	20.442.435,82	19,43	31.189.795.207,98	0,07
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,36	0,03	0,58	1,80	11.083.276,55	10,53	5.431.217.487,91	0,20
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>0,77</b>	<b>0,03</b>	<b>0,63</b>	<b>1,91</b>	<b>37.244.600,87</b>	<b>35,39</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	Trim.				
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,06	0,04	0,85	2,65	17.232.012,70	16,38	16.860.564.075,44	0,10
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,09	0,04	0,86	2,79	9.096.321,83	8,64	2.837.635.942,66	0,32
BRAM	BRDESCO	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,09	0,05	0,91	2,92	11.210.526,82	10,65	10.645.688.775,75	0,11
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,07</b>	<b>0,04</b>	<b>0,87</b>	<b>2,76</b>	<b>37.538.861,35</b>	<b>35,67</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	Trim.				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO	0,40	0,03	1,11	3,81	3.570.950,91	3,39	2.909.237.074,63	0,12
<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea b</b>			<b>0,40</b>	<b>0,03</b>	<b>1,11</b>	<b>3,81</b>	<b>3.570.950,91</b>	<b>3,39</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>0,38</b>	<b>0,04</b>	<b>0,78</b>	<b>2,41</b>	<b>78.354.413,13</b>	<b>74,46</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

16,85%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	17,20	0,34	6,72	2,39	6.769.902,58	6,43	956.795.060,83	0,71
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	16,21	0,24	0,22	-0,80	5.247.084,03	4,99	1.424.304.935,88	0,37
GUEPARDO	DAYCOVAL	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	16,82	0,38	1,49	2,88	5.718.715,70	5,43	575.583.312,97	0,99
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>14,97</b>	<b>0,32</b>	<b>3,03</b>	<b>1,58</b>	<b>17.735.702,31</b>	<b>16,85</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>14,97</b>	<b>0,32</b>	<b>3,03</b>	<b>1,58</b>	<b>17.735.702,31</b>	<b>16,85</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

6,96%

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	Trim.				
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	15,39	0,43	1,57	16,41	7.320.012,31	6,96	1.559.186.452,18	0,47
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>15,39</b>	<b>0,43</b>	<b>1,57</b>	<b>16,41</b>	<b>7.320.012,31</b>	<b>6,96</b>		
Investimentos no Exterior			15,39	0,43	1,57	16,41	7.320.012,31	6,96		

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	Trim.				
PÁTRIA	PÁTRIA	PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	442,70	0,00	0,00	0,00	0,00	2.615.006,70	0,00	
<b>Sub-total Artigo 10º II</b>			<b>442,70</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>			
Investimentos Estruturados				0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

1,73%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
PLURAL	GENIAL	BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPF11	7,68	0,53	1,33	3,15	1.179.282,79	1,12	351.316.200,42	0,34
RIO BRAVO	BB	BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII	77,53	1,13	1,29	8,58	642.750,72	0,61	13.164.806,92	4,88
<b>Sub-total Artigo 11º</b>			<b>38,82</b>	<b>0,74</b>	<b>1,32</b>	<b>5,04</b>	<b>1.822.033,51</b>	<b>1,73</b>		
<b>Fundos Imobiliários</b>			<b>38,82</b>	<b>0,74</b>	<b>1,32</b>	<b>5,04</b>	<b>1.822.033,51</b>	<b>1,73</b>		
<b>Total</b>			<b>2,50</b>	<b>0,12</b>	<b>1,25</b>	<b>3,72</b>	<b>105.232.161,26</b>	<b>100,00</b>		

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	37.244.600,87	35,39	0,00	50,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	37.538.861,35	35,67	0,00	25,00	60,00	0,00	65,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	3.570.950,91	3,39	0,00	3,00	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>78.354.413,13</b>	<b>74,46</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	17.735.702,31	16,85	0,00	12,00	30,00	0,00	35,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>17.735.702,31</b>	<b>16,85</b>					35,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	7.320.012,31	6,96	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>7.320.012,31</b>	<b>6,96</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º II	Fundo de Participação	0,00	0,00	0,00	0,00	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	1.822.033,51	1,73	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Fundos Imobiliários</b>	<b>1.822.033,51</b>	<b>1,73</b>					5,00
<b>Total</b>		<b>105.232.161,26</b>	<b>100,00</b>					



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,63 75,72	1,91 72,64	1,91 72,64	5,17 93,32	11,72 94,81	233.588,35	670.552,29
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,87 104,84	2,76 105,29	2,76 105,29	5,76 103,99	12,89 104,29	334.114,14	1.021.011,75
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	1,11 133,38	3,81 145,07	3,81 145,07	7,39 133,47	14,44 116,78	39.262,28	130.981,64
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	3,03 3,74	1,58 6,11	1,58 6,11	14,01 4,11	44,50 18,76	521.811,92	275.793,00
Artigo 9º III % do CDI	1,57 187,87	16,41 625,15	16,41 625,15	30,45 549,93	37,79 305,67	112.854,14	1.592.275,07
Artigo 11º % do CDI	1,32 157,95	5,04 192,08	5,04 192,08	-2,02 -36,46	2,02 16,30	23.728,28	89.400,47
<b>DIADEMA (Total)</b>						<b>1.265.359,11</b>	<b>3.780.014,22</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 Financeiro Trimestre (R\$)
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	20.274.026,86	0,00	0,00	0,00	20.442.435,82	168.408,96	453.137,77
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	11.019.602,85	0,00	0,00	0,00	11.083.276,55	63.673,70	214.610,55
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RF LONGO PRAZO	5.717.382,81	0,00	0,00	0,00	5.718.888,50	1.505,69	2.803,97
	37.011.012,52	0,00	0,00	0,00	37.244.600,87	233.588,35	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	15.776.348,95	23.393.595,88	-22.092.327,93	0,00	17.232.012,70	154.395,80	445.757,69
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	11.109.381,66	0,00	0,00	0,00	11.210.526,82	101.145,16	318.171,28
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	9.517.748,65	0,00	-500.000,00	0,00	9.096.321,83	78.573,18	257.082,78

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
	36.403.479,26	23.393.595,88	-22.592.327,93	0,00	37.538.861,35	334.114,14	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO	3.531.688,63	0,00	0,00	0,00	3.570.950,91	39.262,28	130.981,64
	3.531.688,63	0,00	0,00	0,00	3.570.950,91	39.262,28	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	5.235.601,24	0,00	0,00	0,00	5.247.084,03	11.482,79	-42.501,19
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	5.634.872,16	0,00	0,00	0,00	5.718.715,70	83.843,54	160.019,59
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	6.343.416,99	0,00	0,00	0,00	6.769.902,58	426.485,59	158.274,60
	17.213.890,39	0,00	0,00	0,00	17.735.702,31	521.811,92	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	7.207.158,17	0,00	0,00	0,00	7.320.012,31	112.854,14	1.592.275,07
	7.207.158,17	0,00	0,00	0,00	7.320.012,31	112.854,14	

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII	635.550,78	0,00	0,00	0,00	1.000,00	642.750,72	8.199,94	52.928,16
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPPF11	1.173.054,45	0,00	0,00	0,00	9.300,00	1.179.282,79	15.528,34	36.472,31
	1.808.605,23	0,00	0,00	0,00	10.300,00	1.822.033,51	23.728,28	

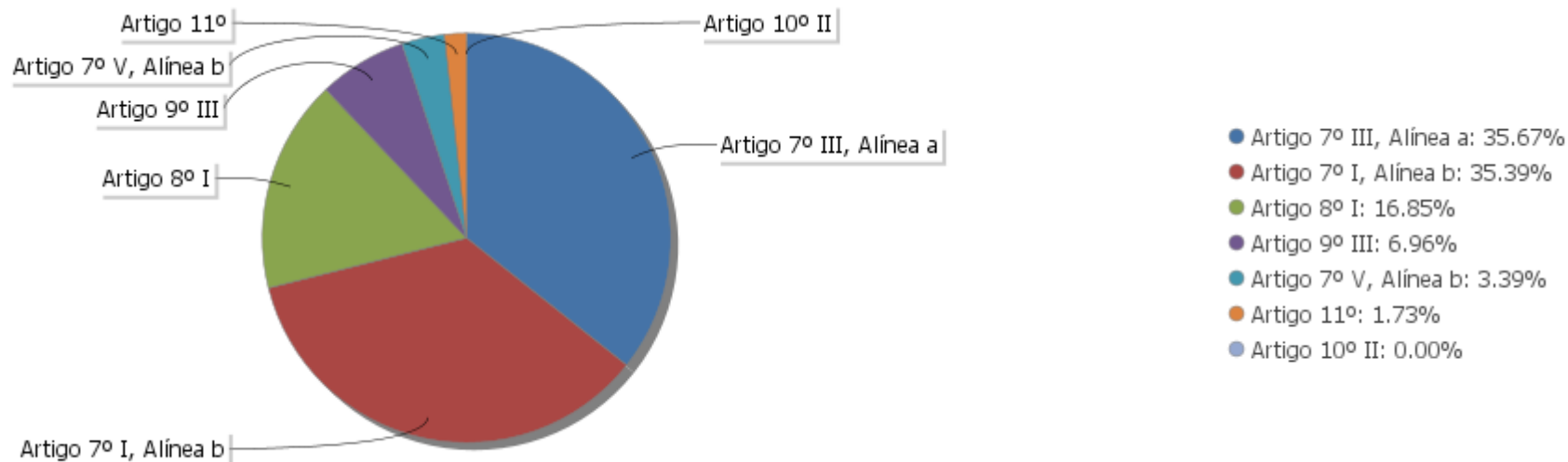
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

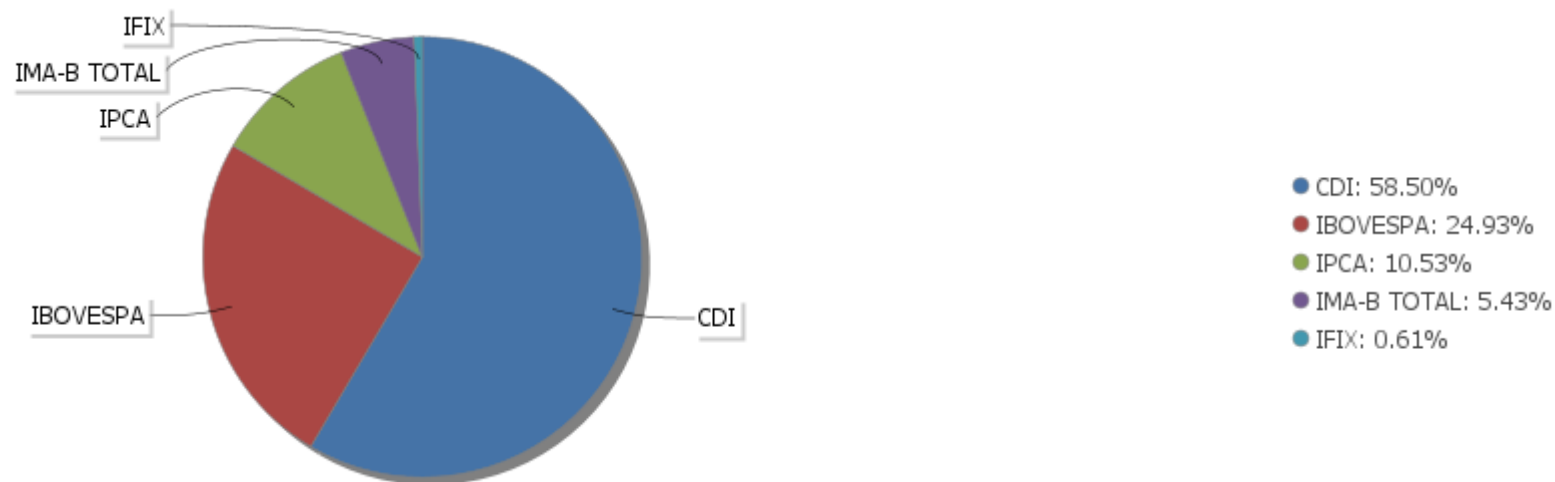
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	83.282.757,32	79,14	85,54	83.282.757,32	79,14	85,54
de 31 dias a 365 dias	21.949.403,94	20,86	14,46	105.232.161,26	100,00	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	0,00	105.232.161,26	100,00	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

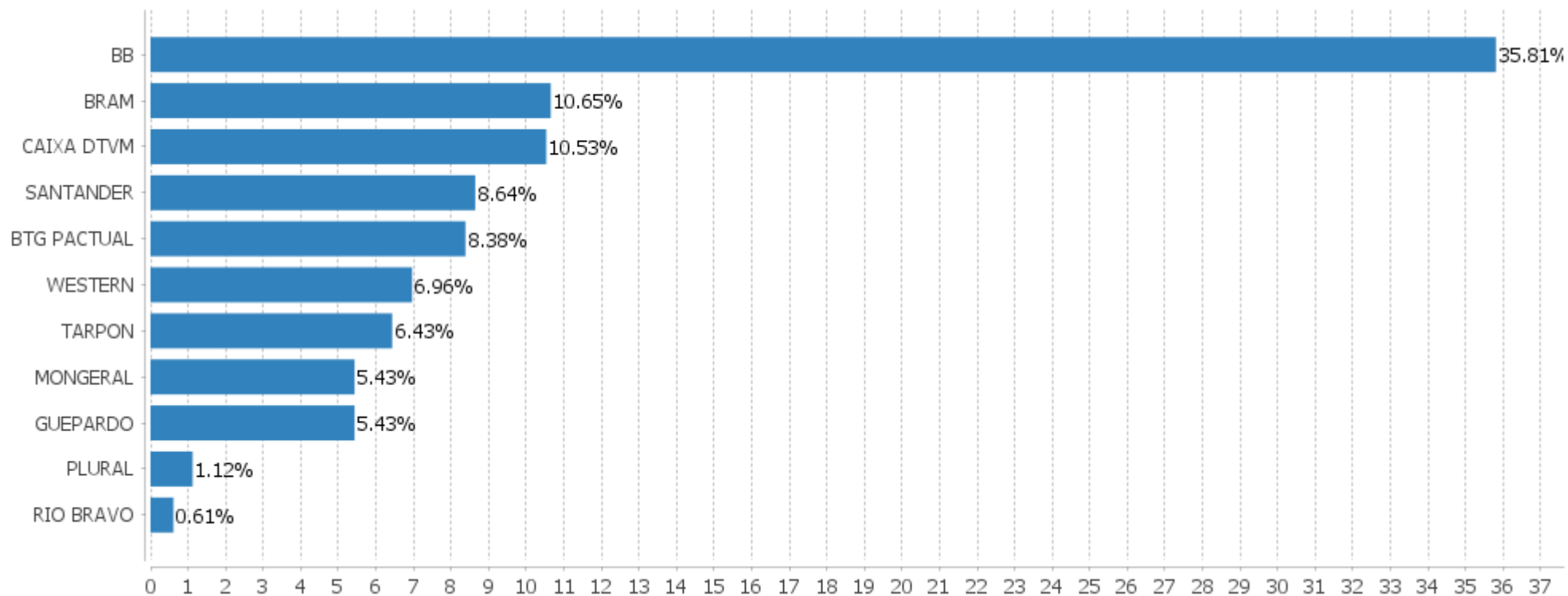


Alocação Por Estratégia



## 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
2024	0,92	1,51	1,25										3,72
IPCA + 5,05%	0,85	1,21	0,55										2,63
p.p. indexador	0,06	0,30	0,70										1,09
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	31	49,21
Meses abaixo - Meta Atuarial	32	50,79

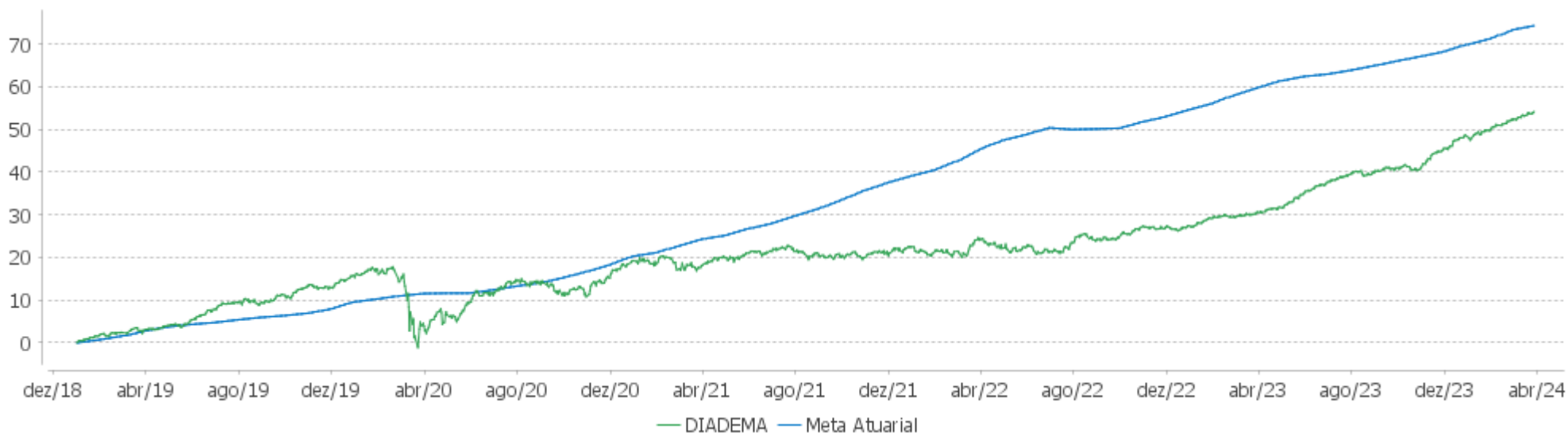
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,93	2020-11
Menor rentabilidade da Carteira	-9,14	2020-03

**Relatório**

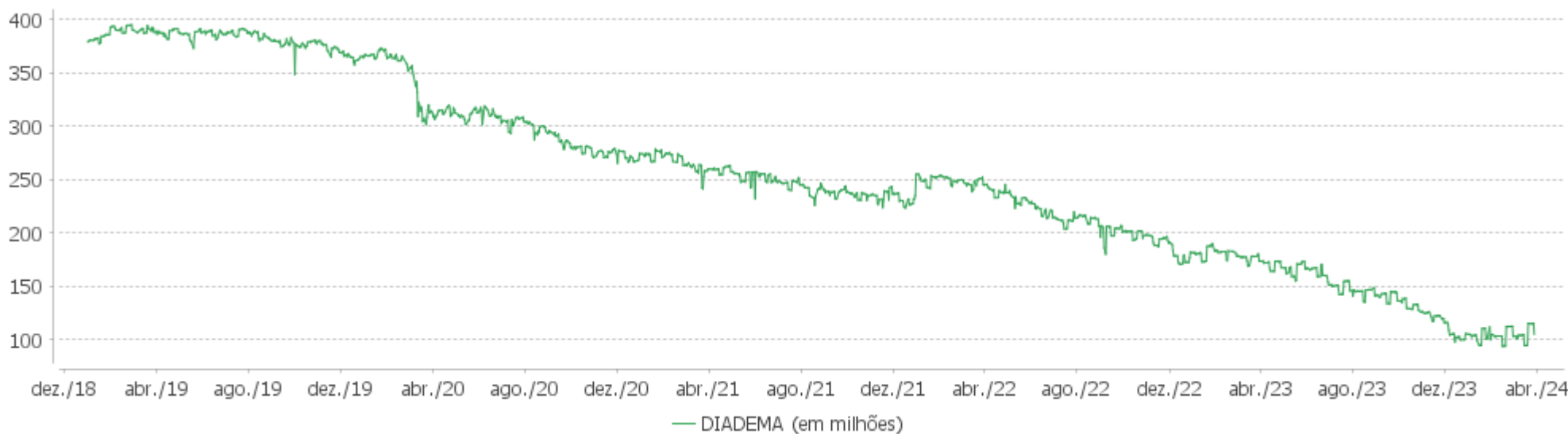
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	3,72	2,63	1,09	2,51
06 meses	9,33	4,99	4,34	2,74
12 meses	18,03	9,07	8,95	2,50
24 meses	24,29	19,78	4,51	3,16
36 meses	30,53	40,38	-9,85	3,58
48 meses	48,38	57,47	-9,10	4,89
60 meses	49,76	72,47	-22,71	6,69
Desde 31/12/2018	54,14	77,55	-23,42	6,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



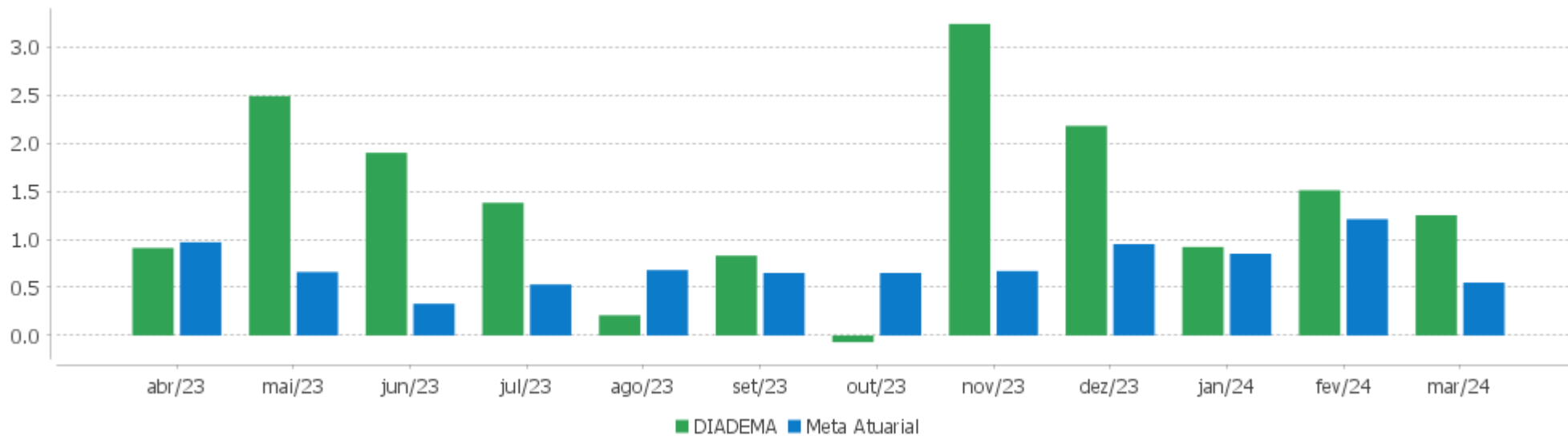
Patrimônio Líquido





EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO % do CDI	1,11 133,38	3,81 145,07	3,81 145,07	7,39 133,47	16,88 136,52	30,28 110,99	42,41 119,64
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RF LONGO PRAZO Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,03 -0,05	0,05 -0,13	0,05 -0,13	4,70 -0,24	11,74 -0,07	19,36 -0,85	24,23 -1,39
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,58 0,42	1,80 0,38	1,80 0,38	4,77 2,26	11,99 8,07	25,10 16,35	28,10 7,05
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO % do CDI	0,83 99,66	2,62 99,69	2,62 99,69	5,49 99,23	12,30 99,51	27,14 99,46	35,43 99,95
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,91 109,23	2,92 111,29	2,92 111,29	6,02 108,71	13,31 107,68	28,84 105,71	37,92 106,99
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,85 102,32	2,65 100,79	2,65 100,79	5,55 100,26	12,40 100,31	27,30 100,05	35,92 101,34
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	0,86 103,63	2,79 106,36	2,79 106,36	5,80 104,72	13,09 105,91	28,17 103,25	37,34 105,36
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,22 0,93	-0,80 3,73	-0,80 3,73	11,91 2,01	23,98 -1,76	-0,33 -7,09	-24,19 -34,03
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	6,72 7,43	2,39 6,92	2,39 6,92	14,21 4,31	66,23 40,49	58,97 52,21	103,98 94,15
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	1,49 2,20	2,88 7,41	2,88 7,41	15,76 5,86	54,11 28,37	41,79 35,04	68,81 58,98
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	1,57 2,27	16,41 20,94	16,41 20,94	30,45 20,55	37,79 12,05	28,06 21,31	13,84 4,00
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	-98,73 -798,63	-98,55 -361,21	-97,42 -274,86
BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII Var. IFIX p.p.	1,29 -0,14	8,58 5,66	8,58 5,66	-12,76 -18,63	-17,54 -40,98	-19,74 -42,34	-9,30 -29,02
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPFF11 Var. IBOVESPA p.p.	1,33 2,04	3,15 7,68	3,15 7,68	6,00 -3,90	22,50 -3,24	23,69 16,93	23,25 13,42
DIADEMA Var. IPCA + 5,06% p.p.	1,25 0,70	3,72 1,09	3,72 1,09	9,33 4,34	18,03 8,96	24,29 4,38	30,53 -9,66
CDI	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44
IBOVESPA	-0,71	-4,53	-4,53	9,90	25,74	6,76	9,84
INPC + 6,00%	0,65	3,02	3,02	5,29	9,47	21,10	43,43

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IPCA + 6,00%	0,62	2,86	2,86	5,45	10,03	22,06	44,00

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
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+32		
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RF 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 INSTITUCIONAL I 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 Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,84	2,46	2,46	5,42	12,28	27,08	33,61	36,96	46,08
IRF-M 1+	0,43	1,37	1,37	6,49	15,26	28,03	28,76	31,09	48,08
IRF-M TOTAL	0,54	1,68	1,68	6,13	14,03	27,20	29,99	32,91	47,66
IMA-B 5	0,77	2,06	2,06	5,09	9,62	21,01	31,56	42,74	56,07
IMA-B 5+	-0,55	-1,51	-1,51	4,82	13,38	19,08	19,49	33,85	44,87
IMA-B TOTAL	0,08	0,18	0,18	4,94	11,81	20,21	25,62	38,67	51,35
IMA-GERAL TOTAL	0,52	1,64	1,64	5,51	12,59	24,78	30,91	37,43	49,07
IDKA 2	0,99	2,24	2,24	5,19	9,48	20,66	31,64	42,92	55,95
IDKA 20	-1,51	-4,59	-4,59	5,22	18,67	18,54	9,63	26,29	33,79
CDI	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44	38,46	46,00

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-0,71	-4,53	-4,53	9,90	25,74	6,76	9,84	75,44	34,26
IBRX 100	-0,73	-4,29	-4,29	10,02	25,18	5,09	8,02	75,18	36,28
IBRX 50	-0,81	-4,06	-4,06	9,78	24,88	5,45	9,81	80,89	34,52
SMALL CAP	2,15	-4,09	-4,09	6,93	24,13	-10,57	-19,33	32,77	16,87
Índice Consumo - ICON	1,26	-7,10	-7,10	4,34	13,75	-29,62	-42,70	-13,51	-19,55
Índice Dividendos - IDIV	-1,20	-3,81	-3,81	10,25	27,20	19,02	32,90	85,19	70,79

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Investimentos Estruturados**

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	3,37	13,68	13,68	22,26	25,75	22,31	15,98	95,38	137,68

**Investimentos Imobiliários**

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	1,43	2,92	2,92	5,87	23,44	22,60	19,72	36,65	37,26

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	3,14	11,17	11,17	18,97	19,08	16,07	2,01	70,15	97,45

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,16	1,42	1,42	2,51	3,93	8,76	21,05	28,43	32,67
INPC	0,19	1,58	1,58	2,36	3,40	7,91	20,56	28,93	33,20
IGPM	-0,47	-0,91	-0,91	0,91	-4,26	-4,10	10,07	44,30	54,12
SELIC	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44	38,46	46,00

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,47	2,38	2,38	4,48	8,00	17,54	36,06	50,08	61,29
IPCA + 5,00%	0,55	2,62	2,62	4,96	9,02	19,79	39,99	55,90	69,16
IPCA + 5,50%	0,59	2,74	2,74	5,21	9,53	20,92	41,99	58,87	73,21
IPCA + 5,89%	0,62	2,83	2,83	5,39	9,92	21,81	43,56	61,21	76,43
IPCA + 6,00%	0,62	2,86	2,86	5,45	10,03	22,06	44,00	61,88	77,34
INPC + 4,00%	0,50	2,55	2,55	4,32	7,45	16,62	35,51	50,66	61,93
INPC + 6,00%	0,65	3,02	3,02	5,29	9,47	21,10	43,43	62,51	78,04

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1421	03/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	3.261,63492600	3,0659470560
1422	05/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	100.000,00	32.588,34072600	3,0685821300
1411	05/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.949.277,84	635.237,30420800	3,0685821300
1406	08/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	594.560,53	0,00	193.673,71340200	3,0699082470
1412	10/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	16.050,17	0,00	5.223,68539400	3,0725759280
1423	11/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	3.253,14989700	3,0739438130
1407	12/01/2024	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	5.000.000,00	2.618.807,43699411	1,9092660000
1424	15/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	56.000,00	18.201,29388500	3,0767043460
1413	15/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.434.599,75	1.441.347,38060400	3,0767043460
1414	16/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	32.500,00	0,00	10.558,78519100	3,0780056050
1415	19/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	15.359.965,71	0,00	4.983.529,09782400	3,0821462880
1425	22/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	3.243,06740000	3,0835005160
1416	23/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	78.558,25	0,00	25.465,92000900	3,0848384810
1417	24/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	228.735,05	0,00	74.115,99491200	3,0861766110
1408	24/01/2024	WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	0,00	10.308.642,09	1.525,84011476	6.756,0434349000
1426	25/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	190.000,00	61.538,29822000	3,0875081940
1418	26/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	811.742,38	0,00	262.800,01877700	3,0888216210
1419	29/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	7.000.000,00	0,00	2.265.270,60425400	3,0901385410
1409	29/01/2024	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	3.308.642,09	0,00	972.098,95884500	3,4036062480
1427	30/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	80.000,00	25.877,79167600	3,0914539000
1420	30/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	11.359.822,37	3.674.588,95958300	3,0914539000
1410	31/01/2024	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	4.135.030,86	0,00	1.213.856,70156900	3,4065230720
1441	01/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.000,00	3.231,91388700	3,0941418460
1431	02/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	7.612,35	2.459,24825900	3,0953971290
1432	05/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.992.190,06	643.337,69030900	3,0966475150
1442	05/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	65.000,00	20.990,44198100	3,0966475150
1433	06/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	67.027,32	0,00	21.635,80021100	3,0979820180
1428	07/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	268.078,89	0,00	86.496,73687000	3,0992948370

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1434	15/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	9.613.106,13	3.096.584,15173200	3,1044226990
1443	15/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	65.000,00	20.937,87035500	3,1044226990
1429	16/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	47.639,21	0,00	15.339,23238900	3,1057101680
1435	16/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	34.000,00	0,00	10.947,57661200	3,1057101680
1436	20/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	18.050.479,39	0,00	5.807.015,44900900	3,1083918320
1444	20/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	20.000,00	6.434,19526300	3,1083918320
1437	23/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	28.328,71	0,00	9.102,11887400	3,1123203720
1445	23/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	225.000,00	72.293,32880500	3,1123203720
1446	28/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.000,00	1.604,48149500	3,1162715280
1440	29/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	9.439.025,17	3.027.614,54458500	3,1176442810
1438	29/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	32.000,00	0,00	10.264,16008800	3,1176442810
1447	29/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	60.000,00	19.245,30016600	3,1176442810
1456	05/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	435.000,00	0,00	139.343,22494818	3,1217879460
1463	05/03/2024	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,00	500.000,00	1.951,61890139	256,1975597000
1450	05/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.961.105,43	628.199,43696458	3,1217879460
1457	06/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	15.000,00	4.802,97910273	3,1230616830
1451	07/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	38.797,93	0,00	12.417,91792016	3,1243506560
1448	07/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.632.793,44	0,00	842.668,99905873	3,1243506560
1458	15/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	70.000,00	22.348,07839124	3,1322603570
1449	15/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.783.204,45	569.302,75480290	3,1322603570
1452	15/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	7.900.000,00	2.522.140,27558246	3,1322603570
1453	20/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	20.194.546,54	0,00	6.439.054,20164348	3,1362597530
1459	25/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	190.000,00	60.507,24752292	3,1401197010
1454	25/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	92.457,97	0,00	29.444,09092767	3,1401197010
1462	28/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	45.000,00	14.311,92238703	3,1442316960
1460	28/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	19.000,00	6.042,81167452	3,1442316960
1455	28/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	10.109.018,05	3.215.099,59423805	3,1442316960
<b>Total</b>			<b>73.486.934,44</b>	<b>77.602.603,69</b>		



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.229.703,34

Value-At-Risk: 1,17%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	Limite <sup>(5)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,33	0,14		0,06	-0,20	0,77	78.354.413,13	74,46
Artigo 8º	8,12	5,89		0,92	0,27	3,03	17.735.702,31	16,85
Artigo 9º	12,61	6,40		0,19	0,06	1,57	7.320.012,31	6,96
Artigo 10º	NaN	NaN		0,00	NaN	NaN	0,00	0,00
Artigo 11º	3,11	1,43		0,00	0,16	1,32	1.822.033,51	1,73
<b>DIADEMA</b>		<b>1,17</b>		<b>1,17</b>			<b>105.232.161,26</b>	<b>100,00</b>

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,14%

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 FI RF LONGO PRAZO	2,32	1,24	0,04	0,03	-0,35	0,03	5.718.888,50	5,43
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,02	0,01	0,00	0,00	-0,19	0,83	20.442.435,82	19,43
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,17	0,40	0,02	0,41	-0,22	0,58	11.083.276,55	10,53
<b>Sub-total</b>	<b>0,65</b>	<b>0,30</b>	<b>0,06</b>		<b>-0,31</b>	<b>0,63</b>	<b>37.244.600,87</b>	<b>35,39</b>

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	0,03	0,01	0,00	0,01	0,64	0,85	17.232.012,70	16,38
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,04	0,02	0,00	0,02	0,75	0,86	9.096.321,83	8,64
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,06	0,06	0,00	0,06	1,32	0,91	11.210.526,82	10,65
<b>Sub-total</b>	<b>0,02</b>	<b>0,02</b>	<b>0,00</b>		<b>1,62</b>	<b>0,87</b>	<b>37.538.861,35</b>	<b>35,67</b>

Artigo 7º V, Alínea b

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

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	0,20	0,21	0,00	0,21	1,41	1,11	3.570.950,91	3,39
<b>Sub-total</b>	0,20	0,21	0,00		1,41	1,11	3.570.950,91	3,39

**Renda Variável** Value-At-Risk: 5,89%

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
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	9,37	6,16	0,31	4,72	0,63	6,72	6.769.902,58	6,43
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	10,69	6,93	0,31	3,77	-0,06	0,22	5.247.084,03	4,99
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	11,51	6,52	0,29	3,62	0,06	1,49	5.718.715,70	5,43
<b>Sub-total</b>	8,12	5,89	0,92		0,27	3,03	17.735.702,31	16,85

**Investimentos no Exterior** Value-At-Risk: 6,40%

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	12,61	6,40	0,19	8,48	0,06	1,57	7.320.012,31	6,96
<b>Sub-total</b>	12,61	6,40	0,19		0,06	1,57	7.320.012,31	6,96

**Fundos Imobiliários** Value-At-Risk: 1,43%

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 - BPFF11	3,29	2,15	0,00	6,10	0,15	1,33	1.179.282,79	1,12
BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII	4,01	0,39	-0,00	1,95	0,11	1,29	642.750,72	0,61
<b>Sub-total</b>	3,11	1,43	0,00		0,16	1,32	1.822.033,51	1,73

**Investimentos Estruturados** Value-At-Risk: NaN%

Artigo 10º II

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	0,00	NaN	0,00	NaN	0,00	0,00	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 (%)