



LDB
EMPRESAS

DIADEMA
JANEIRO 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 31.01.2024.

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 75,83%

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 FI RF LONGO PRAZO	4,21	0,20	-0,49	-0,49	5.688.322,92	5,44	212.565.646,29	2,68
BB	BB	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,05	0,04	0,96	0,96	20.112.818,38	19,23	31.634.733.184,62	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,31	0,11	0,66	0,66	10.958.808,32	10,48	5.336.453.186,66	0,21
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,73	0,09	0,58	0,58	36.759.949,62	35,15		

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	0,09	0,04	0,97	0,97	18.600.981,83	17,79	16.400.080.186,89	0,11
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,09	0,05	1,04	1,04	9.436.425,31	9,02	2.799.993.446,09	0,34
BRAM	BRDESCO	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,09	0,05	1,09	1,09	11.010.721,42	10,53	9.205.921.475,18	0,12
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,06	0,05	1,02	1,02	39.048.128,56	37,34		

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	0,51	0,07	1,36	1,36	3.486.905,35	3,33	2.856.273.253,82	0,12
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			0,51	0,07	1,36	1,36	3.486.905,35	3,33		
Renda Fixa			0,37	0,07	0,83	0,83	79.294.983,53	75,83		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

16,06%

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	17,33	0,43	-3,37	-3,37	5.111.399,21	4,89	1.385.702.652,77	0,37
GUEPARDO	DAYCOVAL	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	18,45	0,56	-1,49	-1,49	5.475.855,71	5,24	483.893.890,15	1,13
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT 30 FIC FIA	18,96	3,30	-6,16	-6,16	6.204.559,96	5,93	876.894.794,02	0,71
Sub-total Artigo 8º I			15,94	1,52	-3,83	-3,83	16.791.814,88	16,06		
Renda Variável			15,94	1,52	-3,83	-3,83	16.791.814,88	16,06		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 6,39%

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	15,79	-1,12	6,27	6,27	6.682.640,29	6,39	1.448.103.316,07	0,46
Sub-total Artigo 9º III			15,79	-1,12	6,27	6,27	6.682.640,29	6,39		
Investimentos no Exterior			15,79	-1,12	6,27	6,27	6.682.640,29	6,39		

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	0,00	0,00	2.615.006,70	0,00	
Sub-total Artigo 10º II			440,93	0,00	0,00	0,00	0,00			
Investimentos Estruturados				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	Ano				
PLURAL	GENIAL	BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPF11	7,57	0,00	1,03	1,03	1.173.436,04	1,12	351.430.483,05	0,33
RIO BRAVO	BB	BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII	77,25	0,00	6,63	6,63	633.239,48	0,61	12.923.477,03	4,90
Sub-total Artigo 11º			38,67	0,00	2,98	2,98	1.806.675,52	1,73		
Fundos Imobiliários			38,67	0,00	2,98	2,98	1.806.675,52	1,73		
Total			2,54	0,22	0,92	0,92	104.576.114,22	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	36.759.949,62	35,15	0,00	50,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	39.048.128,56	37,34	0,00	25,00	60,00	0,00	65,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	3.486.905,35	3,33	0,00	3,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	79.294.983,53	75,83					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	16.791.814,88	16,06	0,00	12,00	30,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	16.791.814,88	16,06					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	6.682.640,29	6,39	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	6.682.640,29	6,39					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º II	Fundo de Participação	0,00	0,00	0,00	0,00	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	0,00	0,00					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	1.806.675,52	1,73	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	1.806.675,52	1,73					5,00
Total		104.576.114,22	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	0,58 60,07	0,58 60,07	3,27 116,34	5,30 87,76	12,60 97,85	185.901,04	185.901,04
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,02 105,67	1,02 105,67	2,92 104,12	6,33 104,86	13,19 102,48	357.166,72	357.166,72
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	1,36 141,14	1,36 141,14	3,64 129,59	8,37 138,58	12,49 97,02	46.936,08	46.936,08
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-3,83 0,97	-3,83 0,97	12,94 0,03	7,08 2,31	25,75 13,13	-668.094,43	-668.094,43
Artigo 9º III % do CDI	6,27 648,88	6,27 648,88	18,87 672,19	16,73 276,97	33,97 263,89	954.903,05	954.903,05
Artigo 11º % do CDI	2,98 308,14	2,98 308,14	5,88 209,55	-7,59 -125,71	2,23 17,30	53.442,48	53.442,48
DIADEMA (Total)						930.254,94	930.254,94

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	12.545.625,10	7.443.672,95	0,00	0,00	20.112.818,38	123.520,33	123.520,33
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	15.868.666,00	0,00	-5.000.000,00	0,00	10.958.808,32	90.142,32	90.142,32
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RF LONGO PRAZO	5.716.084,53	0,00	0,00	0,00	5.688.322,92	-27.761,61	-27.761,61
	34.130.375,63	7.443.672,95	-5.000.000,00	0,00	36.759.949,62	185.901,04	

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	12.536.955,12	24.122.112,09	-18.199.699,96	0,00	18.600.981,83	141.614,58	141.614,58
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	10.892.355,54	0,00	0,00	0,00	11.010.721,42	118.365,88	118.365,88
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	9.339.239,05	0,00	0,00	0,00	9.436.425,31	97.186,26	97.186,26
	32.768.549,71	24.122.112,09	-18.199.699,96	0,00	39.048.128,56	357.166,72	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	3.439.969,27	0,00	0,00	0,00	3.486.905,35	46.936,08	46.936,08
	3.439.969,27	0,00	0,00	0,00	3.486.905,35	46.936,08	

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	5.289.585,22	0,00	0,00	0,00	5.111.399,21	-178.186,01	-178.186,01
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	5.558.696,11	0,00	0,00	0,00	5.475.855,71	-82.840,40	-82.840,40
TARPON GT 30 FIC FIA	6.611.627,98	0,00	0,00	0,00	6.204.559,96	-407.068,02	-407.068,02
	17.459.909,31	0,00	0,00	0,00	16.791.814,88	-668.094,43	

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	16.036.379,33	0,00	-10.308.642,09	0,00	6.682.640,29	954.903,05	954.903,05
	16.036.379,33	0,00	-10.308.642,09	0,00	6.682.640,29	954.903,05	

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	0,00
	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	

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	624.322,56	0,00	0,00	0,00	32.500,00	633.239,48	41.416,92	41.416,92
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPFF11	1.170.710,48	0,00	0,00	0,00	9.300,00	1.173.436,04	12.025,56	12.025,56
	1.795.033,04	0,00	0,00	0,00	41.800,00	1.806.675,52	53.442,48	

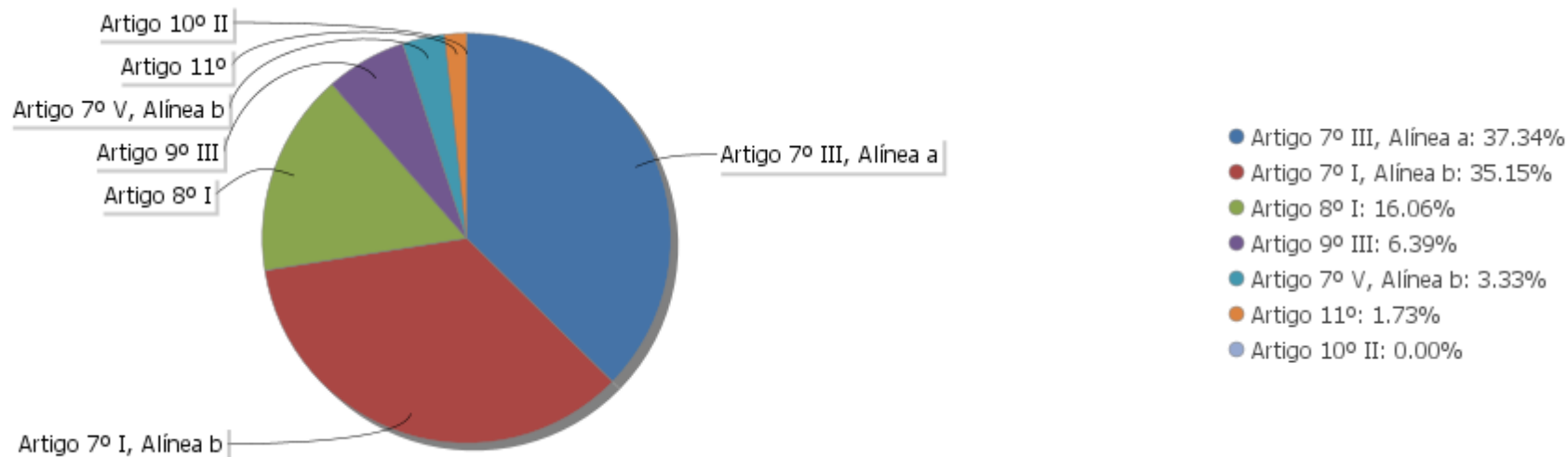
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

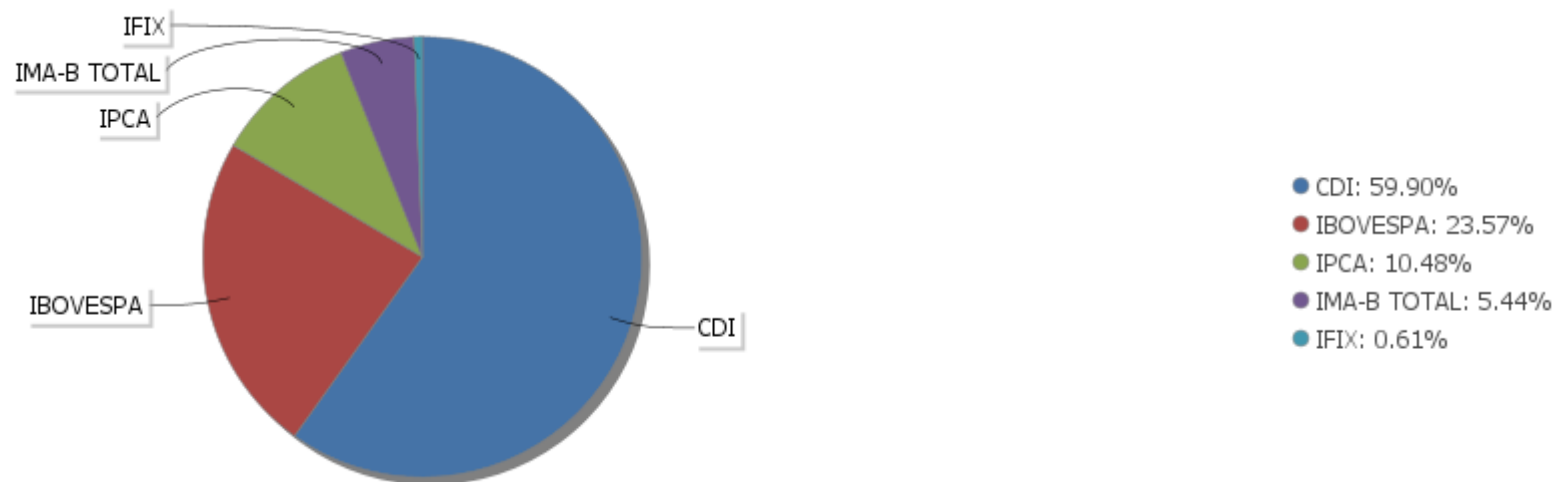
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	83.664.154,51	80,00	85,54	83.664.154,51	80,00	85,54
de 31 dias a 365 dias	20.911.959,71	20,00	14,46	104.576.114,22	100,00	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	0,00	104.576.114,22	100,00	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

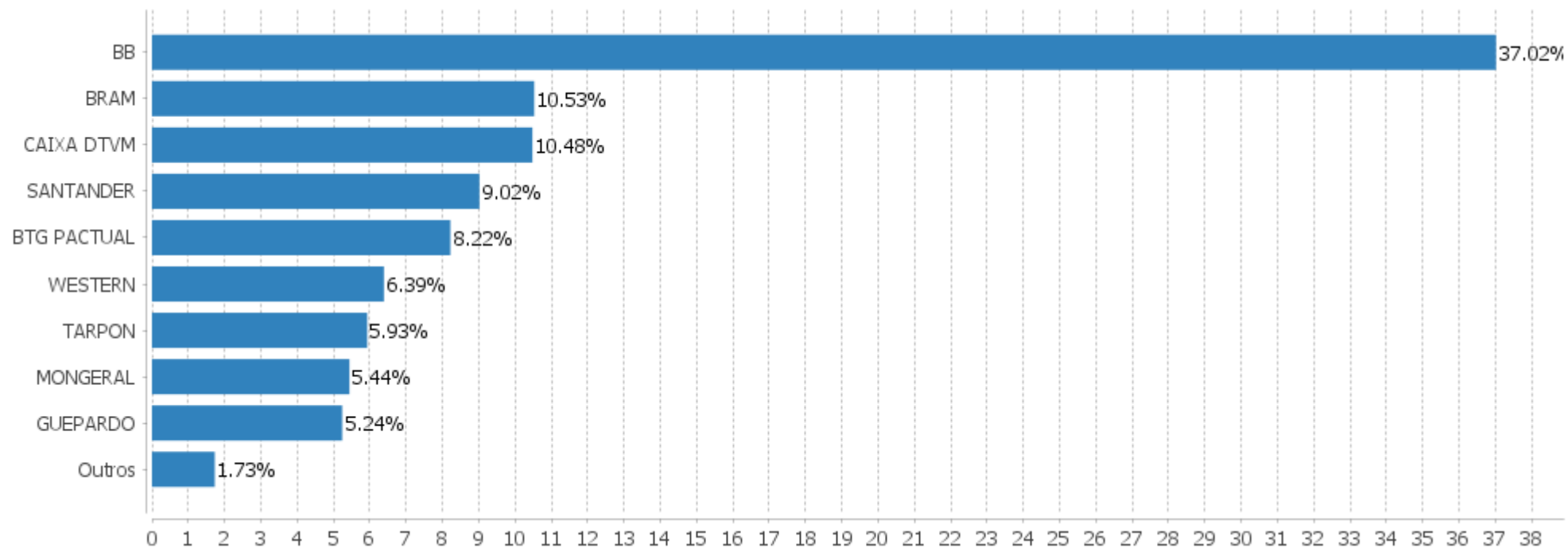


Alocação Por Estratégia



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												0,92
IPCA + 5,05%	0,85												0,85
p.p. indexador	0,06												0,06
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	29	47,54
Meses abaixo - Meta Atuarial	32	52,46

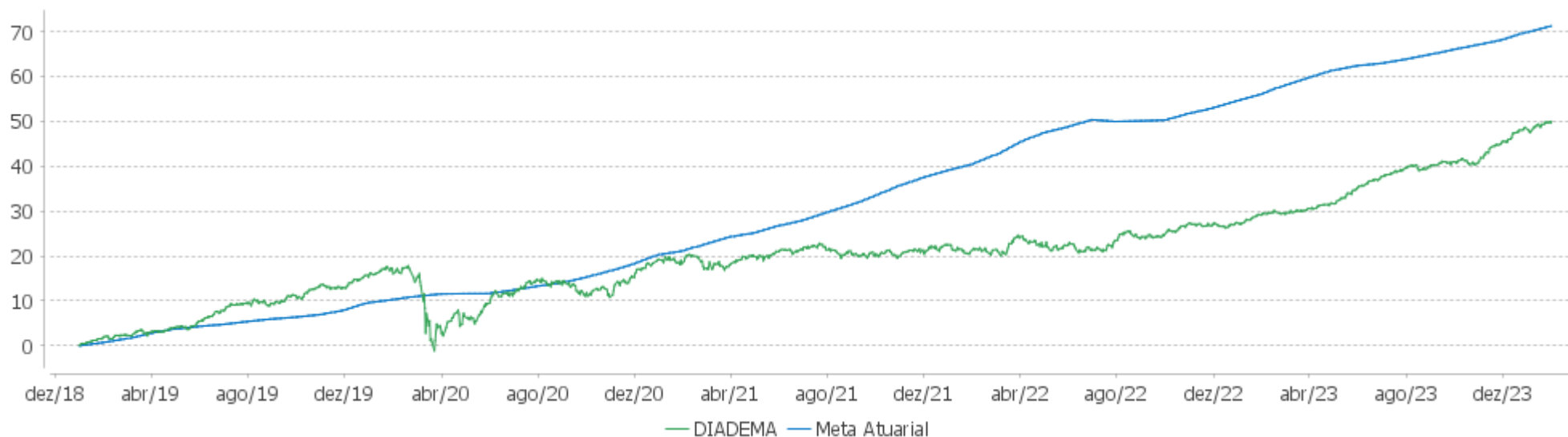
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,93	2020-11
Menor rentabilidade da Carteira	-9,14	2020-03

Relatório

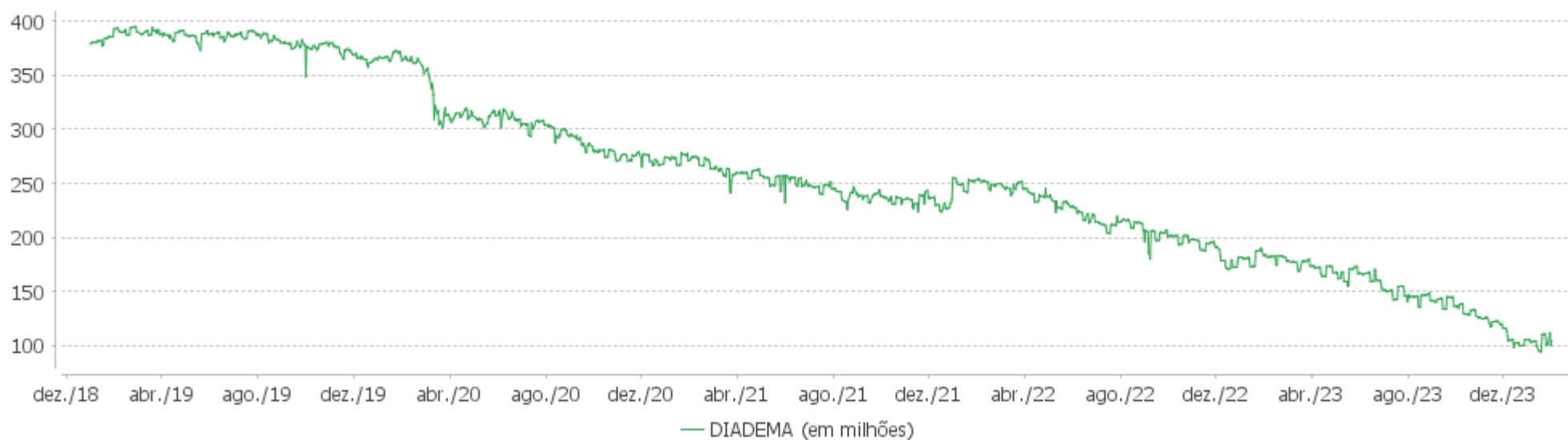
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	6,46	2,50	3,95	3,03
06 meses	7,48	4,55	2,93	2,91
12 meses	15,99	9,73	6,26	2,54
24 meses	23,55	21,76	1,79	3,43
36 meses	26,83	41,65	-14,81	3,89
48 meses	29,21	56,65	-27,44	7,28
60 meses	47,09	73,04	-25,94	6,71
Desde 31/12/2018	49,97	74,47	-24,50	6,65

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

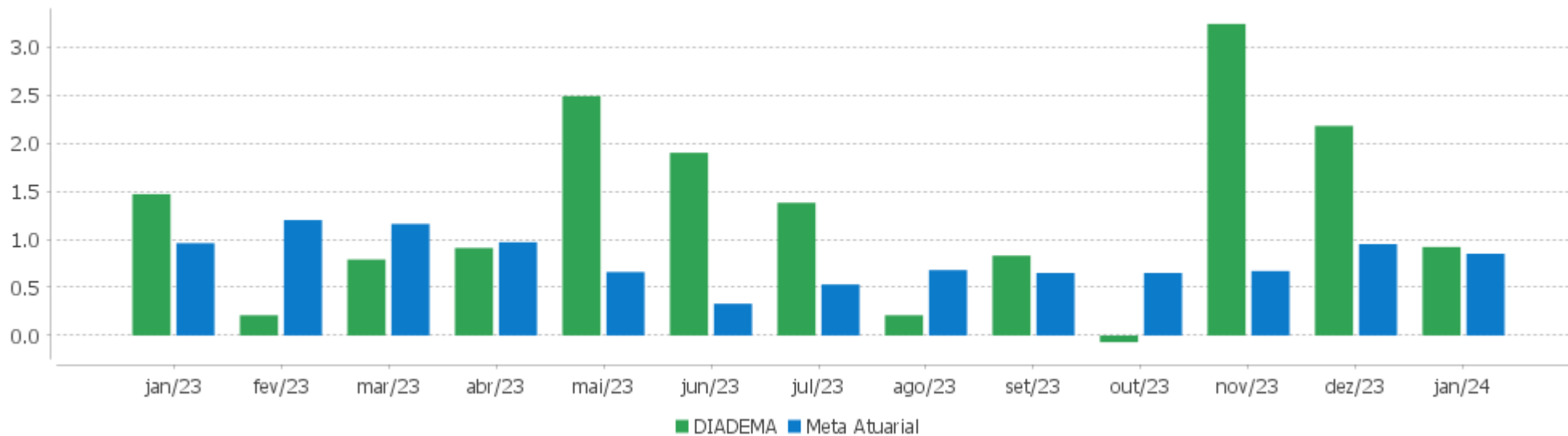


Patrimônio Líquido



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	1,36 141,14	1,36 141,14	3,64 129,59	8,37 138,56	15,16 117,75	29,88 109,31	40,93 121,44
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RF LONGO PRAZO Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,49 -0,04	-0,49 -0,04	4,88 -0,09	2,69 -0,22	15,31 -0,22	23,02 -0,78	20,95 -1,43
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,66 0,24	0,66 0,24	3,33 2,07	4,67 2,67	13,16 8,65	25,72 15,18	26,39 4,38
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO % do CDI	0,96 99,51	0,96 99,51	2,79 99,34	6,00 99,42	12,81 99,49	27,23 99,63	33,60 99,72
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,09 112,41	1,09 112,41	3,04 108,45	6,56 108,57	13,58 105,49	28,79 105,35	35,99 106,81
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,97 100,00	0,97 100,00	2,81 100,09	6,04 100,08	12,80 99,46	27,43 100,36	34,15 101,32
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI % do CDI	1,04 107,65	1,04 107,65	2,95 105,27	6,45 106,83	13,33 103,56	28,24 103,32	35,48 105,28
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,37 1,43	-3,37 1,43	13,39 0,48	1,81 -2,95	6,94 -5,69	1,60 -12,32	-26,78 -37,80
TARPON GT 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-6,16 -1,36	-6,16 -1,36	11,40 -1,51	10,28 5,51	42,45 29,82	65,15 51,24	101,97 90,94
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-1,49 3,30	-1,49 3,30	14,31 1,40	8,75 3,99	40,63 28,01	37,57 23,65	63,46 52,44
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	6,27 11,07	6,27 11,07	18,87 5,95	16,73 11,96	33,97 21,34	2,43 -11,49	10,63 -0,39
PÁTRIA SPECIAL OPORTUNITIES I FIC FIP % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	-98,71 -766,81	-99,27 -363,22	-97,49 -289,28
BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII Var. IFIX p.p.	6,63 5,97	6,63 5,97	6,73 1,10	-22,03 -26,29	-16,09 -34,26	-18,16 -38,21	-8,47 -24,24
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPFF11 Var. IBOVESPA p.p.	1,03 5,82	1,03 5,82	5,48 -7,44	4,73 -0,03	20,30 7,67	21,16 7,24	19,60 8,58
DIADEMA Var. IPCA + 5,06% p.p.	0,92 0,06	0,92 0,06	6,46 3,96	7,48 2,93	15,99 6,27	23,55 1,64	26,83 -14,53
CDI	0,97	0,97	2,81	6,04	12,87	27,33	33,70
IBOVESPA	-4,79	-4,79	12,91	4,76	12,63	13,92	11,02
INPC + 6,00%	1,08	1,08	2,69	4,67	9,97	23,23	44,47

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IPCA + 6,00%	0,93	0,93	2,73	5,02	10,70	24,12	45,22

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+2		
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 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	0,83	0,83	2,77	5,92	12,95	27,12	31,60	36,12	45,12
IRF-M 1+	0,60	0,60	5,55	6,14	18,37	28,70	23,39	30,51	48,22
IRF-M TOTAL	0,67	0,67	4,68	6,05	16,31	27,74	26,10	32,31	47,48
IMA-B 5	0,68	0,68	3,99	4,44	11,33	23,79	29,45	39,23	56,02
IMA-B 5+	-1,47	-1,47	5,89	1,54	19,03	23,38	15,40	19,65	46,36
IMA-B TOTAL	-0,45	-0,45	4,97	2,91	15,53	23,80	22,38	28,77	52,10
IMA-GERAL TOTAL	0,47	0,47	3,98	5,14	14,53	26,21	28,00	33,76	48,90
IDKA 2	0,81	0,81	4,15	4,81	11,43	23,53	29,55	40,17	55,62
IDKA 20	-3,34	-3,34	7,85	-0,30	28,79	24,16	6,04	6,79	36,82
CDI	0,97	0,97	2,81	6,04	12,87	27,33	33,70	37,09	45,03

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-4,79	-4,79	12,91	4,76	12,63	13,92	11,02	12,30	31,17
IBRX 100	-4,51	-4,51	13,20	5,15	11,88	12,72	10,34	12,15	33,43
IBRX 50	-4,15	-4,15	13,07	5,74	11,32	13,01	11,95	14,94	31,89
SMALL CAP	-6,55	-6,55	12,50	-6,30	6,34	-10,11	-19,32	-22,95	11,91
Índice Consumo - ICON	-8,33	-8,33	13,01	-11,48	-4,76	-28,41	-45,21	-47,39	-24,62
Índice Dividendos - IDIV	-3,51	-3,51	14,18	8,88	15,58	28,28	35,93	29,79	64,85

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	3,94	3,94	13,17	10,31	15,47	-0,78	18,02	74,30	143,07

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,67	0,67	5,63	4,26	18,16	20,04	15,77	8,33	38,34

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	2,86	2,86	12,43	7,98	9,50	-5,80	2,83	51,79	101,82

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,42	0,42	1,27	2,01	4,51	10,54	22,01	27,58	32,93
INPC	0,57	0,57	1,22	1,66	3,82	9,75	21,38	28,10	33,61
IGPM	0,07	0,07	1,41	2,15	-3,32	0,35	17,32	47,48	59,00
SELIC	0,97	0,97	2,80	6,04	12,87	27,33	33,70	37,09	45,03

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,76	0,76	2,25	4,03	8,64	19,51	37,19	49,11	61,60
IPCA + 5,00%	0,85	0,85	2,49	4,53	9,67	21,80	41,17	54,89	69,49
IPCA + 5,50%	0,89	0,89	2,61	4,77	10,18	22,96	43,18	57,84	73,54
IPCA + 5,89%	0,92	0,92	2,70	4,97	10,59	23,86	44,77	60,18	76,76
IPCA + 6,00%	0,93	0,93	2,73	5,02	10,70	24,12	45,22	60,84	77,68
INPC + 4,00%	0,91	0,91	2,21	3,67	7,92	18,65	36,48	49,72	62,43
INPC + 6,00%	1,08	1,08	2,69	4,67	9,97	23,23	44,47	61,50	78,60

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
Total			31.565.785,04	33.508.342,05		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.458.069,05

Value-At-Risk: 1,39%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,43	0,25		0,13	-0,31	0,83	79.294.983,53	75,83
Artigo 8º	17,03	7,44		1,14	-0,28	-3,83	16.791.814,88	16,06
Artigo 9º	13,46	6,25		0,13	0,39	6,27	6.682.640,29	6,39
Artigo 10º	NaN	NaN		0,00	NaN	NaN	0,00	0,00
Artigo 11º	8,93	0,45		-0,00	0,23	2,98	1.806.675,52	1,73
DIADEMA		1,39		1,39			104.576.114,22	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,25%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RF LONGO PRAZO		2,14	0,08	0,06			5.688.322,92	5,44
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO		0,01	-0,00	0,01			20.112.818,38	19,23
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,73	0,05	0,73			10.958.808,32	10,48
Sub-total	0,85	0,54	0,13		-0,45	0,58	36.759.949,62	35,15

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,01	0,00	0,01			18.600.981,83	17,79
SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI		0,02	-0,00	0,02			9.436.425,31	9,02
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,04	0,00	0,04			11.010.721,42	10,53
Sub-total	0,05	0,02	0,00		1,08	1,02	39.048.128,56	37,34

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
-------	-----------------------------	--------------------	---------------------	---------------------	--------	-------	------------	------------

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO		0,20	-0,00	0,20			3.486.905,35	3,33
Sub-total	0,25	0,20	-0,00		1,56	1,36	3.486.905,35	3,33

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,44%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		7,54	0,34	3,43			5.111.399,21	4,89
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA		7,95	0,37	4,11			5.475.855,71	5,24
TARPON GT 30 FIC FIA		8,39	0,43	5,49			6.204.559,96	5,93
Sub-total	17,03	7,44	1,14		-0,28	-3,83	16.791.814,88	16,06

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,25%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I		6,25	0,13	8,40			6.682.640,29	6,39
Sub-total	13,46	6,25	0,13		0,39	6,27	6.682.640,29	6,39

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 0,45%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FII - BPF11		0,18	0,00	6,40			1.173.436,04	1,12
BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FI IMOBILIARIO - FII		1,24	-0,00	2,51			633.239,48	0,61
Sub-total	8,93	0,45	-0,00		0,23	2,98	1.806.675,52	1,73

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	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 (%)