



LDB
EMPRESAS

SANTA MARIA DE JETIBÁ
JULHO 2021



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 30.07.2021.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

99,59%

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IRF-M	3,00	-0,50	-2,19	11.018.940,07	14,25	6.941.606.073,67	0,16
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	9,57	-0,72	-4,55	7.696.854,23	9,95	281.334.128,28	2,74
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,64	-0,40	-1,23	10.709.051,00	13,85	5.838.267.480,63	0,18
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,58	0,02	1,19	7.404.646,53	9,58	5.928.712.027,28	0,12
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	1,44	0,07	-0,32	2.536.414,06	3,28	177.653.174,46	1,43
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,93	-0,25	-0,93	7.495.138,24	9,69	8.970.903.955,40	0,08
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,68	-0,36	-1,55	46.861.044,13	60,60		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	5,62	-0,39	-1,21	11.354.278,48	14,68	2.818.884.270,28	0,40
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			5,62	-0,39	-1,21	11.354.278,48	14,68		

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BANESTES	BANESTES	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,37	0,44	2,22	488.247,89	0,63	282.543.390,63	0,17
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,47	0,38	1,54	4.690.271,48	6,07	5.483.866.382,38	0,09
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	9,98	-0,56	-4,74	7.410.935,37	9,58	247.804.323,02	2,99
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,15	0,25	1,01	3.460.501,19	4,47	2.238.891.886,28	0,15
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,05	0,26	1,11	446.538,96	0,58	570.379.498,92	0,08
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,99	0,03	0,52	2.305.596,78	2,98	146.161.754,56	1,58
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			4,39	-0,06	-1,29	18.802.091,67	24,31		

Renda Fixa

3,77

-0,29

-1,44

77.017.414,28

99,59

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

0,41%

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	20,29	-4,44	-3,36	193.288,69	0,25	1.704.868.967,48	0,01
SCHRODER	BEM	SCHRODER BEST IDEAS FIA	20,47	-6,01	-7,44	120.331,93	0,16	54.740.712,46	0,22
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			14,85	-5,05	-4,96	313.620,62	0,41		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			14,85	-5,05	-4,96	313.620,62	0,41		
Total			3,78	-0,31	-1,46	77.331.034,90	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	46.861.044,13	60,60	0,00	64,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	11.354.278,48	14,68	0,00	11,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	18.802.091,67	24,31	0,00	13,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	77.017.414,28	99,59					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	313.620,62	0,41	0,00	5,00	20,00	0,00	20,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	313.620,62	0,41					30,00

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	-0,36 -101,27	-1,55 -94,85	0,52 55,73	-0,65 -44,15	0,34 14,03	-169.017,63	-745.043,21
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-0,39 -108,35	-1,21 -74,20	1,11 118,86	-0,33 -22,32	2,25 92,65	-43.918,39	-137.675,47
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,06 -16,85	-1,29 -79,39	1,05 112,86	-0,13 -8,80	-0,61 -25,14	-13.665,39	-227.504,86
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-5,05 -1,11	-4,96 1,06				-16.686,21	-16.379,38
SANTA MARIA DE JETIBÁ (Total)						-243.287,62	-1.126.602,92

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	7.752.653,13	0,00	0,00	0,00	7.696.854,23	-55.798,90	-366.630,67
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	2.610.453,70	0,00	-76.000,00	0,00	2.536.414,06	1.960,36	-15.533,45
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	7.513.897,06	0,00	0,00	0,00	7.495.138,24	-18.758,82	-67.386,10
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	7.402.974,71	0,00	0,00	0,00	7.404.646,53	1.671,82	84.179,20
BB PREV RF IRF-M	11.074.170,62	0,00	0,00	0,00	11.018.940,07	-55.230,55	-246.765,66
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	10.751.912,54	0,00	0,00	0,00	10.709.051,00	-42.861,54	-132.906,53
					46.861.044,13	0,00	0,00

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	11.398.196,87	0,00	0,00	0,00	11.354.278,48	-43.918,39	-137.675,47
					11.354.278,48	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	1.980.301,22	326.711,12	0,00	0,00	2.305.596,78	-1.415,56	14.884,20
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	7.452.920,40	0,00	0,00	0,00	7.410.935,37	-41.985,03	-369.128,99
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	486.093,16	0,00	0,00	0,00	488.247,89	2.154,73	15.531,10
BB PREV RF FLUXO FIC	3.451.681,06	314,49	0,00	0,00	3.460.501,19	8.505,64	34.385,57
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	532.578,77	0,00	-87.377,47	0,00	446.538,96	1.337,66	6.061,23
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.672.534,31	0,00	0,00	0,00	4.690.271,48	17.737,17	70.762,03
					18.802.091,67	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	202.276,43	0,00	0,00	0,00	193.288,69	-8.987,74	-6.711,31
SCHRODER BEST IDEAS FIA	128.030,40	0,00	0,00	0,00	120.331,93	-7.698,47	-9.668,07
					313.620,62	0,00	0,00

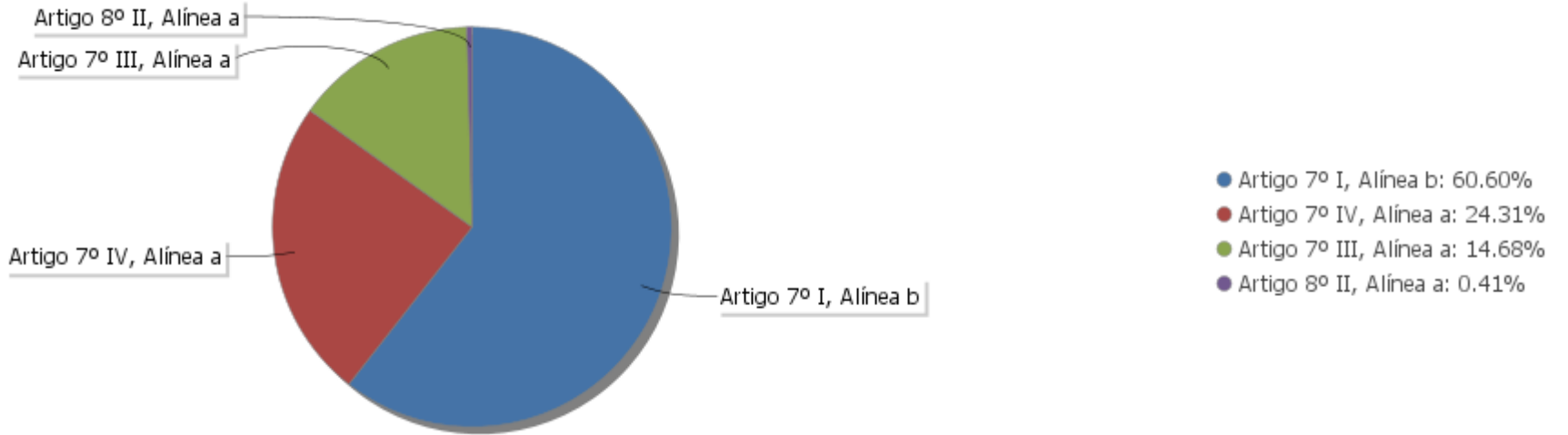
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

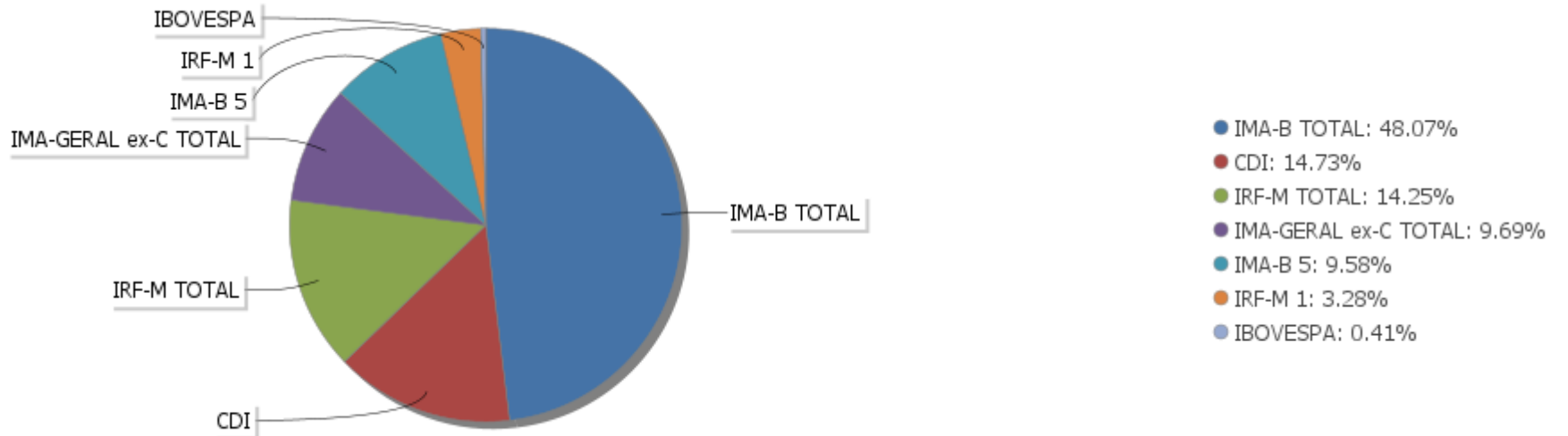
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	77.331.034,90	100,00	77.331.034,90	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	77.331.034,90	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	77.331.034,90	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

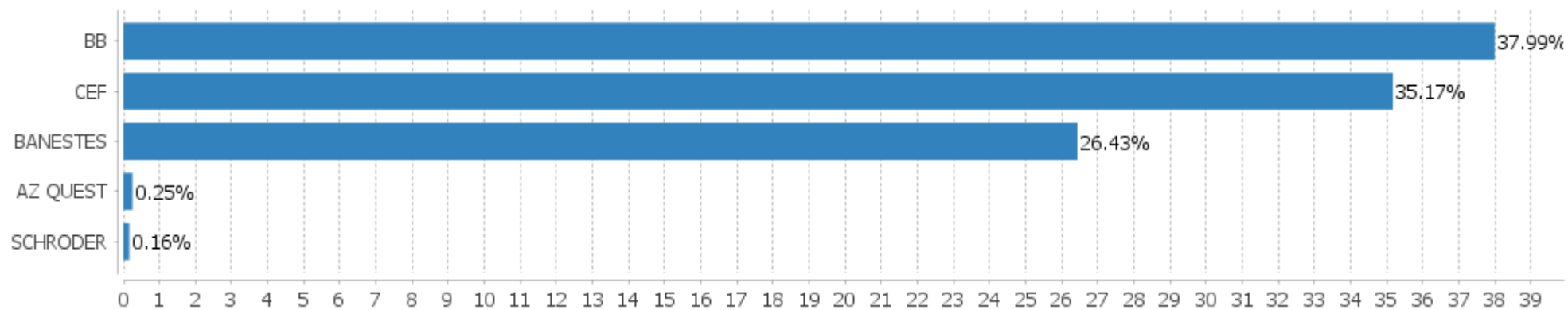


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2021	-0,96	-1,27	-0,61	0,68	0,71	0,31	-0,31						-1,46
IPCA + 5,42%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,43						7,99
p.p. indexador	-1,63	-2,51	-2,03	-0,05	-0,56	-0,66	-1,74						-9,45
2020	0,57	0,42	-5,52	1,12	1,19	1,38	3,19	-1,47	-1,66	0,19	1,16	3,72	4,04
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,63
p.p. indexador	-0,14	-0,24	-6,09	0,98	1,11	0,64	2,31	-2,19	-2,78	-1,15	-0,19	1,86	-6,59
2019	2,80	0,64	0,45	1,04	3,06	3,20	1,49	-0,53	2,61	2,73	-1,95	1,42	18,17
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	1,97	-0,25	-0,75	-0,02	2,42	2,75	0,76	-1,15	2,16	2,10	-2,93	-0,23	7,58

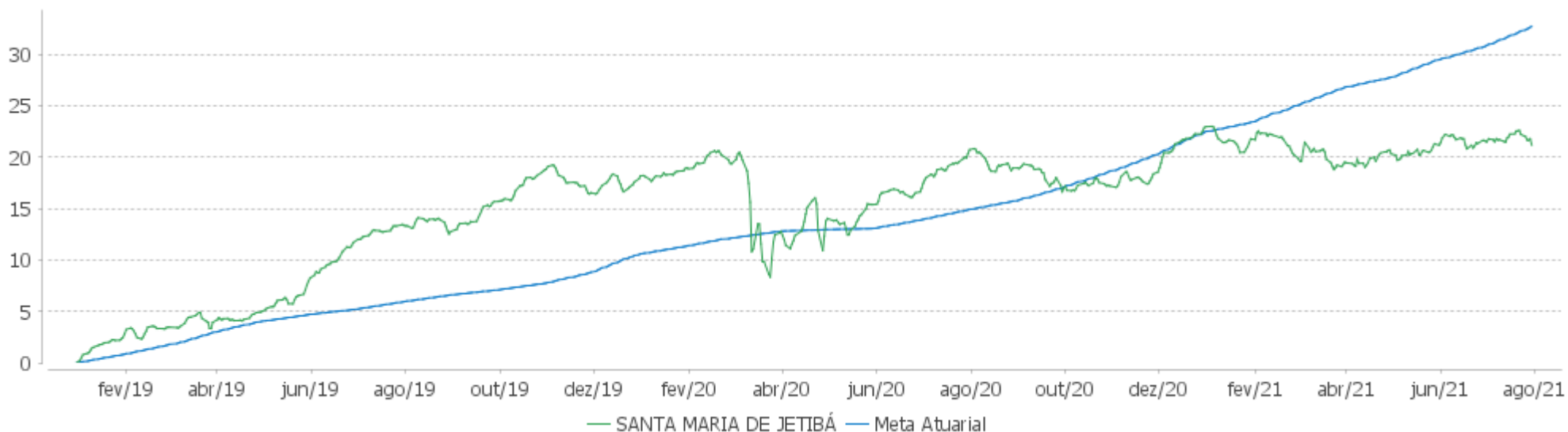
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

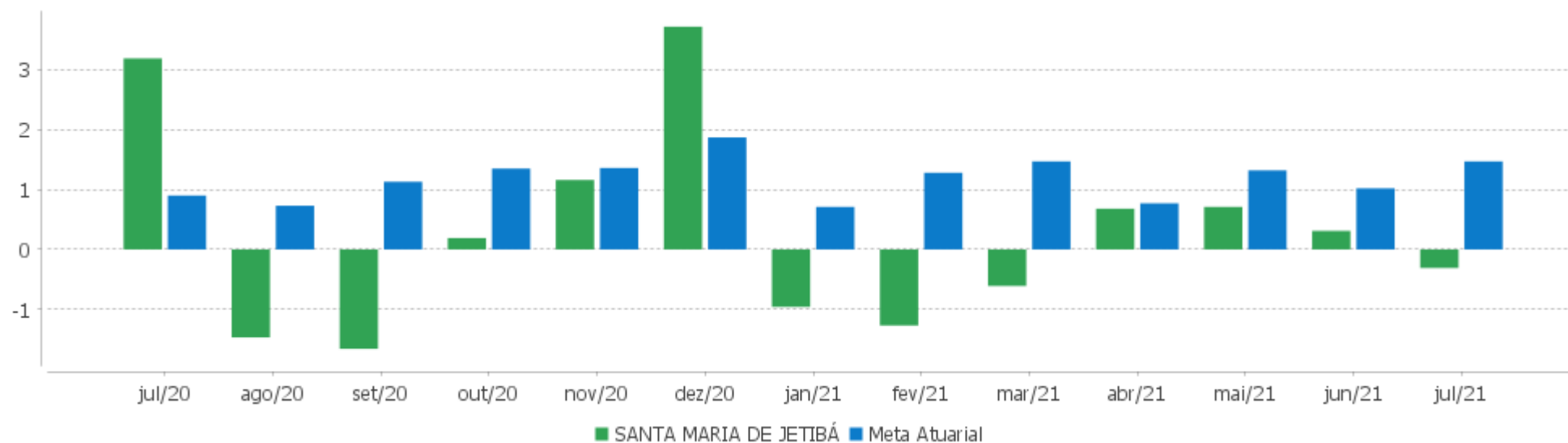
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	11	35,48	03 meses	0,71	3,72	-3,01	3,38
Meses abaixo - Meta Atuarial	20	64,52	06 meses	-0,50	7,27	-7,78	3,96
			12 meses	0,37	15,06	-14,69	3,78
			24 meses	6,89	24,71	-17,82	6,19
Maior rentabilidade da Carteira	3,72	2020-12	Desde 31/12/2018	21,15	32,12	-10,97	5,62
Menor rentabilidade da Carteira	-5,52	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,44 124,65	2,22 136,18	1,06 113,38	2,06 139,61	3,12 128,34	4,18 61,69	10,58 78,12
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,56 -0,19	-4,74 -3,65	1,33 0,23	-1,91 -1,66	-3,21 -5,73	-1,06 -11,95	34,49 -6,86
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF % do CDI	0,03 8,92	-0,68 -41,90	0,90 97,03	0,14 9,64	0,47 19,39	7,41 109,44	26,81 197,98
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,25 69,29	1,01 61,74	0,66 71,31	0,93 62,71	1,30 53,48	4,47 66,00	9,91 73,19
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,38 106,75	1,54 94,65	0,98 105,27	1,34 90,58	1,98 81,27	6,32 93,38	12,95 95,60
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,26 72,02	1,11 68,32	0,69 74,13	1,03 69,73	1,56 63,91	4,95 73,18	10,69 78,91
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,39 -0,01	-1,21 -0,12	1,11 0,00	-0,33 -0,09	2,25 -0,27	10,23 -0,66	40,05 -1,29
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,07 -0,12	-0,32 -1,33	0,25 -0,35	0,11 -0,85	0,35 -1,63	9,06 1,46	21,45 6,01
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,72 -0,35	-4,55 -3,45	1,15 0,05	-2,12 -1,87	-3,07 -5,60	0,88 -10,00	39,78 -1,57
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,40 -0,03	-1,23 -0,14	1,04 -0,06	-0,36 -0,12	2,28 -0,24	10,19 -0,70	40,21 -1,14
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,25 -0,15	-0,93 -0,49	0,34 -0,38	-0,38 -0,38	0,55 -0,41	7,68 -0,42	24,46 0,00
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,02 -0,01	1,19 -0,12	0,52 -0,07	1,09 -0,11	4,79 -0,27	13,79 -0,54	29,57 -0,87
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,50 -0,02	-2,19 -0,15	-0,17 -0,11	-1,40 -0,15	-1,69 -0,29	7,71 -0,56	23,91 -0,91
SCHRODER BEST IDEAS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-6,01 -2,07	-1,96 -4,30	-1,00 -3,45	0,84 -5,01	15,36 -2,99	31,05 11,42	68,92 15,17
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-4,44 -0,50	8,25 5,92	1,64 -0,81	10,37 4,51	15,22 -3,14	28,77 9,14	87,80 34,05
SANTA MARIA DE JETIBÁ Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,31 -1,79	-1,46 -9,79	0,71 -3,16	-0,50 -8,07	0,37 -15,11	6,89 -18,37	
CDI	0,36	1,63	0,93	1,48	2,43	6,77	13,54

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IBOVESPA	-3,94	2,34	2,44	5,85	18,35	19,63	53,75
INPC + 6,00%	1,54	8,59	4,13	7,80	16,39	26,73	38,51
IPCA + 6,00%	1,47	8,33	3,86	7,56	15,48	25,26	36,99

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	D+1 du	D+0	D+27	D+29	20.0000000000000	2,00
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	D+0	D+0	D+1 du	D+2 du	0,00	0,50
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	0,15
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,80
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du	0,00	0,30
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	1,00
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,20
BB PREV RF IRF-M	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,80
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
SCHRODER BEST IDEAS FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	10.0000000000000 Para informações adicionais, vide o Regulamento	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	0,19	1,00	0,60	0,96	1,99	7,60	15,44	23,97	40,68
IRF-M 1+	-0,83	-4,11	-0,42	-2,76	-3,34	8,28	28,38	38,97	66,27
IRF-M TOTAL	-0,47	-2,04	-0,06	-1,25	-1,40	8,27	24,82	34,87	59,02
IMA-B 5	0,03	1,31	0,59	1,21	5,06	14,34	30,43	41,23	60,61
IMA-B 5+	-0,76	-3,29	1,44	-1,63	0,34	8,18	49,88	56,72	81,63
IMA-B TOTAL	-0,37	-1,09	1,10	-0,24	2,53	10,89	41,35	50,46	72,98
IMA-GERAL TOTAL	-0,10	0,04	0,87	0,28	1,67	9,12	25,92	35,34	55,62
IDKA 2	-0,18	1,68	0,38	1,54	5,88	15,07	29,57	41,20	61,95
IDKA 20	-1,44	-5,02	1,98	-2,27	-1,21	3,68	67,33	69,21	99,56
CDI	0,36	1,63	0,93	1,48	2,43	6,77	13,54	21,60	36,83

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,94	2,34	2,44	5,85	18,35	19,63	53,75	84,77	112,54
IBRX 100	-3,99	4,47	2,33	7,73	20,73	23,34	61,40	92,00	121,47
IBRX 50	-3,85	4,91	2,77	7,91	22,23	22,51	54,85	86,08	113,55
SMALL CAP	-5,80	4,96	1,45	8,69	20,13	29,57	86,53	106,58	160,32
IFIX	2,51	-1,60	-1,29	-1,92	3,33	6,19	31,08	36,68	62,68
Índice Consumo - ICON	-5,22	-2,08	1,59	-0,81	2,95	15,45	58,99	62,68	71,63
Índice Dividendos - IDIV	-1,72	0,31	1,58	5,67	14,21	18,21	67,31	86,37	136,91

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,96	4,76	2,34	4,50	8,99	11,51	15,10	20,26	23,52
INPC	1,02	5,01	2,60	4,73	9,85	12,81	16,38	20,58	23,08
IGPM	0,78	15,98	5,54	13,06	33,83	46,23	55,58	68,40	65,60
SELIC	0,36	1,63	0,93	1,48	2,43	6,77	13,54	21,61	36,86

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	4,72	15,33	-0,37	10,68	32,26	100,62	112,87	191,07	219,74
MSCI ACWI	2,99	10,44	-2,20	5,36	29,16	87,89	90,03	148,07	175,22
MSCI World	4,15	12,45	-1,01	7,85	31,07	90,86	94,44	156,03	181,87

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,31	7,15	3,36	6,55	13,32	20,59	29,41	40,58	50,15
IPCA + 5,00%	1,39	7,74	3,61	7,06	14,40	22,91	33,17	46,04	57,47
IPCA + 5,50%	1,43	8,04	3,74	7,31	14,94	24,08	35,07	48,83	61,23
IPCA + 5,89%	1,47	8,27	3,84	7,51	15,36	25,00	36,57	51,03	64,22
IPCA + 6,00%	1,47	8,33	3,86	7,56	15,48	25,26	36,99	51,65	65,07
INPC + 4,00%	1,37	7,41	3,63	6,79	14,21	22,00	30,85	40,95	49,61
INPC + 6,00%	1,54	8,59	4,13	7,80	16,39	26,73	38,51	52,05	64,49

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
87	01/07/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	203,53	107,23774400	1,8979200000
88	02/07/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	240,30	126,59604100	1,8981440000
89	05/07/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	4.512,22	2.376,89634500	1,8983660000
90	07/07/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	59,00	31,07047100	1,8988000000
91	08/07/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.500,45	790,11926800	1,8990150000
86	09/07/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	314,49	0,00	147,51550100	2,1319115470
92	09/07/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	109,45	57,62731800	1,8992320000
93	12/07/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.030,45	542,49882700	1,8994510000
94	19/07/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.010,90	531,89697300	1,9005560000
84	21/07/2021	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	326.711,12	0,00	255.246,65896531	1,2799819600
85	23/07/2021	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	0,00	76.000,00	40.826,58981125	1,8615319200
95	26/07/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	49,00	25,76676300	1,9016600000
96	28/07/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	39.632,20	20.836,01236500	1,9021010000
97	29/07/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.291,67	678,99613400	1,9023230000
98	30/07/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	37.738,30	19.835,67276800	1,9025470000
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.394.246,04

Value-At-Risk: 1,80%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTA MARIA DE JETIBÁ		1,80	1,80			77.331.034,90	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,80%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF-M		1,25	0,16	0,02			11.018.940,07	14,25
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B		3,50	0,34	1,23			7.696.854,23	9,95
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,40	0,33	0,02			10.709.051,00	13,85
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,36	0,11	0,04			7.404.646,53	9,58
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1		0,40	0,01	0,25			2.536.414,06	3,28
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,20	0,11	0,21			7.495.138,24	9,69
Sub-total	3,25	1,76	1,06		-0,22	-0,36	46.861.044,13	60,60

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP		2,38	0,35	0,03			11.354.278,48	14,68
Sub-total	4,32	2,38	0,35		-0,17	-0,39	11.354.278,48	14,68

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI		0,09	-0,00	0,09			488.247,89	0,63
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,04	0,00	0,04			4.690.271,48	6,07
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF		3,65	0,34	1,45			7.410.935,37	9,58
BB PREV RF FLUXO FIC		0,02	-0,00	0,02			3.460.501,19	4,47
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,02	0,00	0,02			446.538,96	0,58

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF		1,18	0,03	1,18			2.305.596,78	2,98
Sub-total	2,39	1,59	0,38		-0,17	-0,06	18.802.091,67	24,31

Renda Variável e Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 7,24%

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		7,51	0,01	3,91			193.288,69	0,25
SCHRODER BEST IDEAS FIA		7,60	0,01	2,02			120.331,93	0,16
Sub-total	18,56	7,24	0,01		-0,29	-5,05	313.620,62	0,41