



LDB
EMPRESAS

SANTA MARIA DE JETIBÁ
FEVEREIRO 2022



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 25.02.2022.

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

97,97%

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	3,55	0,57	0,44	11.057.038,88	13,90	4.398.251.592,64	0,25
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,20	0,88	1,68	4.900.332,54	6,16	16.227.045.266,95	0,03
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	7,42	0,41	-0,54	6.943.547,26	8,73	189.307.422,05	3,67
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,61	0,53	-0,23	10.651.554,94	13,39	4.318.650.723,31	0,25
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,14	0,63	1,25	185.043,58	0,23	779.530.510,06	0,02
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,77	1,05	1,13	7.716.205,11	9,70	6.375.804.434,87	0,12
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	0,76	0,71	1,38	1.129.841,80	1,42	273.789.264,47	0,41
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,74	0,62	0,65	7.584.579,51	9,53	6.887.287.977,51	0,11
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,98	0,65	0,45	50.168.143,62	63,05		

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos 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	0,35	0,82	1,53	1.261.262,44	1,59	291.552.370,35	0,43
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	5,64	0,48	-0,28	11.289.067,03	14,19	2.339.591.507,81	0,48
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	7,25	0,42	-0,24	6.804.365,51	8,55	201.878.031,30	3,37
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,16	0,68	1,33	3.588.127,26	4,51	3.177.445.522,66	0,11
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	2,16	0,79	1,35	4.840.937,41	6,08	140.645.511,93	3,44
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			5,52	0,56	0,26	27.783.759,65	34,92		
Renda Fixa			3,96	0,62	0,38	77.951.903,27	97,97		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDÁ VARIÁVEL

0,68%

Artigo 8º I (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	17,37	-1,47	1,13	163.118,86	0,20	1.428.707.503,72	0,01
ARX	BEM	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	18,33	1,00	7,97	259.461,16	0,33	299.494.056,41	0,09
SCHRODER	BEM	SCHRODER BEST IDEAS FIA	19,44	1,93	14,51	115.771,14	0,15	58.756.755,47	0,20
Sub-total Artigo 8º I			15,01	0,43	7,09	538.351,16	0,68		
Renda Variável			16,87	0,43	7,09	538.351,16	0,68		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

1,36%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	11,70	0,32	4,93	100.075,50	0,13	46.929.596,91	0,21
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	5,87	-2,05	-1,98	980.215,98	1,23	123.808.243,84	0,79
Sub-total Artigo 10º I			11,39	-1,83	1,91	1.080.291,48	1,36		
Investimentos Estruturados			11,39	-1,83	1,91	1.080.291,48	1,36		
Total			3,97	0,58	0,40	79.570.545,91	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	50.168.143,62	63,05	0,00	60,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	27.783.759,65	34,92	0,00	30,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	77.951.903,27	97,97					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	538.351,16	0,68	0,00	5,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	538.351,16	0,68					30,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	1.080.291,48	1,36	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	1.080.291,48	1,36					15,00

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	0,65 87,07	0,45 30,14	1,26 55,74	1,37 35,85	1,22 21,55	325.478,52	220.475,56
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,56 74,43	0,26 17,70	0,48 21,44	1,11 29,04	1,21 21,46	152.811,69	73.130,69
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	0,43 -0,46	7,09 -0,85				2.310,93	35.640,20
Artigo 10º I % do CDI	-1,83 -244,47	1,91 128,47				-20.165,44	-15.080,13
SANTA MARIA DE JETIBÁ (Total)						460.435,70	314.166,32

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\$)
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	6.915.237,61	0,00	0,00	0,00	6.943.547,26	28.309,65	-42.951,29
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	1.121.860,53	0,00	0,00	0,00	1.129.841,80	7.981,27	20.586,05
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	7.538.143,62	0,00	0,00	0,00	7.584.579,51	46.435,89	49.298,39
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	7.635.697,27	0,00	0,00	0,00	7.716.205,11	80.507,84	86.368,54
BB PREV RF IRF M	10.994.600,54	0,00	0,00	0,00	11.057.038,88	62.438,34	48.426,93
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	216.462,94	0,00	-32.775,35	0,00	185.043,58	1.355,99	2.863,79
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	10.595.711,37	0,00	0,00	0,00	10.651.554,94	55.843,57	-24.992,54
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.857.726,57	0,00	0,00	0,00	4.900.332,54	42.605,97	80.875,69
					50.168.143,62	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	4.416.160,52	389.173,52	0,00	0,00	4.840.937,41	35.603,37	59.000,21
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	6.775.836,79	0,00	0,00	0,00	6.804.365,51	28.528,72	-19.889,73
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	1.250.987,46	0,00	0,00	0,00	1.261.262,44	10.274,98	18.967,86

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	3.563.660,46	314,49	0,00	0,00	3.588.127,26	24.152,31	47.228,58
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	11.234.814,72	0,00	0,00	0,00	11.289.067,03	54.252,31	-32.176,23
					27.783.759,65	0,00	0,00

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	256.899,40	0,00	0,00	0,00	259.461,16	2.561,76	19.153,99
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	165.558,32	0,00	0,00	0,00	163.118,86	-2.439,46	1.817,81
SCHRODER BEST IDEAS FIA	113.582,51	0,00	0,00	0,00	115.771,14	2.188,63	14.668,40
					538.351,16	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	99.758,09	0,00	0,00	0,00	100.075,50	317,41	4.703,89
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	1.000.698,83	0,00	0,00	0,00	980.215,98	-20.482,85	-19.784,02
					1.080.291,48	0,00	0,00

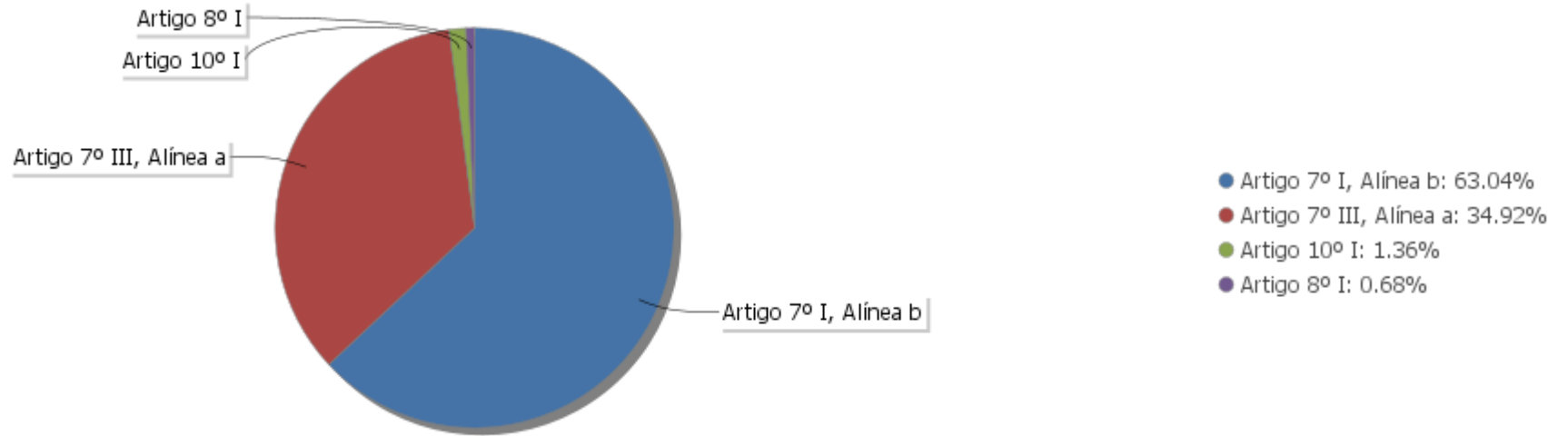
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

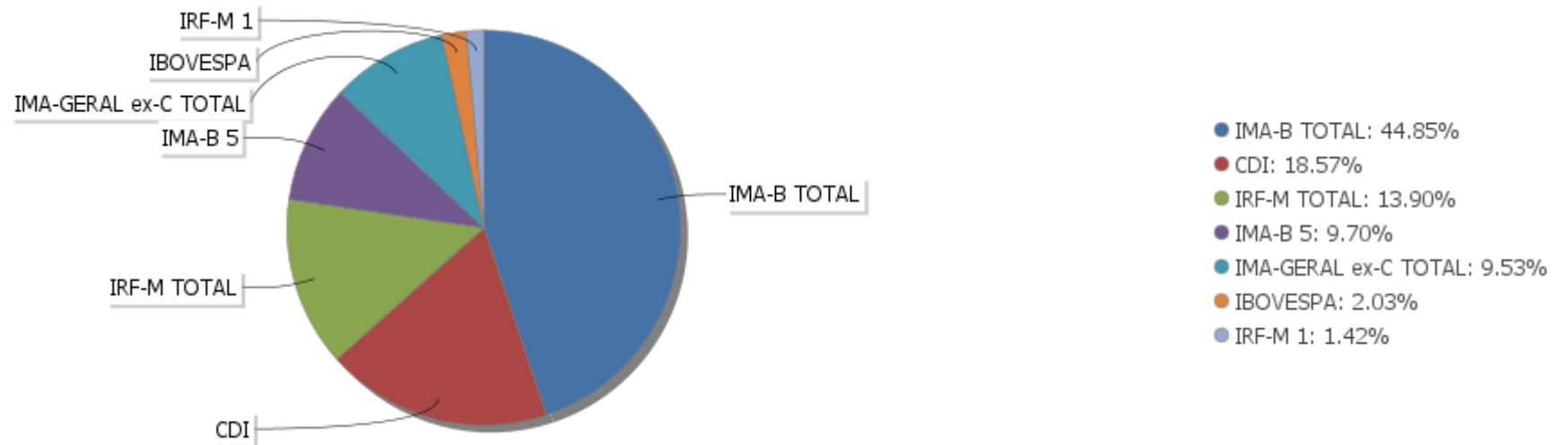
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	79.470.470,41	99,87	79.470.470,41	99,87
de 31 a 365 dias	100.075,50	0,13	79.570.545,91	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	79.570.545,91	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

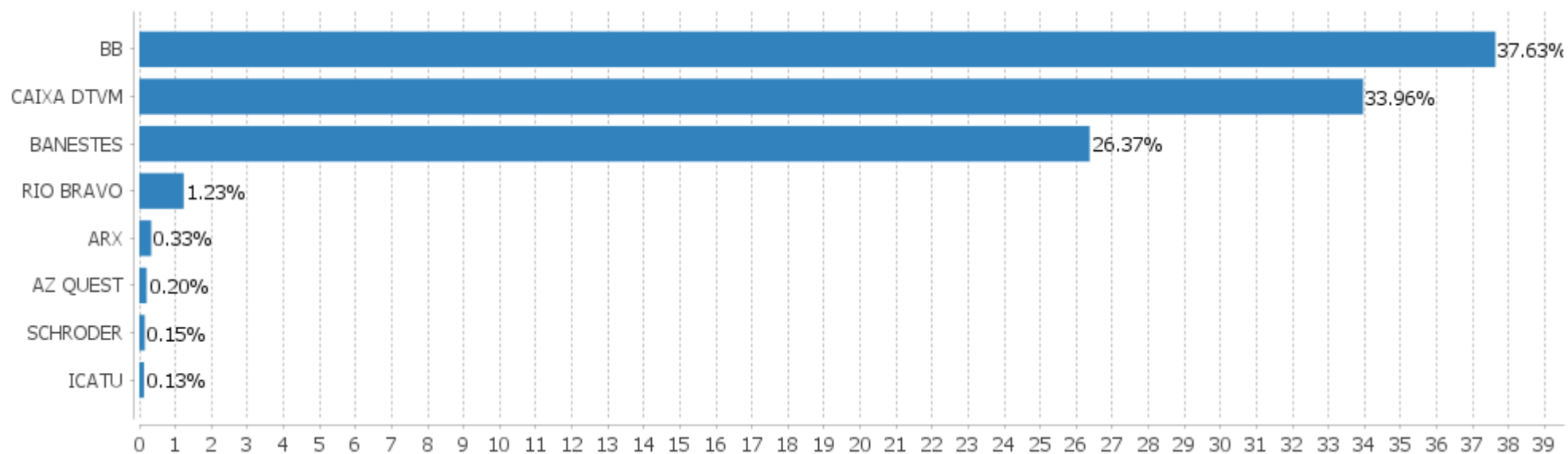


Alocação Por Estratégia



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
2022	-0,19	0,58											0,40
IPCA + 4,89%	0,94	1,37											2,33
p.p. indexador	-1,13	-0,79											-1,93
2021	-0,96	-1,27	-0,61	0,68	0,71	0,31	-0,31	-0,77	-0,10	-1,90	2,33	0,68	-1,27
IPCA + 5,42%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,43	1,34	1,61	1,68	1,37	1,22	16,00
p.p. indexador	-1,63	-2,51	-2,03	-0,05	-0,56	-0,66	-1,74	-2,11	-1,71	-3,57	0,96	-0,53	-17,27
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

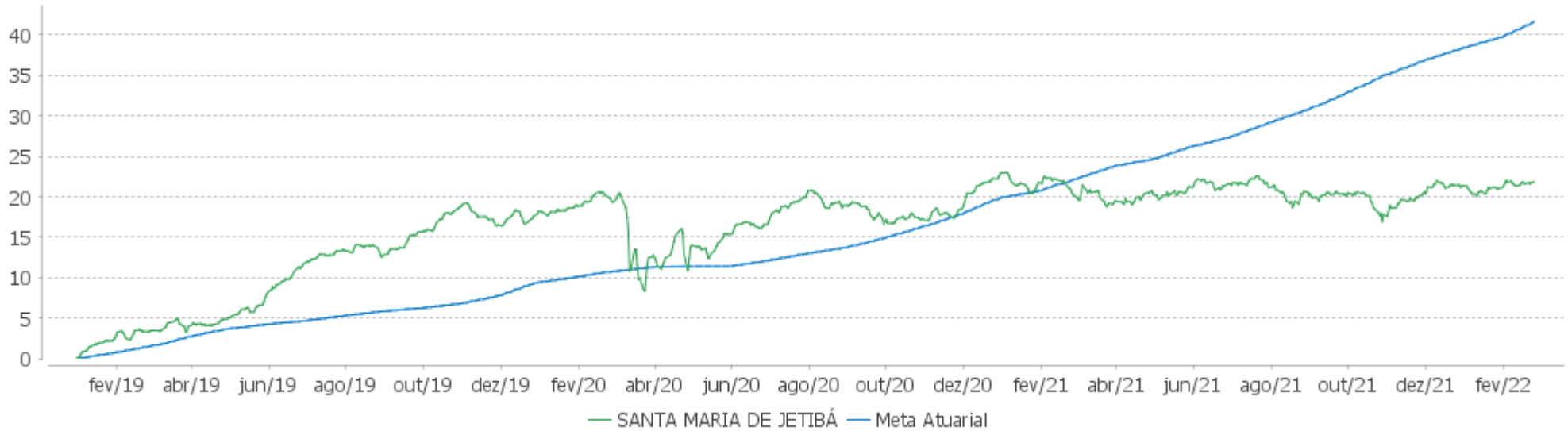
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

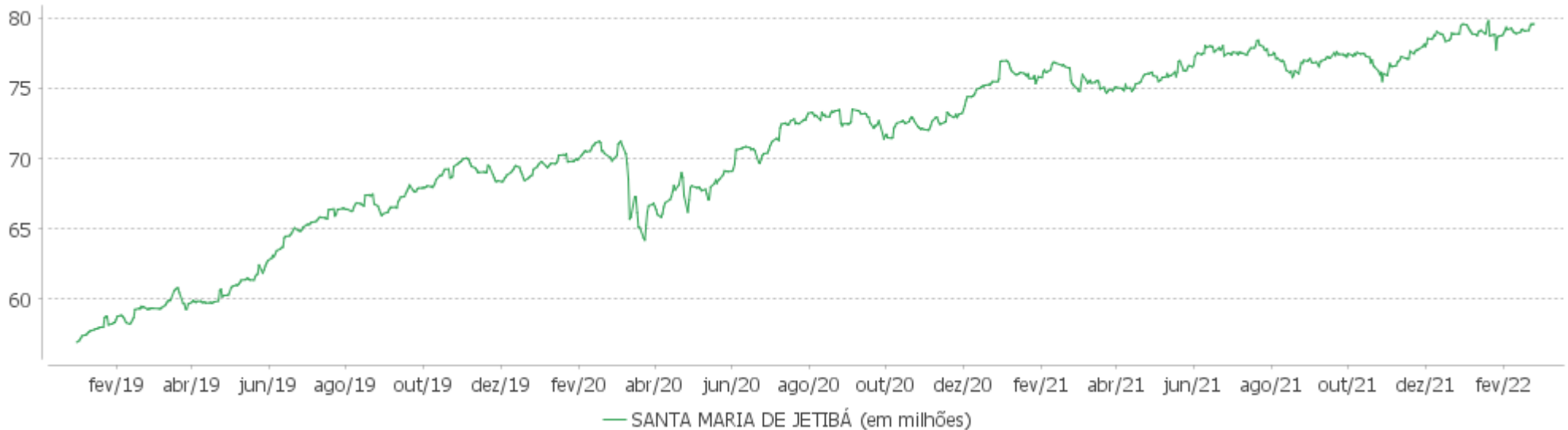
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	12	31,58	03 meses	1,08	3,57	-2,49	2,76
Meses abaixo - Meta Atuarial	26	68,42	06 meses	1,37	8,47	-7,10	3,75
			12 meses	1,37	16,47	-15,10	3,97
			24 meses	2,11	29,54	-27,43	6,36
Maior rentabilidade da Carteira	3,72	2020-12	36 meses	17,78	42,75	-24,97	5,47
Menor rentabilidade da Carteira	-5,52	2020-03	Desde 31/12/2018	21,86	45,22	-23,37	5,36

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

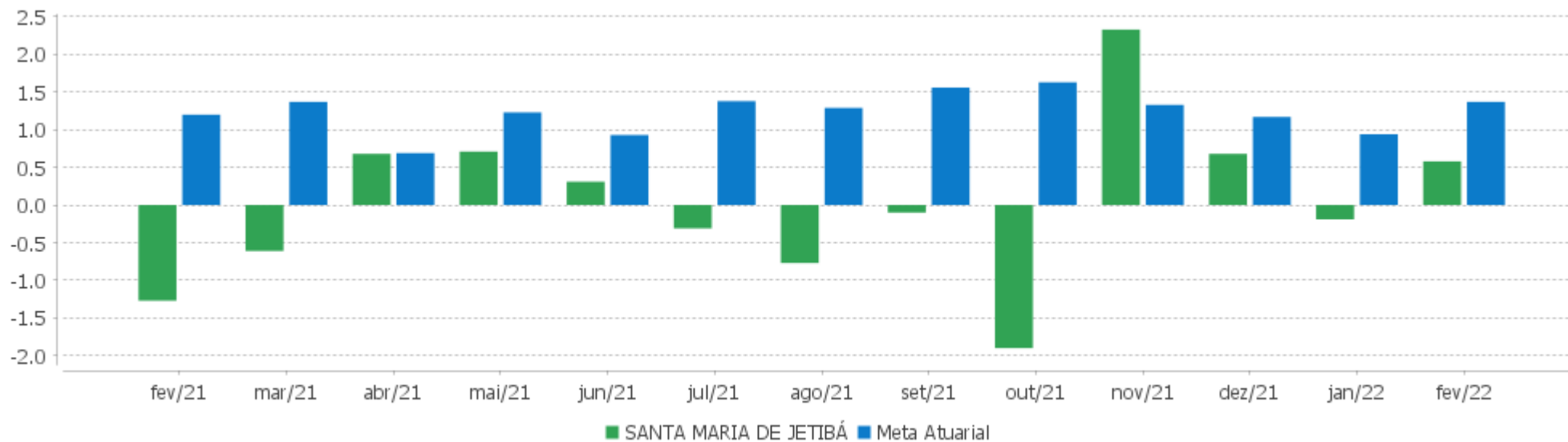


Patrimônio Líquido



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
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,82 109,58	1,53 102,66	2,27 100,36	3,95 103,80	6,27 111,08	5,81 71,24	11,44 80,63
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,42 -0,12	-0,24 -0,04	0,19 0,16	0,25 -0,48	-0,68 -1,60	-7,63 -11,75	12,95 -9,91
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF % do CDI	0,79 105,80	1,35 91,02	2,07 91,43	3,24 85,14	3,99 70,65	2,92 35,85	19,55 137,78
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,48 -0,06	-0,28 -0,09	-0,06 -0,09	0,55 -0,18	0,66 -0,26	3,48 -0,64	21,62 -1,24
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,68 90,41	1,33 89,71	2,01 88,96	3,29 86,49	4,51 79,90	5,83 71,53	10,54 74,29
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,71 -0,03	1,38 -0,00	2,18 -0,08	3,26 0,33	3,94 -0,32	8,13 0,66	19,46 4,98
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,53 -0,02	-0,23 -0,04	-0,03 -0,06	0,61 -0,12	0,65 -0,27	3,48 -0,63	21,73 -1,13
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,41 -0,14	-0,54 -0,35	-0,47 -0,50	-1,33 -2,06	-2,91 -3,84	-8,26 -12,38	13,17 -9,69
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,62	0,65	1,57	1,65	1,74	4,37	16,33
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,05 -0,01	1,13 -0,04	1,90 -0,07	4,10 -0,17	6,00 -0,32	12,29 -0,65	25,72 -0,96
BB PREV RF IRF M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,57 -0,02	0,44 -0,06	2,32 -0,07	1,00 -0,16	0,13 -0,35	2,89 -0,62	14,85 -0,94
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,88 117,01	1,68 112,83	2,47 109,10	4,06 106,57	5,80 102,66	7,96 97,65	13,98 98,51
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,63 84,60	1,25 83,78	1,88 83,24	3,10 81,29	4,41 78,14	6,00 73,57	10,98 77,34
SCHRODER BEST IDEAS FIA Var. IBOVESPA p.p.	1,93 1,04	14,51 6,57	14,15 3,13	-0,90 3,85	1,11 -1,71	10,34 1,73	34,60 16,23
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	1,00 0,11	7,97 0,03	11,64 0,62	0,33 5,08	8,12 5,30		
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-1,47 -2,36	1,13 -6,81	3,47 -7,55	-11,11 -6,36	-7,61 -10,43	-11,59 -20,20	28,08 9,71
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	-2,05	-1,84					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-2,94	-5,55					
ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	0,32 -0,57	4,93 -3,00	5,70 -5,31	-2,63 2,12	-1,17 -3,99	3,91 -4,70	
SANTA MARIA DE JETIBÁ Var. IPCA + 4,89% p.p.	0,58 -0,79	0,40 -1,93	1,08 -2,44	1,37 -6,92	1,37 -14,61	2,11 -25,78	17,78 -21,71
CDI	0,75	1,49	2,26	3,81	5,65	8,15	14,19
IBOVESPA	0,89	7,94	11,02	-4,75	2,82	8,61	18,37
INPC + 6,00%	1,44	2,62	3,92	8,81	17,47	32,17	45,56
IPCA + 6,00%	1,45	2,50	3,80	8,85	17,20	30,60	43,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	D+0	D+0			-	
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	D+1 du	D+0	D+27	D+29	-	2,00
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	D+0	D+0	D+1 du	D+2 du		0,50
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,15
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,80
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IRF M	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,80
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	D+1 du	D+0	D+30	D+32		2,00
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO						
SCHRODER BEST IDEAS FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 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	0,74	1,38	2,27	2,93	4,26	7,47	14,48	22,35	34,40
IRF-M 1+	0,48	-0,02	2,26	0,18	-1,69	1,08	15,45	28,42	46,68
IRF-M TOTAL	0,58	0,50	2,40	1,16	0,48	3,51	15,79	27,30	43,94
IMA-B 5	1,06	1,18	1,97	4,26	6,32	12,94	26,68	39,47	55,81
IMA-B 5+	0,01	-1,60	-1,93	-2,75	-4,23	-3,33	17,98	38,31	53,22
IMA-B TOTAL	0,54	-0,19	0,03	0,73	0,92	4,12	22,86	40,19	55,41
IMA-GERAL TOTAL	0,74	0,95	1,83	2,30	2,88	6,29	18,28	30,05	44,43
IDKA 2	1,26	1,31	2,15	4,31	6,70	14,12	26,89	39,82	57,21
IDKA 20	-0,58	-3,49	-5,69	-9,10	-12,75	-14,41	8,86	34,44	45,63
CDI	0,75	1,49	2,26	3,81	5,65	8,15	14,19	21,51	32,41

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,89	7,94	11,02	-4,75	2,82	8,61	18,37	32,56	69,72
IBRX 100	1,46	8,43	11,83	-4,71	2,87	9,99	22,25	38,00	76,75
IBRX 50	1,74	9,53	13,65	-3,21	4,78	13,29	20,78	33,87	72,89
SMALL CAP	-5,19	-1,95	1,77	-18,60	-13,32	-11,41	20,21	34,33	77,03
IFIX	-1,29	-2,27	6,31	-0,32	-5,04	-7,51	12,59	18,59	35,11
Índice Consumo - ICON	-2,51		-0,33	-21,72	-21,21	-20,40	7,27	6,67	33,15
Índice Dividendos - IDIV	-2,32	4,98	6,66	-1,56	9,19	5,34	28,12	49,91	76,56

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	1,01	1,56	2,30	5,77	10,54	16,29	20,94	25,65	29,22
INPC	1,00	1,68	2,42	5,73	10,80	17,68	22,30	27,12	29,42
IGPM	1,83	3,68	4,59	4,61	16,12	49,73	59,94	72,10	71,38
SELIC	0,75	1,49	2,26	3,81	5,65	8,15	14,19	21,52	32,43

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	-6,85	-15,28	-12,20	-3,13	6,92	69,56	116,47	155,90	207,13
MSCI ACWI	-6,59	-14,77	-12,07	-5,84	-1,21	55,63	90,73	113,55	160,11

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	2,19	3,30	7,83	14,98	25,74	35,98	46,92	57,07
IPCA + 5,00%	1,38	2,35	3,55	8,34	16,09	28,16	39,93	52,64	64,73
IPCA + 5,50%	1,42	2,42	3,68	8,60	16,65	29,37	41,93	55,56	68,67
IPCA + 5,89%	1,45	2,48	3,77	8,79	17,08	30,33	43,50	57,86	71,80
IPCA + 6,00%	1,45	2,50	3,80	8,85	17,20	30,60	43,95	58,52	72,69
INPC + 4,00%	1,30	2,31	3,43	7,79	15,25	27,25	37,51	48,64	57,31
INPC + 6,00%	1,44	2,62	3,92	8,81	17,47	32,17	45,56	60,37	72,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
189	01/02/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	181,09	92,58771400	1,9558750000
190	02/02/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	435,45	222,57251100	1,9564410000
191	04/02/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	613,95	313,61228400	1,9576720000
196	08/02/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	314,49	0,00	142,82031000	2,2019977380
192	21/02/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	853,46	434,32658200	1,9650190000
197	22/02/2022	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	389.173,52	0,00	297.610,74240905	1,3076595200
193	24/02/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	24.776,42	12.595,94839600	1,9670150000
194	25/02/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	5.865,98	2.981,12318600	1,9677080000
195	25/02/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	49,00	24,90184400	1,9677080000
Total			389.488,01	32.775,35		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.151.744,39

Value-At-Risk: 1,45%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTA MARIA DE JETIBÁ		1,45	1,45			79.570.545,91	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,46%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF M		1,77	0,22	0,02			11.057.038,88	13,90
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,06	0,00	0,03			4.900.332,54	6,16
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B		2,40	0,21	0,35			6.943.547,26	8,73
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,15	0,28	0,03			10.651.554,94	13,39
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,04	0,00	0,00			185.043,58	0,23
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,16	0,10	0,03			7.716.205,11	9,70
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1		0,22	0,00	0,37			1.129.841,80	1,42
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,12	0,10	2,02			7.584.579,51	9,53
Sub-total	2,43	1,46	0,92		-0,04	0,65	50.168.143,62	63,05

Artigo 7º III, 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		0,07	0,00	0,06			1.261.262,44	1,59
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP		2,19	0,31	0,08			11.289.067,03	14,19
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF		2,16	0,18	0,24			6.804.365,51	8,55
BB PREV RF FLUXO FIC		0,04	0,00	0,00			3.588.127,26	4,51
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF		0,30	0,02	0,29			4.840.937,41	6,08
Sub-total	2,53	1,47	0,51		-0,08	0,56	27.783.759,65	34,92

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 2,02%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO		6,48	0,00	5,02			100.075,50	0,13
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO		1,98	-0,00	9,83			980.215,98	1,23
Sub-total	6,44	2,02	-0,00		-0,40	-1,83	1.080.291,48	1,36

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,33%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		8,83	0,01	5,78			163.118,86	0,20
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA		10,19	0,01	2,40			259.461,16	0,33
SCHRODER BEST IDEAS FIA		10,17	0,00	2,39			115.771,14	0,15
Sub-total	11,15	9,33	0,02		-0,03	0,43	538.351,16	0,68