



LDB
EMPRESAS

SANTA MARIA DE JETIBÁ
MARÇO 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 31.03.2022.

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 97,95%

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	0,84	1,29	11.150.398,33	13,67	4.149.479.304,06	0,27
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,19	0,88	2,57	4.943.504,16	6,06	15.773.057.881,61	0,03
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	6,97	2,88	2,33	7.143.741,00	8,76	187.437.571,64	3,81
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,54	3,06	2,82	10.977.825,70	13,45	4.323.772.543,08	0,25
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,15	0,79	2,04	135.816,22	0,17	862.837.732,74	0,02
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,71	2,58	3,74	7.915.182,28	9,70	6.475.752.452,47	0,12
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	0,65	0,88	2,27	1.139.784,19	1,40	286.843.761,65	0,40
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,65	1,34	2,01	7.686.393,69	9,42	6.199.415.029,16	0,12
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,84	1,94	2,40	51.092.645,57	62,62		

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	0,22	0,90	2,44	1.272.592,59	1,56	296.428.751,03	0,43
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	5,58	3,06	2,77	11.635.029,56	14,26	2.362.599.114,39	0,49
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	6,46	3,02	2,77	7.009.541,30	8,59	218.519.076,67	3,21
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,17	0,83	2,18	3.618.359,03	4,43	3.423.570.144,27	0,11
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	1,75	1,12	2,49	5.287.980,51	6,48	132.521.948,96	3,99
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			5,30	2,31	2,58	28.823.502,99	35,33		
Renda Fixa			3,79	2,08	2,47	79.916.148,56	97,95		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

0,69%

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	16,53	5,09	6,27	171.420,51	0,21	1.463.287.787,94	0,01
ARX	BEM	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	18,09	5,18	13,56	272.893,95	0,33	323.084.432,34	0,08
SCHRODER	BEM	SCHRODER BEST IDEAS FIA	19,10	5,40	20,70	122.026,35	0,15	64.750.329,11	0,19
Sub-total Artigo 8º I			16,64	5,20	12,66	566.340,81	0,69		
Renda Variável			17,19	5,20	12,66	566.340,81	0,69		

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	4,44	9,59	104.514,96	0,13	55.434.798,87	0,19
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	6,23	2,57	0,54	1.005.386,92	1,23	126.896.675,26	0,79
Sub-total Artigo 10º I			9,98	2,74	4,70	1.109.901,88	1,36		
Investimentos Estruturados			9,98	2,74	4,70	1.109.901,88	1,36		
Total			3,81	2,11	2,51	81.592.391,25	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	51.092.645,57	62,62	0,00	60,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	28.823.502,99	35,33	0,00	30,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	79.916.148,56	97,95					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	566.340,81	0,69	0,00	5,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	566.340,81	0,69					30,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	1.109.901,88	1,36	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	1.109.901,88	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	1,94 210,55	2,40 99,05	2,40 99,05	3,44 79,73	3,80 59,24	975.048,18	1.195.523,74
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	2,31 250,45	2,58 106,50	2,58 106,50	3,59 83,33	4,06 63,36	648.947,66	722.078,35
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	5,20 -0,86	12,66 -1,82	12,66 -1,82			27.989,65	63.629,85
Artigo 10º I % do CDI	2,74 296,82	4,70 194,02	4,70 194,02			29.610,40	14.530,27
SANTA MARIA DE JETIBÁ (Total)						1.681.595,89	1.995.762,21

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	6.943.547,26	0,00	0,00	0,00	7.143.741,00	200.193,74	157.242,45
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	1.129.841,80	0,00	0,00	0,00	1.139.784,19	9.942,39	30.528,44
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	7.584.579,51	0,00	0,00	0,00	7.686.393,69	101.814,18	151.112,57
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	7.716.205,11	0,00	0,00	0,00	7.915.182,28	198.977,17	285.345,71
BB PREV RF IRF M	11.057.038,88	0,00	0,00	0,00	11.150.398,33	93.359,45	141.786,38
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	185.043,58	0,00	-50.546,23	0,00	135.816,22	1.318,87	4.182,66
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	10.651.554,94	0,00	0,00	0,00	10.977.825,70	326.270,76	301.278,22
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.900.332,54	0,00	0,00	0,00	4.943.504,16	43.171,62	124.047,31
					51.092.645,57	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	4.840.937,41	390.449,24	0,00	0,00	5.287.980,51	56.593,86	115.594,07
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	6.804.365,51	0,00	0,00	0,00	7.009.541,30	205.175,79	185.286,06
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	1.261.262,44	0,00	0,00	0,00	1.272.592,59	11.330,15	30.298,01

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	3.588.127,26	346,44	0,00	0,00	3.618.359,03	29.885,33	77.113,91
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	11.289.067,03	0,00	0,00	0,00	11.635.029,56	345.962,53	313.786,30
					28.823.502,99	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	259.461,16	0,00	0,00	0,00	272.893,95	13.432,79	32.586,78
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	163.118,86	0,00	0,00	0,00	171.420,51	8.301,65	10.119,46
SCHRODER BEST IDEAS FIA	115.771,14	0,00	0,00	0,00	122.026,35	6.255,21	20.923,61
					566.340,81	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	100.075,50	0,00	0,00	0,00	104.514,96	4.439,46	9.143,35
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	980.215,98	0,00	0,00	0,00	1.005.386,92	25.170,94	5.386,92
					1.109.901,88	0,00	0,00

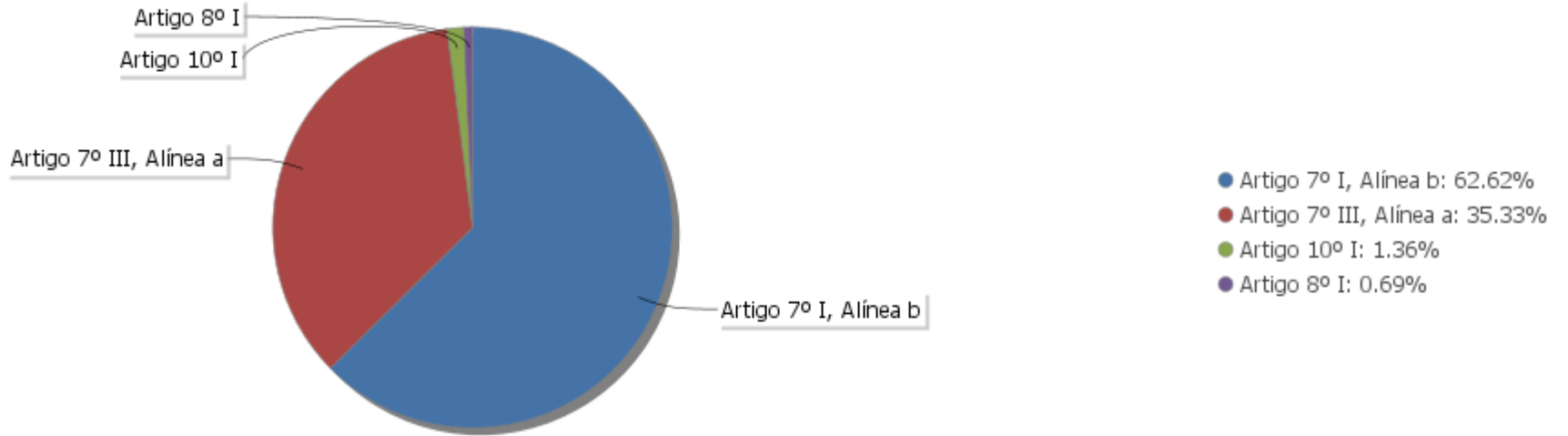
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

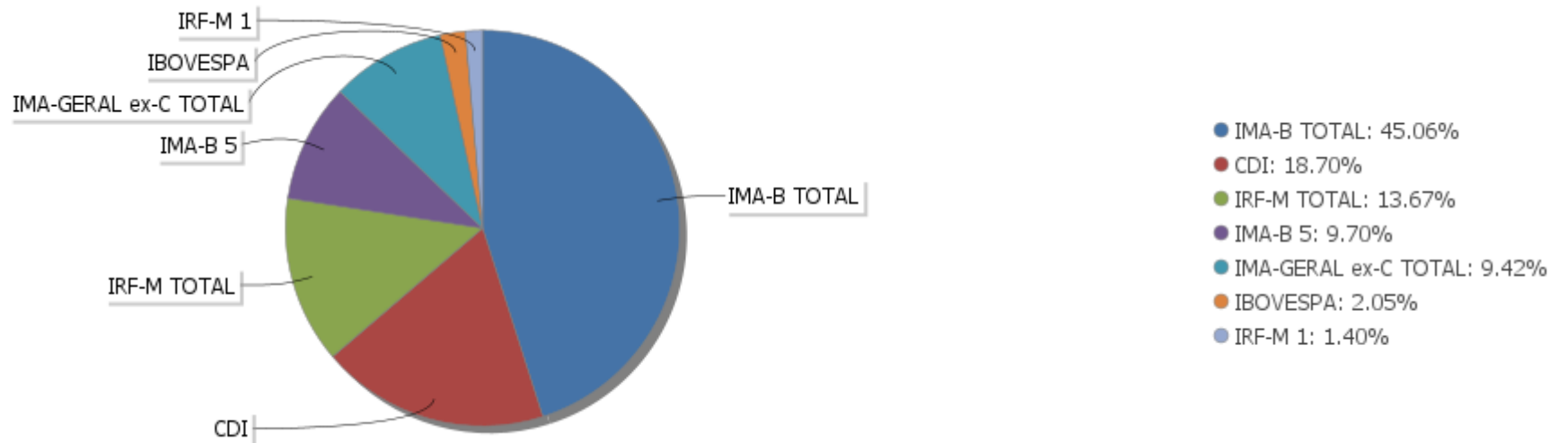
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	81.487.876,29	99,87	81.487.876,29	99,87
de 31 a 365 dias	104.514,96	0,13	81.592.391,25	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	81.592.391,25	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

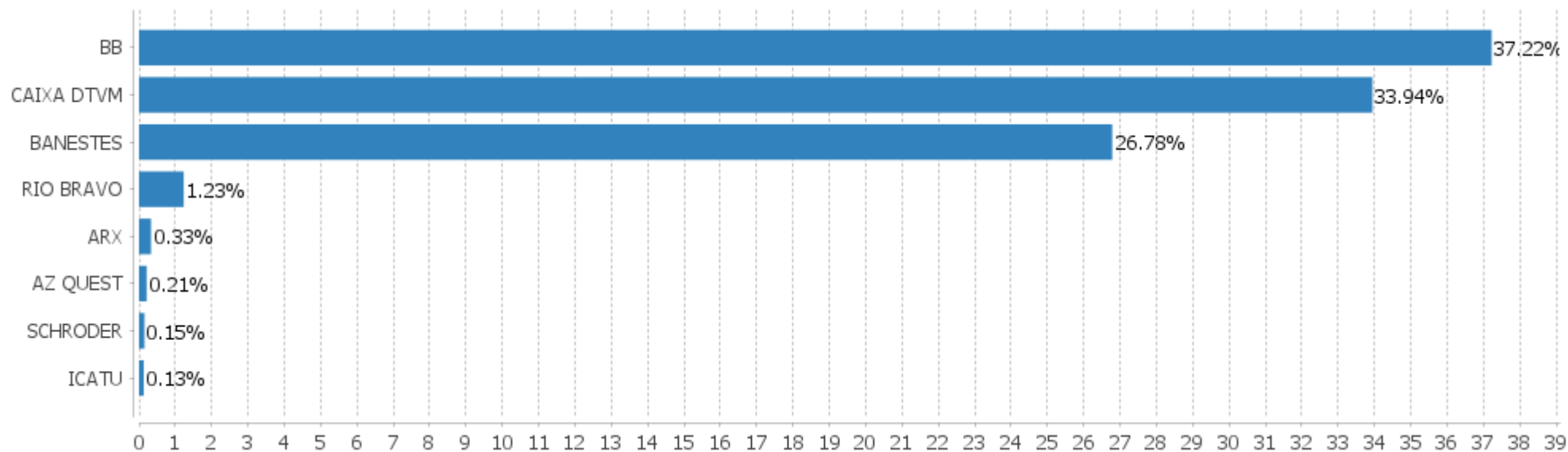


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

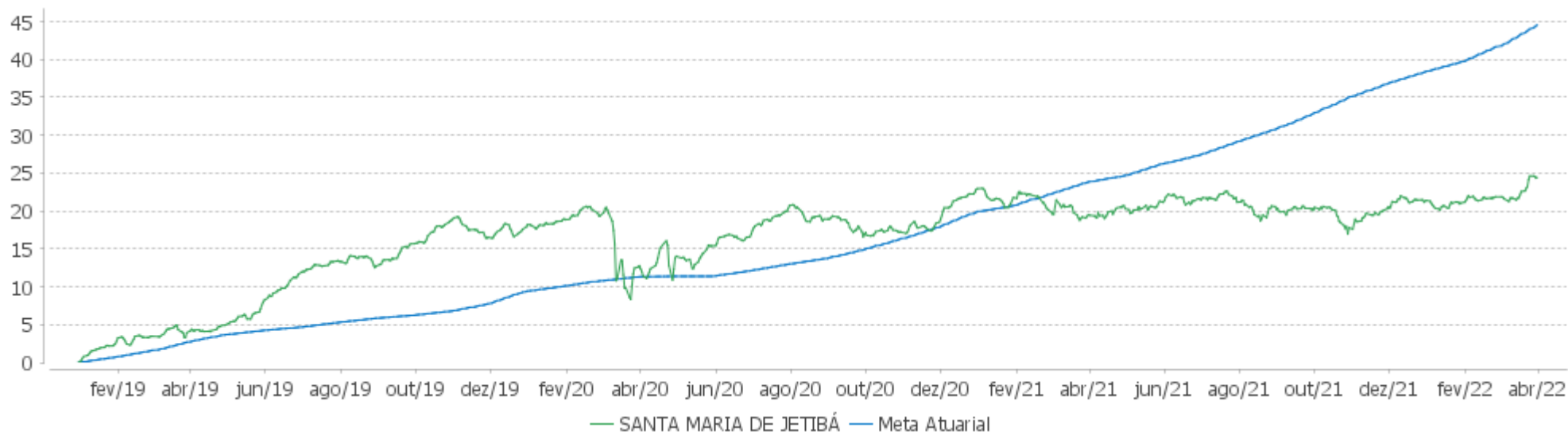
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2022	-0,19	0,58	2,11										2,51
IPCA + 4,89%	0,94	1,37	2,04										4,42
p.p. indexador	-1,13	-0,79	0,06										-1,91
2021	-0,96	-1,27	-0,61	0,68	0,71	0,31	-0,31	-0,77	-0,10	-1,90	2,33	0,68	-1,27
IPCA + 5,42%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	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	13	33,33	03 meses	2,51	4,42	-1,91	3,10
Meses abaixo - Meta Atuarial	26	66,67	06 meses	3,61	8,94	-5,32	3,88
			12 meses	4,13	17,19	-13,05	3,81
			24 meses	10,34	31,44	-21,09	4,60
Maior rentabilidade da Carteira	3,72	2020-12	36 meses	19,73	43,95	-24,22	5,45
Menor rentabilidade da Carteira	-5,52	2020-03	Desde 31/12/2018	24,42	48,19	-23,77	5,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

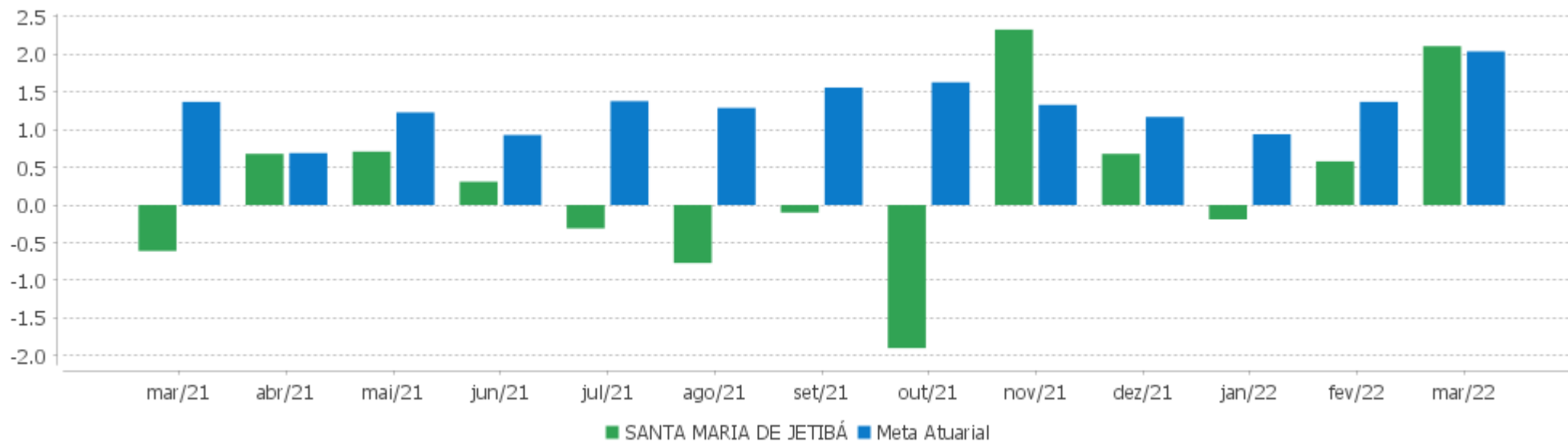


Patrimônio Líquido



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
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,06 -0,01	2,82 -0,05	2,82 -0,05	3,85 -0,11	4,23 -0,27	14,81 -0,55	24,76 -1,14
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,88 -0,19	2,33 -0,54	2,33 -0,54	2,41 -1,56	1,44 -3,07	8,64 -6,72	16,12 -9,78
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,88 -0,01	2,27 -0,01	2,27 -0,01	3,83 0,40	5,12 -0,02	7,87 0,10	19,90 4,95
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	1,34	2,01	2,01	3,02	3,54	8,04	17,28
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	2,58 -0,03	3,74 -0,07	3,74 -0,07	5,75 -0,17	8,38 -0,33	17,29 -0,67	27,99 -0,98
BB PREV RF IRF M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,84 -0,00	1,29 -0,06	1,29 -0,06	2,23 -0,11	1,84 -0,35	3,87 -0,62	15,16 -0,92
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,88 95,40	2,57 106,16	2,57 106,16	4,53 104,99	6,56 102,37	8,53 97,12	14,46 98,34
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,79 85,11	2,04 84,22	2,04 84,22	3,56 82,59	5,11 79,61	6,55 74,58	11,40 77,49
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,02 -0,06	2,77 -0,10	2,77 -0,10	3,89 -0,07	4,28 -0,23	10,92 -4,43	16,21 -9,69
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,90 97,28	2,44 100,59	2,44 100,59	4,31 99,95	6,62 103,23	8,21 93,54	11,90 80,88
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF % do CDI	1,12 121,40	2,49 102,71	2,49 102,71	4,27 98,96	5,67 88,49	5,92 67,45	19,69 133,85
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,06 -0,01	2,77 -0,10	2,77 -0,10	3,78 -0,18	4,26 -0,25	14,68 -0,68	24,65 -1,25
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,83 90,19	2,18 89,84	2,18 89,84	3,79 88,01	5,27 82,24	6,45 73,43	11,03 75,02
SCHRODER BEST IDEAS FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,40 -0,66	20,70 6,22	20,70 6,22	12,67 4,54	2,46 -0,42	76,44 12,11	43,88 18,11
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,18 -0,88	13,56 -0,92	13,56 -0,92	9,47 1,34	5,55 2,66		
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,09 -0,97	6,27 -8,20	6,27 -8,20	-2,50 -10,63	-3,61 -6,50	49,24 -15,09	36,90 11,14
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	2,57	0,68					

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.	-3,49	-9,31					
ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	4,44	9,59	9,59	4,82	2,56	40,17	
Var. IBOVESPA p.p.	-1,62	-4,89	-4,89	-3,31	-0,32	-24,17	
SANTA MARIA DE JETIBÁ	2,11	2,51	2,51	3,61	4,13	10,34	19,73
Var. IPCA + 4,89% p.p.	0,06	-1,91	-1,91	-5,19	-12,61	-19,53	-21,05
CDI	0,92	2,42	2,42	4,31	6,41	8,78	14,71
IBOVESPA	6,06	14,48	14,48	8,13	2,89	64,34	25,77
INPC + 6,00%	2,23	4,91	4,91	9,38	18,43	34,19	47,02
IPCA + 6,00%	2,14	4,69	4,69	9,37	17,98	32,62	45,29

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	0,89	2,28	2,28	3,43	5,14	7,77	14,95	22,64	34,09
IRF-M 1+	0,81	0,79	0,79	1,73	0,56	2,39	15,66	27,47	45,50
IRF-M TOTAL	0,84	1,35	1,35	2,35	2,19	4,49	16,08	26,70	43,00
IMA-B 5	2,61	3,81	3,81	5,92	8,72	17,96	28,97	40,83	57,68
IMA-B 5+	3,56	1,91	1,91	1,99	0,35	12,40	21,66	42,68	57,29
IMA-B TOTAL	3,07	2,87	2,87	3,96	4,50	15,36	25,90	43,16	58,53
IMA-GERAL TOTAL	1,57	2,54	2,54	3,91	4,91	10,14	19,47	30,83	44,94
IDKA 2	2,54	3,88	3,88	5,80	9,10	18,45	29,25	41,12	58,63
IDKA 20	4,00	0,37	0,37	-2,51	-7,51	6,54	12,87	41,87	51,51
CDI	0,92	2,42	2,42	4,31	6,41	8,78	14,71	21,98	32,24

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,06	14,48	14,48	8,13	2,89	64,34	25,77	40,57	84,66
IBRX 100	5,96	14,89	14,89	8,55	2,79	66,70	29,68	46,11	91,79
IBRX 50	5,43	15,47	15,47	10,28	4,13	71,54	27,56	41,05	86,31
SMALL CAP	8,81	6,69	6,69	-5,35	-9,80	48,46	30,68	46,05	95,46
IFIX	1,42	-0,88	-0,88	2,37	-2,35	11,46	11,96	17,92	36,76
Índice Consumo - ICON	5,74			-11,99	-18,58	22,89	14,32	13,52	40,45
Índice Dividendos - IDIV	10,00	15,48	15,48	13,37	11,66	55,59	43,49	63,17	97,87

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	1,62	3,20	3,20	6,25	11,30	18,09	21,99	27,57	30,99
INPC	1,71	3,42	3,42	6,26	11,73	19,48	23,44	29,20	31,22
IGPM	1,74	5,49	5,49	7,11	14,77	50,46	60,70	73,99	74,34
SELIC	0,92	2,42	2,42	4,31	6,41	8,78	14,71	21,99	32,26

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	-4,75	-19,30	-19,30	-8,39	-5,17	59,75	94,34	144,53	186,72
MSCI ACWI	-6,10	-19,97	-19,97	-12,65	-12,11	46,60	70,12	100,67	137,04

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,97	4,20	4,20	8,34	15,75	27,68	37,22	49,19	59,20
IPCA + 5,00%	2,05	4,45	4,45	8,86	16,86	30,14	41,22	55,00	66,95
IPCA + 5,50%	2,10	4,57	4,57	9,11	17,42	31,38	43,24	57,97	70,94
IPCA + 5,89%	2,13	4,66	4,66	9,31	17,85	32,35	44,84	60,31	74,11
IPCA + 6,00%	2,14	4,69	4,69	9,37	17,98	32,62	45,29	60,98	75,01
INPC + 4,00%	2,06	4,42	4,42	8,35	16,20	29,19	38,85	51,10	59,47
INPC + 6,00%	2,23	4,91	4,91	9,38	18,43	34,19	47,02	63,04	75,31

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
200	02/03/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	224,84	114,22602300	1,9683780000
201	04/03/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	9.123,61	4.631,94183000	1,9697160000
202	07/03/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	2.209,80	1.121,50668900	1,9703850000
199	08/03/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	346,44	0,00	156,30138100	2,2164871330
203	10/03/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	2.634,72	1.335,79736700	1,9723950000
204	16/03/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	660,45	334,39100400	1,9750830000
198	18/03/2022	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	390.449,24	0,00	296.589,58834295	1,3164630700
205	21/03/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	5.355,45	2.708,54963500	1,9772390000
206	25/03/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	49,00	24,74429400	1,9802000000
207	28/03/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	18.169,92	9.172,36791000	1,9809410000
208	29/03/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.564,85	789,65705600	1,9816830000
209	30/03/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	6.049,80	3.051,71076200	1,9824290000
210	31/03/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	4.503,79	2.271,00094200	1,9831740000
Total			390.795,68	50.546,23		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.082.189,38

Value-At-Risk: 1,33%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTA MARIA DE JETIBÁ		1,33	1,33			81.592.391,25	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,31%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF M		1,59	0,19	0,02			11.150.398,33	13,67
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,05	-0,00	0,03			4.943.504,16	6,06
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B		2,17	0,19	0,31			7.143.741,00	8,76
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,96	0,26	0,01			10.977.825,70	13,45
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,03	-0,00	0,00			135.816,22	0,17
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,08	0,09	0,03			7.915.182,28	9,70
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1		0,18	0,00	0,16			1.139.784,19	1,40
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		0,96	0,09	2,46			7.686.393,69	9,42
Sub-total	3,56	1,31	0,82		0,29	1,94	51.092.645,57	62,62

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		0,06	0,00	0,05			1.272.592,59	1,56
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP		2,00	0,28	0,06			11.635.029,56	14,26
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF		2,00	0,17	0,25			7.009.541,30	8,59
BB PREV RF FLUXO FIC		0,03	-0,00	0,00			3.618.359,03	4,43
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF		0,26	0,02	0,26			5.287.980,51	6,48
Sub-total	3,84	1,34	0,47		0,36	2,31	28.823.502,99	35,33

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 2,99%

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		5,97	0,00	4,40			104.514,96	0,13
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO		2,88	0,01	7,32			1.005.386,92	1,23
Sub-total	6,88	2,99	0,02		0,26	2,74	1.109.901,88	1,36

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,61%

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		9,20	0,01	4,95			171.420,51	0,21
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA		9,11	0,01	2,21			272.893,95	0,33
SCHRODER BEST IDEAS FIA		8,36	0,00	2,53			122.026,35	0,15
Sub-total	19,63	8,61	0,03		0,22	5,20	566.340,81	0,69