



**LDB**  
EMPRESAS

**SANTA MARIA DE JETIBÁ**  
FEVEREIRO 2023



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 28.02.2023.

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

97,15%

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				
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	2,46	-0,09	0,98	1,63	8.315.060,77	9,19	6.344.349.295,74	0,13
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI	6,82	-0,24	1,30	1,59	10.236.282,96	11,31	603.290.137,21	1,70
BB	BB	BB PREV RF IRF M	3,75	-0,07	0,82	1,65	1.394.841,45	1,54	3.867.541.368,40	0,04
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,08	0,05	0,93	2,06	4.876.714,08	5,39	18.186.776.756,57	0,03
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	5,67	-0,29	1,29	1,23	3.928.325,17	4,34	160.757.681,48	2,44
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,64	-0,28	1,26	1,22	10.315.359,54	11,40	3.236.214.383,57	0,32
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,05	0,04	0,79	1,76	1.726.161,16	1,91	1.066.490.987,09	0,16
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,66	0,01	1,40	2,79	8.589.104,74	9,49	5.558.874.332,70	0,15
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	0,34	0,04	0,95	2,13	1.274.353,93	1,41	205.384.713,86	0,62
SAFRA	SAFRA	SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,07	0,05	0,60	0,60	503.019,83	0,56	3.960.124.128,50	0,01
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>3,75</b>	<b>-0,13</b>	<b>1,18</b>	<b>1,74</b>	<b>51.159.223,63</b>	<b>56,52</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	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	5,75	-0,30	1,22	1,13	11.376.541,91	12,57	1.235.830.765,45	0,92
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	5,62	-0,34	0,85	0,20	3.743.077,56	4,13	158.792.518,46	2,36
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,05	0,05	0,85	1,89	4.005.201,04	4,42	3.964.919.513,24	0,10
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,70	0,04	-0,07	0,31	830.650,05	0,92	3.084.127.809,19	0,03
BANESTES	BANESTES	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,70	0,04	-0,12	0,20	6.502.421,65	7,18	278.500.667,87	2,33
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	0,95	0,02	0,01	0,25	10.329.353,11	11,41	157.565.110,90	6,56
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>3,51</b>	<b>-0,11</b>	<b>0,55</b>	<b>0,76</b>	<b>36.787.245,32</b>	<b>40,64</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

3,64

-0,12

0,92

1,35

87.946.468,95

97,15

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

1,10%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	19,82	-1,11	-5,37	-2,86	143.060,58	0,16	876.824.136,01	0,02
ARX	BEM	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	21,12	-0,57	-9,39	-7,34	742.783,50	0,82	239.209.283,56	0,31
SCHRODER	BEM	SCHRODER BEST IDEAS FIA	21,78	-1,42	-9,01	-5,34	108.432,88	0,12	90.855.017,95	0,12
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>20,60</b>	<b>-0,74</b>	<b>-8,79</b>	<b>-6,51</b>	<b>994.276,96</b>	<b>1,10</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>20,60</b>	<b>-0,74</b>	<b>-8,79</b>	<b>-6,51</b>	<b>994.276,96</b>	<b>1,10</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

1,75%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	12,03	0,21	0,17	2,91	568.109,61	0,63	139.075.139,02	0,41
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	6,76	-0,24	-2,40	-0,77	1.014.161,33	1,12	128.004.150,77	0,79
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>7,71</b>	<b>-0,08</b>	<b>-1,49</b>	<b>0,52</b>	<b>1.582.270,94</b>	<b>1,75</b>		
Investimentos Estruturados			7,71	-0,08	-1,49	0,52	1.582.270,94	1,75		
<b>Total</b>			<b>3,77</b>	<b>-0,13</b>	<b>0,75</b>	<b>1,25</b>	<b>90.523.016,85</b>	<b>100,00</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	51.159.223,63	56,52					100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	36.787.245,32	40,64					60,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>87.946.468,95</b>	<b>97,15</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	994.276,96	1,10					30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>994.276,96</b>	<b>1,10</b>					30,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	1.582.270,94	1,75					10,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>1.582.270,94</b>	<b>1,75</b>					15,00
<b>Total</b>		<b>90.523.016,85</b>	<b>100,00</b>					

**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	1,18 128,33	1,74 85,02	2,13 66,74	4,15 64,38	9,29 71,45	598.122,38	903.749,87
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,55 59,72	0,76 36,92	1,01 31,53	3,32 51,48	8,73 67,16	196.508,44	259.384,25
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-8,79 -1,30	-6,51 -2,13	-8,73 -2,02	-9,33 -5,14	-13,71 -6,45	-95.803,91	-69.206,91
Artigo 10º I % do CDI	-1,49 -162,56	0,52 25,38	0,61 19,20	4,28 66,48	6,76 52,04	-23.973,04	8.196,50
<b>SANTA MARIA DE JETIBÁ (Total)</b>						<b>674.853,87</b>	<b>1.102.123,71</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 Financ. Ano (R\$)
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	3.878.186,79	0,00	0,00	0,00	3.928.325,17	50.138,38	67.586,68
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	1.262.413,45	0,00	0,00	0,00	1.274.353,93	11.940,48	26.516,87
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	8.234.629,88	0,00	0,00	0,00	8.315.060,77	80.430,89	133.419,72
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	8.470.610,88	0,00	0,00	0,00	8.589.104,74	118.493,86	233.363,01
BB PREV RF IRF M	1.383.471,03	0,00	0,00	0,00	1.394.841,45	11.370,42	22.579,14
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI	10.392.387,34	0,00	-291.901,42	0,00	10.236.282,96	135.797,04	164.873,92
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	1.570.670,89	216.000,00	-73.875,30	0,00	1.726.161,16	13.365,57	28.887,55
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	10.402.721,60	0,00	-216.000,00	0,00	10.315.359,54	128.637,94	125.219,38
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.831.786,11	0,00	0,00	0,00	4.876.714,08	44.927,97	98.283,77
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,00	500.000,00	0,00	0,00	503.019,83	3.019,83	3.019,83
					51.159.223,63	598.122,38	0,67

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	9.876.244,59	451.676,42	0,00	0,00	10.329.353,11	1.432,10	25.681,43



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	3.711.585,83	0,00	0,00	0,00	3.743.077,56	31.491,73	11.562,89
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	831.206,11	0,00	0,00	0,00	830.650,05	-556,06	2.837,24
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	6.509.926,07	0,00	0,00	0,00	6.502.421,65	-7.504,42	17.663,57
BB PREV RF FLUXO FIC	3.971.067,14	346,44	0,00	0,00	4.005.201,04	33.787,46	74.437,78
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	11.738.684,28	0,00	-500.000,00	0,00	11.376.541,91	137.857,63	127.201,34
					36.787.245,32	196.508,44	0,22

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	819.721,70	0,00	0,00	0,00	742.783,50	-76.938,20	-58.874,38
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	151.183,13	0,00	0,00	0,00	143.060,58	-8.122,55	-4.216,70
SCHRODER BEST IDEAS FIA	119.176,04	0,00	0,00	0,00	108.432,88	-10.743,16	-6.115,83
					994.276,96	-95.803,91	-0,11

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	567.133,30	0,00	0,00	0,00	568.109,61	976,31	16.075,66
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	1.039.110,68	0,00	0,00	0,00	1.014.161,33	-24.949,35	-7.879,16
					1.582.270,94	-23.973,04	-0,03

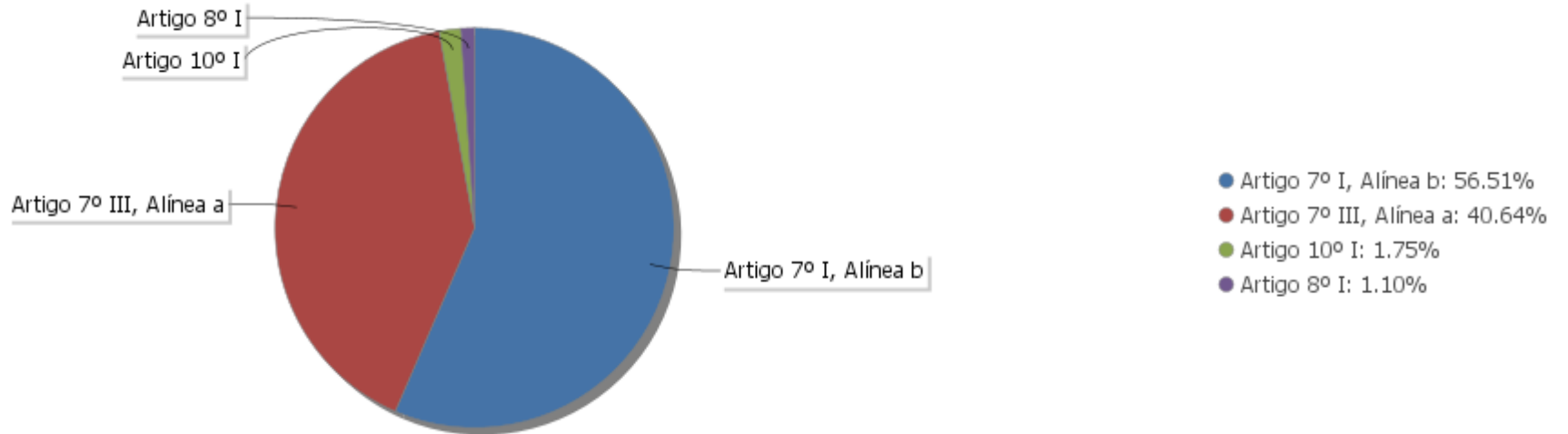
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

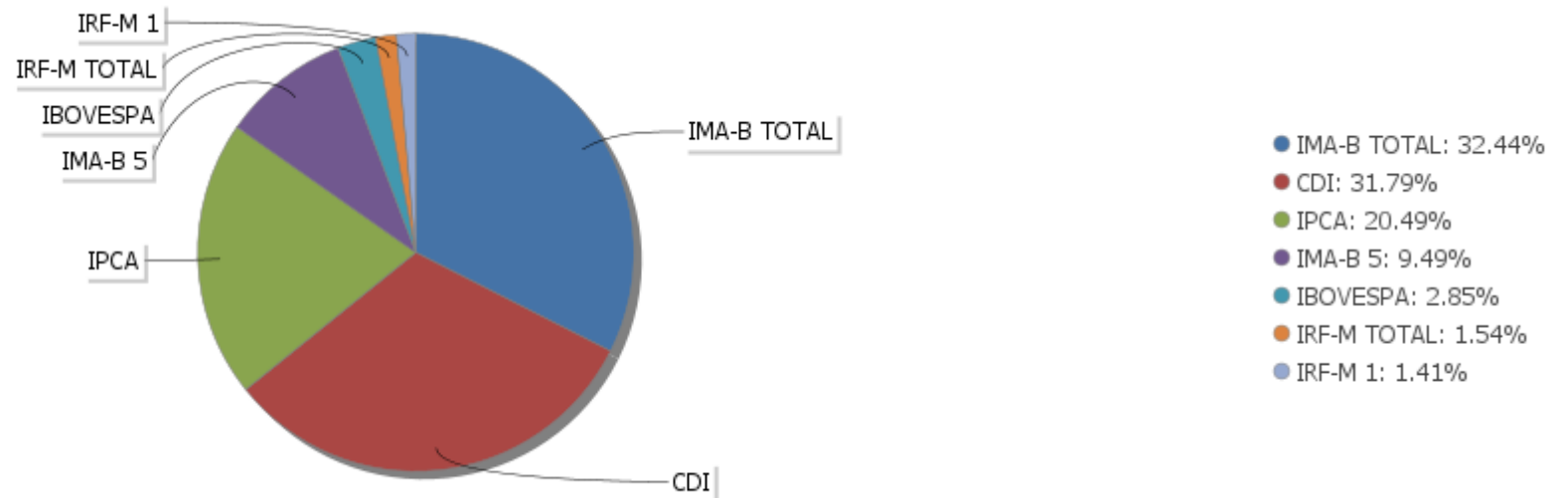
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	79.718.624,28	88,06	79.718.624,28	88,06
de 31 a 365 dias	568.109,61	0,63	80.286.733,89	88,69
acima de 365 dias	10.236.282,96	11,31	90.523.016,85	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

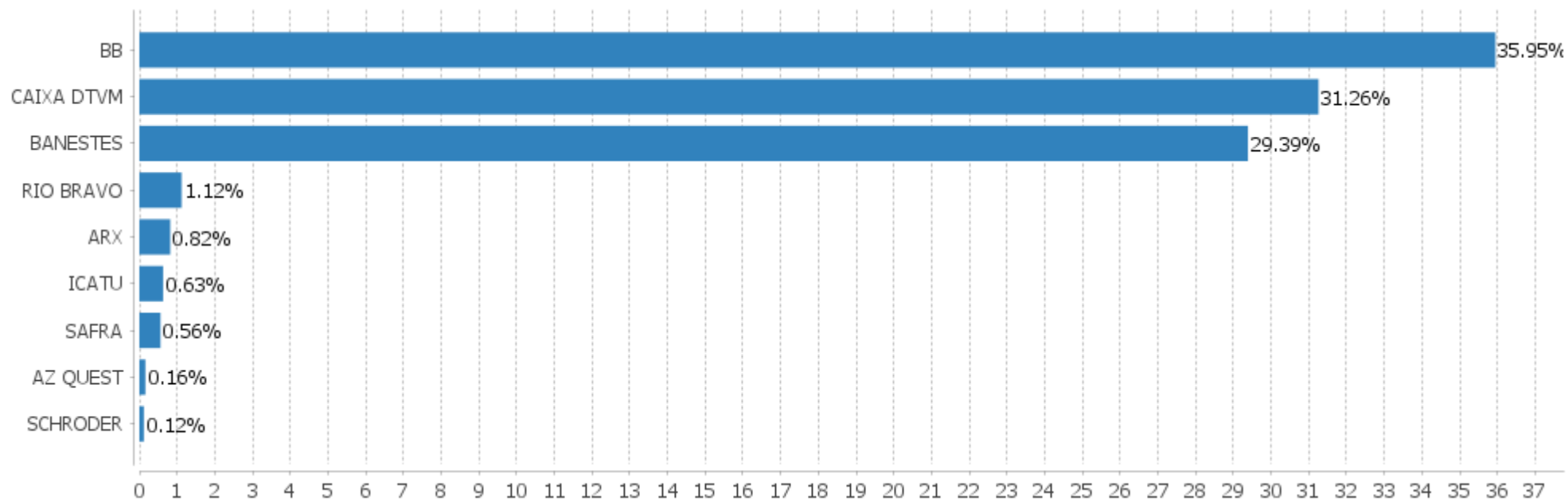


Alocação Por Estratégia



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
2023	0,49	0,75											1,25
IPCA + 4,89%	0,95	1,18											2,15
p.p. indexador	-0,46	-0,43											-0,90
2022	-0,19	0,58	2,11	0,55	0,93	-0,08	0,11	1,21	1,20	1,25	-0,38	0,29	7,83
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	-1,13	-0,79	0,06	-0,88	0,04	-1,15	0,40	1,14	1,09	0,28	-1,17	-0,75	-3,11
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. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	18	36,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	32	64,00

	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,72	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-5,52	2020-03

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,54	3,21	-1,66	3,61
06 meses	3,66	5,15	-1,49	4,08
12 meses	8,74	10,74	-2,00	3,77
24 meses	10,23	28,97	-18,75	3,87
36 meses	11,03	43,45	-32,42	5,63
48 meses	28,07	58,08	-30,00	5,09
Desde 31/12/2018	32,51	60,82	-28,31	5,02

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

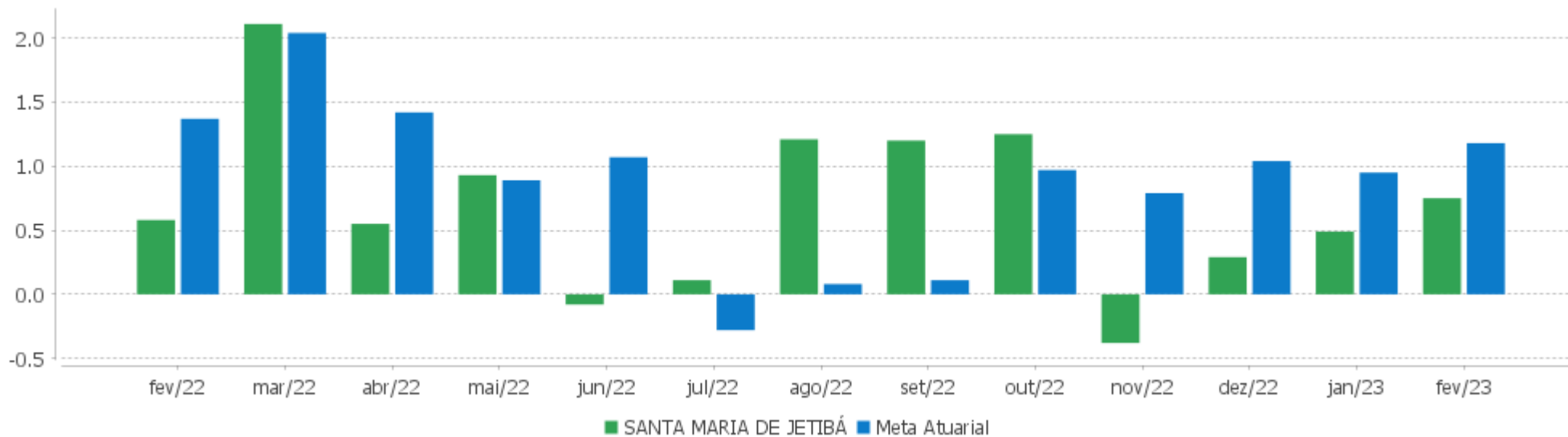


Patrimônio Líquido



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 PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,29 0,01	1,23 -0,05	1,10 0,01	2,94 -0,08	7,54 -0,40	4,40 -4,53	-1,35 -13,73
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,26 -0,02	1,22 -0,06	0,98 -0,10	2,84 -0,18	7,75 -0,19	8,45 -0,48	11,50 -0,88
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,95 -0,04	2,13 0,03	3,33 0,04	6,46 -0,03	12,79 -0,02	17,23 -0,38	21,96 0,72
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,40 -0,01	2,79 -0,03	3,73 -0,06	5,73 -0,15	11,31 -0,26	17,99 -0,63	25,00 -1,01
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,98 0,14	1,63 0,26	2,41 0,41	4,63 1,90	10,13 4,54	13,25 -3,48	
BB PREV RF IRF M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,82 -0,04	1,65 -0,06	3,10 -0,11	4,73 -0,20	9,88 -0,24	10,03 -0,63	13,06 -0,93
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,93 101,27	2,06 100,25	3,17 99,23	6,39 99,12	12,84 98,82	19,39 100,04	21,83 98,28
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI % do CDI	0,90 98,57	2,02 98,67	3,17 99,15	6,40 99,34	12,84 98,82	19,24 99,26	21,71 97,72
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI Var. IPCA p.p.	1,30 0,46	1,59 0,21	1,50 -0,50	2,93 0,20			
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,79 86,00	1,76 85,72	2,74 85,65	5,54 86,00	11,14 85,68	16,04 82,77	17,80 80,16
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,85 -0,43	0,20 -1,08	-0,04 -1,13	1,89 -1,13	6,72 -1,22	5,99 -2,94	-1,43 -13,81
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	-0,12 -12,56	0,20 9,87	1,26 39,27	4,43 68,80	10,73 82,59	17,68 91,24	17,17 77,29
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	-0,07 -7,29	0,31 15,06	1,42 44,43	4,77 74,04	11,47 88,21	18,97 97,89	18,95 85,31
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF % do CDI	0,01 0,63	0,25 12,05	1,15 36,11	4,20 65,11	10,31 79,32	14,71 75,91	13,53 60,94
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,22 -0,06	1,13 -0,15	0,87 -0,22	2,61 -0,41	7,52 -0,42	8,23 -0,70	11,26 -1,12
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,85 92,66	1,89 92,30	2,95 92,15	5,94 92,17	11,87 91,35	16,92 87,32	18,40 82,84
SCHRODER BEST IDEAS FIA	-9,01	-5,34	-7,57	-5,81	-6,34	-5,30	3,35



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.	-1,52	-0,96	-0,85	-1,62	0,92	-0,66	2,62
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-9,39 -1,89	-7,34 -2,97	-9,65 -2,93	-10,00 -5,80	-15,90 -8,64	-9,07 -4,43	
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-5,37 2,12	-2,86 1,51	-4,61 2,10	-8,39 -4,20	-12,30 -5,04	-18,97 -14,33	-22,46 -23,19
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	-2,40 5,09	-0,77 3,61	-0,88 5,83	1,30 5,50	3,39 10,65		
ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	0,17 7,66	2,91 7,29	3,40 10,12	10,06 14,26	14,74 22,00	13,40 18,04	19,23 18,50
SANTA MARIA DE JETIBÁ Var. IPCA + 4,89% p.p.	0,75 -0,43	1,25 -0,90	1,54 -1,66	3,66 -1,49	8,74 -2,00	10,23 -18,20	11,03 -30,59
CDI	0,92	2,05	3,20	6,44	13,00	19,38	22,21
IBOVESPA	-7,49	-4,38	-6,72	-4,19	-7,26	-4,64	0,73
INPC + 6,00%	1,19	2,17	3,40	5,43	11,77	31,30	47,73
IPCA + 6,00%	1,26	2,32	3,48	5,69	11,91	31,16	46,15

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	D+1 du	D+2 du	-	
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 LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	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 RETORNO TOTAL 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
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI	D+0	D+0	D+0	D+0		
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	D+0	D+0	D+1	D+2		1,20
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI			D+0	D+0		0,10
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	0,98	2,09	3,30	6,49	12,81	17,61	21,23	29,14	38,03
IRF-M 1+	0,79	1,51	3,16	4,25	9,06	7,22	10,24	25,91	40,07
IRF-M TOTAL	0,86	1,71	3,21	4,93	10,13	10,66	13,99	27,51	40,19
IMA-B 5	1,41	2,82	3,79	5,87	11,57	18,62	26,01	41,34	55,61
IMA-B 5+	1,17	-0,11	-1,30	0,52	4,86	0,42	1,37	23,71	45,02
IMA-B TOTAL	1,28	1,28	1,08	3,02	7,94	8,94	12,38	32,61	51,33
IMA-GERAL TOTAL	1,03	1,74	2,52	4,81	10,51	13,70	17,46	30,71	43,72
IDKA 2	1,62	3,08	4,36	6,05	11,25	18,71	26,96	41,17	55,55
IDKA 20	0,79	-3,83	-7,02	-4,75	-2,27	-14,73	-16,36	6,39	31,39
CDI	0,92	2,05	3,20	6,44	13,00	19,38	22,21	29,03	37,30

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-7,49	-4,38	-6,72	-4,19	-7,26	-4,64	0,73	9,78	22,94
IBRX 100	-7,59	-4,34	-6,85	-4,76	-8,23	-5,60	0,93	12,19	26,64
IBRX 50	-7,54	-4,41	-6,85	-3,59	-7,74	-3,34	4,52	11,43	23,50
SMALL CAP	-10,52	-7,90	-10,68	-16,48	-20,21	-30,84	-29,32	-4,09	7,17
Índice Consumo - ICON	-9,78		-12,01	-20,80	-30,44	-45,20	-44,63	-25,38	-25,80
Índice Dividendos - IDIV	-7,55	-2,11	-3,69	-0,84	5,04	14,70	10,65	34,58	57,47

**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	-0,54	3,21	-4,28	0,94	-8,25	-1,90	55,57	98,62	134,79

**Investimentos Imobiliários**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-0,45	-2,05	-2,05	-5,64	2,45	-2,71	-5,24	15,36	21,50

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,92	3,71	-1,93	3,17	-8,75	-9,86	42,01	74,04	94,86

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,84	1,37	2,00	2,73	5,60	16,73	22,79	27,71	32,68
INPC	0,77	1,23	1,93	2,47	5,47	16,86	24,12	28,99	34,07
IGPM	-0,06	0,15	0,60	-1,88	1,86	18,28	52,51	62,91	75,30
SELIC	0,92	2,05	3,20	6,44	13,00	19,38	22,21	29,03	37,31

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,12	2,01	2,99	4,71	9,80	26,26	38,06	49,31	61,33
IPCA + 5,00%	1,19	2,16	3,23	5,20	10,85	28,69	42,07	55,11	69,21
IPCA + 5,50%	1,23	2,24	3,36	5,45	11,38	29,92	44,10	58,08	73,26
IPCA + 5,89%	1,25	2,30	3,45	5,64	11,79	30,89	45,70	60,42	76,48
IPCA + 6,00%	1,26	2,32	3,48	5,69	11,91	31,16	46,15	61,08	77,39
INPC + 4,00%	1,05	1,87	2,92	4,45	9,67	26,39	39,56	50,81	63,02
INPC + 6,00%	1,19	2,17	3,40	5,43	11,77	31,30	47,73	62,70	79,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
379	01/02/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	2.238,90	1.031,43268600	2,1706700000
380	02/02/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	313,00	144,13228000	2,1716160000
377	07/02/2023	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	0,00	500.000,00	121.729,16748900	4,1074790000
381	07/02/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	36,86	16,95133600	2,1744590000
376	08/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	346,44	0,00	140,76153400	2,4611837480
390	08/02/2023	SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	500.000,00	0,00	878,40631200	569,2126670000
378	09/02/2023	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	216.000,00	55.793,09224900	3,8714470000
382	09/02/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	216.000,00	0,00	99.248,55974717	2,1763540000
383	13/02/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	7.323,50	3.362,09646800	2,1782540000
375	15/02/2023	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI	0,00	291.901,42	285.578,78760400	1,0221397130
384	16/02/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	7.657,47	3.510,81008400	2,1811120000
389	17/02/2023	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	451.676,42	0,00	313.251,98392984	1,4418948400
385	24/02/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	150,00	68,65198000	2,1849330000
386	27/02/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	23.214,86	10.620,31427300	2,1858920000
387	27/02/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	55,00	25,16066900	2,1858920000
388	28/02/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	32.885,71	15.037,90146123	2,1868550000
<b>Total</b>			<b>1.168.022,86</b>	<b>1.081.776,72</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.613.761,42

Value-At-Risk: 1,78%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTA MARIA DE JETIBÁ		1,78	1,78			90.523.016,85	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,69%

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
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI		1,37	0,12	1,36			8.315.060,77	9,19
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI		3,20	0,36	3,20			10.236.282,96	11,31
BB PREV RF IRF M		1,68	0,02	0,03			1.394.841,45	1,54
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,02	0,00	0,02			4.876.714,08	5,39
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B		2,93	0,13	0,18			3.928.325,17	4,34
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		3,10	0,35	0,03			10.315.359,54	11,40
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,00	-0,00	0,00			1.726.161,16	1,91
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,36	0,12	0,02			8.589.104,74	9,49
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1		0,18	0,00	0,11			1.274.353,93	1,41
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI		0,01	0,00	0,01			503.019,83	0,56
<b>Sub-total</b>	3,46	1,96	1,10		0,08	1,18	51.159.223,63	56,52

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
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP		3,15	0,39	0,09			11.376.541,91	12,57
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF		2,94	0,12	0,34			3.743.077,56	4,13
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	-0,00	0,01			4.005.201,04	4,42
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI		0,26	-0,00	0,26			830.650,05	0,92
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI		0,26	-0,00	0,26			6.502.421,65	7,18
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF		0,40	0,03	0,40			10.329.353,11	11,41

**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
<b>Sub-total</b>	2,39	1,34	0,54		-0,15	0,55	36.787.245,32	40,64

**Investimentos Estruturados**

Value-At-Risk: 3,72%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO		4,26	0,02	7,02			568.109,61	0,63
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO		3,57	0,03	7,07			1.014.161,33	1,12
<b>Sub-total</b>	6,53	3,72	0,05		-0,37	-1,49	1.582.270,94	1,75

**Renda Variável**

Value-At-Risk: 10,52%

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
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		10,89	0,01	6,05			143.060,58	0,16
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA		10,60	0,07	3,15			742.783,50	0,82
SCHRODER BEST IDEAS FIA		11,35	0,01	2,62			108.432,88	0,12
<b>Sub-total</b>	15,46	10,52	0,09		-0,63	-8,79	994.276,96	1,10