



LDB
EMPRESAS

SANTA MARIA DE JETIBÁ
DEZEMBRO 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 29.12.2023.

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

95,76%

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				
BANESTES	BANESTES	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,04	0,03	0,66	6,45	306.710,15	0,29	1.465.080.401,12	0,02
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	1,58	0,04	0,95	14,99	9.407.728,08	8,83	6.297.472.287,75	0,15
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI	4,76	0,10	2,31	15,54	11.973.447,89	11,24	955.783.734,64	1,25
BB	BB	BB PREV RF IRF M	2,64	0,04	1,46	16,06	1.592.691,22	1,50	4.067.997.534,34	0,04
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,08	0,04	0,90	12,98	5.398.664,54	5,07	11.756.324.476,80	0,05
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	4,59	0,09	2,87	16,01	3.473.259,35	3,26	261.090.510,59	1,33
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,45	0,10	2,73	15,86	11.263.388,04	10,58	5.157.397.073,53	0,22
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,97	0,10	1,44	11,93	8.339.431,35	7,83	5.230.672.087,91	0,16
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	0,29	0,04	0,89	13,18	1.412.319,77	1,33	175.972.602,10	0,80
SAFRA	SAFRA	SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,04	0,04	0,88	11,27	556.363,75	0,52	5.390.177.797,31	0,01
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,82	0,08	1,82	14,45	53.724.004,14	50,45		

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				
BANESTES	BANESTES	FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,03	0,04	0,81	7,04	3.719.965,62	3,49	183.063.895,76	2,03
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	4,58	0,09	2,77	15,98	11.046.462,49	10,37	1.298.723.695,54	0,85
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	4,76	0,09	2,94	15,84	4.327.136,14	4,06	174.002.166,72	2,49
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,04	0,04	0,82	11,93	3.354.967,81	3,15	4.049.178.389,19	0,08
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,03	0,04	0,81	11,58	2.138.627,50	2,01	959.626.212,50	0,22
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,71	0,04	0,94	10,88	1.845.156,24	1,73	2.927.068.052,50	0,06
BANESTES	BANESTES	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,99	0,04	0,90	10,92	6.349.673,79	5,96	282.381.059,04	2,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	0,93	0,05	1,29	10,67	12.393.799,57	11,64	145.094.591,49	8,54
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			2,05	0,06	1,66	12,98	45.175.789,16	42,42		

Artigo 7º IV (Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira))

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
SAFRA	SAFRA	LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a. a	1,20	0,00	0,77	6,02	1.060.170,22	1,00		
SAFRA	SAFRA	LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 5,85 % a. a	2,31	0,58	0,58	0,58	2.011.676,44	1,89		
Sub-total Artigo 7º IV			1,28	0,38	0,75	6,00	3.071.846,66	2,88		
Renda Fixa			2,47	0,08	1,72	13,82	101.971.639,96	95,76		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

1,50%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES	18,67	-0,00	9,84	17,73	176.594,83	0,17	376.189.803,29	0,05
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	16,46	-0,01	5,24	15,29	169.797,18	0,16	812.542.946,28	0,02
ARX	BEM	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	17,34	-0,01	5,01	17,17	939.318,04	0,88	179.150.313,67	0,52
GUEPARDO	DAYCOVAL	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	18,84	-0,00	2,67	15,67	173.501,32	0,16	474.190.468,78	0,04
SCHRODER	BEM	SCHRODER BEST IDEAS FIA	16,96	-0,01	6,19	19,86	137.302,89	0,13	141.603.513,57	0,10
Sub-total Artigo 8º I			16,63	-0,01	5,39	16,58	1.596.514,26	1,50		
Renda Variável			16,63	-0,01	5,39	16,58	1.596.514,26	1,50		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

2,74%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	7,43	0,03	4,49	15,69	1.182.359,40	1,11	149.233.568,01	0,79
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	5,51	0,03	3,86	21,42	1.733.586,23	1,63	343.502.317,29	0,50
Sub-total Artigo 10º I			6,03	0,03	4,11	17,16	2.915.945,63	2,74		
Investimentos Estruturados			6,03	0,03	4,11	17,16	2.915.945,63	2,74		
Total			2,58	0,08	1,83	13,98	106.484.099,85	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	53.724.004,14	50,45	0,00	56,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	45.175.789,16	42,42	0,00	32,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	3.071.846,66	2,88	0,00	0,00	20,00	0,00	20,00
	Total Renda Fixa	101.971.639,96	95,76					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	1.596.514,26	1,50	0,00	5,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	1.596.514,26	1,50					30,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	2.915.945,63	2,74	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	2.915.945,63	2,74					15,00
Total		106.484.099,85	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	1,82 202,76	14,45 110,75	3,71 130,84	4,63 75,22	14,45 110,75	965.841,78	7.168.427,55
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,66 185,30	12,98 99,48	3,58 125,98	5,20 84,53	12,98 99,48	720.712,61	4.891.824,44
Artigo 7º IV % do CDI	0,75 83,78	6,00 72,48	2,28 80,39	4,17 67,89		19.787,40	71.846,66
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	5,39 0,01	16,58 -5,70	14,99 -0,12	11,90 -1,74	16,58 -5,70	81.625,75	233.030,39
Artigo 10º I % do CDI	4,11 458,84	17,16 131,50	8,25 290,59	8,54 138,82	17,16 131,50	115.185,50	341.871,19
SANTA MARIA DE JETIBÁ (Total)						1.903.153,04	12.707.000,23

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 INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	139.171,23	1.583.457,92	-1.418.680,54	0,00	306.710,15	2.761,54	21.707,74
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	4.376.351,98	0,00	-1.000.000,00	0,00	3.473.259,35	96.907,37	612.520,86
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	1.399.883,66	0,00	0,00	0,00	1.412.319,77	12.436,11	164.482,71
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	9.319.356,91	0,00	0,00	0,00	9.407.728,08	88.371,17	1.226.087,03
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	9.219.642,44	0,00	-1.000.000,00	0,00	8.339.431,35	119.788,91	983.689,62
BB PREV RF IRF M	1.569.787,71	0,00	0,00	0,00	1.592.691,22	22.903,51	220.428,91
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI	11.702.595,51	0,00	0,00	0,00	11.973.447,89	270.852,38	1.610.408,31
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	10.964.432,92	0,00	0,00	0,00	11.263.388,04	298.955,12	1.573.247,88
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.350.666,81	0,00	0,00	0,00	5.398.664,54	47.997,73	620.234,23
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	551.495,81	0,00	0,00	0,00	556.363,75	4.867,94	56.363,75
	54.593.384,98	1.583.457,92	-3.418.680,54	0,00	53.724.004,14	965.841,78	

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

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	12.235.729,60	0,00	0,00	0,00	12.393.799,57	158.069,97	1.184.571,98
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	4.203.590,64	0,00	0,00	0,00	4.327.136,14	123.545,50	595.621,47
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	909.559,01	925.000,00	0,00	0,00	1.845.156,24	10.597,23	92.343,43
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	6.562.578,76	0,00	-270.000,00	0,00	6.349.673,79	57.095,03	684.915,71
BB PREV RF FLUXO FIC	3.319.813,12	7.866,82	0,00	0,00	3.354.967,81	27.287,87	413.034,91
FI BANESTES INVEST MONEY RF	3.243.387,85	450.057,83	0,00	0,00	3.719.965,62	26.519,94	117.569,68
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	2.031.464,19	212.767,90	-122.663,53	0,00	2.138.627,50	17.058,94	209.133,95
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	10.958.692,26	0,00	-212.767,90	0,00	11.046.462,49	300.538,13	1.673.889,82
	43.464.815,43	1.595.692,55	-605.431,43	0,00	45.175.789,16	720.712,61	

Artigo 7º IV (Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira))

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 5,85 % a.a	0,00	2.000.000,00	0,00	0,00	2.011.676,44	11.676,44	11.676,44
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a	1.052.059,26	0,00	0,00	0,00	1.060.170,22	8.110,96	60.170,22
	1.052.059,26	2.000.000,00	0,00	0,00	3.071.846,66	19.787,40	

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	894.475,83	0,00	0,00	0,00	939.318,04	44.842,21	137.660,16
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	161.344,92	0,00	0,00	0,00	169.797,18	8.452,26	22.519,90
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	168.989,46	0,00	0,00	0,00	173.501,32	4.511,86	23.501,32
SCHRODER BEST IDEAS FIA	129.300,80	0,00	0,00	0,00	137.302,89	8.002,09	22.754,18
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES	160.777,50	0,00	0,00	0,00	176.594,83	15.817,33	26.594,83
	1.514.888,51	0,00	0,00	0,00	1.596.514,26	81.625,75	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	1.669.192,68	0,00	0,00	0,00	1.733.586,23	64.393,55	181.552,28

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	1.131.567,45	0,00	0,00	0,00	1.182.359,40	50.791,95	160.318,91
	2.800.760,13	0,00	0,00	0,00	2.915.945,63	115.185,50	

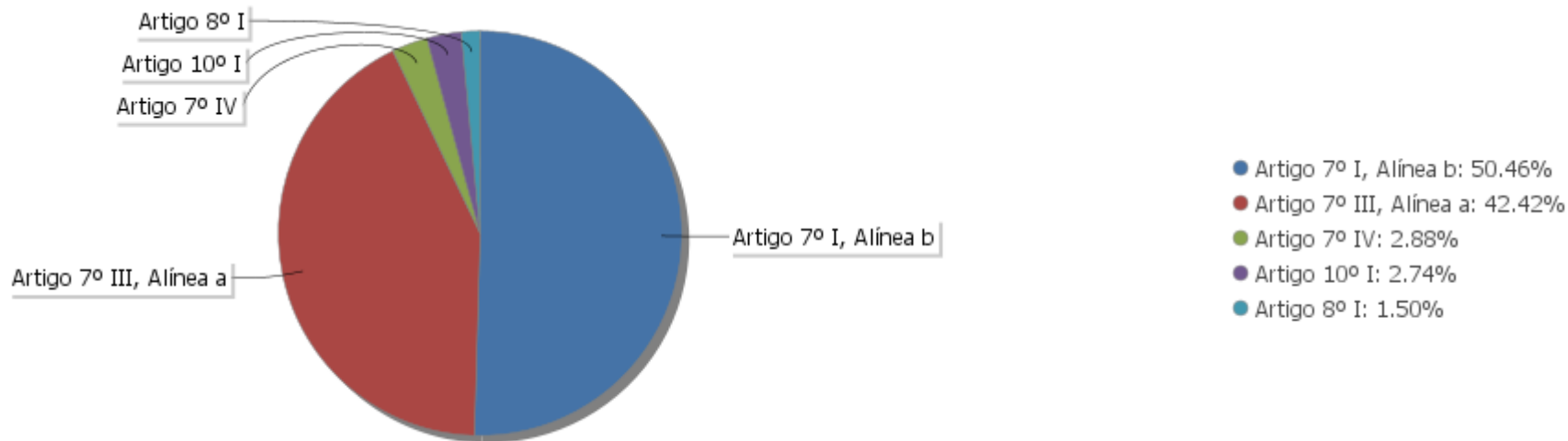
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

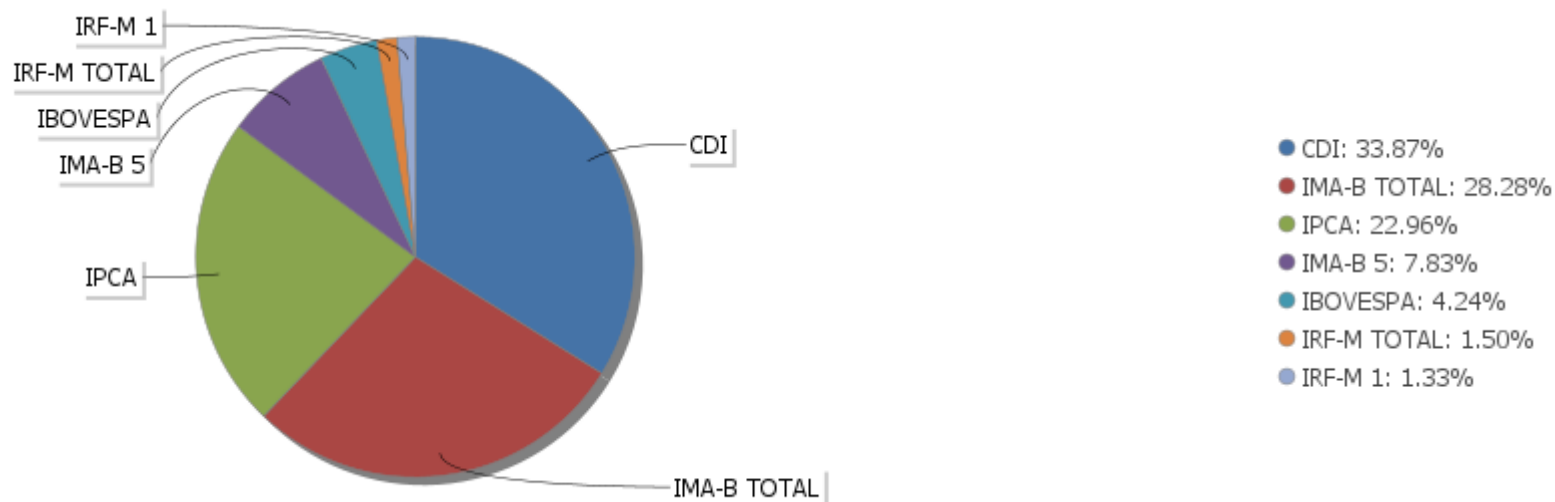
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo P.I.
de 0 a 30 dias	88.172.763,52	82,80	88.172.763,52	82,80	
de 31 dias a 365 dias	3.266.041,78	3,07	91.438.805,30	85,87	
acima de 365 dias	15.045.294,55	14,13	106.484.099,85	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

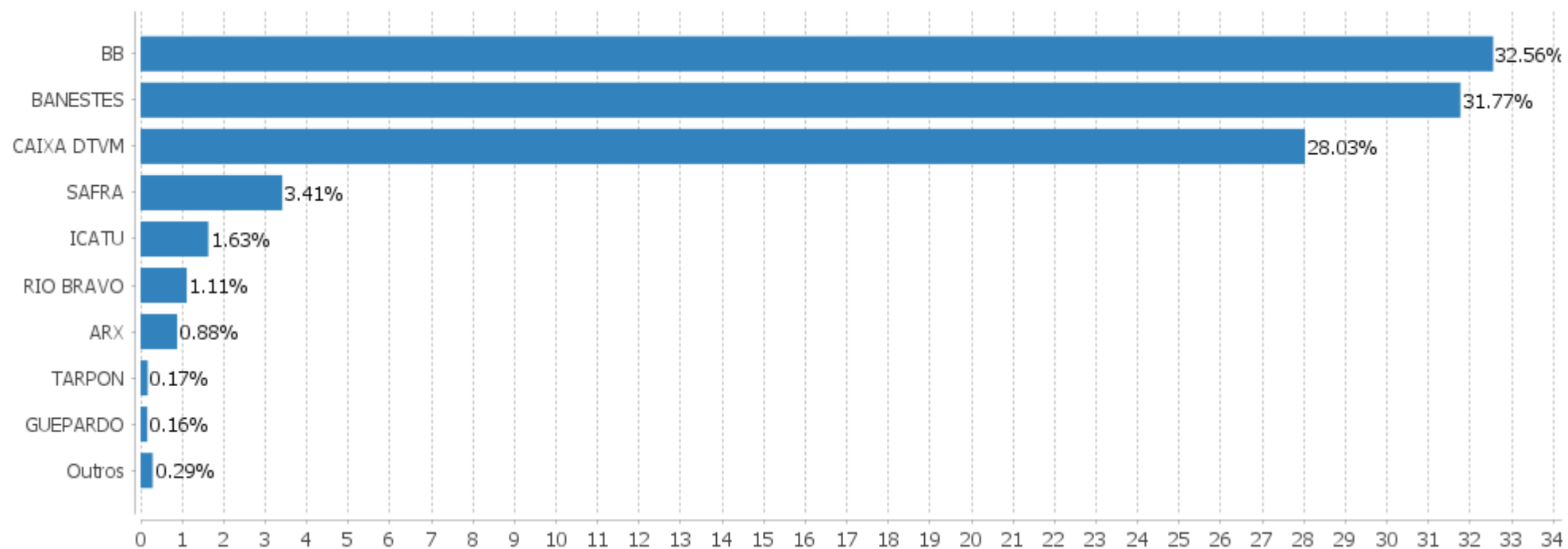


Alocação Por Estratégia



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	1,82	1,38	1,95	1,83	0,93	0,24	-0,07	-0,02	2,06	1,83	13,98
IPCA + 5,20%	0,98	1,21	1,18	0,97	0,67	0,34	0,54	0,69	0,66	0,66	0,68	0,97	9,99
p.p. indexador	-0,49	-0,45	0,64	0,40	1,28	1,49	0,39	-0,45	-0,73	-0,69	1,37	0,87	3,98
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

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	25	41,67
Meses abaixo - Meta Atuarial	35	58,33

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

Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	3,90	2,33	1,57	2,63
06 meses	5,06	4,29	0,76	2,47
12 meses	13,98	9,99	3,98	2,58
24 meses	22,90	22,02	0,88	3,16
36 meses	21,34	41,55	-20,21	3,52
48 meses	26,24	56,59	-30,35	5,03
60 meses	49,18	73,18	-24,00	4,68
Desde 31/12/2018	49,18	73,18	-24,00	4,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

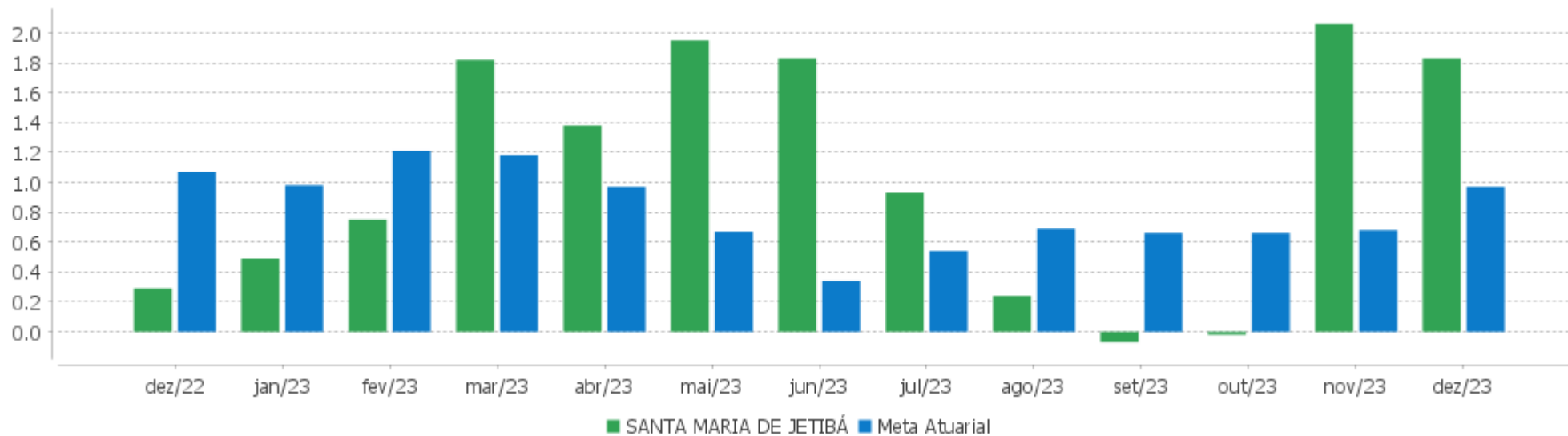


Patrimônio Líquido



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
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a Var. IPCA p.p.	0,77 0,21	6,02 4,21	2,30 1,22	4,20 2,49			
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 5,85 % a.a Var. IPCA p.p.	0,58 0,14	0,58 0,14					
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA % do CDI	0,66 73,76	9,72 74,49	2,11 74,20	4,58 74,51	9,72 74,49	19,79 73,20	22,58 69,22
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,73 -0,02	15,86 -0,20	4,71 -0,05	4,15 -0,06	15,86 -0,20	23,03 -0,41	21,15 -0,73
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,89 -0,02	13,18 -0,07	2,84 -0,05	6,08 -0,08	13,18 -0,07	26,72 -0,14	29,02 -1,55
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,87 0,12	16,01 -0,04	4,97 0,21	4,20 -0,02	16,01 -0,04	22,58 -0,87	13,80 -8,08
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,44 -0,02	11,93 -0,19	2,92 -0,05	4,62 -0,13	11,93 -0,19	22,58 -0,51	27,81 -0,90
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,95 0,39	14,99 10,37	2,92 1,84	5,73 4,03	14,99 10,37	25,68 15,01	26,35 4,54
BB PREV RF IRF M Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,46 -0,02	16,06 -0,45	4,33 -0,05	6,05 -0,24	16,06 -0,45	26,02 -0,77	23,15 -1,12
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,90 100,08	12,98 99,48	2,79 98,28	6,04 98,18	12,98 99,48	27,02 99,94	32,53 99,73
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI Var. IPCA p.p.	2,31 1,75	15,54 10,91	4,20 3,11	3,37 1,67	15,54 10,91		
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI % do CDI	0,88 98,48	12,84 98,44	2,78 97,94	6,04 98,26	12,84 98,44	26,73 98,88	32,18 98,67
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,94 0,19	15,84 -0,22	5,04 0,28	4,10 -0,11	15,84 -0,22	23,08 -0,37	15,87 -6,02
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,90 99,86	10,92 83,72	2,78 97,94	6,12 99,46	10,92 83,72	24,45 90,46	30,74 94,26
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,94 105,42	10,88 83,36	2,94 103,47	6,45 104,93	10,88 83,36	25,22 93,29	32,11 98,45
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF % do CDI	1,29 144,13	10,67 81,75	3,25 114,36	5,93 96,38	10,67 81,75	23,42 86,64	24,52 75,18
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	2,77	15,98	4,76	4,21	15,98	22,96	21,12

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,02	-0,08	0,01	0,00	-0,08	-0,49	-0,76
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,82 91,56	11,93 91,44	2,58 90,82	5,62 91,31	11,93 91,44	24,53 90,75	28,60 87,69
FI BANESTES INVEST MONEY RF % do CDI	0,81 90,61	11,89 91,13	2,58 90,85	5,60 91,11	11,89 91,13	24,43 90,37	28,55 87,52
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,81 90,81	11,58 88,77	2,59 91,25	5,63 91,52	11,58 88,77	23,39 86,50	27,44 84,13
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	9,84 4,46	55,29 33,01	11,50 -3,61	24,35 10,72	55,29 33,01	78,59 50,58	105,58 92,84
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	2,67 -2,71	41,44 19,16	12,52 -2,59	16,24 2,61	41,44 19,16	47,88 19,87	62,60 49,86
SCHRODER BEST IDEAS FIA Var. IBOVESPA p.p.	6,19 0,81	19,86 -2,42	15,15 0,04	11,39 -2,24	19,86 -2,42	35,81 7,79	11,87 -0,87
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,01 -0,37	17,17 -5,11	16,98 1,86	14,09 0,46	17,17 -5,11	14,83 -13,18	7,37 -5,38
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,24 -0,14	15,29 -6,99	8,91 -6,21	5,20 -8,43	15,29 -6,99	5,27 -22,74	-4,90 -17,65
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	4,49 -0,89	15,69 -6,60	10,05 -5,06	9,63 -4,00	15,69 -6,60		
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	3,86 -1,53	21,42 -0,86	7,05 -8,07	8,00 -5,63	21,42 -0,86	42,06 14,05	32,96 20,22
SANTA MARIA DE JETIBÁ Var. IPCA + 5,20% p.p.	1,83 0,87	13,98 3,98	3,90 1,57	5,06 0,76	13,98 3,98	22,90 0,52	21,34 -20,33
CDI	0,90	13,05	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62
IBOVESPA	5,38	22,28	15,12	13,63	22,28	28,01	12,74
INPC + 6,00%	1,02	9,85	2,20	3,95	9,85	23,32	43,97
IPCA + 6,00%	1,03	10,82	2,52	4,68	10,82	24,24	44,91

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 INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA			D+0	D+0		3,50
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 BANESTES INVEST MONEY RF	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
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
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+2		
ICATU VANGUARDA IGARATÉ 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

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES	D+1	D+1	D+90	D+90	O fundo cobrara 20.00 % do que exceder 100.00 % o índice IBOV_FEC. A taxa de performance sera paga no(s) mes(es) de Janeiro	2,00

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	0,91	13,25	2,89	6,16	13,25	26,86	30,57	35,59	44,75
IRF-M 1+	1,73	18,52	5,05	6,37	18,52	27,30	20,95	31,18	49,86
IRF-M TOTAL	1,48	16,51	4,38	6,28	16,51	26,79	24,26	32,58	48,53
IMA-B 5	1,46	12,13	2,97	4,75	12,13	23,09	28,71	39,06	57,35
IMA-B 5+	3,94	19,28	6,42	3,80	19,28	23,21	15,14	21,47	58,36
IMA-B TOTAL	2,75	16,05	4,76	4,21	16,05	23,45	21,89	29,69	59,46
IMA-GERAL TOTAL	1,63	14,80	3,81	5,67	14,80	25,89	27,10	33,88	51,04
IDKA 2	1,45	12,13	2,89	5,00	12,13	22,60	28,70	39,79	56,32
IDKA 20	6,58	27,13	10,28	3,92	27,13	24,70	6,62	8,97	57,20
CDI	0,90	13,05	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62	36,29	44,42

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	5,38	22,28	15,12	13,63	22,28	28,01	12,74	16,03	52,68
IBRX 100	5,48	21,27	14,95	13,77	21,27	26,15	12,05	15,97	54,69
IBRX 50	5,31	20,06	14,43	14,39	20,06	26,93	13,55	17,66	51,96
SMALL CAP	7,05	17,12	11,48	3,40	17,12	-0,52	-16,63	-17,18	31,02
Índice Consumo - ICON	5,98	6,98	12,32	-1,29	6,98	-20,15	-40,99	-40,51	-7,65
Índice Dividendos - IDIV	6,90	26,84	14,61	16,04	26,84	42,88	33,72	32,38	92,17

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	2,43	15,27	7,54	7,67	15,27	-13,18	18,31	77,33	137,73

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	4,25	15,50	2,86	4,95	15,50	18,06	15,37	3,56	40,82

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	2,70	11,43	7,01	6,95	11,43	-16,44	4,80	54,48	99,34

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,56	4,62	1,08	1,70	4,62	10,67	21,81	27,31	32,79
INPC	0,55	3,71	0,77	0,99	3,71	9,86	21,02	27,61	33,33
IGPM	0,74	-3,18	1,84	1,34	-3,18	2,10	20,25	48,08	58,89
SELIC	0,90	13,05	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62	36,29	44,42

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,87	8,75	2,05	3,70	8,75	19,63	36,91	48,80	61,44
IPCA + 5,00%	0,95	9,79	2,28	4,19	9,79	21,92	40,87	54,57	69,32
IPCA + 5,50%	0,99	10,30	2,40	4,44	10,30	23,08	42,88	57,51	73,37
IPCA + 5,89%	1,02	10,71	2,49	4,63	10,71	23,98	44,46	59,84	76,59
IPCA + 6,00%	1,03	10,82	2,52	4,68	10,82	24,24	44,91	60,50	77,50
INPC + 4,00%	0,86	7,80	1,73	2,98	7,80	18,75	36,03	49,15	62,09
INPC + 6,00%	1,02	9,85	2,20	3,95	9,85	23,32	43,97	60,89	78,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
701	01/12/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	201,32	84,60220100	2,3796070000
672	04/12/2023	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	0,00	500.397,32	109.115,66190026	4,5859348600
673	04/12/2023	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	0,00	499.602,68	108.942,38483312	4,5859348600
684	04/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	12.188,02	1.249,13058767	9,7572005600
685	04/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	62.303,90	6.385,42782830	9,7572005600
702	04/12/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	3.797,58	1.595,22565000	2,3805910000
677	05/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	3.605,98	0,00	369,44605671	9,7605047700
670	06/12/2023	LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 5,85 % a.a	2.000.000,00	0,00	1,00000000	2.000.000,0000000000
664	06/12/2023	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	0,00	108.000,00	23.256,33963900	4,6438950000
669	06/12/2023	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,00	1.000.000,00	38.403,74604800	26,0391264630
678	06/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	9.853,25	0,00	1.009,16455413	9,7637694100
703	06/12/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	108.000,00	0,00	45.329,29846615	2,3825650000
686	07/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	64.842,84	6.638,93637939	9,7670524300
687	07/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	3.608,40	369,44605671	9,7670524300
688	07/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	2.191,97	224,42492396	9,7670524300
704	07/12/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	7.494,90	3.144,42864200	2,3835490000
663	08/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	7.866,82	0,00	2.909,65836000	2,7036919890
671	08/12/2023	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	270.000,00	10.395,86641724	25,9718612300
679	08/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	64.998,16	0,00	6.652,55861426	9,7704002000
705	08/12/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	4.505,62	1.889,51951200	2,3845320000
680	12/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	810.623,43	0,00	82.911,14660723	9,7770138700
706	12/12/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	5.156,64	2.160,74775700	2,3865070000
681	13/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	11.394,37	0,00	1.165,02953239	9,7803271800
689	15/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	7.679,90	784,73963017	9,7865586800
690	15/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	46.564,86	4.758,04228473	9,7865586800
707	15/12/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	5.156,64	2.158,09907100	2,3894360000
691	18/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	27,39	2,79782939	9,7897320400
708	18/12/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	8.835,80	3.696,39648100	2,3903820000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
682	19/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	378.694,49	0,00	38.670,11501682	9,7929496700
674	20/12/2023	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	330.000,00	0,00	145.133,43257095	2,2737696900
692	20/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	18.530,74	1.891,71850015	9,7957184200
693	20/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	351.642,43	35.897,56411148	9,7957184200
675	21/12/2023	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	480.000,00	0,00	211.014,24208715	2,2747279800
694	21/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	189.829,23	19.372,51556277	9,7988941800
709	21/12/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	48.307,54	20.185,08243400	2,3932300000
666	22/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,01	0,00	0,00102020	9,8020009800
695	22/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	37,14	3,78902227	9,8020009800
665	26/12/2023	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	0,00	104.767,90	22.048,61089200	4,7516780000
696	26/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	270.985,95	27.637,27805065	9,8050882400
697	26/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	11.423,22	1.165,02980089	9,8050882400
698	26/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	243.369,19	24.820,70370435	9,8050882400
710	26/12/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	104.767,90	0,00	43.742,12463144	2,3951260000
711	26/12/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	55,00	22,96238300	2,3951260000
712	26/12/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	3.506,38	1.463,96472100	2,3951260000
667	27/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	0,01	0,00102020	9,8083494200
699	27/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	18.319,23	1.867,71792231	9,8083494200
713	27/12/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	35.646,11	14.876,86933500	2,3960760000
668	28/12/2023	FI BANESTES INVEST MONEY RF	450.057,83	0,00	17.532,26965463	25,6702548400
676	28/12/2023	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	115.000,00	0,00	50.464,79934891	2,2788161500
700	28/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	115.136,12	11.734,93081191	9,8114016900
683	29/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	304.288,23	0,00	31.003,04125914	9,8147864700
Total			5.179.150,47	4.024.111,97		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.272.056,39

Value-At-Risk: 1,19%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTA MARIA DE JETIBÁ		1,19		1,19			106.484.099,85	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,11%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA		0,02	-0,00	0,01			306.710,15	0,29
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI		0,20	0,02	0,21			9.407.728,08	8,83
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI		2,24	0,25	2,23			11.973.447,89	11,24
BB PREV RF IRF M		1,35	0,02	0,03			1.592.691,22	1,50
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,03	0,00	0,03			5.398.664,54	5,07
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B		2,26	0,07	0,07			3.473.259,35	3,26
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,20	0,23	0,03			11.263.388,04	10,58
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,26	0,09	0,02			8.339.431,35	7,83
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1		0,09	0,00	0,03			1.412.319,77	1,33
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI		0,01	-0,00	0,01			556.363,75	0,52
Sub-total	1,70	1,35	0,68		0,54	1,82	53.724.004,14	50,45

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI BANESTES INVEST MONEY RF		0,02	-0,00	0,00			3.719.965,62	3,49
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP		2,26	0,23	0,07			11.046.462,49	10,37
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF		2,33	0,09	0,14			4.327.136,14	4,06
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	-0,00	0,01			3.354.967,81	3,15
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,02	-0,00	0,00			2.138.627,50	2,01
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI		0,03	0,00	0,03			1.845.156,24	1,73

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI		0,03	0,00	0,03			6.349.673,79	5,96
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF		0,44	0,05	0,44			12.393.799,57	11,64
Sub-total	1,30	0,89	0,37		0,59	1,66	45.175.789,16	42,42

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 6,40 % a.a		0,11	0,00	0,12			1.060.170,22	1,00
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA SA 5,85 % a.a		0,62	-0,00	0,63			2.011.676,44	1,89
Sub-total	1,30	0,38	-0,00		-0,11	0,75	3.071.846,66	2,88

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 2,92%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO		3,86	0,03	3,87			1.182.359,40	1,11
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO		2,70	0,03	5,16			1.733.586,23	1,63
Sub-total	6,22	2,92	0,06		0,52	4,11	2.915.945,63	2,74

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,80%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES		8,55	0,01	5,02			176.594,83	0,17
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		9,17	0,01	4,07			169.797,18	0,16
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA		8,13	0,05	2,85			939.318,04	0,88
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA		8,01	0,01	3,93			173.501,32	0,16
SCHRODER BEST IDEAS FIA		6,54	0,01	1,63			137.302,89	0,13
Sub-total	12,88	7,80	0,09		0,35	5,39	1.596.514,26	1,50

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

- (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 (%)