



**LDB**  
EMPRESAS

**SANTA MARIA DE JETIBÁ**  
MAIO 2021



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.05.2021.

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

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

Equipe LDB Empresas.

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Posição de Ativos e Enquadramento

 RENDA FIXA 100,00%

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	2,98	0,16	-1,87	11.055.061,21	14,45	7.136.312.109,36	0,15
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	10,14	1,14	-4,56	7.695.849,57	10,06	288.925.390,80	2,66
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,82	1,04	-1,23	10.497.583,27	13,72	5.804.299.790,87	0,18
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,44	0,69	1,36	7.416.758,07	9,69	5.747.060.006,20	0,13
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	1,50	0,10	-0,47	3.286.664,85	4,30	171.111.374,51	1,92
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,94	0,48	-0,79	7.505.528,69	9,81	9.352.083.339,26	0,08
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>3,65</b>	<b>0,64</b>	<b>-1,43</b>	<b>47.457.445,66</b>	<b>62,02</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	5,80	1,06	-1,25	10.854.362,77	14,19	2.766.490.944,46	0,39
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>5,80</b>	<b>1,06</b>	<b>-1,25</b>	<b>10.854.362,77</b>	<b>14,19</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BANESTES	BANESTES	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,38	0,29	1,45	484.554,69	0,63	287.922.405,66	0,17
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,47	0,29	0,84	4.658.077,23	6,09	4.637.859.082,40	0,10
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	10,51	1,29	-4,79	7.407.506,88	9,68	246.575.146,46	3,00
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,15	0,19	0,53	3.443.639,39	4,50	2.438.437.445,72	0,14
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,03	0,20	0,62	564.262,41	0,74	567.210.701,26	0,10
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	3,01	0,53	0,15	1.645.821,77	2,15	146.313.204,88	1,12
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>4,72</b>	<b>0,69</b>	<b>-1,64</b>	<b>18.203.862,37</b>	<b>23,79</b>		

<b>Renda Fixa</b>			<b>3,73</b>	<b>0,71</b>	<b>-1,45</b>	<b>76.515.670,80</b>	<b>100,00</b>		
-------------------	--	--	-------------	-------------	--------------	----------------------	---------------	--	--

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Total

3,73

0,71

-1,45

76.515.670,80

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
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	47.457.445,66	62,02	0,00	64,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa Referenciados	10.854.362,77	14,19	0,00	11,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	18.203.862,37	23,79	0,00	13,00	40,00	0,00	40,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>76.515.670,80</b>	<b>100,00</b>					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	0,64 238,49	-1,43 -148,65	0,75 111,16	2,05 182,17	5,10 234,42	300.537,22	-689.171,09
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,06 397,23	-1,25 -130,25	1,20 177,30	3,54 314,20		114.091,61	-137.591,18
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,69 258,62	-1,64 -171,04	0,60 88,41	1,81 160,19	3,46 158,97	125.374,33	-290.884,31
<b>SANTA MARIA DE JETIBÁ (Total)</b>						<b>540.003,16</b>	<b>-1.117.646,58</b>

## RESULTADO POR ATIVO

## Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	7.609.317,59	0,00	0,00	0,00	7.695.849,57	86.531,98	-367.635,33
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	3.879.724,04	0,00	-596.000,00	0,00	3.286.664,85	2.940,81	-19.282,66
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	7.229.789,62	240.000,00	0,00	0,00	7.505.528,69	35.739,07	-56.995,65
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	7.067.294,50	300.000,00	0,00	0,00	7.416.758,07	49.463,57	96.290,74
BB PREV RF IRF-M	11.037.519,93	0,00	0,00	0,00	11.055.061,21	17.541,28	-210.644,52
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	10.389.262,76	0,00	0,00	0,00	10.497.583,27	108.320,51	-130.903,67
					47.457.445,66	0,00	0,00

## Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	10.740.271,16	0,00	0,00	0,00	10.854.362,77	114.091,61	-137.591,18
					10.854.362,77	0,00	0,00

## Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	1.311.249,29	325.996,64	0,00	0,00	1.645.821,77	8.575,84	9.700,57

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	7.313.500,38	0,00	0,00	0,00	7.407.506,88	94.006,50	-372.557,48
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	612.834,14	0,00	-130.000,00	0,00	484.554,69	1.720,55	11.837,90
BB PREV RF FLUXO FIC	3.436.742,60	314,49	0,00	0,00	3.443.639,39	6.582,30	18.152,75
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	604.095,48	0,00	-41.006,79	0,00	564.262,41	1.173,72	3.414,17
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.644.761,81	0,00	0,00	0,00	4.658.077,23	13.315,42	38.567,78
					18.203.862,37	0,00	0,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

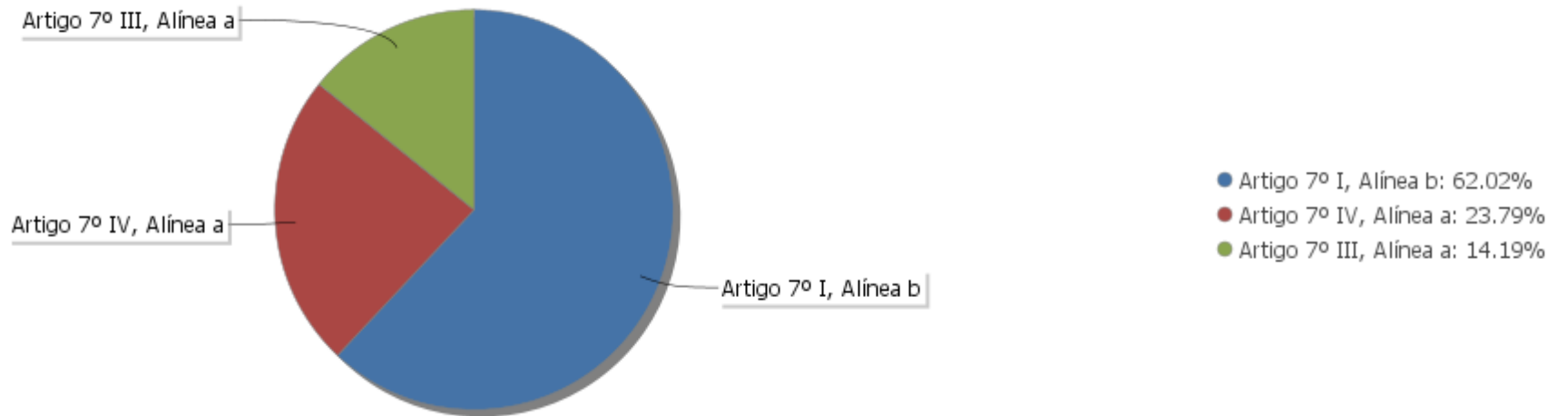
## Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	76.515.670,80	100,00	76.515.670,80	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	76.515.670,80	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	76.515.670,80	100,00

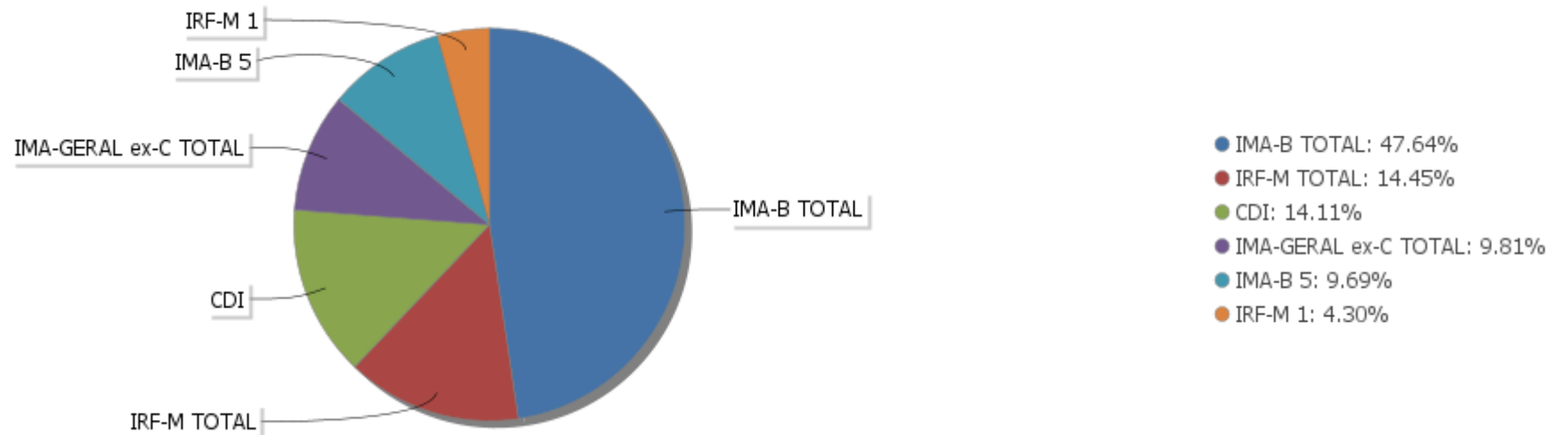


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

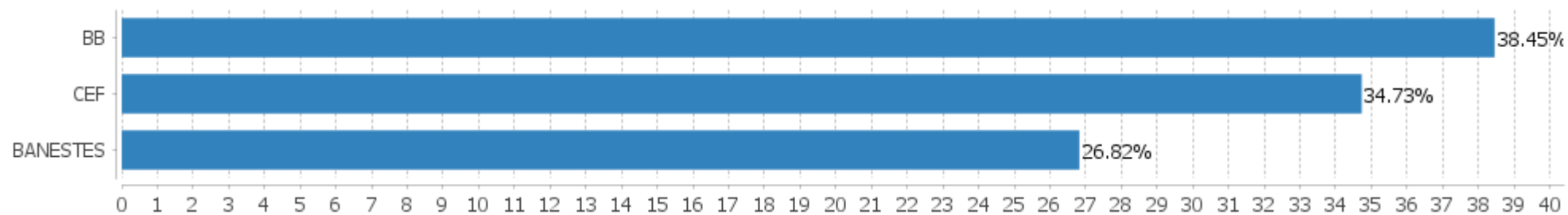


Alocação Por Estratégia



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Alocação por Gestor



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial**

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2021	-0,96	-1,27	-0,61	0,68	0,71								-1,45
IPCA + 5,42%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27								5,45
p.p. indexador	-1,63	-2,51	-2,03	-0,05	-0,56								-6,90
2020	0,57	0,42	-5,52	1,12	1,19	1,38	3,19	-1,47	-1,66	0,19	1,16	3,72	4,04
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,63
p.p. indexador	-0,14	-0,24	-6,09	0,98	1,11	0,64	2,31	-2,19	-2,78	-1,15	-0,19	1,86	-6,59
2019	2,80	0,64	0,45	1,04	3,06	3,20	1,49	-0,53	2,61	2,73	-1,95	1,42	18,17
IPCA + 6,00%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	1,97	-0,25	-0,75	-0,02	2,42	2,75	0,76	-1,15	2,16	2,10	-2,93	-0,23	7,58

**Performance Sobre a Meta Atuarial**

**Relatório**

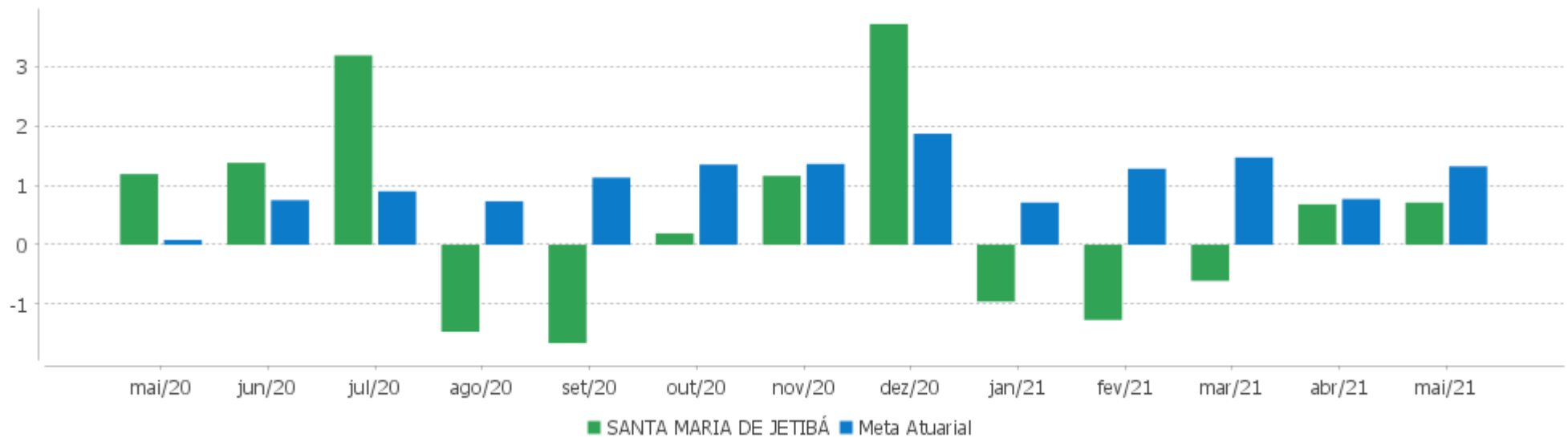
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	11	37,93	03 meses	0,78	3,46	-2,68	4,41
Meses abaixo - Meta Atuarial	18	62,07	06 meses	2,21	7,40	-5,20	4,01
			12 meses	5,01	14,18	-9,17	3,73
			24 meses	11,95	23,21	-11,26	6,17
Maior rentabilidade da Carteira	3,72	2020-12	Desde 31/12/2018	21,15	29,01	-7,86	5,75
Menor rentabilidade da Carteira	-5,52	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,06 0,00	-1,25 -0,11	1,20 -0,05	3,54 -0,12	8,86 -0,30	15,67 -0,78	42,69 -1,40
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,04 -0,02	-1,23 -0,09	1,20 -0,05	3,55 -0,11	8,92 -0,25	15,71 -0,75	42,92 -1,18
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,14 0,08	-4,56 -3,42	0,34 -0,91	3,02 -0,64	6,56 -2,60	8,87 -7,59	42,44 -1,65
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,10 -0,10	-0,47 -1,07	0,22 -0,29	0,56 -0,35	1,36 -0,75	11,99 3,43	22,60 6,23
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,48 -0,02	-0,79 -0,13	0,68 0,07	1,57 0,12	3,44 0,10	11,29 0,29	26,57 0,54
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,69 -0,00	1,36 -0,06	1,89 -0,03	3,19 -0,09	7,12 -0,28	17,04 -0,51	32,23 -0,86
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,16 -0,04	-1,87 -0,08	0,11 -0,08	0,06 -0,08	0,51 -0,21	11,56 -0,54	26,18 -0,87
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,29 108,79	1,45 150,38	1,08 159,89	1,71 152,09	3,32 152,29	4,40 61,41	10,87 77,64
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,29 0,23	-4,79 -3,65	0,68 -0,56	2,91 -0,75	5,39 -3,78	6,74 -9,71	36,03 -8,06
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF % do CDI	0,53 199,91	-1,05 -108,77	0,63 93,69	1,52 134,45	2,59 118,78	11,03 153,84	
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,19 71,61	0,53 55,34	0,40 60,00	0,64 56,37	1,06 48,65	4,87 67,87	10,36 74,01
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,29 107,20	0,84 87,91	0,57 84,09	1,10 97,71	1,69 77,41	6,69 93,35	13,33 95,26
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,20 73,78	0,62 64,32	0,46 68,33	0,71 62,87	1,32 60,72	5,38 75,00	11,16 79,72
SANTA MARIA DE JETIBÁ Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,71 -0,61	-1,45 -7,14	0,78 -2,83	2,21 -5,45	5,01 -9,50	11,95 -11,68	
CDI	0,27	0,96	0,67	1,13	2,18	7,17	14,00
IBOVESPA	6,16	6,05	14,70	15,91	44,41	30,08	64,44
INPC + 6,00%	1,45	5,80	3,74	7,89	15,40	24,81	38,59
IPCA + 6,00%	1,32	5,68	3,61	7,65	14,51	23,63	37,13

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	D+0	D+0	D+1 du	D+2 du	0,00	0,50
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	0,15
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,80
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du	0,00	0,30
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	1,00
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,20
BB PREV RF IRF-M	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,80
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20

**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	0,20	0,60	0,52	0,91	2,11	8,57	16,37	25,88	43,11
IRF-M 1+	0,20	-3,51	-0,14	-0,57	-0,28	13,33	31,30	45,86	74,27
IRF-M TOTAL	0,20	-1,79	0,19	0,13	0,71	12,10	27,04	40,22	64,99
IMA-B 5	0,69	1,42	1,92	3,27	7,39	17,55	33,09	46,16	64,24
IMA-B 5+	1,38	-3,35	0,65	3,91	10,69	15,30	52,84	63,86	92,42
IMA-B TOTAL	1,06	-1,14	1,25	3,66	9,17	16,46	44,09	56,66	80,66
IMA-GERAL TOTAL	0,61	-0,21	0,73	1,81	4,20	12,11	27,53	39,29	60,68
IDKA 2	0,88	2,19	2,53	3,96	8,47	18,26	32,51	46,64	65,76
IDKA 20	2,37	-4,65	0,81	6,18	15,79	13,16	71,22	79,58	122,22
CDI	0,27	0,96	0,67	1,13	2,18	7,17	14,00	22,75	39,03

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,16	6,05	14,70	15,91	44,41	30,08	64,44	101,27	160,39
IBRX 100	5,92	8,14	15,50	18,03	47,63	34,45	72,38	109,11	171,70
IBRX 50	6,18	8,39	15,91	18,61	49,33	32,34	65,03	102,41	160,17
SMALL CAP	6,32	10,00	16,04	18,26	57,75	55,08	97,90	135,01	241,15
IFIX	-1,56	-1,87	-2,43	0,28	5,97	10,33	27,21	36,94	74,68
Índice Consumo - ICON	6,51	2,66	9,81	7,79	27,87	37,71	69,55	74,93	108,51
Índice Dividendos - IDIV	5,64	4,32	15,93	13,64	37,85	30,26	78,57	100,70	199,05

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,83	3,22	2,08	4,61	8,06	10,08	15,21	18,50	22,77
INPC	0,96	3,33	2,22	4,84	8,90	11,13	16,44	18,49	22,46
IGPM	4,10	14,39	8,77	15,49	37,04	45,96	57,11	63,81	66,39
SELIC	0,27	0,96	0,67	1,13	2,18	7,17	14,00	22,77	39,07

**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	-2,64	12,69	4,37	13,92	33,16	102,83	116,09	181,17	191,78
MSCI ACWI	-1,84	10,84	2,43	12,92	34,65	91,95	95,33	147,44	157,20
MSCI World	-1,95	11,37	3,24	13,05	33,59	93,08	98,36	151,08	158,61

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,16	4,87	3,11	6,65	12,36	19,03	29,54	38,50	49,22
IPCA + 5,00%	1,24	5,28	3,36	7,15	13,44	21,32	33,30	43,87	56,50
IPCA + 5,50%	1,28	5,48	3,48	7,40	13,97	22,47	35,20	46,62	60,24
IPCA + 5,89%	1,31	5,64	3,58	7,60	14,39	23,38	36,70	48,78	63,21
IPCA + 6,00%	1,32	5,68	3,61	7,65	14,51	23,63	37,13	49,40	64,06
INPC + 4,00%	1,29	4,99	3,24	6,88	13,23	20,16	30,92	38,49	48,86
INPC + 6,00%	1,45	5,80	3,74	7,89	15,40	24,81	38,59	49,39	63,66



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
60	03/05/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	4.680,75	2.477,05640500	1,8896420000
61	06/05/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	324,25	171,55712100	1,8900400000
62	11/05/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	109,45	57,89131300	1,8906040000
57	12/05/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	314,49	0,00	148,15006500	2,1227800200
63	17/05/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.100,04	581,61341200	1,8913590000
64	18/05/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.460,00	771,85523000	1,8915460000
52	19/05/2021	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	325.996,64	0,00	258.467,03934086	1,2612696800
65	19/05/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	677,80	358,29541200	1,8917340000
58	20/05/2021	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	300.000,00	0,00	14.386,28842900	20,8531895820
59	20/05/2021	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	240.000,00	0,00	158.981,50860000	1,5096095270
54	24/05/2021	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	0,00	84.435,82	45.524,08850578	1,8547503700
55	24/05/2021	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	0,00	263.849,84	142.256,25413947	1,8547503700
56	24/05/2021	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	0,00	247.714,34	133.556,70067881	1,8547503700
66	25/05/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	49,00	25,89169600	1,8924850000
53	26/05/2021	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	130.000,00	6.415,12139412	20,2646204200
67	27/05/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	24.963,06	13.188,01289200	1,8928600000
68	28/05/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	6.280,77	3.317,80728500	1,8930480000
69	31/05/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.361,67	719,22870900	1,8932370000
<b>Total</b>						

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.640.643,36

Value-At-Risk: 2,14%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTA MARIA DE JETIBÁ		2,14	2,14			76.515.670,80	100,00

## Renda Fixa

Value-At-Risk: 2,14%

## 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 IRF-M		1,49	0,18	0,04			11.055.061,21	14,45
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B		4,56	0,42	3,00			7.695.849,57	10,06
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,97	0,39	0,02			10.497.583,27	13,72
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,41	0,12	0,04			7.416.758,07	9,69
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1		0,66	0,02	0,53			3.286.664,85	4,30
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,42	0,13	0,28			7.505.528,69	9,81
<b>Sub-total</b>	3,36	2,03	1,26		0,11	0,64	47.457.445,66	62,02

## 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		2,95	0,40	0,04			10.854.362,77	14,19
<b>Sub-total</b>	5,02	2,95	0,40		0,16	1,06	10.854.362,77	14,19

## Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI		0,12	0,00	0,12			484.554,69	0,63
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,04	0,00	0,04			4.658.077,23	6,09
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF		5,15	0,46	3,50			7.407.506,88	9,68
BB PREV RF FLUXO FIC		0,02	0,00	0,02			3.443.639,39	4,50
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,02	0,00	0,02			564.262,41	0,74

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
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF		1,61	0,03	1,61			1.645.821,77	2,15
<b>Sub-total</b>	2,99	2,24	0,49		0,14	0,69	18.203.862,37	23,79