



LDB
EMPRESAS

SANTA MARIA DE JETIBÁ
DEZEMBRO 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 30.12.2022.

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

97,01%

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	2,27	0,05	1,22	1,22	8.181.641,05	9,27	6.757.838.619,84	0,12
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI	7,04	0,04	-0,08	3,50	10.363.310,46	11,75	549.861.629,89	1,88
BB	BB	BB PREV RF IRF M	3,68	0,05	1,43	8,58	1.372.262,31	1,56	4.012.099.701,11	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,10	0,05	1,09	12,43	4.778.430,31	5,42	16.549.368.546,86	0,03
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B	5,47	0,04	-0,13	5,66	6.860.738,49	7,78	160.999.611,99	4,26
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,40	0,04	-0,24	6,19	10.406.140,16	11,79	3.466.339.701,42	0,30
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,08	0,04	0,96	10,58	1.624.389,70	1,84	918.894.770,10	0,18
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,62	0,04	0,91	9,51	8.355.741,73	9,47	5.613.586.065,55	0,15
BANESTES	BANESTES	BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	0,35	0,05	1,18	11,96	1.247.837,06	1,41	345.169.436,09	0,36
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,43		-0,39	7,27	0,00	0,00	0,00	
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,59	0,04	0,38	7,89	53.190.491,27	60,29		

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	5,50	0,04	-0,26	6,02	11.749.340,57	13,32	1.457.873.778,20	0,81
BANESTES	BANESTES	BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	5,35	0,04	-0,25	6,25	6.731.514,67	7,63	181.768.415,38	3,70
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,08	0,05	1,03	11,26	3.931.070,38	4,46	3.841.990.026,28	0,10
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	0,13	0,05	1,11	2,59	102.812,81	0,12	3.275.697.229,55	0,00
BANESTES	BANESTES	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,13	0,05	1,05	12,20	484.758,08	0,55	304.007.413,59	0,16
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	0,73	0,05	0,91	11,53	9.399.284,74	10,65	158.129.265,66	5,94
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			3,48	0,05	0,25	8,20	32.398.781,25	36,72		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

3,54

0,05

0,33

8,00

85.589.272,52

97,01

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

1,21%

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	20,27	0,01	-1,80	-8,69	147.277,28	0,17	999.511.078,28	0,01
ARX	BEM	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	20,57	-0,01	-2,49	-2,00	801.657,88	0,91	294.871.697,00	0,27
SCHRODER	BEM	SCHRODER BEST IDEAS FIA	21,30	-0,00	-2,36	13,30	114.548,71	0,13	94.235.188,91	0,12
Sub-total Artigo 8º I			20,22	-0,00	-2,38	-1,16	1.063.483,87	1,21		
Renda Variável			20,22	-0,00	-2,38	-1,16	1.063.483,87	1,21		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

1,78%

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	12,57	0,01	0,48	17,00	552.033,95	0,63	132.527.608,79	0,42
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	6,57	0,04	-0,11	2,20	1.022.040,49	1,16	128.998.626,49	0,79
Sub-total Artigo 10º I			8,53	0,03	0,09	8,24	1.574.074,44	1,78		
Investimentos Estruturados			8,53	0,03	0,09	8,24	1.574.074,44	1,78		
Total			3,64	0,04	0,29	7,83	88.226.830,83	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	53.190.491,27	60,29	0,00	60,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	32.398.781,25	36,72	0,00	30,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	85.589.272,52	97,01					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	1.063.483,87	1,21	0,00	5,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	1.063.483,87	1,21					30,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	1.574.074,44	1,78	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	1.574.074,44	1,78					15,00
Total		88.226.830,83	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	0,38 34,12	7,89 63,80	1,19 37,36	3,63 54,89	7,89 63,80	202.472,81	3.911.856,28
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,25 22,18	8,20 66,24	1,17 36,46	3,52 53,18	8,20 66,24	81.972,66	2.343.315,61
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-2,38 0,07	-1,16 -5,84	-2,40 -2,13	7,73 -3,63	-1,16 -5,84	-25.906,15	-39.227,09
Artigo 10º I % do CDI	0,09 8,26	8,24 66,60	2,76 86,16	9,50 143,64	8,24 66,60	1.458,77	78.702,83
SANTA MARIA DE JETIBÁ (Total)						259.998,09	6.294.647,63

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	6.869.903,97	0,00	0,00	0,00	6.860.738,49	-9.165,48	374.239,94
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1	1.233.252,55	0,00	0,00	0,00	1.247.837,06	14.584,51	138.581,31
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	8.114.252,17	0,00	-8.082.930,60	0,00	0,00	-31.321,57	547.649,48
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,00	8.082.930,60	0,00	0,00	8.181.641,05	98.710,44	98.710,44
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	8.280.081,77	0,00	0,00	0,00	8.355.741,73	75.659,96	725.905,16
BB PREV RF IRF M	1.352.871,32	0,00	0,00	0,00	1.372.262,31	19.390,99	363.650,36
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI	10.371.952,05	0,00	0,00	0,00	10.363.310,46	-8.641,59	352.381,91
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	1.314.579,89	381.835,52	-85.281,74	0,00	1.624.389,70	13.256,03	79.214,87
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	10.430.845,89	0,00	0,00	0,00	10.406.140,16	-24.705,73	640.713,82
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.105.560,59	0,00	-381.835,52	0,00	4.778.430,31	54.705,24	590.808,98
					53.190.491,27	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	8.928.691,61	388.052,43	0,00	0,00	9.399.284,74	82.540,70	734.349,14

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF	6.748.055,70	0,00	0,00	0,00	6.731.514,67	-16.541,03	407.259,43
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI	101.685,70	0,00	0,00	0,00	102.812,81	1.127,11	2.812,81
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	746.091,05	0,00	-267.000,00	0,00	484.758,08	5.667,03	122.463,50
BB PREV RF FLUXO FIC	3.890.140,42	720,32	0,00	0,00	3.931.070,38	40.209,64	398.333,42
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	11.780.371,36	0,00	0,00	0,00	11.749.340,57	-31.030,79	678.097,31
					32.398.781,25	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	822.096,28	0,00	0,00	0,00	801.657,88	-20.438,40	-38.649,29
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	149.981,94	0,00	0,00	0,00	147.277,28	-2.704,66	-14.023,77
SCHRODER BEST IDEAS FIA	117.311,80	0,00	0,00	0,00	114.548,71	-2.763,09	13.445,97
					1.063.483,87	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	549.413,50	0,00	0,00	0,00	552.033,95	2.620,45	56.662,34
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	1.023.202,17	0,00	0,00	0,00	1.022.040,49	-1.161,68	22.040,49
					1.574.074,44	0,00	0,00

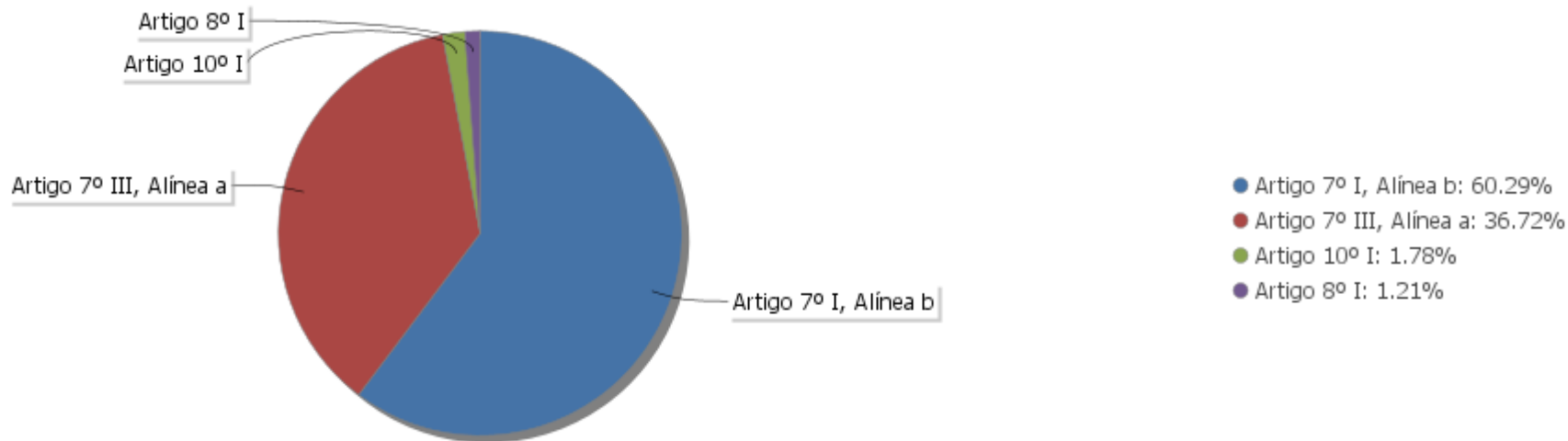
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

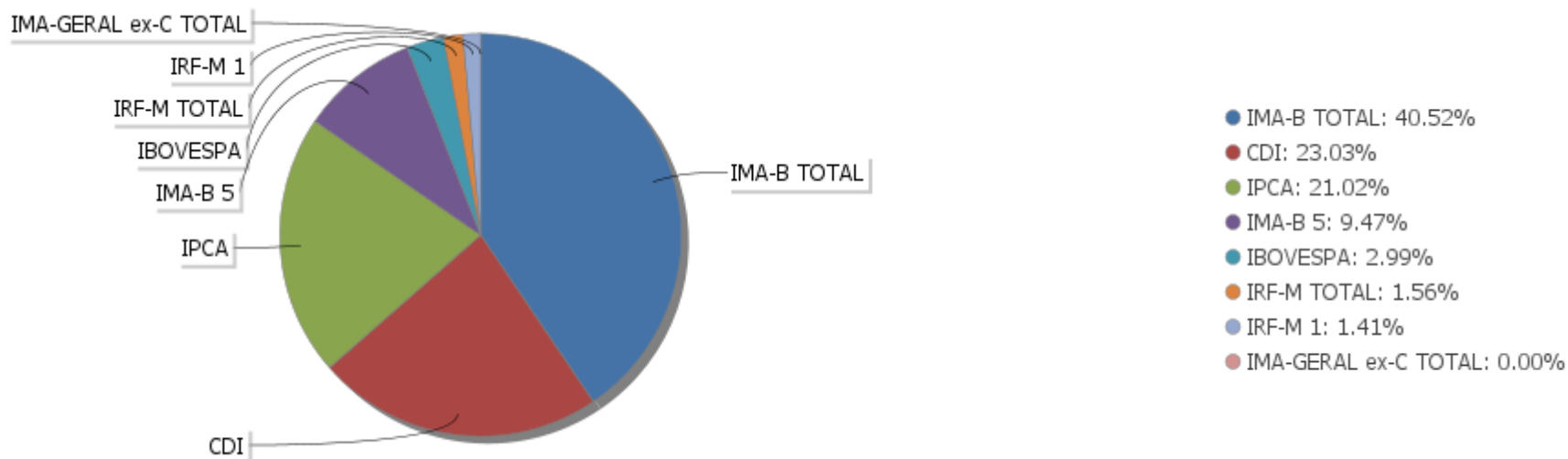
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	77.311.486,42	87,63	77.311.486,42	87,63
de 31 a 365 dias	552.033,95	0,63	77.863.520,37	88,25
acima de 365 dias	10.363.310,46	11,75	88.226.830,83	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

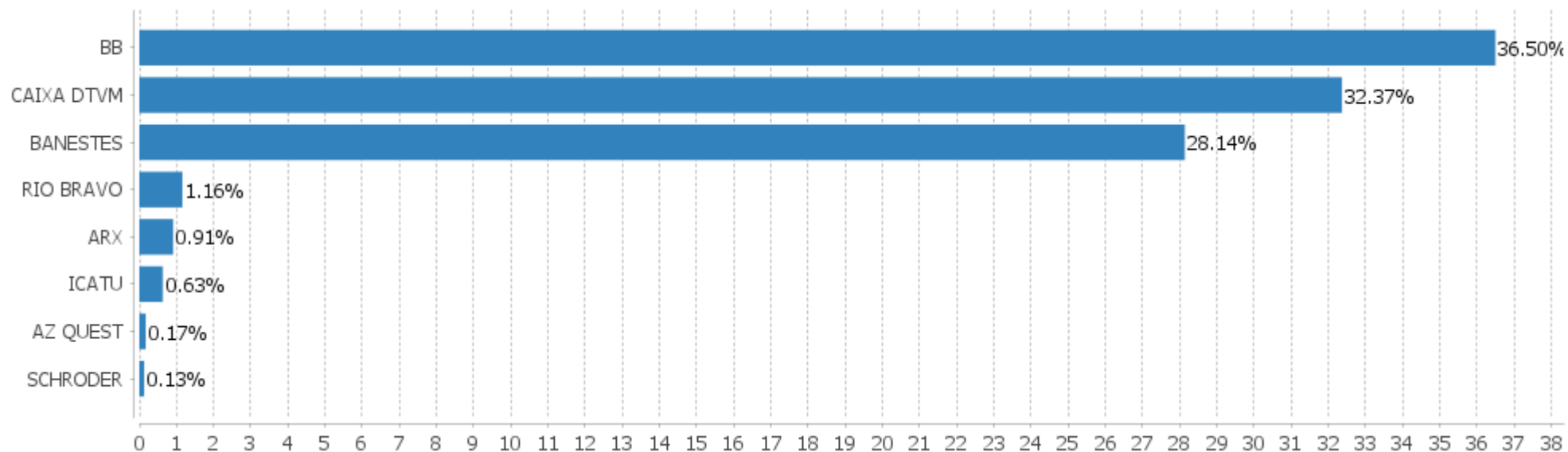


Alocação Por Estratégia



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	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. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	18	37,50	03 meses	1,17	2,83	-1,66	4,53
Meses abaixo - Meta Atuarial	30	62,50	06 meses	3,74	2,72	1,02	4,19
			12 meses	7,83	10,94	-3,11	3,64
			24 meses	6,46	28,69	-22,23	3,88
Maior rentabilidade da Carteira	3,72	2020-12	36 meses	10,76	42,37	-31,61	5,60
Menor rentabilidade da Carteira	-5,52	2020-03	48 meses	30,88	57,44	-26,56	5,07
			Desde 31/12/2018	30,88	57,44	-26,56	5,07

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

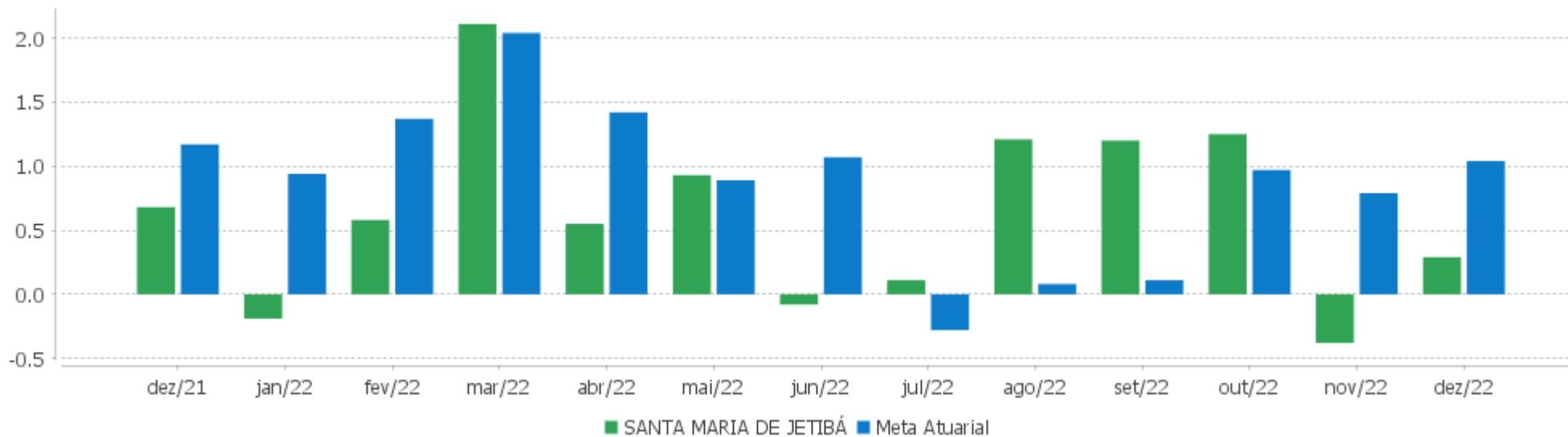


Patrimônio Líquido



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 REFERENCIAL FI RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	1,18 0,00	11,96 -0,05	3,12 -0,03	6,60 -0,09	11,96 -0,05	13,99 -1,30	21,13 1,41
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,24 -0,04	6,19 -0,17	0,10 -0,13	1,86 -0,07	6,19 -0,17	4,57 -0,45	10,91 -0,84
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,13 0,06	5,66 -0,71	0,24 0,01	2,00 0,06	5,66 -0,71	-1,90 -6,93	-1,94 -13,69
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,39	7,27	0,54	3,43	7,27	6,84	12,28
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,91 -0,03	9,51 -0,27	2,44 -0,09	2,86 -0,12	9,51 -0,27	14,19 -0,61	23,07 -0,95
BB PREV RF IRF M Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,43 -0,04	8,58 -0,24	1,63 -0,11	6,34 -0,15	8,58 -0,24	6,10 -0,55	12,89 -0,91
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,77 0,15	9,30 3,52	1,67 0,04	4,80 4,51	9,30 3,52	9,89 -6,54	
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	1,09 97,41	12,43 100,42	3,12 97,45	6,55 98,96	12,43 100,42	17,30 99,95	20,18 98,18
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI Var. IPCA p.p.	-0,08 -0,70	0,43 -0,14	0,14 -1,49	1,17 0,89			
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,96 85,76	10,58 85,49	2,76 86,23	5,72 86,52	10,58 85,49	14,21 82,10	16,39 79,70
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,25 -0,05	6,25 -0,12	0,15 -0,09	1,96 0,02	6,25 -0,12	0,03 -5,00	-0,71 -12,46
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	1,05 93,59	12,20 98,59	3,08 96,20	6,49 98,12	12,20 98,59	17,87 103,22	17,62 85,68
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	1,11 98,67	12,94 104,56	3,24 101,39	6,84 103,48	12,94 104,56	19,15 110,64	19,40 94,36
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF % do CDI	0,91 80,60	11,53 93,17	2,73 85,23	5,98 90,43	11,53 93,17	12,52 72,32	14,43 70,21
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,26 -0,07	6,02 -0,35	-0,06 -0,29	1,74 -0,20	6,02 -0,35	4,43 -0,59	10,75 -1,00
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	1,03 92,01	11,26 91,00	2,95 92,16	6,09 92,12	11,26 91,00	14,89 86,04	16,78 81,63
SCHRODER BEST IDEAS FIA	-2,36	13,30	-2,76	11,14	13,30	-6,67	3,00

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.	0,09	8,61	-2,48	-0,21	8,61	1,13	8,11
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,49 -0,04	-2,00 -6,69	-2,13 -1,86	8,02 -3,34	-2,00 -6,69	-8,37 -0,57	
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-1,80 0,64	-8,69 -13,38	-3,58 -3,31	3,72 -7,64	-8,69 -13,38	-17,52 -9,72	-20,12 -15,01
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	-0,11 2,33	2,35 1,77	1,24 1,51	6,73 -4,63			
ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	0,48 2,92	17,00 12,31	5,69 5,97	15,04 3,68	17,00 12,31	9,50 17,30	11,46 16,58
SANTA MARIA DE JETIBÁ Var. IPCA + 4,89% p.p.	0,29 -0,75	7,83 -3,11	1,17 -1,66	3,74 1,02	7,83 -3,11	6,46 -21,59	10,76 -29,59
CDI	1,12	12,37	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56
IBOVESPA	-2,45	4,69	-0,27	11,36	4,69	-7,80	-5,11
INPC + 6,00%	1,20	12,26	3,01	3,29	12,26	31,06	46,46
IPCA + 6,00%	1,13	12,11	3,10	3,27	12,11	30,76	44,83

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 FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	D+0	D+0		D+3 du		
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		
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	1,18	12,02	3,16	6,70	12,02	15,30	19,73	27,82	36,73
IRF-M 1+	1,62	7,41	1,10	6,63	7,41	2,06	10,68	26,44	41,95
IRF-M TOTAL	1,48	8,82	1,74	6,49	8,82	6,66	13,80	27,49	41,17
IMA-B 5	0,94	9,78	2,53	2,98	9,78	14,79	24,02	40,34	54,18
IMA-B 5+	-1,19	3,30	-1,72	1,24	3,30	-3,47	1,84	32,76	53,22
IMA-B TOTAL	-0,19	6,37	0,23	1,94	6,37	5,02	11,75	37,40	55,34
IMA-GERAL TOTAL	0,77	9,66	1,73	4,95	9,66	10,71	16,62	31,57	44,78
IDKA 2	1,24	9,34	2,25	2,34	9,34	14,78	24,67	39,41	53,01
IDKA 20	-3,32	-1,92	-5,66	0,71	-1,92	-16,13	-14,29	23,65	48,88
CDI	1,12	12,37	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56	27,75	35,96

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-2,45	4,69	-0,27	11,36	4,69	-7,80	-5,11	24,86	43,63
IBRX 100	-2,63	4,02	-0,39	10,33	4,02	-7,61	-4,37	27,56	47,23
IBRX 50	-2,55	5,72	0,38	12,12	5,72	-5,43	-2,00	26,57	44,96
SMALL CAP	-3,01	-15,06	-7,61	5,76	-15,06	-28,82	-29,28	11,87	20,97
Índice Consumo - ICON									
Índice Dividendos - IDIV	-1,61	12,65	3,15	7,71	12,65	5,43	4,37	51,51	75,68

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	-7,26	-24,68	3,34	1,04	-24,68	2,63	53,84	106,24	126,51

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-0,00	2,22	-4,14	2,56	2,22	-0,11	-10,33	21,92	28,78

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-5,43	-25,01	5,58	1,05	-25,01	-5,95	38,64	78,90	86,12

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,62	5,78	1,63	0,28	5,78	16,43	21,69	26,93	31,68
INPC	0,69	5,93	1,55	0,30	5,93	16,70	23,05	28,57	32,98
IGPM	0,45	5,45	-1,09	-2,51	5,45	24,20	52,94	64,11	76,48
SELIC	1,12	12,37	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56	27,75	35,97

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,97	10,00	2,61	2,28	10,00	25,89	36,82	48,44	60,11
IPCA + 5,00%	1,05	11,05	2,86	2,78	11,05	28,31	40,79	54,22	67,93
IPCA + 5,50%	1,09	11,58	2,98	3,03	11,58	29,53	42,80	57,17	71,96
IPCA + 5,89%	1,12	11,99	3,07	3,22	11,99	30,49	44,38	59,51	75,15
IPCA + 6,00%	1,13	12,11	3,10	3,27	12,11	30,76	44,83	60,17	76,06
INPC + 4,00%	1,04	10,15	2,53	2,31	10,15	26,18	38,35	50,36	61,69
INPC + 6,00%	1,20	12,26	3,01	3,29	12,26	31,06	46,46	62,24	77,79

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
345	01/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	10.341,02	4.856,12218800	2,1294810000
346	02/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	2.452,53	1.151,19931300	2,1304130000
335	06/12/2022	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	245.000,00	10.489,33985415	23,3570466200
347	06/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	7.421,64	3.480,62534200	2,1322720000
348	07/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	2.825,96	1.324,75091600	2,1332010000
336	08/12/2022	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	10.000,00	427,73262827	23,3790909100
340	12/12/2022	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	0,00	8.082.930,60	4.951.672,00144936	1,6323638960
341	12/12/2022	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	259.515,67	0,00	224.142,82963500	1,1578138600
342	12/12/2022	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	7.817.771,97	0,00	6.752.183,78571200	1,1578138600
343	12/12/2022	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	5.642,96	0,00	4.873,80903200	1,1578138600
349	15/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	2.458,67	1.149,55474100	2,1388020000
350	16/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	600,00	280,40826900	2,1397370000
351	19/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	21.611,00	10.095,43737700	2,1406700000
352	20/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	8.737,65	4.079,95783200	2,1416030000
353	21/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	22.711,32	10.600,22925300	2,1425310000
334	22/12/2022	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	388.052,43	0,00	270.461,69137892	1,4347778000
344	22/12/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	381.835,52	80.617,53274500	4,7363830000
354	22/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	381.835,52	0,00	178.139,62645400	2,1434620000
355	22/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	810,00	377,89333000	2,1434620000
356	23/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	2.586,78	1.206,29825500	2,1443950000
357	26/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	55,00	25,63695900	2,1453250000
338	27/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	692,88	0,00	285,63966600	2,4257135130
358	27/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.500,88	699,30049200	2,1462590000
337	29/12/2022	BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI	0,00	12.000,00	509,66986804	23,5446526300
339	29/12/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	27,44	0,00	11,30146800	2,4280029600
359	29/12/2022	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.169,29	544,33127800	2,1481220000
Total			8.853.538,87	8.817.047,86		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.786.484,30

Value-At-Risk: 2,02%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTA MARIA DE JETIBÁ		2,02	2,02			88.226.830,83	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,94%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI		1,31	0,12	1,32			8.181.641,05	9,27
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI		3,42	0,40	3,42			10.363.310,46	11,75
BB PREV RF IRF M		1,58	0,02	0,02			1.372.262,31	1,56
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,02	0,00	0,02			4.778.430,31	5,42
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B		2,89	0,22	0,14			6.860.738,49	7,78
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,95	0,35	0,05			10.406.140,16	11,79
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,00	-0,00	0,00			1.624.389,70	1,84
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,43	0,12	0,02			8.355.741,73	9,47
BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1		0,15	0,00	0,04			1.247.837,06	1,41
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
Sub-total	3,73	2,05	1,23		-0,20	0,38	53.190.491,27	60,29

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP		3,01	0,40	0,10			11.749.340,57	13,32
BANESTES INSTITUCIONAL FI RF		2,80	0,21	0,22			6.731.514,67	7,63
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	-0,00	0,01			3.931.070,38	4,46
BANESTES LIQUIDEZ FI RF REFERENCIADO DI		0,06	-0,00	0,06			102.812,81	0,12
BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI		0,06	-0,00	0,06			484.758,08	0,55
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF		0,38	0,04	0,38			9.399.284,74	10,65

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	3,23	1,78	0,65		-0,27	0,25	32.398.781,25	36,72

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 4,22%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO		5,61	0,02	5,96			552.033,95	0,63
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO		3,59	0,03	7,31			1.022.040,49	1,16
Sub-total	6,08	4,22	0,05		-0,17	0,09	1.574.074,44	1,78

Renda Variável

Value-At-Risk: 11,00%

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		11,91	0,01	5,52			147.277,28	0,17
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA		10,92	0,07	2,56			801.657,88	0,91
SCHRODER BEST IDEAS FIA		11,64	0,01	2,40			114.548,71	0,13
Sub-total	21,08	11,00	0,09		-0,17	-2,38	1.063.483,87	1,21