



LDB
EMPRESAS

CORONEL FABRICIANO
JANEIRO 2022



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.01.2022.

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 87,33%

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
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,67	0,61	0,61	1.339.529,41	1,81	6.296.869.255,71	0,02
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,71	0,04	0,04	1.938.800,59	2,63	848.732.387,83	0,23
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,77	0,09	0,09	6.344.570,19	8,59	12.040.160.059,77	0,05
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,62	0,01	0,01	2.987.368,61	4,05	9.258.989.052,65	0,03
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,76	0,10	0,10	1.553.718,72	2,10	1.235.193.585,55	0,13
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	5,10	-0,54	-0,54	6.192.110,79	8,39	1.104.395.418,47	0,56
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,77	0,02	0,02	9.074.877,35	12,29	10.879.369.499,05	0,08
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,77	0,04	0,04	3.434.500,40	4,65	7.461.201.984,89	0,05
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,30	0,67	0,67	8.703.610,99	11,79	11.686.800.915,89	0,07
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI IMA-B 5 TOP RENDA FIXA LP	2,99	0,13	0,13	1.546.964,02	2,10	797.400.240,01	0,19
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,69	0,11	0,11	43.116.051,07	58,39		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	5,71	-0,76	-0,76	3.106.671,53	4,21	2.422.224.309,42	0,13
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	5,71	-0,76	-0,76	8.415.855,84	11,40	815.943.738,86	1,03
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,13	0,61	0,61	9.845.211,52	13,33	870.019.736,18	1,13
CEF	CEF	CAIXA FI RF SIMPLES LP	0,18	0,78	0,78	10,40	0,00	1.574.487.770,55	0,00
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			5,74	-0,13	-0,13	21.367.749,29	28,94		
Renda Fixa			2,95	0,03	0,03	64.483.800,36	87,33		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

REND A VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

7,98%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	19,13	3,68	3,68	2.939.634,00	3,98	1.143.503.101,80	0,26
CEF	CEF	FIC FI EM AÇÕES CAIXA IBOVESPA	20,16	6,76	6,76	1.281.506,16	1,74	137.433.951,40	0,93
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	20,13	5,72	5,72	1.145.358,83	1,55	849.367.313,22	0,13
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	18,37	7,55	7,55	527.567,56	0,71	152.857.254,11	0,35
Sub-total Artigo 8º I			16,25	5,07	5,07	5.894.066,55	7,98		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			16,67	5,07	5,07	5.894.066,55	7,98		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

4,25%

Artigo 10º I (FI ou FIC Multimercado - Aberto)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	5,75	2,67	2,67	3.135.350,75	4,25	1.369.544.454,93	0,23
Sub-total Artigo 10º I			5,75	2,67	2,67	3.135.350,75	4,25		
Investimentos Estruturados			5,06	2,67	2,67	3.135.350,75	4,25		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FII 0,44%

Artigo 11º (FI Imobiliário - Negociados em Bolsa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
PLANNER	PLANNER	CARE11	70,36	-24,91	-24,91	326.618,24	0,44	0,00	
Sub-total Artigo 11º			70,36	-24,91	-24,91	326.618,24	0,44		
FII			88,69	-24,91	-24,91	326.618,24	0,44		
Total			3,78	0,37	0,37	73.839.835,90	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			ALM	Limite Legal
				Mínimo	Objetivo	Máximo		
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	43.116.051,07	58,39	0,00	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	21.367.749,29	28,94	0,00	0,00	0,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	64.483.800,36	87,33					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	5.894.066,55	7,98	0,00	0,00	0,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	5.894.066,55	7,98					30,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	FI ou FIC Multimercado - Aberto	3.135.350,75	4,25	0,00	0,00	0,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	3.135.350,75	4,25					15,00
FII								
Artigo 11º	FI Imobiliário - Negociados em Bolsa	326.618,24	0,44	0,00	0,00	0,00	0,00	5,00
	Total FII	326.618,24	0,44					5,00

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	0,11 14,49	0,11 14,49	3,09 147,20			45.704,65	45.704,65
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-0,13 -18,26	-0,13 -18,26	3,49 166,55			-28.603,90	-28.603,90
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	5,07 -1,91	5,07 -1,91				284.667,98	284.667,98
Artigo 10º I % do CDI	2,67 364,84	2,67 364,84				81.586,16	81.586,16
Artigo 11º % do CDI	-24,91 -3.401,69	-24,91 -3.401,69				-108.349,32	-108.349,32
CORONEL FABRICIANO (Total)						275.005,57	275.005,57

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\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	3.433.196,20	0,00	0,00	0,00	3.434.500,40	1.304,20	1.304,20
BB PREV RF IDKA2	2.987.080,90	0,00	0,00	0,00	2.987.368,61	287,71	287,71
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9.073.170,43	0,00	0,00	0,00	9.074.877,35	1.706,92	1.706,92
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.938.026,04	0,00	0,00	0,00	1.938.800,59	774,55	774,55
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.338.841,28	0,00	0,00	0,00	6.344.570,19	5.728,91	5.728,91
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.331.421,08	0,00	0,00	0,00	1.339.529,41	8.108,33	8.108,33
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	6.225.543,80	0,00	0,00	0,00	6.192.110,79	-33.433,01	-33.433,01
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	8.645.890,45	0,00	0,00	0,00	8.703.610,99	57.720,54	57.720,54
SANTANDER FI IMA-B 5 TOP RENDA FIXA LP	1.544.965,57	0,00	0,00	0,00	1.546.964,02	1.998,45	1.998,45
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	1.552.210,67	0,00	0,00	0,00	1.553.718,72	1.508,05	1.508,05
					43.116.051,07	0,00	0,00

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\$)
BB PREV RF IMA-B	8.480.070,50	0,00	0,00	0,00	8.415.855,84	-64.214,66	-64.214,66
CAIXA FI RF SIMPLES LP	10,32	0,00	0,00	0,00	10,40	0,08	0,08
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	9.785.701,46	0,00	0,00	0,00	9.845.211,52	59.510,06	59.510,06
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	3.130.570,91	0,00	0,00	0,00	3.106.671,53	-23.899,38	-23.899,38
					21.367.749,29	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\$)
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	2.835.180,06	0,00	0,00	0,00	2.939.634,00	104.453,94	104.453,94
FIC FI EM AÇÕES CAIXA IBOVESPA	1.200.331,27	0,00	0,00	0,00	1.281.506,16	81.174,89	81.174,89
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	1.083.377,53	0,00	0,00	0,00	1.145.358,83	61.981,30	61.981,30
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	490.509,71	0,00	0,00	0,00	527.567,56	37.057,85	37.057,85
					5.894.066,55	0,00	0,00

Artigo 10º I (FI ou FIC Multimercado - Aberto)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	3.053.764,59	0,00	0,00	0,00	3.135.350,75	81.586,16	81.586,16
					3.135.350,75	0,00	0,00

Artigo 11º (FI Imobiliário - Negociados em Bolsa)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CARE11	434.967,56	0,00	0,00	0,00	326.618,24	-108.349,32	-108.349,32
					326.618,24	0,00	0,00

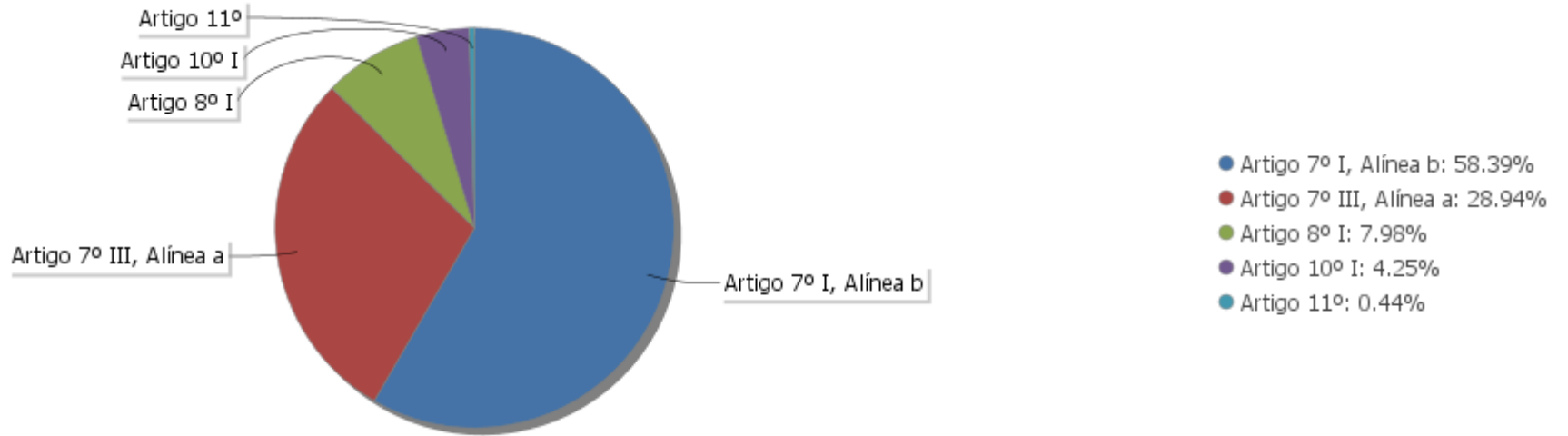
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

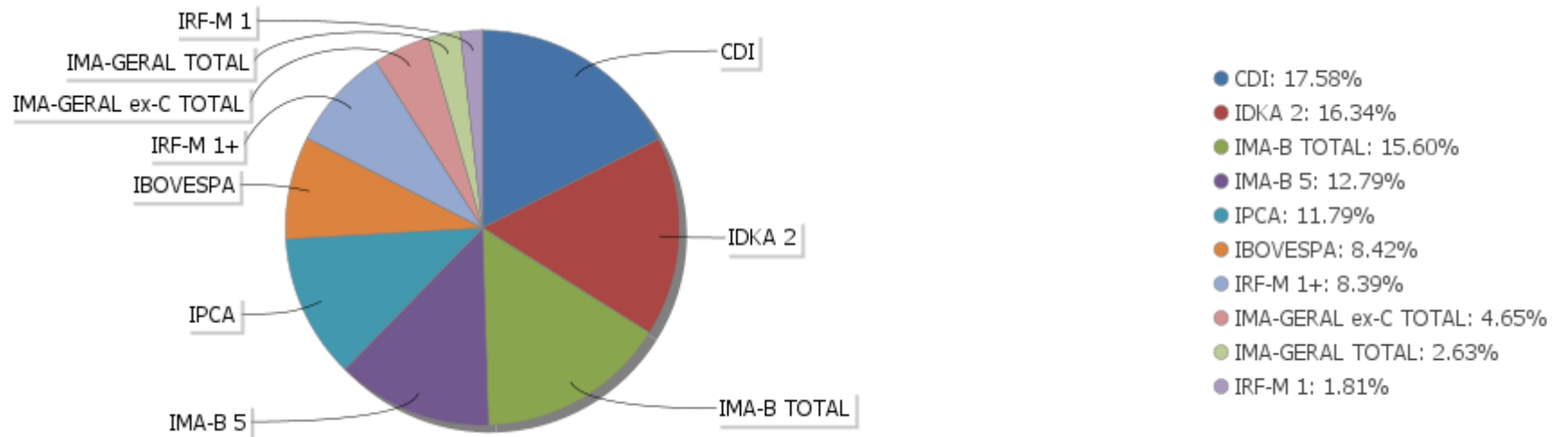
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	69.754.843,07	94,47	69.754.843,07	94,47
de 31 a 365 dias	4.084.992,83	5,53	73.839.835,90	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	73.839.835,90	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

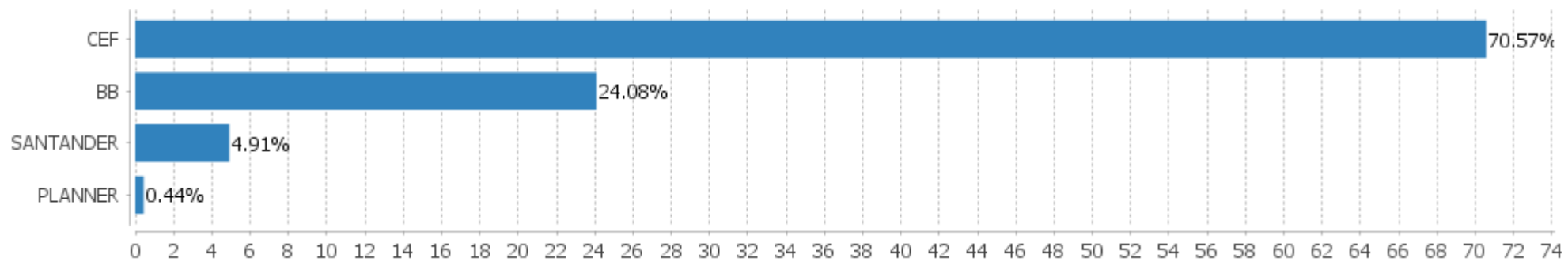


Alocação Por Estratégia



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	0,37												0,37
IPCA + 5,79%	0,95												0,95
p.p. indexador	-0,58												-0,58
2021									-0,26	-2,11	1,55	1,25	0,38
IPCA + 5,79%									1,64	1,70	1,40	1,25	6,12
p.p. indexador									-1,90	-3,81	0,14	-0,00	-5,75

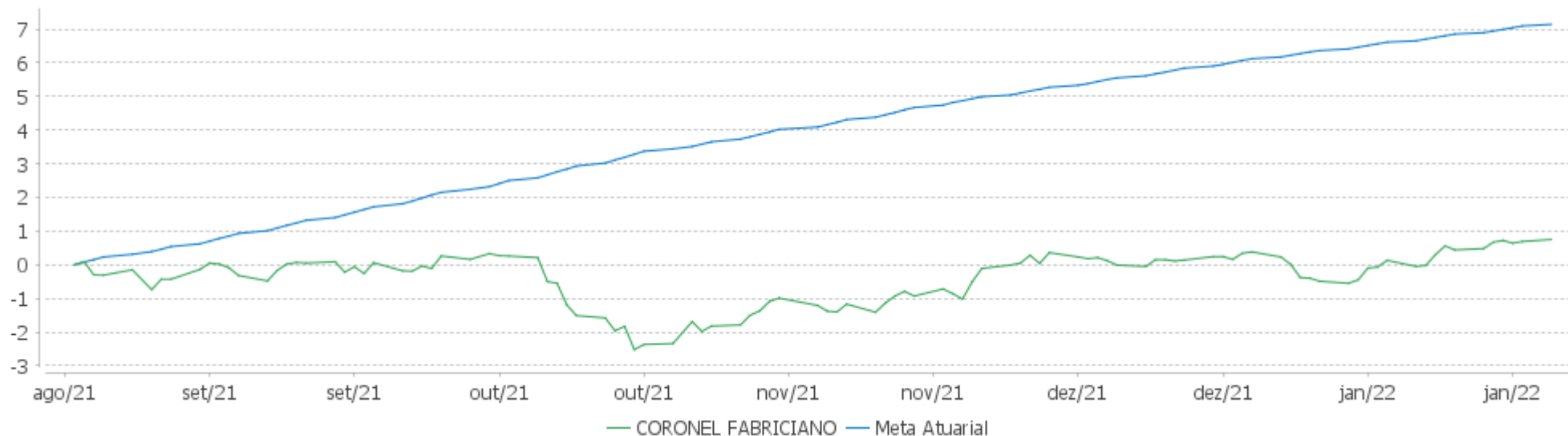
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	1	20,00	03 meses	3,20	3,65	-0,45	3,16
Meses abaixo - Meta Atuarial	4	80,00	06 meses				
			12 meses				
			24 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	1,55	2021-11	Desde 31/08/2021	0,75	7,14	-6,38	3,78
Menor rentabilidade da Carteira	-2,11	2021-10					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	-0,54 -0,04	-0,54 -0,04	3,95 -0,06	-1,62 -0,21	-4,49 -0,37	0,83 -0,57	14,18 -0,99
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,10 -0,02	0,10 -0,02	3,37 -0,05	3,22 -0,11	4,37 -0,21	12,03 -0,45	25,25 -0,78
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,09 -0,02	0,09 -0,02	3,35 -0,08	3,20 -0,12	4,32 -0,25	11,89 -0,59	25,04 -1,00
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,01 -0,04	0,01 -0,04	3,16 -0,25	3,11 -0,18	4,47 -0,40	12,51 -0,97	24,08 -1,89
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,04	0,04	2,70	0,57	0,19	4,20	16,07
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,67 0,19	0,67 0,19	2,42 0,24	0,62 -4,94	0,53 -9,78	6,39 -8,96	21,39 1,21
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,02 -0,03	0,02 -0,03	3,17 -0,24	3,14 -0,15	4,54 -0,33	12,57 -0,90	24,17 -1,81
SANTANDER FI IMA-B 5 TOP RENDA FIXA LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,13 0,02	0,13 0,02	3,34 -0,09	2,85 -0,48	3,60 -0,97	11,29 -1,18	24,50 -1,54
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,61 -0,02	0,61 -0,02	2,25 -0,06	2,44 -0,10	3,30 -0,23	6,63 -0,45	13,45 -0,71
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,04 -0,17	0,04 -0,17	2,85 -0,05	0,97 -0,16	0,85 -0,57	4,72 -1,26	16,00 -1,98
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,76 -0,02	-0,76 -0,02	2,89 -0,05	-1,02 -0,12	-1,37 -0,23	3,29 -0,73	21,64 -1,22
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,76 -0,03	-0,76 -0,03	2,84 -0,10	-1,05 -0,15	-1,38 -0,23	3,43 -0,59	21,70 -1,16
CAIXA FI RF SIMPLES LP % do CDI	0,71 97,33	0,71 97,33	1,84 87,92	2,97 85,43	3,71 74,22	4,47 58,33	8,86 63,72
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,61 83,05	0,61 83,05	1,72 82,11	2,77 79,83	3,83 76,60	5,57 72,72	10,75 77,30
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES Var. IBOVESPA p.p.	7,55 0,57	7,55 0,57	10,41 2,06	0,23 8,16	5,17 7,71		
FIC FI EM AÇÕES CAIXA IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	6,76 -0,22	6,76 -0,22	7,85 -0,50	-8,68 -0,75	-4,24 -1,70		
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	5,72	5,72	5,48	-12,94	-8,27	-12,36	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Varição da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-1,26	-1,26	-2,87	-5,01	-5,73	-10,94	
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	3,68	3,68	6,98	-3,28	4,59	6,18	28,39
Var. IBOVESPA p.p.	-3,30	-3,30	-1,38	4,64	7,13	7,60	13,25
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	2,67	2,67	4,10	0,38	2,42	4,65	14,82
% do CDI	364,84	364,84	195,52	10,91	48,34	60,73	106,62
CARE11	-24,91	-24,91	-18,43	-45,85	-39,02	-63,41	-75,96
Var. IBOVESPA p.p.	-31,89	-31,89	-26,78	-37,92	-36,48	-61,99	-91,10
CORONEL FABRICIANO	0,37	0,37	3,20				
Var. IPCA + 5,79% p.p.	-0,58	-0,58	-0,45				
CDI	0,73	0,73	2,10	3,47	5,00	7,66	13,90
IBOVESPA	6,98	6,98	8,35	-7,93	-2,54	-1,42	15,14
INPC + 6,00%							
IPCA + 6,00%	0,97	0,97	3,70	8,71	16,93	29,51	43,07

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32	20.000000000000	2,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du	0,00	0,30
BB PREV RF IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,20
BB PREV RF IMA-B	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du	0,00	0,30
CAIXA FI RF SIMPLES LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	1,50
CARE11	Não se aplica	Não se aplica				
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,80
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+1 du	D+3 du	0,00	1,00
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,40
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FIC FI EM AÇÕES CAIXA IBOVESPA			D+1 du	D+3 du	0,00	4,00
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	D+1 du	D+0	D+23 du	D+25 du	0,00	1,50
SANTANDER FI IMA-B 5 TOP RENDA FIXA LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du	20.000000000000	0,30
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES			D+1 du	D+3 du	0,00	1,10
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	0,00	0,10

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	0,63	0,63	2,31	2,54	3,53	7,08	14,16	22,11	34,75
IRF-M 1+	-0,50	-0,50	4,01	-1,41	-4,13	1,40	15,16	29,50	49,44
IRF-M TOTAL	-0,08	-0,08	3,63	-0,03	-1,28	3,58	15,45	27,96	45,98
IMA-B 5	0,11	0,11	3,42	3,32	4,57	12,47	26,04	38,75	56,48
IMA-B 5+	-1,61	-1,61	2,45	-4,92	-6,47	-3,03	18,62	39,06	60,95
IMA-B TOTAL	-0,73	-0,73	2,94	-0,91	-1,15	4,02	22,86	40,20	60,52
IMA-GERAL TOTAL	0,21	0,21	2,90	1,13	1,42	5,98	17,98	30,01	46,61
IDKA 2	0,05	0,05	3,41	3,29	4,87	13,47	25,98	38,94	57,36
IDKA 20	-2,92	-2,92	0,64	-12,61	-14,59	-13,99	10,19	35,73	59,77
CDI	0,73	0,73	2,10	3,47	5,00	7,66	13,90	21,17	32,56

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,98	6,98	8,35	-7,93	-2,54	-1,42	15,14	32,07	73,41
IBRX 100	6,87	6,87	8,36	-9,14	-2,11	-0,51	18,37	36,58	79,96
IBRX 50	7,65	7,65	9,69	-8,20	-0,93	1,71	16,71	32,14	74,76
SMALL CAP	3,42	3,42	4,89	-17,43	-10,25	-14,29	24,49	41,16	97,42
IFIX	-0,99	-0,99	3,78	-1,67	-3,56	-9,76	15,24	21,52	43,53
Índice Consumo - ICON			-5,43	-22,83	-23,46	-26,51	5,30	5,50	37,84
Índice Dividendos - IDIV	7,47	7,47	10,17	0,27	5,96	1,18	28,50	52,53	93,40

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	0,48	0,48	2,18	5,56	10,31	15,34	20,18	24,72	28,28
INPC									
IGPM	1,82	1,82	2,72	3,40	16,91	46,97	58,45	69,12	68,43
SELIC	0,73	0,73	2,10	3,47	5,00	7,66	13,90	21,18	32,59

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	-9,05	-9,05	-6,91	7,47	18,94	75,67	144,98	170,90	239,48
MSCI ACWI	-8,76	-8,76	-8,61	3,62	9,17	61,14	114,25	124,36	183,76
MSCI World									

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,81	0,81	3,20	7,67	14,73	24,70	35,14	45,81	55,90
IPCA + 5,00%	0,89	0,89	3,45	8,19	15,83	27,09	39,07	51,48	63,50
IPCA + 5,50%	0,93	0,93	3,57	8,45	16,38	28,30	41,06	54,37	67,41
IPCA + 5,89%	0,96	0,96	3,67	8,65	16,81	29,24	42,62	56,66	70,51
IPCA + 6,00%	0,97	0,97	3,70	8,71	16,93	29,51	43,07	57,31	71,39
INPC + 4,00%									
INPC + 6,00%									

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
	Total					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.197.410,66

Value-At-Risk: 1,62%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CORONEL FABRICIANO		1,62	1,62			73.839.835,90	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,19%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,63	0,01	0,02			1.339.529,41	1,81
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,22	0,03	0,10			1.938.800,59	2,63
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,06	0,07	0,01			6.344.570,19	8,59
BB PREV RF IDKA2		1,36	0,04	0,38			2.987.368,61	4,05
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI		1,07	0,02	0,01			1.553.718,72	2,10
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,52	0,17	0,03			6.192.110,79	8,39
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,60	0,14	0,26			9.074.877,35	12,29
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,11	0,04	1,75			3.434.500,40	4,65
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,74	0,06	0,77			8.703.610,99	11,79
SANTANDER FI IMA-B 5 TOP RENDA FIXA LP		1,24	0,02	0,20			1.546.964,02	2,10
Sub-total	2,16	1,27	0,59		-0,29	0,11	43.116.051,07	58,39

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		2,19	0,07	0,07			3.106.671,53	4,21
BB PREV RF IMA-B		2,14	0,18	0,03			8.415.855,84	11,40
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,04	0,00	0,00			9.845.211,52	13,33
CAIXA FI RF SIMPLES LP		0,05	0,00	0,03			10,40	0,00
Sub-total	2,30	1,16	0,25		-0,38	-0,13	21.367.749,29	28,94

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável e Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 10,40%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES VALOR FIC FIA		10,41	0,32	2,92			2.939.634,00	3,98
FIC FI EM AÇÕES CAIXA IBOVSPA		10,63	0,14	0,20			1.281.506,16	1,74
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR		12,05	0,15	4,39			1.145.358,83	1,55
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES		9,38	0,05	3,95			527.567,56	0,71
Sub-total	16,25	10,40	0,66		0,27	5,07	5.894.066,55	7,98

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 3,10%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO		3,10	0,10	3,09			3.135.350,75	4,25
Sub-total	5,06	3,10	0,10		0,38	2,67	3.135.350,75	4,25

FII

Value-At-Risk: 38,50%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CARE11		38,50	0,01	38,75			326.618,24	0,44
Sub-total	88,69	38,50	0,01		-0,29	-24,91	326.618,24	0,44