



LDB
EMPRESAS

CORONEL FABRICIANO
OUTUBRO 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 29.10.2021.

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

86,86%

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
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,58	-0,54	-0,16	1.309.999,48	1,93	6.589.712.896,46	0,02
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,61	-1,44	-1,45	1.885.107,48	2,78	1.005.905.268,08	0,19
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,69	-1,24	-0,28	6.139.065,43	9,05	10.998.044.937,35	0,06
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,50	-1,25	-0,23	2.895.790,01	4,27	9.253.803.912,06	0,03
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,68	-1,25	-0,28	1.503.067,95	2,22	1.192.878.203,57	0,13
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	4,97	-3,49	-4,25	5.956.977,61	8,79	1.356.658.213,03	0,44
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,65	-1,29	-0,23	8.795.814,09	12,97	11.036.712.361,17	0,08
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,84	-1,63	-1,63	3.344.111,61	4,93	7.937.028.591,03	0,04
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,40	-0,66	-0,31	8.498.099,79	12,53	13.374.488.418,39	0,06
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI IMA-B 5 TOP RENDA FIXA LP	2,96	-1,42	-0,50	1.497.016,58	2,21	990.342.348,90	0,15
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,20	-1,49	-1,02	41.825.050,03	61,69		

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
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	5,59	-2,55	-2,69	3.020.880,33	4,46	2.549.734.484,26	0,12
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			5,59	-2,55	-2,69	3.020.880,33	4,46		

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
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	5,61	-2,59	-2,72	8.179.518,43	12,06	1.089.006.458,36	0,75
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,08	0,38	0,71	5.864.803,94	8,65	615.231.424,98	0,95
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA FI RF SIMPLES LP	0,12	0,49	0,78	10,21	0,00	1.926.894.566,10	0,00
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			3,85	-1,46	-1,43	14.044.332,58	20,71		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

3,43

-1,54

-1,25

58.890.262,94

86,86

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

13,14%

Artigo 8º I, Alínea a (Fundos de Ações Referenciados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI EM AÇÕES CAIXA IBOVSPA	20,71	-6,87	-13,05	1.188.205,76	1,75	131.204.472,32	0,91
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			20,71	-6,87	-13,05	1.188.205,76	1,75		

Artigo 8º II, Alínea a (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	20,43	-5,54	-7,92	2.747.959,73	4,05	1.091.836.208,84	0,25
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	19,20	-10,13	-15,09	1.085.894,10	1,60	862.345.754,21	0,13
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	19,05	-4,48	-8,60	477.820,33	0,70	155.505.778,90	0,31
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			24,33	-6,63	-9,91	4.311.674,16	6,36		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	5,78	-1,47	-3,03	3.011.863,45	4,44	1.671.301.254,91	0,18
Sub-total Artigo 8º III			5,78	-1,47	-3,03	3.011.863,45	4,44		

Artigo 8º IV, Alínea b (Fundos de Investimentos Imobiliários)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
PLANNER	PLANNER	CARE11	49,48	-20,31	-29,98	400.422,42	0,59	285.292.727,14	0,14
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b			49,48	-20,31	-29,98	400.422,42	0,59		

Renda Variável

18,39 -5,72 -9,66 8.912.165,79 13,14

Total

4,43 -2,11 -2,37 67.802.428,73 100,00

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	41.825.050,03	61,69	10,03	55,16	70,26	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	3.020.880,33	4,46	0,00	0,00	3,55	0,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	14.044.332,58	20,71	3,59	17,93	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	58.890.262,94	86,86					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	1.188.205,76	1,75	0,00	0,00	2,01	0,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	4.311.674,16	6,36	3,58	17,91	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	3.011.863,45	4,44	3,14	3,14	10,00	0,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	400.422,42	0,59	0,00	1,22	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Variável	8.912.165,79	13,14					30,00

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	-1,49 -309,73	-1,02 -110,85				-631.733,73	-431.268,86
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-2,55 -531,54	-2,69 -292,42				-79.159,12	-83.582,39
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-1,46 -304,61	-1,43 -155,77				-198.074,27	-194.194,65
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-6,87 -0,13	-13,05 -0,19				-87.597,01	-178.409,36
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-6,63 0,11	-9,91 2,95				-306.028,02	-474.483,17
Artigo 8º III % do CDI	-1,47 -306,36	-3,03 -328,63				-44.988,93	-93.974,44
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	-20,31 -13,57	-29,98 -17,11				-102.068,46	-171.414,56
CORONEL FABRICIANO (Total)						-1.449.649,54	-1.627.327,43

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	3.399.397,11	0,00	0,00	0,00	3.344.111,61	-55.285,50	-55.466,09
BB PREV RF IDKA2	2.932.527,52	0,00	0,00	0,00	2.895.790,01	-36.737,51	-6.741,40
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8.910.966,07	0,00	0,00	0,00	8.795.814,09	-115.151,98	-20.088,86
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.216.400,02	0,00	0,00	0,00	6.139.065,43	-77.334,59	-16.940,17
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.912.565,58	0,00	0,00	0,00	1.885.107,48	-27.458,10	-27.779,59
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.317.054,52	0,00	0,00	0,00	1.309.999,48	-7.055,04	-2.092,71
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	6.172.600,99	0,00	0,00	0,00	5.956.977,61	-215.623,38	-264.117,25
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	8.554.665,81	0,00	0,00	0,00	8.498.099,79	-56.566,02	-26.308,32
SANTANDER FI IMA-B 5 TOP RENDA FIXA LP	1.518.512,16	0,00	0,00	0,00	1.497.016,58	-21.495,58	-7.571,41
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	1.522.093,98	0,00	0,00	0,00	1.503.067,95	-19.026,03	-4.163,06

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					41.825.050,03	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\$)
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	3.100.039,45	0,00	0,00	0,00	3.020.880,33	-79.159,12	-83.582,39
					3.020.880,33	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IMA-B	8.397.023,71	0,00	0,00	0,00	8.179.518,43	-217.505,28	-228.450,13
CAIXA FI RF SIMPLES LP	10,16	0,00	0,00	0,00	10,21	0,05	0,08
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	5.091.636,28	883.967,69	-130.230,99	0,00	5.864.803,94	19.430,96	34.255,40
					14.044.332,58	0,00	0,00

Artigo 8º I, Alínea a (Fundos de Ações Referenciados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC FI EM AÇÕES CAIXA IBOVSPA	1.275.802,77	0,00	0,00	0,00	1.188.205,76	-87.597,01	-178.409,36
					1.188.205,76	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	2.909.170,70	0,00	0,00	0,00	2.747.959,73	-161.210,97	-236.466,91
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	1.208.298,58	0,00	0,00	0,00	1.085.894,10	-122.404,48	-193.054,86
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	500.232,90	0,00	0,00	0,00	477.820,33	-22.412,57	-44.961,40
					4.311.674,16	0,00	0,00

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	3.056.852,38	0,00	0,00	0,00	3.011.863,45	-44.988,93	-93.974,44
					3.011.863,45	0,00	0,00

Artigo 8º IV, Alínea b (Fundos de Investimentos Imobiliários)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CARE11	502.490,88	0,00	0,00	0,00	0,00	400.422,42	-102.068,46	-171.414,56
						400.422,42	0,00	0,00

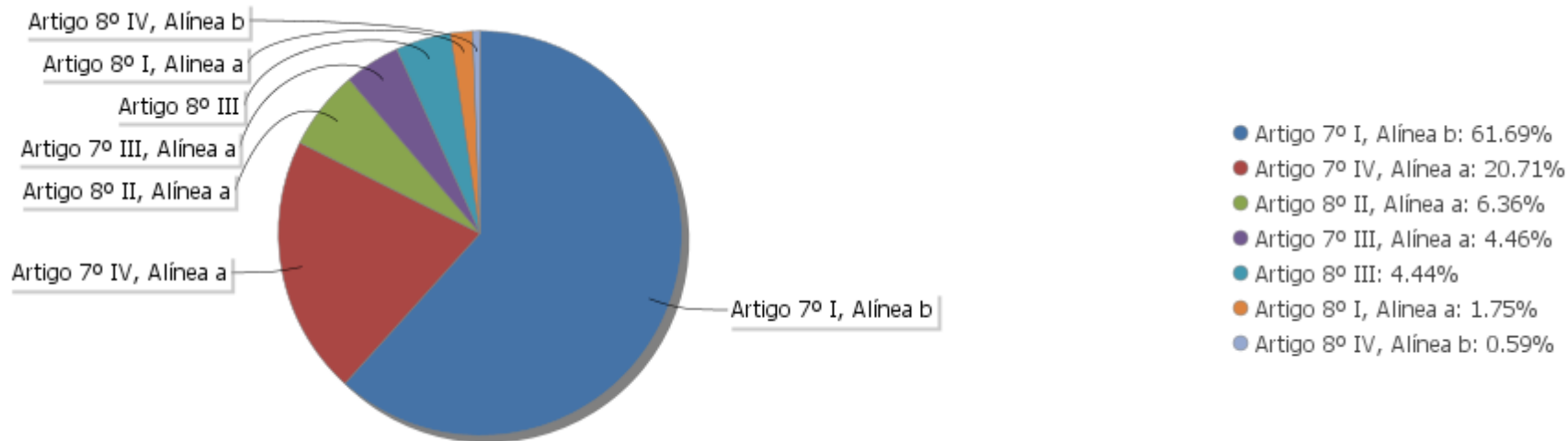
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

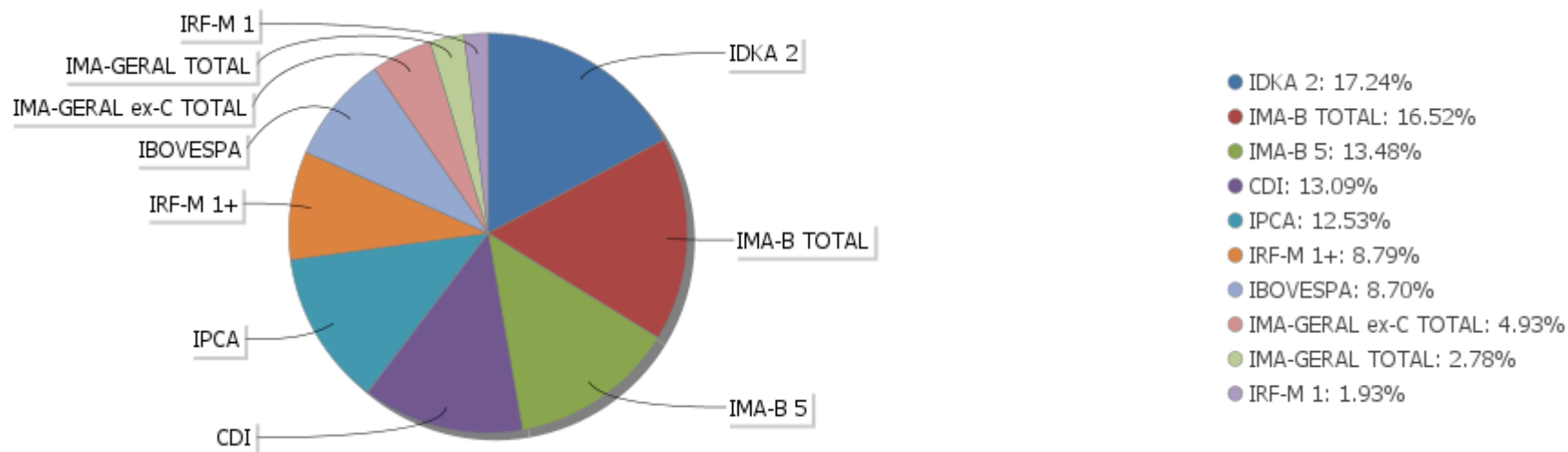
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	63.968.574,90	94,35	63.968.574,90	94,35
de 31 a 365 dias	3.833.853,83	5,65	67.802.428,73	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	67.802.428,73	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

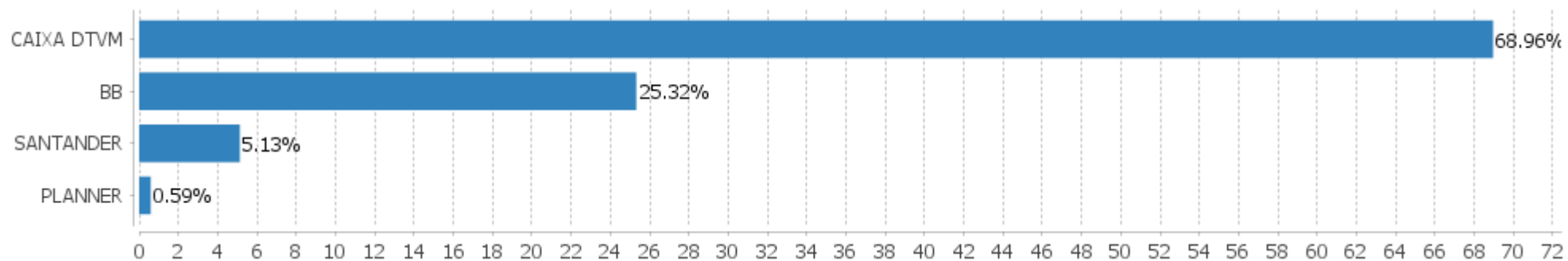


Alocação Por Estratégia



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									-0,26	-2,11			-2,37
IPCA + 5,79%									1,64	1,70			3,37
p.p. indexador									-1,90	-3,81			-5,74

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	0	0,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	2	100,00

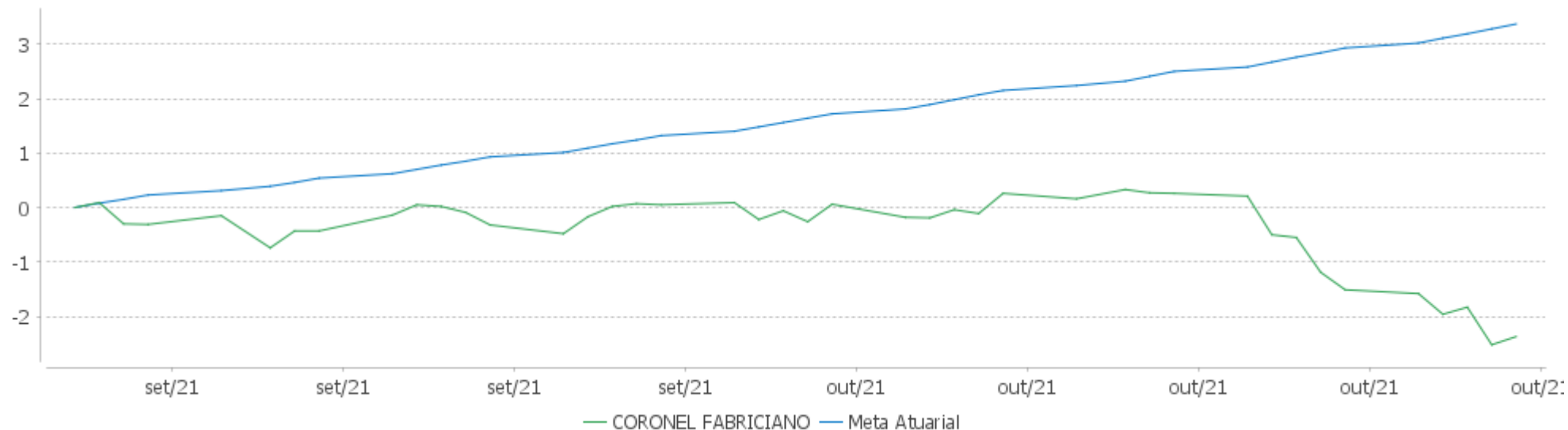
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	-0,26	2021-09
Menor rentabilidade da Carteira	-2,11	2021-10

Relatório

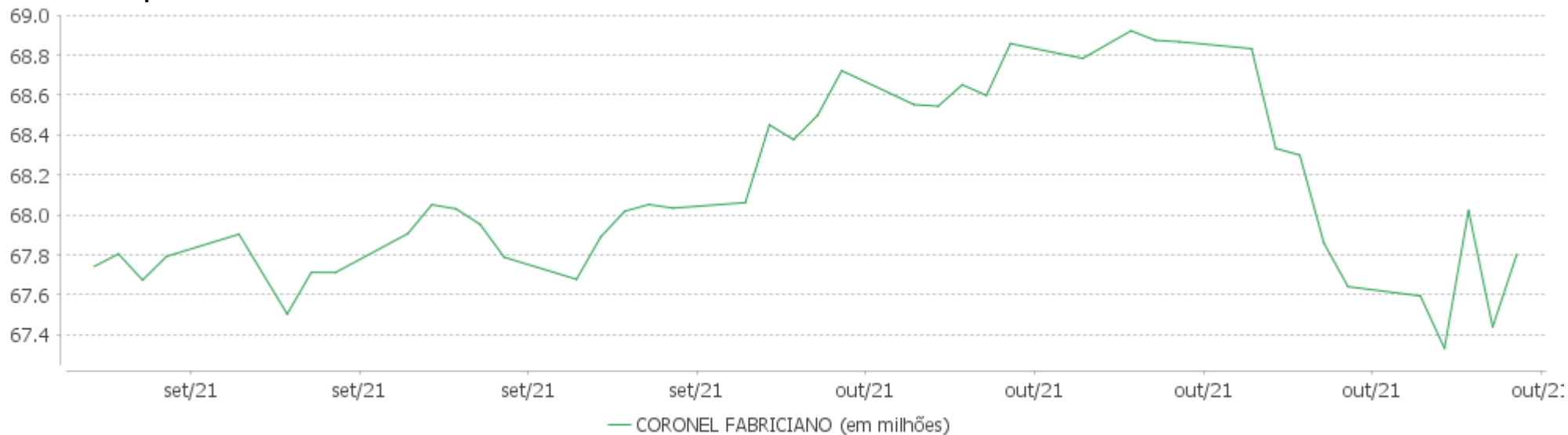
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses				
06 meses				
12 meses				
24 meses				
Desde 31/08/2021	-2,37	3,37	-5,74	4,43

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

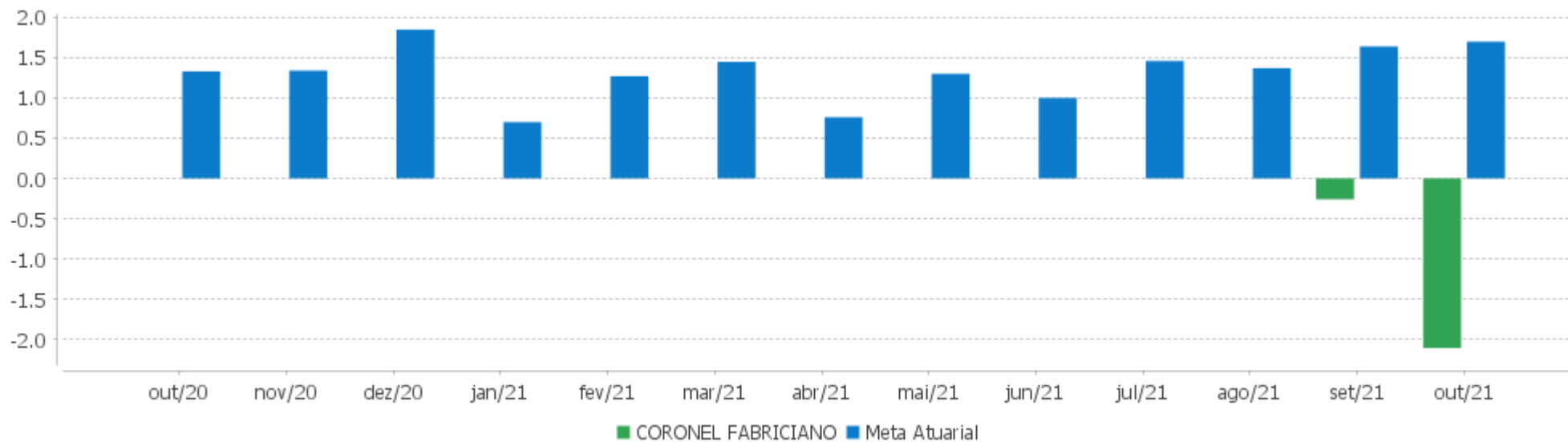


Patrimônio Líquido



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
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,59 -0,05	-4,97 -0,18	-3,80 -0,07	-2,78 -0,10	1,54 -0,29	0,12 -0,69	26,49 -1,27
CAIXA FI RF SIMPLES LP % do CDI	0,43 89,45	1,94 64,68	1,10 81,84	1,76 76,78	2,14 64,26	3,34 50,20	8,13 61,26
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,38 78,48	2,16 71,94	1,03 76,63	1,73 75,51	2,33 70,23	4,75 71,33	10,32 77,70
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,55 -0,01	-4,95 -0,16	-3,78 -0,05	-2,72 -0,05	1,61 -0,22	0,21 -0,60	26,61 -1,15
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	-3,49 -0,05	-9,40 -0,29	-5,35 -0,14	-5,88 -0,27	-6,24 -0,34	-2,10 -0,56	15,08 -1,05
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	-1,25 -0,01	1,05 -0,17	-0,15 -0,05	0,38 -0,11	4,21 -0,22	9,95 -0,44	24,83 -0,78
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	-1,24 -0,01	1,03 -0,19	-0,14 -0,05	0,39 -0,10	4,19 -0,24	9,79 -0,60	24,71 -0,90
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	-1,25 0,21	1,45 -0,11	-0,05 0,07	0,61 0,35	4,38 -0,24	10,97 -0,69	23,36 -1,76
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-1,63 -0,27	-2,98 -0,88	-2,07 -0,40	-1,74 -0,78	0,17 -0,50	1,97 -0,88	17,51 -0,37
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,66 -1,91	-1,82 -10,05	-1,75 -5,07	-2,29 -8,02	0,30 -10,38	4,82 -10,19	24,02 6,09
SANTANDER FI IMA-B 5 TOP RENDA FIXA LP Var. IMA-B 5 p.p.	-1,42 -0,18	0,18 -1,04	-0,47 -0,38	-0,13 -0,62	3,56 -0,87	9,07 -1,32	24,27 -1,34
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	-1,29 0,17	1,46 -0,10	-0,03 0,09	0,46 0,21	4,40 -0,22	10,83 -0,83	23,45 -1,67
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	-0,54 0,00	1,05 -0,18	0,18 -0,04	0,71 -0,12	1,55 -0,22	5,47 -0,44	12,78 -0,69
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-1,44 -0,13	-2,39 -0,71	-1,82 -0,11	-1,21 -0,35	0,36 -0,69	2,47 -1,28	17,16 -1,95
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-4,48 2,26	-9,60 3,43	-9,22 5,80	-8,12 4,83	12,09 1,93		
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	-10,13 -3,39	-15,27 -2,24	-17,46 -2,43	-16,11 -3,16	2,63 -7,53	-4,49 -1,02	
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	-5,54	-7,69	-9,59	-7,38	19,55	9,52	44,24

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.	1,20	5,35	5,43	5,56	9,39	12,98	25,85
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO % do CDI	-1,47 -306,36	-2,19 -72,86	-3,57 -265,02	-2,17 -94,46	4,35 130,85	3,64 54,66	14,96 112,66
FIC FI EM AÇÕES CAIXA IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	-6,87 -0,13	-14,25 -1,21	-15,33 -0,30	-13,65 -0,70	8,03 -2,13		
CARE11 Var. IBOVESPA p.p.	-20,31 -13,57	-26,15 -13,12	-33,47 -18,44	-31,26 -18,31	-34,57 -44,73	-61,42 -57,96	-72,65 -91,04
CORONEL FABRICIANO Var. IPCA + 5,79% p.p.	-2,11 -3,81	-2,37 -5,74					
CDI	0,48	3,00	1,35	2,29	3,32	6,65	13,28
IBOVESPA	-6,74	-13,04	-15,02	-12,95	10,16	-3,47	18,39
INPC + 6,00%	1,63	13,79	4,79	9,12	17,69	30,64	42,02
IPCA + 6,00%	1,72	13,57	4,83	8,88	17,26	29,10	40,32

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		2,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA-B	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,30
CAIXA FI RF SIMPLES LP	D+0	D+0	D+0	D+0		1,50
CARE11	Não se aplica	Não se aplica				
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,80
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIC FI EM AÇÕES CAIXA IBOVESPA			D+1 du	D+3 du		4,00
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	D+1 du	D+0	D+23 du	D+25 du		1,50
SANTANDER FI IMA-B 5 TOP RENDA FIXA LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,30
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES			D+1 du	D+3 du		1,10
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		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	-0,54	1,23	0,23	0,83	1,78	5,91	13,47	21,48	36,42
IRF-M 1+	-3,44	-9,10	-5,21	-5,61	-5,90	-1,54	16,13	28,17	50,67
IRF-M TOTAL	-2,63	-5,50	-3,53	-3,59	-3,30	0,99	15,83	26,75	47,22
IMA-B 5	-1,24	1,22	-0,10	0,49	4,43	10,39	25,61	37,29	55,80
IMA-B 5+	-3,87	-10,25	-7,19	-5,85	-1,01	-6,80	27,68	41,57	63,18
IMA-B TOTAL	-2,54	-4,79	-3,73	-2,67	1,83	0,81	27,76	40,92	61,47
IMA-GERAL TOTAL	-1,31	-1,68	-1,71	-0,86	1,05	3,75	19,11	29,71	47,78
IDKA 2	-1,47	1,56	-0,12	0,25	4,62	11,66	25,12	37,32	56,68
IDKA 20	-6,31	-17,52	-13,17	-11,45	-5,06	-17,66	27,75	43,34	67,23
CDI	0,48	3,00	1,35	2,29	3,32	6,65	13,28	20,70	34,10

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-6,74	-13,04	-15,02	-12,95	10,16	-3,47	18,39	39,29	59,42
IBRX 100	-6,81	-12,40	-16,15	-14,19	10,40	-1,79	22,56	43,44	64,83
IBRX 50	-6,27	-12,20	-16,31	-13,99	11,64	-2,23	17,51	38,33	58,04
SMALL CAP	-12,53	-17,37	-21,28	-20,14	3,62	-2,77	38,93	46,64	90,99
IFIX	-1,47	-6,78	-5,26	-6,48	-3,29	-4,17	19,32	20,19	41,88
Índice Consumo - ICON	-9,73	-20,10	-18,41	-17,11	-8,62	-10,39	29,95	16,52	35,92
Índice Dividendos - IDIV	-4,23	-8,71	-8,99	-7,55	13,78	1,74	41,65	49,00	84,75

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	1,25	8,24	3,32	5,73	10,67	15,01	17,92	23,30	26,63
INPC	1,16	8,45	3,27	5,96	11,08	16,38	19,35	24,13	26,41
IGPM	0,64	16,74	0,66	6,24	21,73	47,21	51,84	68,23	65,87
SELIC	0,48	3,00	1,35	2,29	3,32	6,65	13,28	20,71	34,13

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	10,92	33,14	15,45	15,03	37,70	113,67	157,78	207,96	284,24
MSCI ACWI	8,97	25,22	13,38	10,89	32,23	96,53	133,44	158,41	221,64

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,57	11,80	4,33	7,84	15,06	24,32	32,57	44,11	53,90
IPCA + 5,00%	1,64	12,68	4,58	8,36	16,16	26,70	36,41	49,70	61,40
IPCA + 5,50%	1,68	13,13	4,71	8,62	16,71	27,90	38,35	52,55	65,25
IPCA + 5,89%	1,71	13,47	4,80	8,82	17,14	28,84	39,89	54,81	68,31
IPCA + 6,00%	1,72	13,57	4,83	8,88	17,26	29,10	40,32	55,45	69,18
INPC + 4,00%	1,48	12,02	4,29	8,08	15,49	25,80	34,17	45,08	53,62
INPC + 6,00%	1,63	13,79	4,79	9,12	17,69	30,64	42,02	56,50	68,89

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
10	01/10/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	209,00	109,11872274	1,9153450000
11	04/10/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.632,00	851,90836347	1,9156990000
12	13/10/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	20.929,83	0,00	10.913,29310382	1,9178290000
13	14/10/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	8.460,00	4.410,42152369	1,9181840000
14	19/10/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	11.932,00	6.216,99241790	1,9192560000
15	22/10/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	100,00	52,07446440	1,9203270000
16	27/10/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	603.797,06	0,00	314.248,49588841	1,9214000000
17	28/10/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	107.897,99	56.145,60768215	1,9217530000
18	29/10/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	259.240,80	0,00	134.866,01359893	1,9222100000
Total			883.967,69	130.230,99		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.278.559,42

Value-At-Risk: 1,89%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CORONEL FABRICIANO		1,89	1,89			67.802.428,73	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,53%

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		0,56	0,01	0,02			1.309.999,48	1,93
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,42	0,04	0,07			1.885.107,48	2,78
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,44	0,11	0,01			6.139.065,43	9,05
BB PREV RF IDKA2		1,51	0,05	0,56			2.895.790,01	4,27
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI		1,43	0,03	0,01			1.503.067,95	2,22
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP		2,23	0,17	0,02			5.956.977,61	8,79
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,56	0,16	0,55			8.795.814,09	12,97
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,64	0,07	0,30			3.344.111,61	4,93
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,42	0,14	1,42			8.498.099,79	12,53
SANTANDER FI IMA-B 5 TOP RENDA FIXA LP		1,61	0,03	0,19			1.497.016,58	2,21
Sub-total	4,16	1,47	0,80		-0,47	-1,49	41.825.050,03	61,69

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		2,76	0,11	0,06			3.020.880,33	4,46
Sub-total	7,57	2,76	0,11		-0,40	-2,55	3.020.880,33	4,46

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IMA-B		2,76	0,29	0,04			8.179.518,43	12,06

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,02	-0,00	0,02			5.864.803,94	8,65
CAIXA FI RF SIMPLES LP		0,05	0,00	0,05			10,21	0,00
Sub-total	4,58	1,61	0,29		-0,42	-1,46	14.044.332,58	20,71

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,90%

Artigo 8º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI EM AÇÕES CAIXA IBOVESPA		9,73	0,13	0,23			1.188.205,76	1,75
Sub-total	25,11	9,73	0,13		-0,29	-6,87	1.188.205,76	1,75

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES VALOR FIC FIA		9,56	0,29	2,50			2.747.959,73	4,05
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR		11,23	0,14	3,36			1.085.894,10	1,60
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES		8,45	0,04	3,50			477.820,33	0,70
Sub-total	24,14	9,65	0,47		-0,29	-6,63	4.311.674,16	6,36

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO		2,79	0,10	2,79			3.011.863,45	4,44
Sub-total	7,19	2,79	0,10		-0,27	-1,47	3.011.863,45	4,44

Artigo 8º IV, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CARE11		2,01	-0,00	9,73			400.422,42	0,59
Sub-total	80,60	2,01	-0,00		-0,26	-20,31	400.422,42	0,59

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

-Referente ao mês de outubro de 2021, vale observar que:

- O Instituto está com 4,46% dos recursos garantidores alocados no Artigo 7º III, Alínea a, limite este, superior ao limite estipulado na Política de Investimento;