



**LDB**  
EMPRESAS

**CORONEL FABRICIANO**  
DEZEMBRO 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 31.12.2021.

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

87,63%

## 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	0,64	0,85	1,47	1.331.421,08	1,81	6.465.382.741,43	0,02
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,73	0,94	1,31	1.938.026,04	2,63	1.012.379.189,72	0,19
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,78	0,77	2,97	6.338.841,28	8,62	12.444.051.491,75	0,05
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,61	0,71	2,91	2.987.080,90	4,06	9.277.694.744,55	0,03
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,77	0,77	2,98	1.552.210,67	2,11	1.144.893.205,94	0,14
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	5,10	2,27	0,07	6.225.543,80	8,46	1.203.780.064,86	0,52
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,76	0,72	2,92	9.073.170,43	12,33	10.998.710.156,34	0,08
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,84	0,91	0,99	3.433.196,20	4,67	7.701.081.218,58	0,04
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,33	0,83	1,43	8.645.890,45	11,75	12.561.638.596,69	0,07
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI IMA-B 5 TOP RENDA FIXA LP	3,02	0,72	2,68	1.544.965,57	2,10	860.870.698,51	0,18
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>2,82</b>	<b>1,00</b>	<b>1,93</b>	<b>43.070.346,42</b>	<b>58,55</b>		

## 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	5,79	0,22	0,84	3.130.570,91	4,26	2.563.016.894,45	0,12
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>5,79</b>	<b>0,22</b>	<b>0,84</b>	<b>3.130.570,91</b>	<b>4,26</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
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	5,80	0,21	0,86	8.480.070,50	11,53	1.098.154.442,70	0,77
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,12	0,63	1,83	9.785.701,46	13,30	877.330.736,27	1,12
CEF	CEF	CAIXA FI RF SIMPLES LP	0,15	0,58	1,91	10,32	0,00	1.681.053.290,68	0,00
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>3,76</b>	<b>0,45</b>	<b>1,19</b>	<b>18.265.782,28</b>	<b>24,83</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

3,13

0,81

1,64

64.466.699,61

87,63

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

12,37%

## 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
CEF	CEF	FIC FI EM AÇÕES CAIXA IBOVSPA	20,65	2,71	-12,17	1.200.331,27	1,63	127.925.994,66	0,94
<b>Sub-total Artigo 8º I, Alínea a</b>			<b>20,65</b>	<b>2,71</b>	<b>-12,17</b>	<b>1.200.331,27</b>	<b>1,63</b>		

## 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	20,03	4,08	-5,00	2.835.180,06	3,85	1.098.659.963,05	0,26
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	19,96	2,19	-15,29	1.083.377,53	1,47	826.907.180,52	0,13
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	18,88	1,72	-6,17	490.509,71	0,67	148.880.160,43	0,33
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>22,01</b>	<b>3,34</b>	<b>-7,88</b>	<b>4.409.067,30</b>	<b>5,99</b>		

## Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

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	5,87	1,27	-1,68	3.053.764,59	4,15	1.426.442.696,60	0,21
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>5,87</b>	<b>1,27</b>	<b>-1,68</b>	<b>3.053.764,59</b>	<b>4,15</b>		

## 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	65,66	58,29	-23,94	434.967,56	0,59	284.489.229,68	0,15
<b>Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b</b>			<b>65,66</b>	<b>58,29</b>	<b>-23,94</b>	<b>434.967,56</b>	<b>0,59</b>		

## Renda Variável e Investimentos Estruturados

16,70 4,27 -7,77 9.098.130,72 12,37

## Total

3,99 1,25 0,38 73.564.830,33 100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			ALM	Limite Legal
				Mínimo	Objetivo	Máximo		
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	43.070.346,42	58,55	10,03	55,16	70,26	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	3.130.570,91	4,26	0,00	0,00	3,55	0,00	60,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	18.265.782,28	24,83	3,59	17,93	40,00	0,00	40,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>64.466.699,61</b>	<b>87,63</b>					100,00
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	1.200.331,27	1,63	0,00	0,00	2,01	0,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	4.409.067,30	5,99	3,58	17,91	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	3.053.764,59	4,15	3,14	3,14	10,00	0,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea b	Fundos de Investimentos Imobiliários	434.967,56	0,59	0,00	1,22	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>9.098.130,72</b>	<b>12,37</b>					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	1,00 130,84	1,93 84,20	1,45 78,47			426.031,25	814.027,53
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,22 28,97	0,84 36,76	0,98 53,48			18.272.691,47	18.291.890,47
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,45 59,34	1,19 52,18	1,16 63,20			-18.200.955,13	-18.084.135,17
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	2,71 -0,14	-12,17 -0,42	-5,92 -0,37			-1.168.626,29	-1.366.615,12
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	3,34 0,49	-7,88 3,87	-4,52 1,03			-4.266.483,90	-4.786.157,33
Artigo 8º III % do CDI	1,27 166,71	-1,68 -73,28	-0,10 -5,48			-3.015.380,27	-3.105.837,89
Artigo 8º IV, Alínea b Var. IBOVESPA p.p.	58,29 55,43	-23,94 -12,18	-13,44 -7,89			-274.798,78	-571.836,06
<b>CORONEL FABRICIANO (Total)</b>						<b>-8.227.521,65</b>	<b>-8.808.663,57</b>

**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	3.402.097,62	0,00	0,00	0,00	3.433.196,20	31.098,58	33.618,50
BB PREV RF IDKA2	2.966.134,00	0,00	0,00	0,00	2.987.080,90	20.946,90	84.549,49
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9.008.336,42	0,00	0,00	0,00	9.073.170,43	64.834,01	257.267,48
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.919.999,35	0,00	0,00	0,00	1.938.026,04	18.026,69	25.138,97
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.290.565,27	0,00	0,00	0,00	6.338.841,28	48.276,01	182.835,68
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320.218,36	0,00	0,00	0,00	1.331.421,08	11.202,72	19.328,89
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	6.087.510,10	0,00	0,00	0,00	6.225.543,80	138.033,70	4.448,94
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	8.575.087,18	0,00	0,00	0,00	8.645.890,45	70.803,27	121.482,34
SANTANDER FI IMA-B 5 TOP RENDA FIXA LP	1.533.961,65	0,00	0,00	0,00	1.544.965,57	11.003,92	40.377,58
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	1.540.405,22	0,00	0,00	0,00	1.552.210,67	11.805,45	44.979,66

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					43.070.346,42	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	3.123.661,72	0,00	0,00	0,00	3.130.570,91	6.909,19	26.108,19
					3.130.570,91	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	8.462.559,50	0,00	0,00	0,00	8.480.070,50	17.511,00	72.101,94
CAIXA FI RF SIMPLES LP	10,26	0,00	0,00	0,00	10,32	0,06	0,19
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	6.490.088,71	3.422.668,06	-174.371,40	0,00	9.785.701,46	47.316,09	109.544,98
					18.265.782,28	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	1.168.626,29	0,00	0,00	0,00	1.200.331,27	31.704,98	-166.283,85
					1.200.331,27	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	2.724.124,35	0,00	0,00	0,00	2.835.180,06	111.055,71	-149.246,58
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	1.060.157,48	0,00	0,00	0,00	1.083.377,53	23.220,05	-195.571,43
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	482.202,07	0,00	0,00	0,00	490.509,71	8.307,64	-32.272,02
					4.409.067,30	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	3.015.380,27	0,00	0,00	0,00	3.053.764,59	38.384,32	-52.073,30
					3.053.764,59	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	274.799,70	0,00	-0,92	0,00	0,00	434.967,56	160.168,78	-136.868,50
						434.967,56	0,00	0,00

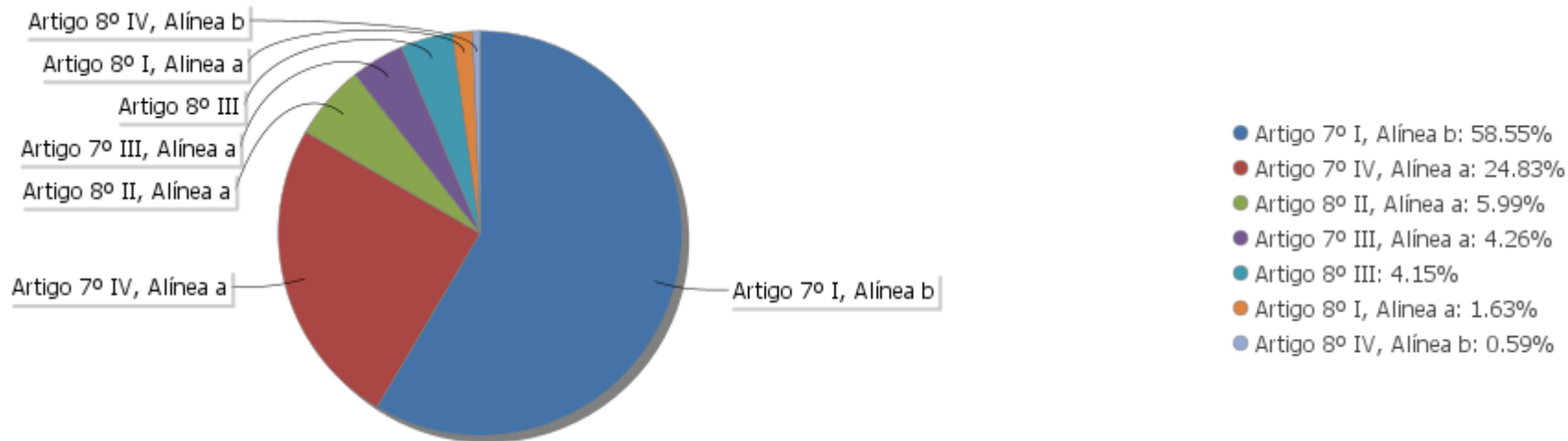
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

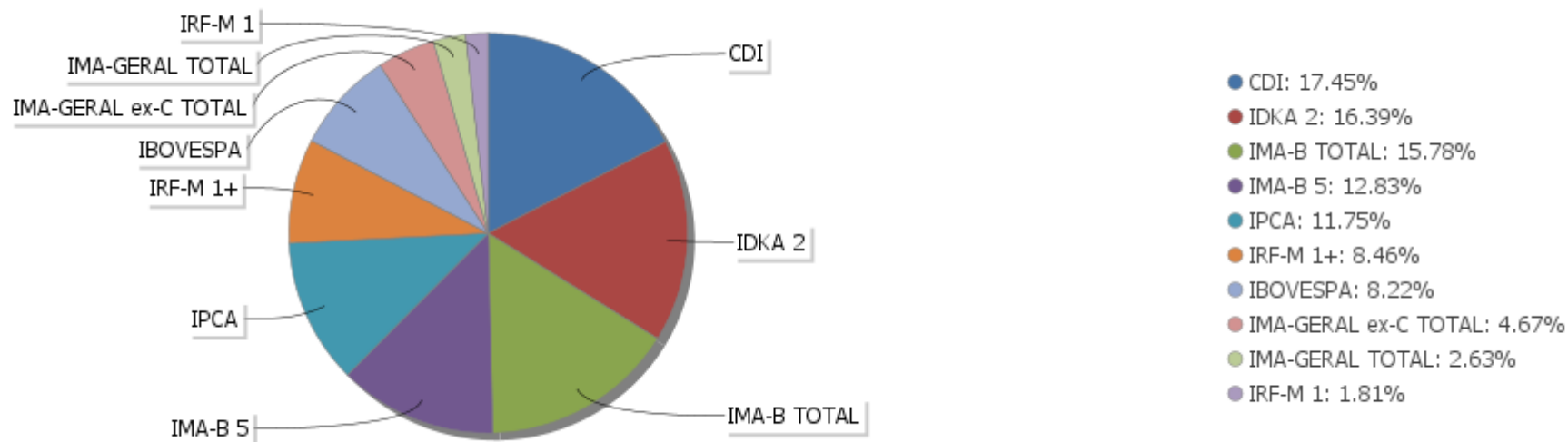
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	69.646.272,74	94,67	69.646.272,74	94,67
de 31 a 365 dias	3.918.557,59	5,33	73.564.830,33	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	73.564.830,33	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

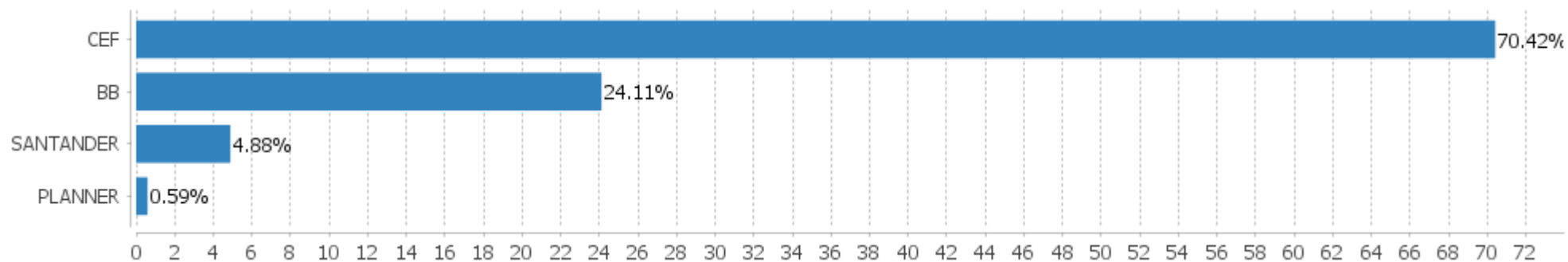


Alocação Por Estratégia



## 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	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

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	1	25,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	3	75,00

	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,55	2021-11
Menor rentabilidade da Carteira	-2,11	2021-10

Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	0,64	4,42	-3,78	4,07
06 meses				
12 meses				
24 meses				
Desde 31/08/2021	0,38	6,12	-5,75	3,99



## 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.	2,27 -0,02	-5,31 -0,32	0,86 -0,07	-1,95 -0,20	-5,31 -0,32	2,47 -0,58	16,70 -1,02
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,77 -0,02	4,35 -0,21	1,98 -0,05	3,12 -0,11	4,35 -0,21	12,52 -0,45	27,04 -0,80
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,77 -0,02	4,31 -0,25	1,97 -0,06	3,12 -0,12	4,31 -0,25	12,39 -0,58	26,84 -0,99
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,71 -0,12	4,65 -0,33	1,86 0,02	3,18 0,13	4,65 -0,33	12,93 -1,09	25,58 -1,92
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,91	-0,40	0,99	0,28	-0,40	4,67	18,35
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,83 0,10	-0,11 -10,17	1,07 -1,89	-0,82 -6,89	-0,11 -10,17	6,55 -8,48	24,06 4,07
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,72 -0,11	4,66 -0,31	1,82 -0,02	3,05 0,00	4,66 -0,31	13,07 -0,95	25,72 -1,78
SANTANDER FI IMA-B 5 TOP RENDA FIXA LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,72 -0,07	3,39 -1,18	1,74 -0,29	2,62 -0,62	3,39 -1,18	11,79 -1,18	26,27 -1,56
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,85 -0,03	2,70 -0,23	1,09 -0,04	1,99 -0,11	2,70 -0,23	6,43 -0,45	13,40 -0,70
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,94 0,07	0,35 -0,61	1,33 -0,01	0,80 -0,02	0,35 -0,61	5,18 -1,16	18,15 -1,83
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,21 -0,02	-1,48 -0,21	0,99 -0,07	-0,65 -0,10	-1,48 -0,21	4,35 -0,71	27,90 -1,27
CAIXA FI RF SIMPLES LP % do CDI	0,64 83,19	3,08 70,19	1,56 84,57	2,51 81,32	3,08 70,19	3,99 54,76	8,53 62,34
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,63 82,41	3,29 74,83	1,49 80,81	2,41 78,18	3,29 74,83	5,25 72,11	10,59 77,39
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,22 -0,00	-1,50 -0,23	0,98 -0,08	-0,68 -0,13	-1,50 -0,23	4,46 -0,60	27,93 -1,24
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO % do CDI	1,27 166,71	-0,82 -18,77	-0,10 -5,48	-3,05 -98,68	-0,82 -18,77	1,68 23,02	15,61 114,05
CARE11 Var. IBOVESPA p.p.	58,29 55,43	-19,96 -8,03	-13,44 -7,89	-31,31 -13,97	-19,96 -8,03	-56,57 -47,21	-67,42 -86,69
FIC FI EM AÇÕES CAIXA IBOVESPA	2,71	-13,38	-5,92	-17,89	-13,38		

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.	-0,14	-1,45	-0,37	-0,56	-1,45		
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES Var. IBOVESPA p.p.	1,72 -1,13	-7,20 4,72	-1,94 3,60	-8,58 8,75	-7,20 4,72		
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	2,19 -0,66	-15,47 -3,54	-10,34 -4,79	-21,61 -4,28	-15,47 -3,54	-14,48 -5,12	
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	4,08 1,22	-4,76 7,17	-2,54 3,00	-8,88 8,45	-4,76 7,17	0,93 10,29	42,75 23,48
CORONEL FABRICIANO Var. IPCA + 5,79% p.p.	1,25 -0,00	0,38 -5,75	0,64 -3,78				
CDI	0,76	4,40	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69
IBOVESPA	2,85	-11,93	-5,55	-17,33	-11,93	-9,36	19,27
INPC + 6,00%	1,27	16,74	4,26	9,16	16,74	30,46	44,52
IPCA + 6,00%	1,27	16,64	4,47	9,25	16,64	29,19	42,87

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	0,88	2,93	1,13	2,10	2,93	6,88	14,10	22,06	35,63
IRF-M 1+	2,29	-4,99	0,93	-1,74	-4,99	3,04	17,72	32,16	54,19
IRF-M TOTAL	1,89	-1,99	0,98	-0,42	-1,99	4,57	17,15	29,72	49,44
IMA-B 5	0,79	4,57	2,03	3,24	4,57	12,97	27,83	40,44	58,11
IMA-B 5+	-0,34	-6,55	0,09	-4,11	-6,55	-1,41	28,53	48,33	67,24
IMA-B TOTAL	0,22	-1,26	1,06	-0,55	-1,26	5,06	29,17	46,04	64,72
IMA-GERAL TOTAL	0,87	0,96	1,34	0,82	0,96	6,35	19,98	32,02	48,95
IDKA 2	0,83	4,97	1,84	3,05	4,97	14,02	27,50	39,94	58,99
IDKA 20	-2,28	-14,50	-2,87	-11,27	-14,50	-12,61	26,07	51,79	70,27
CDI	0,76	4,40	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69	20,99	33,03

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	2,85	-11,93	-5,55	-17,33	-11,93	-9,36	19,27	37,20	74,05
IBRX 100	3,14	-11,17	-5,51	-18,37	-11,17	-8,07	22,63	41,54	80,53
IBRX 50	3,76	-10,54	-4,49	-18,01	-10,54	-7,30	19,73	37,12	73,89
SMALL CAP	3,80	-16,20	-11,28	-24,79	-16,20	-16,75	31,71	42,41	112,70
IFIX	8,78	-2,28	3,28	1,81	-2,28	-12,28	19,27	25,98	50,42
Índice Consumo - ICON									
Índice Dividendos - IDIV	1,60	-6,41	-1,83	-8,30	-6,41	-7,35	34,49	55,95	95,40

**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	0,73	10,06	2,96	6,07	10,06	15,03	19,99	24,48	28,15
INPC	0,73	10,16	2,75	5,97	10,16	16,16	21,37	25,53	28,13
IGPM	0,87	17,78	1,54	2,35	17,78	45,04	55,63	67,36	66,49
SELIC	0,76	4,40	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69	21,00	33,06

**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	3,63	36,26	13,52	23,73	36,26	104,25	173,82	200,73	264,52
MSCI ACWI	3,17	25,42	9,15	16,96	25,42	84,89	138,58	148,21	206,39
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%	1,09	14,45	3,97	8,20	14,45	24,38	34,95	45,56	55,77
IPCA + 5,00%	1,18	15,54	4,22	8,73	15,54	26,77	38,87	51,22	63,36
IPCA + 5,50%	1,22	16,09	4,35	8,99	16,09	27,98	40,86	54,11	67,27
IPCA + 5,89%	1,26	16,52	4,44	9,20	16,52	28,92	42,43	56,40	70,37
IPCA + 6,00%	1,27	16,64	4,47	9,25	16,64	29,19	42,87	57,04	71,26
INPC + 4,00%	1,09	14,55	3,77	8,10	14,55	25,60	36,50	46,79	55,74
INPC + 6,00%	1,27	16,74	4,26	9,16	16,74	30,46	44,52	58,37	71,23

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
27	06/12/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.400,00	724,19948799	1,9331690000
28	09/12/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	819.854,31	0,00	423.796,09407671	1,9345490000
29	10/12/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	34.952,82	18.062,49273295	1,9351050000
30	14/12/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	279.219,34	0,00	144.208,40389604	1,9362210000
31	15/12/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	323.625,68	0,00	167.094,70358017	1,9367800000
32	21/12/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	331.402,09	0,00	170.912,77366371	1,9390130000
33	23/12/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	200,00	103,08561002	1,9401350000
34	28/12/2021	CARE11	0,00	0,92	0,40000000	2,3100000000
35	28/12/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	31.629,12	16.288,43957248	1,9418140000
36	29/12/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	106.189,46	54.669,96297827	1,9423730000
37	30/12/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	2.882,49	0,00	1.483,57816104	1,9429310000
38	31/12/2021	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	1.665.684,15	0,00	857.058,25602396	1,9434900000
<b>Total</b>						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.292.149,97

Value-At-Risk: 1,76%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CORONEL FABRICIANO		1,76	1,76			73.564.830,33	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,40%

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
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,62	0,01	0,02			1.331.421,08	1,81
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,29	0,03	0,08			1.938.026,04	2,63
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,20	0,09	0,02			6.338.841,28	8,62
BB PREV RF IDKA2		1,37	0,04	0,38			2.987.080,90	4,06
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI		1,21	0,02	0,01			1.552.210,67	2,11
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP		2,44	0,17	0,02			6.225.543,80	8,46
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,62	0,16	0,26			9.073.170,43	12,33
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,19	0,05	1,85			3.433.196,20	4,67
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,06	0,09	1,07			8.645.890,45	11,75
SANTANDER FI IMA-B 5 TOP RENDA FIXA LP		1,46	0,03	0,27			1.544.965,57	2,10
<b>Sub-total</b>	1,96	1,35	0,68		0,12	1,00	43.070.346,42	58,55

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		2,99	0,11	0,08			3.130.570,91	4,26
<b>Sub-total</b>	4,59	2,99	0,11		-0,12	0,22	3.130.570,91	4,26

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
BB PREV RF IMA-B		3,01	0,29	0,06			8.480.070,50	11,53

## 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
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,04	0,00	0,00			9.785.701,46	13,30
CAIXA FI RF SIMPLES LP		0,04	0,00	0,03			10,32	0,00
<b>Sub-total</b>	2,46	1,40	0,29		-0,13	0,45	18.265.782,28	24,83

## Renda Variável e Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 7,24%

## Artigo 8º I, 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 EM AÇÕES CAIXA IBOVESPA		10,04	0,12	0,18			1.200.331,27	1,63
<b>Sub-total</b>	18,66	10,04	0,12		0,10	2,71	1.200.331,27	1,63

## Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES VALOR FIC FIA		9,99	0,28	2,40			2.835.180,06	3,85
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR		11,45	0,13	3,88			1.083.377,53	1,47
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES		10,55	0,06	3,44			490.509,71	0,67
<b>Sub-total</b>	18,51	10,16	0,47		0,14	3,34	4.409.067,30	5,99

## Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO		2,90	0,09	2,89			3.053.764,59	4,15
<b>Sub-total</b>	5,58	2,90	0,09		0,09	1,27	3.053.764,59	4,15

## Artigo 8º IV, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CARE11		11,82	-0,00	15,14			434.967,56	0,59
<b>Sub-total</b>	74,93	11,82	-0,00		0,77	58,29	434.967,56	0,59

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Observações**

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

- O Instituto está com 4,26% dos recursos garantidores alocados no Artigo 7º III, Alínea a, limite este, superior ao limite estipulado na Política de Investimento;