



LDB
EMPRESAS

RUBINÉIA
JANEIRO 2023



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 31.01.2023.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

100,00%

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	2,19	0,01	1,38	1,38	371.383,86	1,06	186.124.134,70	0,20
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2,85	0,01	1,39	1,39	2.085.891,00	5,97	2.846.054.203,16	0,07
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,44	0,06	1,09	1,09	2.990.361,04	8,57	572.089.944,66	0,52
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,62	0,04	1,37	1,37	4.802.286,81	13,75	7.844.346.137,20	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,55	0,09	-0,03	-0,03	5.993.189,85	17,17	3.356.845.685,28	0,18
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,67	0,09	0,69	0,69	2.427.410,57	6,95	483.170.355,38	0,50
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,44	0,06	1,12	1,12	47.914,99	0,14	6.631.421.970,83	0,00
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,04	0,06	0,79	0,79	18.718.438,12	53,61		

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				
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,07	0,05	1,13	1,13	3.621.512,95	10,37	8.262.735.410,47	0,04
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	5,53	0,13	0,01	0,01	5.883.148,21	16,85	333.421.268,46	1,76
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,08	0,05	1,09	1,09	2.695.156,22	7,72	15.285.936.736,43	0,02
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	5,65	0,09	-0,09	-0,09	3.963.046,85	11,35	1.409.888.691,45	0,28
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			3,49	0,09	0,43	0,43	16.162.864,23	46,29		

Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
PETRA	FINAXIS	FIDC PREMIUM	89,13	-0,34	-0,34	-0,34	32.381,56	0,09	34.351.744,14	0,09
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			89,13	-0,34	-0,34	-0,34	32.381,56	0,09		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa	3,23	0,07	0,62	0,62	34.913.683,91	100,00
Total	3,23	0,07	0,62	0,62	34.913.683,91	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	18.718.438,12	53,61	0,00	54,95	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	16.162.864,23	46,29	0,00	45,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	32.381,56	0,09	0,00	0,05	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	34.913.683,91	100,00					100,00
Total		34.913.683,91	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	0,79 70,00	0,79 70,00	1,11 33,73	4,36 65,06	9,73 75,94	146.046,90	146.046,90
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,43 38,15	0,43 38,15	0,52 15,74	4,21 62,81	9,12 71,21	67.426,50	67.426,50
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-0,34 -30,38	-0,34 -30,38	11,37 344,13	9,63 143,51	-55,25 -431,33	-110,89	-110,89
RUBINÉIA (Total)						213.362,51	213.362,51

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 TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	366.318,40	0,00	0,00	0,00	371.383,86	5.065,46	5.065,46
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2.057.345,90	0,00	0,00	0,00	2.085.891,00	28.545,10	28.545,10
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	2.958.215,97	0,00	0,00	0,00	2.990.361,04	32.145,07	32.145,07
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.737.160,76	0,00	0,00	0,00	4.802.286,81	65.126,05	65.126,05
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.995.159,35	0,00	0,00	0,00	5.993.189,85	-1.969,50	-1.969,50
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.410.807,13	0,00	0,00	0,00	2.427.410,57	16.603,44	16.603,44
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	47.383,71	0,00	0,00	0,00	47.914,99	531,28	531,28
	18.572.391,22	0,00	0,00	0,00	18.718.438,12	146.046,90	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	3.186.216,06	597.715,75	-200.000,00	0,00	3.621.512,95	37.581,14	37.581,14
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	5.882.455,12	0,00	0,00	0,00	5.883.148,21	693,09	693,09
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.986.949,73	363.961,46	-688.504,85	0,00	2.695.156,22	32.749,88	32.749,88
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	3.966.644,46	0,00	0,00	0,00	3.963.046,85	-3.597,61	-3.597,61
	16.022.265,37	961.677,21	-888.504,85	0,00	16.162.864,23	67.426,50	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIDC PREMIUM	32.492,45	0,00	0,00	0,00	32.381,56	-110,89	-110,89
	32.492,45	0,00	0,00	0,00	32.381,56	-110,89	

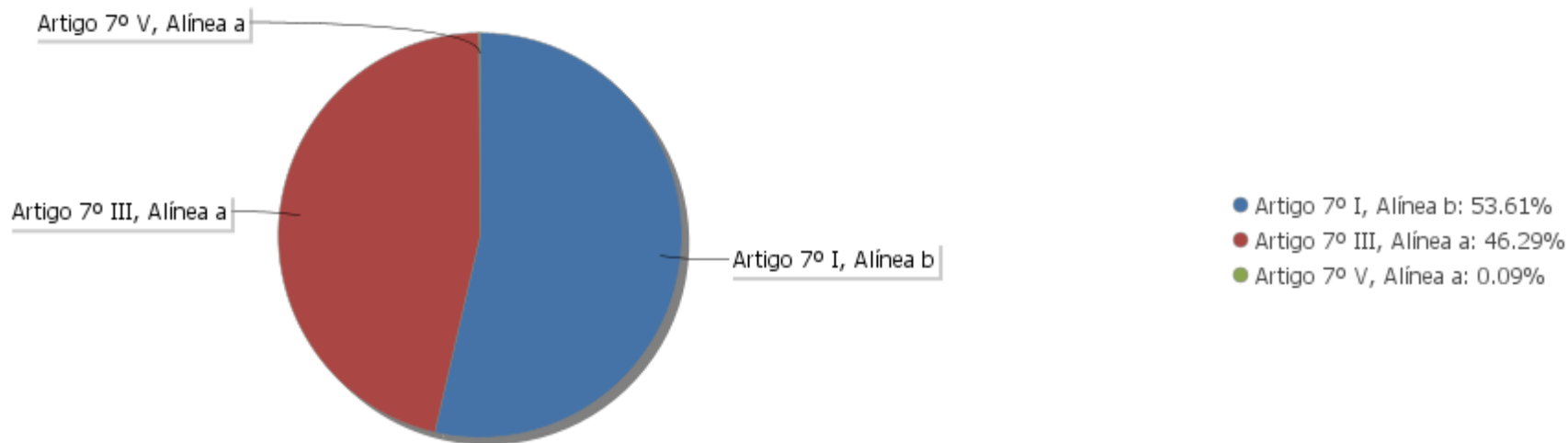
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

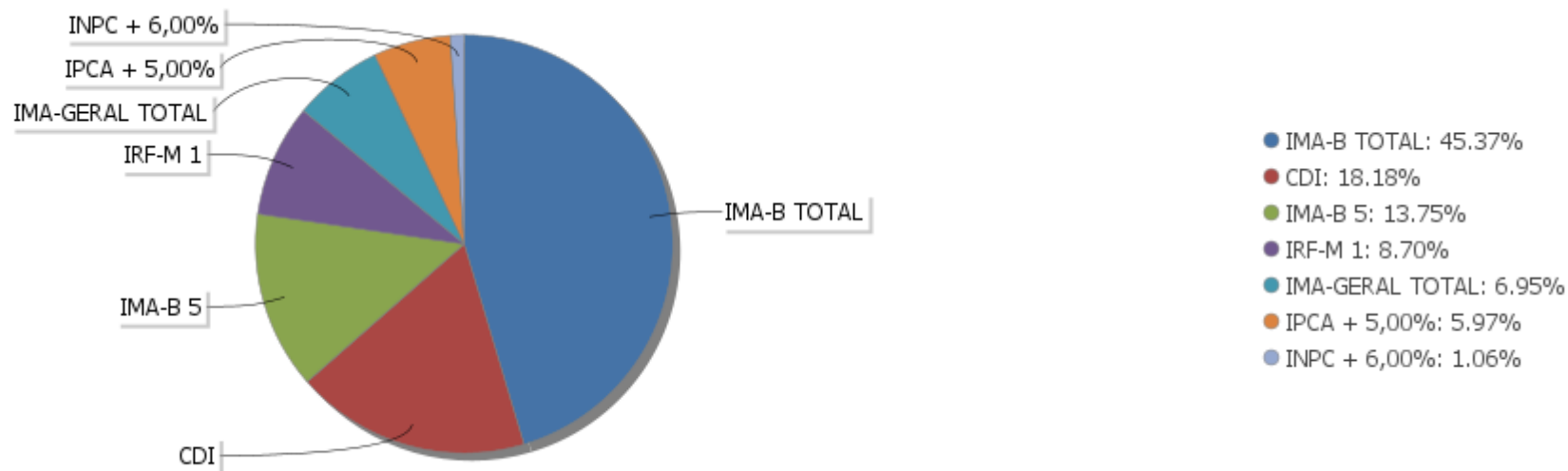
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	32.456.409,05	92,96		32.456.409,05	92,96	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00		32.456.409,05	92,96	
acima de 365 dias	2.457.274,86	7,04		34.913.683,91	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

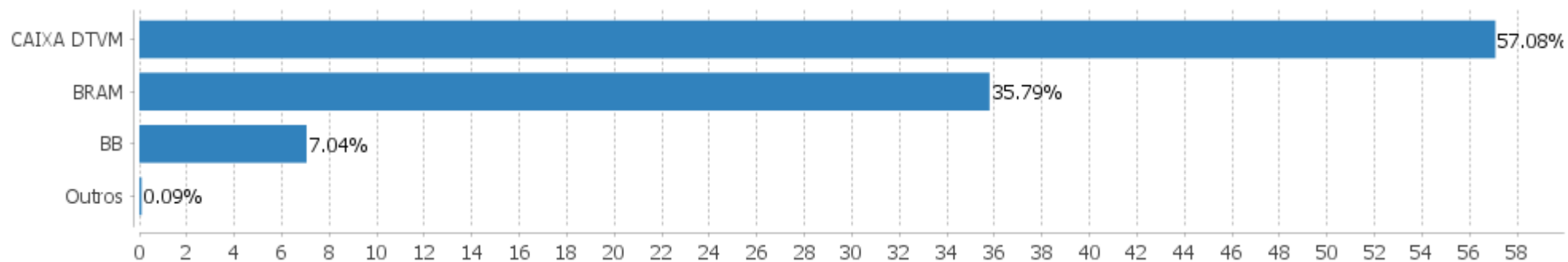


Alocação Por Estratégia



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
2023	0,62												0,62
IPCA + 4,94%	0,95												0,95
p.p. indexador	-0,34												-0,34
2022	-0,14	0,70	2,25	0,89	0,81	0,17	-0,11	0,96	1,16	1,27	-0,23	0,46	8,47
IPCA + 4,83%	0,94	1,37	2,04	1,42	0,88	1,07	-0,29	0,07	0,10	0,97	0,79	1,04	10,87
p.p. indexador	-1,07	-0,67	0,21	-0,53	-0,08	-0,90	0,18	0,89	1,06	0,30	-1,02	-0,57	-2,40
2021	-0,44	-0,98	-0,26	0,57	0,71	0,29	-0,12	-0,47	0,19	-1,58	2,38	0,51	0,75
IPCA + 5,40%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,42	1,33	1,60	1,67	1,37	1,21	15,98
p.p. indexador	-1,10	-2,22	-1,68	-0,16	-0,56	-0,68	-1,55	-1,81	-1,41	-3,25	1,00	-0,71	-15,23
2020	0,37	0,42	-3,29	0,75	1,20	1,19	2,17	-0,73	-0,79	0,15	1,23	2,85	5,51
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	-0,34	-0,24	-3,86	0,61	1,13	0,45	1,29	-1,45	-1,91	-1,19	-0,11	0,99	-5,12
2019	1,39	0,47	0,53	0,80	1,47	1,89	0,91	0,06	1,64	1,87	-0,97	1,18	11,80
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	0,56	-0,42	-0,66	-0,26	0,83	1,44	0,18	-0,56	1,20	1,23	-1,95	-0,46	1,21
2018	1,17	0,55	0,82	0,39	-0,54	0,40	1,45	0,10	0,52	2,34	0,52	0,91	8,94
IPCA + 6,00%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
p.p. indexador	0,37	-0,19	0,24	-0,32	-1,43	-1,35	0,61	-0,34	-0,40	1,38	0,27	0,29	-0,98

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	23	37,70
Meses abaixo - Meta Atuarial	38	62,30
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,85	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-3,29	2020-03

Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	0,85	2,80	-1,95	4,07
06 meses	4,30	3,98	0,32	3,60
12 meses	9,29	10,89	-1,60	3,23
24 meses	10,44	28,95	-18,51	3,36
36 meses	15,60	42,60	-27,01	4,69
48 meses	27,94	57,51	-29,58	4,18
60 meses	39,68	73,19	-33,51	3,93
Desde 29/12/2017	41,31	74,58	-33,26	3,89

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

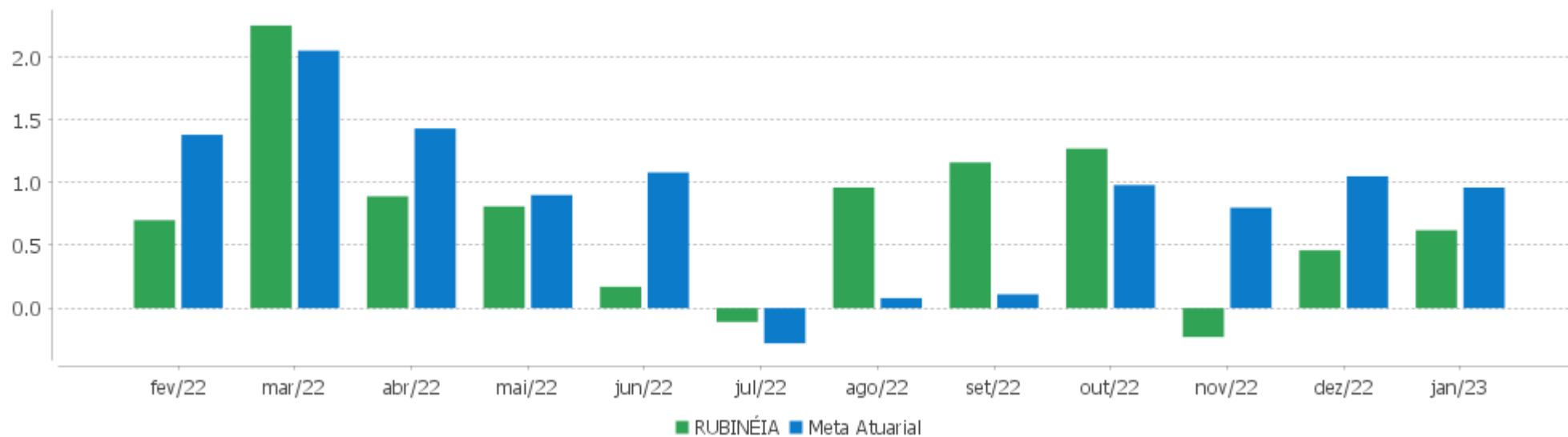


Patrimônio Líquido



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
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03 -0,03	-0,03 -0,03	-1,10 -0,11	2,78 -0,06	6,97 -0,19	5,46 -0,47	10,60 -0,86
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,37 -0,02	1,37 -0,02	1,95 -0,06	4,36 -0,04	11,08 -0,11	15,87 -0,40	24,28 -0,78
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	1,09 -0,01	1,09 -0,01	3,19 -0,06	6,64 -0,11	12,30 -0,24	15,96 -0,55	19,53 -0,97
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	1,39 0,43	1,39 0,43	2,20 -0,64	4,46 0,40	10,57 -0,49		
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	1,12 0,02	1,12 0,02	3,23 -0,02	6,66 -0,09	12,31 -0,23	16,01 -0,50	19,75 -0,76
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6,00% p.p.	1,38 0,41	1,38 0,41	2,19 -0,86	4,44 0,02	11,72 -0,33	18,11 -13,26	25,93 -20,92
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,69 -0,01	0,69 -0,01	1,39 -0,03	5,28 0,09	10,13 -0,07	11,07 -0,69	15,33 -1,46
FIDC PREMIUM % do CDI	-0,34 -30,38	-0,34 -30,38	11,37 344,13	9,63 143,51	-55,25 -431,33	-57,84 -313,47	-59,74 -278,45
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,01 0,01	0,01 0,01	-1,14 -0,15	2,67 -0,17	6,75 -0,40	4,56 -1,37	9,71 -1,75
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,13 100,38	1,13 100,38	3,39 102,66	6,94 103,53	13,39 104,56	19,73 106,95	22,02 102,64
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,09 -0,09	-0,09 -0,09	-1,23 -0,24	2,56 -0,28	6,74 -0,42	5,27 -0,66	10,40 -1,06
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	1,09 97,41	1,09 97,41	3,32 100,46	6,79 101,24	13,01 101,60	18,94 102,67	21,56 100,50
RUBINÉIA Var. IPCA + 4,97% p.p.	0,62 -0,34	0,62 -0,34	0,85 -1,97	4,30 0,28	9,29 -1,71	10,44 -18,13	15,60 -25,40
CDI	1,12	1,12	3,30	6,71	12,81	18,45	21,46
IBOVESPA	3,37	3,37	-2,25	9,95	1,15	-1,42	-0,29
INPC + 6,00%	0,97	0,97	3,05	4,42	12,05	31,37	46,85
IPCA + 6,00%	1,04	1,04	3,08	4,55	12,12	31,18	45,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI			D+0	D+0		
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		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 B 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 RENDA FIXA REFERENCIADO DI 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
FIDC PREMIUM	Não se aplica	Não se aplica				

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	1,10	1,10	3,25	6,75	12,54	16,51	20,51	28,48	37,42
IRF-M 1+	0,72	0,72	0,90	6,13	8,73	4,24	10,25	25,21	40,80
IRF-M TOTAL	0,84	0,84	1,65	6,17	9,82	8,42	13,75	26,79	40,53
IMA-B 5	1,40	1,40	2,01	4,40	11,19	16,27	25,06	40,14	54,28
IMA-B 5+	-1,26	-1,26	-3,59	1,84	3,66	-3,05	0,52	22,96	44,15
IMA-B TOTAL	-0,00	-0,00	-0,99	2,84	7,15	5,93	11,46	31,65	50,23
IMA-GERAL TOTAL	0,70	0,70	1,42	5,19	10,20	11,76	16,79	30,01	43,27
IDKA 2	1,44	1,44	1,90	3,99	10,86	16,26	25,79	39,66	54,03
IDKA 20	-4,58	-4,58	-9,69	-0,34	-3,60	-17,66	-17,08	6,23	30,85
CDI	1,12	1,12	3,30	6,71	12,81	18,45	21,46	28,49	36,69

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,37	3,37	-2,25	9,95	1,15	-1,42	-0,29	16,47	33,58
IBRX 100	3,51	3,51	-2,34	9,39	0,75	-1,38	0,24	19,26	37,61
IBRX 50	3,38	3,38	-1,47	10,88	1,52	0,57	3,26	18,48	34,15
SMALL CAP	2,92	2,92	-11,39	3,51	-15,47	-24,13	-27,55	5,24	19,33
Índice Consumo - ICON	2,96	2,96	-16,42	-6,37	-24,84	-42,47	-44,77	-20,86	-20,70
Índice Dividendos - IDIV	5,89	5,89	5,00	11,84	10,99	17,61	12,30	42,62	69,29

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	3,77	3,77	2,13	-2,99	-14,07	2,21	50,95	110,51	132,79

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,60	-1,60	-5,69	0,25	1,59	-2,03	-8,32	17,07	23,45

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	4,67	4,67	7,25	-0,08	-13,97	-6,09	38,62	84,31	93,01

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,53	0,53	1,57	1,50	5,77	16,75	22,08	27,19	32,00
INPC	0,46	0,46	1,54	1,37	5,71	16,92	23,38	28,69	33,29
IGPM	0,21	0,21	0,09	-2,50	3,79	21,34	52,54	64,45	75,53
SELIC	1,12	1,12	3,30	6,71	12,81	18,45	21,46	28,49	36,70

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,87	0,87	2,58	3,55	10,01	26,28	37,25	48,75	60,49
IPCA + 5,00%	0,96	0,96	2,83	4,05	11,06	28,72	41,24	54,54	68,33
IPCA + 5,50%	1,00	1,00	2,96	4,30	11,59	29,95	43,26	57,50	72,37
IPCA + 5,89%	1,03	1,03	3,06	4,50	12,00	30,91	44,84	59,84	75,57
IPCA + 6,00%	1,04	1,04	3,08	4,55	12,12	31,18	45,29	60,50	76,48
INPC + 4,00%	0,80	0,80	2,55	3,41	9,94	26,46	38,73	50,51	62,06
INPC + 6,00%	0,97	0,97	3,05	4,42	12,05	31,37	46,85	62,40	78,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1	17/01/2023	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	300.019,97	0,00	20.466,21200000	14,6592817000
2	17/01/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	349.090,96	78.740,21513200	4,4334520000
3	17/01/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	363.961,46	0,00	82.094,37251100	4,4334520000
4	18/01/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.048,88	236,47118100	4,4355510000
5	23/01/2023	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	200.000,00	13.617,57000000	14,6869085000
6	24/01/2023	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	297.695,78	0,00	20.259,39400000	14,6942095000
7	25/01/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	752,90	169,34334500	4,4459970000
8	31/01/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	323.016,90	72.506,12729300	4,4550290000
9	31/01/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	14.595,21	3.276,12012400	4,4550290000
Total			961.677,21	888.504,85		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 597.742,60

Value-At-Risk: 1,71%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	3,48	1,71		1,71	-0,14	0,62	34.913.683,91	100,00
RUBINÉIA		1,71		1,71			34.913.683,91	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,71%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	1,95	1,35	0,01	1,35	0,13	1,38	371.383,86	1,06
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,96	1,36	0,07	1,35	0,13	1,39	2.085.891,00	5,97
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,53	0,15	0,01	0,01	-0,07	1,09	2.990.361,04	8,57
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,40	1,39	0,18	0,02	0,10	1,37	4.802.286,81	13,75
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,21	2,95	0,50	0,03	-0,19	-0,03	5.993.189,85	17,17
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,90	1,34	0,09	0,08	-0,15	0,69	2.427.410,57	6,95
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,51	0,15	0,00	0,02	-0,00	1,12	47.914,99	0,14
Sub-total	3,21	1,61	0,86		-0,11	0,79	18.718.438,12	53,61

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,05	0,01	0,00	0,01	0,08	1,13	3.621.512,95	10,37
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	6,19	3,05	0,51	0,24	-0,18	0,01	5.883.148,21	16,85
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,04	0,02	0,00	0,02	-0,69	1,09	2.695.156,22	7,72
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	6,33	3,00	0,34	0,09	-0,19	-0,09	3.963.046,85	11,35
Sub-total	3,81	1,85	0,85		-0,18	0,43	16.162.864,23	46,29

Artigo 7º V, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC PREMIUM	1,16	0,45	-0,00	0,45	-1,27	-0,34	32.381,56	0,09
Sub-total	1,16	0,45	-0,00		-1,27	-0,34	32.381,56	0,09

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)

(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)