



**LDB**  
EMPRESAS

**CORONEL FABRICIANO**  
MAIO 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 31.05.2023.

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										89,58%
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				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,38	0,04	1,12	5,37	1.567.543,39	1,76	7.491.213.170,65	0,02
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,56	0,03	1,87	6,88	2.266.622,29	2,54	491.678.019,87	0,46
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,45	0,00	0,63	5,91	7.362.634,90	8,26	8.623.099.025,61	0,09
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,69	0,01	0,39	5,49	3.444.685,53	3,86	7.232.116.284,73	0,05
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,46	0,00	0,56	5,83	2.729.037,56	3,06	1.154.899.961,96	0,24
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	5,31	0,03	2,84	8,39	7.217.607,37	8,10	1.321.509.484,64	0,55
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,79	0,01	0,36	5,50	10.437.259,50	11,71	6.636.813.957,94	0,16
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,01	0,05	0,97	4,60	15.812.598,74	17,74	900.415.296,74	1,76
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	1,97	0,00	0,00	0,00	3.682.714,19	4,13	0,00	
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,62	0,04	1,81	6,03	10.147.984,87	11,39	5.078.181.389,68	0,20
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI IMA-B 5 TOP RENDA FIXA LP	2,46	0,00	0,55	5,80	1.789.996,39	2,01	570.700.005,14	0,31
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>1,86</b>	<b>0,03</b>	<b>1,08</b>	<b>5,46</b>	<b>66.458.684,73</b>	<b>74,56</b>		
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	5,46	-0,01	2,57	8,71	3.608.093,17	4,05	1.265.571.591,84	0,29
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	5,30	-0,01	2,64	8,72	9.777.832,80	10,97	669.374.985,98	1,46
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA FI RF SIMPLES LP	0,03	0,00	1,01	4,63	11,98	0,00	693.721.881,97	0,00
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>5,34</b>	<b>-0,01</b>	<b>2,62</b>	<b>8,72</b>	<b>13.385.937,95</b>	<b>15,02</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>2,38</b>	<b>0,02</b>	<b>1,34</b>	<b>5,99</b>	<b>79.844.622,68</b>	<b>89,58</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

6,12%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	21,01	-0,52	2,71	-3,81	2.632.624,64	2,95	811.651.815,24	0,32
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI EM AÇÕES CAIXA IBOVESPA	20,88	-0,58	3,43	-2,04	1.215.939,78	1,36	94.251.007,65	1,29
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	20,43	-0,27	6,15	-0,76	1.055.863,44	1,18	596.574.464,37	0,18
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	18,89	-0,82	0,82	0,24	548.639,27	0,62	96.959.569,53	0,57
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>20,27</b>	<b>-0,51</b>	<b>3,32</b>	<b>-2,44</b>	<b>5.453.067,13</b>	<b>6,12</b>		
Renda Variável			20,27	-0,51	3,32	-2,44	5.453.067,13	6,12		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

3,96%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	6,33	-0,04	1,97	3,29	3.533.538,72	3,96	568.217.214,92	0,62
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>6,33</b>	<b>-0,04</b>	<b>1,97</b>	<b>3,29</b>	<b>3.533.538,72</b>	<b>3,96</b>		
Investimentos Estruturados			6,33	-0,04	1,97	3,29	3.533.538,72	3,96		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

0,34%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
PLANNER	PLANNER	CARE11	36,06	2,13	1,59	-31,91	301.493,76	0,34	0,00	
<b>Sub-total Artigo 11º</b>			<b>36,06</b>	<b>2,13</b>	<b>1,59</b>	<b>-31,91</b>	<b>301.493,76</b>	<b>0,34</b>		
Fundos Imobiliários			36,06	2,13	1,59	-31,91	301.493,76	0,34		
<b>Total</b>			<b>3,28</b>	<b>-0,01</b>	<b>1,48</b>	<b>5,13</b>	<b>89.132.722,29</b>	<b>100,00</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	66.458.684,73	74,56					100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	13.385.937,95	15,02					60,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>79.844.622,68</b>	<b>89,58</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	5.453.067,13	6,12					30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>5.453.067,13</b>	<b>6,12</b>					30,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	3.533.538,72	3,96					10,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>3.533.538,72</b>	<b>3,96</b>					15,00
<b>Fundos Imobiliários</b>								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	301.493,76	0,34					5,00
	<b>Total Fundos Imobiliários</b>	<b>301.493,76</b>	<b>0,34</b>					5,00
<b>Total</b>		<b>89.132.722,29</b>	<b>100,00</b>					

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	1,08 96,42	5,46 101,67	3,29 101,21	6,53 99,72	10,62 78,82	712.117,65	3.440.003,35
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	2,62 233,29	8,72 162,36	7,45 229,04	8,45 128,99	10,16 75,39	341.832,93	1.073.330,77
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	3,32 -0,41	-2,44 -1,16	1,65 -1,60	-4,99 -1,30	-7,08 -4,37	175.471,63	-136.262,50
Artigo 10º I % do CDI	1,97 175,45	3,29 61,24	3,50 107,71	3,43 52,35	9,35 69,40	68.293,40	112.479,86
Artigo 11º % do CDI	1,59 141,31	-31,91 -594,43	-13,90 -427,66	-40,37 -616,13	-58,89 -436,94	4.710,84	-141.325,20
<b>CORONEL FABRICIANO (Total)</b>						<b>1.302.426,45</b>	<b>4.348.226,28</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	3.682.714,19	0,00	0,00	0,00	3.682.714,19	0,00	0,00
BB PREV RF IDKA2	3.431.344,25	0,00	0,00	0,00	3.444.685,53	13.341,28	179.168,85
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	15.660.683,43	0,00	0,00	0,00	15.812.598,74	151.915,31	695.939,09
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	10.399.775,98	0,00	0,00	0,00	10.437.259,50	37.483,52	543.852,76
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7.316.500,65	0,00	0,00	0,00	7.362.634,90	46.134,25	410.926,71
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.225.031,01	0,00	0,00	0,00	2.266.622,29	41.591,28	145.981,71
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.550.128,57	0,00	0,00	0,00	1.567.543,39	17.414,82	79.830,52
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	7.018.337,37	0,00	0,00	0,00	7.217.607,37	199.270,00	558.800,58
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	9.968.056,12	0,00	0,00	0,00	10.147.984,87	179.928,75	577.022,54
SANTANDER FI IMA-B 5 TOP RENDA FIXA LP	1.780.124,90	0,00	0,00	0,00	1.789.996,39	9.871,49	98.154,47
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2.713.870,61	0,00	0,00	0,00	2.729.037,56	15.166,95	150.326,12
					66.458.684,73	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	9.526.507,73	0,00	0,00	0,00	9.777.832,80	251.325,07	784.253,72
CAIXA FI RF SIMPLES LP	11,86	0,00	0,00	0,00	11,98	0,12	0,53
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	3.517.585,43	0,00	0,00	0,00	3.608.093,17	90.507,74	289.076,52
					13.385.937,95	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	2.563.207,76	0,00	0,00	0,00	2.632.624,64	69.416,88	-104.166,43
FIC FI EM AÇÕES CAIXA IBOVESPA	1.175.574,99	0,00	0,00	0,00	1.215.939,78	40.364,79	-25.302,48
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	994.659,15	0,00	0,00	0,00	1.055.863,44	61.204,29	-8.113,48
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	544.153,60	0,00	0,00	0,00	548.639,27	4.485,67	1.319,89
					5.453.067,13	0,00	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	3.465.245,32	0,00	0,00	0,00	3.533.538,72	68.293,40	112.479,86
					3.533.538,72	0,00	

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CARE11	296.782,92	0,00	0,00	0,00	0,00	301.493,76	4.710,84	-141.325,20
						301.493,76	0,00	

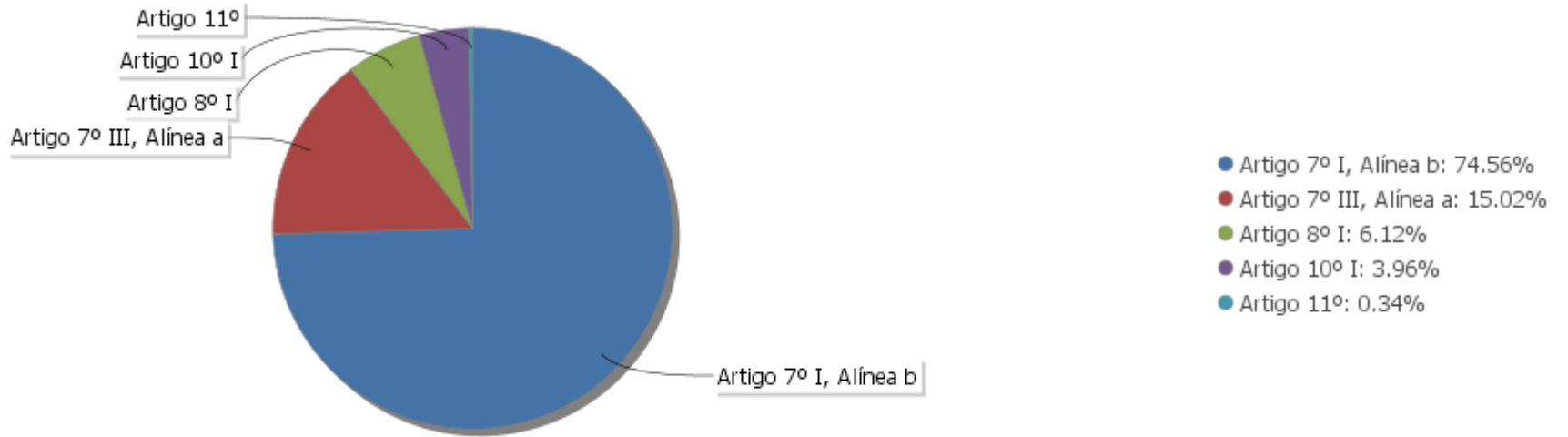
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

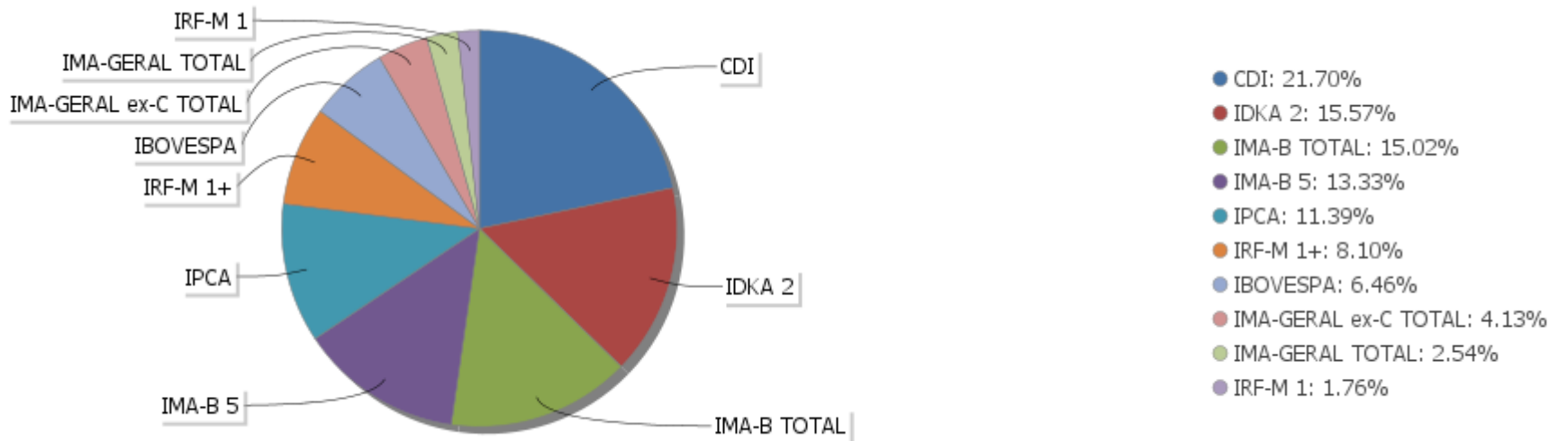
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	85.444.234,21	95,86	85.444.234,21	95,86	
de 31 dias a 365 dias	3.688.488,08	4,14	89.132.722,29	100,00	
acima de 365 dias	0,00	0,00	89.132.722,29	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

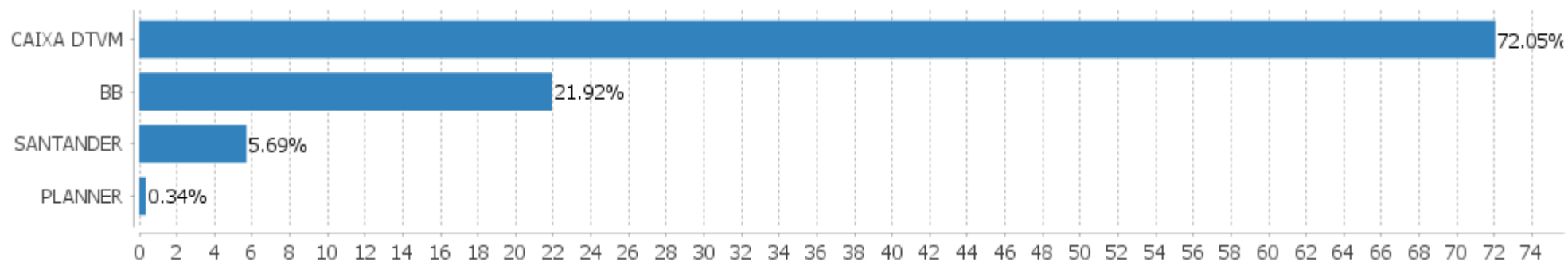


Alocação Por Estratégia



## 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	1,03	0,32	1,21	0,99	1,48								5,13
IPCA + 5,04%	0,96	1,19	1,16	0,96	0,66								5,04
p.p. indexador	0,07	-0,88	0,04	0,03	0,82								0,09
2022	0,37	0,81	2,43	-0,00	1,21	-0,75	0,61	1,20	0,86	1,50	-0,61	0,47	8,37
IPCA + 5,04%	0,95	1,39	2,06	1,44	0,90	1,08	-0,27	0,09	0,12	0,98	0,80	1,05	11,10
p.p. indexador	-0,58	-0,57	0,37	-1,44	0,31	-1,83	0,89	1,11	0,74	0,52	-1,41	-0,58	-2,73
2021					0,20	0,24	0,26	0,32	-1,78	-2,11	1,55	1,25	-0,13
IPCA + 5,79%					1,30	1,00	1,46	1,37	1,64	1,70	1,40	1,25	11,80
p.p. indexador					-1,11	-0,77	-1,20	-1,05	-3,41	-3,81	0,14	-0,00	-11,93

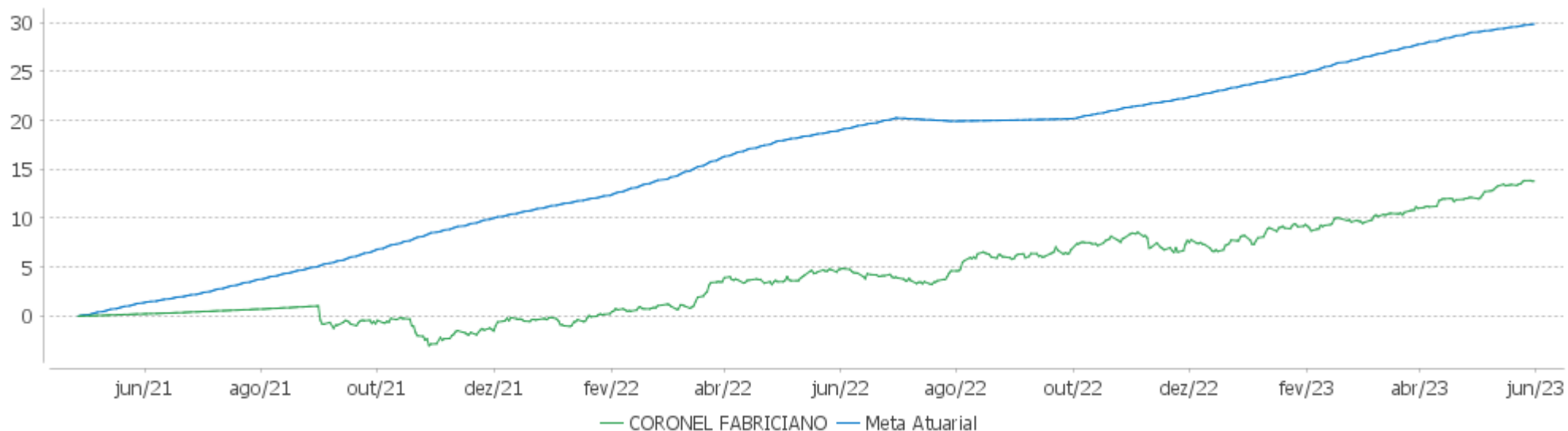
**Performance Sobre a Meta Atuarial**

**Relatório**

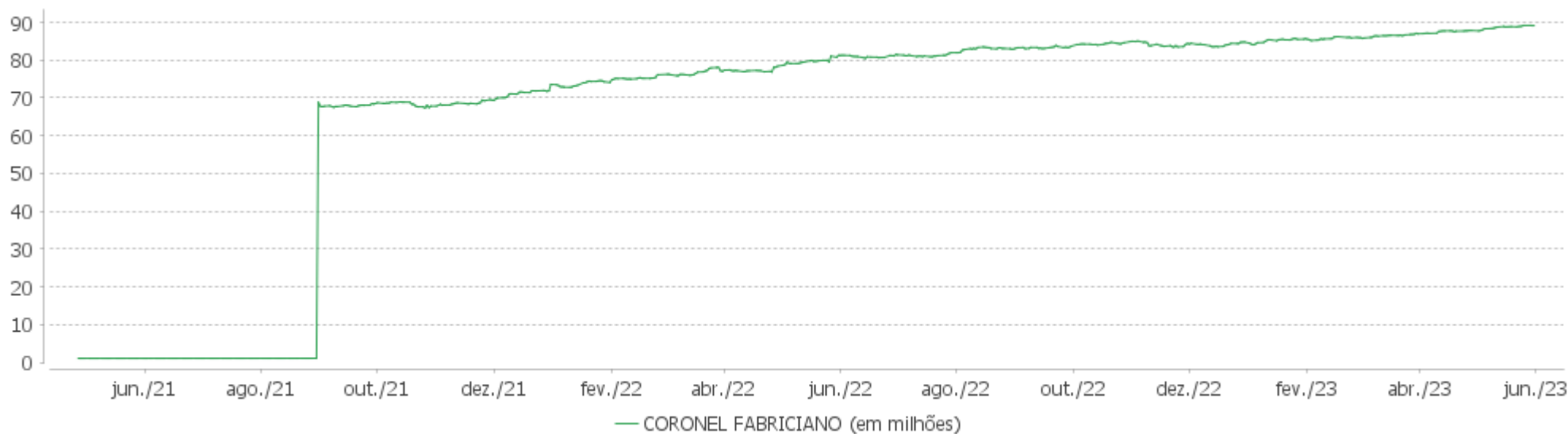
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	11	44,00	03 meses	3,73	2,81	0,91	2,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	14	56,00	06 meses	5,62	6,15	-0,52	2,76
			12 meses	8,61	9,15	-0,55	3,28
			24 meses	13,53	28,64	-15,11	3,31
Maior rentabilidade da Carteira	2,43	2022-03	Desde 27/04/2021	13,78	30,47	-16,69	3,24
Menor rentabilidade da Carteira	-2,11	2021-10					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

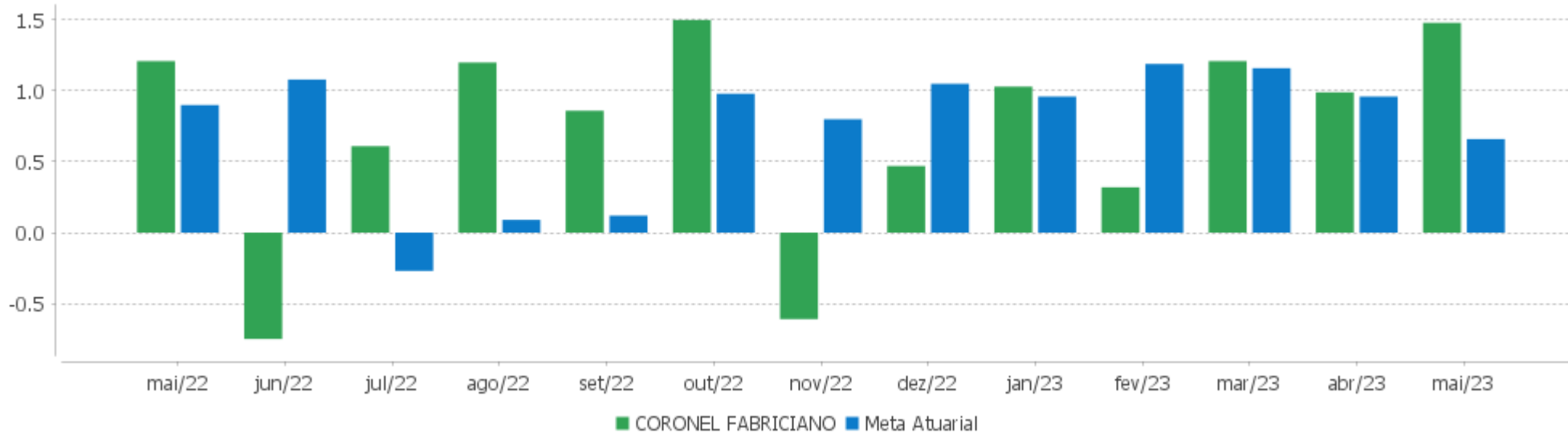


Patrimônio Líquido



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 IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	2,84 -0,01	8,39 -0,15	6,81 -0,11	10,09 -0,20	15,28 -0,56	13,87 -0,93	13,34 -1,14
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,56 -0,01	5,83 -0,10	2,96 -0,06	6,81 -0,12	9,23 -0,22	19,39 -0,51	27,91 -0,85
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,63 0,06	5,91 -0,02	3,04 0,02	6,89 -0,04	9,41 -0,03	19,60 -0,30	28,08 -0,68
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,39 0,10	5,49 -0,27	2,47 -0,13	6,77 -0,30	8,61 -0,13	18,88 0,09	28,11 -0,73
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,00	0,00	0,00	-0,39	3,77	7,69	11,39
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	1,81 1,58	6,03 3,08	3,94 2,38	7,24 3,65	12,48 8,55	16,41 0,28	20,43 -5,06
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,36 0,07	5,50 -0,26	2,49 -0,11	6,80 -0,27	8,34 -0,40	18,22 -0,57	27,61 -1,23
SANTANDER FI IMA-B 5 TOP RENDA FIXA LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,55 -0,02	5,80 -0,13	2,94 -0,08	6,77 -0,16	9,13 -0,31	18,63 -1,27	27,10 -1,66
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	1,12 -0,02	5,37 -0,06	3,20 -0,06	6,58 -0,08	13,30 -0,22	20,31 -0,52	22,58 -0,79
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	1,87 0,10	6,88 0,10	5,08 0,13	7,71 0,11	12,69 0,14	18,24 -0,24	22,15 -1,30
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,97 86,36	4,60 85,75	2,80 86,01	5,61 85,64	11,56 85,76	18,74 83,53	20,31 80,91
BB PREV RF IMA-B Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,64 0,11	8,72 -0,04	7,43 0,04	8,46 -0,09	10,14 -0,33	15,01 -0,53	25,20 -0,94
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,57 0,04	8,71 -0,05	7,49 0,10	8,42 -0,13	10,21 -0,26	14,97 -0,58	25,16 -0,98
CAIXA FI RF SIMPLES LP % do CDI	1,01 90,23	4,68 87,19	2,82 86,79	5,70 86,96	11,74 87,14	19,25 85,81	19,71 78,54
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES Var. IBOVESPA p.p.	0,82 -2,91	0,24 1,52	2,59 -0,65	-1,56 2,13	-1,35 1,36	-0,04 14,12	33,22 9,27
FIC FI EM AÇÕES CAIXA IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	3,43 -0,30	-2,04 -0,76	2,67 -0,58	-4,38 -0,69	-3,96 -1,25	-16,57 -2,41	17,26 -6,69
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	6,15	-0,76	3,02	-4,39	-5,09	-22,33	7,32

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.	2,42	0,51	-0,22	-0,70	-2,38	-8,17	-16,63
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	2,71 -1,03	-3,81 -2,53	0,46 -2,79	-6,19 -2,50	-10,27 -7,56	-16,05 -1,88	22,90 -1,05
FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO % do CDI	1,97 175,45	3,29 61,24	3,50 107,71	3,43 52,35	9,35 69,40	12,63 56,29	24,58 97,91
CARE11 Var. IBOVESPA p.p.	1,59 -2,15	-31,91 -30,64	-13,90 -17,14	-40,37 -36,68	-58,89 -56,18	-50,97 -36,80	-43,59 -67,54
CORONEL FABRICIANO Var. IPCA + 5,04% p.p.	1,48 0,82	5,13 0,09	3,73 0,91	5,62 -0,52	8,61 -0,55	13,53 -14,57	
CDI	1,12	5,37	3,25	6,55	13,48	22,43	25,10
IBOVESPA	3,74	-1,28	3,24	-3,69	-2,71	-14,17	23,95
INPC + 6,00%	0,87	5,27	3,03	6,53	9,94	30,40	50,49
IPCA + 6,00%	0,74	5,43	3,05	6,63	10,15	30,45	49,38

## 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	1,14	5,42	3,26	6,67	13,53	20,82	23,37	31,17	40,60
IRF-M 1+	2,85	8,54	6,92	10,30	15,84	14,80	14,48	30,11	50,74
IRF-M TOTAL	2,20	7,34	5,54	8,93	14,73	16,57	17,40	30,67	48,09
IMA-B 5	0,57	5,93	3,02	6,92	9,45	19,90	28,76	40,94	59,58
IMA-B 5+	4,13	11,16	11,29	9,84	11,30	11,03	22,89	28,01	69,69
IMA-B TOTAL	2,53	8,76	7,39	8,55	10,47	15,54	26,13	34,56	66,49
IMA-GERAL TOTAL	1,77	6,78	4,95	7,60	12,55	18,47	23,45	32,82	51,09
IDKA 2	0,29	5,76	2,60	7,07	8,74	18,79	28,85	40,48	57,41
IDKA 20	7,14	15,51	20,12	11,68	12,90	1,60	17,65	14,97	73,96
CDI	1,12	5,37	3,25	6,55	13,48	22,43	25,10	31,21	39,57

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,74	-1,28	3,24	-3,69	-2,71	-14,17	23,95	11,65	41,15
IBRX 100	3,59	-2,09	2,36	-4,66	-4,47	-16,34	23,50	12,48	44,21
IBRX 50	2,92	-3,51	0,95	-5,97	-4,44	-15,81	25,71	11,41	38,93
SMALL CAP	13,54	4,71	13,69	1,56	-7,34	-32,24	6,89	5,09	34,10
Índice Consumo - ICON	12,26		6,51	-6,28	-15,80	-46,84	-32,02	-26,79	-9,87
Índice Dividendos - IDIV	0,84	0,48	2,64	-1,14	-0,85	1,55	39,98	32,28	81,33

**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	2,16	6,32	3,02	-1,39	9,00	-3,17	28,94	96,40	109,24

**Investimentos Imobiliários**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	5,43	5,10	7,30	5,10	6,84	6,99	13,39	18,05	36,10

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	0,56	4,28	0,55	-1,39	6,70	-11,51	19,15	69,85	72,84

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,23	2,95	1,56	3,59	3,94	16,13	25,48	27,84	33,80
INPC	0,36	2,79	1,54	3,50	3,74	16,08	26,41	29,00	35,17
IGPM	-1,84	-2,58	-2,73	-2,14	-4,47	5,78	44,96	54,39	66,19
SELIC	1,12	5,37	3,25	6,55	13,48	22,43	25,10	31,21	39,57

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,57	4,62	2,56	5,63	8,08	25,59	41,11	49,48	62,68
IPCA + 5,00%	0,66	5,03	2,80	6,13	9,11	28,01	45,21	55,30	70,63
IPCA + 5,50%	0,70	5,23	2,93	6,38	9,63	29,23	47,29	58,27	74,72
IPCA + 5,89%	0,73	5,39	3,02	6,57	10,03	30,18	48,92	60,62	77,96
IPCA + 6,00%	0,74	5,43	3,05	6,63	10,15	30,45	49,38	61,28	78,88
INPC + 4,00%	0,70	4,45	2,54	5,53	7,87	25,54	42,15	50,84	64,35
INPC + 6,00%	0,87	5,27	3,03	6,53	9,94	30,40	50,49	62,75	80,72

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
	<b>Total</b>		<b>0,00</b>	<b>0,00</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.026.149,95

Value-At-Risk: 1,15%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CORONEL FABRICIANO		1,15	1,15			89.132.722,29	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,80%

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		0,22	0,00	0,01			1.567.543,39	1,76
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,83	0,02	0,04			2.266.622,29	2,54
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,86	0,06	0,03			7.362.634,90	8,26
BB PREV RF IDKA2		0,99	0,03	0,16			3.444.685,53	3,86
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI		0,87	0,02	0,01			2.729.037,56	3,06
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,06	0,14	0,04			7.217.607,37	8,10
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,01	0,09	0,16			10.437.259,50	11,71
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,00	-0,00	0,00			15.812.598,74	17,74
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		0,00	0,00	0,00			3.682.714,19	4,13
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,30	0,02	0,33			10.147.984,87	11,39
SANTANDER FI IMA-B 5 TOP RENDA FIXA LP		0,87	0,01	0,01			1.789.996,39	2,01
<b>Sub-total</b>	0,92	0,60	0,39		-0,04	1,08	66.458.684,73	74,56

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		1,99	0,07	0,07			3.608.093,17	4,05
BB PREV RF IMA-B		1,95	0,18	0,05			9.777.832,80	10,97
CAIXA FI RF SIMPLES LP		0,02	0,00	0,02			11,98	0,00
<b>Sub-total</b>	3,22	1,96	0,25		0,47	2,62	13.385.937,95	15,02

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,27%

Artigo 8º I

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		8,55	0,21	1,25			2.632.624,64	2,95
FIC FI EM AÇÕES CAIXA IBOVESPA		8,67	0,10	0,16			1.215.939,78	1,36
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR		8,28	0,08	2,92			1.055.863,44	1,18
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES		7,37	0,03	2,87			548.639,27	0,62
<b>Sub-total</b>	16,20	8,27	0,42		0,14	3,32	5.453.067,13	6,12

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 2,55%

Artigo 10º I

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		2,55	0,09	2,55			3.533.538,72	3,96
<b>Sub-total</b>	4,38	2,55	0,09		0,19	1,97	3.533.538,72	3,96

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 15,63%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CARE11		15,63	0,01	16,81			301.493,76	0,34
<b>Sub-total</b>	39,56	15,63	0,01		0,01	1,59	301.493,76	0,34