

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

CONSOLIDADO

Período: 2º trimestre de 2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

97,03%

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Trim.		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,634200%)	0,47	0,02	0,45	2,44	30.882.857,53	2,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	0,47	0,02	0,46	2,48	31.351.497,28	2,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,886400%)	0,60	0,02	0,47	2,50	7.353.297,25	0,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	0,47	0,02	0,47	2,51	83.879.070,86	5,87
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	3,83	0,02	0,47	2,51	12.563.639,24	0,88
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,216000%)	3,02	0,02	0,49	2,58	2.659.083,07	0,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	0,47	0,02	0,47	2,51	126.436.301,67	8,85
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	0,47	0,02	0,46	2,47	42.875.073,66	3,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	0,47	0,02	0,44	2,44	89.603.873,26	6,27
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	0,47	0,02	0,46	2,48	74.089.643,10	5,18
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,926400%)	2,96	0,02	0,47	2,51	17.730.071,42	1,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	0,47	0,02	0,47	2,52	72.383.487,59	5,06
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	0,47	0,02	0,47	2,52	85.042.830,42	5,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	2,99	0,02	0,47	2,53	29.648.561,05	2,07
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,225100%)	3,09	0,02	0,49	2,58	6.143.791,32	0,43

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Trim.		
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea a	0,48	0,02	0,46	2,49	712.643.078,72	49,86

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	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,37	0,07	1,16	3,15	224.852.760,00	15,73	7.342.301.496,88	3,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,39	0,06	0,93	1,44	208.152.326,99	14,56	3.755.106.041,15	5,54
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	6,13	0,69	2,18	7,06	31.815.120,90	2,23	240.605.691,57	13,22
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2,39	0,06	0,93	1,44	12.640.381,21	0,88	3.511.010.528,94	0,36
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	1,27	0,10	1,12	2,80	477.460.589,10	33,41		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,03	0,05	1,08	3,12	21.270.617,82	1,49	13.832.360.605,07	0,15
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,05	1,00	2,90	368.778,06	0,03	4.278.810.513,26	0,01
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,05	0,04	1,13	3,22	175.160.772,40	12,26	8.773.662.957,45	2,00
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	0,41	0,04	1,13	3,21	196.800.168,28	13,77		
		Renda Fixa	0,61	0,05	0,82	2,69	1.386.903.836,10	97,03		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

1,39%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	28,40	0,91	9,71	23,77	12.331.902,87	0,86	125.467.276,94	9,83
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	26,49	1,08	8,03	24,57	7.504.691,42	0,53	675.053.112,68	1,11
Sub-total Artigo 8º I			26,18	0,98	9,07	24,07	19.836.594,29	1,39		
Renda Variável			26,18	0,98	9,07	24,07	19.836.594,29	1,39		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,58%

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	23,77	0,25	0,47	5,60	22.551.180,73	1,58	2.036.420.590,68	1,11
Sub-total Artigo 9º III			23,77	0,25	0,47	5,60	22.551.180,73	1,58		
Investimentos no Exterior			23,77	0,25	0,47	5,60	22.551.180,73	1,58		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

0,00%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	19,46	0,00	0,00	3,20	0,00	0,00	1.596.861.875,61	0,00
Sub-total Artigo 10º I			19,46	0,00	0,00	3,24	0,00	0,00		
Investimentos Estruturados			18,89	0,00	0,00	3,24	0,00	0,00		
Total			1,28	0,07	0,91	2,98	1.429.291.611,12	100,00		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

Ativo	Valor (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	0,00
Sub-total Disponibilidades Financeiras	0,00
Total	1.429.291.611,12

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 a	Títulos do Tesouro Nacional	712.643.078,72	49,86	0,00	57,40	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	477.460.589,10	33,41	0,00	20,33	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	196.800.168,28	13,77	0,00	22,27	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	1.386.903.836,10	97,03					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	19.836.594,29	1,39	0,00	0,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	19.836.594,29	1,39					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	22.551.180,73	1,58	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	22.551.180,73	1,58					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	0,00	0,00	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	0,00	0,00					15,00
Total		1.429.291.611,12	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre (R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,46 43,22	2,49 79,27	2,49 79,27	6,25 96,22	9,55 70,55	3.286.211,91	17.467.784,89
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,12 104,78	2,80 88,94	2,80 88,94	6,42 98,84	11,42 84,31	7.178.909,81	18.652.305,33
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,13 105,05	3,21 102,03	3,21 102,03	6,52 100,29	13,72 101,28	2.142.169,14	4.760.701,89
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	9,07 0,07	24,07 8,16	24,07 8,16	9,63 2,02	7,83 -12,01	1.649.870,46	3.848.182,32
Artigo 9º III % do CDI	0,47 43,67	5,60 178,11	5,60 178,11	14,53 223,59	13,40 98,98	105.068,17	1.196.507,70
Artigo 10º I % do CDI	0,00 0,00	3,24 103,10	3,24 103,10	12,37 190,37	22,85 168,70	0,00	1.855.705,93
CONSOLIDADO (Total)						14.362.229,49	47.781.188,06

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
NTN-B 150535 (5,634200%)	30.745.592,85	0,00	0,00	0,00	30.882.857,53	137.264,68	749.791,97
NTN-B 150535 (5,784900%)	31.208.451,57	0,00	0,00	0,00	31.351.497,28	143.045,71	772.028,21
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.319.165,86	0,00	0,00	0,00	7.353.297,25	34.131,39	182.779,82
NTN-B 150535 (5,909200%)	83.488.154,44	0,00	0,00	0,00	83.879.070,86	390.916,42	2.089.482,56
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.504.925,42	0,00	0,00	0,00	12.563.639,24	58.713,82	313.482,48
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.646.056,84	0,00	0,00	0,00	2.659.083,07	13.026,23	68.107,01
NTN-B 150545 (5,900200%)	125.848.140,27	0,00	0,00	0,00	126.436.301,67	588.161,40	3.146.659,05
NTN-B 150832 (5,763300%)	42.680.217,03	0,00	0,00	0,00	42.875.073,66	194.856,63	1.035.018,68
NTN-B 150860 (5,599600%)	89.208.160,56	0,00	0,00	0,00	89.603.873,26	395.712,70	2.130.325,92
NTN-B 150860 (5,788000%)	73.751.437,98	0,00	0,00	0,00	74.089.643,10	338.205,12	1.792.722,76
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.647.212,15	0,00	0,00	0,00	17.730.071,42	82.859,27	434.474,15

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
NTN-B 150860 (5,949840%)	72.043.895,86	0,00	0,00	0,00	72.383.487,59	339.591,73	1.777.532,57
NTN-B 150860 (5,959200%)	84.643.215,20	0,00	0,00	0,00	85.042.830,42	399.615,22	2.090.224,52
NTN-B 150860 (5,986700%)	29.508.595,82	0,00	0,00	0,00	29.648.561,05	139.965,23	730.519,44
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.113.644,96	0,00	0,00	0,00	6.143.791,32	30.146,36	154.635,75
					712.643.078,72	3.286.211,91	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	12.523.767,25	0,00	0,00	0,00	12.640.381,21	116.613,96	179.389,25
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	206.231.362,75	0,00	0,00	0,00	208.152.326,99	1.920.964,24	2.953.357,46
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	31.135.593,01	0,00	0,00	0,00	31.815.120,90	679.527,89	2.097.417,65
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	337.237.858,63	247.934.409,51	-364.781.311,86	0,00	224.852.760,00	4.461.803,72	13.422.140,97
					477.460.589,10	7.178.909,81	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	365.136,64	0,00	0,00	0,00	368.778,06	3.641,42	10.397,41
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	114.175.402,44	59.073.590,85	0,00	0,00	175.160.772,40	1.911.779,11	4.224.840,11
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	21.043.869,21	0,00	0,00	0,00	21.270.617,82	226.748,61	525.464,37
					196.800.168,28	2.142.169,14	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB AÇÕES CONSUMO FIC	11.239.979,42	0,00	0,00	0,00	12.331.902,87	1.091.923,45	2.368.126,79
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	6.946.744,41	0,00	0,00	0,00	7.504.691,42	557.947,01	1.480.055,53
					19.836.594,29	1.649.870,46	

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	22.446.112,56	0,00	0,00	0,00	22.551.180,73	105.068,17	1.196.507,70
					22.551.180,73	105.068,17	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	1.024.937,81
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	26.791.502,30	0,00	-26.791.502,30	0,00	0,00	0,00	830.768,12
					0,00	0,00	

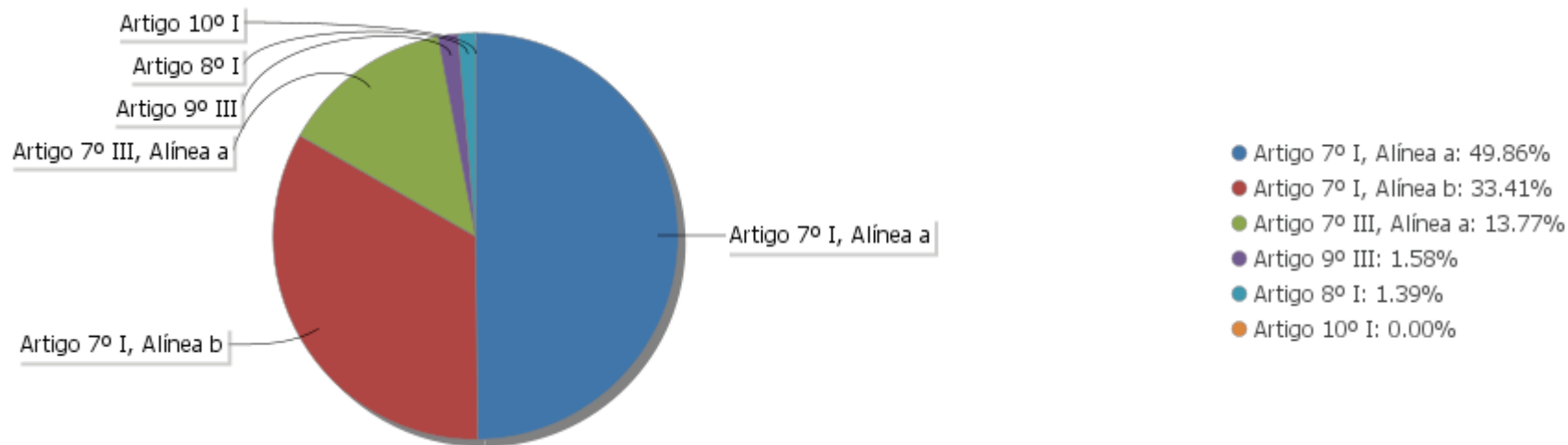
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

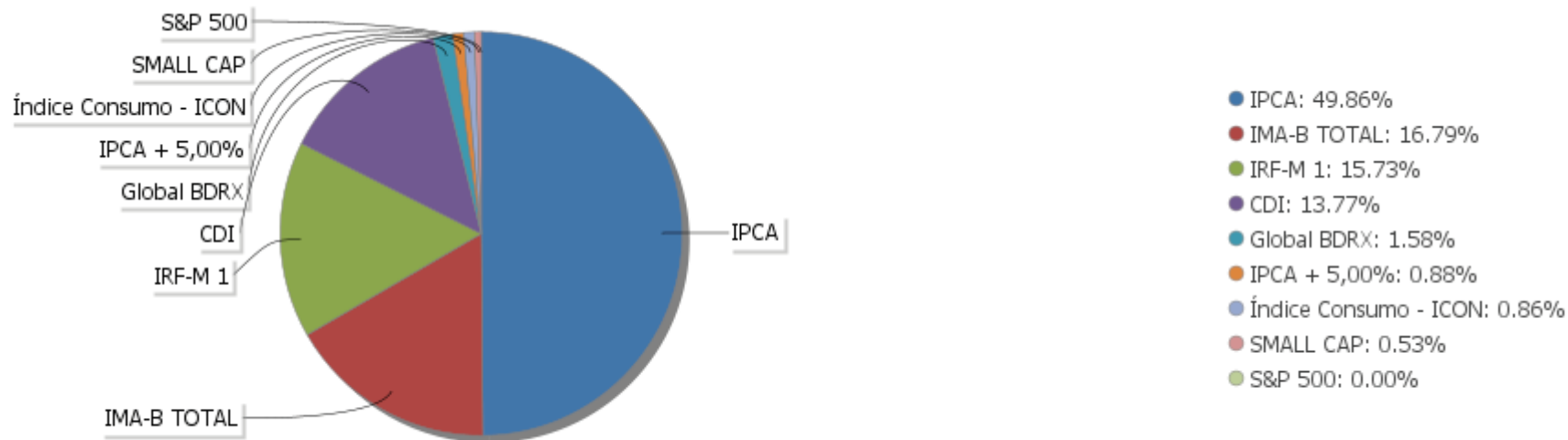
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	464.040.703,30	32,47	464.040.703,30	32,47	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	464.040.703,30	32,47	
acima de 365 dias	965.250.907,82	67,53	1.429.291.611,12	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

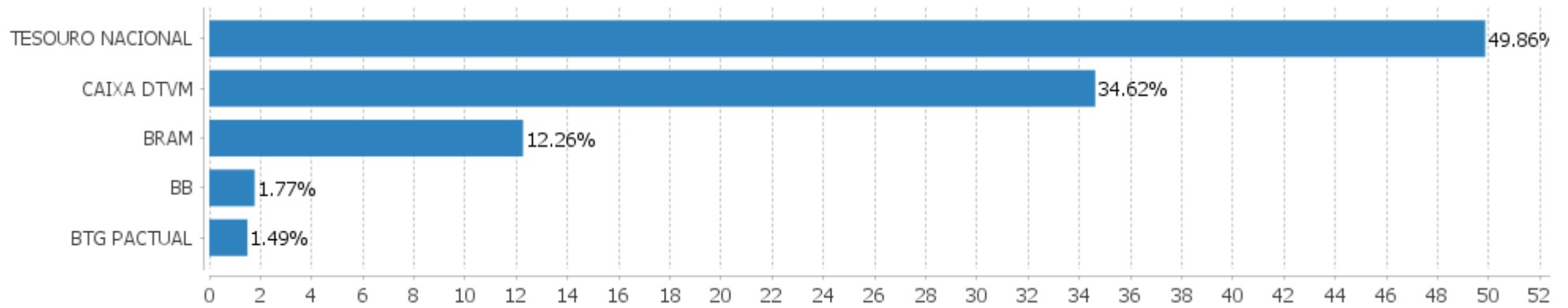


Alocação Por Estratégia



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	1,40	0,80	1,41	0,89	1,16	0,91							6,74
IPCA + 4,00%	0,87	1,12	1,07	0,89	0,57	0,25							4,88
p.p. indexador	0,53	-0,33	0,34	-0,01	0,58	0,66							1,87
2022	-0,32	0,33	1,64	0,23	1,01	-0,01	1,05	0,37	0,09	1,36	0,80	0,63	7,39
IPCA + 4,00%	0,87	1,31	1,97	1,36	0,81	1,00	-0,35	-0,00	0,04	0,90	0,72	0,97	10,00
p.p. indexador	-1,18	-0,98	-0,33	-1,13	0,20	-1,01	1,40	0,37	0,05	0,45	0,08	-0,34	-2,61
2021	-0,23	-0,56	0,26	0,90	0,46	0,19	-0,17	-0,33	-0,08	-0,80	1,22	1,45	2,32
IPCA + 2,00%	0,41	1,00	1,11	0,47	1,00	0,70	1,13	1,04	1,33	1,41	1,11	0,91	12,25
p.p. indexador	-0,64	-1,56	-0,86	0,44	-0,53	-0,50	-1,30	-1,38	-1,41	-2,21	0,11	0,54	-9,93
2020	0,52	0,46	-0,47	0,59	1,11	0,70	0,84	-0,16	-0,27	-0,10	1,14	1,59	6,09
IPCA + 3,75%	0,53	0,51	0,39	-0,02	-0,09	0,57	0,70	0,55	0,95	1,17	1,19	1,68	8,42
p.p. indexador	-0,01	-0,06	-0,87	0,61	1,20	0,13	0,14	-0,71	-1,22	-1,27	-0,04	-0,09	-2,33

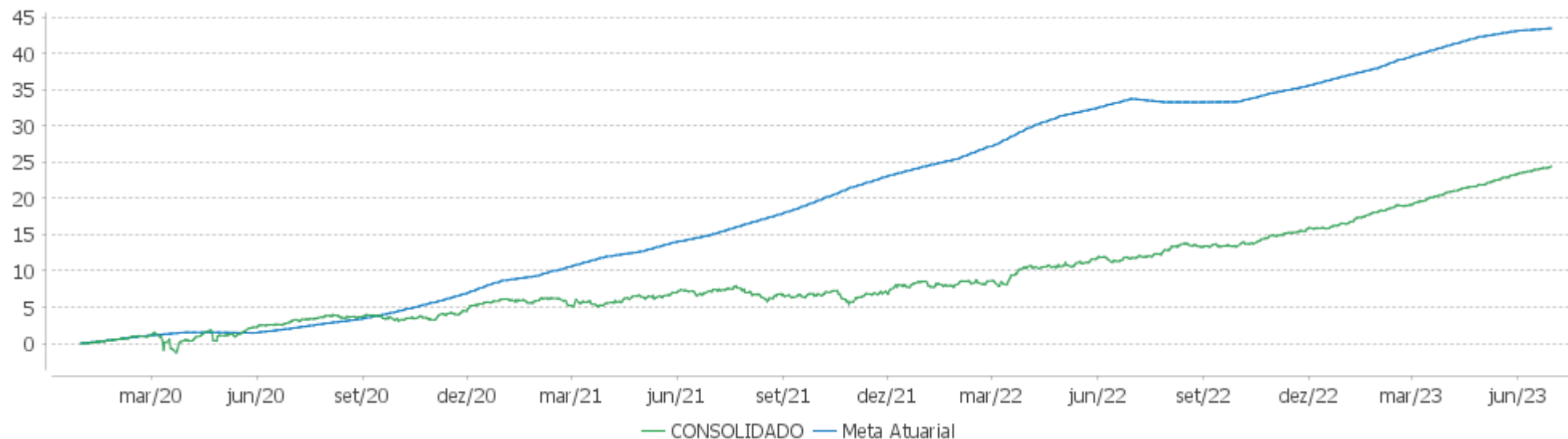
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

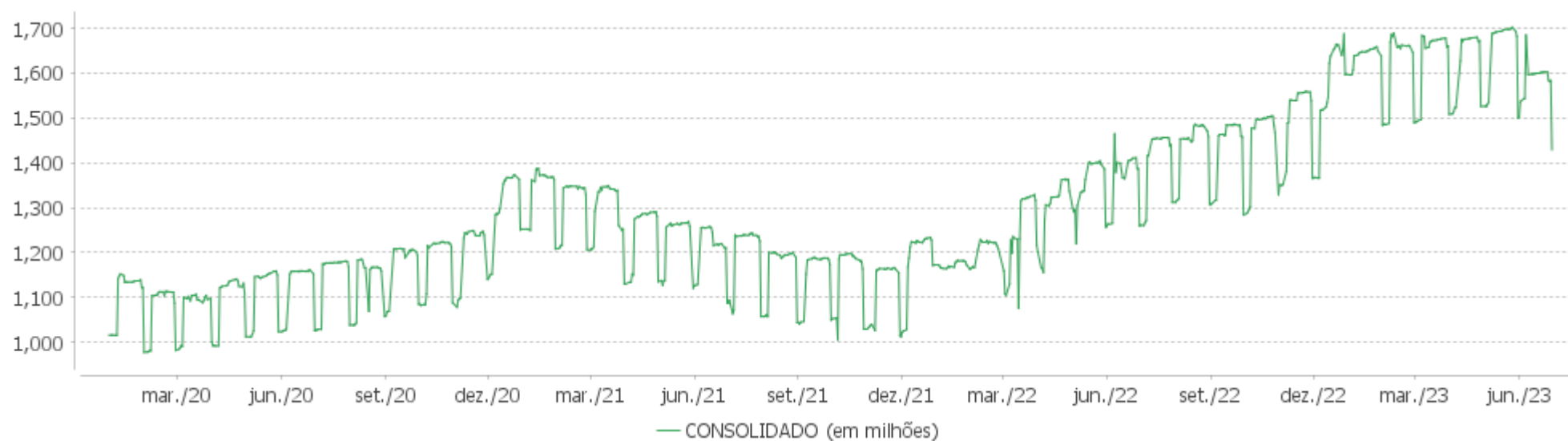
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	17	40,48	03 meses	2,98	1,72	1,26	0,62
Meses abaixo - Meta Atuarial	25	59,52	06 meses	6,74	4,88	1,87	0,82
			12 meses	11,40	7,27	4,13	1,28
			24 meses	16,10	23,60	-7,50	2,16
			36 meses	20,88	37,77	-16,88	2,17
Maior rentabilidade da Carteira	1,64	2022-03	Desde 31/12/2019	24,44	40,40	-15,97	2,57
Menor rentabilidade da Carteira	-0,80	2021-10					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

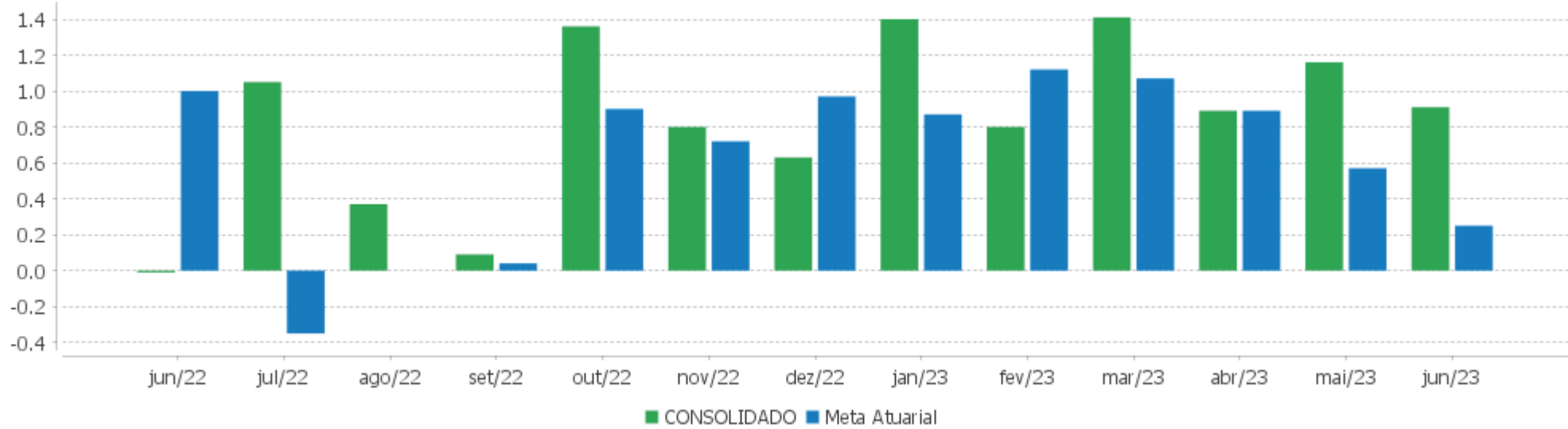


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150535 (5,784900%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	2,48 1,72	2,48 1,72	6,22 3,35	9,49 6,33	22,31 6,88	32,23 7,17
NTN-B 150535 (6,216000%) Var. IPCA p.p.	0,49 0,57	2,58 1,82	2,58 1,82	6,43 3,56	6,73 3,57	19,44 4,02	
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	2,47 1,71	2,47 1,71	6,21 3,34	9,47 6,31	22,25 6,82	32,13 7,07
NTN-B 150535 (5,886400%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	2,50 1,74	2,50 1,74	6,27 3,40	9,60 6,44	22,48 7,06	
NTN-B 150860 (6,225100%) Var. IPCA p.p.	0,49 0,57	2,58 1,82	2,58 1,82	6,44 3,57	6,70 3,54	19,33 3,91	
NTN-B 150860 (5,959200%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	2,52 1,76	2,52 1,76	6,31 3,44	9,67 6,51	22,63 7,20	32,70 7,64
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	0,45 0,53	2,44 1,68	2,44 1,68	6,15 3,28	9,34 6,18	25,54 10,11	35,64 10,58
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	2,51 1,75	2,51 1,75	6,28 3,41	9,62 6,46	26,10 10,68	36,41 11,35
NTN-B 150860 (5,986700%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	2,53 1,77	2,53 1,77	6,32 3,45	6,57 3,41	19,15 3,73	28,94 3,88
NTN-B 150860 (5,949840%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	2,52 1,76	2,52 1,76	6,30 3,43	9,66 6,50	22,61 7,19	32,68 7,62
NTN-B 150860 (5,599600%) Var. IPCA p.p.	0,44 0,52	2,44 1,67	2,44 1,67	6,13 3,26	9,30 6,14	22,16 6,74	32,14 7,09
NTN-B 150545 (5,900200%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	2,51 1,75	2,51 1,75	6,28 3,41	9,61 6,45	26,10 10,67	36,42 11,37
NTN-B 150535 (5,927000%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	2,51 1,75	2,51 1,75	6,29 3,42	9,56 6,40	22,45 7,03	32,47 7,41
NTN-B 150860 (5,788000%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	2,48 1,72	2,48 1,72	6,22 3,35	9,50 6,34	22,41 6,98	32,44 7,38
NTN-B 150860 (5,926400%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	2,51 1,75	2,51 1,75	6,29 3,42	6,54 3,38	19,11 3,69	
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,93 -1,46	1,44 -5,66	1,44 -5,66	5,55 -5,81	8,42 -5,11	18,34 0,53	24,09 -2,47
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,18	7,06	7,06	11,76	13,10	18,45	24,63

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,21	-0,05	-0,05	0,40	-0,43	0,64	-1,93
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,93	1,44	1,44	5,56	8,39		
Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,60	-0,52	-0,52	0,19	0,10		
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,16	3,15	3,15	6,59	13,58	21,47	23,68
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,03	-0,07	-0,07	-0,09	-0,24	-0,53	-0,80
BRASESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	1,13	3,22	3,22	6,53	13,87	24,53	27,55
% do CDI	105,64	102,48	102,48	100,53	102,45	104,96	105,26
BB PREV RF FLUXO FIC	1,00	2,90	2,90	5,98	12,44	20,85	22,25
% do CDI	93,03	92,23	92,23	92,01	91,84	89,21	85,01
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	1,08	3,12	3,12	6,42	13,39	23,19	25,00
% do CDI	100,52	99,28	99,28	98,84	98,85	99,25	95,53
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	8,03	24,57	24,57	13,04	18,85	-28,83	-2,28
Var. SMALL CAP p.p.	-0,14	-0,60	-0,60	-0,22	-0,94	-1,19	-3,32
BB AÇÕES CONSUMO FIC	9,71	23,77	23,77	7,66	5,73	-44,13	-35,70
Var. Índice Consumo - ICON p.p.	0,19	-0,28	-0,28	-0,72	-1,87	-1,98	-3,33
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,47	5,60	5,60	14,53	13,40	-1,43	24,43
Var. Global BDRX p.p.	-0,02	-0,29	-0,29	-0,61	-1,04	-2,02	-4,32
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	7,00	10,43	10,43	20,17	28,33	20,97	67,67
Var. S&P 500 p.p.	6,31	7,70	7,70	13,11	20,17	21,20	41,34
CONSOLIDADO	0,91	2,98	2,98	6,74	11,40	16,10	20,88
Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,66	1,26	1,26	1,87	4,13	-8,73	-19,75
CDI	1,07	3,15	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17
IBOVESPA	9,00	15,91	15,91	7,61	19,83	-6,87	24,23
INPC + 6,00%	0,39	2,22	2,22	5,67	9,15	29,49	49,89
IPCA + 6,00%	0,41	2,19	2,19	5,86	9,33	29,66	48,88

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES CONSUMO FIC	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI			D+0	D+0		
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	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
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	1,19	3,22	3,22	6,68	13,82	22,00	24,49	31,97	41,51
IRF-M 1+	2,65	6,89	6,89	11,41	18,80	17,59	16,30	30,02	54,96
IRF-M TOTAL	2,12	5,52	5,52	9,62	16,74	18,79	18,96	30,63	51,17
IMA-B 5	1,05	2,55	2,55	7,04	10,23	21,32	28,68	40,02	60,53
IMA-B 5+	3,37	10,90	10,90	14,91	16,34	13,82	23,52	25,96	77,32
IMA-B TOTAL	2,39	7,10	7,10	11,37	13,52	17,81	26,56	32,82	71,02
IMA-GERAL TOTAL	1,74	4,83	4,83	8,64	14,01	20,10	24,37	32,47	53,53
IDKA 2	0,97	1,99	1,99	6,79	9,28	20,32	28,82	40,12	58,67
IDKA 20	5,91	19,68	19,68	22,33	23,20	6,46	19,60	13,99	89,13
CDI	1,07	3,15	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17	32,00	40,34

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	9,00	15,91	15,91	7,61	19,83	-6,87	24,23	16,96	62,29
IBRX 100	8,87	14,96	14,96	6,59	17,60	-9,50	23,38	17,63	65,59
IBRX 50	8,77	13,79	13,79	4,96	17,68	-9,03	25,07	16,40	59,58
SMALL CAP	8,17	25,16	25,16	13,26	19,79	-27,64	1,04	6,25	50,57
Índice Consumo - ICON	9,53	24,04	24,04	8,38	7,60	-42,14	-32,37	-22,91	3,43
Índice Dividendos - IDIV	8,78	13,95	13,95	9,30	17,73	12,91	39,77	39,55	106,18

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	0,69	2,73	2,73	7,06	8,17	-0,23	26,33	90,25	104,62

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	4,71	14,28	14,28	10,05	12,87	14,54	12,44	20,15	48,47

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,09	0,15	0,15	4,18	5,27	-8,63	14,48	64,05	68,93

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	-0,08	0,76	0,76	2,87	3,16	15,42	25,06	27,72	32,02
INPC	-0,10	0,79	0,79	2,69	3,00	15,28	25,91	28,86	33,13
IGPM	-1,93	-4,65	-4,65	-4,46	-6,86	3,11	39,98	50,22	60,00
SELIC	1,07	3,15	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17	32,00	40,34

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,25	1,72	1,72	4,88	7,27	24,82	40,63	49,40	60,53
IPCA + 5,00%	0,33	1,96	1,96	5,37	8,30	27,23	44,71	55,22	68,37
IPCA + 5,50%	0,37	2,08	2,08	5,62	8,81	28,44	46,79	58,20	72,40
IPCA + 5,89%	0,40	2,17	2,17	5,81	9,21	29,39	48,42	60,54	75,60
IPCA + 6,00%	0,41	2,19	2,19	5,86	9,33	29,66	48,88	61,21	76,52
INPC + 4,00%	0,23	1,75	1,75	4,69	7,10	24,66	41,58	50,73	61,88
INPC + 6,00%	0,39	2,22	2,22	5,67	9,15	29,49	49,89	62,65	78,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150535 (5,634200%)	30.882.857,53	5,634200	31.931.132,38	5,229500	1.048.274,85
NTN-B 150535 (5,784900%)	31.351.497,28	5,784900	32.818.108,28	5,229500	1.466.611,00
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.353.297,25	5,886400	7.761.039,12	5,229500	407.741,87
NTN-B 150535 (5,909200%)	83.879.070,86	5,909200	88.697.589,94	5,229500	4.818.519,08
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.563.639,24	5,927000	13.304.638,49	5,229500	740.999,25
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.659.083,07	6,216000	2.882.671,67	5,229500	223.588,60
NTN-B 150545 (5,900200%)	126.436.301,67	5,900200	133.261.773,69	5,459700	6.825.472,02
NTN-B 150832 (5,763300%)	42.875.073,66	5,763300	44.591.499,33	5,176900	1.716.425,67
NTN-B 150860 (5,599600%)	89.603.873,26	5,599600	91.630.508,26	5,449500	2.026.635,00
NTN-B 150860 (5,788000%)	74.089.643,10	5,788000	77.885.932,02	5,449500	3.796.288,92
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.730.071,42	5,926400	19.013.330,46	5,449500	1.283.259,04
NTN-B 150860 (5,949840%)	72.383.487,59	5,949840	77.885.932,02	5,449500	5.502.444,43
NTN-B 150860 (5,959200%)	85.042.830,42	5,959200	91.630.508,26	5,449500	6.587.677,84
NTN-B 150860 (5,986700%)	29.648.561,05	5,986700	32.070.677,89	5,449500	2.422.116,84
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.143.791,32	6,225100	6.872.288,12	5,449500	728.496,80

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2306	03/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	31.298,80	0,00	10.096,84308300	3,0998600000
2294	03/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	22.845,02	0,00	7.369,69411500	3,0998600000
2330	03/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	34.090,60	10.997,46294700	3,0998600000
2320	04/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	679.817,31	0,00	219.234,73288900	3,1008650000
2308	04/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	489.315,64	157.799,72379400	3,1008650000
2296	04/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.316.588,85	0,00	1.392.059,58659900	3,1008650000
2322	05/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.942.893,50	0,00	626.220,88340300	3,1025690000
2295	05/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.176.973,64	0,00	1.990.922,24540300	3,1025690000
2299	06/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.134,84	0,00	7.454,08704900	3,1036450000
2323	10/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	15.898.164,50	5.119.401,94082000	3,1054730000
2319	10/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.961.946,13	0,00	6.750.001,08840100	3,1054730000
2314	10/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	42.797.372,39	13.781.273,38687800	3,1054729987
2298	10/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	110.262.872,89	0,00	35.505.983,43311900	3,1054730000
2333	10/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	18.180.715,91	5.854.411,19954100	3,1054730000
2329	10/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	48.457.992,20	0,00	15.604.061,66790000	3,1054730000
2324	11/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.542.733,60	817.985,33817100	3,1085320000
2318	11/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.896.673,30	0,00	4.470.493,88585900	3,1085320000
2293	11/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.017,82	0,00	2.257,59940700	3,1085320000
2307	11/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	35.299.611,38	0,00	11.355.717,54770400	3,1085320000
2311	12/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.542.733,56	817.625,76593700	3,1098990000
2297	12/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	43.722,32	0,00	14.059,08037500	3,1098990000
2331	12/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.542.733,56	817.625,76837300	3,1098990000
2321	13/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	164.461,12	0,00	52.862,91254400	3,1110870000
2300	13/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.623.393,13	0,00	843.240,04118100	3,1110870000
2313	14/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	307.413,76	98.780,89422200	3,1120771119
2305	14/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	328.731,56	0,00	105.630,92108500	3,1120770000
2289	18/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.936,90	0,00	621,92732900	3,1143510000
2304	18/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.493,10	0,00	2.405,99084600	3,1143510000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2303	19/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	306.858,26	0,00	98.494,82390400	3,1154760000
2325	24/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.427.824,94	1.098.821,73194600	3,1195460000
2317	24/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.427.824,94	0,00	1.098.821,73239300	3,1195460000
2291	24/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.104,66	0,00	5.162,50121000	3,1195460000
2312	24/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	15.876,80	5.089,45734800	3,1195460000
2328	25/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	75.669,18	24.241,60618700	3,1214590000
2316	25/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	219.490,63	0,00	70.316,67883500	3,1214590000
2326	26/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.258,86	1.684,20841400	3,1224520000
2310	26/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.682.982,64	3.101.082,94206600	3,1224520000
2301	27/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.247,55	0,00	8.402,39412100	3,1238180000
2290	27/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	422,55982900	3,1238180000
2315	28/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.830.915,84	0,00	906.063,55371800	3,1244120000
2327	28/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	29.061.046,56	9.301.285,02735300	3,1244120000
2309	28/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	97.732.115,16	31.280.162,52388100	3,1244120000
2292	28/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	940,88743700	3,1244120000
2302	28/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.714.330,06	0,00	2.148.989,97315300	3,1244120000
2332	28/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	30.116.044,21	9.638.947,80942000	3,1244120000
2434	02/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	504.803,13	0,00	161.460,74046300	3,1264760000
2393	03/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	635.683,40	203.208,26170800	3,1282360000
2435	03/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	188.606,99	0,00	60.291,80343100	3,1282360000
2395	04/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	635.683,40	203.080,11203200	3,1302100000
2394	04/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.326.319,21	0,00	423.715,72833772	3,1302100000
2436	04/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	152.430,72	0,00	48.696,64335600	3,1302100000
2448	04/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	635.683,39	203.080,10957400	3,1302100000
2447	04/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.607.488,09	0,00	1.471.942,16681900	3,1302100000
2338	04/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	635.683,39	203.080,10879600	3,1302100000
2337	04/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	635.593,39	203.051,35629200	3,1302100000
2336	04/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	635.683,39	0,00	203.080,10964100	3,1302100000
2396	05/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.269,05	0,00	3.598,13979300	3,1319100000
2449	05/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.105.026,96	0,00	672.122,43008260	3,1319100000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2398	08/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.328.680,63	3.934.673,16777400	3,1333430000
2397	08/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	36.539.245,69	0,00	11.661.425,41368700	3,1333430000
2451	08/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	43.296.588,34	13.818.017,48047700	3,1333430000
2450	08/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	140.334.626,82	0,00	44.787.508,68321700	3,1333430000
2340	08/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	18.341.947,99	5.853.795,12782300	3,1333430000
2339	08/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	48.392.407,01	0,00	15.444.337,56853300	3,1333430000
2437	09/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.611,49	0,00	3.066,46758400	3,1343850000
2452	09/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	189.194,83	0,00	60.361,06923600	3,1343850000
2438	10/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.469,67	0,00	1.425,44196700	3,1356380000
2399	11/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.385,58	0,00	2.035,31273500	3,1373950000
2453	11/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	235.948,89	0,00	75.205,35029800	3,1373950000
2439	11/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.653,73	0,00	3.714,46056300	3,1373950000
2454	12/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	700,00	0,00	223,04401500	3,1383940000
2440	12/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.577,79	0,00	821,37233200	3,1383940000
2406	15/05/2023	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	8.523.095,45	0,00	2.243.468,20612364	3,7990712000
2455	15/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.272,09	0,00	723,63932800	3,1398100000
2441	15/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.897,79	0,00	1.241,40951204	3,1398100000
2456	16/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	39.976,83	12.726,02739700	3,1413440000
2442	17/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.815,90	0,00	2.168,88464000	3,1425830000
2457	17/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.972,31	2.218,65575400	3,1425830000
2400	18/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	901,10	286,57931800	3,1443240000
2459	18/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.352,64	2.338,38497100	3,1443240000
2458	18/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.874,73	0,00	3.458,52717400	3,1443240000
2460	19/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.204,90	0,00	4.197,34571800	3,1460120000
2461	22/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.405,02	0,00	764,12790800	3,1474050000
2443	22/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.104,66	0,00	5.116,80574900	3,1474050000
2462	23/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	18.601,63	5.906,81696700	3,1491800000
2444	23/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	32.221,71	0,00	10.231,77779600	3,1491800000
2463	24/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.520,00	0,00	799,73824440	3,1510310000
2445	24/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	58.384,42	0,00	18.528,67204417	3,1510310000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2465	25/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.545,01	4.295,01683800	3,1536570000
2464	25/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.846,57	0,00	2.488,08605300	3,1536570000
2466	26/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	157.361,78	0,00	49.870,69134900	3,1553960000
2402	29/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.278,11	1.672,15231200	3,1564760000
2401	29/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	48.893,04	0,00	15.489,75503000	3,1564760000
2468	29/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.578.247,70	3.034.475,06266600	3,1564760000
2467	29/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	220.555,37	0,00	69.873,92585909	3,1564760000
2446	30/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	116.542,50	0,00	36.901,49942700	3,1582050000
2470	30/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.340.548,18	3.907.456,34672500	3,1582050000
2469	30/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.571,82	0,00	4.930,59190268	3,1582050000
2407	31/05/2023	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	0,00	32.282.088,55	16.111.017,36638340	2,0037275000
2404	31/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	29.073.740,91	9.201.969,07297000	3,1595130000
2403	31/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	895.881,71	0,00	283.550,56934400	3,1595130000
2471	31/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.971.099,05	0,00	940.366,14187000	3,1595130000
2472	31/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	94.497.858,39	29.908.994,95903324	3,1595130000
2341	31/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	30.172.917,12	9.549.863,26046800	3,1595130000
2473	01/06/2023	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	26.791.502,30	0,00	1.744.862,70800000	15,3545045000
2518	01/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	245.213,35	0,00	77.568,01145300	3,1612690000
2475	01/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.346.501,73	0,00	425.937,09361600	3,1612690000
2533	01/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	400,00	126,53030300	3,1612690000
2543	01/06/2023	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,00	26.791.502,30	15.315.109,60411700	1,7493510000
2474	02/06/2023	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	32.282.088,55	0,00	2.101.298,74800000	15,3629219000
2519	02/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.948,03	0,00	9.785,32569300	3,1626980000
2476	02/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	737.633,02	0,00	233.229,04052173	3,1626980000
2520	05/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	565.459,36	0,00	178.668,33077600	3,1648550000
2477	05/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.838.435,04	0,00	1.528.801,49011500	3,1648550000
2478	06/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	190.193,03	0,00	60.059,77461200	3,1667290000
2479	06/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	16.438,10	5.190,87644400	3,1667290000
2522	07/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.282.275,06	3.876.197,69464700	3,1686400000
2521	07/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	38.561.473,65	0,00	12.169.723,80895274	3,1686400000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2481	07/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	59.248.503,38	18.698.401,64481800	3,1686400000
2480	07/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	143.919.411,44	0,00	45.419.931,40274600	3,1686400000
2535	07/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	18.219.179,89	5.749.842,16888002	3,1686400000
2534	07/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	48.621.481,35	0,00	15.344.589,90292365	3,1686400000
2523	09/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	19.744.492,21	6.226.421,20711900	3,1710820000
2483	09/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	47.761.055,90	15.061.438,30402367	3,1710820000
2482	09/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.987,31	0,00	5.356,94441200	3,1710820000
2536	09/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	22.294.175,34	7.030.463,21134400	3,1710820000
2525	12/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	136.793,92	43.112,00574300	3,1729890000
2524	12/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.564,43	0,00	5.850,77036100	3,1729890000
2485	12/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	22.358,72	7.046,57858200	3,1729890000
2484	12/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	539.100,53	0,00	169.903,05670700	3,1729890000
2486	13/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	27.251,85	0,00	8.586,96237800	3,1736310000
2505	13/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.398,37	0,00	2.016,10395100	3,1736310000
2526	14/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	634.495,25	199.815,03222800	3,1754130000
2488	14/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	772.548,43	243.290,69251700	3,1754130000
2487	14/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.164.144,35	0,00	366.611,94937400	3,1754130000
2506	14/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.499,07	0,00	3.621,28327800	3,1754130000
2537	14/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	635.683,39	200.189,20058588	3,1754130000
2490	15/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	15.683,19	4.935,80418200	3,1774320000
2489	15/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.713,84	0,00	3.057,13544700	3,1774320000
2507	16/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.211,71	0,00	2.268,73868800	3,1787310000
2492	16/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	68.000,52	21.392,34766400	3,1787310000
2491	16/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.955,28	0,00	5.648,56856300	3,1787310000
2538	16/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.721,55	2.114,53869100	3,1787310000
2493	19/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.004,69	0,00	630,34956300	3,1802830000
2508	19/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	162.716,41	0,00	51.164,12910400	3,1802830000
2527	20/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.188,15	373,38310800	3,1821200000
2495	20/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.808,08	568,19981647	3,1821200000
2494	20/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	52.746,14	0,00	16.575,78595400	3,1821200000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2509	20/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.605,80	0,00	504,63213200	3,1821200000
2496	21/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	760,96	239,02160000	3,1836150000
2510	21/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	64.301,65	0,00	20.197,68407900	3,1836150000
2511	22/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	46.152,18	0,00	14.493,02405000	3,1844410000
2497	23/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.111,06	0,00	976,29417600	3,1866010000
2512	23/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.944,52	0,00	5.317,42756600	3,1866010000
2513	26/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.544,75	0,00	4.875,50559200	3,1883360000
2498	27/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	19.502.284,72	6.113.237,34480857	3,1901730000
2514	27/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	40.091,00	0,00	12.567,03006300	3,1901730000
2515	28/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	71.380,46	0,00	22.364,01603500	3,1917550000
2500	28/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.731.388,80	855.763,92924896	3,1917550000
2499	28/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.992,20	0,00	2.190,70699300	3,1917550000
2529	29/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.212,63	1.632,15808700	3,1937040000
2528	29/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	25.364,58	0,00	7.942,05724700	3,1937040000
2516	29/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	102.527,92	0,00	32.103,13792300	3,1937040000
2501	29/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	524.309,28	0,00	164.169,65379384	3,1937040000
2532	30/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	106.210,13	33.231,17650611	3,1960990000
2531	30/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.182.222,73	8.817.693,92312316	3,1960990000
2530	30/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	902.914,32	0,00	282.505,11639300	3,1960990000
2517	30/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	799.866,04	0,00	250.263,22401152	3,1960990000
2504	30/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	673.577,91	210.750,01431433	3,1960990000
2503	30/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	100.941.670,60	31.582.773,43724334	3,1960990000
2540	30/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	16.494.112,94	5.160.701,51033700	3,1960990000
2539	30/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	14.282.069,36	4.468.594,17016000	3,1960990000
2541	30/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.220.259,77	0,00	1.320.440,87808200	3,1960990000
Total			814.167.433,38	932.208.478,44		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 4.064.574,44

Value-At-Risk: 0,28%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		0,28	0,28			1.429.291.611,12	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,21%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,634200%)		0,13	0,00	0,12			30.882.857,53	2,16
NTN-B 150535 (5,784900%)		0,13	0,00	0,12			31.351.497,28	2,19
NTN-B 150535 (5,886400%)		0,12	0,00	0,12			7.353.297,25	0,51
NTN-B 150535 (5,909200%)		0,13	0,00	0,12			83.879.070,86	5,87
NTN-B 150535 (5,927000%)		0,13	0,00	0,12			12.563.639,24	0,88
NTN-B 150535 (6,216000%)		0,13	0,00	0,12			2.659.083,07	0,19
NTN-B 150545 (5,900200%)		0,13	0,00	0,12			126.436.301,67	8,85
NTN-B 150832 (5,763300%)		0,13	0,00	0,12			42.875.073,66	3,00
NTN-B 150860 (5,599600%)		0,13	0,00	0,12			89.603.873,26	6,27
NTN-B 150860 (5,788000%)		0,13	0,00	0,12			74.089.643,10	5,18
NTN-B 150860 (5,926400%)		0,12	0,00	0,11			17.730.071,42	1,24
NTN-B 150860 (5,949840%)		0,13	0,00	0,12			72.383.487,59	5,06
NTN-B 150860 (5,959200%)		0,13	0,00	0,12			85.042.830,42	5,95
NTN-B 150860 (5,986700%)		0,13	0,00	0,12			29.648.561,05	2,07
NTN-B 150860 (6,225100%)		0,13	0,00	0,12			6.143.791,32	0,43
Sub-total	0,37	0,13	0,01		-1,66	0,46	712.643.078,72	49,86

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		0,22	0,02	0,01			224.852.760,00	15,73

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,83	0,08	1,60			208.152.326,99	14,56
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		2,34	0,03	0,77			31.815.120,90	2,23
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		0,83	0,00	0,82			12.640.381,21	0,88
Sub-total	0,58	0,56	0,14		0,09	1,12	477.460.589,10	33,41

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI		0,02	-0,00	0,02			21.270.617,82	1,49
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	-0,00	0,01			368.778,06	0,03
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,03	-0,00	0,03			175.160.772,40	12,26
Sub-total	0,05	0,03	-0,00		1,20	1,13	196.800.168,28	13,77

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 7,63%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		7,63	0,03	0,62			22.551.180,73	1,58
Sub-total	13,88	7,63	0,03		-0,04	0,47	22.551.180,73	1,58

Renda Variável

Value-At-Risk: 11,15%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		11,52	0,07	0,47			12.331.902,87	0,86
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		11,19	0,04	0,18			7.504.691,42	0,53
Sub-total	21,65	11,15	0,10		0,37	9,07	19.836.594,29	1,39

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: NaN%

Artigo 10º I

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
Sub-total	0,00	NaN	0,00		0,00	0,00	0,00	0,00