

**CEARAPREV**  
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA  
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



**CEARÁ**  
GOVERNO DO ESTADO  
SECRETARIA DO  
PLANEJAMENTO E GESTÃO

# RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

# **CONSOLIDADO**

Período: junho 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	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,634200%)	0,47	0,02	0,45	6,15	30.882.857,53	2,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	0,47	0,02	0,46	6,22	31.351.497,28	2,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,886400%)	0,60	0,02	0,47	6,27	7.353.297,25	0,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	0,47	0,02	0,47	6,28	83.879.070,86	5,87
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	3,83	0,02	0,47	6,29	12.563.639,24	0,88
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,216000%)	3,02	0,02	0,49	6,43	2.659.083,07	0,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	0,47	0,02	0,47	6,28	126.436.301,67	8,85
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	0,47	0,02	0,46	6,21	42.875.073,66	3,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	0,47	0,02	0,44	6,13	89.603.873,26	6,27
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	0,47	0,02	0,46	6,22	74.089.643,10	5,18
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,926400%)	2,96	0,02	0,47	6,29	17.730.071,42	1,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	0,47	0,02	0,47	6,30	72.383.487,59	5,06
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	0,47	0,02	0,47	6,31	85.042.830,42	5,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	2,99	0,02	0,47	6,32	29.648.561,05	2,07
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,225100%)	3,09	0,02	0,49	6,44	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	Ano		
	<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>	<b>0,48</b>	<b>0,02</b>	<b>0,46</b>	<b>6,25</b>	<b>712.643.078,72</b>	<b>49,86</b>

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	0,37	0,07	1,16	6,59	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	5,55	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	11,76	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	5,56	12.640.381,21	0,88	3.511.010.528,94	0,36
		<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>	<b>1,27</b>	<b>0,10</b>	<b>1,12</b>	<b>6,42</b>	<b>477.460.589,10</b>	<b>33,41</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				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,03	0,05	1,08	6,42	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	4,31	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	6,53	175.160.772,40	12,26	8.773.662.957,45	2,00
		<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>	<b>0,41</b>	<b>0,04</b>	<b>1,13</b>	<b>6,52</b>	<b>196.800.168,28</b>	<b>13,77</b>		
		<b>Renda Fixa</b>	<b>0,61</b>	<b>0,05</b>	<b>0,82</b>	<b>6,37</b>	<b>1.386.903.836,10</b>	<b>97,03</b>		

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	Ano				
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	28,40	0,91	9,71	7,66	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	13,04	7.504.691,42	0,53	675.053.112,68	1,11
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>26,18</b>	<b>0,98</b>	<b>9,07</b>	<b>9,63</b>	<b>19.836.594,29</b>	<b>1,39</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>26,18</b>	<b>0,98</b>	<b>9,07</b>	<b>9,63</b>	<b>19.836.594,29</b>	<b>1,39</b>		

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	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	23,77	0,25	0,47	14,53	22.551.180,73	1,58	2.036.420.590,68	1,11
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>23,77</b>	<b>0,25</b>	<b>0,47</b>	<b>14,53</b>	<b>22.551.180,73</b>	<b>1,58</b>		
Investimentos no Exterior			23,77	0,25	0,47	14,53	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	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	19,46	0,00	0,00	12,31	0,00	0,00	1.596.861.875,61	0,00
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>19,46</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>12,37</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>		
Investimentos Estruturados			18,89	0,00	0,00	12,37	0,00	0,00		
<b>Total</b>			<b>1,28</b>	<b>0,07</b>	<b>0,91</b>	<b>6,74</b>	<b>1.429.291.611,12</b>	<b>100,00</b>		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2023

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

Ativo	Valor (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	0,00
<b>Sub-total Disponibilidades Financeiras</b>	<b>0,00</b>
<b>Total</b>	<b>1.429.291.611,12</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 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
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>1.386.903.836,10</b>	<b>97,03</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	19.836.594,29	1,39	0,00	0,00	30,00	0,00	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>19.836.594,29</b>	<b>1,39</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
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
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>22.551.180,73</b>	<b>1,58</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	0,00	0,00	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>					15,00
<b>Total</b>		<b>1.429.291.611,12</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 a % do CDI	0,46 43,22	6,25 96,22	2,49 79,27	6,25 96,22	9,55 70,55	3.286.211,91	42.557.325,65
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,12 104,78	6,42 98,84	2,80 88,94	6,42 98,84	11,42 84,31	7.178.909,81	44.242.167,39
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,13 105,05	6,52 100,29	3,21 102,03	6,52 100,29	13,72 101,28	2.142.169,14	8.429.991,67
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	9,07 0,07	9,63 2,02	24,07 8,16	9,63 2,02	7,83 -12,01	1.649.870,46	1.743.143,00
Artigo 9º III % do CDI	0,47 43,67	14,53 223,59	5,60 178,11	14,53 223,59	13,40 98,98	105.068,17	2.860.981,57
Artigo 10º I % do CDI	0,00 0,00	12,37 190,37	3,24 103,10	12,37 190,37	22,85 168,70	0,00	6.503.558,98
<b>CONSOLIDADO (Total)</b>						<b>14.362.229,49</b>	<b>106.337.168,26</b>

### RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150535 (5,634200%)	30.745.592,85	0,00	0,00	0,00	30.882.857,53	137.264,68	1.831.881,59
NTN-B 150535 (5,784900%)	31.208.451,57	0,00	0,00	0,00	31.351.497,28	143.045,71	1.881.361,40
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.319.165,86	0,00	0,00	0,00	7.353.297,25	34.131,39	444.669,94
NTN-B 150535 (5,909200%)	83.488.154,44	0,00	0,00	0,00	83.879.070,86	390.916,42	5.081.313,88
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.504.925,42	0,00	0,00	0,00	12.563.639,24	58.713,82	762.114,26
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.646.056,84	0,00	0,00	0,00	2.659.083,07	13.026,23	164.818,42
NTN-B 150545 (5,900200%)	125.848.140,27	0,00	0,00	0,00	126.436.301,67	588.161,40	7.653.337,47
NTN-B 150832 (5,763300%)	42.680.217,03	0,00	0,00	0,00	42.875.073,66	194.856,63	2.527.048,48
NTN-B 150860 (5,599600%)	89.208.160,56	0,00	0,00	0,00	89.603.873,26	395.712,70	5.214.694,66
NTN-B 150860 (5,788000%)	73.751.437,98	0,00	0,00	0,00	74.089.643,10	338.205,12	4.374.423,19
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.647.212,15	0,00	0,00	0,00	17.730.071,42	82.859,27	1.057.783,72
NTN-B 150860 (5,949840%)	72.043.895,86	0,00	0,00	0,00	72.383.487,59	339.591,73	4.326.070,06

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2023

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150860 (5,959200%)	84.643.215,20	0,00	0,00	0,00	85.042.830,42	399.615,22	5.086.220,38
NTN-B 150860 (5,986700%)	29.508.595,82	0,00	0,00	0,00	29.648.561,05	139.965,23	1.776.852,04
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.113.644,96	0,00	0,00	0,00	6.143.791,32	30.146,36	374.736,16
					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 Financ. Ano (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	673.963,03
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	11.104.531,25
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	3.364.946,49
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	29.098.726,62
					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 Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	365.136,64	0,00	0,00	0,00	368.778,06	3.641,42	15.224,57
BRADESCO 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	7.699.511,62
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	715.255,48
					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 Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES CONSUMO FIC	11.239.979,42	0,00	0,00	0,00	12.331.902,87	1.091.923,45	877.223,24
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	6.946.744,41	0,00	0,00	0,00	7.504.691,42	557.947,01	865.919,76
					19.836.594,29	1.649.870,46	

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

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2023

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	22.446.112,56	0,00	0,00	0,00	22.551.180,73	105.068,17	2.860.981,57
					22.551.180,73	105.068,17	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	3.567.989,40
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	26.791.502,30	0,00	-26.791.502,30	0,00	0,00	0,00	2.935.569,58
					0,00	0,00	

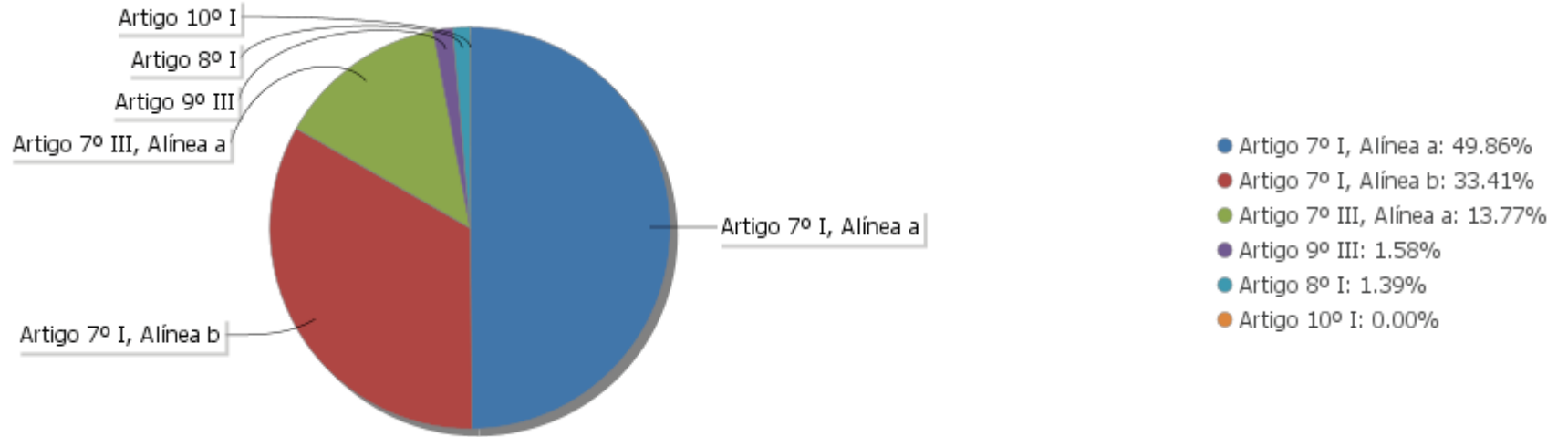
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Liquidez

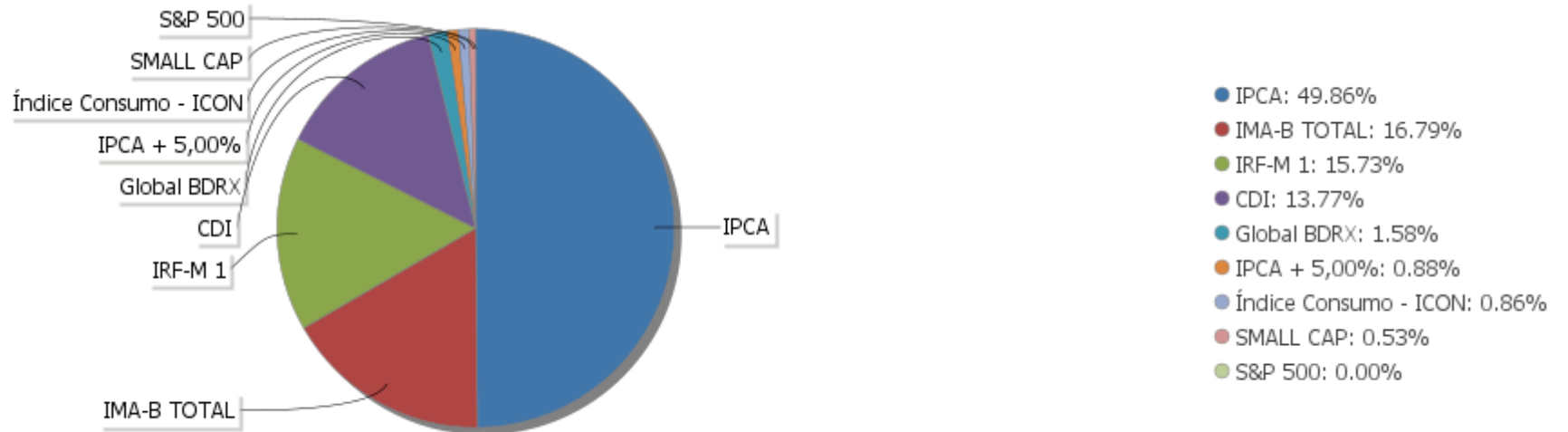
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	464.040.703,30	32,47	464.040.703,30	32,47	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	464.040.703,30	32,47	
acima de 365 dias	965.250.907,82	67,53	1.429.291.611,12	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

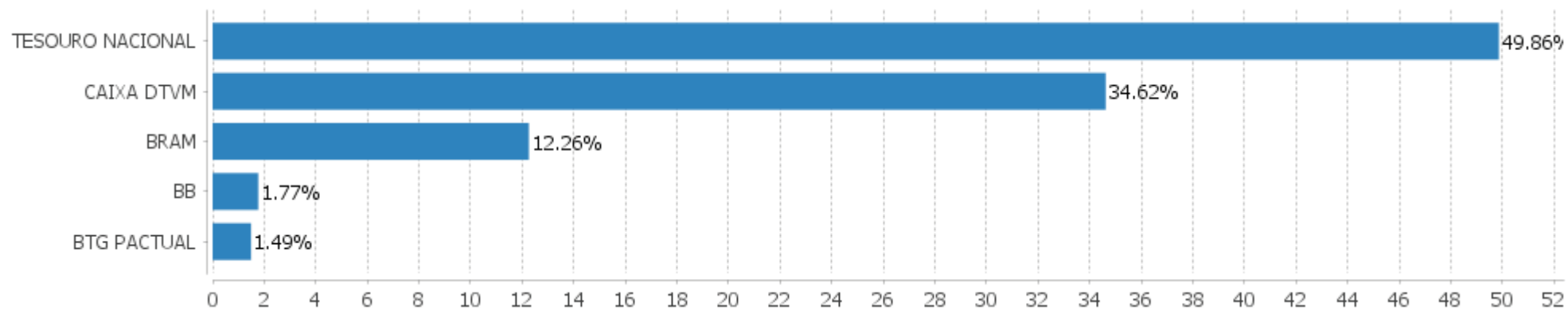


Alocação Por Estratégia



## 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

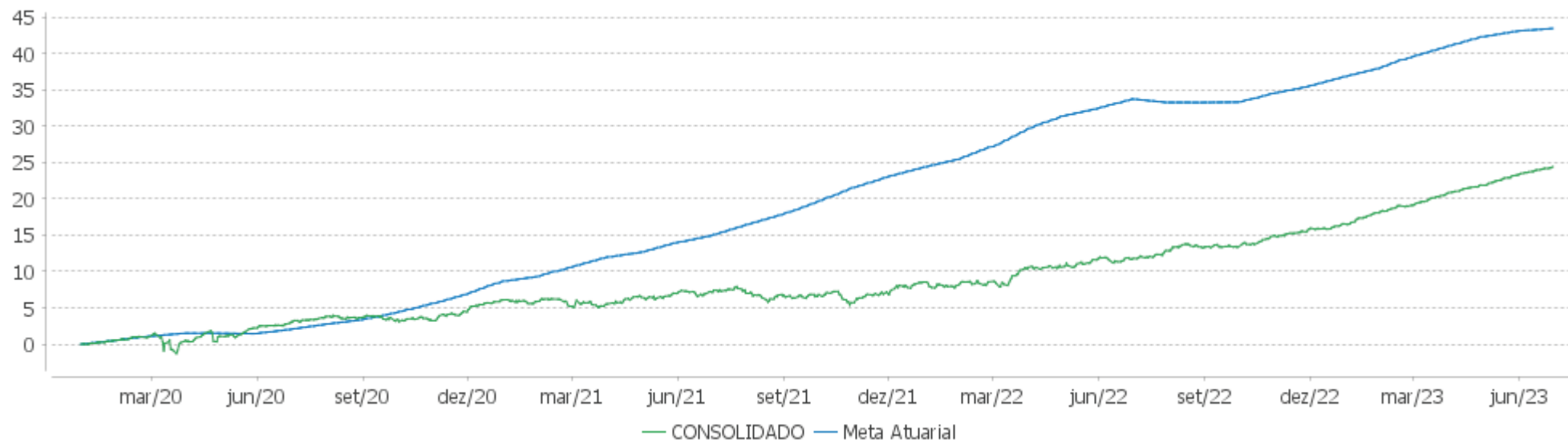
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

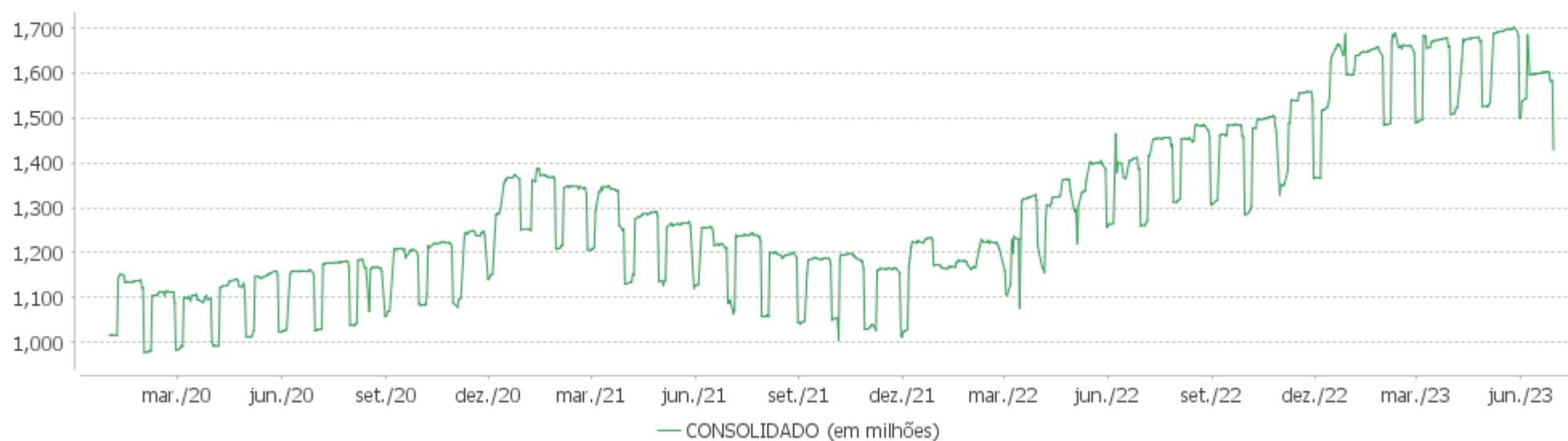
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	17	40,48	03 meses	2,98	1,72	1,26	0,62
Meses abaixo - Meta Atuarial	25	59,52	06 meses	6,74	4,88	1,87	0,82
			12 meses	11,40	7,27	4,13	1,28
			24 meses	16,10	23,60	-7,50	2,16
Maior rentabilidade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

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Evolução



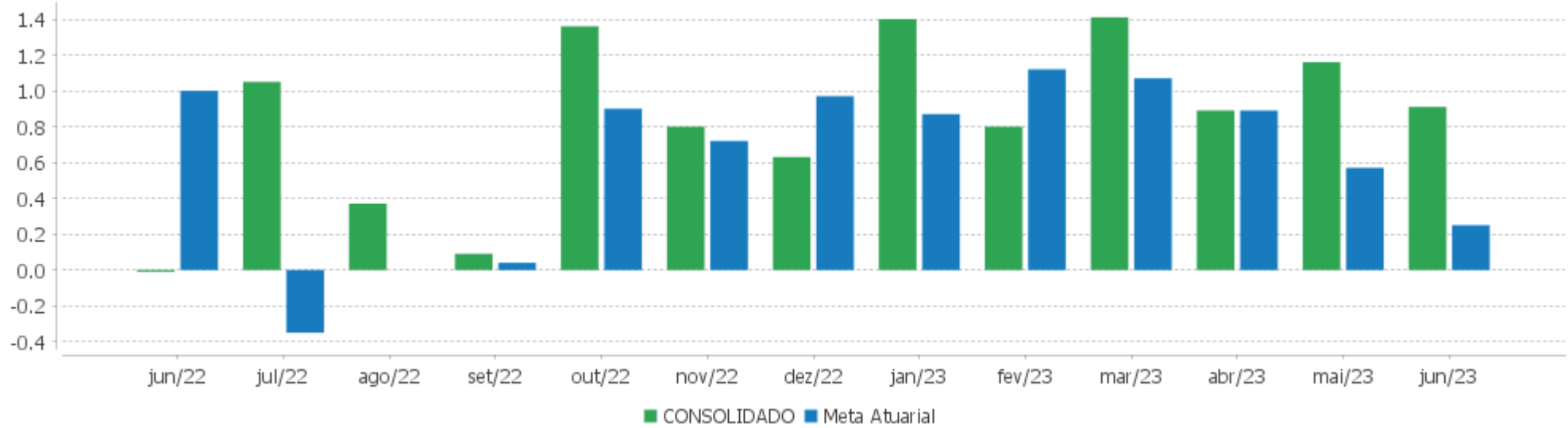
### Patrimônio Líquido





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
NTN-B 150535 (5,784900%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	6,22 3,35	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	6,43 3,56	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	6,21 3,34	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	6,27 3,40	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	6,44 3,57	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	6,31 3,44	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	6,15 3,28	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	6,28 3,41	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	6,32 3,45	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	6,30 3,43	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	6,13 3,26	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	6,28 3,41	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	6,29 3,42	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	6,22 3,35	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	6,29 3,42	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	5,55 -5,81	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	11,76	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 Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,21	0,40	-0,05	0,40	-0,43	0,64	-1,93
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,93 0,60	5,56 0,19	1,44 -0,52	5,56 0,19	8,39 0,10		
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	1,16 -0,03	6,59 -0,09	3,15 -0,07	6,59 -0,09	13,58 -0,24	21,47 -0,53	23,68 -0,80
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,13 105,64	6,53 100,53	3,22 102,48	6,53 100,53	13,87 102,45	24,53 104,96	27,55 105,26
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	1,00 93,03	5,98 92,01	2,90 92,23	5,98 92,01	12,44 91,84	20,85 89,21	22,25 85,01
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	1,08 100,52	6,42 98,84	3,12 99,28	6,42 98,84	13,39 98,85	23,19 99,25	25,00 95,53
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. SMALL CAP p.p.	8,03 -0,14	13,04 -0,22	24,57 -0,60	13,04 -0,22	18,85 -0,94	-28,83 -1,19	-2,28 -3,32
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. Índice Consumo - ICON p.p.	9,71 0,19	7,66 -0,72	23,77 -0,28	7,66 -0,72	5,73 -1,87	-44,13 -1,98	-35,70 -3,33
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	0,47 -0,02	14,53 -0,61	5,60 -0,29	14,53 -0,61	13,40 -1,04	-1,43 -2,02	24,43 -4,32
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	7,00 6,31	20,17 13,11	10,43 7,70	20,17 13,11	28,33 20,17	20,97 21,20	67,67 41,34
CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,91 0,66	6,74 1,87	2,98 1,26	6,74 1,87	11,40 4,13	16,10 -8,73	20,88 -19,75
CDI	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17
IBOVESPA	9,00	7,61	15,91	7,61	19,83	-6,87	24,23
INPC + 6,00%	0,39	5,67	2,22	5,67	9,15	29,49	49,89
IPCA + 6,00%	0,41	5,86	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 Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	1,19	6,68	3,22	6,68	13,82	22,00	24,49	31,97	41,51
IRF-M 1+	2,65	11,41	6,89	11,41	18,80	17,59	16,30	30,02	54,96
IRF-M TOTAL	2,12	9,62	5,52	9,62	16,74	18,79	18,96	30,63	51,17
IMA-B 5	1,05	7,04	2,55	7,04	10,23	21,32	28,68	40,02	60,53
IMA-B 5+	3,37	14,91	10,90	14,91	16,34	13,82	23,52	25,96	77,32
IMA-B TOTAL	2,39	11,37	7,10	11,37	13,52	17,81	26,56	32,82	71,02
IMA-GERAL TOTAL	1,74	8,64	4,83	8,64	14,01	20,10	24,37	32,47	53,53
IDKA 2	0,97	6,79	1,99	6,79	9,28	20,32	28,82	40,12	58,67
IDKA 20	5,91	22,33	19,68	22,33	23,20	6,46	19,60	13,99	89,13
CDI	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17	32,00	40,34

#### Renda Variável

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

## 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	0,69	7,06	2,73	7,06	8,17	-0,23	26,33	90,25	104,62

### Investimentos Imobiliários

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

### Investimentos no Exterior

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

### Indicadores Econômicos

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

### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,25	4,88	1,72	4,88	7,27	24,82	40,63	49,40	60,53
IPCA + 5,00%	0,33	5,37	1,96	5,37	8,30	27,23	44,71	55,22	68,37
IPCA + 5,50%	0,37	5,62	2,08	5,62	8,81	28,44	46,79	58,20	72,40
IPCA + 5,89%	0,40	5,81	2,17	5,81	9,21	29,39	48,42	60,54	75,60
IPCA + 6,00%	0,41	5,86	2,19	5,86	9,33	29,66	48,88	61,21	76,52
INPC + 4,00%	0,23	4,69	1,75	4,69	7,10	24,66	41,58	50,73	61,88
INPC + 6,00%	0,39	5,67	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
2473	01/06/2023	BRADESCO 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	BRADESCO 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
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



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
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
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

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2023

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
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
<b>Total</b>			<b>307.008.000,36</b>	<b>391.572.814,16</b>		

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 <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	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 <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	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
<b>Sub-total</b>	0,37	0,13	0,01		-1,66	0,46	712.643.078,72	49,86

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

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2023

### 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 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
<b>Sub-total</b>	0,58	0,56	0,14		0,09	1,12	477.460.589,10	33,41

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
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
<b>Sub-total</b>	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 <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		7,63	0,03	0,62			22.551.180,73	1,58
<b>Sub-total</b>	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 <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	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
<b>Sub-total</b>	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 <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
<b>Sub-total</b>	0,00	NaN	0,00		0,00	0,00	0,00	0,00