

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



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

# RELATÓRIO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS **CONSOLIDADO**

Período: 3º trimestre de 2023

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Posição de Ativos e Enquadramento

**RENDA FIXA** 97,10%

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%)	0,37	0,04	0,69	1,88	31.464.677,16	2,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	0,37	0,04	0,70	1,92	31.953.732,67	2,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,886400%)	0,52	0,04	0,70	1,95	7.496.371,29	0,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	0,37	0,04	0,71	1,95	85.515.770,14	6,10
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	3,82	0,04	0,71	1,96	12.809.343,53	0,91
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,216000%)	3,01	0,04	0,73	2,03	2.712.965,07	0,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	0,37	0,04	0,71	1,95	128.900.755,77	9,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	0,37	0,04	0,70	1,92	42.462.037,55	3,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840	7,90	0,84	-2,25	-3,13	47.082.926,22	3,36
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,347000%)	2,75	0,04	0,66	1,32	8.503.588,03	0,61
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,674000%)	3,97	0,04	0,56	0,56	21.840.665,33	1,56
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860	10,58	1,01	-2,95	-5,03	23.877.621,10	1,70
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,442000%)	2,71	0,04	0,67	1,33	19.099.704,39	1,36
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	0,37	0,04	0,68	1,88	88.816.194,66	6,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	0,37	0,04	0,70	1,92	73.414.905,96	5,24

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/09/2023

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Trim.		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,926400%)	0,37	0,04	0,71	1,96	17.564.400,46	1,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	0,37	0,04	0,71	1,96	71.704.160,23	5,12
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	0,37	0,04	0,71	1,96	84.243.327,30	6,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	0,37	0,04	0,71	1,97	29.368.413,41	2,10
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,225100%)	0,37	0,04	0,73	2,03	6.083.155,25	0,43
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>0,48</b>	<b>0,11</b>	<b>0,42</b>	<b>1,46</b>	<b>834.914.715,52</b>	<b>59,56</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	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,36	0,06	0,91	3,12	170.062.717,67	12,13	7.513.988.203,57	2,26
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	4,79	0,42	-0,18	0,05	25.012.194,84	1,78	1.671.746.319,73	1,50
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,22	0,31	0,15	0,58	25.145.766,14	1,79	2.124.960.940,76	1,18
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,87	0,16	1,10	3,09	209.038.616,65	14,91	3.791.584.166,14	5,51
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	5,47	0,51	-1,22	-0,79	30.816.964,32	2,20	233.057.013,22	13,22
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,87	0,16	1,10	3,09	12.675.248,50	0,90	3.520.695.315,59	0,36
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>0,97</b>	<b>0,14</b>	<b>0,80</b>	<b>2,85</b>	<b>472.751.508,12</b>	<b>33,73</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	Trim.				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,03	0,05	0,97	3,19	859.947,44	0,06	15.644.937.936,51	0,01
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,00	0,09	0,63	0,00	0,00	3.380.807.738,12	0,00
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,07	0,05	1,05	3,54	52.588.300,40	3,75	8.906.699.435,49	0,59
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,13</b>	<b>0,05</b>	<b>1,05</b>	<b>3,50</b>	<b>53.448.247,84</b>	<b>3,81</b>		

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

0,51

0,12

0,60

2,17

1.361.114.471,48

97,10

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### RENTA VARIÁVEL

1,27%

#### 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	27,05	1,31	-4,07	-12,29	10.815.868,65	0,77	106.036.086,97	10,20
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	24,89	1,17	-2,87	-7,24	6.961.645,37	0,50	663.773.561,70	1,05
		<b>Sub-total Artigo 8º I</b>	<b>25,55</b>	<b>1,25</b>	<b>-3,60</b>	<b>-10,38</b>	<b>17.777.514,02</b>	<b>1,27</b>		
		<b>Renda Variável</b>	<b>25,55</b>	<b>1,25</b>	<b>-3,60</b>	<b>-10,38</b>	<b>17.777.514,02</b>	<b>1,27</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,63%

#### 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	21,98	-0,35	-3,57	1,32	22.849.848,73	1,63	1.999.422.357,55	1,14
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>21,98</b>	<b>-0,35</b>	<b>-3,57</b>	<b>1,32</b>	<b>22.849.848,73</b>	<b>1,63</b>		
Investimentos no Exterior			21,98	-0,35	-3,57	1,32	22.849.848,73	1,63		
<b>Total</b>			<b>0,99</b>	<b>0,13</b>	<b>0,48</b>	<b>2,00</b>	<b>1.401.741.834,23</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 a	Títulos do Tesouro Nacional	834.914.715,52	59,56	0,00	57,40	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	472.751.508,12	33,73	0,00	20,33	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	53.448.247,84	3,81	0,00	22,27	60,00	0,00	60,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>1.361.114.471,48</b>	<b>97,10</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	17.777.514,02	1,27	0,00	0,00	30,00	0,00	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>17.777.514,02</b>	<b>1,27</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	22.849.848,73	1,63	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>22.849.848,73</b>	<b>1,63</b>					10,00
<b>Total</b>		<b>1.401.741.834,23</b>	<b>100,00</b>					

## 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	0,42 42,99	1,46 45,48	1,46 45,48	3,99 61,77	10,52 78,28	3.469.998,41	11.396.399,00
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,80 82,30	2,85 88,42	2,85 88,42	5,72 88,52	12,50 92,97	4.804.320,86	17.600.474,59
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,05 107,24	3,50 108,72	3,50 108,72	6,82 105,50	13,81 102,73	590.229,60	3.872.550,10
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-3,60 -4,31	-10,38 -9,09	-10,38 -9,09	11,19 -3,22	-11,81 -17,74	-663.981,28	-2.059.080,27
Artigo 9º III % do CDI	-3,57 -366,77	1,32 41,13	1,32 41,13	7,00 108,27	20,13 149,74	-847.140,17	298.668,00
Artigo 10º I % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	3,24 50,15	23,43 174,32	0,00	0,00
<b>CONSOLIDADO (Total)</b>						<b>7.353.427,42</b>	<b>31.109.011,42</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 Financeiro Trimestre (R\$)
NTN-B 150535 (5,634200%)	31.250.546,11	0,00	0,00	0,00	31.464.677,16	214.131,05	581.819,63
NTN-B 150535 (5,784900%)	31.732.678,68	0,00	0,00	0,00	31.953.732,67	221.053,99	602.235,39
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.443.940,23	0,00	0,00	0,00	7.496.371,29	52.431,06	143.074,04
NTN-B 150535 (5,909200%)	84.916.285,18	0,00	0,00	0,00	85.515.770,14	599.484,96	1.636.699,28
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.719.366,16	0,00	0,00	0,00	12.809.343,53	89.977,37	245.704,29
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.693.326,08	0,00	0,00	0,00	2.712.965,07	19.638,99	53.882,00
NTN-B 150545 (5,900200%)	127.997.990,58	0,00	0,00	0,00	128.900.755,77	902.765,19	2.464.454,10
NTN-B 150832 (5,763300%)	42.168.941,46	0,00	0,00	0,00	42.462.037,55	293.096,09	807.835,53
NTN-B 150840	48.167.733,12	0,00	0,00	0,00	47.082.926,22	-1.084.806,90	-1.503.938,32
NTN-B 150840 (5,347000%)	8.447.543,65	0,00	0,00	0,00	8.503.588,03	56.044,38	111.311,43
NTN-B 150850 (5,674000%)	0,00	21.719.650,65	0,00	0,00	21.840.665,33	121.014,68	121.014,68



### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
NTN-B 150860	24.603.692,47	0,00	0,00	0,00	23.877.621,10	-726.071,37	-1.251.619,14
NTN-B 150860 (5,442000%)	18.972.462,92	0,00	0,00	0,00	19.099.704,39	127.241,47	252.774,21
NTN-B 150860 (5,599600%)	88.213.996,96	0,00	0,00	0,00	88.816.194,66	602.197,70	1.654.064,68
NTN-B 150860 (5,788000%)	72.906.778,99	0,00	0,00	0,00	73.414.905,96	508.126,97	1.400.744,65
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.441.036,83	0,00	0,00	0,00	17.564.400,46	123.363,63	340.990,77
NTN-B 150860 (5,949840%)	71.199.284,71	0,00	0,00	0,00	71.704.160,23	504.875,52	1.396.154,43
NTN-B 150860 (5,959200%)	83.649.556,92	0,00	0,00	0,00	84.243.327,30	593.770,38	1.642.240,16
NTN-B 150860 (5,986700%)	29.160.824,93	0,00	0,00	0,00	29.368.413,41	207.588,48	574.462,51
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.039.080,48	0,00	0,00	0,00	6.083.155,25	44.074,77	122.494,68
					834.914.715,52	3.469.998,41	

#### 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	12.537.544,66	0,00	0,00	0,00	12.675.248,50	137.703,84	385.634,65
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	206.768.076,72	0,00	0,00	0,00	209.038.616,65	2.270.539,93	6.357.320,71
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	31.196.810,06	0,00	0,00	0,00	30.816.964,32	-379.845,74	-233.871,26
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	202.842.324,50	271.458.088,22	-307.021.527,21	0,00	170.062.717,67	2.783.832,16	10.933.429,51
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	25.056.770,82	0,00	0,00	0,00	25.012.194,84	-44.575,98	12.194,84
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	25.109.099,49	0,00	0,00	0,00	25.145.766,14	36.666,65	145.766,14
					472.751.508,12	4.804.320,86	

#### 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	352.668,92	0,00	-352.992,01	0,00	0,00	323,09	5.499,88
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	52.042.171,79	0,00	0,00	0,00	52.588.300,40	546.128,61	3.427.528,00
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	15.882.828,18	6.652.992,01	-21.719.650,65	0,00	859.947,44	43.777,90	439.522,22
					53.448.247,84	590.229,60	

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

#### 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	11.274.354,77	0,00	0,00	0,00	10.815.868,65	-458.486,12	-1.516.034,22
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	7.167.140,53	0,00	0,00	0,00	6.961.645,37	-205.495,16	-543.046,05
					17.777.514,02	-663.981,28	

#### 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	23.696.988,90	0,00	0,00	0,00	22.849.848,73	-847.140,17	298.668,00
					22.849.848,73	-847.140,17	

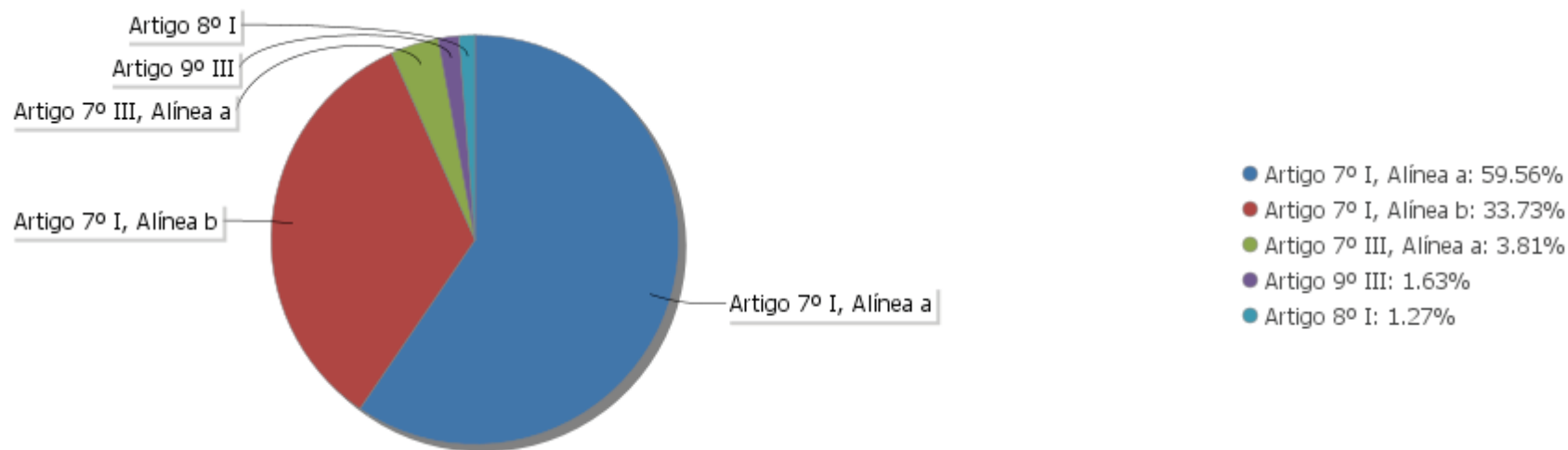
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

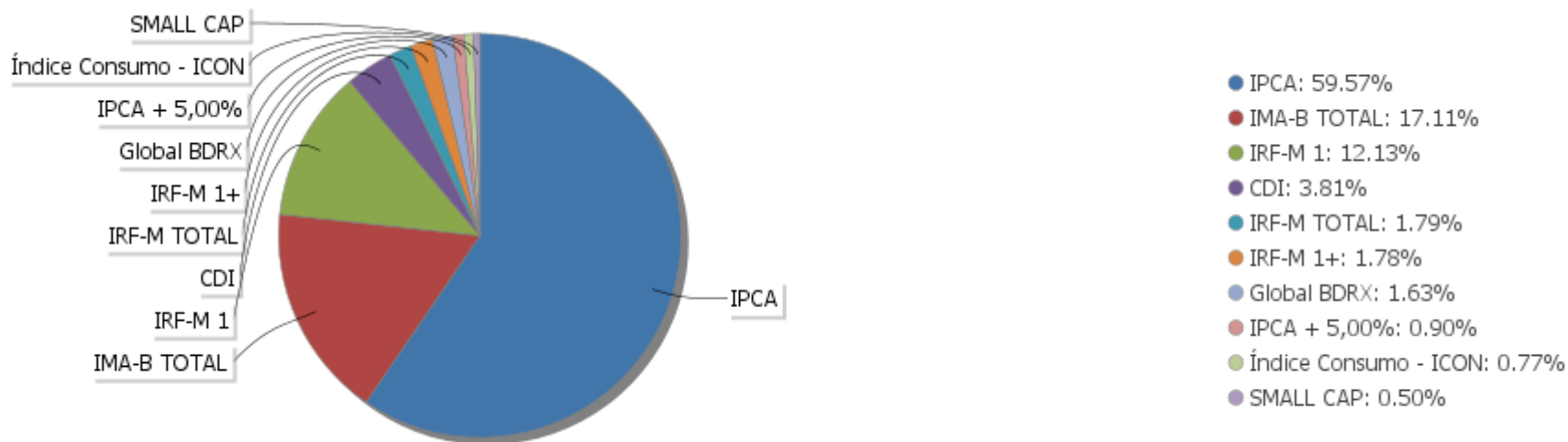
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	314.296.289,24	22,42	314.296.289,24	22,42	
de 31 dias a 365 dias	221.713.865,15	15,82	536.010.154,39	38,24	
acima de 365 dias	865.731.679,84	61,76	1.401.741.834,23	100,00	

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Alocação por Artigo**

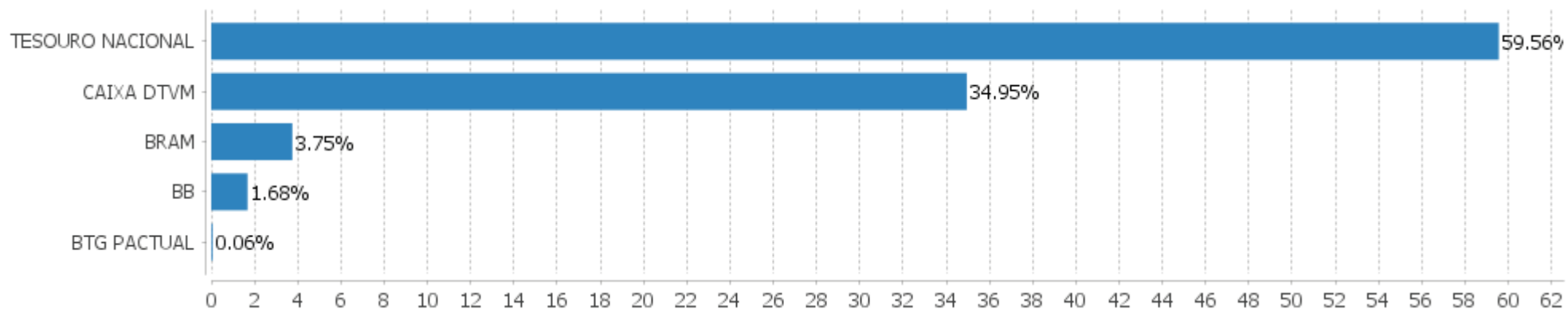


**Alocação Por Estratégia**



### 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	0,84	0,67	0,48				8,88
IPCA + 4,00%	0,87	1,12	1,07	0,89	0,57	0,25	0,45	0,59	0,57				6,57
p.p. indexador	0,53	-0,33	0,34	-0,01	0,58	0,66	0,39	0,08	-0,09				2,31
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

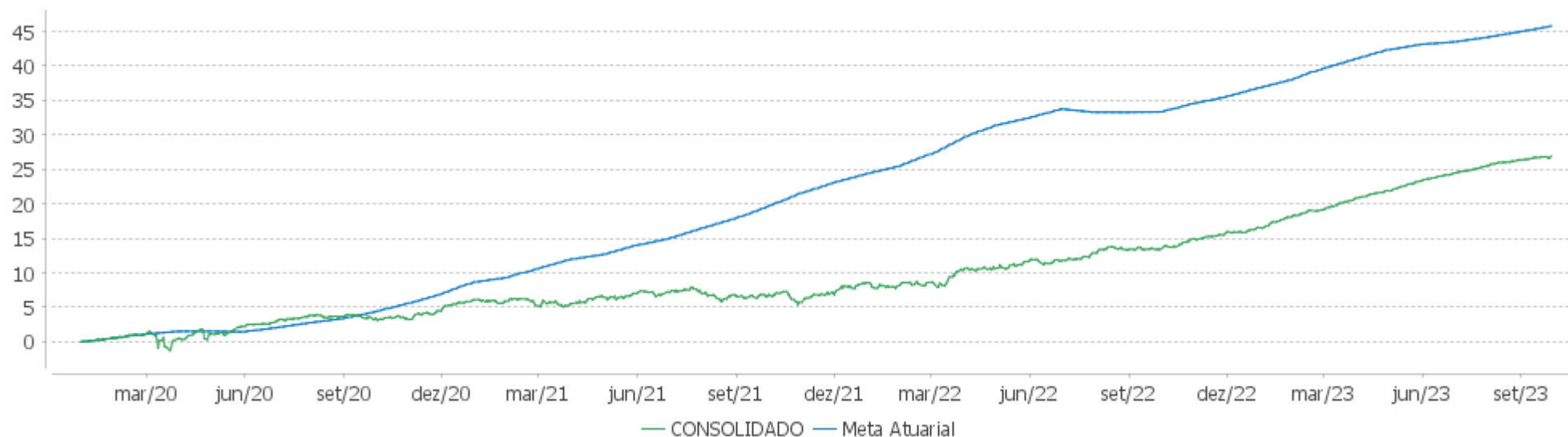
### Performance Sobre a Meta Atuarial

### Relatório

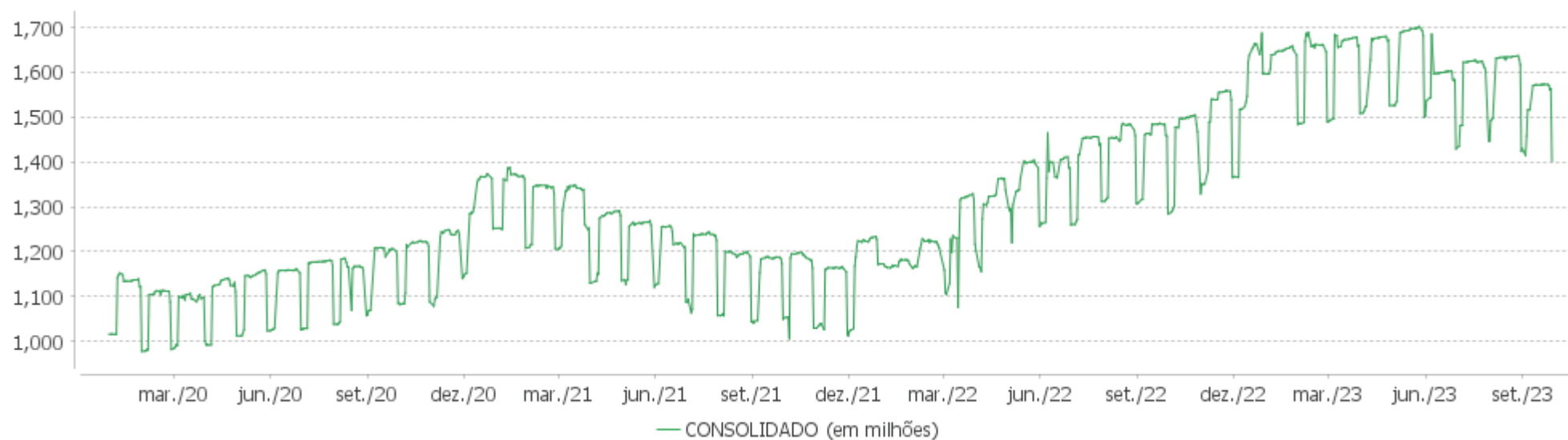
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	19	42,22	03 meses	2,00	1,62	0,39	0,67
Meses abaixo - Meta Atuarial	26	57,78	06 meses	5,05	3,37	1,68	0,66
			12 meses	11,94	9,36	2,58	0,99
			24 meses	19,11	21,30	-2,19	1,95
Maior rentabilidade da Carteira	1,64	2022-03	36 meses	22,81	36,97	-14,16	2,11
Menor rentabilidade da Carteira	-0,80	2021-10	Desde 31/12/2019	26,93	42,68	-15,74	2,48

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Evolução**

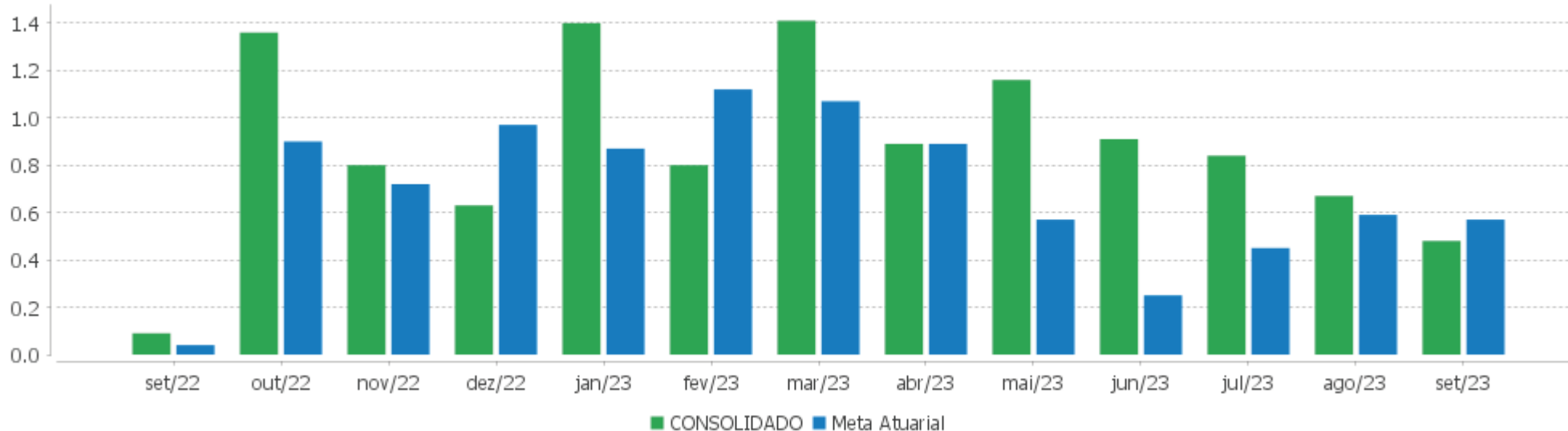


**Patrimônio Líquido**



**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.	0,70 0,44	1,92 1,31	1,92 1,31	4,45 3,07	10,97 5,79	19,58 6,86	31,53 7,26
NTN-B 150535 (6,216000%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,47	2,03 1,42	2,03 1,42	4,66 3,28	8,17 2,99	16,79 4,06	
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,44	1,92 1,30	1,92 1,30	4,44 3,06	10,95 5,77	22,99 10,27	35,24 10,96
NTN-B 150535 (5,886400%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,44	1,95 1,33	1,95 1,33	4,50 3,12	11,08 5,90	19,76 7,03	
NTN-B 150860 (6,225100%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,47	2,03 1,42	2,03 1,42	4,66 3,29	11,43 6,25	20,23 7,50	
NTN-B 150840 Var. IPCA p.p.	-2,25 -2,51	-2,40 -3,01	-2,40 -3,01	8,84 7,46	10,03 4,84	16,27 3,55	19,98 -4,30
NTN-B 150860 Var. IPCA p.p.	-2,95 -3,21	-4,45 -5,06	-4,45 -5,06	9,37 7,99	9,12 3,94		
NTN-B 150860 (5,959200%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,45	1,96 1,35	1,96 1,35	4,53 3,16	11,15 5,97	23,41 10,69	35,86 11,59
NTN-B 150840 (5,347000%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,40	1,81 1,20	1,81 1,20	4,23 2,86	7,56 2,37		
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,43	1,88 1,27	1,88 1,27	4,37 3,00	10,82 5,63	22,75 10,02	34,92 10,65
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,45	1,95 1,34	1,95 1,34	4,51 3,13	11,10 5,92	23,30 10,57	35,69 11,41
NTN-B 150860 (5,986700%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,45	1,97 1,36	1,97 1,36	4,55 3,17	11,18 6,00	19,93 7,21	32,04 7,76
NTN-B 150860 (5,949840%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,45	1,96 1,35	1,96 1,35	4,53 3,15	11,14 5,96	23,39 10,67	35,84 11,57
NTN-B 150860 (5,599600%) Var. IPCA p.p.	0,68 0,42	1,88 1,26	1,88 1,26	4,36 2,98	10,78 5,60	22,76 10,04	35,10 10,82
NTN-B 150545 (5,900200%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,45	1,95 1,34	1,95 1,34	4,50 3,13	11,09 5,91	23,29 10,57	35,71 11,43
NTN-B 150860 (5,442000%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,41	1,84 1,23	1,84 1,23	4,28 2,90	7,70 2,51		
NTN-B 150860 (5,788000%)	0,70	1,92	1,92	4,45	10,98	23,10	35,50

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/09/2023

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,44	1,31	1,31	3,07	5,79	10,38	11,22
NTN-B 150535 (5,927000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,45	1,96 1,34	1,96 1,34	4,52 3,14	11,04 5,85	19,73 7,00	31,77 7,49
NTN-B 150860 (5,926400%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,45	1,96 1,34	1,96 1,34	4,52 3,14	11,13 5,94	19,86 7,14	
NTN-B 150850 (5,674000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,43	-0,91 -1,52	-0,91 -1,52	1,52 0,15	4,85 -0,33		
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	-0,18 -0,03	1,18 -0,09	1,18 -0,09	8,11 -0,13	13,58 -0,48	21,42 -0,89	17,30 -1,17
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,10 2,04	3,09 3,61	3,09 3,61	4,57 -1,97	11,76 0,72	21,08 1,99	26,98 2,28
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,22 -0,27	-0,79 -0,27	-0,79 -0,27	6,21 -0,33	11,04 -0,01	19,83 0,74	23,37 -1,33
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,91 -0,02	3,12 -0,05	3,12 -0,05	6,37 -0,13	13,31 -0,22	24,16 -0,52	26,95 -0,84
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	1,10 0,45	3,09 1,23	3,09 1,23	4,57 0,71	11,76 1,36		
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,15 -0,03	1,77 -0,06	1,77 -0,06	7,33 -0,11	13,46 -0,12	22,40 -0,27	20,86 -0,56
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,05 107,67	3,54 109,96	3,54 109,96	6,88 106,36	13,98 104,03	27,19 105,36	31,34 105,99
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,90 91,93	2,96 91,98	2,96 91,98	5,95 91,99	12,33 91,75	23,32 90,39	25,64 86,73
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,97 99,55	3,19 99,06	3,19 99,06	6,41 99,15	13,28 98,82	25,57 99,08	28,90 97,74
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. SMALL CAP p.p.	-2,87 -0,03	-7,24 0,01	-7,24 0,01	15,55 -0,54	-3,23 -0,29	-21,52 -0,69	-10,58 -2,22
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-4,07 -0,04	-12,29 -0,18	-12,29 -0,18	8,55 -0,47	-19,10 -1,28	-42,30 -1,66	-44,29 -2,66
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	-3,57 -0,12	1,32 -0,49	1,32 -0,49	7,00 -0,82	20,13 -1,72	-7,28 -1,99	9,65 -4,99
CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,48 -0,09	2,00 0,39	2,00 0,39	5,05 1,68	11,94 2,58	19,11 -2,78	22,81 -16,92
CDI	0,97	3,22	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57
IBOVESPA	0,71	-1,29	-1,29	14,41	5,93	5,03	23,21

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/09/2023

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
INPC + 6,00%	0,57	1,71	1,71	3,97	10,73	25,81	47,70
IPCA + 6,00%	0,72	2,11	2,11	4,35	11,44	26,60	47,91

## 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		
BRDESCO 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
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
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	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	0,93	3,18	3,18	6,50	13,54	24,68	27,79	33,59	43,54
IRF-M 1+	-0,15	1,26	1,26	8,24	14,06	22,31	18,47	27,49	54,02
IRF-M TOTAL	0,17	1,83	1,83	7,45	13,57	22,67	21,42	29,39	51,16
IMA-B 5	0,13	1,73	1,73	4,32	11,65	21,97	29,23	38,58	59,92
IMA-B 5+	-1,92	-2,46	-2,46	8,17	10,15	15,88	19,59	17,59	70,32
IMA-B TOTAL	-0,95	-0,52	-0,52	6,55	11,05	19,09	24,70	27,33	67,28
IMA-GERAL TOTAL	0,18	1,80	1,80	6,72	12,50	22,90	25,94	31,42	53,46
IDKA 2	0,29	2,05	2,05	4,08	11,42	21,35	28,89	39,21	57,10
IDKA 20	-3,53	-5,76	-5,76	12,78	8,75	9,82	12,05	2,09	75,69
CDI	0,97	3,22	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57	34,18	42,60

#### Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,71	-1,29	-1,29	14,41	5,93	5,03	23,21	11,28	46,91
IBRX 100	0,84	-1,02	-1,02	13,78	5,09	3,69	22,17	11,68	50,59
IBRX 50	1,21	-0,03	-0,03	13,75	5,32	5,93	25,49	12,91	45,69
SMALL CAP	-2,84	-7,25	-7,25	16,09	-2,94	-20,83	-8,36	-10,00	41,57
Índice Consumo - ICON	-4,02	-12,11	-12,11	9,02	-17,82	-40,64	-41,63	-42,24	-10,67
Índice Dividendos - IDIV	1,32	1,25	1,25	15,38	14,16	22,39	46,36	32,00	101,74

## 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	-3,22	0,12	0,12	2,85	10,76	-8,35	13,20	73,22	84,04

### Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,20	2,03	2,03	16,60	7,64	18,54	15,18	19,93	50,80

### Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-2,61	-0,05	-0,05	0,10	9,93	-14,78	3,18	51,70	56,69

### Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,26	0,61	0,61	1,38	5,19	12,73	24,28	28,17	31,88
INPC	0,11	0,22	0,22	1,01	4,51	12,02	24,10	28,93	32,69
IGPM	0,37	-0,49	-0,49	-5,12	-5,97	1,79	27,09	49,89	54,94
SELIC	0,97	3,22	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57	34,18	42,60

### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,57	1,62	1,62	3,37	9,36	21,89	39,73	49,87	60,35
IPCA + 5,00%	0,65	1,87	1,87	3,86	10,40	24,23	43,78	55,70	68,19
IPCA + 5,50%	0,69	1,99	1,99	4,10	10,92	25,41	45,84	58,68	72,22
IPCA + 5,89%	0,72	2,08	2,08	4,30	11,33	26,34	47,45	61,03	75,41
IPCA + 6,00%	0,72	2,11	2,11	4,35	11,44	26,60	47,91	61,70	76,32
INPC + 4,00%	0,42	1,22	1,22	3,00	8,65	21,12	39,53	50,75	61,34
INPC + 6,00%	0,57	1,71	1,71	3,97	10,73	25,81	47,70	62,65	77,41

## 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%)	31.464.677,16	5,634200	31.334.023,33	5,686500	-130.653,83
NTN-B 150535 (5,784900%)	31.953.732,67	5,784900	32.204.412,87	5,686500	250.680,20
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.496.371,29	5,886400	7.615.908,45	5,686500	119.537,16
NTN-B 150535 (5,909200%)	85.515.770,14	5,909200	87.038.953,70	5,686500	1.523.183,56
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.809.343,53	5,927000	13.055.843,05	5,686500	246.499,53
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.712.965,07	6,216000	2.828.766,00	5,686500	115.800,93
NTN-B 150545 (5,900200%)	128.900.755,77	5,900200	130.024.735,89	5,825200	1.123.980,12
NTN-B 150832 (5,763300%)	42.462.037,55	5,763300	42.902.284,86	5,607300	440.247,31
NTN-B 150840 (5,347000%)	8.503.588,03	5,347000	8.132.505,44	5,777400	-371.082,59
NTN-B 150850 (5,674000%)	21.840.665,33	5,674000	21.333.897,93	5,853300	-506.767,40
NTN-B 150860 (5,442000%)	19.099.704,39	5,442000	17.908.215,82	5,875100	-1.191.488,57
NTN-B 150860 (5,599600%)	88.816.194,66	5,599600	85.277.218,20	5,875100	-3.538.976,46
NTN-B 150860 (5,788000%)	73.414.905,96	5,788000	72.485.635,47	5,875100	-929.270,49
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.564.400,46	5,926400	17.695.022,78	5,875100	130.622,32
NTN-B 150860 (5,949840%)	71.704.160,23	5,949840	72.485.635,47	5,875100	781.475,24
NTN-B 150860 (5,959200%)	84.243.327,30	5,959200	85.277.218,20	5,875100	1.033.890,90
NTN-B 150860 (5,986700%)	29.368.413,41	5,986700	29.847.026,37	5,875100	478.612,96
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.083.155,25	6,225100	6.395.791,37	5,875100	312.636,12

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2596	03/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	708.241,17	0,00	221.443,07646033	3,1982990000
2568	03/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.879.131,40	0,00	1.212.873,28045314	3,1982990000
2555	03/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	264.941,38	0,00	82.838,21493863	3,1982990000
2544	03/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	103.421,44	32.336,38881168	3,1982990000
2597	04/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	34.656,36	0,00	10.832,23832677	3,1993720000
2583	04/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	18.205,09	5.690,20732819	3,1993720000
2569	04/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.663.712,33	0,00	1.770.257,51616255	3,1993720000
2556	04/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	37.461,81	0,00	11.709,11353853	3,1993720000
2552	04/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	39.546.416,33	0,00	12.360.680,88674902	3,1993720000
2570	05/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	22.477,61	0,00	7.023,32692376	3,2004220000
2545	05/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	37.719,87	11.785,90510876	3,2004220000
2584	06/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	122.516,81	38.274,94887481	3,2009660000
2571	06/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	166.585,45	0,00	52.042,24287293	3,2009660000
2598	07/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	41.715.020,98	0,00	13.020.669,18371386	3,2037540000
2603	07/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.503.996,68	3.902.920,34906550	3,2037540000
2585	07/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	43.629.803,13	13.618.337,46598522	3,2037540000
2572	07/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	162.229.258,32	0,00	50.637.239,41351302	3,2037540000
2557	07/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.807,49	0,00	7.431,12298884	3,2037540000
2546	07/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	18.658.092,30	5.823.821,77283275	3,2037540000
2553	07/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.470.639,84	0,00	3.268.240,89490017	3,2037540000
2558	10/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.637,99	0,00	3.319,70146999	3,2045020000
2586	11/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.137,98	1.290,88430994	3,2055390000
2599	12/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	739.706,85	0,00	230.652,75653528	3,2070150000
2559	12/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	24.863,33	0,00	7.752,79504461	3,2070150000
2573	13/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.059,02	0,00	953,48019554	3,2082680000
2560	13/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.079,44	0,00	1.583,23431833	3,2082680000
2600	14/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.534,89	0,00	1.724,56135759	3,2094480000
2587	14/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.263,36	705,21784431	3,2094480000



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2574	14/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.093,80	0,00	2.521,86668860	3,2094480000
2547	14/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.177,11	1.301,50418390	3,2094480000
2575	17/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.272,09	0,00	707,39220480	3,2119240000
2554	17/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.194,63	0,00	683,27581848	3,2119240000
2576	18/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.604,37	0,00	1.121,40795054	3,2141470000
2561	18/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.963,90	0,00	2.166,64016923	3,2141470000
2604	19/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.443.003,70	448.766,76534534	3,2154870000
2562	19/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	175.014,48	0,00	54.428,60754841	3,2154870000
2588	19/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.943,69	3.092,43669777	3,2154870000
2577	19/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.270,48	0,00	1.639,09230546	3,2154870000
2548	19/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.194,63	682,51869779	3,2154870000
2605	20/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.393.646,01	433.251,99038769	3,2167100000
2589	20/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.393.645,99	433.251,98417016	3,2167100000
2578	20/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.054,85	0,00	949,68150688	3,2167100000
2549	20/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.393.465,99	433.196,02637477	3,2167100000
2563	21/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.104,66	0,00	5.002,54403605	3,2192940000
2579	21/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	627,25	0,00	194,84085641	3,2192940000
2550	21/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	180,00	55,91288028	3,2192940000
2564	24/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.418,32	0,00	1.061,31319780	3,2208400000
2606	26/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.401,87	1.674,61575448	3,2257370000
2580	26/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	220.357,62	0,00	68.312,33296453	3,2257370000
2590	26/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.259.248,90	2.870.428,95933549	3,2257370000
2595	27/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	372.053,29	143.247,76839709	2,5972711070
2609	27/07/2023	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	7.372.053,29	0,00	1.890.404,97171888	3,8997217000
2607	27/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.000.000,00	2.169.083,12856156	3,2271700000
2565	27/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	248.051,46	0,00	76.863,46241444	3,2271700000
2591	27/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.207.003,65	1.923.358,12801929	3,2271700000
2601	28/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.103,81	0,00	8.085,99078889	3,2282760000
2566	28/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.012.747,68	0,00	313.711,61573546	3,2282760000
2581	28/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	50.971,78	0,00	15.789,16424742	3,2282760000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2592	28/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.141.424,55	2.212.148,07841709	3,2282760000
2608	31/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.148.948,71	8.713.927,54632639	3,2303400000
2602	31/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	904.508,73	0,00	280.004,18841360	3,2303400000
2582	31/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.298.305,26	0,00	1.021.039,66145978	3,2303400000
2593	31/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	104.553.587,31	32.366.124,71442635	3,2303400000
2567	31/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	902.144,81	0,00	279.272,40166670	3,2303400000
2551	31/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	32.252.879,65	9.984.360,67101296	3,2303400000
2616	01/08/2023	BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	17.016.551,60	1.082.990,89375216	15,7125528000
2614	01/08/2023	BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	53.060.412,91	3.376.944,12775498	15,7125528000
2615	01/08/2023	BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	5.923.035,49	376.962,01027245	15,7125528000
2620	01/08/2023	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	76.000.000,00	0,00	19.458.804,55858342	3,9056870000
2626	01/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	105.625,72	0,00	32.688,12292600	3,2313180000
2640	02/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.158.916,54	0,00	1.596.101,64352555	3,2321980000
2677	02/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.380,76	1.974,12410997	3,2321980000
2676	02/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	39.564.962,93	0,00	12.240.884,66424396	3,2321980000
2685	02/08/2023	NTN-B 150840 (5,347000%)	8.624.242,21	0,00	1.900,00000000	4.539,0748473700
2684	02/08/2023	NTN-B 150860 (5,442000%)	19.359.696,27	0,00	4.200,00000000	4.609,4514928600
2687	02/08/2023	NTN-B 150840	49.929.823,34	0,00	11.000,00000000	4.539,0748490900
2686	02/08/2023	NTN-B 150860	25.812.928,36	0,00	5.600,00000000	4.609,4514928570
2624	02/08/2023	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	76.038.479,79	19.458.804,55960331	3,9076645000
2623	02/08/2023	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	7.387.068,40	1.890.404,97207475	3,9076645000
2622	02/08/2023	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	8.766.721,07	2.243.468,20716057	3,9076645000
2621	02/08/2023	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	11.534.420,93	2.951.742,89655624	3,9076645000
2659	02/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	857.729,02	265.370,19696000	3,2321980000
2658	02/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	744.986,88	0,00	230.489,24601700	3,2321980000
2631	03/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	34.141,66	0,00	10.548,36797100	3,2366770000
2641	03/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	505.722,87	0,00	156.247,55574931	3,2366770000
2660	03/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	315.453,15	0,00	97.462,04208800	3,2366770000
2632	04/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.394,53	0,00	4.445,59916000	3,2379280000
2642	04/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.141.577,66	0,00	661.403,73102700	3,2379280000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2618	04/08/2023	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	33.644.070,38	2.137.532,60192607	15,7396759000
2617	04/08/2023	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	7.327.585,89	465.548,71501515	15,7396759000
2619	04/08/2023	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	9.028.343,73	573.604,16995626	15,7396759000
2661	04/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.383,33	0,00	3.206,78223800	3,2379280000
2675	04/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	25.000.000,00	0,00	8.474.521,68952132	2,9500190000
2674	04/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	25.000.000,00	0,00	9.004.579,72925030	2,7763650000
2643	07/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	158.899.428,53	0,00	49.060.295,45272102	3,2388600000
2644	07/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	47.754.910,96	14.744.357,87604400	3,2388600000
2679	07/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	20.063.825,27	6.194.718,28668112	3,2388600000
2678	07/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.467.953,60	0,00	3.849.488,27673935	3,2388600000
2662	07/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	41.983.808,35	0,00	12.962.526,42905200	3,2388600000
2663	07/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.362.316,19	3.816.872,66277000	3,2388600000
2646	08/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	66.926,95	20.650,05828900	3,2410050000
2645	08/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	41.420,34	0,00	12.780,09136000	3,2410050000
2633	08/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.912,62	0,00	2.132,86310800	3,2410050000
2664	08/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	893.058,30	275.549,80572800	3,2410050000
2647	09/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.995,38	0,00	1.232,22769279	3,2424040000
2634	09/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.577,79	0,00	795,02430900	3,2424040000
2630	10/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.346,48	0,00	1.031,47361800	3,2443680000
2635	10/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.596,38	0,00	2.033,17872695	3,2443680000
2629	14/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.063,24	0,00	5.255,56249200	3,2467010000
2636	14/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	50.859,59	0,00	15.665,00580100	3,2467010000
2680	14/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.194,63	0,00	675,95691750	3,2467010000
2665	14/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.534,89	0,00	1.704,77355300	3,2467010000
2610	15/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	350.767,36	0,00	134.242,34399400	2,6129412640
2611	15/08/2023	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,00	350.767,36	301.102,46470900	1,1649435030
2683	15/08/2023	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	14.571.102,94	0,00	3.712.132,09746949	3,9252652000
2637	16/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	406,20909000	3,2495580000
2628	17/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.689,34	0,00	2.365,23246600	3,2509870000
2666	17/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.235.316,37	0,00	1.917.976,40839500	3,2509870000

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2627	18/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	64.788,03	19.918,77560600	3,2526110000
2648	21/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	165.436,33	0,00	50.843,16269600	3,2538560000
2638	21/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.104,66	0,00	4.949,40771810	3,2538560000
2650	22/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	71.006,83	21.809,62215546	3,2557570000
2649	22/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	33.658,59	0,00	10.338,17634400	3,2557570000
2681	22/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	23.763,19	7.298,82174867	3,2557570000
2667	22/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.534,89	1.700,03097500	3,2557570000
2652	23/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	75.247,34	23.098,56427500	3,2576630000
2651	23/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	71.711,93	0,00	22.013,30524300	3,2576630000
2653	29/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.386.944,78	2.876.451,22757600	3,2633770000
2670	29/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.668,19	1.430,47782700	3,2633770000
2669	29/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.668,19	1.430,47746300	3,2633770000
2668	29/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.668,19	0,00	1.430,47830500	3,2633770000
2655	30/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.464.181,71	3.817.351,02451500	3,2651390000
2654	30/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	52.387,68	0,00	16.044,54818000	3,2651390000
2671	30/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.813,58	0,00	8.212,07917900	3,2651390000
2639	31/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	900,03790300	3,2662180000
2657	31/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	152.128.641,38	46.576.389,38265600	3,2662180000
2656	31/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.250.796,60	0,00	995.278,51478377	3,2662180000
2682	31/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	14.044.538,83	4.299.939,20491529	3,2662180000
2672	31/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	931.716,93	0,00	285.258,64776900	3,2662180000
2673	31/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	29.921.452,60	9.160.886,56687100	3,2662180000
2696	01/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.577,79	0,00	788,91209700	3,2675250000
2710	01/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.323.479,92	0,00	1.323.166,59245100	3,2675250000
2730	01/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	725.176,17	0,00	221.934,39070800	3,2675250000
2711	04/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	961.203,94	0,00	294.037,42751900	3,2689850000
2729	04/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	352.992,01	134.242,34399400	2,6295131540
2742	04/09/2023	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	6.652.992,01	0,00	1.683.371,61597700	3,9521826000
2732	04/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.300.000,00	1.927.203,70375400	3,2689850000
2731	04/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.355,14	0,00	9.285,79972000	3,2689850000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2688	04/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	16.122.350,15	4.931.913,16323300	3,2689850000
2697	05/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.570,00	0,00	1.091,66466600	3,2702350000
2713	05/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	19.996,24	6.114,61744100	3,2702350000
2712	05/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.249.186,08	0,00	687.775,06203600	3,2702350000
2733	05/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.326,12	0,00	4.992,33847100	3,2702350000
2690	05/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	400,00	122,31513100	3,2702350000
2689	05/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	40.646.370,16	0,00	12.429.189,38853000	3,2702350000
2715	06/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	74.359.656,96	22.725.264,75544556	3,2721140000
2714	06/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	124.968.120,49	0,00	38.191.860,21330500	3,2721140000
2745	06/09/2023	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	6.659.065,95	1.683.371,61560700	3,9557908000
2744	06/09/2023	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	14.684.418,00	3.712.132,09758200	3,9557908000
2743	06/09/2023	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	376.166,70	95.092,66769100	3,9557908000
2735	06/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.882.081,57	3.936.929,33059400	3,2721140000
2734	06/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	27.647.543,28	0,00	8.449.443,77854800	3,2721140000
2746	06/09/2023	NTN-B 150850 (5,674000%)	21.719.650,65	0,00	5.000,00000000	4.343,9301300000
2692	06/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	20.349.515,97	6.219.073,04319900	3,2721140000
2691	06/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.826.442,95	0,00	3.919.925,45186300	3,2721140000
2716	08/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.650,84	0,00	504,22801500	3,2739950000
2698	08/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.465,24	0,00	2.585,59955000	3,2739950000
2717	11/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	37.097.481,84	0,00	11.324.771,25767200	3,2757820000
2699	11/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.833,03	0,00	2.391,19391900	3,2757820000
2736	11/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.419.776,29	0,00	4.707.204,65830700	3,2757820000
2718	12/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.155,70	0,00	1.572,92291700	3,2777830000
2693	12/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	244.366,37	0,00	74.552,33308600	3,2777830000
2719	12/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	246.007,07	75.052,88468000	3,2777830000
2700	13/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.351,42	0,00	1.936,76990900	3,2793880000
2720	14/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.908,47	0,00	6.373,00440400	3,2807870000
2701	14/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	402,34248600	3,2807870000
2737	18/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.801,61	0,00	853,21371600	3,2835970000
2702	18/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.884,10	0,00	1.182,87962865	3,2835970000

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2703	19/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.197,36	0,00	364,49403800	3,2849920000
2721	21/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.053,13	0,00	320,30679900	3,2878790000
2704	21/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	45.863,10	0,00	13.949,14472217	3,2878790000
2705	22/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	43.074,68	0,00	13.094,89254356	3,2894260000
2694	25/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.328,36	403,66059600	3,2907840000
2722	25/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.473,61	1.663,31475600	3,2907840000
2706	25/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.716,89	0,00	5.079,91104800	3,2907840000
2707	26/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.947,03	0,00	3.325,33012400	3,2920130000
2723	26/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	55.031,48	0,00	16.716,66545600	3,2920130000
2738	27/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.544,36	1.380,08525400	3,2928090000
2708	27/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.819,49	0,00	856,25677000	3,2928090000
2724	27/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.357.052,11	2.841.662,57773800	3,2928090000
2739	28/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	27.788,43	0,00	8.436,23090700	3,2939390000
2726	28/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	15.434,86	4.685,83653400	3,2939390000
2725	28/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	52.387,68	0,00	15.904,26537900	3,2939390000
2741	29/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	29.363.300,94	8.908.998,24032300	3,2959150000
2740	29/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	892.423,51	0,00	270.766,54282600	3,2959150000
2695	29/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	32.434.964,91	9.840.959,15837000	3,2959150000
2709	29/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	33.440,07	0,00	10.145,91395700	3,2959150000
2728	29/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	105.559.420,10	32.027.349,03661047	3,2959150000
2727	29/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.054.998,42	0,00	926.904,49237900	3,2959150000
<b>Total</b>			<b>1.097.180.803,63</b>	<b>1.135.033.172,54</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 5.079.352,39

Value-At-Risk: 0,36%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	Limite	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		0,36		0,36			1.401.741.834,23	100,00

#### Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,29%

#### 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%)		0,07	0,00	0,07			31.464.677,16	2,24
NTN-B 150535 (5,784900%)		0,07	0,00	0,07			31.953.732,67	2,28
NTN-B 150535 (5,886400%)		0,07	0,00	0,07			7.496.371,29	0,53
NTN-B 150535 (5,909200%)		0,07	0,00	0,07			85.515.770,14	6,10
NTN-B 150535 (5,927000%)		0,07	0,00	0,07			12.809.343,53	0,91
NTN-B 150535 (6,216000%)		0,07	0,00	0,07			2.712.965,07	0,19
NTN-B 150545 (5,900200%)		0,07	0,00	0,07			128.900.755,77	9,20
NTN-B 150832 (5,763300%)		0,07	0,00	0,07			42.462.037,55	3,03
NTN-B 150840		3,03	0,09	3,03			47.082.926,22	3,36
NTN-B 150840 (5,347000%)		0,07	0,00	0,07			8.503.588,03	0,61
NTN-B 150850 (5,674000%)		0,19	0,00	0,20			21.840.665,33	1,56
NTN-B 150860		4,04	0,06	4,05			23.877.621,10	1,70
NTN-B 150860 (5,442000%)		0,07	0,00	0,07			19.099.704,39	1,36
NTN-B 150860 (5,599600%)		0,07	0,00	0,07			88.816.194,66	6,34
NTN-B 150860 (5,788000%)		0,07	0,00	0,07			73.414.905,96	5,24
NTN-B 150860 (5,926400%)		0,07	0,00	0,07			17.564.400,46	1,25
NTN-B 150860 (5,949840%)		0,07	0,00	0,07			71.704.160,23	5,12
NTN-B 150860 (5,959200%)		0,07	0,00	0,07			84.243.327,30	6,01
NTN-B 150860 (5,986700%)		0,07	0,00	0,07			29.368.413,41	2,10
NTN-B 150860 (6,225100%)		0,07	0,00	0,07			6.083.155,25	0,43

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/09/2023

### 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
<b>Sub-total</b>	0,81	0,30	0,16		-0,69	0,42	834.914.715,52	59,56

#### 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		0,13	0,01	0,01			170.062.717,67	12,13
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP		1,48	0,02	0,02			25.012.194,84	1,78
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,97	0,01	0,02			25.145.766,14	1,79
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,48	0,02	1,79			209.038.616,65	14,91
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,84	0,04	0,42			30.816.964,32	2,20
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		0,47	0,00	0,48			12.675.248,50	0,90
<b>Sub-total</b>	0,68	0,40	0,10		-0,25	0,80	472.751.508,12	33,73

#### 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			859.947,44	0,06
BB PREV RF FLUXO FIC		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,02	-0,00	0,02			52.588.300,40	3,75
<b>Sub-total</b>	0,07	0,02	-0,00		0,98	1,05	53.448.247,84	3,81

#### Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,88%

#### 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		6,88	0,02	0,68			22.849.848,73	1,63
<b>Sub-total</b>	10,48	6,88	0,02		-0,43	-3,57	22.849.848,73	1,63

#### Renda Variável

Value-At-Risk: 9,45%

#### 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
-------	-----------------------------	--------------------	---------------------	---------------------	--------	-------	------------	------------



Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/09/2023

### 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
BB AÇÕES CONSUMO FIC		9,48	0,05	0,53			10.815.868,65	0,77
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		9,75	0,04	0,43			6.961.645,37	0,50
<b>Sub-total</b>	18,93	9,45	0,09		-0,24	-3,60	17.777.514,02	1,27

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

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

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

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