

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

CONSOLIDADO

Período: agosto de 2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

97,04%

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%)	0,41	0,03	0,73	7,41	31.250.546,11	2,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	0,41	0,03	0,74	7,51	31.732.678,68	2,23
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,886400%)	0,55	0,04	0,75	7,58	7.443.940,23	0,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	0,41	0,03	0,75	7,60	84.916.285,18	5,96
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	3,82	0,03	0,75	7,61	12.719.366,16	0,89
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,216000%)	3,01	0,04	0,78	7,81	2.693.326,08	0,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	0,41	0,03	0,75	7,59	127.997.990,58	8,99
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	0,41	0,03	0,74	7,50	42.168.941,46	2,96
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840	7,82	-0,95	-0,90	-0,90	48.167.733,12	3,38
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,347000%)	2,74	0,03	0,65	0,65	8.447.543,65	0,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860	10,47	-1,33	-2,14	-2,14	24.603.692,47	1,73
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,442000%)	2,70	0,03	0,66	0,66	18.972.462,92	1,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	0,41	0,03	0,72	7,39	88.213.996,96	6,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	0,41	0,03	0,74	7,52	72.906.778,99	5,12
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,926400%)	0,41	0,04	0,75	7,61	17.441.036,83	1,23

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/08/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	0,41	0,04	0,75	7,63	71.199.284,71	5,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	0,41	0,03	0,75	7,63	83.649.556,92	5,88
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	0,41	0,03	0,76	7,65	29.160.824,93	2,05
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,225100%)	0,41	0,04	0,78	7,81	6.039.080,48	0,42
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,45	-0,07	0,56	7,36	809.725.066,46	56,88

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	0,36	0,03	1,11	8,92	202.842.324,50	14,25	7.477.458.112,25	2,71
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	4,90	-0,35	0,23	0,23	25.056.770,82	1,76	1.608.678.980,95	1,56
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,27	-0,23	0,44	0,44	25.109.099,49	1,76	1.941.182.587,32	1,29
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,05	-0,01	0,90	7,63	206.768.076,72	14,52	3.750.386.694,20	5,51
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	5,47	-0,66	-0,28	12,25	31.196.810,06	2,19	235.929.641,69	13,22
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2,05	-0,01	0,90	7,64	12.537.544,66	0,88	3.482.446.500,34	0,36
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b		1,04	-0,03	0,95	8,58	503.510.626,25	35,37			

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	1,14	8,76	15.882.828,18	1,12	14.919.559.795,42	0,11
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,05	0,54	0,54	352.668,92	0,02	3.554.344.878,79	0,01
BRAM	BRANDESCO	BRANDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,06	0,05	1,27	9,16	52.042.171,79	3,66	9.013.672.474,30	0,58
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a		0,24	0,05	1,25	9,11	68.277.668,89	4,80			
Renda Fixa		0,52	-0,05	0,76	8,04	1.381.513.361,60	97,04			

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

1,30%

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	27,36	-2,18	-10,44	-1,57	11.274.354,77	0,79	111.903.200,62	10,08
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	25,28	-2,49	-7,25	7,96	7.167.140,53	0,50	684.787.474,06	1,05
Sub-total Artigo 8º I			25,84	-2,30	-9,23	1,92	18.441.495,30	1,30		
Renda Variável			25,84	-2,30	-9,23	1,92	18.441.495,30	1,30		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,66%

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	22,55	1,65	2,90	20,35	23.696.988,90	1,66	2.114.296.555,90	1,12
Sub-total Artigo 9º III			22,55	1,65	2,90	20,35	23.696.988,90	1,66		
Investimentos no Exterior			22,55	1,65	2,90	20,35	23.696.988,90	1,66		
Total			1,08	-0,05	0,67	8,36	1.423.651.845,80	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	809.725.066,46	56,88	0,00	57,40	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	503.510.626,25	35,37	0,00	20,33	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	68.277.668,89	4,80	0,00	22,27	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	1.381.513.361,60	97,04					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	18.441.495,30	1,30	0,00	0,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	18.441.495,30	1,30					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	23.696.988,90	1,66	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	23.696.988,90	1,66					10,00
Total		1.423.651.845,80	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,56 49,19	7,36 83,00	1,51 45,46	5,09 76,28	10,20 75,26	4.521.336,11	50.483.726,24
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,95 83,28	8,58 96,79	3,17 95,64	6,23 93,23	12,54 92,50	6.228.820,73	57.038.321,12
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,25 109,45	9,11 102,70	3,58 107,95	6,95 104,04	13,96 102,98	975.311,08	11.712.312,17
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-9,23 -4,14	1,92 -3,55	1,40 -5,44	9,89 -0,41	-10,61 -16,28	-1.874.964,85	348.044,01
Artigo 9º III % do CDI	2,90 254,87	20,35 229,51	5,57 167,89	14,51 217,29	14,97 110,43	668.675,44	4.006.789,74
Artigo 10º I % do CDI	0,00 0,00	12,37 139,53	0,00 0,00	7,44 111,41	15,18 112,02	0,00	6.503.558,98
CONSOLIDADO (Total)						10.519.178,51	130.092.752,26

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%)	31.025.203,97	0,00	0,00	0,00	31.250.546,11	225.342,14	2.199.570,17
NTN-B 150535 (5,784900%)	31.499.739,95	0,00	0,00	0,00	31.732.678,68	232.938,73	2.262.542,80
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.388.656,04	0,00	0,00	0,00	7.443.940,23	55.284,19	535.312,92
NTN-B 150535 (5,909200%)	84.283.909,12	0,00	0,00	0,00	84.916.285,18	632.376,06	6.118.528,20
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.624.463,44	0,00	0,00	0,00	12.719.366,16	94.902,72	917.841,18
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.672.562,77	0,00	0,00	0,00	2.693.326,08	20.763,31	199.061,43
NTN-B 150545 (5,900200%)	127.045.806,45	0,00	0,00	0,00	127.997.990,58	952.184,13	9.215.026,38
NTN-B 150832 (5,763300%)	43.077.109,17	0,00	0,00	1.220.871,64	42.168.941,46	312.703,93	3.041.787,92
NTN-B 150840	0,00	49.929.823,34	0,00	1.342.958,80	48.167.733,12	-419.131,42	-419.131,42
NTN-B 150840 (5,347000%)	0,00	8.624.242,21	0,00	231.965,61	8.447.543,65	55.267,05	55.267,05
NTN-B 150860	0,00	25.812.928,36	0,00	683.688,12	24.603.692,47	-525.547,77	-525.547,77
NTN-B 150860 (5,442000%)	0,00	19.359.696,27	0,00	512.766,09	18.972.462,92	125.532,74	125.532,74

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150860 (5,599600%)	90.014.418,40	0,00	0,00	2.441.743,28	88.213.996,96	641.321,84	6.266.561,64
NTN-B 150860 (5,788000%)	74.440.155,54	0,00	0,00	2.075.481,79	72.906.778,99	542.105,24	5.267.040,87
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.815.883,50	0,00	0,00	506.661,73	17.441.036,83	131.815,06	1.275.410,86
NTN-B 150860 (5,949840%)	72.735.139,63	0,00	0,00	2.075.481,79	71.199.284,71	539.626,87	5.217.348,97
NTN-B 150860 (5,959200%)	85.456.617,68	0,00	0,00	2.441.743,28	83.649.556,92	634.682,52	6.134.690,16
NTN-B 150860 (5,986700%)	29.793.498,52	0,00	0,00	854.610,15	29.160.824,93	221.936,56	2.143.726,07
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.174.979,02	0,00	0,00	183.130,75	6.039.080,48	47.232,21	453.156,07
					809.725.066,46	4.521.336,11	

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	12.774.031,29	0,00	-350.767,36	0,00	12.537.544,66	114.280,73	921.893,84
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	210.353.164,95	0,00	0,00	5.471.031,05	206.768.076,72	1.885.942,82	15.191.312,03
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	32.041.456,82	0,00	0,00	764.285,32	31.196.810,06	-80.361,44	3.510.920,97
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	226.011.402,59	272.888.417,01	-300.200.583,41	0,00	202.842.324,50	4.143.088,31	37.248.323,97
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	25.000.000,00	0,00	0,00	25.056.770,82	56.770,82	56.770,82
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	25.000.000,00	0,00	0,00	25.109.099,49	109.099,49	109.099,49
					503.510.626,25	6.228.820,73	

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	0,00	350.767,36	0,00	0,00	352.668,92	1.901,56	20.401,36
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	177.233.402,00	0,00	-126.000.000,00	0,00	52.042.171,79	808.769,79	10.580.911,01
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	28.873.775,70	90.571.102,94	-103.726.690,19	0,00	15.882.828,18	164.639,73	1.110.999,80
					68.277.668,89	975.311,08	

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	12.588.906,14	0,00	0,00	0,00	11.274.354,77	-1.314.551,37	-180.324,86

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/08/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	7.727.554,01	0,00	0,00	0,00	7.167.140,53	-560.413,48	528.368,87
					18.441.495,30	-1.874.964,85	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	23.028.313,46	0,00	0,00	0,00	23.696.988,90	668.675,44	4.006.789,74
					23.696.988,90	668.675,44	

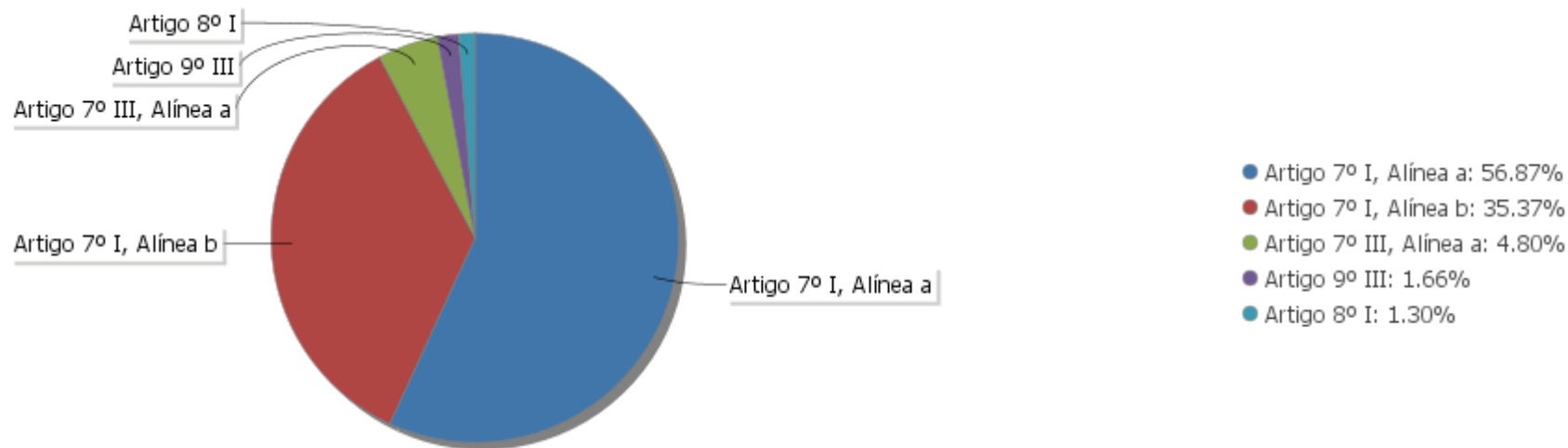
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

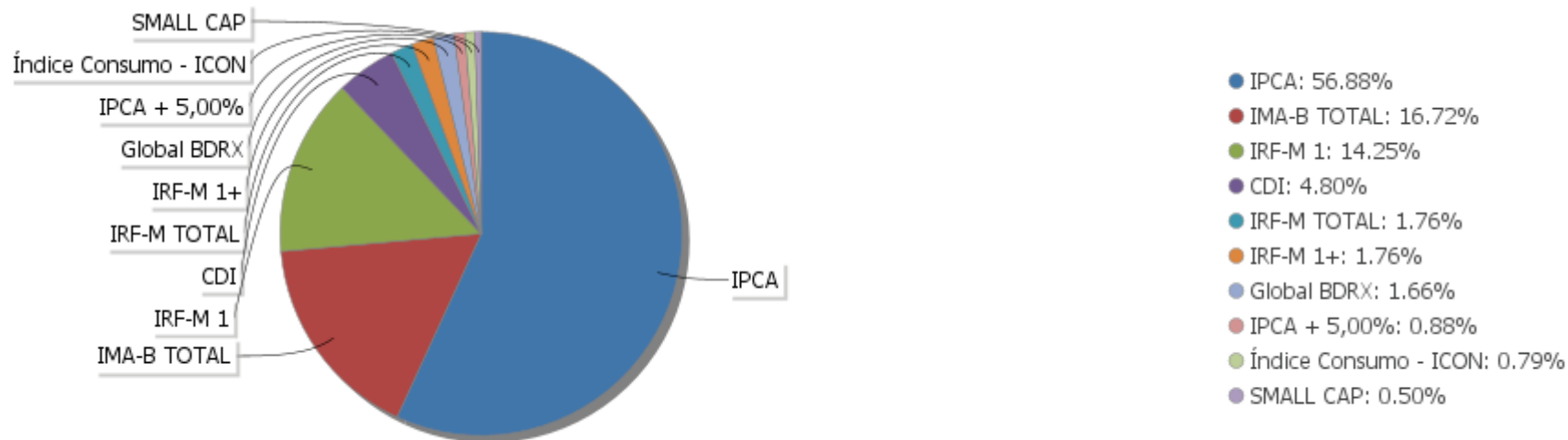
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	363.424.347,90	25,53	363.424.347,90	25,53	
de 31 dias a 365 dias	219.305.621,38	15,40	582.729.969,28	40,93	
acima de 365 dias	840.921.876,52	59,07	1.423.651.845,80	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

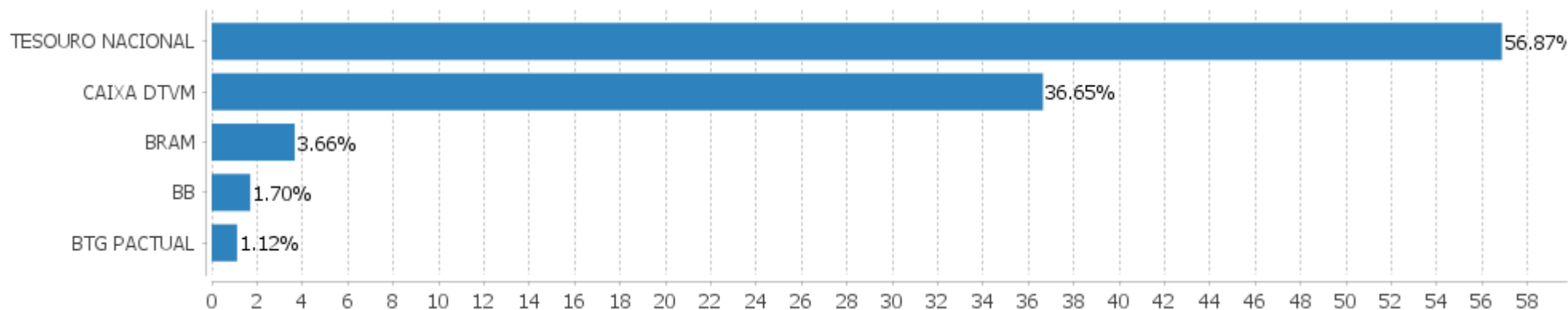


Alocação Por Estratégia



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					8,36
IPCA + 4,00%	0,87	1,12	1,07	0,89	0,57	0,25	0,45	0,59					5,97
p.p. indexador	0,53	-0,33	0,34	-0,01	0,58	0,66	0,39	0,08					2,39
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

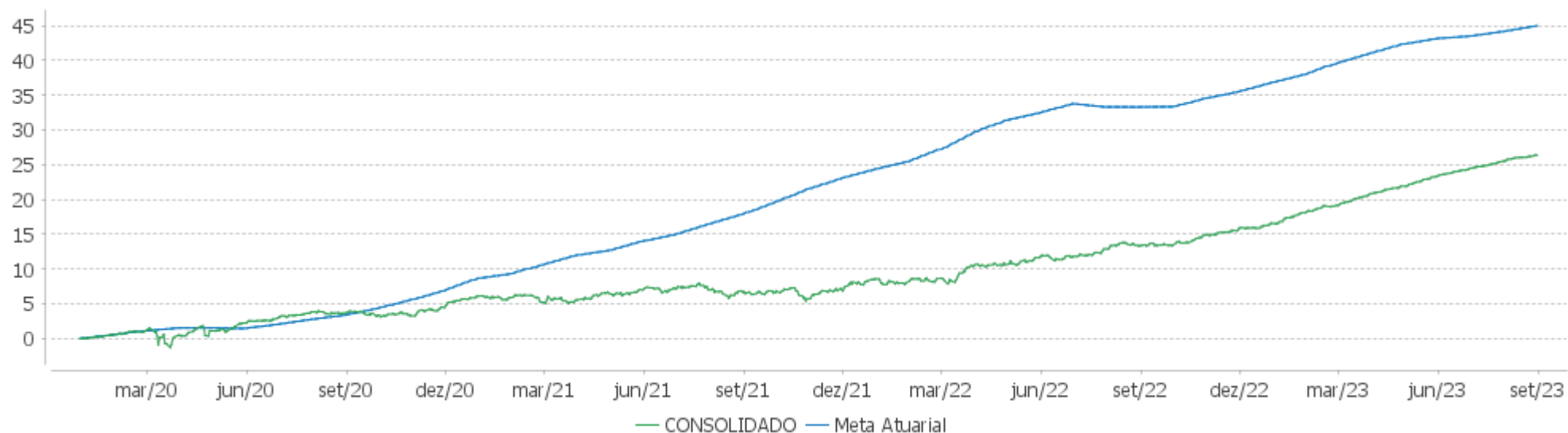
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	19	43,18	03 meses	2,44	1,29	1,15	0,54
Meses abaixo - Meta Atuarial	25	56,82	06 meses	6,02	3,88	2,14	0,66
			12 meses	11,50	8,78	2,73	1,08
			24 meses	18,44	22,21	-3,76	2,00
Maior rentabilidade da Carteira	1,64	2022-03	36 meses	21,89	37,48	-15,59	2,14
Menor rentabilidade da Carteira	-0,80	2021-10	Desde 31/12/2019	26,32	41,86	-15,54	2,51

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

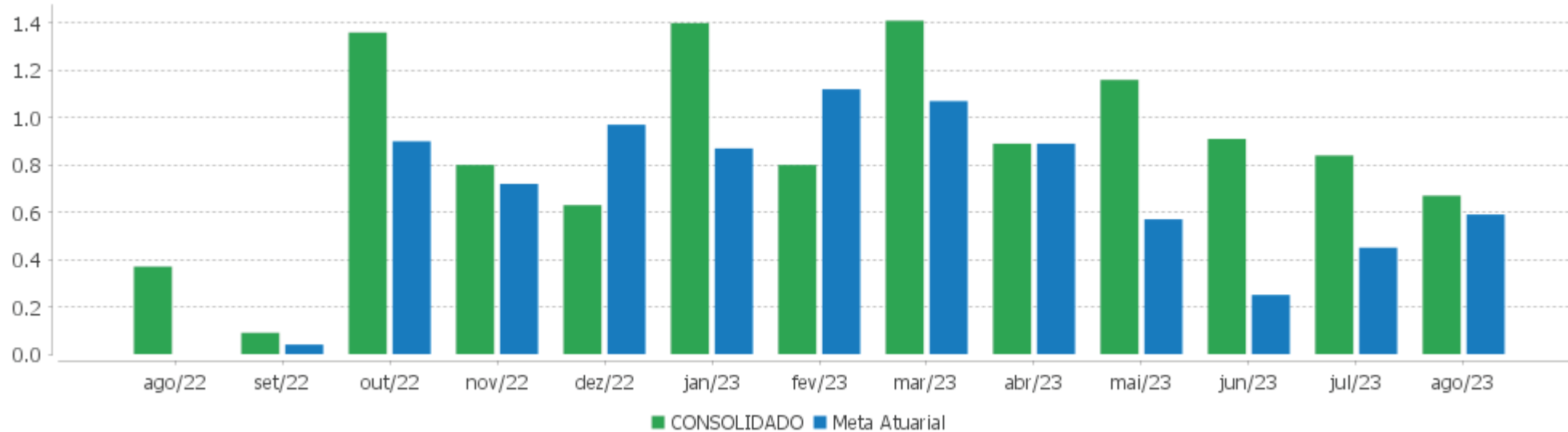


Patrimônio Líquido



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.	0,74 0,51	7,51 4,28	1,68 1,41	5,26 3,42	10,34 5,73	20,71 6,97	31,75 7,00
NTN-B 150535 (6,216000%) Var. IPCA p.p.	0,78 0,55	7,81 4,57	1,79 1,52	5,47 3,64	7,55 2,95	17,89 4,15	
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	0,74 0,51	7,50 4,27	1,67 1,40	5,24 3,41	10,32 5,71	24,15 10,41	35,46 10,72
NTN-B 150535 (5,886400%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,52	7,58 4,35	1,70 1,43	5,31 3,47	10,45 5,84	20,88 7,15	
NTN-B 150860 (6,225100%) Var. IPCA p.p.	0,78 0,55	7,81 4,58	1,79 1,52	5,48 3,65	10,80 6,19	21,36 7,62	
NTN-B 150860 Var. IPCA p.p.	-2,31 -2,54	16,49 13,26	3,02 2,75	18,43 16,59	16,67 12,06		
NTN-B 150840 Var. IPCA p.p.	-0,89 -1,12	15,23 12,00	3,48 3,21	15,92 14,09	15,58 10,97	17,49 3,75	19,19 -5,56
NTN-B 150860 (5,959200%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,52	7,63 4,40	1,72 1,45	5,34 3,51	10,52 5,91	24,57 10,84	36,09 11,34
NTN-B 150840 (5,347000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,47	4,35 1,11	1,57 1,30	5,03 3,20	6,94 2,33		
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,50	7,41 4,18	1,64 1,37	5,18 3,35	10,18 5,57	23,90 10,16	35,15 10,40
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,52	7,60 4,37	1,71 1,44	5,32 3,49	10,47 5,86	24,46 10,72	35,91 11,17
NTN-B 150860 (5,986700%) Var. IPCA p.p.	0,76 0,53	7,65 4,42	1,73 1,46	5,36 3,53	10,55 5,94	21,06 7,32	32,26 7,51
NTN-B 150860 (5,949840%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,52	7,63 4,39	1,72 1,45	5,34 3,51	10,51 5,90	24,56 10,82	36,07 11,32
NTN-B 150860 (5,599600%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,49	7,39 4,16	1,63 1,36	5,16 3,33	10,15 5,54	23,92 10,18	35,32 10,57
NTN-B 150545 (5,900200%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,52	7,59 4,36	1,71 1,44	5,31 3,48	10,46 5,85	24,45 10,72	35,93 11,18
NTN-B 150860 (5,442000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,48	4,45 1,22	1,59 1,32	5,08 3,25	7,08 2,47		
NTN-B 150860 (5,788000%)	0,74	7,52	1,68	5,26	10,34	24,26	35,72

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/08/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,51	4,28	1,41	3,42	5,73	10,52	10,98
NTN-B 150535 (5,927000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,52	7,61 4,38	1,71 1,44	5,33 3,50	10,40 5,79	20,86 7,12	31,99 7,24
NTN-B 150860 (5,926400%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,52	7,61 4,38	1,71 1,44	5,33 3,49	10,49 5,88	20,99 7,25	
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	0,55 -0,04	12,75 -0,24	4,03 -0,08	11,11 -0,20	15,53 -0,51	20,69 -0,92	16,36 -1,21
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,90 1,28	7,63 -4,21	2,92 0,09	4,76 -5,67	11,09 -2,68	20,92 0,85	24,64 0,65
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,28 0,10	12,25 0,41	2,63 -0,21	10,51 0,08	13,73 -0,03	20,72 0,65	22,50 -1,49
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	1,11 -0,03	8,92 -0,13	3,38 -0,06	6,69 -0,13	13,51 -0,23	23,50 -0,53	25,97 -0,83
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,90 0,23	7,64 0,99	2,92 1,38	4,76 0,37	11,09 1,27		
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,73 -0,03	11,33 -0,10	3,75 -0,06	9,45 -0,11	14,84 -0,12	21,77 -0,29	19,95 -0,59
BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,27 111,21	9,16 103,30	3,63 109,23	7,00 104,85	14,06 103,73	26,49 105,38	30,12 105,63
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	1,05 92,46	8,15 91,91	3,06 92,33	6,14 91,93	12,44 91,82	22,65 90,13	24,53 86,01
BGT PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	1,14 99,64	8,76 98,82	3,30 99,39	6,60 98,79	13,39 98,81	24,91 99,11	27,34 95,87
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. SMALL CAP p.p.	-7,25 0,17	7,96 -0,17	3,17 -0,09	16,79 -0,62	-2,31 -0,37	-24,48 -0,72	-13,39 -2,58
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-10,44 -0,03	-1,57 -0,82	0,31 0,01	5,92 -0,91	-16,69 -1,31	-43,56 -1,73	-44,30 -2,71
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	2,90 -0,36	20,35 -1,08	5,57 -0,40	14,51 -0,51	14,97 -0,67	-4,08 -2,01	11,45 -4,96
CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,67 0,08	8,36 2,39	2,44 1,15	6,02 2,14	11,50 2,73	18,44 -4,56	21,89 -18,39
CDI	1,14	8,87	3,32	6,68	13,55	25,14	28,52
IBOVESPA	-5,09	5,47	6,84	10,30	5,68	-2,56	16,48
INPC + 6,00%	0,73	6,87	1,52	4,60	10,27	27,21	48,86
IPCA + 6,00%	0,76	7,32	1,79	4,89	10,86	27,77	48,51

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		
BRANCO 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+ TÍTULOS 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 Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	1,15	9,05	3,44	6,81	13,74	24,03	26,80	33,22	43,08
IRF-M 1+	0,59	12,99	4,10	11,31	16,04	21,61	17,57	30,08	56,68
IRF-M TOTAL	0,76	11,43	3,81	9,56	14,96	22,06	20,53	31,03	52,86
IMA-B 5	0,61	8,75	2,66	5,76	11,97	23,03	28,90	40,81	61,13
IMA-B 5+	-1,27	14,28	2,80	14,40	15,00	16,66	18,76	24,36	71,86
IMA-B TOTAL	-0,38	11,84	2,83	10,43	13,76	20,07	23,99	32,22	68,62
IMA-GERAL TOTAL	0,63	10,39	3,38	8,50	13,72	22,67	24,97	33,10	54,16
IDKA 2	0,77	8,66	2,75	5,42	11,80	22,33	28,55	41,03	58,78
IDKA 20	-3,05	19,50	3,45	24,26	18,37	10,39	11,16	10,89	77,63
CDI	1,14	8,87	3,32	6,68	13,55	25,14	28,52	33,50	41,88

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-5,09	5,47	6,84	10,30	5,68	-2,56	16,48	14,44	50,95
IBRX 100	-5,01	4,62	6,85	9,37	4,16	-4,36	15,60	14,31	54,15
IBRX 50	-4,76	3,66	7,43	8,45	4,56	-3,16	18,26	15,68	49,30
SMALL CAP	-7,43	8,13	3,26	17,40	-1,94	-23,76	-10,81	-5,44	42,85
Índice Consumo - ICON	-10,42	-0,75	0,30	6,83	-15,38	-41,83	-41,59	-38,22	-6,46
Índice Dividendos - IDIV	-2,83	9,22	8,71	11,58	10,64	15,38	37,76	32,74	99,45

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	1,97	10,75	4,16	7,31	8,32	-4,62	15,85	83,19	84,91

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,49	12,06	6,62	14,40	7,95	16,84	15,48	20,93	50,17

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	0,73	6,92	2,53	3,09	6,36	-11,42	5,54	59,73	56,19

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,23	3,23	0,27	1,83	4,61	13,74	24,75	27,79	32,17
INPC	0,20	2,80	0,01	1,55	4,06	13,24	25,04	28,72	32,95
IGPM	-0,14	-5,28	-2,77	-5,42	-7,20	0,77	32,13	49,34	56,73
SELIC	1,14	8,87	3,32	6,68	13,55	25,14	28,52	33,50	41,88

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,59	5,97	1,29	3,88	8,78	23,00	40,28	49,45	60,68
IPCA + 5,00%	0,68	6,64	1,54	4,39	9,82	25,37	44,35	55,27	68,52
IPCA + 5,50%	0,72	6,98	1,66	4,64	10,34	26,57	46,42	58,24	72,56
IPCA + 5,89%	0,75	7,25	1,76	4,84	10,74	27,50	48,05	60,59	75,76
IPCA + 6,00%	0,76	7,32	1,79	4,89	10,86	27,77	48,51	61,26	76,67
INPC + 4,00%	0,56	5,52	1,03	3,59	8,20	22,46	40,61	50,54	61,62
INPC + 6,00%	0,73	6,87	1,52	4,60	10,27	27,21	48,86	62,43	77,71

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%)	31.250.546,11	5,634200	31.835.528,91	5,404200	584.982,80
NTN-B 150535 (5,784900%)	31.732.678,68	5,784900	32.719.849,16	5,404200	987.170,48
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.443.940,23	5,886400	7.737.802,17	5,404200	293.861,94
NTN-B 150535 (5,909200%)	84.916.285,18	5,909200	88.432.024,76	5,404200	3.515.739,58
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.719.366,16	5,927000	13.264.803,71	5,404200	545.437,55
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.693.326,08	6,216000	2.874.040,80	5,404200	180.714,72
NTN-B 150545 (5,900200%)	127.997.990,58	5,900200	132.622.479,27	5,597500	4.624.488,69
NTN-B 150832 (5,763300%)	42.168.941,46	5,763300	43.390.219,69	5,337500	1.221.278,23
NTN-B 150840 (5,347000%)	8.447.543,65	5,347000	8.319.881,18	5,492000	-127.662,47
NTN-B 150860 (5,442000%)	18.972.462,92	5,442000	18.452.769,35	5,625600	-519.693,57
NTN-B 150860 (5,599600%)	88.213.996,96	5,599600	87.870.330,24	5,625600	-343.666,72
NTN-B 150860 (5,788000%)	72.906.778,99	5,788000	74.689.780,70	5,625600	1.783.001,71
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.441.036,83	5,926400	18.233.093,52	5,625600	792.056,69
NTN-B 150860 (5,949840%)	71.199.284,71	5,949840	74.689.780,70	5,625600	3.490.495,99
NTN-B 150860 (5,959200%)	83.649.556,92	5,959200	87.870.330,24	5,625600	4.220.773,32
NTN-B 150860 (5,986700%)	29.160.824,93	5,986700	30.754.615,58	5,625600	1.593.790,65
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.039.080,48	6,225100	6.590.274,77	5,625600	551.194,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2616	01/08/2023	BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	17.016.551,60	1.082.990,89375216	15,7125528000
2614	01/08/2023	BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	53.060.412,91	3.376.944,12775498	15,7125528000
2615	01/08/2023	BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	5.923.035,49	376.962,01027245	15,7125528000
2620	01/08/2023	BTG PACTUAL TESOURO 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 TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	76.038.479,79	19.458.804,55960331	3,9076645000
2623	02/08/2023	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	7.387.068,40	1.890.404,97207475	3,9076645000
2622	02/08/2023	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	8.766.721,07	2.243.468,20716057	3,9076645000
2621	02/08/2023	BTG PACTUAL TESOURO 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
2618	04/08/2023	BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	33.644.070,38	2.137.532,60192607	15,7396759000
2617	04/08/2023	BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	7.327.585,89	465.548,71501515	15,7396759000
2619	04/08/2023	BRANCO 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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
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
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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
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
Total			517.536.977,49	530.278.040,96		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 4.968.661,25

Value-At-Risk: 0,35%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		0,35		0,35			1.423.651.845,80	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,30%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,634200%)		0,10	0,00	0,11			31.250.546,11	2,20
NTN-B 150535 (5,784900%)		0,10	0,00	0,11			31.732.678,68	2,23
NTN-B 150535 (5,886400%)		0,10	0,00	0,11			7.443.940,23	0,52
NTN-B 150535 (5,909200%)		0,10	0,00	0,11			84.916.285,18	5,96
NTN-B 150535 (5,927000%)		0,10	0,00	0,11			12.719.366,16	0,89
NTN-B 150535 (6,216000%)		0,10	0,00	0,11			2.693.326,08	0,19
NTN-B 150545 (5,900200%)		0,10	0,00	0,11			127.997.990,58	8,99
NTN-B 150832 (5,763300%)		0,10	0,00	0,11			42.168.941,46	2,96
NTN-B 150840		2,62	0,07	2,62			48.167.733,12	3,38
NTN-B 150840 (5,347000%)		0,10	0,00	0,11			8.447.543,65	0,59
NTN-B 150860		4,30	0,06	4,29			24.603.692,47	1,73
NTN-B 150860 (5,442000%)		0,10	0,00	0,11			18.972.462,92	1,33
NTN-B 150860 (5,599600%)		0,10	0,00	0,11			88.213.996,96	6,20
NTN-B 150860 (5,788000%)		0,10	0,00	0,11			72.906.778,99	5,12
NTN-B 150860 (5,926400%)		0,10	0,00	0,11			17.441.036,83	1,23
NTN-B 150860 (5,949840%)		0,10	0,00	0,11			71.199.284,71	5,00
NTN-B 150860 (5,959200%)		0,10	0,00	0,11			83.649.556,92	5,88
NTN-B 150860 (5,986700%)		0,10	0,00	0,11			29.160.824,93	2,05
NTN-B 150860 (6,225100%)		0,10	0,00	0,11			6.039.080,48	0,42
Sub-total	0,61	0,32	0,15		-0,95	0,56	809.725.066,46	56,88

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/08/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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		0,14	0,01	0,01			202.842.324,50	14,25
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP		1,46	0,02	0,02			25.056.770,82	1,76
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,00	0,01	0,02			25.109.099,49	1,76
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,49	0,03	1,78			206.768.076,72	14,52
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,77	0,03	0,53			31.196.810,06	2,19
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		0,49	0,00	0,51			12.537.544,66	0,88
Sub-total	0,82	0,40	0,11		-0,23	0,95	503.510.626,25	35,37

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI		0,02	0,00	0,02			15.882.828,18	1,12
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	0,00	0,01			352.668,92	0,02
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,03	-0,00	0,03			52.042.171,79	3,66
Sub-total	0,04	0,03	-0,00		2,51	1,25	68.277.668,89	4,80

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 7,04%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		7,04	0,00	0,87			23.696.988,90	1,66
Sub-total	17,55	7,04	0,00		0,10	2,90	23.696.988,90	1,66

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,87%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		10,06	0,05	0,52			11.274.354,77	0,79
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		9,96	0,03	0,41			7.167.140,53	0,50
Sub-total	16,54	9,87	0,09		-0,63	-9,23	18.441.495,30	1,30

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

- (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 (%)