

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



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

# RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

# **CONSOLIDADO**

Período: julho de 2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

97,00%

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%)	0,45	0,03	0,46	6,64	31.025.203,97	2,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	0,45	0,03	0,47	6,72	31.499.739,95	2,18
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,886400%)	0,58	0,03	0,48	6,78	7.388.656,04	0,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	0,45	0,03	0,48	6,80	84.283.909,12	5,83
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	3,83	0,03	0,48	6,81	12.624.463,44	0,87
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,216000%)	3,01	0,03	0,51	6,97	2.672.562,77	0,18
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	0,45	0,03	0,48	6,79	127.045.806,45	8,78
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	0,45	0,03	0,47	6,71	43.077.109,17	2,98
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	0,45	0,03	0,46	6,62	90.014.418,40	6,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	0,45	0,03	0,47	6,73	74.440.155,54	5,15
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,926400%)	2,96	0,03	0,48	6,81	17.815.883,50	1,23
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	0,45	0,03	0,49	6,82	72.735.139,63	5,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	0,45	0,03	0,49	6,83	85.456.617,68	5,91
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	2,99	0,03	0,49	6,84	29.793.498,52	2,06
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,225100%)	3,09	0,03	0,51	6,98	6.174.979,02	0,43

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/07/2023

## 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>0,45</b>	<b>0,03</b>	<b>0,48</b>	<b>6,76</b>	<b>716.048.143,20</b>	<b>49,50</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	0,35	0,06	1,07	7,73	226.011.402,59	15,62	7.409.323.495,01	3,05
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,22	0,04	1,06	6,67	210.353.164,95	14,54	3.809.865.990,18	5,52
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	5,92	0,31	0,71	12,56	32.041.456,82	2,21	242.317.384,37	13,22
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2,22	0,04	1,06	6,67	12.774.031,29	0,88	3.548.133.366,37	0,36
		<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>	<b>1,16</b>	<b>0,07</b>	<b>1,07</b>	<b>7,56</b>	<b>481.180.055,65</b>	<b>33,26</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	1,05	7,54	28.873.775,70	2,00	13.958.737.896,42	0,21
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,00	0,89	5,23	0,00	0,00	3.542.574.797,77	0,00
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,06	0,06	1,18	7,79	177.233.402,00	12,25	8.447.360.930,23	2,10
		<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>	<b>0,28</b>	<b>0,06</b>	<b>1,17</b>	<b>7,76</b>	<b>206.107.177,70</b>	<b>14,25</b>		
		<b>Renda Fixa</b>	<b>0,56</b>	<b>0,05</b>	<b>0,80</b>	<b>7,22</b>	<b>1.403.335.376,55</b>	<b>97,00</b>		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/07/2023

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### RENTA VARIÁVEL

1,40%

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	28,18	0,94	2,08	9,90	12.588.906,14	0,87	126.847.411,24	9,92
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	26,18	1,21	2,97	16,40	7.727.554,01	0,53	701.038.285,73	1,10
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>26,16</b>	<b>1,04</b>	<b>2,42</b>	<b>12,29</b>	<b>20.316.460,15</b>	<b>1,40</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>26,16</b>	<b>1,04</b>	<b>2,42</b>	<b>12,29</b>	<b>20.316.460,15</b>	<b>1,40</b>		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/07/2023

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,59%

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	22,96	0,17	2,12	16,95	23.028.313,46	1,59	2.066.727.306,72	1,11
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>22,96</b>	<b>0,17</b>	<b>2,12</b>	<b>16,95</b>	<b>23.028.313,46</b>	<b>1,59</b>		
Investimentos no Exterior			22,96	0,17	2,12	16,95	23.028.313,46	1,59		
Total			1,19	0,06	0,84	7,64	1.446.680.150,16	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
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	716.048.143,20	49,50	0,00	57,40	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	481.180.055,65	33,26	0,00	20,33	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	206.107.177,70	14,25	0,00	22,27	60,00	0,00	60,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>1.403.335.376,55</b>	<b>97,00</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	20.316.460,15	1,40	0,00	0,00	30,00	0,00	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>20.316.460,15</b>	<b>1,40</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	23.028.313,46	1,59	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>23.028.313,46</b>	<b>1,59</b>					10,00
<b>Total</b>		<b>1.446.680.150,16</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	0,48 44,57	6,76 88,49	2,02 61,02	5,51 85,49	9,55 70,32	3.405.064,48	45.962.390,13
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,07 99,77	7,56 98,97	3,09 93,50	6,33 98,26	12,33 90,73	6.567.333,00	50.809.500,39
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,17 108,99	7,76 101,59	3,49 105,64	6,56 101,80	14,05 103,44	2.307.009,42	10.737.001,09
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	2,42 -0,85	12,29 1,16	25,94 9,17	8,79 1,29	4,20 -14,01	479.865,86	2.223.008,86
Artigo 9º III % do CDI	2,12 197,37	16,95 221,89	8,55 258,83	12,11 187,96	7,35 54,09	477.132,73	3.338.114,30
Artigo 10º I % do CDI	0,00 0,00	12,37 161,92	1,22 36,96	5,57 86,37	11,52 84,77	0,00	6.503.558,98
<b>CONSOLIDADO (Total)</b>						<b>13.236.405,49</b>	<b>119.573.573,75</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%)	30.882.857,53	0,00	0,00	0,00	31.025.203,97	142.346,44	1.974.228,03
NTN-B 150535 (5,784900%)	31.351.497,28	0,00	0,00	0,00	31.499.739,95	148.242,67	2.029.604,07
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.353.297,25	0,00	0,00	0,00	7.388.656,04	35.358,79	480.028,73
NTN-B 150535 (5,909200%)	83.879.070,86	0,00	0,00	0,00	84.283.909,12	404.838,26	5.486.152,14
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.563.639,24	0,00	0,00	0,00	12.624.463,44	60.824,20	822.938,46
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.659.083,07	0,00	0,00	0,00	2.672.562,77	13.479,70	178.298,12
NTN-B 150545 (5,900200%)	126.436.301,67	0,00	0,00	0,00	127.045.806,45	609.504,78	8.262.842,25
NTN-B 150832 (5,763300%)	42.875.073,66	0,00	0,00	0,00	43.077.109,17	202.035,51	2.729.083,99
NTN-B 150860 (5,599600%)	89.603.873,26	0,00	0,00	0,00	90.014.418,40	410.545,14	5.625.239,80
NTN-B 150860 (5,788000%)	74.089.643,10	0,00	0,00	0,00	74.440.155,54	350.512,44	4.724.935,63
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.730.071,42	0,00	0,00	0,00	17.815.883,50	85.812,08	1.143.595,80
NTN-B 150860 (5,949840%)	72.383.487,59	0,00	0,00	0,00	72.735.139,63	351.652,04	4.677.722,10

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/07/2023

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150860 (5,959200%)	85.042.830,42	0,00	0,00	0,00	85.456.617,68	413.787,26	5.500.007,64
NTN-B 150860 (5,986700%)	29.648.561,05	0,00	0,00	0,00	29.793.498,52	144.937,47	1.921.789,51
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.143.791,32	0,00	0,00	0,00	6.174.979,02	31.187,70	405.923,86
					716.048.143,20	3.405.064,48	

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	12.640.381,21	0,00	0,00	0,00	12.774.031,29	133.650,08	807.613,11
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	208.152.326,99	0,00	0,00	0,00	210.353.164,95	2.200.837,96	13.305.369,21
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	31.815.120,90	0,00	0,00	0,00	32.041.456,82	226.335,92	3.591.282,41
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	224.852.760,00	272.441.041,97	-275.288.908,42	0,00	226.011.402,59	4.006.509,04	33.105.235,66
					481.180.055,65	6.567.333,00	

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	368.778,06	0,00	-372.053,29	0,00	0,00	3.275,23	18.499,80
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	175.160.772,40	0,00	0,00	0,00	177.233.402,00	2.072.629,60	9.772.141,22
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	21.270.617,82	7.372.053,29	0,00	0,00	28.873.775,70	231.104,59	946.360,07
					206.107.177,70	2.307.009,42	

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	12.331.902,87	0,00	0,00	0,00	12.588.906,14	257.003,27	1.134.226,51
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	7.504.691,42	0,00	0,00	0,00	7.727.554,01	222.862,59	1.088.782,35
					20.316.460,15	479.865,86	

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



Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/07/2023

### 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	22.551.180,73	0,00	0,00	0,00	23.028.313,46	477.132,73	3.338.114,30
					23.028.313,46	477.132,73	

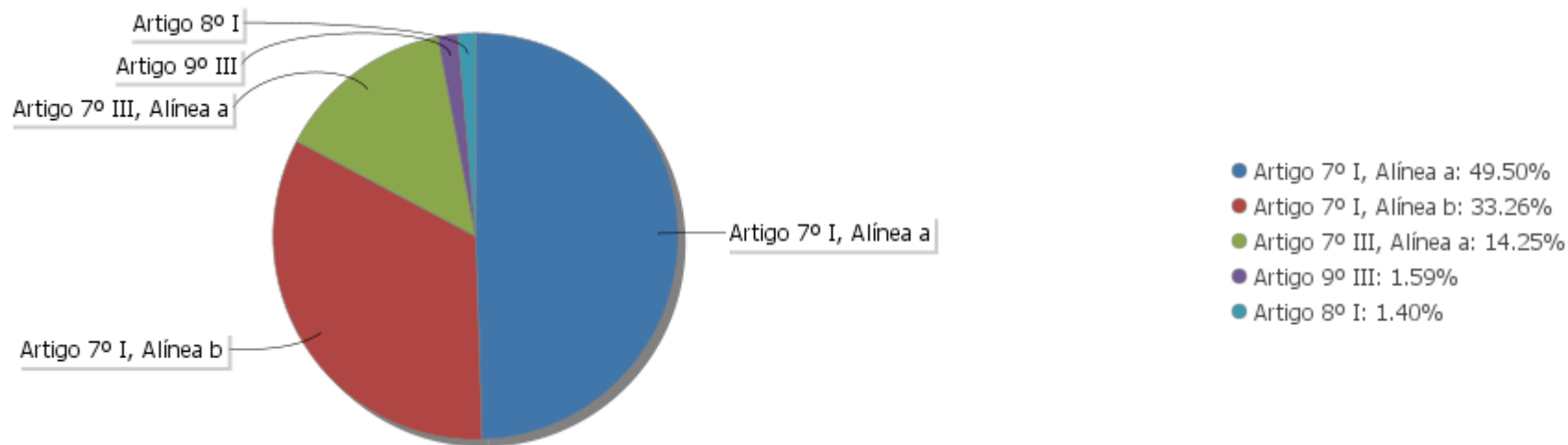
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Liquidez

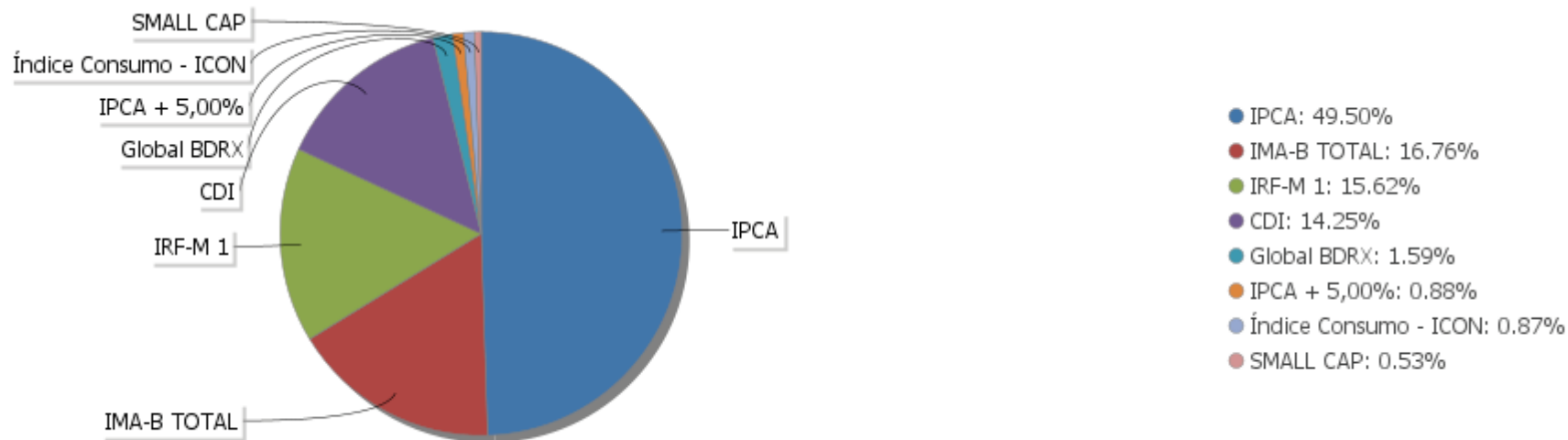
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	475.463.353,90	32,87	475.463.353,90	32,87	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	475.463.353,90	32,87	
acima de 365 dias	971.216.796,26	67,13	1.446.680.150,16	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

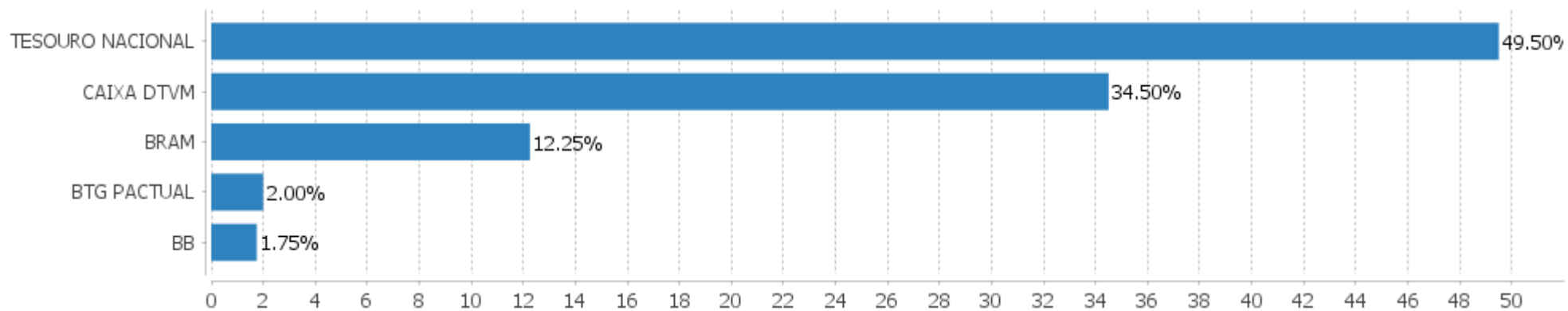


Alocação Por Estratégia



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Gestor



Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/07/2023

## 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						7,64
IPCA + 4,00%	0,87	1,12	1,07	0,89	0,57	0,25	0,45						5,34
p.p. indexador	0,53	-0,33	0,34	-0,01	0,58	0,66	0,39						2,30
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

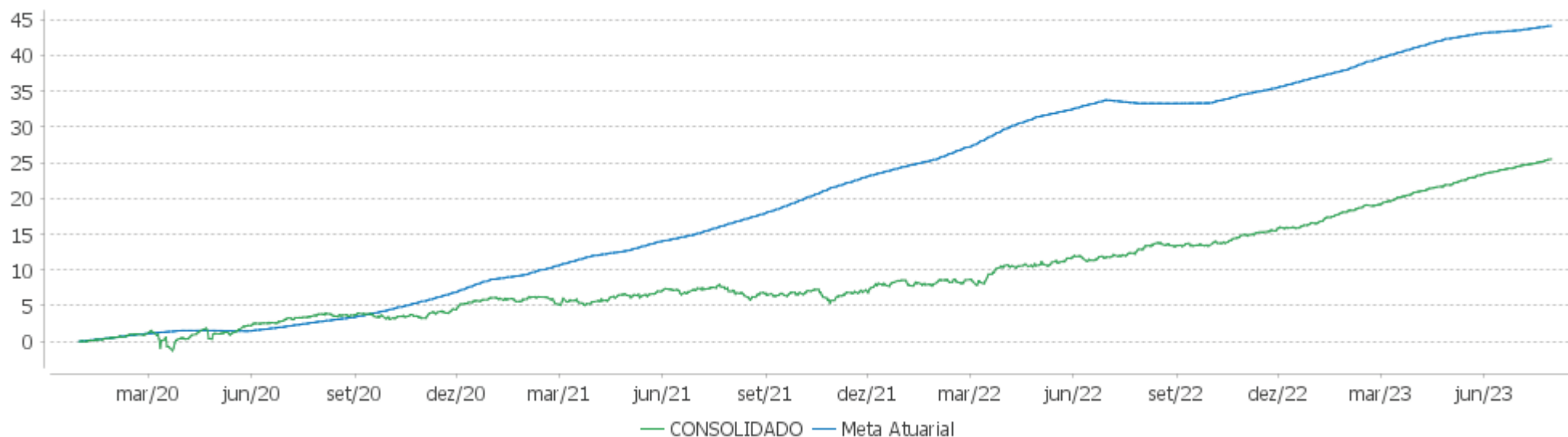
### Performance Sobre a Meta Atuarial

### Relatório

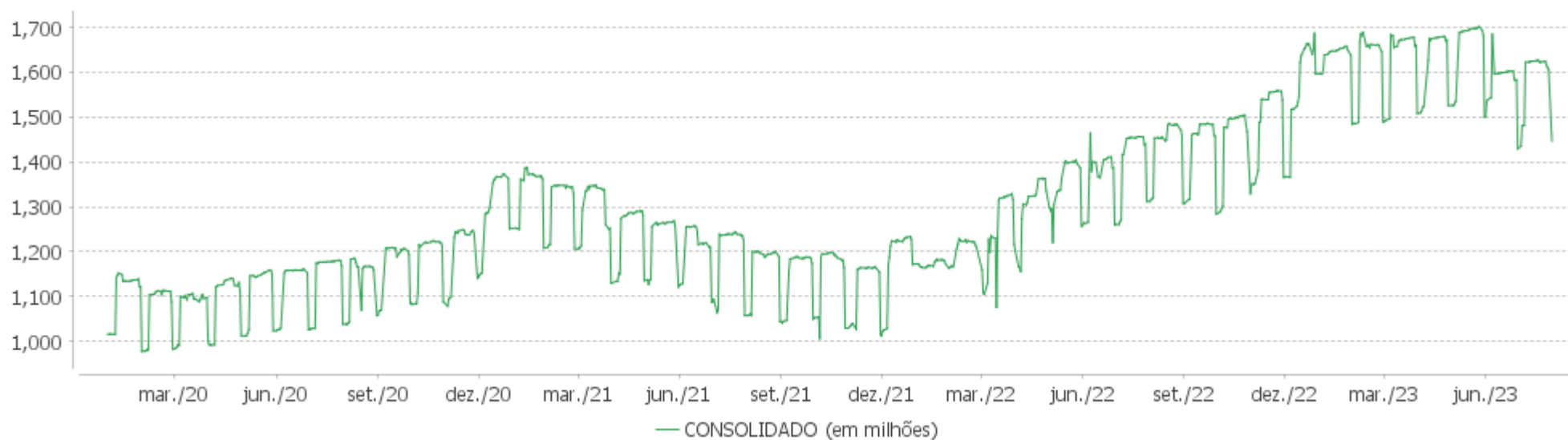
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	18	41,86	03 meses	2,94	1,27	1,66	0,56
Meses abaixo - Meta Atuarial	25	58,14	06 meses	6,16	4,43	1,73	0,73
			12 meses	11,17	8,14	3,03	1,19
			24 meses	17,27	22,76	-5,49	2,08
Maior rentabilidade da Carteira	1,64	2022-03	36 meses	20,88	37,43	-16,54	2,16
Menor rentabilidade da Carteira	-0,80	2021-10	Desde 31/12/2019	25,49	41,03	-15,55	2,54

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Evolução

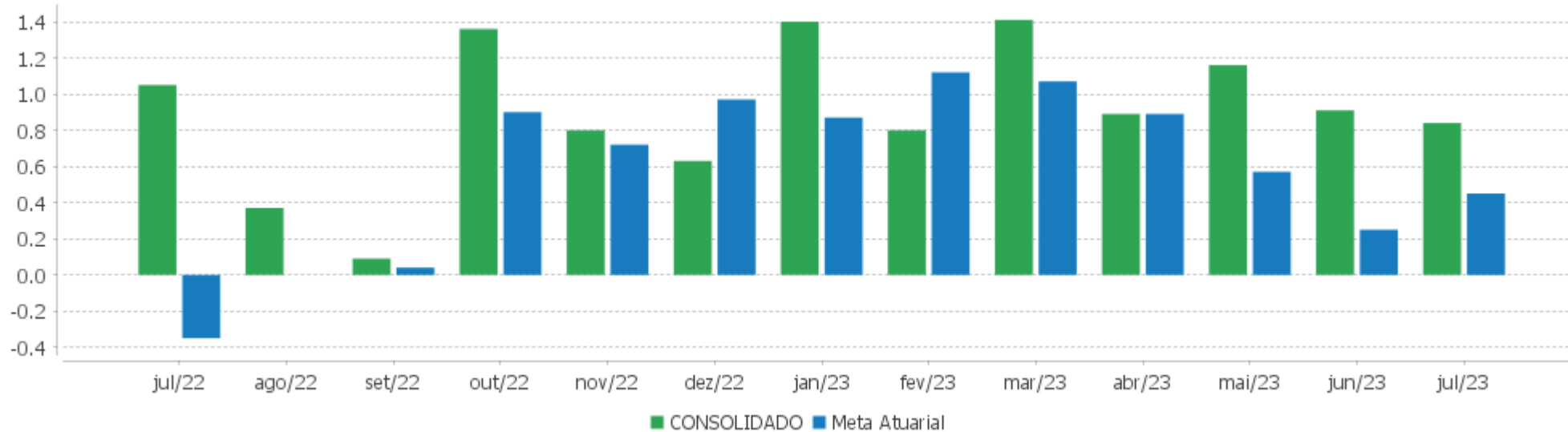


### Patrimônio Líquido



### 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.	0,47 0,35	6,72 3,73	2,00 1,73	5,48 3,03	9,49 5,50	21,43 6,96	31,75 7,00
NTN-B 150535 (6,216000%) Var. IPCA p.p.	0,51 0,39	6,97 3,98	2,11 1,84	5,69 3,24	6,73 2,74	18,58 4,12	
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,35	6,71 3,72	1,99 1,72	5,47 3,02	9,47 5,48	21,37 6,90	31,66 6,90
NTN-B 150535 (5,886400%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,78 3,79	2,02 1,75	5,53 3,08	9,60 5,61	21,60 7,14	
NTN-B 150860 (6,225100%) Var. IPCA p.p.	0,51 0,39	6,98 3,99	2,11 1,84	5,69 3,24	6,70 2,70	18,47 4,01	
NTN-B 150860 (5,959200%) Var. IPCA p.p.	0,49 0,37	6,83 3,83	2,04 1,77	5,56 3,11	9,67 5,68	21,74 7,28	32,22 7,46
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,80 3,80	2,03 1,76	5,54 3,09	9,62 5,63	25,20 10,73	35,92 11,16
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,34	6,64 3,64	1,96 1,69	5,41 2,95	9,34 5,34	24,64 10,17	35,15 10,39
NTN-B 150860 (5,986700%) Var. IPCA p.p.	0,49 0,37	6,84 3,85	2,05 1,78	5,58 3,13	6,56 2,57	18,30 3,83	28,48 3,72
NTN-B 150860 (5,949840%) Var. IPCA p.p.	0,49 0,37	6,82 3,83	2,04 1,77	5,56 3,11	9,66 5,67	21,73 7,27	32,20 7,45
NTN-B 150860 (5,599600%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,34	6,62 3,62	1,95 1,68	5,39 2,94	9,30 5,31	21,28 6,82	31,67 6,91
NTN-B 150545 (5,900200%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,79 3,80	2,03 1,76	5,54 3,08	9,61 5,62	25,19 10,73	35,93 11,17
NTN-B 150860 (5,788000%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,35	6,73 3,73	2,00 1,73	5,48 3,03	9,49 5,50	21,53 7,06	31,96 7,20
NTN-B 150535 (5,927000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,81 3,81	2,03 1,76	5,55 3,10	9,56 5,56	21,57 7,11	31,99 7,23
NTN-B 150860 (5,926400%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,81 3,81	2,03 1,76	5,55 3,10	6,53 2,54	18,26 3,79	
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,06 0,25	6,67 -5,60	1,99 -3,84	5,21 -7,06	9,91 -5,54	19,81 0,60	23,23 1,01
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,71	12,56	5,83	12,25	15,23	19,99	20,44



Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/07/2023

**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.	-0,10	0,29	0,00	-0,02	-0,23	0,78	-1,78
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	1,06 0,53	6,67 0,75	1,99 0,47	5,21 0,29	9,90 0,73		
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	1,07 0,00	7,73 -0,09	3,39 -0,05	6,53 -0,11	13,63 -0,21	22,57 -0,51	24,71 -0,81
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,18 110,38	7,79 102,00	3,52 106,48	6,59 102,28	13,99 103,01	25,52 105,22	28,71 105,28
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,98 91,73	7,02 91,90	3,06 92,50	5,93 91,96	12,47 91,82	21,74 89,64	23,32 85,51
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	1,05 98,02	7,54 98,70	3,30 99,78	6,36 98,68	13,42 98,79	24,03 99,08	26,09 95,66
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. SMALL CAP p.p.	2,97 -0,15	16,40 -0,40	25,91 -0,75	12,68 -0,81	16,58 -0,90	-22,65 -1,87	-7,92 -3,07
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. Índice Consumo - ICON p.p.	2,08 -0,14	9,90 -0,88	25,97 0,28	6,54 -1,06	-0,99 -1,73	-39,56 -1,97	-38,88 -3,12
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	2,12 -0,01	16,95 -0,64	8,55 -0,13	12,11 -0,55	7,35 -1,22	-4,52 -1,52	24,72 -4,48
CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,84 0,39	7,64 2,30	2,94 1,66	6,16 1,73	11,17 3,03	17,27 -6,50	20,88 -19,37
CDI	1,07	7,64	3,30	6,44	13,58	24,25	27,27
IBOVESPA	3,27	11,13	16,77	7,50	18,20	0,12	18,49
INPC + 6,00%	0,40	6,09	1,66	5,07	9,71	28,04	49,03
IPCA + 6,00%	0,61	6,51	1,76	5,41	10,21	28,55	48,45

**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		
BRAPREV 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
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	1,07	7,81	3,44	6,64	13,84	23,07	25,52	32,43	42,08
IRF-M 1+	0,82	12,33	6,44	11,52	18,36	19,55	15,56	29,44	53,47
IRF-M TOTAL	0,89	10,59	5,29	9,67	16,44	20,41	18,73	30,37	50,29
IMA-B 5	0,97	8,08	2,62	6,60	11,29	22,46	28,66	40,02	59,74
IMA-B 5+	0,73	15,74	8,42	17,22	19,37	15,53	15,93	24,98	73,16
IMA-B TOTAL	0,81	12,27	5,83	12,27	15,46	19,21	22,22	32,19	68,50
IMA-GERAL TOTAL	0,98	9,70	4,55	8,94	14,59	21,41	23,44	32,48	52,87
IDKA 2	0,98	7,84	2,26	6,31	10,55	21,73	28,89	40,07	57,72
IDKA 20	0,76	23,26	14,33	29,18	28,75	8,83	7,52	12,84	82,11
CDI	1,07	7,64	3,30	6,44	13,58	24,25	27,27	32,66	41,08

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,27	11,13	16,77	7,50	18,20	0,12	18,49	19,77	53,93
IBRX 100	3,32	10,13	16,52	6,40	16,39	-2,60	17,59	20,13	57,20
IBRX 50	3,70	8,84	16,09	5,28	16,73	-1,88	19,92	20,20	51,93
SMALL CAP	3,12	16,80	26,65	13,48	17,47	-20,79	-4,84	2,63	47,75
Índice Consumo - ICON	2,22	10,79	25,68	7,60	0,74	-37,60	-35,76	-27,95	-0,79
Índice Dividendos - IDIV	2,84	12,41	12,81	6,16	18,72	18,15	34,93	39,66	97,67

## 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	1,45	8,61	4,36	4,67	1,54	-3,34	27,84	93,91	105,76

### Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	1,33	11,51	11,86	13,33	13,61	13,21	16,98	20,22	48,40

### Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	1,88	6,14	2,36	1,41	1,33	-9,61	16,75	69,84	71,77

### Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,12	2,99	0,27	2,45	3,99	14,46	24,76	27,64	31,75
INPC	-0,09	2,59	0,17	2,13	3,53	14,01	25,24	28,62	32,68
IGPM	-0,72	-5,15	-4,43	-5,35	-7,72	1,58	35,94	48,54	58,04
SELIC	1,07	7,64	3,30	6,44	13,58	24,25	27,27	32,66	41,08

### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,45	5,34	1,27	4,43	8,14	23,77	40,25	49,25	60,17
IPCA + 5,00%	0,53	5,93	1,52	4,92	9,17	26,15	44,31	55,05	67,99
IPCA + 5,50%	0,57	6,22	1,64	5,16	9,69	27,35	46,37	58,02	72,01
IPCA + 5,89%	0,60	6,44	1,74	5,35	10,09	28,29	47,99	60,36	75,20
IPCA + 6,00%	0,61	6,51	1,76	5,41	10,21	28,55	48,45	61,03	76,11
INPC + 4,00%	0,24	4,94	1,17	4,10	7,65	23,27	40,79	50,39	61,30
INPC + 6,00%	0,40	6,09	1,66	5,07	9,71	28,04	49,03	62,26	77,35

**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%)	31.025.203,97	5,634200	32.046.713,17	5,237600	1.021.509,20
NTN-B 150535 (5,784900%)	31.499.739,95	5,784900	32.936.899,65	5,237600	1.437.159,70
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.388.656,04	5,886400	7.789.131,67	5,237600	400.475,63
NTN-B 150535 (5,909200%)	84.283.909,12	5,909200	89.018.647,70	5,237600	4.734.738,58
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.624.463,44	5,927000	13.352.797,15	5,237600	728.333,71
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.672.562,77	6,216000	2.893.106,05	5,237600	220.543,28
NTN-B 150545 (5,900200%)	127.045.806,45	5,900200	134.717.721,93	5,406400	7.671.915,48
NTN-B 150832 (5,763300%)	43.077.109,17	5,763300	44.755.213,03	5,185500	1.678.103,86
NTN-B 150860 (5,599600%)	90.014.418,40	5,599600	92.349.519,64	5,427000	2.335.101,24
NTN-B 150860 (5,788000%)	74.440.155,54	5,788000	78.497.091,69	5,427000	4.056.936,15
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.815.883,50	5,926400	19.162.525,33	5,427000	1.346.641,83
NTN-B 150860 (5,949840%)	72.735.139,63	5,949840	78.497.091,69	5,427000	5.761.952,06
NTN-B 150860 (5,959200%)	85.456.617,68	5,959200	92.349.519,64	5,427000	6.892.901,96
NTN-B 150860 (5,986700%)	29.793.498,52	5,986700	32.322.331,87	5,427000	2.528.833,35
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.174.979,02	6,225100	6.926.213,97	5,427000	751.234,95

**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

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/07/2023

**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
<b>Total</b>			<b>279.813.095,26</b>	<b>275.660.961,71</b>		



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 3.548.077,48

Value-At-Risk: 0,25%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		0,25	0,25			1.446.680.150,16	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,17%

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%)		0,11	0,00	0,09			31.025.203,97	2,14
NTN-B 150535 (5,784900%)		0,11	0,00	0,09			31.499.739,95	2,18
NTN-B 150535 (5,886400%)		0,11	0,00	0,09			7.388.656,04	0,51
NTN-B 150535 (5,909200%)		0,11	0,00	0,09			84.283.909,12	5,83
NTN-B 150535 (5,927000%)		0,11	0,00	0,09			12.624.463,44	0,87
NTN-B 150535 (6,216000%)		0,11	0,00	0,09			2.672.562,77	0,18
NTN-B 150545 (5,900200%)		0,11	0,00	0,09			127.045.806,45	8,78
NTN-B 150832 (5,763300%)		0,11	0,00	0,09			43.077.109,17	2,98
NTN-B 150860 (5,599600%)		0,11	0,00	0,09			90.014.418,40	6,22
NTN-B 150860 (5,788000%)		0,11	0,00	0,09			74.440.155,54	5,15
NTN-B 150860 (5,926400%)		0,11	0,00	0,09			17.815.883,50	1,23
NTN-B 150860 (5,949840%)		0,11	0,00	0,09			72.735.139,63	5,03
NTN-B 150860 (5,959200%)		0,11	0,00	0,09			85.456.617,68	5,91
NTN-B 150860 (5,986700%)		0,11	0,00	0,09			29.793.498,52	2,06
NTN-B 150860 (6,225100%)		0,11	0,00	0,09			6.174.979,02	0,43
<b>Sub-total</b>	0,07	0,11	0,01		-8,88	0,48	716.048.143,20	49,50

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		0,16	0,02	0,01			226.011.402,59	15,62

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/07/2023

### 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		0,70	0,06	1,47			210.353.164,95	14,54
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,78	0,02	0,51			32.041.456,82	2,21
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		0,70	0,00	0,71			12.774.031,29	0,88
<b>Sub-total</b>	0,62	0,45	0,10		-0,00	1,07	481.180.055,65	33,26

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			28.873.775,70	2,00
BB PREV RF FLUXO FIC		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,03	-0,00	0,03			177.233.402,00	12,25
<b>Sub-total</b>	0,11	0,02	-0,00		0,85	1,17	206.107.177,70	14,25

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,85%

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		6,85	0,02	0,55			23.028.313,46	1,59
<b>Sub-total</b>	11,58	6,85	0,02		0,09	2,12	23.028.313,46	1,59

Renda Variável

Value-At-Risk: 10,93%

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		11,47	0,07	0,59			12.588.906,14	0,87
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		10,64	0,04	0,18			7.727.554,01	0,53
<b>Sub-total</b>	17,67	10,93	0,11		0,08	2,42	20.316.460,15	1,40