

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

CONSOLIDADO

Período: setembro 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	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,634200%)	0,37	0,04	0,69	8,15	31.464.677,16	2,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	0,37	0,04	0,70	8,26	31.953.732,67	2,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,886400%)	0,52	0,04	0,70	8,34	7.496.371,29	0,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	0,37	0,04	0,71	8,36	85.515.770,14	6,10
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	3,82	0,04	0,71	8,37	12.809.343,53	0,91
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,216000%)	3,01	0,04	0,73	8,59	2.712.965,07	0,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	0,37	0,04	0,71	8,35	128.900.755,77	9,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	0,37	0,04	0,70	8,25	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	8,12	88.816.194,66	6,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	0,37	0,04	0,70	8,26	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	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,926400%)	0,37	0,04	0,71	8,37	17.564.400,46	1,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	0,37	0,04	0,71	8,39	71.704.160,23	5,12
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	0,37	0,04	0,71	8,40	84.243.327,30	6,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	0,37	0,04	0,71	8,42	29.368.413,41	2,10
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,225100%)	0,37	0,04	0,73	8,60	6.083.155,25	0,43
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,48	0,11	0,42	7,81	834.914.715,52	59,56

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	0,06	0,91	9,91	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	8,81	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	10,88	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	8,82	12.675.248,50	0,90	3.520.695.315,59	0,36
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,97	0,14	0,80	9,45	472.751.508,12	33,73		

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	0,97	9,82	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	10,30	52.588.300,40	3,75	8.906.699.435,49	0,59
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,13	0,05	1,05	10,25	53.448.247,84	3,81		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

0,51

0,12

0,60

8,68

1.361.114.471,48

97,10

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/09/2023

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	Ano				
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	27,05	1,31	-4,07	-5,58	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	4,86	6.961.645,37	0,50	663.773.561,70	1,05
Sub-total Artigo 8º I			25,55	1,25	-3,60	-1,75	17.777.514,02	1,27		
Renda Variável			25,55	1,25	-3,60	-1,75	17.777.514,02	1,27		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/09/2023

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	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	21,98	-0,35	-3,57	16,05	22.849.848,73	1,63	1.999.422.357,55	1,14
Sub-total Artigo 9º III			21,98	-0,35	-3,57	16,05	22.849.848,73	1,63		
Investimentos no Exterior			21,98	-0,35	-3,57	16,05	22.849.848,73	1,63		
Total			0,99	0,13	0,48	8,88	1.401.741.834,23	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	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
	Total Renda Fixa	1.361.114.471,48	97,10					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	17.777.514,02	1,27	0,00	0,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	17.777.514,02	1,27					30,00
Investimentos no Exterior								
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
	Total Investimentos no Exterior	22.849.848,73	1,63					10,00
Total		1.401.741.834,23	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	0,42 42,99	7,81 78,66	1,46 45,48	3,99 61,77	10,52 78,28	3.469.998,41	53.953.724,65
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,80 82,30	9,45 95,22	2,85 88,42	5,72 88,52	12,50 92,97	4.804.320,86	61.842.641,98
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,05 107,24	10,25 103,21	3,50 108,72	6,82 105,50	13,81 102,73	590.229,60	12.302.541,77
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-3,60 -4,31	-1,75 -7,97	-10,38 -9,09	11,19 -3,22	-11,81 -17,74	-663.981,28	-315.937,27
Artigo 9º III % do CDI	-3,57 -366,77	16,05 161,64	1,32 41,13	7,00 108,27	20,13 149,74	-847.140,17	3.159.649,57
Artigo 10º I % do CDI	0,00 0,00	12,37 124,61	0,00 0,00	3,24 50,15	23,43 174,32	0,00	6.503.558,98
CONSOLIDADO (Total)						7.353.427,42	137.446.179,68

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%)	31.250.546,11	0,00	0,00	0,00	31.464.677,16	214.131,05	2.413.701,22
NTN-B 150535 (5,784900%)	31.732.678,68	0,00	0,00	0,00	31.953.732,67	221.053,99	2.483.596,79
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.443.940,23	0,00	0,00	0,00	7.496.371,29	52.431,06	587.743,98
NTN-B 150535 (5,909200%)	84.916.285,18	0,00	0,00	0,00	85.515.770,14	599.484,96	6.718.013,16
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.719.366,16	0,00	0,00	0,00	12.809.343,53	89.977,37	1.007.818,55
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.693.326,08	0,00	0,00	0,00	2.712.965,07	19.638,99	218.700,42
NTN-B 150545 (5,900200%)	127.997.990,58	0,00	0,00	0,00	128.900.755,77	902.765,19	10.117.791,57
NTN-B 150832 (5,763300%)	42.168.941,46	0,00	0,00	0,00	42.462.037,55	293.096,09	3.334.884,01
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
NTN-B 150860	24.603.692,47	0,00	0,00	0,00	23.877.621,10	-726.071,37	-1.251.619,14

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/09/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
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	6.868.759,34
NTN-B 150860 (5,788000%)	72.906.778,99	0,00	0,00	0,00	73.414.905,96	508.126,97	5.775.167,84
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.441.036,83	0,00	0,00	0,00	17.564.400,46	123.363,63	1.398.774,49
NTN-B 150860 (5,949840%)	71.199.284,71	0,00	0,00	0,00	71.704.160,23	504.875,52	5.722.224,49
NTN-B 150860 (5,959200%)	83.649.556,92	0,00	0,00	0,00	84.243.327,30	593.770,38	6.728.460,54
NTN-B 150860 (5,986700%)	29.160.824,93	0,00	0,00	0,00	29.368.413,41	207.588,48	2.351.314,55
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.039.080,48	0,00	0,00	0,00	6.083.155,25	44.074,77	497.230,84
					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 Financ. Ano (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	1.059.597,68
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	17.461.851,96
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	3.131.075,23
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	40.032.156,13
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 Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	352.668,92	0,00	-352.992,01	0,00	0,00	323,09	20.724,45
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	52.042.171,79	0,00	0,00	0,00	52.588.300,40	546.128,61	11.127.039,62
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	1.154.777,70
					53.448.247,84	590.229,60	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/09/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES CONSUMO FIC	11.274.354,77	0,00	0,00	0,00	10.815.868,65	-458.486,12	-638.810,98
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	7.167.140,53	0,00	0,00	0,00	6.961.645,37	-205.495,16	322.873,71
					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 Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	23.696.988,90	0,00	0,00	0,00	22.849.848,73	-847.140,17	3.159.649,57
					22.849.848,73	-847.140,17	

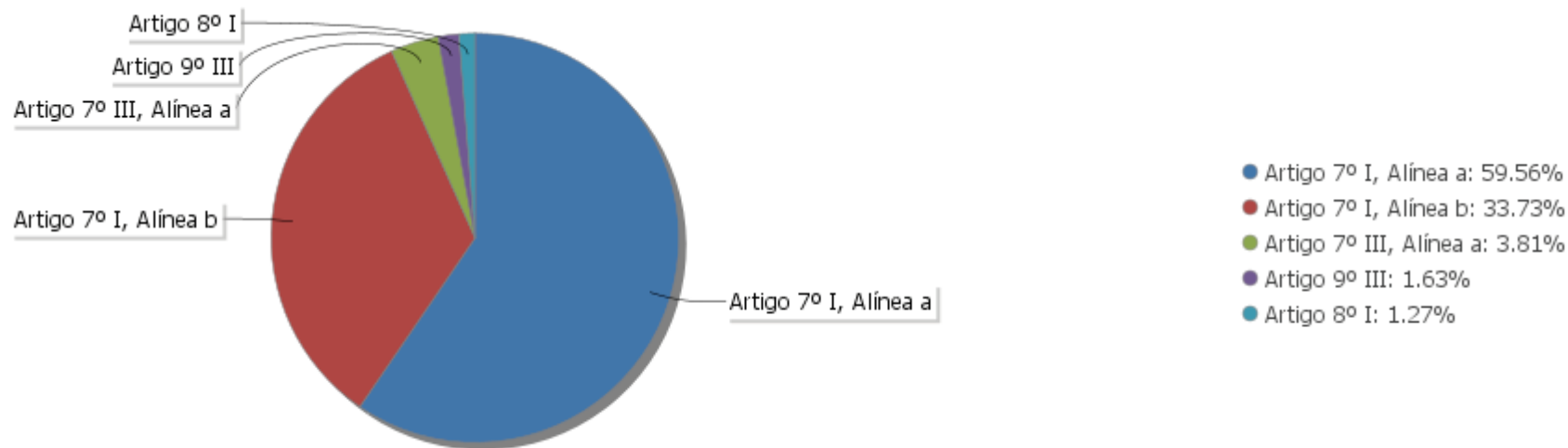
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

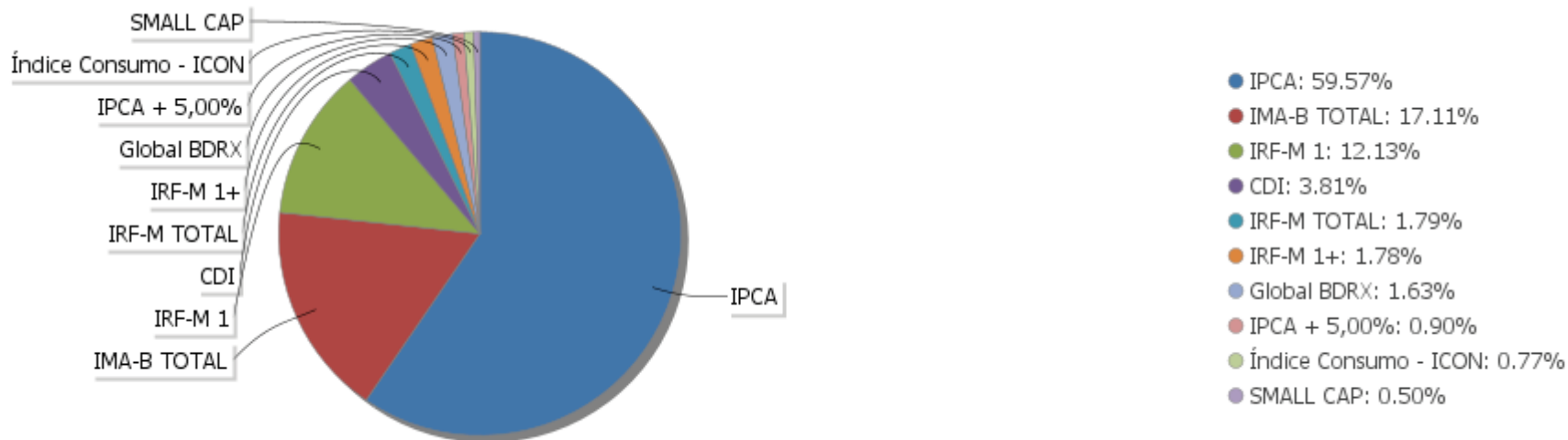
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	314.296.289,24	22,42	314.296.289,24	22,42	
de 31 dias a 365 dias	221.713.865,15	15,82	536.010.154,39	38,24	
acima de 365 dias	865.731.679,84	61,76	1.401.741.834,23	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

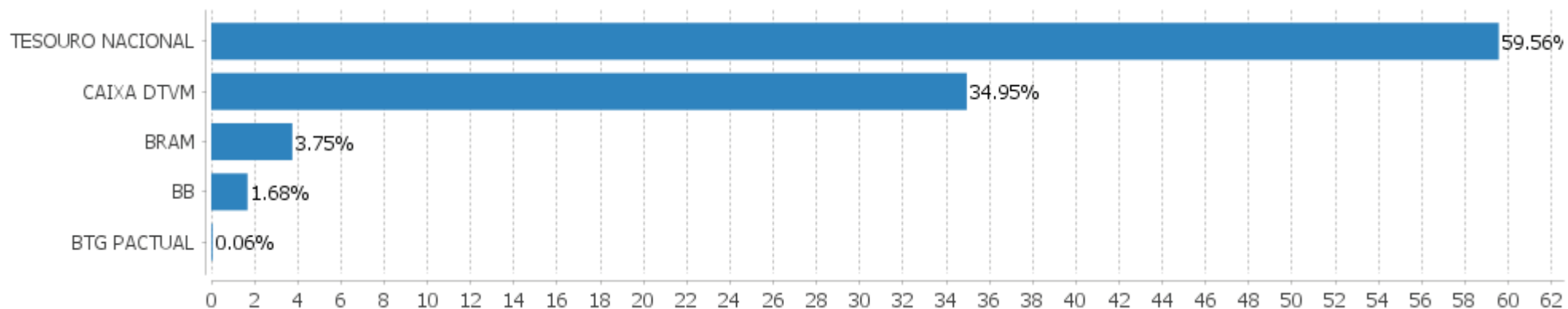


Alocação Por Estratégia



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

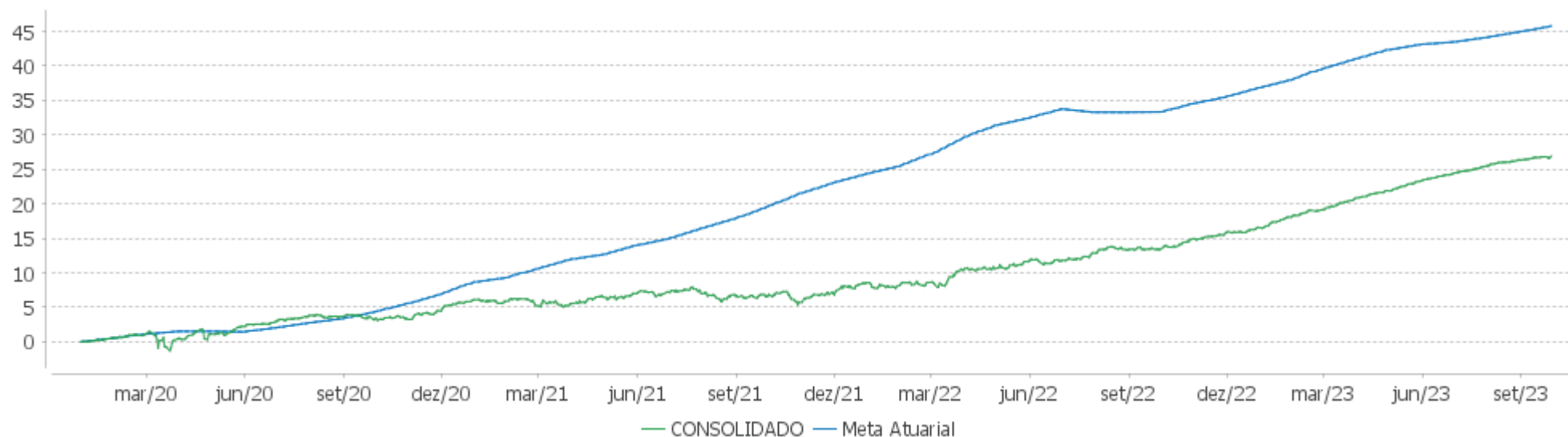
Performance Sobre a Meta Atuarial

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

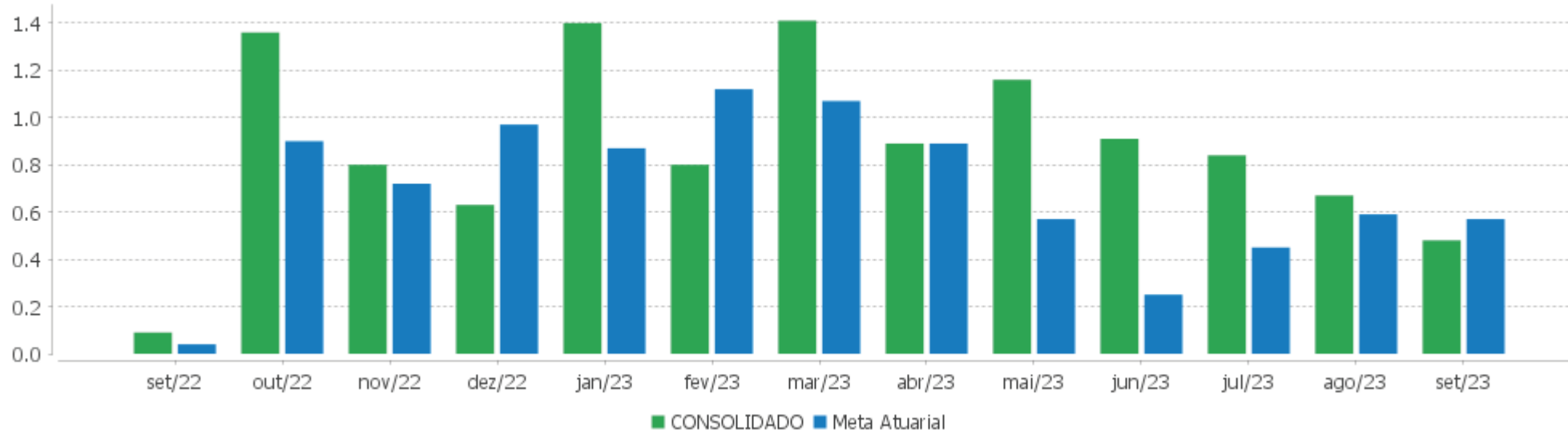


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150535 (5,784900%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,44	8,26 4,76	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	8,59 5,09	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	8,25 4,75	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	8,34 4,84	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	8,60 5,10	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	12,64 9,14	-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	13,05 9,55	-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	8,40 4,90	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	5,04 1,54	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	8,15 4,65	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	8,36 4,86	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	8,42 4,92	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	8,39 4,89	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	8,12 4,62	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	8,35 4,85	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	5,15 1,65	1,84 1,23	4,28 2,90	7,70 2,51		
NTN-B 150860 (5,788000%)	0,70	8,26	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 Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,44	4,77	1,31	3,07	5,79	10,38	11,22
NTN-B 150535 (5,927000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,45	8,37 4,87	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	8,37 4,87	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	2,32 -1,18	-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	12,55 -0,27	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	8,81 -1,97	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	10,88 0,10	-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	9,91 -0,15	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	8,82 1,48	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	11,49 -0,13	1,77 -0,06	7,33 -0,11	13,46 -0,12	22,40 -0,27	20,86 -0,56
BRAPRESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,05 107,67	10,30 103,80	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	9,12 91,85	2,96 91,98	5,95 91,99	12,33 91,75	23,32 90,39	25,64 86,73
BGT PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,97 99,55	9,82 98,89	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	4,86 -0,19	-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	-5,58 -0,83	-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	16,05 -1,18	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	8,88 2,31	2,00 0,39	5,05 1,68	11,94 2,58	19,11 -2,78	22,81 -16,92
CDI	0,97	9,93	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57
IBOVESPA	0,71	6,22	-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 Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
INPC + 6,00%	0,57	7,49	1,71	3,97	10,73	25,81	47,70
IPCA + 6,00%	0,72	8,10	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 Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,93	10,06	3,18	6,50	13,54	24,68	27,79	33,59	43,54
IRF-M 1+	-0,15	12,82	1,26	8,24	14,06	22,31	18,47	27,49	54,02
IRF-M TOTAL	0,17	11,62	1,83	7,45	13,57	22,67	21,42	29,39	51,16
IMA-B 5	0,13	8,89	1,73	4,32	11,65	21,97	29,23	38,58	59,92
IMA-B 5+	-1,92	12,08	-2,46	8,17	10,15	15,88	19,59	17,59	70,32
IMA-B TOTAL	-0,95	10,79	-0,52	6,55	11,05	19,09	24,70	27,33	67,28
IMA-GERAL TOTAL	0,18	10,59	1,80	6,72	12,50	22,90	25,94	31,42	53,46
IDKA 2	0,29	8,97	2,05	4,08	11,42	21,35	28,89	39,21	57,10
IDKA 20	-3,53	15,28	-5,76	12,78	8,75	9,82	12,05	2,09	75,69
CDI	0,97	9,93	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57	34,18	42,60

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,71	6,22	-1,29	14,41	5,93	5,03	23,21	11,28	46,91
IBRX 100	0,84	5,50	-1,02	13,78	5,09	3,69	22,17	11,68	50,59
IBRX 50	1,21	4,92	-0,03	13,75	5,32	5,93	25,49	12,91	45,69
SMALL CAP	-2,84	5,06	-7,25	16,09	-2,94	-20,83	-8,36	-10,00	41,57
Índice Consumo - ICON	-4,02	-4,75	-12,11	9,02	-17,82	-40,64	-41,63	-42,24	-10,67
Índice Dividendos - IDIV	1,32	10,67	1,25	15,38	14,16	22,39	46,36	32,00	101,74

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	-3,22	7,19	0,12	2,85	10,76	-8,35	13,20	73,22	84,04

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,20	12,28	2,03	16,60	7,64	18,54	15,18	19,93	50,80

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-2,61	4,13	-0,05	0,10	9,93	-14,78	3,18	51,70	56,69

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,26	3,50	0,61	1,38	5,19	12,73	24,28	28,17	31,88
INPC	0,11	2,91	0,22	1,01	4,51	12,02	24,10	28,93	32,69
IGPM	0,37	-4,93	-0,49	-5,12	-5,97	1,79	27,09	49,89	54,94
SELIC	0,97	9,93	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57	34,18	42,60

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,57	6,57	1,62	3,37	9,36	21,89	39,73	49,87	60,35
IPCA + 5,00%	0,65	7,34	1,87	3,86	10,40	24,23	43,78	55,70	68,19
IPCA + 5,50%	0,69	7,72	1,99	4,10	10,92	25,41	45,84	58,68	72,22
IPCA + 5,89%	0,72	8,01	2,08	4,30	11,33	26,34	47,45	61,03	75,41
IPCA + 6,00%	0,72	8,10	2,11	4,35	11,44	26,60	47,91	61,70	76,32
INPC + 4,00%	0,42	5,97	1,22	3,00	8,65	21,12	39,53	50,75	61,34
INPC + 6,00%	0,57	7,49	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
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
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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
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
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

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/09/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2727	29/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.054.998,42	0,00	926.904,49237900	3,2959150000
Total			299.830.730,88	329.094.169,87		

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 ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite	CVaR ⁽³⁾	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 ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	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 ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	0,81	0,30	0,16		-0,69	0,42	834.914.715,52	59,56

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		0,13	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
Sub-total	0,68	0,40	0,10		-0,25	0,80	472.751.508,12	33,73

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI		0,02	0,00	0,02			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
Sub-total	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 ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		6,88	0,02	0,68			22.849.848,73	1,63
Sub-total	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 ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
-------	-----------------------------	--------------------	---------------------	---------------------	--------	-------	------------	------------

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/09/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	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
Sub-total	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 (%)