

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



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

# RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

# **CONSOLIDADO**

Período: outubro de 2023

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Posição de Ativos e Enquadramento

**RENDA FIXA** 97,25%

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%)	0,36	0,03	0,70	8,90	31.685.068,45	2,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	0,36	0,04	0,71	9,03	32.181.376,74	2,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,886400%)	0,51	0,04	0,72	9,12	7.550.373,25	0,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	0,36	0,04	0,72	9,14	86.133.470,42	6,11
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	3,79	0,04	0,72	9,16	12.902.042,32	0,91
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,216000%)	3,01	0,04	0,75	9,40	2.733.217,89	0,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	0,36	0,04	0,72	9,13	129.830.815,44	9,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	0,36	0,04	0,71	9,02	42.763.814,76	3,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840	8,26	-0,05	-0,94	-4,04	46.638.869,23	3,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,347000%)	2,74	0,03	0,68	2,01	8.561.204,33	0,61
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,674000%)	3,96	0,03	0,70	1,26	21.994.335,31	1,56
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860	10,99	-0,19	-1,20	-6,17	23.591.452,94	1,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,442000%)	2,70	0,03	0,69	2,03	19.230.572,08	1,36
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	0,36	0,03	0,70	8,88	89.435.797,86	6,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	0,36	0,04	0,71	9,04	73.938.031,92	5,24

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/10/2023

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,926400%)	0,36	0,04	0,72	9,15	17.691.500,14	1,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	0,36	0,04	0,73	9,17	72.224.355,77	5,12
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	0,36	0,04	0,73	9,18	84.855.045,54	6,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	0,36	0,04	0,73	9,21	29.582.320,11	2,10
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,225100%)	0,36	0,04	0,75	9,41	6.128.609,74	0,43
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>0,54</b>	<b>0,02</b>	<b>0,57</b>	<b>8,42</b>	<b>839.652.274,24</b>	<b>59,52</b>

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,37	0,06	0,94	10,95	174.759.022,78	12,39	7.795.296.699,71	2,24
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	4,95	0,04	0,09	0,14	25.035.160,79	1,77	1.646.050.653,70	1,52
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,34	0,05	0,35	0,93	25.232.921,46	1,79	2.161.431.244,75	1,17
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,80	0,05	0,44	9,29	209.950.601,00	14,88	3.808.125.905,80	5,51
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	5,70	-0,10	-0,84	9,95	30.557.575,67	2,17	231.095.354,15	13,22
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,80	0,05	0,44	9,29	12.730.513,07	0,90	3.536.045.684,72	0,36
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>0,99</b>	<b>0,05</b>	<b>0,55</b>	<b>10,06</b>	<b>478.265.794,77</b>	<b>33,90</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	0,04	0,05	0,97	10,88	868.280,25	0,06	15.592.181.602,05	0,01
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,07	0,05	1,05	11,47	53.142.777,64	3,77	8.965.211.424,43	0,59
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,06</b>	<b>0,05</b>	<b>1,05</b>	<b>11,41</b>	<b>54.011.057,89</b>	<b>3,83</b>		

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Renda Fixa

0,56

0,03

0,59

9,32

1.371.929.126,90

97,25

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### RENTA VARIÁVEL

1,16%

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	26,31	1,76	-8,89	-13,97	9.854.662,35	0,70	95.481.121,01	10,32
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	24,39	1,01	-7,45	-2,95	6.443.176,43	0,46	610.653.217,70	1,06
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>25,24</b>	<b>1,46</b>	<b>-8,32</b>	<b>-9,92</b>	<b>16.297.838,78</b>	<b>1,16</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>25,24</b>	<b>1,46</b>	<b>-8,32</b>	<b>-9,92</b>	<b>16.297.838,78</b>	<b>1,16</b>		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/10/2023

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,60%

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	20,25	0,45	-1,40	14,42	22.530.144,69	1,60	1.935.277.303,73	1,16
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>20,25</b>	<b>0,45</b>	<b>-1,40</b>	<b>14,42</b>	<b>22.530.144,69</b>	<b>1,60</b>		
Investimentos no Exterior			20,25	0,45	-1,40	14,42	22.530.144,69	1,60		
<b>Total</b>			<b>0,90</b>	<b>0,06</b>	<b>0,46</b>	<b>9,38</b>	<b>1.410.757.110,37</b>	<b>100,00</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	839.652.274,24	59,52	0,00	57,40	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	478.265.794,77	33,90	0,00	20,33	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	54.011.057,89	3,83	0,00	22,27	60,00	0,00	60,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>1.371.929.126,90</b>	<b>97,25</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	16.297.838,78	1,16	0,00	0,00	30,00	0,00	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>16.297.838,78</b>	<b>1,16</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	22.530.144,69	1,60	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>22.530.144,69</b>	<b>1,60</b>					10,00
<b>Total</b>		<b>1.410.757.110,37</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	0,57 56,88	8,42 76,38	1,55 49,45	3,60 54,98	10,54 78,58	4.737.558,72	58.691.283,37
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,55 55,51	10,06 91,25	2,32 73,86	5,48 83,69	11,66 86,88	3.700.216,16	65.542.858,14
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,05 105,56	11,41 103,47	3,38 107,59	6,99 106,70	13,89 103,56	562.810,05	12.865.351,82
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-8,32 -5,39	-9,92 -13,03	-19,78 -12,56	1,03 -7,31	-25,47 -22,97	-1.479.675,24	-1.795.612,51
Artigo 9º III % do CDI	-1,40 -140,26	14,42 130,83	-2,16 -68,81	6,20 94,66	16,47 122,72	-319.704,04	2.839.945,53
Artigo 10º I % do CDI	0,00 0,00	12,37 112,22	0,00 0,00	1,22 18,64	13,44 100,16	0,00	6.503.558,98
<b>CONSOLIDADO (Total)</b>						<b>7.201.205,65</b>	<b>144.647.385,33</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%)	31.464.677,16	0,00	0,00	0,00	31.685.068,45	220.391,29	2.634.092,51
NTN-B 150535 (5,784900%)	31.953.732,67	0,00	0,00	0,00	32.181.376,74	227.644,07	2.711.240,86
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.496.371,29	0,00	0,00	0,00	7.550.373,25	54.001,96	641.745,94
NTN-B 150535 (5,909200%)	85.515.770,14	0,00	0,00	0,00	86.133.470,42	617.700,28	7.335.713,44
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.809.343,53	0,00	0,00	0,00	12.902.042,32	92.698,79	1.100.517,34
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.712.965,07	0,00	0,00	0,00	2.733.217,89	20.252,82	238.953,24
NTN-B 150545 (5,900200%)	128.900.755,77	0,00	0,00	0,00	129.830.815,44	930.059,67	11.047.851,24
NTN-B 150832 (5,763300%)	42.462.037,55	0,00	0,00	0,00	42.763.814,76	301.777,21	3.636.661,22
NTN-B 150840	47.082.926,22	0,00	0,00	0,00	46.638.869,23	-444.056,99	-1.947.995,31
NTN-B 150840 (5,347000%)	8.503.588,03	0,00	0,00	0,00	8.561.204,33	57.616,30	168.927,73
NTN-B 150850 (5,674000%)	21.840.665,33	0,00	0,00	0,00	21.994.335,31	153.669,98	274.684,66
NTN-B 150860	23.877.621,10	0,00	0,00	0,00	23.591.452,94	-286.168,16	-1.537.787,30



Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/10/2023

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150860 (5,442000%)	19.099.704,39	0,00	0,00	0,00	19.230.572,08	130.867,69	383.641,90
NTN-B 150860 (5,599600%)	88.816.194,66	0,00	0,00	0,00	89.435.797,86	619.603,20	7.488.362,54
NTN-B 150860 (5,788000%)	73.414.905,96	0,00	0,00	0,00	73.938.031,92	523.125,96	6.298.293,80
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.564.400,46	0,00	0,00	0,00	17.691.500,14	127.099,68	1.525.874,17
NTN-B 150860 (5,949840%)	71.704.160,23	0,00	0,00	0,00	72.224.355,77	520.195,54	6.242.420,03
NTN-B 150860 (5,959200%)	84.243.327,30	0,00	0,00	0,00	84.855.045,54	611.718,24	7.340.178,78
NTN-B 150860 (5,986700%)	29.368.413,41	0,00	0,00	0,00	29.582.320,11	213.906,70	2.565.221,25
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.083.155,25	0,00	0,00	0,00	6.128.609,74	45.454,49	542.685,33
	834.914.715,52	0,00	0,00	0,00	839.652.274,24	4.737.558,72	

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	12.675.248,50	0,00	0,00	0,00	12.730.513,07	55.264,57	1.114.862,25
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	209.038.616,65	0,00	0,00	0,00	209.950.601,00	911.984,35	18.373.836,31
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.816.964,32	0,00	0,00	0,00	30.557.575,67	-259.388,65	2.871.686,58
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	170.062.717,67	273.549.300,89	-271.735.230,40	0,00	174.759.022,78	2.882.234,62	42.914.390,75
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	25.012.194,84	0,00	0,00	0,00	25.035.160,79	22.965,95	35.160,79
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	25.145.766,14	0,00	0,00	0,00	25.232.921,46	87.155,32	232.921,46
	472.751.508,12	273.549.300,89	-271.735.230,40	0,00	478.265.794,77	3.700.216,16	

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	52.588.300,40	0,00	0,00	0,00	53.142.777,64	554.477,24	11.681.516,86
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	859.947,44	0,00	0,00	0,00	868.280,25	8.332,81	1.163.110,51
	53.448.247,84	0,00	0,00	0,00	54.011.057,89	562.810,05	

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	10.815.868,65	0,00	0,00	0,00	9.854.662,35	-961.206,30	-1.600.017,28

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	6.961.645,37	0,00	0,00	0,00	6.443.176,43	-518.468,94	-195.595,23
	17.777.514,02	0,00	0,00	0,00	16.297.838,78	-1.479.675,24	

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	22.849.848,73	0,00	0,00	0,00	22.530.144,69	-319.704,04	2.839.945,53
	22.849.848,73	0,00	0,00	0,00	22.530.144,69	-319.704,04	

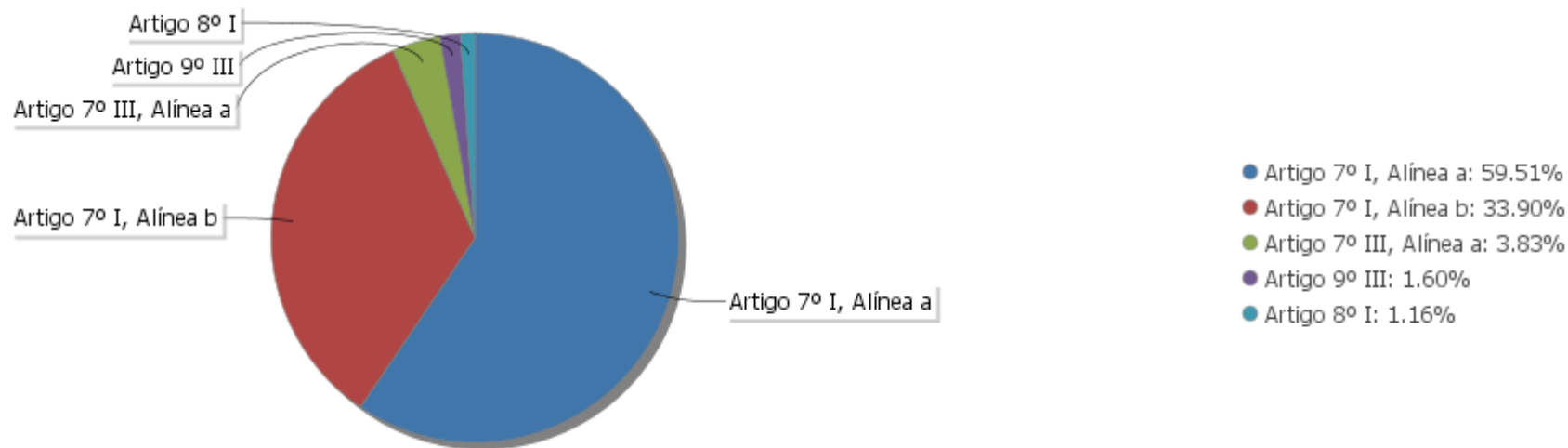
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

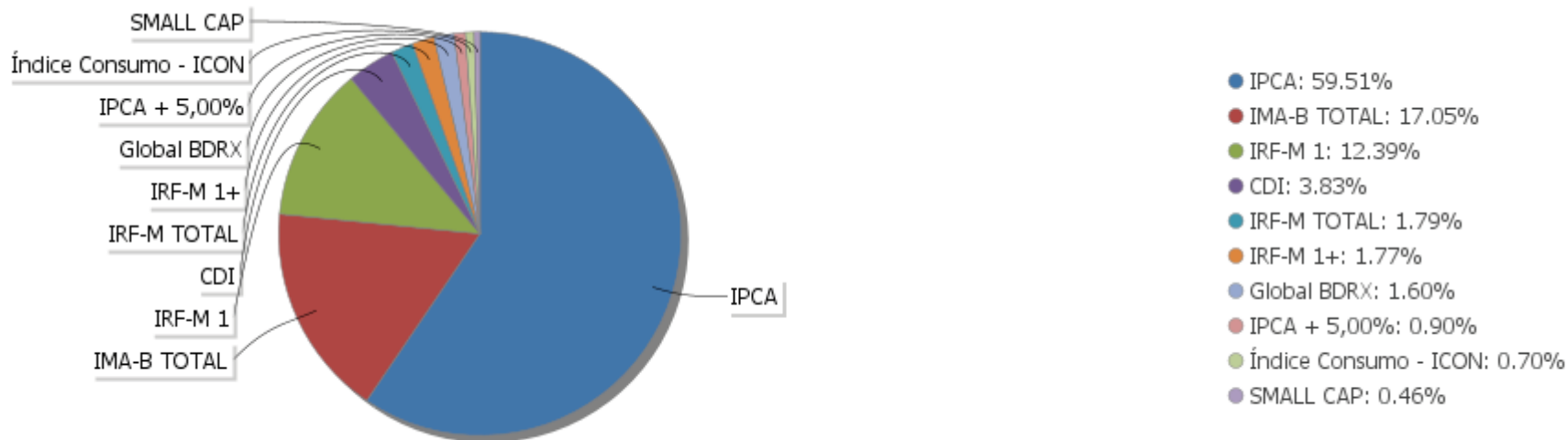
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo P.I.
de 0 a 30 dias	317.866.146,39	22,53	317.866.146,39	22,53	
de 31 dias a 365 dias	222.681.114,07	15,78	540.547.260,46	38,32	
acima de 365 dias	870.209.849,91	61,68	1.410.757.110,37	100,00	

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Alocação por Artigo**

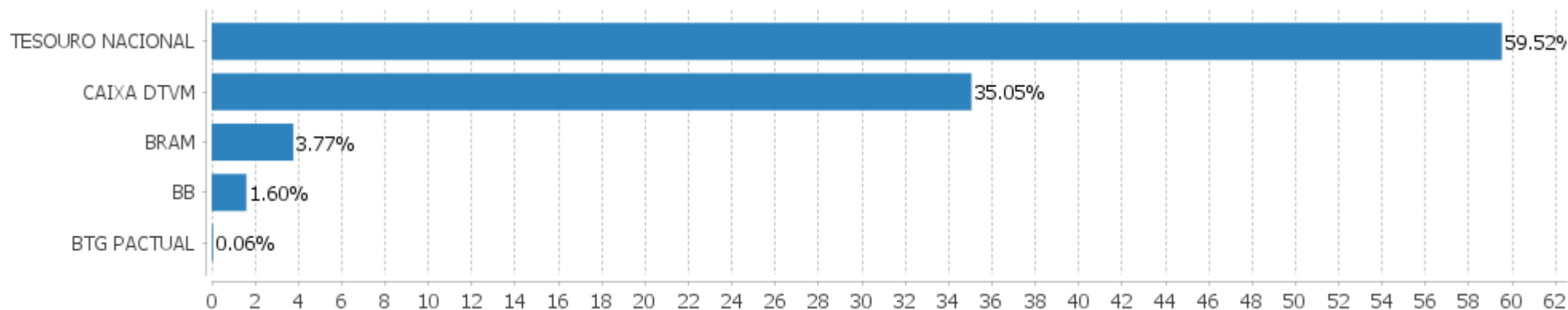


**Alocação Por Estratégia**



### 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	0,46			9,38
IPCA + 4,00%	0,87	1,12	1,07	0,89	0,57	0,25	0,45	0,59	0,57	0,57			7,18
p.p. indexador	0,53	-0,33	0,34	-0,01	0,58	0,66	0,39	0,08	-0,09	-0,11			2,21
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

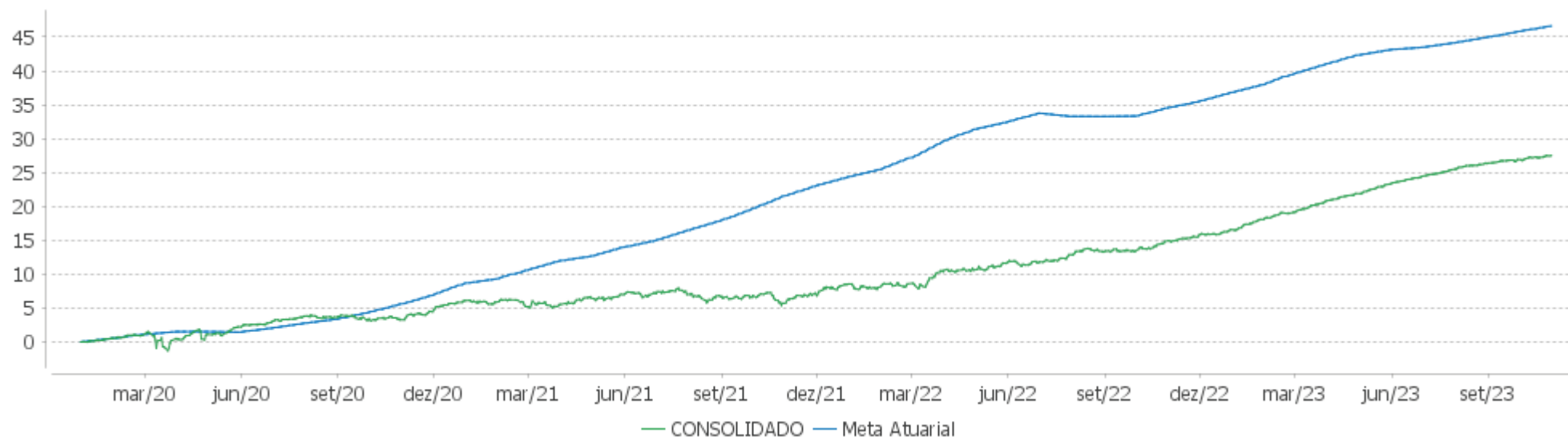
### Performance Sobre a Meta Atuarial

### Relatório

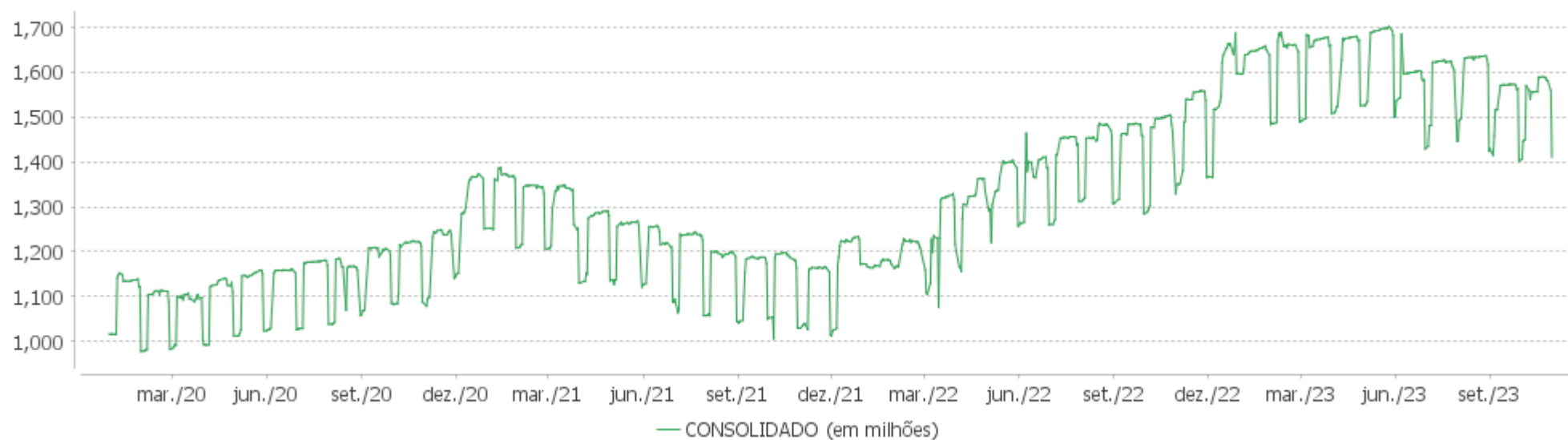
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	19	41,30	03 meses	1,62	1,74	-0,12	0,86
Meses abaixo - Meta Atuarial	27	58,70	06 meses	4,60	3,04	1,57	0,74
			12 meses	10,95	9,00	1,96	0,90
			24 meses	20,62	20,29	0,33	1,82
Maior rentabilidade da Carteira	1,64	2022-03	36 meses	23,50	36,15	-12,66	2,09
Menor rentabilidade da Carteira	-0,80	2021-10	Desde 31/12/2019	27,52	43,49	-15,97	2,46

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Evolução**

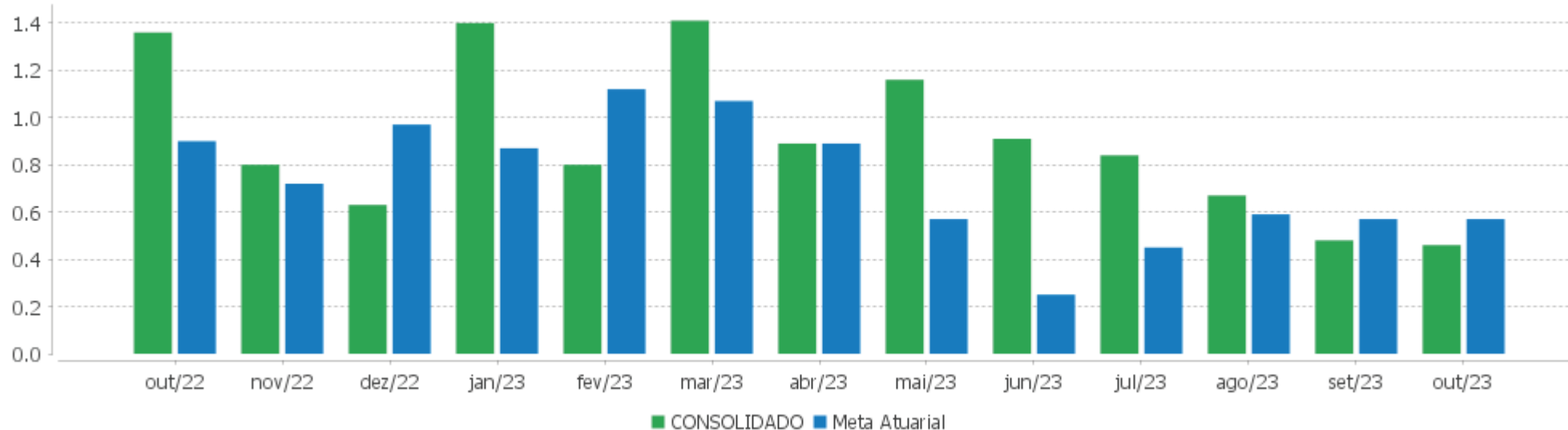


**Patrimônio Líquido**



**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.	0,71 0,47	9,03 5,29	2,16 1,43	4,21 3,20	11,16 6,34	18,68 7,08	30,79 7,28
NTN-B 150535 (6,216000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,51	9,40 5,65	2,27 1,54	4,42 3,42	8,35 3,53	15,90 4,30	
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,47	9,02 5,27	2,16 1,43	4,20 3,19	11,14 6,32	22,06 10,46	34,48 10,97
NTN-B 150535 (5,886400%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,48	9,12 5,37	2,19 1,46	4,26 3,25	11,27 6,45	18,85 7,25	
NTN-B 150860 (6,225100%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,51	9,41 5,66	2,27 1,54	4,43 3,42	11,62 6,80	19,32 7,72	
NTN-B 150840 Var. IPCA p.p.	-0,94 -1,18	11,57 7,83	-4,04 -4,77	4,60 3,59	7,96 3,14	19,59 7,99	18,19 -5,32
NTN-B 150860 Var. IPCA p.p.	-1,20 -1,44	11,70 7,95	-6,33 -7,06	3,82 2,81	7,64 2,82		
NTN-B 150860 (5,959200%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,49	9,18 5,44	2,21 1,47	4,29 3,29	11,34 6,52	22,48 10,87	35,10 11,59
NTN-B 150840 (5,347000%) Var. IPCA p.p.	0,68 0,44	5,75 2,00	2,06 1,32	3,99 2,98	7,74 2,92		
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,48	9,14 5,39	2,19 1,46	4,27 3,27	11,29 6,47	22,36 10,76	34,92 11,41
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,46	8,90 5,16	2,13 1,40	4,13 3,13	11,00 6,18	21,81 10,21	34,17 10,65
NTN-B 150860 (5,986700%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,49	9,21 5,46	2,21 1,48	4,31 3,30	11,37 6,55	19,02 7,42	31,29 7,78
NTN-B 150860 (5,949840%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,49	9,17 5,43	2,20 1,47	4,29 3,29	11,33 6,51	22,46 10,86	35,08 11,57
NTN-B 150860 (5,599600%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,46	8,88 5,13	2,12 1,39	4,11 3,11	10,96 6,15	21,83 10,23	34,34 10,83
NTN-B 150545 (5,900200%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,48	9,13 5,38	2,19 1,46	4,26 3,26	11,28 6,46	22,36 10,76	34,94 11,43
NTN-B 150860 (5,442000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,45	5,87 2,12	2,08 1,35	4,04 3,03	7,87 3,06		
NTN-B 150535 (5,927000%)	0,72	9,16	2,20	4,28	11,22	18,82	31,03

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/10/2023

### 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.	0,48	5,41	1,47	3,27	6,40	7,22	7,52
NTN-B 150860 (5,788000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,47	9,04 5,29	2,16 1,43	4,21 3,21	11,16 6,34	22,17 10,57	34,74 11,23
NTN-B 150860 (5,926400%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,48	9,15 5,41	2,20 1,47	4,28 3,27	11,31 6,49	18,95 7,35	
NTN-B 150850 (5,674000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,46	3,04 -0,71	-0,67 -1,40	1,29 0,29	5,03 0,21		
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	0,09 -0,03	12,66 -0,30	0,46 -0,10	6,89 -0,14	12,72 -0,44	25,93 -0,89	18,07 -1,27
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,44 1,09	9,29 -0,77	2,46 4,42	4,49 0,74	10,16 1,19	23,45 2,05	27,77 4,15
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,84 -0,19	9,95 -0,11	-2,32 -0,35	3,38 -0,37	8,94 -0,03	21,74 0,34	22,15 -1,47
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,44 -0,21	9,29 1,26	2,46 0,47	4,49 0,96	10,17 0,13		
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,94 -0,02	10,95 -0,17	2,99 -0,07	6,48 -0,13	13,26 -0,22	26,00 -0,55	27,96 -0,84
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,35 -0,03	11,88 -0,16	1,23 -0,08	6,56 -0,12	12,79 -0,16	26,15 -0,30	21,72 -0,56
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,05 105,69	11,47 104,02	3,41 108,42	7,05 107,56	13,96 104,06	27,79 105,05	32,52 106,09
BGT PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,97 97,13	10,88 98,70	3,11 98,80	6,50 99,29	13,23 98,57	26,15 98,84	30,25 98,67
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. SMALL CAP p.p.	-7,45 -0,05	-2,95 -0,23	-16,62 0,09	4,98 -0,51	-16,39 -0,15	-17,11 -0,92	-15,20 -2,04
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-8,89 0,01	-13,97 -0,75	-21,72 -0,05	-1,39 0,16	-30,41 -0,85	-41,71 -1,62	-47,69 -2,43
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	-1,40 0,17	14,42 -0,97	-2,16 -0,29	6,20 -0,45	16,47 -1,90	-17,58 -1,45	10,07 -4,78
CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,46 -0,11	9,38 2,21	1,62 -0,12	4,60 1,57	10,95 1,96	20,62 -0,07	23,50 -15,37
CDI	1,00	11,02	3,14	6,55	13,42	26,45	30,65
IBOVESPA	-2,94	3,11	-7,22	8,34	-2,49	9,32	20,43
INPC + 6,00%	0,61	8,14	1,93	3,62	10,36	24,54	46,58
IPCA + 6,00%	0,73	8,88	2,23	4,04	11,08	25,37	47,00

## 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 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 TESOUREO 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	0,96	11,12	3,06	6,61	13,48	26,55	28,80	34,03	43,59
IRF-M 1+	0,12	12,95	0,56	7,03	13,15	26,82	19,34	24,87	47,27
IRF-M TOTAL	0,37	12,04	1,31	6,68	12,95	26,45	22,28	27,70	46,46
IMA-B 5	-0,31	8,55	0,43	3,06	9,21	23,11	28,57	35,91	54,63
IMA-B 5+	-0,98	10,98	-4,11	3,97	8,37	19,37	18,16	11,25	52,40
IMA-B TOTAL	-0,66	10,06	-1,97	3,75	8,97	21,40	23,62	22,38	55,11
IMA-GERAL TOTAL	0,30	10,92	1,11	5,71	11,71	24,89	26,20	29,58	48,76
IDKA 2	-0,41	8,53	0,64	2,92	9,03	22,65	28,32	36,96	53,47
IDKA 20	-1,16	13,95	-7,55	5,69	7,85	15,86	10,01	-4,59	48,02
CDI	1,00	11,02	3,14	6,55	13,42	26,45	30,65	34,86	43,24

#### Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-2,94	3,11	-7,22	8,34	-2,49	9,32	20,43	5,52	29,42
IBRX 100	-3,03	2,31	-7,11	8,24	-3,47	7,90	19,13	5,97	32,25
IBRX 50	-2,99	1,78	-6,48	8,57	-2,99	9,63	22,40	7,19	28,83
SMALL CAP	-7,40	-2,72	-16,71	5,49	-16,24	-16,19	-13,16	-18,52	16,44
Índice Consumo - ICON	-8,90	-13,22	-21,67	-1,55	-29,56	-40,09	-45,26	-46,32	-22,15
Índice Dividendos - IDIV	-3,15	7,18	-4,65	7,57	6,28	23,78	40,83	25,93	75,34

## 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	-1,22	5,87	-2,52	1,73	4,20	-18,39	12,38	74,39	110,39

### Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,97	10,06	-1,30	10,41	5,49	17,94	14,06	13,03	40,73

### Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-2,10	1,94	-3,96	-1,70	4,45	-23,43	1,25	50,47	78,73

### Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,24	3,75	0,73	1,00	4,82	11,60	23,51	28,35	31,61
INPC	0,12	3,04	0,43	0,60	4,14	10,87	23,15	29,03	32,32
IGPM	0,50	-4,46	0,73	-3,74	-4,57	1,65	23,73	49,63	54,34
SELIC	1,00	11,02	3,14	6,55	13,42	26,45	30,65	34,86	43,24

### 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	7,18	1,74	3,04	9,00	20,69	38,87	50,04	59,99
IPCA + 5,00%	0,65	8,03	1,99	3,54	10,04	23,02	42,90	55,86	67,80
IPCA + 5,50%	0,69	8,46	2,11	3,79	10,56	24,19	44,94	58,84	71,82
IPCA + 5,89%	0,72	8,79	2,21	3,98	10,97	25,11	46,55	61,19	75,01
IPCA + 6,00%	0,73	8,88	2,23	4,04	11,08	25,37	47,00	61,85	75,91
INPC + 4,00%	0,45	6,44	1,44	2,62	8,29	19,90	38,47	50,83	60,87
INPC + 6,00%	0,61	8,14	1,93	3,62	10,36	24,54	46,58	62,71	76,88

## 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%)	31.685.068,45	5,634200	31.089.467,58	5,875700	-595.600,87
NTN-B 150535 (5,784900%)	32.181.376,74	5,784900	31.953.063,91	5,875700	-228.312,83
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.550.373,25	5,886400	7.556.467,82	5,875700	6.094,57
NTN-B 150535 (5,909200%)	86.133.470,42	5,909200	86.359.632,18	5,875700	226.161,76
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.902.042,32	5,927000	12.953.944,83	5,875700	51.902,51
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.733.217,89	6,216000	2.806.688,05	5,875700	73.470,16
NTN-B 150545 (5,900200%)	129.830.815,44	5,900200	129.052.340,22	5,952700	-778.475,22
NTN-B 150832 (5,763300%)	42.763.814,76	5,763300	42.451.502,07	5,875800	-312.312,69
NTN-B 150840 (5,347000%)	8.561.204,33	5,347000	8.055.804,69	5,940400	-505.399,64
NTN-B 150850 (5,674000%)	21.994.335,31	5,674000	21.068.534,95	6,006200	-925.800,36
NTN-B 150860 (5,442000%)	19.230.572,08	5,442000	17.693.589,71	6,008700	-1.536.982,37
NTN-B 150860 (5,599600%)	89.435.797,86	5,599600	84.255.189,08	6,008700	-5.180.608,78
NTN-B 150860 (5,788000%)	73.938.031,92	5,788000	71.616.910,72	6,008700	-2.321.121,20
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.691.500,14	5,926400	17.482.951,73	6,008700	-208.548,41
NTN-B 150860 (5,949840%)	72.224.355,77	5,949840	71.616.910,72	6,008700	-607.445,05
NTN-B 150860 (5,959200%)	84.855.045,54	5,959200	84.255.189,08	6,008700	-599.856,46
NTN-B 150860 (5,986700%)	29.582.320,11	5,986700	29.489.316,18	6,008700	-93.003,93
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.128.609,74	6,225100	6.319.139,18	6,008700	190.529,44

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2796	02/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	762.088,34	0,00	231.157,14103289	3,2968410000
2756	02/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.956.410,10	0,00	1.200.060,93712100	3,2968410000
2781	02/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	48.324,11	0,00	14.657,70111449	3,2968410000
2797	03/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	36.707,13	0,00	11.131,35019400	3,2976350000
2782	03/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	21.166,85	0,00	6.418,79710762	3,2976350000
2757	03/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.030.122,44	0,00	312.382,18905300	3,2976350000
2747	03/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	40.534.288,88	0,00	12.291.927,05681496	3,2976350000
2798	04/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	174.000,06	0,00	52.726,07661100	3,3000760000
2783	04/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.558,53	0,00	6.229,71410355	3,3000760000
2758	04/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	164.783,91	0,00	49.933,36820100	3,3000760000
2799	05/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.665,60	0,00	3.230,52277000	3,3015090000
2759	05/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.992.867,36	0,00	603.623,17958200	3,3015090000
2784	05/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	36.098,11	0,00	10.933,82147376	3,3015090000
2801	06/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.414.812,16	1.639.324,12013100	3,3030760000
2800	06/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.950.530,43	0,00	7.250.977,70381305	3,3030760000
2761	06/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.573.577,07	1.687.389,89656914	3,3030760000
2760	06/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	112.776.902,79	0,00	34.142.993,61867500	3,3030760000
2748	06/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.812.800,51	0,00	3.879.051,07542182	3,3030760000
2749	06/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	20.378.547,20	6.169.566,54913900	3,3030760000
2802	09/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.886.225,22	0,00	1.175.847,80945229	3,3050410000
2803	09/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.835.854,47	2.370.879,65446800	3,3050410000
2762	09/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.226,79	0,00	3.396,86860163	3,3050410000
2763	09/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.311.073,96	2.514.665,91763700	3,3050410000
2785	10/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.725,77	0,00	521,86484800	3,3069290000
2765	10/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	35.389.144,80	10.701.513,33697500	3,3069290000
2764	10/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.949.056,84	0,00	4.520.525,49056800	3,3069290000
2804	11/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.122.003,97	0,00	1.548.575,23932300	3,3075590000
2767	11/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.183,82	2.171,93970100	3,3075590000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2786	11/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.314,60	0,00	397,45322700	3,3075590000
2766	11/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.394.479,27	0,00	3.444.981,41076200	3,3075590000
2750	11/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	35.354,05	10.688,86448100	3,3075590000
2787	13/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.910,23	0,00	879,60543500	3,3085630000
2768	16/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.302,03	3.716,02414300	3,3105350000
2751	16/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.525,29	762,80413000	3,3105350000
2805	17/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.247,76	1.282,68766029	3,3116090000
2806	18/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.237.332,34	0,00	3.090.007,96246500	3,3130440000
2769	18/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	22.777.621,16	0,00	6.875.133,91310200	3,3130440000
2788	18/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	56.732,63	0,00	17.124,01948178	3,3130440000
2752	18/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.617,45	488,20655600	3,3130440000
2789	19/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.987,36	0,00	2.711,64676083	3,3143550000
2753	19/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.525,29	0,00	761,92502000	3,3143550000
2790	20/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	34.708,66	0,00	10.465,74199100	3,3164070000
2770	20/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	295.716,94	0,00	89.167,86751445	3,3164070000
2808	23/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	41.536,08	12.519,12556777	3,3178100000
2807	23/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.576.305,01	0,00	776.507,69935500	3,3178100000
2773	23/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	144,20	43,46188800	3,3178100000
2772	23/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.576.305,01	776.507,69891800	3,3178100000
2791	23/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.104,66	0,00	4.854,00309200	3,3178100000
2771	23/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	42.112,11	0,00	12.692,74310400	3,3178100000
2792	24/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.311,15	0,00	3.708,64464200	3,3195820000
2775	24/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.309.967,15	997.103,59534400	3,3195820000
2774	24/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	52.390,46	0,00	15.782,24607797	3,3195820000
2793	25/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	35.283,13	0,00	10.623,78486900	3,3211450000
2809	26/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.754.473,88	828.856,16679300	3,3232230000
2776	26/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.754.473,89	828.856,17058000	3,3232230000
2794	26/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.186,74	0,00	1.560,75592800	3,3232230000
2754	26/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.754.473,89	828.856,17000500	3,3232230000
2811	30/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.023,88	1.510,97668800	3,3249220000



Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/10/2023

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2810	30/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.727,35	0,00	8.640,00719400	3,3249220000
2778	30/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	22.786.849,91	6.853.348,71314274	3,3249220000
2777	30/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	59.644,85	0,00	17.938,72157001	3,3249220000
2812	31/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	878.535,95	0,00	264.071,94907100	3,3268810000
2813	31/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	31.113.903,11	9.352.274,13003350	3,3268810000
2780	31/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	90.548.217,45	27.217.149,47123146	3,3268810000
2779	31/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.728.877,54	0,00	820.251,02190310	3,3268810000
2795	31/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	883,62643500	3,3268810000
2755	31/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	30.123.621,89	9.054.613,58143000	3,3268810000
<b>Total</b>			<b>273.549.300,89</b>	<b>271.735.230,40</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 5.481.125,15

Value-At-Risk: 0,39%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	Limite <sup>(5)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		0,39		0,39			1.410.757.110,37	100,00

#### Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,33%

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%)		0,05	0,00	0,06			31.685.068,45	2,25
NTN-B 150535 (5,784900%)		0,05	0,00	0,06			32.181.376,74	2,28
NTN-B 150535 (5,886400%)		0,05	0,00	0,06			7.550.373,25	0,54
NTN-B 150535 (5,909200%)		0,05	0,00	0,06			86.133.470,42	6,11
NTN-B 150535 (5,927000%)		0,05	0,00	0,06			12.902.042,32	0,91
NTN-B 150535 (6,216000%)		0,05	0,00	0,06			2.733.217,89	0,19
NTN-B 150545 (5,900200%)		0,05	0,00	0,06			129.830.815,44	9,20
NTN-B 150832 (5,763300%)		0,05	0,00	0,06			42.763.814,76	3,03
NTN-B 150840		3,28	0,10	3,29			46.638.869,23	3,31
NTN-B 150840 (5,347000%)		0,05	0,00	0,06			8.561.204,33	0,61
NTN-B 150850 (5,674000%)		0,18	-0,00	0,19			21.994.335,31	1,56
NTN-B 150860		4,74	0,07	4,75			23.591.452,94	1,67
NTN-B 150860 (5,442000%)		0,05	0,00	0,06			19.230.572,08	1,36
NTN-B 150860 (5,599600%)		0,05	0,00	0,06			89.435.797,86	6,34
NTN-B 150860 (5,788000%)		0,05	0,00	0,06			73.938.031,92	5,24
NTN-B 150860 (5,926400%)		0,05	0,00	0,06			17.691.500,14	1,25
NTN-B 150860 (5,949840%)		0,05	0,00	0,06			72.224.355,77	5,12
NTN-B 150860 (5,959200%)		0,05	0,00	0,06			84.855.045,54	6,01
NTN-B 150860 (5,986700%)		0,05	0,00	0,06			29.582.320,11	2,10
NTN-B 150860 (6,225100%)		0,05	0,00	0,06			6.128.609,74	0,43

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/10/2023

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
<b>Sub-total</b>	0,93	0,31	0,17		-0,46	0,57	839.652.274,24	59,52

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		0,12	0,01	0,01			174.759.022,78	12,39
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP		1,85	0,03	0,02			25.035.160,79	1,77
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,28	0,02	0,02			25.232.921,46	1,79
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,43	0,03	1,89			209.950.601,00	14,88
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		2,08	0,04	0,45			30.557.575,67	2,17
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		0,43	0,00	0,44			12.730.513,07	0,90
<b>Sub-total</b>	1,10	0,45	0,13		-0,41	0,55	478.265.794,77	33,90

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 TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI		0,02	0,00	0,02			868.280,25	0,06
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,02	-0,00	0,02			53.142.777,64	3,77
<b>Sub-total</b>	0,03	0,02	-0,00		1,70	1,05	54.011.057,89	3,83

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,90%

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		6,90	0,01	0,71			22.530.144,69	1,60
<b>Sub-total</b>	16,49	6,90	0,01		-0,15	-1,40	22.530.144,69	1,60

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,72%

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		9,63	0,05	0,62			9.854.662,35	0,70

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/10/2023

### 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
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		10,17	0,04	0,44			6.443.176,43	0,46
<b>Sub-total</b>	26,70	9,72	0,08		-0,35	-8,32	16.297.838,78	1,16

(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 (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)