

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS **CONSOLIDADO**

Período: 4º trimestre de 2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENTA FIXA 97,45%

Artigo 7º I, Alínea 4 (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Trim.		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,634200%)	0,37	0,23	0,94	2,34	31.303.756,49	1,80
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	0,37	0,23	0,96	2,38	31.791.439,42	1,82
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,886400%)	0,37	0,24	0,97	2,40	7.458.453,95	0,43
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	0,37	0,24	0,97	2,41	85.083.672,26	4,88
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	0,37	0,24	0,97	2,41	12.744.662,52	0,73
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,216000%)	0,37	0,24	1,00	2,49	2.699.406,81	0,15
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	0,41	0,30	1,03	2,47	128.346.811,59	7,36
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	0,36	0,22	0,94	2,36	43.464.226,13	2,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840	7,18	0,10	4,30	6,59	50.183.497,97	2,88
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,347000%)	2,75	0,25	0,95	2,30	8.698.963,97	0,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,674000%)	3,98	0,32	1,03	2,44	22.373.257,54	1,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860	9,64	0,10	5,08	8,48	25.901.547,53	1,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,442000%)	2,72	0,34	1,04	2,41	19.560.054,59	1,12
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	0,44	0,35	1,06	2,45	90.992.839,04	5,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	0,44	0,35	1,08	2,50	75.249.466,11	4,32

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/12/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Trim.		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,926400%)	0,45	0,36	1,09	2,53	18.009.507,13	1,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	0,45	0,35	1,09	2,54	73.525.513,79	4,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	0,44	0,35	1,09	2,54	86.385.195,96	4,96
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	0,45	0,35	1,10	2,55	30.117.152,08	1,73
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,225100%)	0,45	0,36	1,12	2,61	6.241.907,10	0,36
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,61	0,29	1,34	2,87	850.131.331,98	48,77

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,35	0,04	0,89	2,83	473.498.556,55	27,17	8.470.280.308,74	5,59
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	3,89	0,04	1,71	5,00	26.263.466,44	1,51	1.537.705.344,55	1,71
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,63	0,04	1,46	4,33	26.233.609,41	1,51	2.351.648.712,32	1,12
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,38	0,10	0,92	2,16	213.555.017,19	12,25	3.886.422.398,07	5,49
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	4,76	0,10	2,31	4,19	32.107.256,06	1,84	242.814.999,95	13,22
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,38	0,10	0,92	2,16	12.949.090,84	0,74	3.596.758.160,15	0,36
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,81	0,06	0,97	2,70	784.606.996,49	45,02		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,05	0,04	0,89	2,79	9.608.181,44	0,55	16.847.897.691,64	0,06
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,07	0,04	0,94	3,01	54.171.604,20	3,11	10.327.922.782,38	0,52
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,07	0,04	0,93	3,00	63.779.785,64	3,66		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

0,56

0,17

1,15

2,79

1.698.518.114,11

97,45

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

1,14%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	24,26	-0,01	6,06	12,11	12.125.484,80	0,70	117.523.076,84	10,32
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	22,12	-0,01	6,93	11,06	7.731.372,90	0,44	702.099.612,74	1,10
Sub-total Artigo 8º I			23,06	-0,01	6,40	11,70	19.856.857,70	1,14		
Renda Variável			23,06	-0,01	6,40	11,70	19.856.857,70	1,14		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,41%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	15,18	-0,00	2,59	7,65	24.597.330,60	1,41	1.995.875.754,00	1,23
Sub-total Artigo 9º III			15,18	-0,00	2,59	7,65	24.597.330,60	1,41		
Investimentos no Exterior			15,18	-0,00	2,59	7,65	24.597.330,60	1,41		
Total			0,81	0,17	1,23	2,98	1.742.972.302,41	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	850.131.331,98	48,77	0,00	57,40	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	784.606.996,49	45,02	0,00	20,33	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	63.779.785,64	3,66	0,00	22,27	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	1.698.518.114,11	97,45					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	19.856.857,70	1,14	0,00	0,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	19.856.857,70	1,14					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	24.597.330,60	1,41	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	24.597.330,60	1,41					10,00
Total		1.742.972.302,41	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre (R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	1,34 149,69	2,87 101,18	2,87 101,18	4,38 71,19	10,90 83,58	11.255.151,30	23.825.263,43
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,97 108,72	2,70 95,31	2,70 95,31	5,63 91,54	12,41 95,14	7.329.557,51	17.742.809,32
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,93 103,85	3,00 105,60	3,00 105,60	6,60 107,37	13,55 103,85	588.182,08	1.719.047,41
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	6,40 1,01	11,70 -3,42	11,70 -3,42	0,10 -13,53	9,75 -12,54	1.193.636,94	2.079.343,68
Artigo 9º III % do CDI	2,59 288,79	7,65 269,47	7,65 269,47	9,07 147,55	24,92 191,01	620.631,91	1.747.481,87
Artigo 10º I % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	12,37 94,82	0,00	0,00
CONSOLIDADO (Total)						20.987.159,74	47.113.945,71

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
NTN-B 150535 (5,634200%)	31.011.361,49	0,00	0,00	0,00	31.303.756,49	292.395,00	724.540,16
NTN-B 150535 (5,784900%)	31.489.971,32	0,00	0,00	0,00	31.791.439,42	301.468,10	747.763,72
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.387.019,07	0,00	0,00	0,00	7.458.453,95	71.434,88	177.298,83
NTN-B 150535 (5,909200%)	84.266.937,60	0,00	0,00	0,00	85.083.672,26	816.734,66	2.027.515,54
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.622.106,49	0,00	0,00	0,00	12.744.662,52	122.556,03	304.261,00
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.672.715,49	0,00	0,00	0,00	2.699.406,81	26.691,32	66.379,18
NTN-B 150545 (5,900200%)	127.034.538,03	0,00	0,00	0,00	128.346.811,59	1.312.273,56	3.135.475,95
NTN-B 150832 (5,763300%)	43.058.087,88	0,00	0,00	0,00	43.464.226,13	406.138,25	1.002.188,58
NTN-B 150840	48.112.719,39	0,00	0,00	0,00	50.183.497,97	2.070.778,58	3.100.571,75
NTN-B 150840 (5,347000%)	8.617.424,83	0,00	0,00	0,00	8.698.963,97	81.539,14	195.375,94
NTN-B 150850 (5,674000%)	22.144.199,95	0,00	0,00	0,00	22.373.257,54	229.057,59	532.592,21

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
NTN-B 150860	24.650.122,20	0,00	0,00	0,00	25.901.547,53	1.251.425,33	2.023.926,43
NTN-B 150860 (5,442000%)	19.358.229,14	0,00	0,00	0,00	19.560.054,59	201.825,45	460.350,20
NTN-B 150860 (5,599600%)	90.040.193,30	0,00	0,00	0,00	90.992.839,04	952.645,74	2.176.644,38
NTN-B 150860 (5,788000%)	74.448.228,67	0,00	0,00	0,00	75.249.466,11	801.237,44	1.834.560,15
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.815.408,57	0,00	0,00	0,00	18.009.507,13	194.098,56	445.106,67
NTN-B 150860 (5,949840%)	72.731.549,11	0,00	0,00	0,00	73.525.513,79	793.964,68	1.821.353,56
NTN-B 150860 (5,959200%)	85.451.549,82	0,00	0,00	0,00	86.385.195,96	933.646,14	2.141.868,66
NTN-B 150860 (5,986700%)	29.790.901,80	0,00	0,00	0,00	30.117.152,08	326.250,28	748.738,67
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.172.916,53	0,00	0,00	0,00	6.241.907,10	68.990,57	158.751,85
	838.876.180,68	0,00	0,00	0,00	850.131.331,98	11.255.151,30	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	12.830.643,81	0,00	0,00	0,00	12.949.090,84	118.447,03	273.842,34
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	211.601.906,79	0,00	0,00	0,00	213.555.017,19	1.953.110,40	4.516.400,54
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	31.382.443,15	0,00	0,00	0,00	32.107.256,06	724.812,91	1.290.291,74
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	151.074.850,70	912.295.331,98	-593.586.020,00	0,00	473.498.556,55	3.714.393,87	9.323.159,83
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	25.822.325,21	0,00	0,00	0,00	26.263.466,44	441.141,23	1.251.271,60
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	25.855.957,34	0,00	0,00	0,00	26.233.609,41	377.652,07	1.087.843,27
	458.568.127,00	912.295.331,98	-593.586.020,00	0,00	784.606.996,49	7.329.557,51	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	53.668.347,07	0,00	0,00	0,00	54.171.604,20	503.257,13	1.583.303,80
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	9.523.256,49	0,00	0,00	0,00	9.608.181,44	84.924,95	135.743,61
	63.191.603,56	0,00	0,00	0,00	63.779.785,64	588.182,08	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB AÇÕES CONSUMO FIC	11.432.774,24	0,00	0,00	0,00	12.125.484,80	692.710,56	1.309.616,15
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	7.230.446,52	0,00	0,00	0,00	7.731.372,90	500.926,38	769.727,53
	18.663.220,76	0,00	0,00	0,00	19.856.857,70	1.193.636,94	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	23.976.698,69	0,00	0,00	0,00	24.597.330,60	620.631,91	1.747.481,87
	23.976.698,69	0,00	0,00	0,00	24.597.330,60	620.631,91	

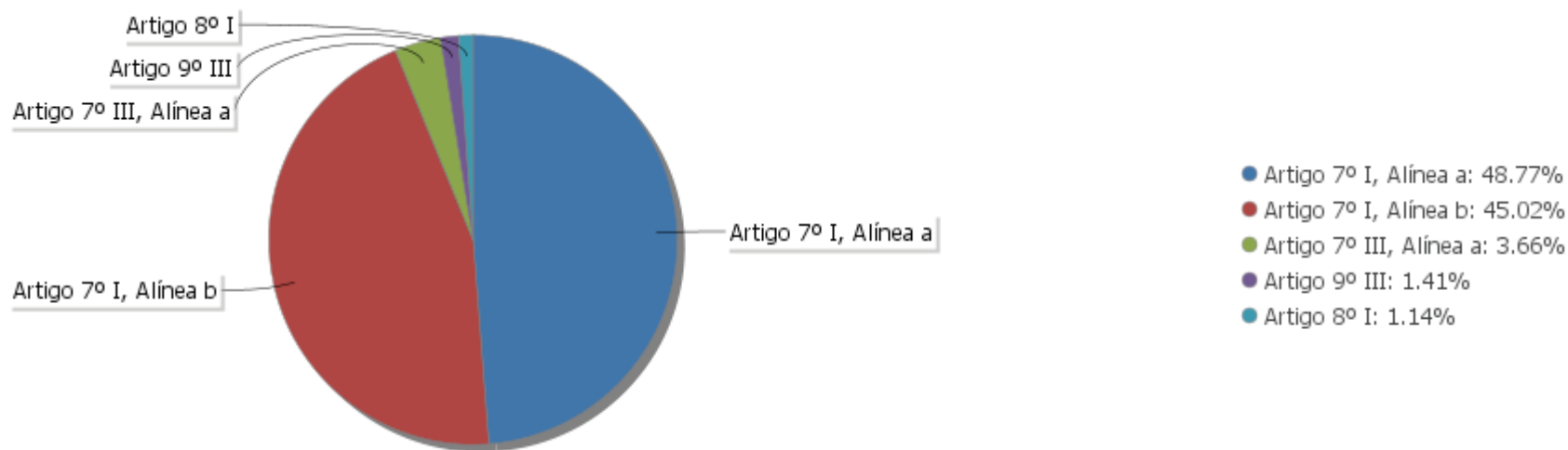
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

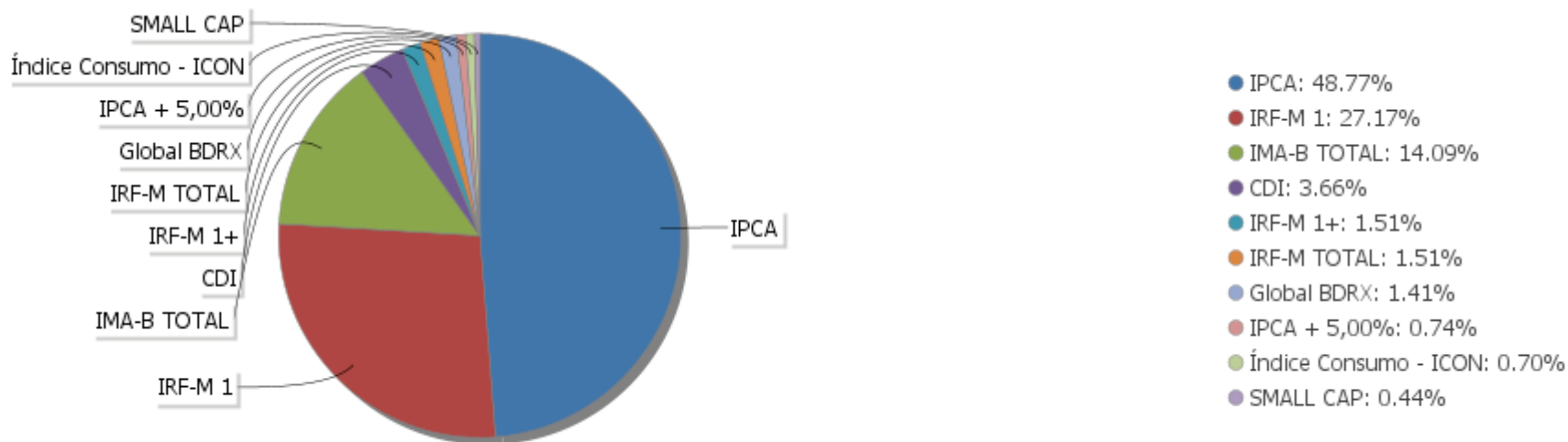
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo P.I.
de 0 a 30 dias	634.229.606,34	36,39	634.229.606,34	36,39	
de 31 dias a 365 dias	226.504.108,03	13,00	860.733.714,37	49,38	
acima de 365 dias	882.238.588,04	50,62	1.742.972.302,41	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

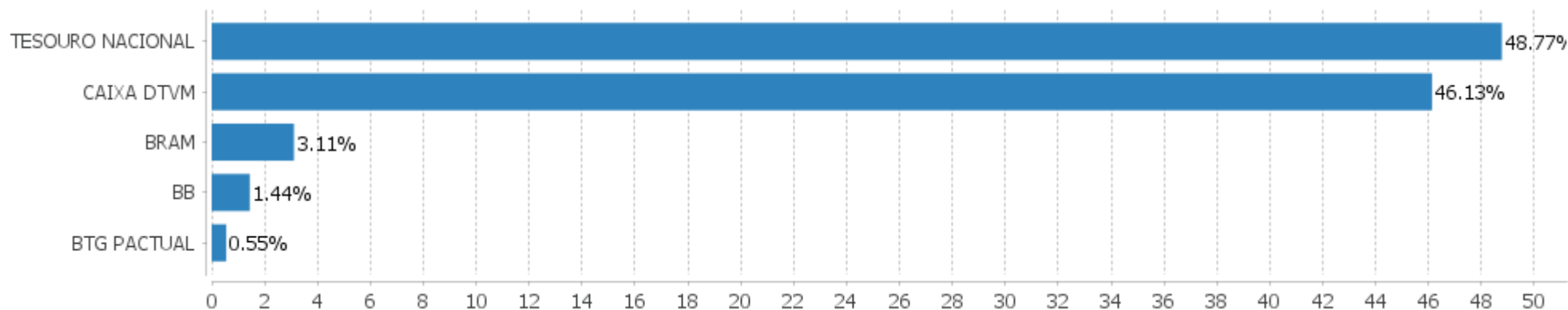


Alocação Por Estratégia



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	1,26	1,23	12,13
IPCA + 4,00%	0,87	1,12	1,07	0,89	0,57	0,25	0,45	0,59	0,57	0,57	0,59	0,87	8,75
p.p. indexador	0,53	-0,33	0,34	-0,01	0,58	0,66	0,39	0,08	-0,09	-0,11	0,66	0,36	3,37
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

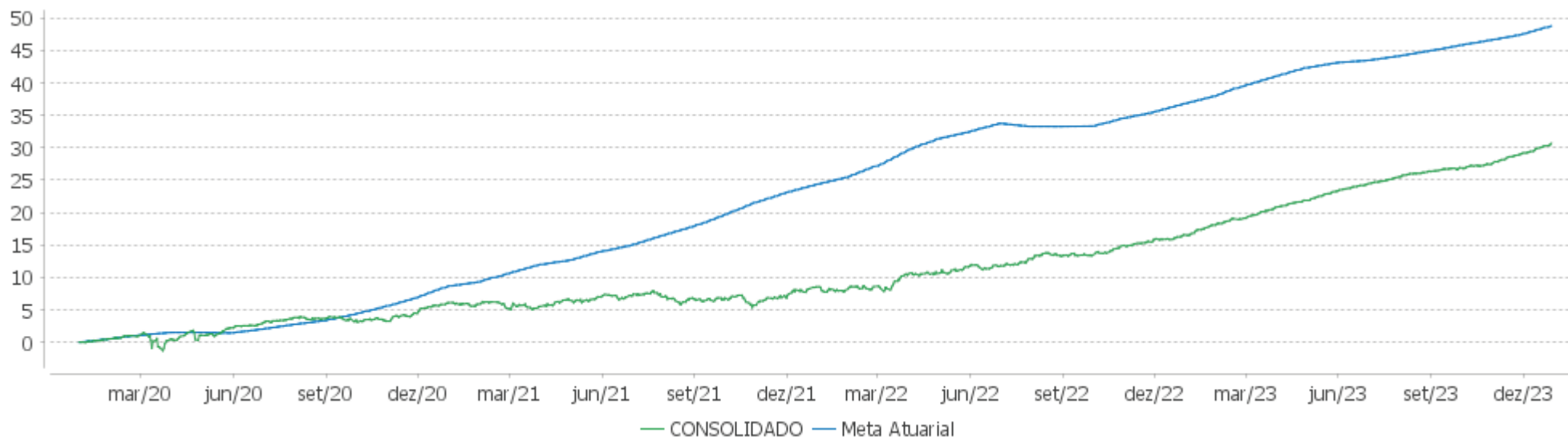
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

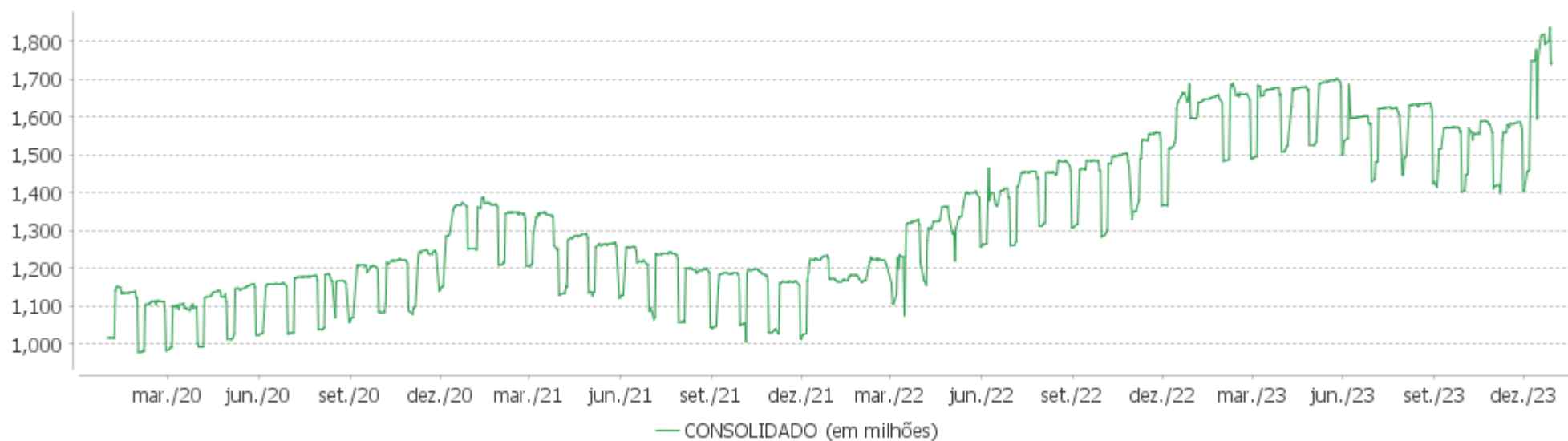
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	21	43,75	03 meses	2,98	2,05	0,93	0,91
Meses abaixo - Meta Atuarial	27	56,25	06 meses	5,04	3,70	1,34	0,80
			12 meses	12,13	8,75	3,37	0,81
			24 meses	20,41	19,63	0,78	1,65
Maior rentabilidade da Carteira	1,64	2022-03	36 meses	23,20	34,29	-11,08	2,06
Menor rentabilidade da Carteira	-0,80	2021-10	48 meses	30,71	45,60	-14,89	2,42
			Desde 31/12/2019	30,71	45,60	-14,89	2,42

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

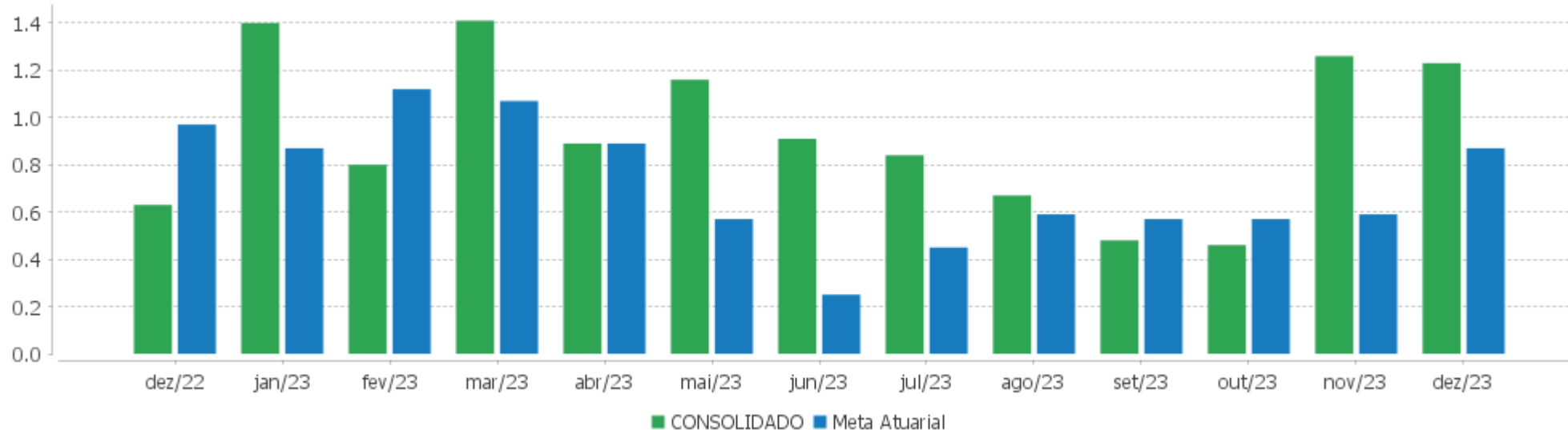


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150535 (5,784900%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,40	2,38 1,29	2,38 1,29	4,34 2,64	10,84 6,22	20,51 9,84	32,91 11,10
NTN-B 150535 (6,216000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,44	2,49 1,40	2,49 1,40	4,56 2,86	11,29 6,67	17,83 7,16	
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	0,94 0,38	2,36 1,28	2,36 1,28	4,32 2,62	10,80 6,18	20,45 9,77	32,80 10,99
NTN-B 150535 (5,886400%) Var. IPCA p.p.	0,97 0,41	2,40 1,32	2,40 1,32	4,40 2,69	10,94 6,32	20,72 10,05	
NTN-B 150860 (6,225100%) Var. IPCA p.p.	1,12 0,56	2,61 1,53	2,61 1,53	4,69 2,99	11,43 6,81	17,90 7,22	
NTN-B 150840 Var. IPCA p.p.	4,30 3,74	6,59 5,50	6,59 5,50	4,02 2,32	20,05 15,43	23,75 13,08	15,57 -6,24
NTN-B 150860 Var. IPCA p.p.	5,08 4,52	8,48 7,39	8,48 7,39	3,65 1,95	22,64 18,01		
NTN-B 150860 (5,959200%) Var. IPCA p.p.	1,09 0,53	2,54 1,46	2,54 1,46	4,56 2,85	11,15 6,53	21,02 10,34	33,59 11,78
NTN-B 150840 (5,347000%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,39	2,30 1,21	2,30 1,21	4,15 2,45	7,45 2,83		
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	0,97 0,41	2,41 1,33	2,41 1,33	4,41 2,71	10,97 6,35	24,30 13,62	37,15 15,34
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	0,94 0,38	2,34 1,26	2,34 1,26	4,27 2,57	10,68 6,06	23,65 12,98	36,28 14,47
NTN-B 150860 (5,986700%) Var. IPCA p.p.	1,10 0,54	2,55 1,47	2,55 1,47	4,57 2,87	11,18 6,56	17,60 6,93	29,82 8,01
NTN-B 150860 (5,949840%) Var. IPCA p.p.	1,09 0,53	2,54 1,46	2,54 1,46	4,55 2,85	11,14 6,52	21,00 10,33	33,57 11,76
NTN-B 150860 (5,599600%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,50	2,45 1,37	2,45 1,37	4,37 2,67	10,77 6,15	20,37 9,70	32,83 11,02
NTN-B 150545 (5,900200%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,47	2,47 1,39	2,47 1,39	4,47 2,77	11,03 6,41	24,36 13,68	37,24 15,43
NTN-B 150535 (5,927000%) Var. IPCA p.p.	0,97 0,41	2,41 1,33	2,41 1,33	4,42 2,72	10,99 6,37	20,71 10,03	33,20 11,39
NTN-B 150860 (5,788000%)	1,08	2,50	2,50	4,47	10,97	20,71	33,23

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/12/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,52	1,42	1,42	2,77	6,35	10,04	11,42
NTN-B 150860 (5,442000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,48	2,41 1,33	2,41 1,33	4,29 2,59	7,68 3,06		
NTN-B 150860 (5,926400%) Var. IPCA p.p.	1,09 0,53	2,53 1,45	2,53 1,45	4,54 2,84	11,12 6,50	17,53 6,86	
NTN-B 150850 (5,674000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,47	2,44 1,35	2,44 1,35	1,51 -0,19	4,81 0,19		
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	1,71 -0,02	5,00 -0,05	5,00 -0,05	6,24 -0,14	18,18 -0,33	26,41 -0,89	19,70 -1,26
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,92 -1,83	2,16 -2,60	2,16 -2,60	5,32 1,11	11,17 -4,89	21,23 -2,22	24,81 2,93
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,31 -0,44	4,19 -0,57	4,19 -0,57	3,36 -0,85	15,52 -0,53	22,22 -1,23	18,75 -3,13
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,92 -0,03	2,16 -0,12	2,16 -0,12	5,32 1,13	11,17 1,38		
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,89 -0,03	2,83 -0,07	2,83 -0,07	6,04 -0,12	13,02 -0,23	26,29 -0,57	29,70 -0,87
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,46 -0,02	4,33 -0,05	4,33 -0,05	6,17 -0,11	16,32 -0,19	26,46 -0,33	23,70 -0,56
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,94 104,62	3,01 106,08	3,01 106,08	6,66 108,27	13,63 104,43	28,40 105,03	34,74 106,51
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,89 99,49	2,79 98,17	2,79 98,17	6,06 98,62	12,88 98,69	26,72 98,85	32,16 98,61
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. SMALL CAP p.p.	6,93 -0,12	11,06 -0,43	11,06 -0,43	3,02 -0,38	16,46 -0,66	-1,39 -0,87	-18,28 -1,65
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. Índice Consumo - ICON p.p.	6,06 0,08	12,11 -0,21	12,11 -0,21	-1,67 -0,39	5,86 -1,13	-22,36 -2,22	-43,53 -2,54
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	2,59 -0,25	7,65 -0,12	7,65 -0,12	9,07 -0,65	24,92 -1,41	-10,73 -1,62	16,51 -4,97
CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,00% p.p.	1,23 0,36	2,98 0,93	2,98 0,93	5,04 1,34	12,13 3,37	20,41 0,78	23,20 -13,71
CDI	0,90	2,84	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62
IBOVESPA	5,38	15,12	15,12	13,63	22,28	28,01	12,74
INPC + 6,00%	1,02	2,20	2,20	3,95	9,85	23,32	43,97
IPCA + 6,00%	1,03	2,52	2,52	4,68	10,82	24,24	44,91

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 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 Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,91	2,89	2,89	6,16	13,25	26,86	30,57	35,59	44,75
IRF-M 1+	1,73	5,05	5,05	6,37	18,52	27,30	20,95	31,18	49,86
IRF-M TOTAL	1,48	4,38	4,38	6,28	16,51	26,79	24,26	32,58	48,53
IMA-B 5	1,46	2,97	2,97	4,75	12,13	23,09	28,71	39,06	57,35
IMA-B 5+	3,94	6,42	6,42	3,80	19,28	23,21	15,14	21,47	58,36
IMA-B TOTAL	2,75	4,76	4,76	4,21	16,05	23,45	21,89	29,69	59,46
IMA-GERAL TOTAL	1,63	3,81	3,81	5,67	14,80	25,89	27,10	33,88	51,04
IDKA 2	1,45	2,89	2,89	5,00	12,13	22,60	28,70	39,79	56,32
IDKA 20	6,58	10,28	10,28	3,92	27,13	24,70	6,62	8,97	57,20
CDI	0,90	2,84	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62	36,29	44,42

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	5,38	15,12	15,12	13,63	22,28	28,01	12,74	16,03	52,68
IBRX 100	5,48	14,95	14,95	13,77	21,27	26,15	12,05	15,97	54,69
IBRX 50	5,31	14,43	14,43	14,39	20,06	26,93	13,55	17,66	51,96
SMALL CAP	7,05	11,48	11,48	3,40	17,12	-0,52	-16,63	-17,18	31,02
Índice Consumo - ICON	5,98	12,32	12,32	-1,29	6,98	-20,15	-40,99	-40,51	-7,65
Índice Dividendos - IDIV	6,90	14,61	14,61	16,04	26,84	42,88	33,72	32,38	92,17

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	2,43	7,54	7,54	7,67	15,27	-13,18	18,31	77,33	137,73

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	4,25	2,86	2,86	4,95	15,50	18,06	15,37	3,56	40,82

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	2,70	7,01	7,01	6,95	11,43	-16,44	4,80	54,48	99,34

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,56	1,08	1,08	1,70	4,62	10,67	21,81	27,31	32,79
INPC	0,55	0,77	0,77	0,99	3,71	9,86	21,02	27,61	33,33
IGPM	0,74	1,84	1,84	1,34	-3,18	2,10	20,25	48,08	58,89
SELIC	0,90	2,84	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62	36,29	44,42

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,87	2,05	2,05	3,70	8,75	19,63	36,91	48,80	61,44
IPCA + 5,00%	0,95	2,28	2,28	4,19	9,79	21,92	40,87	54,57	69,32
IPCA + 5,50%	0,99	2,40	2,40	4,44	10,30	23,08	42,88	57,51	73,37
IPCA + 5,89%	1,02	2,49	2,49	4,63	10,71	23,98	44,46	59,84	76,59
IPCA + 6,00%	1,03	2,52	2,52	4,68	10,82	24,24	44,91	60,50	77,50
INPC + 4,00%	0,86	1,73	1,73	2,98	7,80	18,75	36,03	49,15	62,09
INPC + 6,00%	1,02	2,20	2,20	3,95	9,85	23,32	43,97	60,89	78,22

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%)	31.303.756,49	5,634200	32.039.079,33	5,342800	735.322,84
NTN-B 150535 (5,784900%)	31.791.439,42	5,784900	32.929.053,75	5,342800	1.137.614,33
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.458.453,95	5,886400	7.787.276,23	5,342800	328.822,28
NTN-B 150535 (5,909200%)	85.083.672,26	5,909200	88.997.442,58	5,342800	3.913.770,32
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.744.662,52	5,927000	13.349.616,39	5,342800	604.953,87
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.699.406,81	6,216000	2.892.416,88	5,342800	193.010,07
NTN-B 150545 (5,900200%)	128.346.811,59	5,900200	134.898.753,63	5,477000	6.551.942,04
NTN-B 150832 (5,763300%)	43.464.226,13	5,763300	44.704.324,06	5,322500	1.240.097,93
NTN-B 150840 (5,347000%)	8.698.963,97	5,347000	8.668.058,74	5,381900	-30.905,23
NTN-B 150850 (5,674000%)	22.373.257,54	5,674000	22.969.806,66	5,471800	596.549,12
NTN-B 150860 (5,442000%)	19.560.054,59	5,442000	19.426.160,64	5,488100	-133.893,95
NTN-B 150860 (5,599600%)	90.992.839,04	5,599600	92.505.526,88	5,488100	1.512.687,84
NTN-B 150860 (5,788000%)	75.249.466,11	5,788000	78.629.697,85	5,488100	3.380.231,74
NTN-B 150860 (5,926400%)	18.009.507,13	5,926400	19.194.896,83	5,488100	1.185.389,70
NTN-B 150860 (5,949840%)	73.525.513,79	5,949840	78.629.697,85	5,488100	5.104.184,06
NTN-B 150860 (5,959200%)	86.385.195,96	5,959200	92.505.526,88	5,488100	6.120.330,92
NTN-B 150860 (5,986700%)	30.117.152,08	5,986700	32.376.934,41	5,488100	2.259.782,33
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.241.907,10	6,225100	6.937.914,52	5,488100	696.007,42

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

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
2814	01/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.942,05	0,00	583,38039500	3,3289600000
2827	01/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.951.908,91	0,00	1.187.130,18780600	3,3289600000
2848	01/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	722.775,57	0,00	217.117,52919831	3,3289600000
2828	06/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	739.249,95	0,00	221.845,35434640	3,3322760000
2849	06/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.355,14	0,00	9.109,43151100	3,3322760000
2830	07/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	74.387.631,42	22.311.726,67928000	3,3340150000
2829	07/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.468.312,22	0,00	8.838.686,15468100	3,3340150000
2864	07/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	18.719.786,20	5.614.787,63452600	3,3340150000
2863	07/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	48.781.136,67	0,00	14.631.348,89015100	3,3340150000
2851	07/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.832.725,96	3.849.030,66122978	3,3340150000
2850	07/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.979.241,72	0,00	1.493.467,10197700	3,3340150000
2832	08/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.904,41	1.470,33943300	3,3355630000
2831	08/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	50.843.412,02	0,00	15.242.827,67856500	3,3355630000
2865	08/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.461.328,25	0,00	1.337.503,81869500	3,3355630000
2852	08/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.788.652,04	0,00	3.834.031,02864400	3,3355630000
2833	09/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	53.448.059,17	0,00	16.016.693,67777600	3,3370220000
2866	09/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.211.898,10	363.167,54876800	3,3370220000
2853	09/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.880.974,61	0,00	5.358.362,81870482	3,3370220000
2835	10/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.891,77	1.465,15493500	3,3387390000
2834	10/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.103.736,38	0,00	4.523.784,69236400	3,3387390000
2854	10/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.489.767,74	0,00	1.644.263,81936414	3,3387390000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2815	13/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	71.456,55	0,00	21.392,92125300	3,3401960000
2836	13/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.102,10	0,00	629,33432600	3,3401960000
2816	14/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	107.999,67	0,00	32.312,17667155	3,3423830000
2837	14/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.159.673,60	0,00	4.535.588,41102200	3,3423830000
2867	14/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	539.834,60	161.511,89136613	3,3423830000
2856	14/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	493,50	147,64900400	3,3423830000
2855	14/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.082.800,09	0,00	623.148,24183823	3,3423830000
2857	16/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.546,03	0,00	761,37488400	3,3439900000
2817	17/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.337,20	0,00	698,54743200	3,3458000000
2838	17/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.546,24	0,00	2.554,31884700	3,3458000000
2870	17/11/2023	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	8.608.646,95	0,00	2.128.259,20516036	4,0449241000
2818	20/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.227,73	0,00	5.445,80820719	3,3471120000
2839	21/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	358.313,22	0,00	107.016,99126991	3,3481900000
2819	21/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	60.179,58	0,00	17.973,76492971	3,3481900000
2847	21/11/2023	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	3.843,44	0,00	949,34266967	4,0485276000
2820	22/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.289,88	0,00	683,58320200	3,3498190000
2821	23/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.645,92	0,00	7.055,73500472	3,3513050000
2822	24/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.039,57	0,00	4.783,74449586	3,3529320000
2858	24/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	54.048,86	0,00	16.119,87955616	3,3529320000
2840	27/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.666,68	0,00	4.372,24157765	3,3544990000
2823	27/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.130,90	0,00	3.020,09331300	3,3544990000
2841	28/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.372.508,56	2.792.810,05679700	3,3559420000
2824	28/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	22.549,02	0,00	6.719,13280900	3,3559420000
2859	28/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.790,06	1.427,33640900	3,3559420000
2843	29/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.457.789,30	3.710.530,06571000	3,3574150000
2842	29/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.438,69	0,00	1.024,20761211	3,3574150000
2825	29/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.220,66	0,00	1.554,96416100	3,3574150000
2860	29/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.778,12	0,00	1.125,30622500	3,3574150000
2826	30/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	61.344,50	0,00	18.261,29175915	3,3592640000
2845	30/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	101.584.085,90	30.239.982,89484200	3,3592640000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2844	30/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.649.369,45	0,00	788.675,57000500	3,3592640000
2868	30/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	33.236.345,29	9.893.936,67481925	3,3592640000
2869	30/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	32.471.281,42	9.666.189,20692152	3,3592640000
2861	30/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	986.706,37	0,00	293.726,95030816	3,3592640000
2880	01/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	239.555,08	0,00	71.278,39880300	3,3608370000
2900	01/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	33.250,09	9.893,39533500	3,3608370000
2899	01/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.337.039,70	0,00	397.829,38000200	3,3608370000
2881	04/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	118.139,21	0,00	35.137,82781600	3,3621660000
2923	04/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.942,05	0,00	577,61871300	3,3621660000
2901	04/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.312.062,82	0,00	985.097,94578800	3,3621660000
2871	04/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	46.104.276,65	0,00	13.712.671,13224000	3,3621660000
2924	05/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.695,21	0,00	1.693,25529400	3,3634680000
2882	06/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	537.967,15	0,00	159.865,66600800	3,3651200000
2902	06/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.533.906,83	0,00	1.050.157,74474600	3,3651200000
2884	07/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.958.528,98	4.146.018,48749600	3,3667310028
2883	07/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	46.259.099,46	0,00	13.740.064,01461800	3,3667310000
2904	07/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	38.915.054,55	11.558.706,22060700	3,3667310000
2925	07/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.368,04	0,00	703,36477700	3,3667310000
2903	07/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	171.013.827,22	0,00	50.795.215,66172000	3,3667310000
2873	07/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	22.717.235,09	6.747.564,65367600	3,3667310000
2872	07/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.552.515,43	0,00	4.322.446,73839400	3,3667310000
2885	08/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.819.931,42	0,00	2.024.880,57538000	3,3680660000
2906	08/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.021.284,38	2.678.476,12743400	3,3680660000
2905	08/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	131.826.577,37	0,00	39.140.140,77218203	3,3680660000
2926	08/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.697,54	0,00	2.879,26067900	3,3680660000
2874	08/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	109.923,32	0,00	32.636,92576000	3,3680660000
2907	11/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.327,04	0,00	3.955,04668300	3,3696290000
2927	11/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	74.825,65	0,00	22.205,90159900	3,3696290000
2928	12/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	88.709,07	0,00	26.313,03136000	3,3712980000
2909	12/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	326.423,86	96.824,38621300	3,3712980000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2908	12/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	120.157,18	0,00	35.641,22186700	3,3712980000
2887	13/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.125,37	630,11314700	3,3729970000
2886	13/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.216.492,31	0,00	1.546.545,19704500	3,3729970000
2929	13/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	124.797,45	0,00	36.998,98043100	3,3729970000
2911	13/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.223.492,15	2.734.509,44389300	3,3729970000
2910	13/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.182.815,46	0,00	8.651.894,87568400	3,3729970000
2888	14/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	24.641.365,45	7.301.880,91622700	3,3746600000
2912	14/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	134.187.009,53	39.763.119,69850100	3,3746600000
2875	14/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	24.573.966,19	7.281.908,75311300	3,3746600000
2889	15/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.860.474,64	0,00	5.882.643,37045400	3,3761140000
2930	15/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.864,20	0,00	3.514,15858500	3,3761140000
2913	15/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	86.388.922,45	0,00	25.588.271,73786100	3,3761140000
2876	15/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	52.065.461,07	0,00	15.421.712,97237000	3,3761140000
2890	18/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.256.545,17	0,00	5.109.043,41691100	3,3776470000
2914	18/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	38.945.664,21	0,00	11.530.412,80216600	3,3776470000
2931	18/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.570,00	0,00	1.056,94881600	3,3776470000
2891	19/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	536.276,00	0,00	158.710,98303700	3,3789470000
2915	19/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.979.080,98	0,00	881.659,57619341	3,3789470000
2892	20/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.067,93	3.865,83388400	3,3803650000
2916	20/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	23.260,57	6.881,08127400	3,3803650000
2932	20/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.577,79	0,00	762,57741300	3,3803650000
2877	20/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.196,41	945,58082400	3,3803650000
2933	21/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	53.312,65	0,00	15.764,94630900	3,3817210000
2894	22/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.103,67	1.508,55378200	3,3831540000
2893	22/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.849,14	0,00	1.433,31932200	3,3831540000
2918	22/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	31.398.995,97	9.280.983,35789500	3,3831540000
2934	22/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.802,29	0,00	4.079,71082600	3,3831540000
2917	22/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.306.451,95	0,00	1.272.910,41140800	3,3831540000
2895	26/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.298.302,42	0,00	679.023,71129513	3,3847160000
2919	26/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.508.130,46	0,00	1.922.799,56723100	3,3847160000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/12/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2935	26/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	868,52781700	3,3847160000
2896	27/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.351.438,31	0,00	1.285.026,30332400	3,3862640000
2920	27/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.269.803,50	0,00	8.643.686,22765300	3,3862640000
2936	27/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.949,58	0,00	871,04254100	3,3862640000
2898	28/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	37.394.155,99	11.038.604,55073900	3,3875799987
2897	28/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	25.522.216,90	0,00	7.534.055,84517500	3,3875800000
2922	28/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	205.785.502,81	60.747.053,29587300	3,3875800000
2921	28/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	113.813.727,77	0,00	33.597.354,97611800	3,3875800000
2879	28/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	41.363.001,01	12.210.191,64418257	3,3875800000
2878	28/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	47.491.322,12	0,00	14.019.247,40375100	3,3875800000
Total			1.464.875.386,33	1.162.150.216,89		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 6.865.146,24

Value-At-Risk: 0,39%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		0,39		0,39			1.742.972.302,41	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,30%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,634200%)		0,08	0,00	0,08			31.303.756,49	1,80
NTN-B 150535 (5,784900%)		0,08	0,00	0,08			31.791.439,42	1,82
NTN-B 150535 (5,886400%)		0,08	0,00	0,08			7.458.453,95	0,43
NTN-B 150535 (5,909200%)		0,08	0,00	0,08			85.083.672,26	4,88
NTN-B 150535 (5,927000%)		0,08	0,00	0,08			12.744.662,52	0,73
NTN-B 150535 (6,216000%)		0,08	0,00	0,08			2.699.406,81	0,15
NTN-B 150545 (5,900200%)		0,08	0,00	0,09			128.346.811,59	7,36
NTN-B 150832 (5,763300%)		0,08	0,00	0,08			43.464.226,13	2,49
NTN-B 150840		3,43	0,09	3,41			50.183.497,97	2,88
NTN-B 150840 (5,347000%)		0,08	0,00	0,09			8.698.963,97	0,50
NTN-B 150850 (5,674000%)		0,15	0,00	0,15			22.373.257,54	1,28
NTN-B 150860		4,98	0,07	4,97			25.901.547,53	1,49
NTN-B 150860 (5,442000%)		0,08	0,00	0,09			19.560.054,59	1,12
NTN-B 150860 (5,599600%)		0,08	0,00	0,09			90.992.839,04	5,22
NTN-B 150860 (5,788000%)		0,08	0,00	0,09			75.249.466,11	4,32
NTN-B 150860 (5,926400%)		0,08	0,00	0,09			18.009.507,13	1,03
NTN-B 150860 (5,949840%)		0,08	0,00	0,09			73.525.513,79	4,22
NTN-B 150860 (5,959200%)		0,08	0,00	0,09			86.385.195,96	4,96
NTN-B 150860 (5,986700%)		0,08	0,00	0,09			30.117.152,08	1,73
NTN-B 150860 (6,225100%)		0,08	0,00	0,09			6.241.907,10	0,36

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/12/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	0,95	0,36	0,16		0,47	1,34	850.131.331,98	48,77

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		0,09	0,02	0,02			473.498.556,55	27,17
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP		1,96	0,03	0,02			26.263.466,44	1,51
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,35	0,02	0,02			26.233.609,41	1,51
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,36	0,01	2,14			213.555.017,19	12,25
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		2,24	0,04	0,51			32.107.256,06	1,84
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		0,36	0,00	0,36			12.949.090,84	0,74
Sub-total	0,36	0,29	0,11		0,22	0,97	784.606.996,49	45,02

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI		0,02	-0,00	0,02			9.608.181,44	0,55
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,03	-0,00	0,02			54.171.604,20	3,11
Sub-total	0,03	0,03	-0,00		1,25	0,93	63.779.785,64	3,66

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,24%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		6,24	0,01	0,59			24.597.330,60	1,41
Sub-total	8,58	6,24	0,01		0,20	2,59	24.597.330,60	1,41

Renda Variável

Value-At-Risk: 11,55%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		12,25	0,07	0,43			12.125.484,80	0,70

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/12/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		10,77	0,04	0,41			7.731.372,90	0,44
Sub-total	17,60	11,55	0,11		0,31	6,40	19.856.857,70	1,14

(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 (%)