

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

CONSOLIDADO

Período: novembro de 2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA **96,96%**

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%)	0,33	0,04	0,68	9,64	31.011.361,49	2,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	0,33	0,04	0,69	9,79	31.489.971,32	2,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,886400%)	0,49	0,04	0,70	9,88	7.387.019,07	0,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	0,33	0,04	0,70	9,90	84.266.937,60	6,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	0,50	0,04	0,70	9,92	12.622.106,49	0,90
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,216000%)	0,51	0,04	0,72	10,19	2.672.715,49	0,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	0,33	0,04	0,70	9,89	127.034.538,03	9,05
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	0,33	0,04	0,69	9,77	43.058.087,88	3,07
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840	7,43	0,16	3,16	-1,01	48.112.719,39	3,43
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,347000%)	2,73	0,03	0,66	2,68	8.617.424,83	0,61
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,674000%)	3,96	0,04	0,68	1,95	22.144.199,95	1,58
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860	9,92	0,31	4,49	-1,95	24.650.122,20	1,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,442000%)	2,69	0,04	0,66	2,71	19.358.229,14	1,38
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	0,33	0,04	0,68	9,61	90.040.193,30	6,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	0,33	0,04	0,69	9,79	74.448.228,67	5,31

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/11/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,926400%)	0,33	0,04	0,70	9,92	17.815.408,57	1,27
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	0,33	0,04	0,70	9,94	72.731.549,11	5,18
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	0,33	0,04	0,70	9,95	85.451.549,82	6,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	0,33	0,04	0,71	9,98	29.790.901,80	2,12
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,225100%)	0,33	0,04	0,72	10,20	6.172.916,53	0,44
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,54	0,05	0,94	9,44	838.876.180,68	59,78

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,35	0,06	0,97	12,03	151.074.850,70	10,77	8.126.749.358,76	1,86
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	4,14	0,14	3,14	3,29	25.822.325,21	1,84	1.641.347.327,61	1,57
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,80	0,11	2,47	3,42	25.855.957,34	1,84	2.261.375.933,67	1,14
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,49	0,04	0,79	10,15	211.601.906,79	15,08	3.840.674.276,65	5,51
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	4,99	0,03	2,70	12,92	31.382.443,15	2,24	237.333.514,41	13,22
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,49	0,04	0,79	10,15	12.830.643,81	0,91	3.563.858.141,47	0,36
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,85	0,05	1,15	11,33	458.568.127,00	32,68		

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	0,90	11,88	9.523.256,49	0,68	16.350.404.530,22	0,06
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,07	0,05	0,99	12,57	53.668.347,07	3,82	10.247.341.113,60	0,52
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,07	0,05	0,98	12,50	63.191.603,56	4,50		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

0,55

0,05

1,03

10,44

1.360.635.911,24

96,96

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/11/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

1,33%

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	25,40	0,74	16,01	-0,19	11.432.774,24	0,81	111.264.550,26	10,28
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	23,16	1,11	12,22	8,91	7.230.446,52	0,52	682.494.682,59	1,06
Sub-total Artigo 8º I			24,19	0,88	14,51	3,15	18.663.220,76	1,33		
Renda Variável			24,19	0,88	14,51	3,15	18.663.220,76	1,33		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,71%

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	16,34	0,20	6,42	21,77	23.976.698,69	1,71	1.957.059.984,27	1,23
Sub-total Artigo 9º III			16,34	0,20	6,42	21,77	23.976.698,69	1,71		
Investimentos no Exterior			16,34	0,20	6,42	21,77	23.976.698,69	1,71		
Total			0,85	0,06	1,26	10,76	1.403.275.830,69	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	838.876.180,68	59,78	0,00	57,40	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	458.568.127,00	32,68	0,00	20,33	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	63.191.603,56	4,50	0,00	22,27	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	1.360.635.911,24	96,96					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	18.663.220,76	1,33	0,00	0,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	18.663.220,76	1,33					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	23.976.698,69	1,71	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	23.976.698,69	1,71					10,00
Total		1.403.275.830,69	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	0,94 102,09	9,44 78,35	1,94 66,32	3,47 54,83	10,38 78,04	7.832.553,41	66.523.836,78
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,15 125,70	11,33 94,07	2,53 86,69	5,78 91,32	12,58 94,61	6.713.035,65	72.255.893,79
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,98 107,18	12,50 103,82	3,11 106,71	6,81 107,49	13,81 103,85	568.055,28	13.433.407,10
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	14,51 1,97	3,15 -12,89	1,20 -8,81	2,62 -14,91	-1,44 -14,64	2.365.381,98	569.769,47
Artigo 9º III % do CDI	6,42 699,58	21,77 180,76	1,18 40,45	6,82 107,65	15,93 119,78	1.446.554,00	4.286.499,53
Artigo 10º I % do CDI	0,00 0,00	12,37 102,72	0,00 0,00	0,00 0,00	6,89 51,78	0,00	6.503.558,98
CONSOLIDADO (Total)						18.925.580,32	163.572.965,65

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%)	31.685.068,45	0,00	0,00	885.460,83	31.011.361,49	211.753,87	2.845.846,38
NTN-B 150535 (5,784900%)	32.181.376,74	0,00	0,00	910.056,97	31.489.971,32	218.651,55	2.929.892,41
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.550.373,25	0,00	0,00	215.216,17	7.387.019,07	51.861,99	693.607,93
NTN-B 150535 (5,909200%)	86.133.470,42	0,00	0,00	2.459.613,42	84.266.937,60	593.080,60	7.928.794,04
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.902.042,32	0,00	0,00	368.942,01	12.622.106,49	89.006,18	1.189.523,52
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.733.217,89	0,00	0,00	79.937,44	2.672.715,49	19.435,04	258.388,28
NTN-B 150545 (5,900200%)	129.830.815,44	0,00	0,00	3.689.420,13	127.034.538,03	893.142,72	11.940.993,96
NTN-B 150832 (5,763300%)	42.763.814,76	0,00	0,00	0,00	43.058.087,88	294.273,12	3.930.934,34
NTN-B 150840	46.638.869,23	0,00	0,00	0,00	48.112.719,39	1.473.850,16	-474.145,15
NTN-B 150840 (5,347000%)	8.561.204,33	0,00	0,00	0,00	8.617.424,83	56.220,50	225.148,23
NTN-B 150850 (5,674000%)	21.994.335,31	0,00	0,00	0,00	22.144.199,95	149.864,64	424.549,30
NTN-B 150860	23.591.452,94	0,00	0,00	0,00	24.650.122,20	1.058.669,26	-479.118,04

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/11/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150860 (5,442000%)	19.230.572,08	0,00	0,00	0,00	19.358.229,14	127.657,06	511.298,96
NTN-B 150860 (5,599600%)	89.435.797,86	0,00	0,00	0,00	90.040.193,30	604.395,44	8.092.757,98
NTN-B 150860 (5,788000%)	73.938.031,92	0,00	0,00	0,00	74.448.228,67	510.196,75	6.808.490,55
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.691.500,14	0,00	0,00	0,00	17.815.408,57	123.908,43	1.649.782,60
NTN-B 150860 (5,949840%)	72.224.355,77	0,00	0,00	0,00	72.731.549,11	507.193,34	6.749.613,37
NTN-B 150860 (5,959200%)	84.855.045,54	0,00	0,00	0,00	85.451.549,82	596.504,28	7.936.683,06
NTN-B 150860 (5,986700%)	29.582.320,11	0,00	0,00	0,00	29.790.901,80	208.581,69	2.773.802,94
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.128.609,74	0,00	0,00	0,00	6.172.916,53	44.306,79	586.992,12
	839.652.274,24	0,00	0,00	8.608.646,97	838.876.180,68	7.832.553,41	

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	12.730.513,07	0,00	0,00	0,00	12.830.643,81	100.130,74	1.214.992,99
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	209.950.601,00	0,00	0,00	0,00	211.601.906,79	1.651.305,79	20.025.142,10
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.557.575,67	0,00	0,00	0,00	31.382.443,15	824.867,48	3.696.554,06
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	174.759.022,78	270.418.263,07	-296.828.966,49	0,00	151.074.850,70	2.726.531,34	45.640.922,09
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	25.035.160,79	0,00	0,00	0,00	25.822.325,21	787.164,42	822.325,21
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	25.232.921,46	0,00	0,00	0,00	25.855.957,34	623.035,88	855.957,34
	478.265.794,77	270.418.263,07	-296.828.966,49	0,00	458.568.127,00	6.713.035,65	

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	53.142.777,64	0,00	0,00	0,00	53.668.347,07	525.569,43	12.207.086,29
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	868.280,25	8.612.490,39	0,00	0,00	9.523.256,49	42.485,85	1.205.596,36
	54.011.057,89	8.612.490,39	0,00	0,00	63.191.603,56	568.055,28	

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	9.854.662,35	0,00	0,00	0,00	11.432.774,24	1.578.111,89	-21.905,39

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	6.443.176,43	0,00	0,00	0,00	7.230.446,52	787.270,09	591.674,86
	16.297.838,78	0,00	0,00	0,00	18.663.220,76	2.365.381,98	

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	22.530.144,69	0,00	0,00	0,00	23.976.698,69	1.446.554,00	4.286.499,53
	22.530.144,69	0,00	0,00	0,00	23.976.698,69	1.446.554,00	

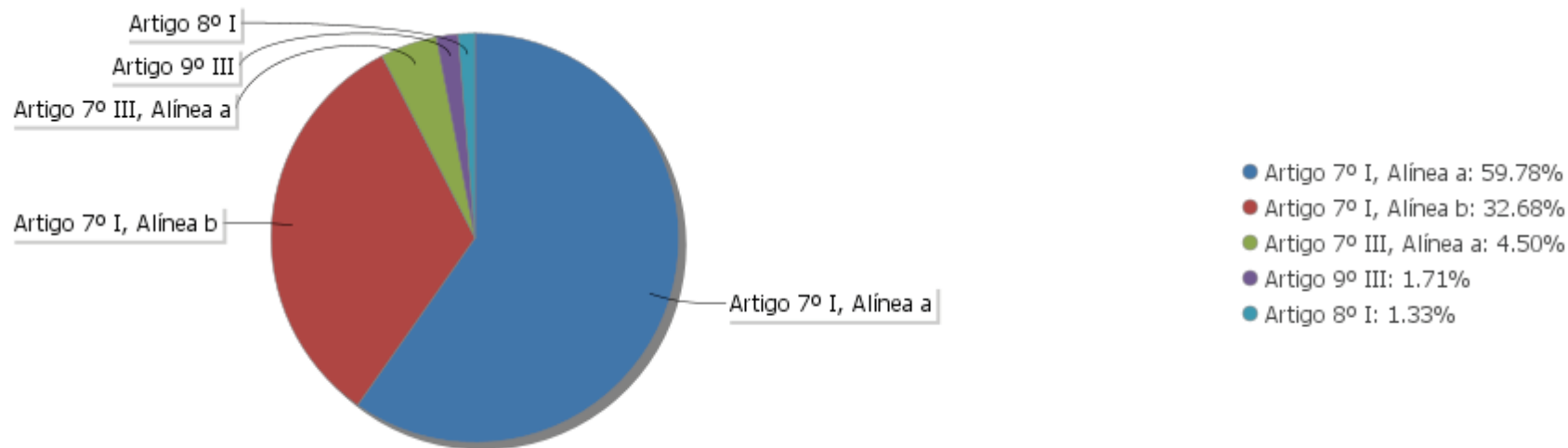
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

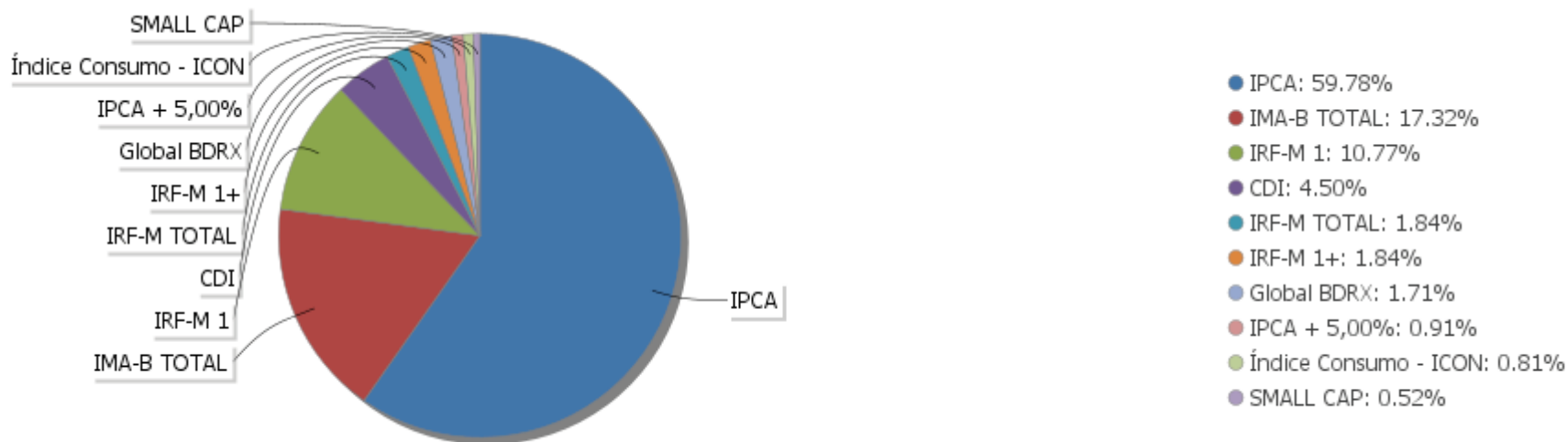
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo P.I.
de 0 a 30 dias	308.584.656,26	21,99	308.584.656,26	21,99	
de 31 dias a 365 dias	224.432.550,60	15,99	533.017.206,86	37,98	
acima de 365 dias	870.258.623,83	62,02	1.403.275.830,69	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

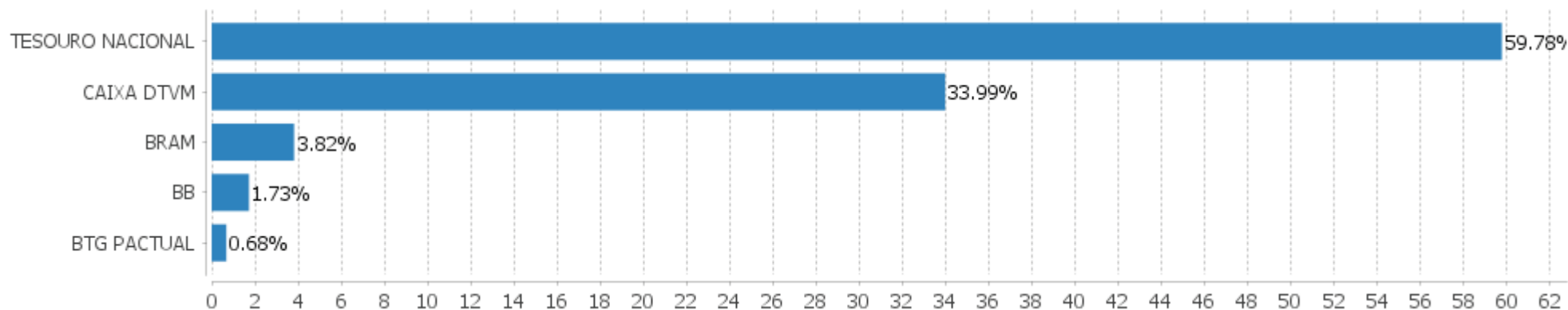


Alocação Por Estratégia



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		10,76
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		7,81
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		2,95
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

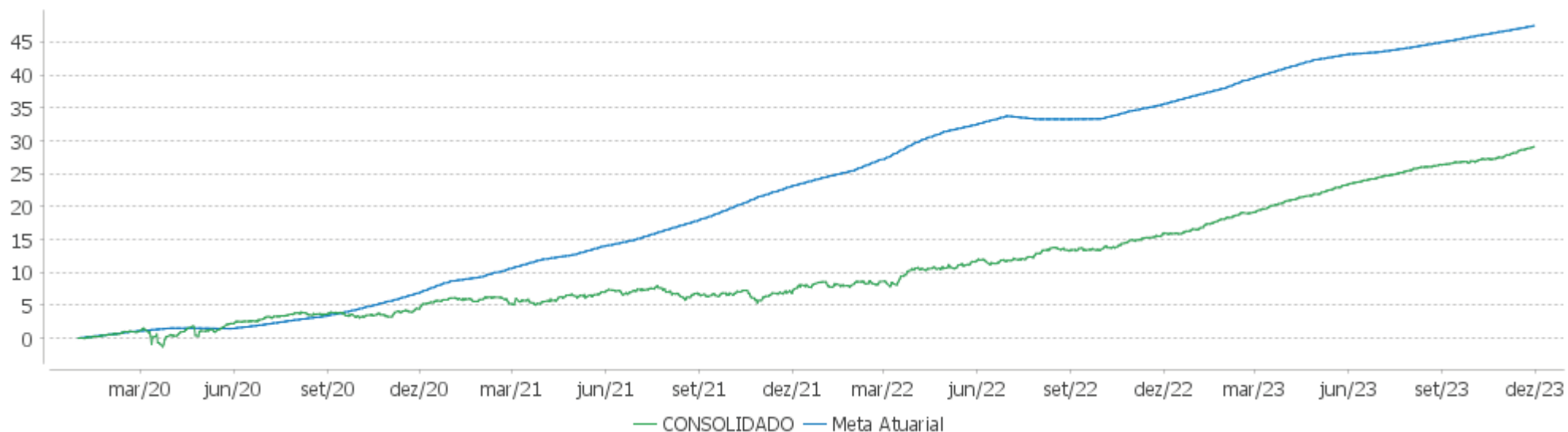
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

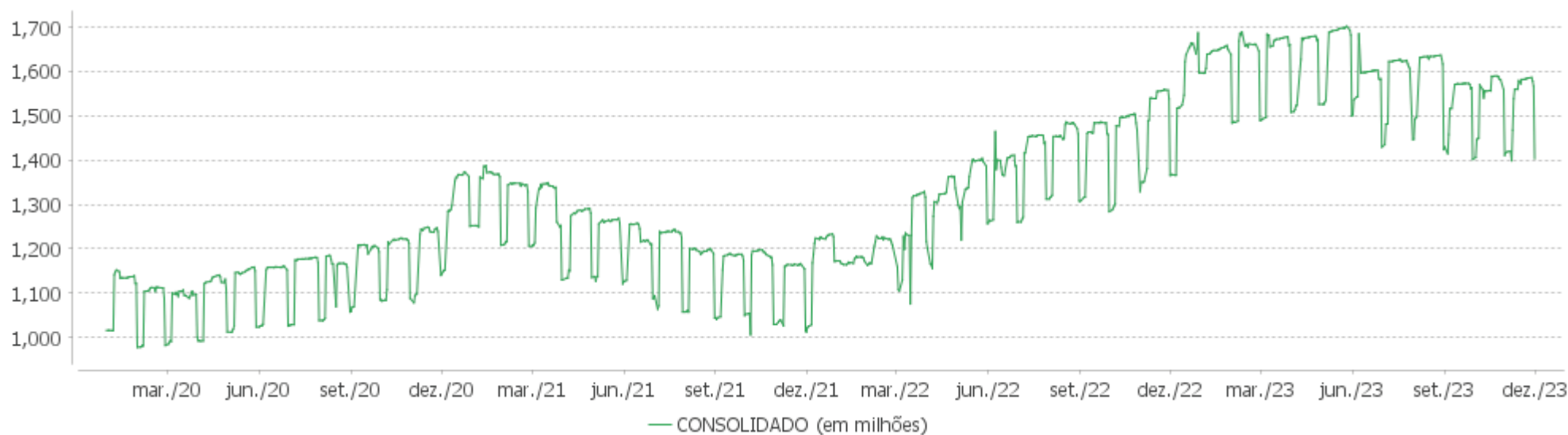
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	20	42,55	03 meses	2,21	1,74	0,47	0,96
Meses abaixo - Meta Atuarial	27	57,45	06 meses	4,71	3,06	1,65	0,77
			12 meses	11,45	8,85	2,60	0,85
			24 meses	20,67	19,68	0,99	1,74
Maior rentabilidade da Carteira	1,64	2022-03	36 meses	23,64	35,36	-11,72	2,07
Menor rentabilidade da Carteira	-0,80	2021-10	Desde 31/12/2019	29,12	44,34	-15,22	2,44

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

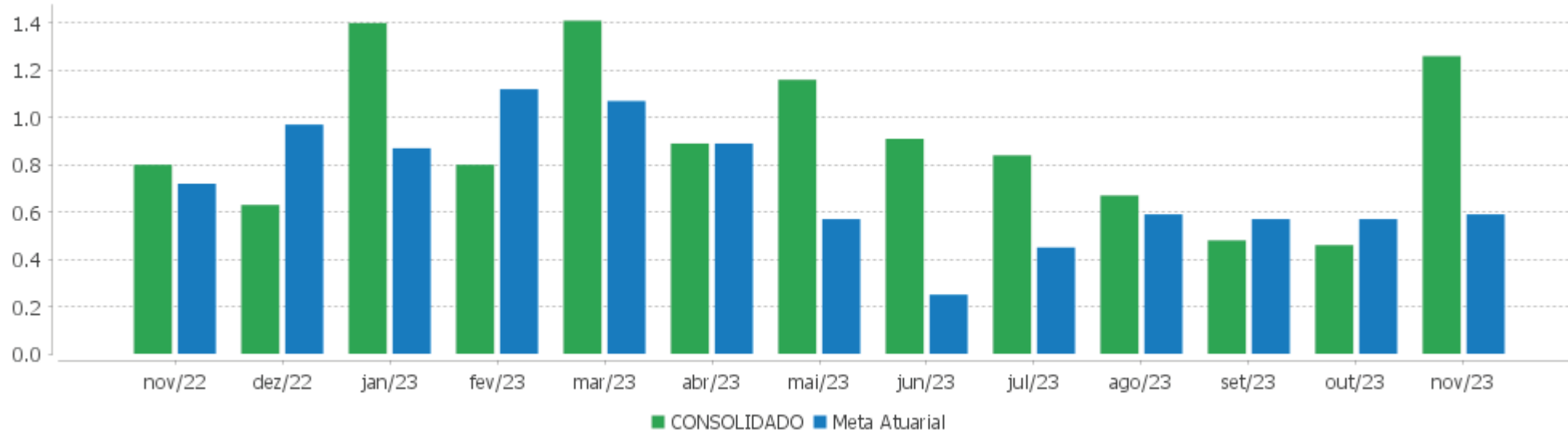


Patrimônio Líquido



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.	0,69 0,41	9,79 5,75	2,11 1,33	3,83 2,77	10,73 6,04	20,90 10,04	33,83 11,06
NTN-B 150535 (6,216000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,44	10,19 6,15	2,21 1,43	4,04 2,99	11,18 6,49	18,20 7,34	
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,41	9,77 5,73	2,11 1,33	3,82 2,76	10,70 6,02	20,84 9,98	33,73 10,97
NTN-B 150535 (5,886400%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,42	9,88 5,84	2,14 1,36	3,88 2,82	10,83 6,15	21,10 10,24	
NTN-B 150860 (6,225100%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,44	10,20 6,16	2,22 1,43	4,04 2,99	11,19 6,50	18,13 7,27	
NTN-B 150860 Var. IPCA p.p.	4,49 4,21	16,71 12,67	0,19 -0,59	3,22 2,16	14,33 9,65		
NTN-B 150840 Var. IPCA p.p.	3,16 2,88	15,10 11,06	-0,11 -0,90	3,36 2,31	13,04 8,36	17,76 6,90	19,55 -3,22
NTN-B 150860 (5,959200%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,42	9,95 5,91	2,15 1,37	3,91 2,86	10,91 6,22	21,26 10,40	34,35 11,58
NTN-B 150840 (5,347000%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,38	6,44 2,41	2,01 1,23	3,61 2,56	7,32 2,63		
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,42	9,90 5,87	2,14 1,36	3,89 2,84	10,86 6,17	24,69 13,83	38,10 15,33
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	0,68 0,40	9,64 5,61	2,08 1,30	3,75 2,70	10,57 5,89	24,05 13,19	37,22 14,46
NTN-B 150860 (5,986700%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,43	9,98 5,94	2,16 1,38	3,93 2,87	10,94 6,25	17,84 6,98	30,56 7,80
NTN-B 150860 (5,949840%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,42	9,94 5,90	2,15 1,37	3,91 2,86	10,90 6,22	21,24 10,38	34,33 11,56
NTN-B 150860 (5,599600%) Var. IPCA p.p.	0,68 0,40	9,61 5,57	2,07 1,29	3,74 2,68	10,53 5,85	20,62 9,76	33,59 10,83
NTN-B 150545 (5,900200%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,42	9,89 5,86	2,14 1,36	3,89 2,83	10,85 6,16	24,67 13,81	38,10 15,33
NTN-B 150860 (5,788000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,41	9,79 5,75	2,11 1,33	3,83 2,78	10,73 6,05	20,95 10,09	33,99 11,22
NTN-B 150860 (5,442000%)	0,66	6,57	2,03	3,66	7,46		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/11/2023

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.	0,38	2,54	1,25	2,61	2,77		
NTN-B 150535 (5,927000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,42	9,92 5,88	2,15 1,36	3,90 2,84	10,87 6,19	21,09 10,23	34,12 11,35
NTN-B 150860 (5,926400%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,42	9,92 5,88	2,15 1,36	3,90 2,84	10,87 6,19	17,77 6,91	
NTN-B 150850 (5,674000%) Var. IPCA p.p.	0,68 0,40	3,74 -0,30	2,09 1,31	0,92 -0,13	4,62 -0,07		
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	3,14 0,00	16,20 -0,30	3,06 -0,05	7,20 -0,13	18,03 -0,36	27,10 -0,89	21,26 -1,26
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,79 -1,84	10,15 -2,80	2,34 1,35	5,33 1,48	11,60 -1,13	21,14 0,73	26,81 2,43
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,70 0,08	12,92 -0,03	0,60 -0,39	3,24 -0,61	12,82 0,10	20,27 -0,14	22,48 -1,90
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,79 0,12	10,15 1,40	2,34 0,36	5,33 1,78	11,61 1,71		
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,97 -0,02	12,03 -0,20	2,85 -0,06	6,32 -0,13	13,32 -0,23	26,24 -0,57	28,92 -0,87
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	2,47 -0,00	14,64 -0,17	2,97 -0,05	6,84 -0,12	16,30 -0,21	26,98 -0,32	24,31 -0,53
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,99 107,76	12,57 104,37	3,12 107,09	6,86 108,36	13,88 104,37	28,23 105,08	33,78 106,70
BGT PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,90 98,04	11,88 98,64	2,87 98,22	6,26 98,82	13,11 98,58	26,54 98,80	31,28 98,82
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. SMALL CAP p.p.	12,22 -0,25	8,91 -0,50	0,88 -0,30	4,08 -0,40	5,65 -0,46	-3,87 -0,33	-17,77 -1,50
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. Índice Consumo - ICON p.p.	16,01 -0,32	-0,19 -1,14	1,41 -0,31	1,72 -0,30	-5,45 -1,06	-26,83 -2,17	-44,15 -2,61
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	6,42 -0,04	21,77 -1,07	1,18 0,02	6,82 -0,39	15,93 -1,73	-11,50 -1,39	14,35 -4,87
CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,00% p.p.	1,26 0,66	10,76 2,95	2,21 0,47	4,71 1,65	11,45 2,60	20,67 0,78	23,64 -14,39
CDI	0,92	12,04	2,92	6,33	13,30	26,87	31,66
IBOVESPA	12,54	16,04	10,01	17,53	13,20	24,94	16,93
INPC + 6,00%	0,56	8,75	1,76	3,31	10,06	23,63	45,34
IPCA + 6,00%	0,74	9,70	2,21	4,04	10,94	24,53	46,11

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	1,00	12,22	2,91	6,45	13,55	26,81	29,79	34,92	44,24
IRF-M 1+	3,14	16,50	3,11	7,34	18,39	28,00	22,52	29,87	50,14
IRF-M TOTAL	2,47	14,81	3,03	6,96	16,50	27,30	24,84	31,46	48,61
IMA-B 5	1,80	10,51	1,62	4,32	11,55	22,27	29,18	38,75	57,20
IMA-B 5+	3,39	14,75	0,42	3,23	13,39	18,13	19,09	19,90	55,21
IMA-B TOTAL	2,62	12,95	0,99	3,85	12,73	20,41	24,38	28,75	57,75
IMA-GERAL TOTAL	1,84	12,96	2,33	5,79	13,83	24,95	27,59	32,92	50,36
IDKA 2	1,83	10,52	1,71	4,50	11,89	21,85	29,05	39,45	56,01
IDKA 20	4,68	19,28	-0,18	3,26	15,32	14,32	11,40	6,27	50,57
CDI	0,92	12,04	2,92	6,33	13,30	26,87	31,66	35,59	43,85

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	12,54	16,04	10,01	17,53	13,20	24,94	16,93	17,65	42,26
IBRX 100	12,38	14,97	9,89	17,42	11,95	23,34	15,95	17,94	44,76
IBRX 50	12,01	14,01	9,98	18,15	11,10	25,06	17,97	19,06	41,25
SMALL CAP	12,46	9,41	1,19	4,49	6,11	-3,54	-16,27	-12,84	24,96
Índice Consumo - ICON	16,33	0,95	1,71	2,02	-4,39	-24,66	-41,54	-39,36	-12,99
Índice Dividendos - IDIV	10,70	18,65	8,63	18,08	16,73	35,80	36,27	36,20	80,93

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	6,29	12,53	1,61	5,84	4,37	-12,16	16,75	69,92	111,42

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,66	10,79	-1,13	5,41	10,79	23,20	13,10	9,91	38,08

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	6,44	8,50	1,48	4,05	2,60	-16,06	3,97	48,41	80,72

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,28	4,04	0,78	1,05	4,68	10,86	22,77	28,06	32,25
INPC	0,10	3,14	0,33	0,34	3,85	10,06	22,12	28,46	32,79
IGPM	0,59	-3,89	1,46	-1,35	-3,46	2,23	20,51	50,06	56,02
SELIC	0,92	12,04	2,92	6,33	13,30	26,87	31,65	35,58	43,84

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,59	7,81	1,74	3,06	8,85	19,89	38,03	49,69	60,78
IPCA + 5,00%	0,67	8,75	1,98	3,55	9,90	22,20	42,03	55,50	68,63
IPCA + 5,50%	0,71	9,23	2,10	3,80	10,42	23,36	44,06	58,47	72,66
IPCA + 5,89%	0,74	9,59	2,19	3,99	10,82	24,28	45,66	60,82	75,87
IPCA + 6,00%	0,74	9,70	2,21	4,04	10,94	24,53	46,11	61,48	76,78
INPC + 4,00%	0,41	6,88	1,29	2,33	7,99	19,02	37,30	50,17	61,43
INPC + 6,00%	0,56	8,75	1,76	3,31	10,06	23,63	45,34	62,00	77,50

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%)	31.011.361,49	5,634200	31.041.775,81	5,622000	30.414,32
NTN-B 150535 (5,784900%)	31.489.971,32	5,784900	31.904.047,36	5,622000	414.076,04
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.387.019,07	5,886400	7.544.876,07	5,622000	157.857,00
NTN-B 150535 (5,909200%)	84.266.937,60	5,909200	86.227.155,04	5,622000	1.960.217,44
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.622.106,49	5,927000	12.934.073,26	5,622000	311.966,77
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.672.715,49	6,216000	2.802.382,54	5,622000	129.667,05
NTN-B 150545 (5,900200%)	127.034.538,03	5,900200	129.828.016,59	5,715700	2.793.478,56
NTN-B 150832 (5,763300%)	43.058.087,88	5,763300	43.599.153,55	5,570000	541.065,67
NTN-B 150840 (5,347000%)	8.617.424,83	5,347000	8.310.378,80	5,701700	-307.046,03
NTN-B 150850 (5,674000%)	22.144.199,95	5,674000	21.907.431,65	5,756800	-236.768,30
NTN-B 150860 (5,442000%)	19.358.229,14	5,442000	18.487.591,65	5,752800	-870.637,49
NTN-B 150860 (5,599600%)	90.040.193,30	5,599600	88.036.150,72	5,752800	-2.004.042,58
NTN-B 150860 (5,788000%)	74.448.228,67	5,788000	74.830.728,11	5,752800	382.499,44
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.815.408,57	5,926400	18.267.501,27	5,752800	452.092,70
NTN-B 150860 (5,949840%)	72.731.549,11	5,949840	74.830.728,11	5,752800	2.099.179,00
NTN-B 150860 (5,959200%)	85.451.549,82	5,959200	88.036.150,72	5,752800	2.584.600,90
NTN-B 150860 (5,986700%)	29.790.901,80	5,986700	30.812.652,75	5,752800	1.021.750,95
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.172.916,53	6,225100	6.602.711,30	5,752800	429.794,77

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
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
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

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/11/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
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
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
Total			279.030.753,46	296.828.966,49		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 5.945.783,38

Value-At-Risk: 0,42%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		0,42		0,42			1.403.275.830,69	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,33%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,634200%)		0,06	0,00	0,06			31.011.361,49	2,21
NTN-B 150535 (5,784900%)		0,06	0,00	0,06			31.489.971,32	2,24
NTN-B 150535 (5,886400%)		0,06	0,00	0,06			7.387.019,07	0,53
NTN-B 150535 (5,909200%)		0,06	0,00	0,06			84.266.937,60	6,01
NTN-B 150535 (5,927000%)		0,06	0,00	0,06			12.622.106,49	0,90
NTN-B 150535 (6,216000%)		0,06	0,00	0,06			2.672.715,49	0,19
NTN-B 150545 (5,900200%)		0,06	0,00	0,06			127.034.538,03	9,05
NTN-B 150832 (5,763300%)		0,06	0,00	0,06			43.058.087,88	3,07
NTN-B 150840		3,06	0,09	3,06			48.112.719,39	3,43
NTN-B 150840 (5,347000%)		0,06	0,00	0,06			8.617.424,83	0,61
NTN-B 150850 (5,674000%)		0,17	0,00	0,17			22.144.199,95	1,58
NTN-B 150860		4,85	0,08	4,85			24.650.122,20	1,76
NTN-B 150860 (5,442000%)		0,06	0,00	0,06			19.358.229,14	1,38
NTN-B 150860 (5,599600%)		0,06	0,00	0,06			90.040.193,30	6,42
NTN-B 150860 (5,788000%)		0,06	0,00	0,06			74.448.228,67	5,31
NTN-B 150860 (5,926400%)		0,06	0,00	0,06			17.815.408,57	1,27
NTN-B 150860 (5,949840%)		0,06	0,00	0,06			72.731.549,11	5,18
NTN-B 150860 (5,959200%)		0,06	0,00	0,06			85.451.549,82	6,09
NTN-B 150860 (5,986700%)		0,06	0,00	0,06			29.790.901,80	2,12
NTN-B 150860 (6,225100%)		0,06	0,00	0,06			6.172.916,53	0,44

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/11/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	0,61	0,32	0,17		0,03	0,94	838.876.180,68	59,78

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		0,11	0,01	0,01			151.074.850,70	10,77
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP		1,92	0,03	0,02			25.822.325,21	1,84
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,33	0,02	0,02			25.855.957,34	1,84
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,39	0,02	1,94			211.601.906,79	15,08
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		2,03	0,04	0,45			31.382.443,15	2,24
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		0,39	0,00	0,39			12.830.643,81	0,91
Sub-total	0,54	0,44	0,12		0,44	1,15	458.568.127,00	32,68

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			9.523.256,49	0,68
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,03	0,00	0,03			53.668.347,07	3,82
Sub-total	0,07	0,03	0,00		0,93	0,98	63.191.603,56	4,50

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,70%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		6,70	0,03	0,67			23.976.698,69	1,71
Sub-total	9,80	6,70	0,03		0,56	6,42	23.976.698,69	1,71

Renda Variável

Value-At-Risk: 10,10%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		10,05	0,06	0,44			11.432.774,24	0,81

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		10,51	0,04	0,41			7.230.446,52	0,52
Sub-total	25,55	10,10	0,11		0,53	14,51	18.663.220,76	1,33

(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 (%)