

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

CONSOLIDADO

Período: janeiro de 2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA **97,41%**

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%)	0,38	0,17	1,02	1,02	31.623.870,29	1,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	0,39	0,17	1,04	1,04	32.120.559,42	1,89
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,886400%)	0,39	0,18	1,04	1,04	7.536.294,35	0,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	0,39	0,18	1,05	1,05	85.973.275,68	5,05
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	0,39	0,18	1,05	1,05	12.878.107,27	0,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,216000%)	0,40	0,18	1,07	1,07	2.728.321,25	0,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	0,47	0,24	1,04	1,04	129.687.763,11	7,62
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	0,37	0,16	1,03	1,03	43.913.381,70	2,58
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840	6,69	0,29	-1,64	-1,64	49.362.752,44	2,90
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,347000%)	2,76	0,19	1,00	1,00	8.785.830,65	0,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,674000%)	3,99	0,26	1,03	1,03	22.602.813,44	1,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860	8,96	0,41	-2,37	-2,37	25.286.499,51	1,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,442000%)	2,74	0,28	1,01	1,01	19.756.935,41	1,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	0,54	0,29	1,02	1,02	91.920.764,94	5,40
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	0,55	0,29	1,04	1,04	76.028.671,75	4,47

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/01/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,926400%)	0,56	0,30	1,05	1,05	18.198.057,57	1,07
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	0,55	0,30	1,05	1,05	74.296.761,36	4,36
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	0,55	0,30	1,05	1,05	87.292.006,46	5,13
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	0,55	0,30	1,05	1,05	30.434.017,61	1,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,225100%)	0,56	0,30	1,07	1,07	6.308.813,83	0,37
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,67	0,26	0,78	0,78	856.735.498,04	50,32

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	0,33	0,05	0,91	0,91	423.413.478,70	24,87	8.572.761.910,40	4,94
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	3,55	0,22	0,59	0,59	26.417.779,00	1,55	1.608.068.056,62	1,64
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,43	0,17	0,67	0,67	26.409.811,03	1,55	2.406.843.346,40	1,10
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,27	0,02	1,11	1,11	215.918.811,65	12,68	3.929.440.362,68	5,49
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	4,46	0,27	-0,35	-0,35	31.995.085,11	1,88	241.966.693,55	13,22
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,27	0,02	1,11	1,11	13.092.465,86	0,77	3.636.582.212,27	0,36
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,76	0,06	0,90	0,90	737.247.431,35	43,30		

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	0,05	0,04	0,96	0,96	9.700.016,19	0,57	17.367.591.977,31	0,06
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,09	0,05	1,09	1,09	54.760.280,31	3,22	9.205.921.475,18	0,59
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,08	0,04	1,07	1,07	64.460.296,50	3,79		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/01/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

0,56

0,16

0,84

0,84

1.658.443.225,89

97,41

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

1,08%

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	23,61	0,63	-8,21	-8,21	11.130.192,58	0,65	104.676.827,81	10,63
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	21,62	1,54	-6,59	-6,59	7.221.957,40	0,42	662.400.867,22	1,09
Sub-total Artigo 8º I			22,46	0,98	-7,58	-7,58	18.352.149,98	1,08		
Renda Variável			22,46	0,98	-7,58	-7,58	18.352.149,98	1,08		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/01/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,51%

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	14,62	-1,12	4,56	4,56	25.719.175,59	1,51	2.108.221.544,73	1,22
Sub-total Artigo 9º III			14,62	-1,12	4,56	4,56	25.719.175,59	1,51		
Investimentos no Exterior			14,62	-1,12	4,56	4,56	25.719.175,59	1,51		
Total			0,79	0,15	0,80	0,80	1.702.514.551,46	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	856.735.498,04	50,32	0,00	59,15	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	737.247.431,35	43,30	0,00	24,84	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	64.460.296,50	3,79	0,00	5,93	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	1.658.443.225,89	97,41					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	18.352.149,98	1,08	0,00	5,08	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	18.352.149,98	1,08					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	25.719.175,59	1,51	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	25.719.175,59	1,51					10,00
Total		1.702.514.551,46	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	0,78 80,36	0,78 80,36	3,09 109,95	4,69 77,64	10,46 81,23	6.604.166,06	6.604.166,06
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,90 92,68	0,90 92,68	3,05 108,83	5,45 90,21	12,12 94,19	7.064.203,44	7.064.203,44
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,07 110,37	1,07 110,37	3,01 107,29	6,50 107,56	13,48 104,74	680.510,86	680.510,86
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-7,58 -2,78	-7,58 -2,78	12,60 -0,31	-9,67 -14,43	-1,73 -14,35	-1.504.707,72	-1.504.707,72
Artigo 9º III % do CDI	4,56 471,80	4,56 471,80	14,15 504,32	11,69 193,50	25,21 195,87	1.121.844,99	1.121.844,99
CONSOLIDADO (Total)						13.966.017,63	13.966.017,63

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%)	31.303.756,49	0,00	0,00	0,00	31.623.870,29	320.113,80	320.113,80
NTN-B 150535 (5,784900%)	31.791.439,42	0,00	0,00	0,00	32.120.559,42	329.120,00	329.120,00
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.458.453,95	0,00	0,00	0,00	7.536.294,35	77.840,40	77.840,40
NTN-B 150535 (5,909200%)	85.083.672,26	0,00	0,00	0,00	85.973.275,68	889.603,42	889.603,42
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.744.662,52	0,00	0,00	0,00	12.878.107,27	133.444,75	133.444,75
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.699.406,81	0,00	0,00	0,00	2.728.321,25	28.914,44	28.914,44
NTN-B 150545 (5,900200%)	128.346.811,59	0,00	0,00	0,00	129.687.763,11	1.340.951,52	1.340.951,52
NTN-B 150832 (5,763300%)	43.464.226,13	0,00	0,00	0,00	43.913.381,70	449.155,57	449.155,57
NTN-B 150840	50.183.497,97	0,00	0,00	0,00	49.362.752,44	-820.745,53	-820.745,53
NTN-B 150840 (5,347000%)	8.698.963,97	0,00	0,00	0,00	8.785.830,65	86.866,68	86.866,68
NTN-B 150850 (5,674000%)	22.373.257,54	0,00	0,00	0,00	22.602.813,44	229.555,90	229.555,90
NTN-B 150860	25.901.547,53	0,00	0,00	0,00	25.286.499,51	-615.048,02	-615.048,02
NTN-B 150860 (5,442000%)	19.560.054,59	0,00	0,00	0,00	19.756.935,41	196.880,82	196.880,82
NTN-B 150860 (5,599600%)	90.992.839,04	0,00	0,00	0,00	91.920.764,94	927.925,90	927.925,90

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/01/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150860 (5,788000%)	75.249.466,11	0,00	0,00	0,00	76.028.671,75	779.205,64	779.205,64
NTN-B 150860 (5,926400%)	18.009.507,13	0,00	0,00	0,00	18.198.057,57	188.550,44	188.550,44
NTN-B 150860 (5,949840%)	73.525.513,79	0,00	0,00	0,00	74.296.761,36	771.247,57	771.247,57
NTN-B 150860 (5,959200%)	86.385.195,96	0,00	0,00	0,00	87.292.006,46	906.810,50	906.810,50
NTN-B 150860 (5,986700%)	30.117.152,08	0,00	0,00	0,00	30.434.017,61	316.865,53	316.865,53
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.241.907,10	0,00	0,00	0,00	6.308.813,83	66.906,73	66.906,73
	850.131.331,98	0,00	0,00	0,00	856.735.498,04	6.604.166,06	

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	12.949.090,84	0,00	0,00	0,00	13.092.465,86	143.375,02	143.375,02
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	213.555.017,19	0,00	0,00	0,00	215.918.811,65	2.363.794,46	2.363.794,46
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	32.107.256,06	0,00	0,00	0,00	31.995.085,11	-112.170,95	-112.170,95
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	473.498.556,55	55.728.290,26	-110.152.058,84	0,00	423.413.478,70	4.338.690,73	4.338.690,73
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	26.263.466,44	0,00	0,00	0,00	26.417.779,00	154.312,56	154.312,56
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	26.233.609,41	0,00	0,00	0,00	26.409.811,03	176.201,62	176.201,62
	784.606.996,49	55.728.290,26	-110.152.058,84	0,00	737.247.431,35	7.064.203,44	

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	54.171.604,20	0,00	0,00	0,00	54.760.280,31	588.676,11	588.676,11
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	9.608.181,44	0,00	0,00	0,00	9.700.016,19	91.834,75	91.834,75
	63.779.785,64	0,00	0,00	0,00	64.460.296,50	680.510,86	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES CONSUMO FIC	12.125.484,80	0,00	0,00	0,00	11.130.192,58	-995.292,22	-995.292,22
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	7.731.372,90	0,00	0,00	0,00	7.221.957,40	-509.415,50	-509.415,50
	19.856.857,70	0,00	0,00	0,00	18.352.149,98	-1.504.707,72	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	24.597.330,60	0,00	0,00	0,00	25.719.175,59	1.121.844,99	1.121.844,99
	24.597.330,60	0,00	0,00	0,00	25.719.175,59	1.121.844,99	

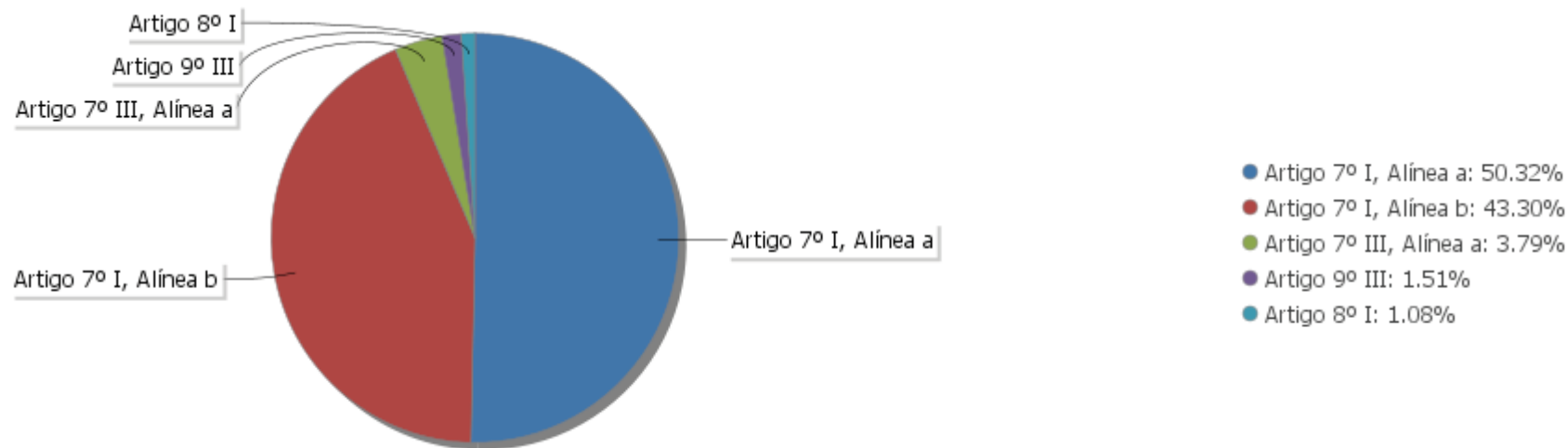
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

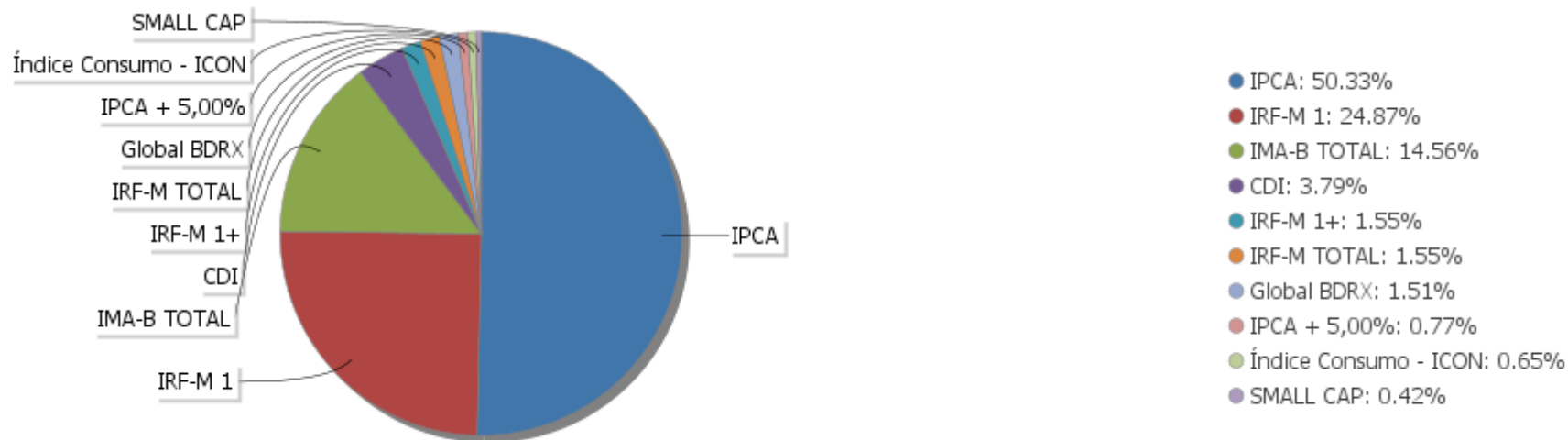
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	584.772.690,80	34,35	15,47	584.772.690,80	34,35	15,47
de 31 dias a 365 dias	229.011.277,51	13,45	17,22	813.783.968,31	47,80	32,69
acima de 365 dias	888.730.583,15	52,20	67,31	1.702.514.551,46	100,00	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

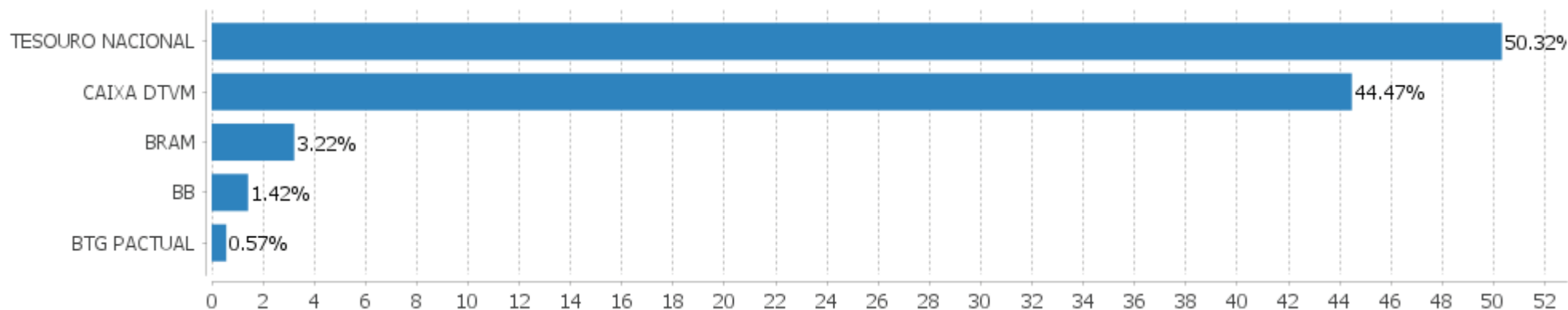


Alocação Por Estratégia



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
2024	0,80												0,80
IPCA + 4,94%	0,84												0,84
p.p. indexador	-0,04												-0,04
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

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	21	42,86
Meses abaixo - Meta Atuarial	28	57,14

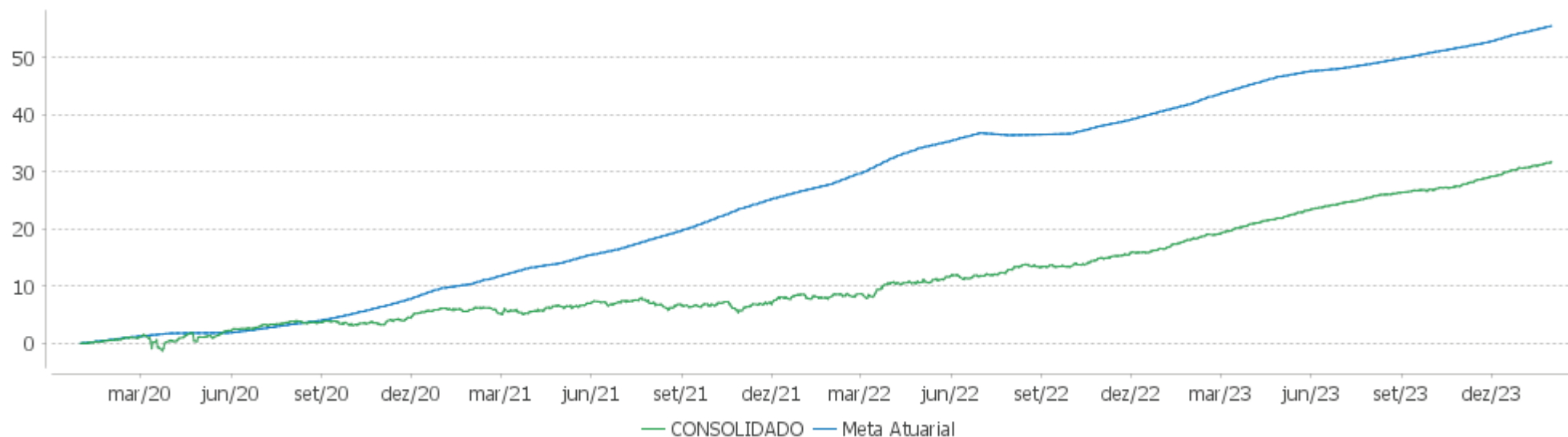
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,64	2022-03
Menor rentabilidade da Carteira	-0,80	2021-10

Relatório

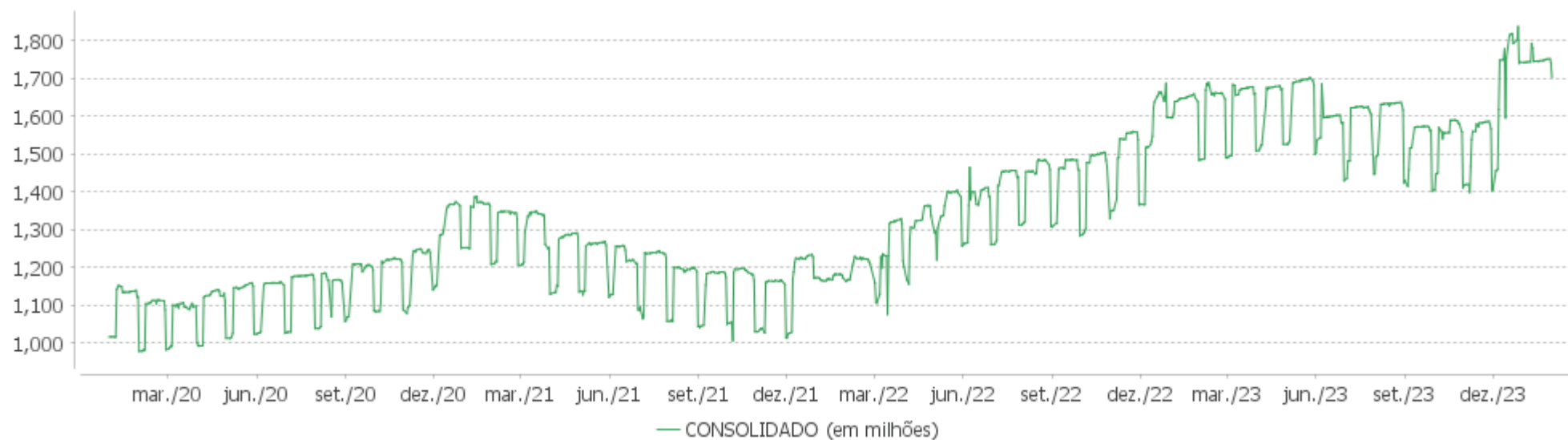
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	3,33	2,33	1,00	0,75
06 meses	5,00	4,11	0,89	0,84
12 meses	11,46	8,72	2,74	0,79
24 meses	21,76	19,60	2,16	1,56
36 meses	24,47	34,87	-10,40	2,03
48 meses	31,07	46,05	-14,98	2,42
Desde 31/12/2019	31,76	46,83	-15,07	2,40

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

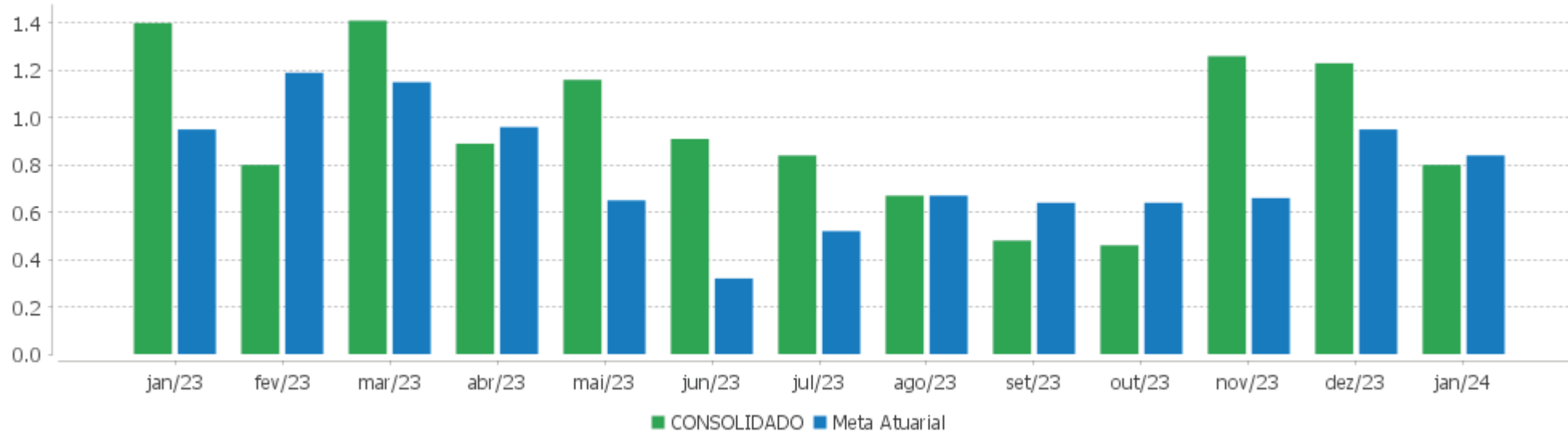


Patrimônio Líquido



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.	1,04 0,62	1,04 0,62	2,71 1,44	4,93 2,92	10,68 6,17	20,39 9,85	32,55 10,53
NTN-B 150535 (6,216000%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,65	1,07 0,65	2,82 1,55	5,15 3,15	11,13 6,63	17,71 7,17	
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,61	1,03 0,61	2,69 1,42	4,90 2,90	10,64 6,13	20,32 9,78	32,44 10,42
NTN-B 150535 (5,886400%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,62	1,04 0,62	2,73 1,47	4,98 2,97	10,78 6,28	20,59 10,05	
NTN-B 150860 (6,225100%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,65	1,07 0,65	2,94 1,68	5,28 3,27	11,27 6,77	17,78 7,24	
NTN-B 150860 Var. IPCA p.p.	-2,37 -2,79	-2,37 -2,79	7,19 5,92	0,40 -1,60	22,97 18,46		
NTN-B 150840 Var. IPCA p.p.	-1,64 -2,06	-1,64 -2,06	5,84 4,58	1,56 -0,44	20,19 15,69	23,87 13,33	14,95 -7,06
NTN-B 150860 (5,959200%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,63	1,05 0,63	2,87 1,61	5,14 3,14	10,99 6,49	20,89 10,35	33,23 11,21
NTN-B 150840 (5,347000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,58	1,00 0,58	2,62 1,36	4,73 2,73	7,30 2,79		
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,60	1,02 0,60	2,67 1,40	4,85 2,84	10,52 6,01	23,52 12,98	35,91 13,89
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,63	1,05 0,63	2,74 1,47	4,99 2,99	10,81 6,30	24,17 13,63	36,78 14,77
NTN-B 150860 (5,986700%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,63	1,05 0,63	2,88 1,61	5,16 3,15	11,02 6,51	17,48 6,94	29,47 7,46
NTN-B 150860 (5,949840%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,63	1,05 0,63	2,87 1,60	5,14 3,13	10,98 6,48	20,87 10,33	33,21 11,19
NTN-B 150860 (5,599600%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,60	1,02 0,60	2,78 1,51	4,96 2,95	10,61 6,10	20,25 9,71	32,47 10,45
NTN-B 150545 (5,900200%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,62	1,04 0,62	2,80 1,54	5,06 3,05	10,87 6,36	24,23 13,69	36,87 14,86
NTN-B 150860 (5,788000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,62	1,04 0,62	2,83 1,56	5,05 3,05	10,81 6,30	20,58 10,04	32,87 10,85
NTN-B 150535 (5,927000%)	1,05	1,05	2,74	5,00	10,83	20,58	32,84

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/01/2024

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.	0,63	0,63	1,48	3,00	6,32	10,04	10,83
NTN-B 150860 (5,442000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,59	1,01 0,59	2,74 1,47	4,87 2,87	7,53 3,02		
NTN-B 150860 (5,926400%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,63	1,05 0,63	2,86 1,60	5,12 3,12	10,96 6,45	17,41 6,87	
NTN-B 150850 (5,674000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,61	1,03 0,61	2,77 1,50	2,08 0,07	4,66 0,15		
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	0,59 -0,01	0,59 -0,01	5,52 -0,03	6,01 -0,13	18,02 -0,35	27,84 -0,86	22,09 -1,30
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,11 1,56	1,11 1,56	2,84 -2,13	5,37 2,46	10,86 -4,68	22,61 -1,19	26,40 4,02
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,35 0,10	-0,35 0,10	4,70 -0,27	2,28 -0,63	14,80 -0,73	22,92 -0,88	20,05 -2,33
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,91 0,08	0,91 0,08	2,80 0,03	5,87 -0,05	12,79 -0,16	26,67 -0,45	30,85 -0,76
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	1,11 0,26	1,11 0,26	2,84 0,36	5,37 0,84	10,86 1,19	22,58 0,78	
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,67 0,01	0,67 0,01	4,66 -0,02	5,95 -0,10	16,08 -0,23	27,40 -0,33	25,50 -0,60
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,09 112,41	1,09 112,41	3,04 108,45	6,56 108,57	13,58 105,49	28,79 105,35	35,99 106,81
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,96 98,87	0,96 98,87	2,77 98,79	5,96 98,77	12,70 98,69	26,98 98,73	33,21 98,54
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. SMALL CAP p.p.	-6,59 -0,04	-6,59 -0,04	12,09 -0,42	-6,54 -0,25	5,31 -1,03	-11,42 -1,31	-20,92 -1,59
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-8,21 0,13	-8,21 0,13	12,94 -0,07	-11,59 -0,11	-5,81 -1,05	-30,34 -1,93	-47,42 -2,21
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	4,56 -0,22	4,56 -0,22	14,15 -0,56	11,69 -0,89	25,21 -1,61	3,42 -2,20	15,15 -4,80
CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,94% p.p.	0,80 -0,04	0,80 -0,04	3,33 0,85	5,00 0,50	11,46 1,86	21,76 0,09	24,47 -16,45
CDI	0,97	0,97	2,81	6,04	12,87	27,33	33,70
IBOVESPA	-4,79	-4,79	12,91	4,76	12,63	13,92	11,02
INPC + 6,00%	1,08	1,08	2,69	4,67	9,97	23,23	44,47
IPCA + 6,00%	0,93	0,93	2,73	5,02	10,70	24,12	45,22

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	0,83	0,83	2,77	5,92	12,95	27,12	31,60	36,12	45,12
IRF-M 1+	0,60	0,60	5,55	6,14	18,37	28,70	23,39	30,51	48,22
IRF-M TOTAL	0,67	0,67	4,68	6,05	16,31	27,74	26,10	32,31	47,48
IMA-B 5	0,68	0,68	3,99	4,44	11,33	23,79	29,45	39,23	56,02
IMA-B 5+	-1,47	-1,47	5,89	1,54	19,03	23,38	15,40	19,65	46,36
IMA-B TOTAL	-0,45	-0,45	4,97	2,91	15,53	23,80	22,38	28,77	52,10
IMA-GERAL TOTAL	0,47	0,47	3,98	5,14	14,53	26,21	28,00	33,76	48,90
IDKA 2	0,81	0,81	4,15	4,81	11,43	23,53	29,55	40,17	55,62
IDKA 20	-3,34	-3,34	7,85	-0,30	28,79	24,16	6,04	6,79	36,82
CDI	0,97	0,97	2,81	6,04	12,87	27,33	33,70	37,09	45,03

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-4,79	-4,79	12,91	4,76	12,63	13,92	11,02	12,30	31,17
IBRX 100	-4,51	-4,51	13,20	5,15	11,88	12,72	10,34	12,15	33,43
IBRX 50	-4,15	-4,15	13,07	5,74	11,32	13,01	11,95	14,94	31,89
SMALL CAP	-6,55	-6,55	12,50	-6,30	6,34	-10,11	-19,32	-22,95	11,91
Índice Consumo - ICON	-8,33	-8,33	13,01	-11,48	-4,76	-28,41	-45,21	-47,39	-24,62
Índice Dividendos - IDIV	-3,51	-3,51	14,18	8,88	15,58	28,28	35,93	29,79	64,85

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	3,94	3,94	13,17	10,31	15,47	-0,78	18,02	74,30	143,07

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,67	0,67	5,63	4,26	18,16	20,04	15,77	8,33	38,34

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	2,86	2,86	12,43	7,98	9,50	-5,80	2,83	51,79	101,82

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,42	0,42	1,27	2,01	4,51	10,54	22,01	27,58	32,93
INPC	0,57	0,57	1,22	1,66	3,82	9,75	21,38	28,10	33,61
IGPM	0,07	0,07	1,41	2,15	-3,32	0,35	17,32	47,48	59,00
SELIC	0,97	0,97	2,80	6,04	12,87	27,33	33,70	37,09	45,03

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,76	0,76	2,25	4,03	8,64	19,51	37,19	49,11	61,60
IPCA + 5,00%	0,85	0,85	2,49	4,53	9,67	21,80	41,17	54,89	69,49
IPCA + 5,50%	0,89	0,89	2,61	4,77	10,18	22,96	43,18	57,84	73,54
IPCA + 5,89%	0,92	0,92	2,70	4,97	10,59	23,86	44,77	60,18	76,76
IPCA + 6,00%	0,93	0,93	2,73	5,02	10,70	24,12	45,22	60,84	77,68
INPC + 4,00%	0,91	0,91	2,21	3,67	7,92	18,65	36,48	49,72	62,43
INPC + 6,00%	1,08	1,08	2,69	4,67	9,97	23,23	44,47	61,50	78,60

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%)	31.623.870,29	5,634200	31.659.194,51	5,620000	35.324,22
NTN-B 150535 (5,784900%)	32.120.559,42	5,784900	32.538.616,58	5,620000	418.057,16
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.536.294,35	5,886400	7.694.943,11	5,620000	158.648,76
NTN-B 150535 (5,909200%)	85.973.275,68	5,909200	87.942.206,98	5,620000	1.968.931,30
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.878.107,27	5,927000	13.191.331,05	5,620000	313.223,78
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.728.321,25	6,216000	2.858.121,73	5,620000	129.800,48
NTN-B 150545 (5,900200%)	129.687.763,11	5,900200	132.761.354,25	5,698500	3.073.591,14
NTN-B 150832 (5,763300%)	43.913.381,70	5,763300	44.347.157,01	5,606800	433.775,31
NTN-B 150840 (5,347000%)	8.785.830,65	5,347000	8.526.293,60	5,645100	-259.537,05
NTN-B 150850 (5,674000%)	22.602.813,44	5,674000	22.520.329,70	5,702500	-82.483,74
NTN-B 150860 (5,442000%)	19.756.935,41	5,442000	18.964.874,63	5,721300	-792.060,78
NTN-B 150860 (5,599600%)	91.920.764,94	5,599600	90.308.926,82	5,721300	-1.611.838,12
NTN-B 150860 (5,788000%)	76.028.671,75	5,788000	76.762.587,80	5,721300	733.916,05
NTN-B 150860 (5,926400%)	18.198.057,57	5,926400	18.739.102,32	5,721300	541.044,75
NTN-B 150860 (5,949840%)	74.296.761,36	5,949840	76.762.587,80	5,721300	2.465.826,44
NTN-B 150860 (5,959200%)	87.292.006,46	5,959200	90.308.926,82	5,721300	3.016.920,36
NTN-B 150860 (5,986700%)	30.434.017,61	5,986700	31.608.124,39	5,721300	1.174.106,78
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.308.813,83	6,225100	6.773.169,51	5,721300	464.355,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2937	02/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.942,05	0,00	572,72405500	3,3909000000
2944	05/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.027,15	0,00	597,24785400	3,3941520000
2938	05/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.942,05	0,00	572,17531800	3,3941520000
2982	10/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.235,67	2.424,49190200	3,3968640000
2981	10/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	179.362,57	52.802,39875200	3,3968640000
2980	10/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.325.442,72	0,00	4.217.255,30371500	3,3968640000
2947	10/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.249.580,47	367.862,96684300	3,3968640000
2946	10/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	398.003,96	117.168,05836300	3,3968640000
2945	10/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.679.751,36	0,00	9.031.786,77745100	3,3968640000
2973	10/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.149,01	8.286,76316000	3,3968640000
2972	10/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	382.046,48	112.470,34780500	3,3968640000
2971	10/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.437.679,46	0,00	1.306.404,80749300	3,3968640000
2984	11/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	387,00	113,87425500	3,3984730000
2983	11/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	897.547,33	264.103,12187200	3,3984730000
2950	11/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.595.857,43	3.117.828,92729300	3,3984730000
2949	11/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.316.704,61	387.440,06683000	3,3984730000
2948	11/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	101.833,08	0,00	29.964,36340600	3,3984730000
2974	11/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	907.882,17	267.144,14653500	3,3984730000
2985	12/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.570.861,52	1.344.151,22671500	3,4005560000
2951	12/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.848,10	0,00	5.836,72199400	3,4005560000
2952	12/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	23.573.698,12	6.932.306,98650800	3,4005560000
2975	12/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.871.464,09	2.314.757,96465800	3,4005560000
2986	15/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.992,24	4.112,72882800	3,4021790000
2953	15/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	31.040,27	9.123,64385100	3,4021790000
2976	15/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.018,13	2.944,62158200	3,4021790000
2988	16/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	219.813,41	64.603,84174000	3,4024820000
2987	16/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	305.895,93	0,00	89.903,76143000	3,4024820000
2939	16/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	387,95208900	3,4024820000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2955	16/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.269.380,69	373.074,91707524	3,4024820000
2954	16/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.424.520,35	0,00	418.670,94374048	3,4024820000
2978	16/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	982.293,01	288.698,95761900	3,4024820000
2977	16/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.055.930,23	0,00	310.341,16565400	3,4024820000
2956	17/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	734.693,70	215.830,62268900	3,4040290000
2989	18/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.398,02	2.465,79930000	3,4058000000
2957	18/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	19.145,82	5.621,53381800	3,4058000000
2979	18/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.196,41	938,51842900	3,4058000000
2990	19/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.560,00	0,00	1.338,52068800	3,4067460000
2959	19/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	84.127,41	24.694,35933100	3,4067460000
2958	19/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.316,85	0,00	3.908,96474200	3,4067460000
2960	22/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	221.186,73	64.890,38492300	3,4086210000
2940	22/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.104,66	0,00	4.724,68485000	3,4086210000
2941	23/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.615,69	0,00	2.819,82315100	3,4100330000
2961	24/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.484,03	0,00	1.900,55043600	3,4116590000
2963	24/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	29.237,39	8.569,84512700	3,4116590000
2962	24/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.534,88	3.674,13006700	3,4116590000
2942	25/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.313,31	0,00	5.364,75497900	3,4136340000
2964	25/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	111.216,12	0,00	32.579,97781800	3,4136340000
2965	29/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	56.223,31	0,00	16.454,08915000	3,4169810000
2992	30/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.752,54	1.682,97931900	3,4180690000
2991	30/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.383,51	0,00	2.745,26640600	3,4180690000
2943	30/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	860,05285400	3,4180690000
2967	30/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.243.231,75	2.996.789,04910800	3,4180690000
2966	30/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.052,54	0,00	5.281,50250900	3,4180690000
2994	31/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	900.071,57	263.183,36194500	3,4199410000
2993	31/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.837.782,66	8.432.245,66184300	3,4199410000
2970	31/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.384.097,25	1.281.921,89528000	3,4199410000
2969	31/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.162.284,53	2.971.479,48643800	3,4199410000
2968	31/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.103.948,04	0,00	907.602,80367400	3,4199410000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/01/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
		Total	55.728.290,26	110.152.058,84		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 6.512.722,46

Value-At-Risk: 0,38%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,74	0,29	5,00	0,26	-0,17	0,84	1.658.443.225,89	97,41
Artigo 8º	19,59	11,48	20,00	0,10	-0,44	-7,58	18.352.149,98	1,08
Artigo 9º	11,95	5,80	20,00	0,02	0,30	4,56	25.719.175,59	1,51
CONSOLIDADO		0,38		0,38			1.702.514.551,46	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,29%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,634200%)		0,10	0,00	0,10			31.623.870,29	1,86
NTN-B 150535 (5,784900%)		0,10	0,00	0,10			32.120.559,42	1,89
NTN-B 150535 (5,886400%)		0,10	0,00	0,10			7.536.294,35	0,44
NTN-B 150535 (5,909200%)		0,10	0,00	0,10			85.973.275,68	5,05
NTN-B 150535 (5,927000%)		0,10	0,00	0,10			12.878.107,27	0,76
NTN-B 150535 (6,216000%)		0,10	0,00	0,10			2.728.321,25	0,16
NTN-B 150545 (5,900200%)		0,10	0,00	0,10			129.687.763,11	7,62
NTN-B 150832 (5,763300%)		0,09	0,00	0,10			43.913.381,70	2,58
NTN-B 150840		3,40	0,09	3,39			49.362.752,44	2,90
NTN-B 150840 (5,347000%)		0,10	0,00	0,10			8.785.830,65	0,52
NTN-B 150850 (5,674000%)		0,10	0,00	0,10			22.602.813,44	1,33
NTN-B 150860		4,07	0,05	4,06			25.286.499,51	1,49
NTN-B 150860 (5,442000%)		0,10	0,00	0,10			19.756.935,41	1,16
NTN-B 150860 (5,599600%)		0,10	0,00	0,10			91.920.764,94	5,40
NTN-B 150860 (5,788000%)		0,10	0,00	0,10			76.028.671,75	4,47
NTN-B 150860 (5,926400%)		0,10	0,00	0,10			18.198.057,57	1,07
NTN-B 150860 (5,949840%)		0,10	0,00	0,10			74.296.761,36	4,36

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/01/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150860 (5,959200%)		0,10	0,00	0,10			87.292.006,46	5,13
NTN-B 150860 (5,986700%)		0,10	0,00	0,10			30.434.017,61	1,79
NTN-B 150860 (6,225100%)		0,10	0,00	0,10			6.308.813,83	0,37
Sub-total	1,09	0,33	0,15		-0,17	0,78	856.735.498,04	50,32

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	0,01	0,04			423.413.478,70	24,87
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP		2,03	0,03	0,02			26.417.779,00	1,55
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,48	0,02	0,02			26.409.811,03	1,55
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,37	0,02	2,11			215.918.811,65	12,68
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		2,20	0,04	0,48			31.995.085,11	1,88
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		0,37	0,00	0,37			13.092.465,86	0,77
Sub-total	0,39	0,31	0,11		-0,18	0,90	737.247.431,35	43,30

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI		0,02	-0,00	0,02			9.700.016,19	0,57
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,04	0,00	0,04			54.760.280,31	3,22
Sub-total	0,13	0,03	0,00		0,77	1,07	64.460.296,50	3,79

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,80%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		5,80	0,02	0,61			25.719.175,59	1,51
Sub-total	11,95	5,80	0,02		0,30	4,56	25.719.175,59	1,51

Renda Variável

Value-At-Risk: 11,48%

Artigo 8º I

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		12,17	0,06	0,29			11.130.192,58	0,65
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		10,80	0,04	0,10			7.221.957,40	0,42
Sub-total	19,59	11,48	0,10		-0,44	-7,58	18.352.149,98	1,08

(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 (%)