



LDB
EMPRESAS

CARAGUATATUBA
JUNHO 2023



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 30.06.2023.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

82,09%

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 150525 (5,940000%)	4,11	0,02	0,47	0,90	20.181.117,14	3,05
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,980000%)	0,47	0,03	0,47	6,32	10.300.923,43	1,56
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,090000%)	0,47	0,02	0,48	6,37	5.091.235,60	0,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,560000%)	0,47	0,02	0,44	6,11	16.830.448,65	2,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,821000%)	0,47	0,02	0,46	6,24	19.672.189,65	2,97
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,710000%)	0,47	0,02	0,45	6,18	32.144.465,53	4,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,760000%)	0,47	0,02	0,46	6,21	10.686.971,80	1,62
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,781000%)	0,47	0,02	0,46	6,22	10.668.898,31	1,61
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,815000%)	0,47	0,02	0,46	6,24	10.645.132,11	1,61
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,850000%)	0,49	-0,01	0,46	6,25	10.292.658,87	1,56
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,892000%)	0,47	0,02	0,47	6,27	5.552.596,70	0,84
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,910000%)	3,02	0,02	0,47	6,29	10.494.905,94	1,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,090000%)	3,03	0,02	0,48	6,37	5.242.424,87	0,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,440000%)	3,02	0,02	0,51	5,30	20.453.047,19	3,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,480000%)	3,03	0,03	0,51	6,56	21.294.095,58	3,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,680000%)	3,07	0,02	0,53	6,66	5.248.597,29	0,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,990300%)	4,23	0,02	0,55	1,08	30.323.957,11	4,58
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,350000%)	3,04	0,01	0,50	5,00	15.293.035,29	2,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (6,350000%)	3,05	0,01	0,50	5,00	15.293.464,40	2,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,708000%)	0,47	0,02	0,45	6,18	10.960.379,69	1,66
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,650000%)	0,47	0,02	0,45	6,16	932.428,65	0,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,770000%)	0,47	0,02	0,46	6,21	10.974.457,78	1,66
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,713000%)	0,47	0,02	0,45	6,19	11.025.730,43	1,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,780000%)	0,47	0,02	0,46	6,22	10.656.335,75	1,61
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,815000%)	0,47	0,02	0,46	6,24	10.950.127,19	1,65
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,916000%)	0,47	0,02	0,47	6,29	3.930.434,55	0,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,920000%)	0,49	-0,01	0,47	6,29	10.527.173,96	1,59
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,47	0,02	0,48	6,31	345.667.233,46	52,24

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	FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	3,92	0,29	2,19	2,42	2.247.465,28	0,34	234.003.023,06	0,96
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,03	0,05	1,08	3,08	19.416.841,23	2,93	6.942.662.276,99	0,28
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,37	0,06	1,15	6,57	444.471,70	0,07	307.873.930,44	0,14

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,38	0,07	1,16	6,49	12.365.322,09	1,87	6.781.214.720,11	0,18
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,40	0,22	1,03	6,92	615.140,16	0,09	1.128.559.610,31	0,05
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,43	0,35	2,10	8,26	16.799.185,26	2,54	5.348.206.988,95	0,31
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,23	0,17	1,48	6,98	51.888.425,72	7,84		

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				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06	0,05	1,12	6,42	65.316.226,21	9,87	15.331.819.820,88	0,43
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,10	0,05	1,17	6,46	27.884.685,68	4,21	4.788.352.840,29	0,58
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,05	1,09	6,44	30.846.584,45	4,66	14.982.085.274,92	0,21
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,08	0,06	1,16	5,51	21.101.436,63	3,19	6.131.327.523,66	0,34
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,08	0,05	1,13	6,44	145.148.932,97	21,94		

Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
VILA RICA	BRL DTVM	FIDC ITALIA SENIOR	15,93	-0,03	-0,03	1,24	487.238,57	0,07	19.087.385,82	2,55
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			15,93	-0,03	-0,03	1,24	487.238,57	0,07		
Renda Fixa			0,33	0,04	0,75	6,42	543.191.830,72	82,09		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

11,32%

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 DIVIDENDOS	19,05	0,08	7,90	7,28	1.546.175,84	0,23	592.169.733,93	0,26
BRAM	BEM	BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	25,56	0,79	6,48	4,22	5.796.521,69	0,88	759.747.191,78	0,76
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	20,01	0,00	8,32	7,51	0,00	0,00	391.223.289,46	0,00
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	21,16	-0,25	8,88	6,51	24.674.470,96	3,73	810.368.157,20	3,04
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	21,46	-0,11	8,37	7,39	7.610.811,98	1,15	691.932.262,79	1,10
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,59	-0,09	8,09	10,12	14.844.645,89	2,24	961.071.884,08	1,54
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	19,51	-0,09	5,27	-1,57	5.990.503,61	0,91	1.502.509.907,38	0,40
BRAM	BEM	BRADERCO F I A SELECTION	20,82	0,31	8,01	5,57	5.600.389,59	0,85	468.779.708,09	1,19
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	22,94	1,04	7,83	3,22	8.855.940,85	1,34	173.835.368,96	5,09
Sub-total Artigo 8º I			20,49	0,09	7,98	5,97	74.919.460,41	11,32		
Renda Variável			20,49	0,09	7,98	5,97	74.919.460,41	11,32		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,52%

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	23,77	0,25	0,47	14,53	23.293.393,05	3,52	2.036.420.590,68	1,14
Sub-total Artigo 9º III			23,77	0,25	0,47	14,53	23.293.393,05	3,52		
Investimentos no Exterior			23,19	0,25	0,47	14,51	23.293.393,05	3,52		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

3,06%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	0,50	0,10	1,22	5,50	20.268.093,18	3,06	1.654.107.518,67	1,23
Sub-total Artigo 10º I			0,50	0,10	1,22	12,24	20.268.093,18	3,06		
Investimentos Estruturados			17,11	0,10	1,22	12,24	20.268.093,18	3,06		
Total			3,40	0,06	1,53	6,95	661.672.777,36	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 1	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	345.667.233,46	52,24	0,00	50,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	51.888.425,72	7,84	0,00	11,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	145.148.932,97	21,94	0,00	25,00	60,00	0,00	65,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	487.238,57	0,07	0,00	0,10	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	543.191.830,72	82,09					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	74.919.460,41	11,32	0,00	5,00	30,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	74.919.460,41	11,32					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	23.293.393,05	3,52	0,00	4,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	23.293.393,05	3,52					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	20.268.093,18	3,06	0,00	4,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	20.268.093,18	3,06					15,00
Total		661.672.777,36	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	0,48 44,72	6,31 97,08	2,53 80,42	6,31 97,08	9,69 71,56	1.649.217,71	20.819.790,75
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,48 137,62	6,98 107,35	3,49 110,90	6,98 107,35	11,84 87,41	754.368,46	1.995.132,70
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,13 105,10	6,44 99,02	3,24 102,92	6,44 99,02	13,50 99,67	1.615.569,17	8.495.442,98
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-0,03 -2,79	1,24 19,10	0,47 14,98	1,24 19,10	-12,71 -93,83	-145,65	5.974,68
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	7,98 -1,02	5,97 -1,64	14,67 -1,24	5,97 -1,64	14,59 -5,24	5.595.430,68	4.267.075,90
Artigo 9º II % do CDI	0,00 0,00	6,13 94,38	0,54 17,01	6,13 94,38	11,03 81,44	0,00	160.631,81
Artigo 9º III % do CDI	0,47 43,67	14,53 223,59	5,60 178,11	14,53 223,59	13,40 98,98	108.526,22	4.596.658,54
Artigo 10º I % do CDI	1,22 114,02	12,24 188,41	3,41 108,37	12,24 188,41	19,96 147,41	238.789,97	2.059.166,12
CARAGUATATUBA (Total)						9.961.756,56	42.399.873,48

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 150525 (5,940000%)	20.086.581,88	0,00	0,00	0,00	20.181.117,14	94.535,26	179.861,86
NTN-B 150525 (5,980000%)	10.252.385,67	0,00	0,00	0,00	10.300.923,43	48.537,76	627.178,56
NTN-B 150527 (6,090000%)	5.066.785,76	0,00	0,00	0,00	5.091.235,60	24.449,84	312.637,45
NTN-B 150535 (5,560000%)	16.756.623,59	0,00	0,00	0,00	16.830.448,65	73.825,06	992.582,31
NTN-B 150535 (5,821000%)	19.581.872,63	0,00	0,00	0,00	19.672.189,65	90.317,02	1.183.774,14
NTN-B 150545 (5,710000%)	31.999.703,69	0,00	0,00	0,00	32.144.465,53	144.761,84	1.917.370,68
NTN-B 150545 (5,760000%)	10.638.425,33	0,00	0,00	0,00	10.686.971,80	48.546,47	639.942,39
NTN-B 150545 (5,781000%)	10.620.258,37	0,00	0,00	0,00	10.668.898,31	48.639,94	639.907,71
NTN-B 150555 (5,815000%)	10.596.321,60	0,00	0,00	0,00	10.645.132,11	48.810,51	640.090,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150555 (5,850000%)	10.245.164,56	0,00	0,00	0,00	10.292.658,87	47.494,31	620.674,65
NTN-B 150824 (5,892000%)	5.526.800,54	0,00	0,00	0,00	5.552.596,70	25.796,16	330.461,21
NTN-B 150824 (5,910000%)	10.445.974,04	0,00	0,00	0,00	10.494.905,94	48.931,90	625.576,15
NTN-B 150824 (6,090000%)	5.217.270,82	0,00	0,00	0,00	5.242.424,87	25.154,05	316.488,06
NTN-B 150824 (6,440000%)	20.349.238,98	0,00	0,00	0,00	20.453.047,19	103.808,21	1.032.550,77
NTN-B 150824 (6,480000%)	21.185.458,28	0,00	0,00	0,00	21.294.095,58	108.637,30	1.321.850,61
NTN-B 150824 (6,680000%)	5.220.982,51	0,00	0,00	0,00	5.248.597,29	27.614,78	330.516,41
NTN-B 150824 (6,990300%)	30.157.126,82	0,00	0,00	0,00	30.323.957,11	166.830,29	322.580,60
NTN-B 150826 (6,350000%)	15.216.470,41	0,00	0,00	0,00	15.293.035,29	76.564,88	729.762,56
NTN-B 150828 (6,350000%)	15.216.900,24	0,00	0,00	0,00	15.293.464,40	76.564,16	729.790,66
NTN-B 150830 (5,708000%)	10.911.037,32	0,00	0,00	0,00	10.960.379,69	49.342,37	643.327,10
NTN-B 150840 (5,650000%)	928.273,35	0,00	0,00	0,00	932.428,65	4.155,30	54.482,40
NTN-B 150840 (5,770000%)	10.924.510,98	0,00	0,00	0,00	10.974.457,78	49.946,80	647.125,38
NTN-B 150850 (5,713000%)	10.976.055,71	0,00	0,00	0,00	11.025.730,43	49.674,72	647.297,61
NTN-B 150850 (5,780000%)	10.607.763,78	0,00	0,00	0,00	10.656.335,75	48.571,97	628.806,95
NTN-B 150850 (5,815000%)	10.899.910,94	0,00	0,00	0,00	10.950.127,19	50.216,25	647.860,68
NTN-B 150850 (5,916000%)	3.912.099,90	0,00	0,00	0,00	3.930.434,55	18.334,65	234.313,80
NTN-B 150850 (5,920000%)	10.478.018,05	0,00	0,00	0,00	10.527.173,96	49.155,91	627.861,45
					345.667.233,46	1.649.217,71	

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 PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	12.223.700,79	0,00	0,00	0,00	12.365.322,09	141.621,30	753.941,94
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	16.452.887,98	0,00	0,00	0,00	16.799.185,26	346.297,28	428.909,66
FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	2.199.259,61	0,00	0,00	0,00	2.247.465,28	48.205,67	52.918,82
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	438.534,39	885,74	0,00	0,00	444.471,70	5.051,57	27.255,92
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	608.876,28	0,00	0,00	0,00	615.140,16	6.263,88	39.803,18
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	19.209.912,47	0,00	0,00	0,00	19.416.841,23	206.928,76	562.924,63
					51.888.425,72	754.368,46	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	29.015.053,63	1.507.622,88	0,00	0,00	30.846.584,45	323.907,94	1.585.423,46
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	20.860.079,29	0,00	0,00	0,00	21.101.436,63	241.357,34	1.101.436,63
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	63.701.918,42	5.015.187,69	-4.129.426,00	0,00	65.316.226,21	728.546,10	3.341.831,21
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	27.560.975,18	1.952,71	0,00	0,00	27.884.685,68	321.757,79	1.996.409,46
					145.148.932,97	1.615.569,17	

Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIDC ITALIA SENIOR	487.384,22	0,00	0,00	0,00	487.238,57	-145,65	5.974,68
					487.238,57	-145,65	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES DIVIDENDOS	1.433.027,45	0,00	0,00	0,00	1.546.175,84	113.148,39	104.961,15
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	22.662.616,57	0,00	0,00	0,00	24.674.470,96	2.011.854,39	1.508.501,53
BRADESCO F I A SELECTION	5.184.951,92	0,00	0,00	0,00	5.600.389,59	415.437,67	295.562,12
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	5.443.771,59	0,00	0,00	0,00	5.796.521,69	352.750,10	234.452,22
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	7.022.742,15	0,00	0,00	0,00	7.610.811,98	588.069,83	523.998,10
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	13.734.088,67	0,00	0,00	0,00	14.844.645,89	1.110.557,22	1.363.647,54
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	5.690.823,32	0,00	0,00	0,00	5.990.503,61	299.680,29	-95.395,00
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	732.955,82	0,00	-793.958,65	0,00	0,00	61.002,83	55.480,68
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	8.213.010,89	0,00	0,00	0,00	8.855.940,85	642.929,96	275.867,56
					74.919.460,41	5.595.430,68	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	23.184.866,83	0,00	0,00	0,00	23.293.393,05	108.526,22	4.596.658,54
					23.293.393,05	108.526,22	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	19.235.344,56	793.958,65	0,00	0,00	20.268.093,18	238.789,97	933.087,78
					20.268.093,18	238.789,97	

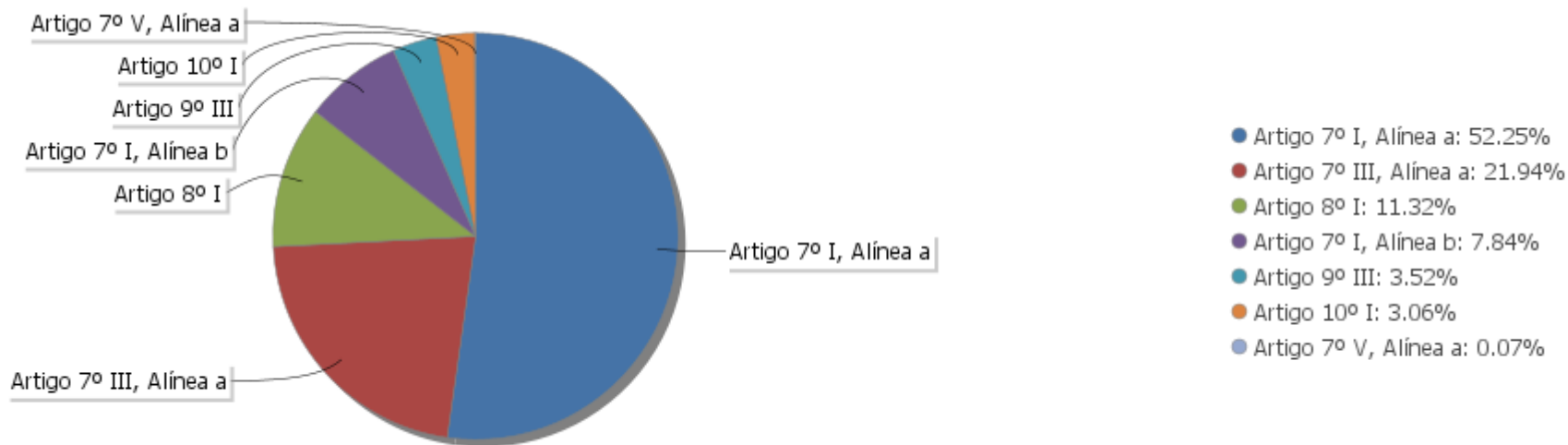
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

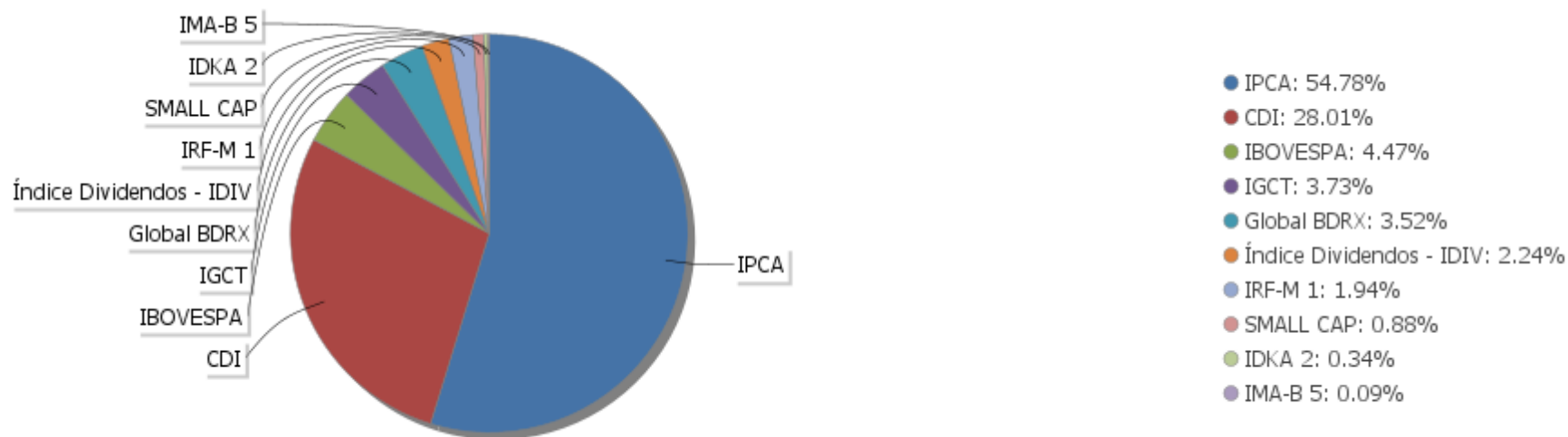
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	278.703.641,57	42,12	278.703.641,57	42,12	
de 31 dias a 365 dias	37.301.902,33	5,64	316.005.543,90	47,76	
acima de 365 dias	345.667.233,46	52,24	661.672.777,36	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

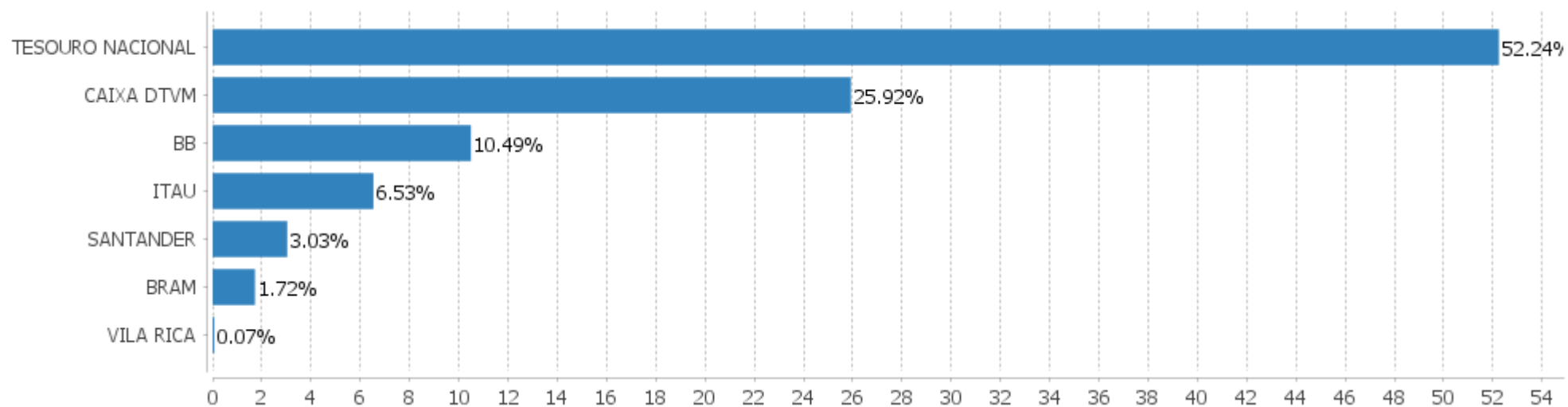


Alocação Por Estratégia



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	1,75	-0,11	0,96	0,97	1,66	1,53							6,95
IPCA + 5,03%	0,96	1,19	1,16	0,96	0,66	0,33							5,38
p.p. indexador	0,79	-1,30	-0,20	0,00	1,00	1,20							1,56
2022	-0,53	-0,27	2,35	-1,70	1,01	-1,73	2,27	0,51	-0,83	2,08	0,78	-0,10	3,79
IPCA + 4,99%	0,95	1,38	2,05	1,43	0,90	1,08	-0,28	0,08	0,12	0,98	0,80	1,05	11,04
p.p. indexador	-1,48	-1,65	0,30	-3,13	0,11	-2,81	2,54	0,42	-0,95	1,10	-0,02	-1,15	-7,25
2021	-0,94	-1,45	0,38	1,02	1,49	0,37	-0,80	-0,98	-1,64	-1,55	1,37	1,32	-1,47
IPCA + 5,46%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,28	0,98	1,43	1,34	1,61	1,68	1,38	1,22	16,05
p.p. indexador	-1,61	-2,69	-1,04	0,29	0,21	-0,60	-2,23	-2,32	-3,25	-3,23	-0,00	0,10	-17,51
2020	0,26	-1,20	-8,82	2,26	2,04	2,60	3,94	-1,32	-1,68	-0,06	3,29	4,43	5,12
IPCA + 5,89%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,89	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,65
p.p. indexador	-0,45	-1,86	-9,40	2,11	1,97	1,86	3,06	-2,04	-2,80	-1,40	1,94	2,58	-5,52
2019	1,51	0,37	0,41	0,94	1,99	2,58	1,16	0,11	1,85	2,11	-0,78	2,17	15,34
IPCA + 6,00%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	0,68	-0,53	-0,78	-0,12	1,35	2,13	0,44	-0,51	1,40	1,47	-1,75	0,52	4,75

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	25	46,30
Meses abaixo - Meta Atuarial	29	53,70

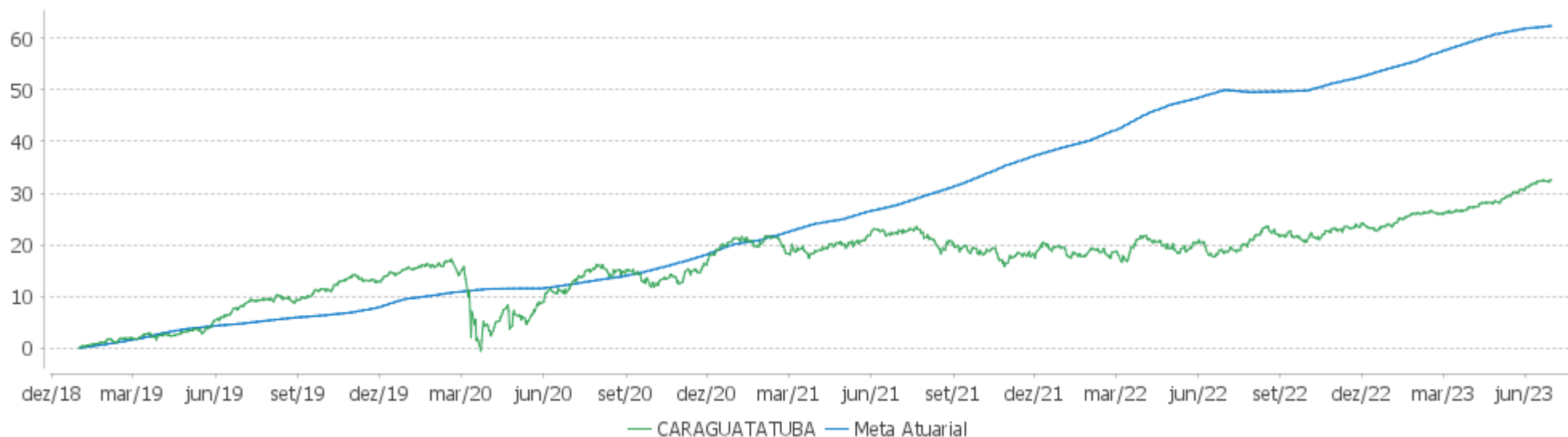
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	4,43	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-8,82	2020-03

Relatório

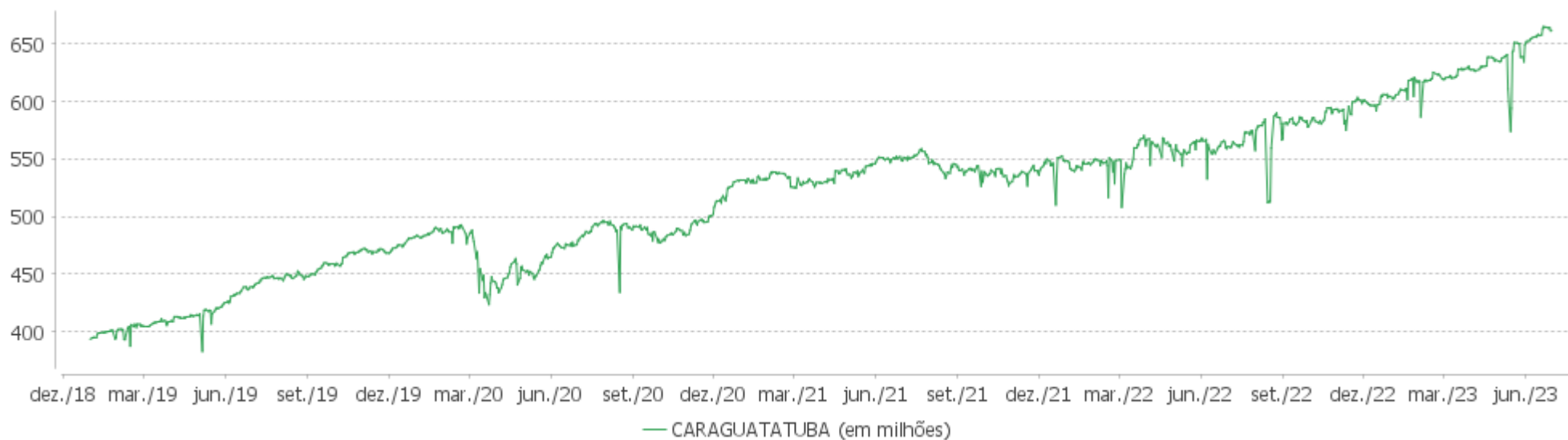
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	4,22	1,96	2,25	1,97
06 meses	6,95	5,38	1,56	2,06
12 meses	12,05	8,31	3,74	3,40
24 meses	8,45	27,52	-19,07	4,94
36 meses	18,91	45,98	-27,07	5,29
48 meses	22,75	57,99	-35,24	7,72
Desde 31/12/2018	32,61	66,17	-33,56	7,36

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

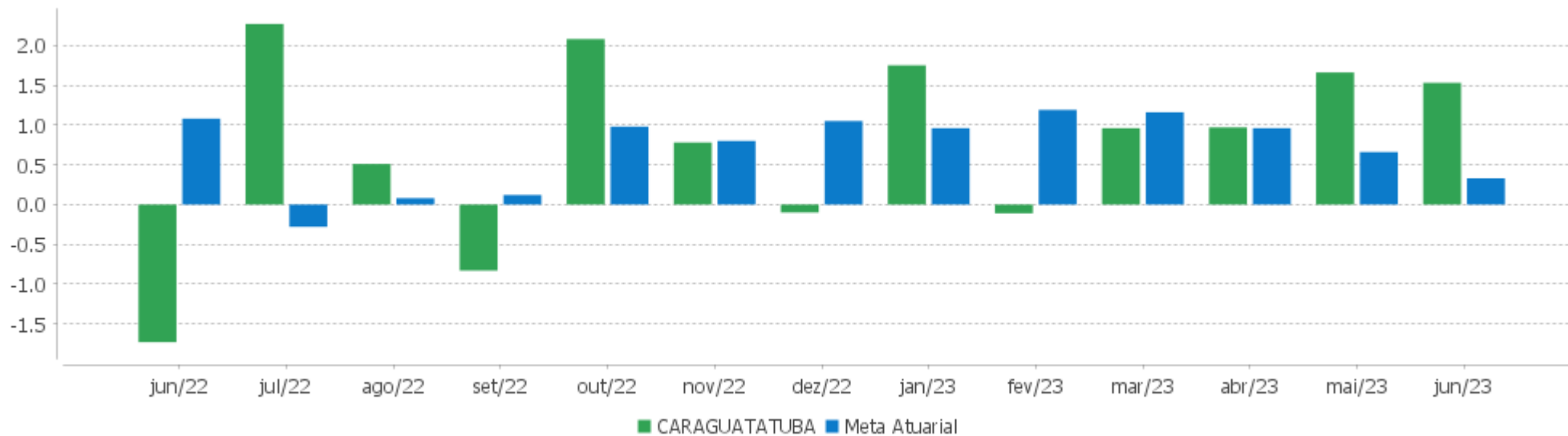


Patrimônio Líquido



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 150525 (5,940000%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	3,25 0,38	-0,42 -1,19	3,25 0,38	3,46 0,30		
NTN-B 150535 (5,560000%) Var. IPCA p.p.	0,44 0,52	6,11 3,24	2,43 1,67	6,11 3,24	9,26 6,10	25,39 9,96	35,43 10,37
NTN-B 150840 (5,650000%) Var. IPCA p.p.	0,45 0,53	6,16 3,28	2,45 1,69	6,16 3,28	9,36 6,19	25,60 10,17	35,76 10,71
NTN-B 150830 (5,708000%) Var. IPCA p.p.	0,45 0,53	6,18 3,31	2,46 1,70	6,18 3,31	9,42 6,25	22,13 6,70	31,95 6,89
NTN-B 150840 (5,770000%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	6,21 3,34	2,48 1,71	6,21 3,34	9,48 6,32	22,32 6,89	32,27 7,21
NTN-B 150826 (6,350000%) Var. IPCA p.p.	0,50 0,58	6,49 3,62	2,61 1,85	6,49 3,62	6,87 3,71		
NTN-B 150824 (6,680000%) Var. IPCA p.p.	0,53 0,61	6,66 3,79	2,69 1,93	6,66 3,79	7,21 4,05	20,52 5,09	
NTN-B 150850 (5,920000%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	6,29 3,42	2,51 1,75	6,29 3,42	9,63 6,47	22,53 7,11	32,58 7,52
NTN-B 150535 (5,821000%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	6,24 3,37	2,49 1,73	6,24 3,37	9,53 6,37	25,92 10,50	36,16 11,10
NTN-B 150824 (6,090000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,56	6,37 3,50	2,55 1,79	6,37 3,50	6,66 3,50	19,33 3,90	
NTN-B 150545 (5,781000%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	6,22 3,35	2,48 1,72	6,22 3,35	9,49 6,33	25,87 10,44	36,14 11,08
NTN-B 150824 (5,892000%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	6,27 3,40	2,50 1,74	6,27 3,40	9,60 6,44	22,43 7,01	32,37 7,31
NTN-B 150824 (6,440000%) Var. IPCA p.p.	0,51 0,59	6,54 3,67	2,63 1,87	6,54 3,67	6,98 3,82		
NTN-B 150555 (5,850000%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	6,25 3,38	2,49 1,73	6,25 3,38	9,56 6,40	25,98 10,55	36,30 11,24
NTN-B 150824 (5,910000%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	6,29 3,41	2,51 1,75	6,29 3,41	6,48 3,32	18,96 3,53	
NTN-B 150850 (5,916000%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	6,29 3,42	2,51 1,75	6,29 3,42	9,63 6,47	22,56 7,14	32,61 7,55
NTN-B 150850 (5,713000%)	0,45	6,19	2,46	6,19	9,42	22,28	32,26

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.	0,53	3,32	1,70	3,32	6,26	6,86	7,20
NTN-B 150527 (6,090000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,56	6,37 3,50	2,55 1,79	6,37 3,50	9,81 6,64	22,84 7,41	
NTN-B 150850 (5,815000%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	6,24 3,37	2,49 1,73	6,24 3,37	9,53 6,36	22,42 7,00	32,44 7,38
NTN-B 150824 (6,990300%) Var. IPCA p.p.	0,55 0,63	3,71 0,84	2,76 2,00	3,71 0,84	4,38 1,22		
NTN-B 150828 (6,350000%) Var. IPCA p.p.	0,50 0,58	6,49 3,62	2,61 1,85	6,49 3,62	6,85 3,69		
NTN-B 150545 (5,760000%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	6,21 3,34	2,47 1,71	6,21 3,34	9,47 6,31	25,83 10,40	36,08 11,03
NTN-B 150525 (5,980000%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	6,32 3,45	2,52 1,76	6,32 3,45	9,70 6,54	22,63 7,21	32,67 7,61
NTN-B 150824 (6,480000%) Var. IPCA p.p.	0,51 0,59	6,56 3,69	2,64 1,88	6,56 3,69	7,03 3,87	20,12 4,69	30,44 5,38
NTN-B 150555 (5,815000%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	6,24 3,37	2,49 1,73	6,24 3,37	9,53 6,36	25,95 10,52	36,26 11,20
NTN-B 150850 (5,780000%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	6,22 3,35	2,48 1,72	6,22 3,35	9,49 6,33	22,37 6,95	32,38 7,32
NTN-B 150545 (5,710000%) Var. IPCA p.p.	0,45 0,53	6,18 3,31	2,46 1,70	6,18 3,31	9,42 6,26	25,73 10,31	35,96 10,90
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	1,15 -0,04	6,57 -0,11	3,14 -0,08	6,57 -0,11	13,60 -0,22	21,58 -0,42	23,74 -0,74
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,03 -0,02	6,92 -0,12	2,49 -0,05	6,92 -0,12	10,00 -0,23	20,80 -0,51	27,85 -0,83
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	2,10 2,18	8,26 5,39	4,86 4,09	8,26 5,39	14,59 11,43	18,86 3,44	22,05 -3,01
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	1,16 -0,03	6,49 -0,18	3,14 -0,08	6,49 -0,18	13,48 -0,34	21,33 -0,67	23,34 -1,15
FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO Var. IDKA 2 p.p.	2,19 1,22	9,71 2,93	5,36 3,37	9,71 2,93			
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI % do CDI	1,08 100,49	6,45 99,26	3,13 99,44	6,45 99,26	13,44 99,27	23,27 99,57	25,58 97,74
FIDC ITALIA SENIOR % do CDI	-0,03 -2,79	-14,12 -217,33	0,47 14,98	-14,12 -217,33	-12,71 -93,83	20,48 87,64	1.387,34 5.301,50
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	1,17	6,46	3,25	6,46	13,73	24,70	27,79

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	108,90	99,37	103,29	99,37	101,41	105,68	106,21
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1,09	6,44	3,16	6,44	13,54	23,74	26,65
% do CDI	101,92	99,04	100,55	99,04	99,98	101,59	101,82
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,12	6,42	3,25	6,42	13,55	23,98	26,71
% do CDI	104,05	98,84	103,25	98,84	100,07	102,62	102,07
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	1,16	6,50	3,32	6,50	13,62	24,10	26,93
% do CDI	107,93	100,07	105,46	100,07	100,59	103,14	102,90
BRADESCO F I A SELECTION	8,01	5,57	14,39	5,57	19,10	-11,84	18,98
Var. IBOVESPA p.p.	-0,99	-2,04	-1,51	-2,04	-0,74	-4,97	-5,25
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	8,37	7,39	15,81	7,39	15,10	-9,65	16,18
Var. IBOVESPA p.p.	-0,63	-0,22	-0,09	-0,22	-4,73	-2,78	-8,05
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	5,27	-1,57	7,34	-1,57	13,35	-15,61	15,87
Var. IBOVESPA p.p.	-3,74	-9,18	-8,57	-9,18	-6,48	-8,73	-8,36
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	7,83	3,22	15,32	3,22	3,54		
Var. IBOVESPA p.p.	-1,17	-4,40	-0,58	-4,40	-16,30		
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	8,09	10,12	15,22	10,12	17,90	3,02	32,41
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,70	0,81	1,26	0,81	0,17	-9,89	-7,36
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	8,06	7,26	15,63	7,26	19,04	-11,73	14,68
Var. IBOVESPA p.p.	-0,94	-0,35	-0,27	-0,35	-0,79	-4,86	-9,55
BB AÇÕES DIVIDENDOS	7,90	7,28	14,22	7,28	14,52	-7,08	14,65
Var. IBOVESPA p.p.	-1,11	-0,33	-1,69	-0,33	-5,32	-0,21	-9,58
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	8,88	6,51	15,45	6,51	17,05	-11,63	19,59
Var. IGCT p.p.	-0,16	-1,00	-0,67	-1,00	-1,81	-2,14	-4,20
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	6,48	4,22	15,83	4,22	9,72	-24,07	0,19
Var. SMALL CAP p.p.	-1,69	-9,05	-9,33	-9,05	-10,07	3,57	-0,86
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,47	14,53	5,60	14,53	13,40	-1,43	24,43
Var. Global BDRX p.p.	-0,02	-0,61	-0,29	-0,61	-1,04	-2,02	-4,32
FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	1,22	6,56	3,37	6,56	13,54	24,64	26,88
% do CDI	114,02	100,99	107,14	100,99	99,99	105,43	102,73
CARAGUATATUBA	1,53	6,95	4,22	6,95	12,05	8,45	18,91
Var. IPCA + 4,99% p.p.	1,20	1,56	2,25	1,56	3,72	-18,86	-25,93
CDI	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17
IBOVESPA	9,00	7,61	15,91	7,61	19,83	-6,87	24,23
INPC + 6,00%	0,39	5,67	2,22	5,67	9,15	29,49	49,89
IPCA + 6,00%	0,41	5,86	2,19	5,86	9,33	29,66	48,88

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES DIVIDENDOS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO F I A SELECTION	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+0	A taxa de performance será apurada e provisionada diariamente, devendo ser paga à ADMINISTRADORA semestralmente, por período vencido, no primeiro dia útil do mês subsequente a cada semestre civil	0,70
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+0	D+0		20,00
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	D+1 du	D+0	D+21 du	D+23 du		1,72
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du		1,72
FIDC ITALIA SENIOR	Não se aplica	Não se aplica				
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du	0	1,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	D+1 du	D+0	D+2 du	D+4 du		1,50
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI			D+0	D+0		0,18
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	D+0	D+0	D+21 du	D+24 du		
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,18
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,10
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20

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	1,19	6,68	3,22	6,68	13,82	22,00	24,49	31,97	41,51
IRF-M 1+	2,65	11,41	6,89	11,41	18,80	17,59	16,30	30,02	54,96
IRF-M TOTAL	2,12	9,62	5,52	9,62	16,74	18,79	18,96	30,63	51,17
IMA-B 5	1,05	7,04	2,55	7,04	10,23	21,32	28,68	40,02	60,53
IMA-B 5+	3,37	14,91	10,90	14,91	16,34	13,82	23,52	25,96	77,32
IMA-B TOTAL	2,39	11,37	7,10	11,37	13,52	17,81	26,56	32,82	71,02
IMA-GERAL TOTAL	1,74	8,64	4,83	8,64	14,01	20,10	24,37	32,47	53,53
IDKA 2	0,97	6,79	1,99	6,79	9,28	20,32	28,82	40,12	58,67
IDKA 20	5,91	22,33	19,68	22,33	23,20	6,46	19,60	13,99	89,13
CDI	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17	32,00	40,34

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	9,00	7,61	15,91	7,61	19,83	-6,87	24,23	16,96	62,29
IBRX 100	8,87	6,59	14,96	6,59	17,60	-9,50	23,38	17,63	65,59
IBRX 50	8,77	4,96	13,79	4,96	17,68	-9,03	25,07	16,40	59,58
SMALL CAP	8,17	13,26	25,16	13,26	19,79	-27,64	1,04	6,25	50,57
Índice Consumo - ICON	9,53	8,38	24,04	8,38	7,60	-42,14	-32,37	-22,91	3,43
Índice Dividendos - IDIV	8,78	9,30	13,95	9,30	17,73	12,91	39,77	39,55	106,18

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	0,69	7,06	2,73	7,06	8,17	-0,23	26,33	90,25	104,62

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	4,71	10,05	14,28	10,05	12,87	14,54	12,44	20,15	48,47

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,09	4,18	0,15	4,18	5,27	-8,63	14,48	64,05	68,93

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	-0,08	2,87	0,76	2,87	3,16	15,42	25,06	27,72	32,02
INPC	-0,10	2,69	0,79	2,69	3,00	15,28	25,91	28,86	33,13
IGPM	-1,93	-4,46	-4,65	-4,46	-6,86	3,11	39,98	50,22	60,00
SELIC	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17	32,00	40,34

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,25	4,88	1,72	4,88	7,27	24,82	40,63	49,40	60,53
IPCA + 5,00%	0,33	5,37	1,96	5,37	8,30	27,23	44,71	55,22	68,37
IPCA + 5,50%	0,37	5,62	2,08	5,62	8,81	28,44	46,79	58,20	72,40
IPCA + 5,89%	0,40	5,81	2,17	5,81	9,21	29,39	48,42	60,54	75,60
IPCA + 6,00%	0,41	5,86	2,19	5,86	9,33	29,66	48,88	61,21	76,52
INPC + 4,00%	0,23	4,69	1,75	4,69	7,10	24,66	41,58	50,73	61,88
INPC + 6,00%	0,39	5,67	2,22	5,67	9,15	29,49	49,89	62,65	78,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150525 (5,940000%)	20.181.117,14	5,940000	20.146.130,28	6,043200	-34.986,86
NTN-B 150525 (5,980000%)	10.300.923,43	5,980000	10.289.153,99	6,043200	-11.769,44
NTN-B 150527 (6,090000%)	5.091.235,60	6,090000	5.226.048,21	5,299400	134.812,61
NTN-B 150535 (5,560000%)	16.830.448,65	5,560000	17.296.030,04	5,229500	465.581,39
NTN-B 150535 (5,821000%)	19.672.189,65	5,821000	20.653.233,82	5,229500	981.044,17
NTN-B 150545 (5,710000%)	32.144.465,53	5,710000	33.124.434,88	5,459700	979.969,35
NTN-B 150545 (5,760000%)	10.686.971,80	5,760000	11.078.495,45	5,459700	391.523,65
NTN-B 150545 (5,781000%)	10.668.898,31	5,781000	11.087.379,57	5,459700	418.481,26
NTN-B 150555 (5,815000%)	10.645.132,11	5,815000	11.206.139,27	5,452600	561.007,16
NTN-B 150555 (5,850000%)	10.292.658,87	5,850000	10.891.107,24	5,452600	598.448,37
NTN-B 150824 (5,892000%)	5.552.596,70	5,892000	5.469.085,42	7,388100	-83.511,28
NTN-B 150824 (5,910000%)	10.494.905,94	5,910000	10.339.274,80	7,388100	-155.631,14
NTN-B 150824 (6,090000%)	5.242.424,87	6,090000	5.173.796,40	7,388100	-68.628,47
NTN-B 150824 (6,440000%)	20.453.047,19	6,440000	20.258.490,56	7,388100	-194.556,63
NTN-B 150824 (6,480000%)	21.294.095,58	6,480000	21.098.608,62	7,388100	-195.486,96
NTN-B 150824 (6,680000%)	5.248.597,29	6,680000	5.211.227,40	7,388100	-37.369,89
NTN-B 150824 (6,990300%)	30.323.957,11	6,990300	30.202.660,32	7,388100	-121.296,79
NTN-B 150826 (6,350000%)	15.293.035,29	6,350000	15.684.796,82	5,410000	391.761,53
NTN-B 150828 (6,350000%)	15.293.464,40	6,350000	16.035.491,63	5,213100	742.027,23
NTN-B 150830 (5,708000%)	10.960.379,69	5,708000	11.312.783,71	5,132700	352.404,02
NTN-B 150840 (5,650000%)	932.428,65	5,650000	959.637,18	5,371900	27.208,53
NTN-B 150840 (5,770000%)	10.974.457,78	5,770000	11.434.550,02	5,371900	460.092,24
NTN-B 150850 (5,713000%)	11.025.730,43	5,713000	11.399.730,15	5,459000	373.999,72
NTN-B 150850 (5,780000%)	10.656.335,75	5,780000	11.114.056,72	5,459000	457.720,97
NTN-B 150850 (5,815000%)	10.950.127,19	5,815000	11.472.282,13	5,459000	522.154,94
NTN-B 150850 (5,916000%)	3.930.434,55	5,916000	4.171.738,96	5,459000	241.304,41
NTN-B 150850 (5,920000%)	10.527.173,96	5,920000	11.182.074,20	5,459000	654.900,24

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
120	02/06/2023	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	885,74	0,00	21,63544301	40,9393050000
121	05/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.784,78	0,00	3.072,56991500	2,8590984880
122	05/06/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	32.351,87	0,00	6.963,95548700	4,6456170000
123	06/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	46.721,45	0,00	16.332,88361000	2,8605757020
124	07/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	242.449,04	0,00	84.711,75836700	2,8620470720
125	07/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.379,03	0,00	2.927,63528600	2,8620470720
126	07/06/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	73.000,00	15.696,39963100	4,6507480000
127	07/06/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	16.129,40	3.468,12941700	4,6507480000
128	14/06/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	12.754,41	2.736,75823600	4,6604080000
129	16/06/2023	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	0,00	793.958,65	260.294,25601634	3,0502350000
130	19/06/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	372.006,95	0,00	79.694,45673200	4,6679150000
131	20/06/2023	FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	793.958,65	0,00	300.590,93425000	2,6413260000
132	20/06/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	657.778,97	0,00	140.841,17070200	4,6703600000
133	20/06/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.814.577,22	0,00	816.762,99471500	4,6703600000
134	21/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.201.288,58	0,00	417.771,80816300	2,8754658800
135	27/06/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	105.824,78	0,00	22.599,86191200	4,6825410000
136	29/06/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	224.903,27	47.979,72158600	4,6874650000
137	29/06/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	32.647,90	0,00	6.964,93733800	4,6874650000
138	29/06/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.802.638,92	811.235,69259900	4,6874650000
139	30/06/2023	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	1.952,71	0,00	0,48374660	4.036,6381740000
Total			7.319.607,67	4.923.384,65		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 6.038.680,86

Value-At-Risk: 0,91%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CARAGUATATUBA	1,67	0,91	0,91	0,28	1,53	661.672.777,36	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,07%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150525 (5,940000%)	0,37	0,22	-0,00	0,24	-1,64	0,47	20.181.117,14	3,05
NTN-B 150525 (5,980000%)	0,36	0,11	-0,00	0,11	-1,65	0,47	10.300.923,43	1,56
NTN-B 150527 (6,090000%)	0,37	0,14	-0,00	0,12	-1,60	0,48	5.091.235,60	0,77
NTN-B 150535 (5,560000%)	0,37	0,13	-0,00	0,12	-1,73	0,44	16.830.448,65	2,54
NTN-B 150535 (5,821000%)	0,37	0,13	-0,00	0,12	-1,67	0,46	19.672.189,65	2,97
NTN-B 150545 (5,710000%)	0,37	0,13	-0,00	0,12	-1,69	0,45	32.144.465,53	4,86
NTN-B 150545 (5,760000%)	0,37	0,13	-0,00	0,12	-1,68	0,46	10.686.971,80	1,62
NTN-B 150545 (5,781000%)	0,37	0,13	-0,00	0,12	-1,68	0,46	10.668.898,31	1,61
NTN-B 150555 (5,815000%)	0,37	0,13	-0,00	0,12	-1,67	0,46	10.645.132,11	1,61
NTN-B 150555 (5,850000%)	0,41	0,14	-0,00	0,14	-1,48	0,46	10.292.658,87	1,56
NTN-B 150824 (5,892000%)	0,37	0,13	-0,00	0,12	-1,65	0,47	5.552.596,70	0,84
NTN-B 150824 (5,910000%)	0,37	0,14	-0,00	0,12	-1,64	0,47	10.494.905,94	1,59
NTN-B 150824 (6,090000%)	0,36	0,12	-0,00	0,11	-1,62	0,48	5.242.424,87	0,79
NTN-B 150824 (6,440000%)	0,37	0,14	-0,00	0,12	-1,53	0,51	20.453.047,19	3,09
NTN-B 150824 (6,480000%)	0,36	0,11	-0,00	0,11	-1,54	0,51	21.294.095,58	3,22
NTN-B 150824 (6,680000%)	0,37	0,13	-0,00	0,12	-1,48	0,53	5.248.597,29	0,79
NTN-B 150824 (6,990300%)	0,37	0,22	-0,00	0,26	-1,42	0,55	30.323.957,11	4,58
NTN-B 150826 (6,350000%)	0,37	0,14	-0,00	0,12	-1,52	0,50	15.293.035,29	2,31
NTN-B 150828 (6,350000%)	0,38	0,13	-0,00	0,13	-1,50	0,50	15.293.464,40	2,31
NTN-B 150830 (5,708000%)	0,37	0,13	-0,00	0,12	-1,69	0,45	10.960.379,69	1,66

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (5,650000%)	0,37	0,13	-0,00	0,12	-1,71	0,45	932.428,65	0,14
NTN-B 150840 (5,770000%)	0,37	0,13	-0,00	0,12	-1,68	0,46	10.974.457,78	1,66
NTN-B 150850 (5,713000%)	0,37	0,13	-0,00	0,12	-1,69	0,45	11.025.730,43	1,67
NTN-B 150850 (5,780000%)	0,37	0,13	-0,00	0,12	-1,68	0,46	10.656.335,75	1,61
NTN-B 150850 (5,815000%)	0,37	0,13	-0,00	0,12	-1,67	0,46	10.950.127,19	1,65
NTN-B 150850 (5,916000%)	0,37	0,13	-0,00	0,12	-1,65	0,47	3.930.434,55	0,59
NTN-B 150850 (5,920000%)	0,40	0,14	-0,00	0,14	-1,49	0,47	10.527.173,96	1,59
Sub-total	0,37	0,12	-0,01		-1,61	0,48	345.667.233,46	52,24

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	2,19	1,46	0,00	0,93	0,51	2,19	2.247.465,28	0,34
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,01	0,01	0,00	0,01	0,36	1,08	19.416.841,23	2,93
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,21	0,21	-0,00	0,30	0,37	1,15	444.471,70	0,07
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,22	0,21	0,00	0,01	0,39	1,16	12.365.322,09	1,87
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	1,87	0,91	0,00	0,01	-0,02	1,03	615.140,16	0,09
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,89	0,55	0,00	0,59	0,55	2,10	16.799.185,26	2,54
Sub-total	0,76	0,26	0,01		0,53	1,48	51.888.425,72	7,84

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,02	0,04	0,00	0,04	2,02	1,12	65.316.226,21	9,87
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,06	0,06	0,00	0,06	1,48	1,17	27.884.685,68	4,21
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,01	0,02	0,00	0,02	1,37	1,09	30.846.584,45	4,66
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,06	0,05	0,00	0,05	1,33	1,16	21.101.436,63	3,19
Sub-total	0,02	0,03	0,00		2,94	1,13	145.148.932,97	21,94

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC ITALIA SENIOR	0,10	0,03	-0,00	0,03	-10,64	-0,03	487.238,57	0,07

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	0,10	0,03	-0,00		-10,64	-0,03	487.238,57	0,07

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,03%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES DIVIDENDOS	14,61	7,86	0,02	2,26	0,47	7,90	1.546.175,84	0,23
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	19,12	10,18	0,08	3,22	0,28	6,48	5.796.521,69	0,88
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	14,75	NaN	0,00	NaN	0,47	8,06	0,00	0,00
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	15,92	8,36	0,30	0,23	0,49	8,88	24.674.470,96	3,73
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	15,86	8,75	0,10	1,36	0,46	8,37	7.610.811,98	1,15
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	14,96	7,43	0,15	1,81	0,47	8,09	14.844.645,89	2,24
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	14,97	6,98	0,05	4,12	0,28	5,27	5.990.503,61	0,91
BRADESCO F I A SELECTION	14,57	8,11	0,07	2,50	0,48	8,01	5.600.389,59	0,85
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	16,69	8,95	0,11	3,31	0,40	7,83	8.855.940,85	1,34
Sub-total	15,35	8,03	0,87		0,45	7,98	74.919.460,41	11,32

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 7,63%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	13,88	7,63	0,04	0,62	-0,04	0,47	23.293.393,05	3,52
Sub-total	13,88	7,63	0,04		-0,04	0,47	23.293.393,05	3,52

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,18%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	0,44	0,18	0,00	0,18	0,34	1,22	20.268.093,18	3,06
Sub-total	0,44	0,18	0,00		0,34	1,22	20.268.093,18	3,06