



LDB
EMPRESAS

CARAGUATATUBA
JULHO 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 31.07.2023.

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

84,91%

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	0,03	0,49	1,39	20.279.005,19	3,02
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,980000%)	0,45	0,03	0,49	6,84	10.351.182,86	1,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,090000%)	0,45	0,02	0,50	6,90	5.116.541,82	0,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,560000%)	0,45	0,03	0,45	6,59	16.907.025,08	2,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,821000%)	0,45	0,03	0,48	6,75	19.765.768,82	2,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,710000%)	0,45	0,03	0,47	6,68	32.294.574,89	4,82
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,760000%)	0,45	0,03	0,47	6,71	10.737.297,52	1,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,781000%)	0,45	0,03	0,47	6,72	10.719.315,06	1,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,815000%)	0,45	0,03	0,48	6,74	10.695.725,69	1,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,850000%)	0,47	-0,00	0,48	6,76	10.341.878,42	1,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,892000%)	0,45	0,03	0,48	6,79	5.579.324,50	0,83
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,910000%)	3,02	0,02	0,48	6,80	10.545.598,76	1,57
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,090000%)	3,03	0,03	0,50	6,90	5.268.458,70	0,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,440000%)	3,02	0,03	0,52	5,85	20.560.369,46	3,07
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,480000%)	3,02	0,03	0,53	7,12	21.406.391,60	3,19

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	0,03	0,54	7,24	5.277.119,27	0,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,990300%)	4,23	0,03	0,57	1,65	30.496.120,84	4,55
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,350000%)	3,03	0,02	0,52	5,54	15.372.214,84	2,29
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (6,350000%)	3,05	0,02	0,52	5,54	15.372.645,20	2,29
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,708000%)	0,45	0,03	0,47	6,68	11.011.536,06	1,64
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,650000%)	0,45	0,03	0,46	6,65	936.737,87	0,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,770000%)	0,45	0,03	0,47	6,72	11.026.219,01	1,64
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,713000%)	0,45	0,03	0,47	6,68	11.077.245,59	1,65
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,780000%)	0,45	0,03	0,47	6,72	10.706.688,55	1,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,815000%)	0,45	0,03	0,48	6,74	11.002.164,05	1,64
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,916000%)	0,45	0,03	0,48	6,80	3.949.427,57	0,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,920000%)	0,46	0,00	0,48	6,80	10.578.093,46	1,58
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,45	0,02	0,49	6,83	347.374.670,68	51,81

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	3,78	0,13	0,95	3,40	12.337.242,58	1,84	241.038.039,45	5,12
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,03	0,05	1,05	4,16	19.620.704,88	2,93	7.072.550.968,90	0,28
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,36	0,03	1,06	7,70	450.081,28	0,07	310.347.681,94	0,15

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	0,36	0,06	1,06	7,62	12.496.212,65	1,86	7.147.233.323,14	0,17
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,21	0,26	0,63	0,63	5.031.390,76	0,75	4.916.698.620,80	0,10
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,32	0,00	0,19	7,12	0,00	0,00	1.108.295.759,82	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	5,04	0,19	0,48	0,48	10.047.953,80	1,50	1.530.052.591,57	0,66
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,45	0,12	0,89	9,23	27.013.709,30	4,03	5.462.057.088,14	0,49
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF ATIVO FIC	1,70	0,18	0,76	0,76	621.003,62	0,09	327.369.009,91	0,19
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,10	0,12	0,89	7,93	87.618.298,87	13,07		

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				
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	5,68	0,28	0,54	0,54	7.037.932,17	1,05	436.690.031,12	1,61
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06	0,05	1,14	7,64	36.600.700,72	5,46	14.867.599.167,79	0,25
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,10	0,06	1,15	7,68	21.130.441,21	3,15	5.292.207.615,10	0,40
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,05	1,06	7,57	52.803.498,11	7,87	14.673.774.494,53	0,36
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,08	0,05	1,15	6,72	16.288.851,50	2,43	5.833.199.134,59	0,28
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,08	0,06	1,08	7,58	133.861.423,71	19,96		

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	15,96	0,96	0,96	2,22	491.927,05	0,07	56.027.774,26	0,88
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			15,96	0,96	0,96	2,22	491.927,05	0,07		
Renda Fixa			0,31	0,05	0,68	7,15	569.346.320,31	84,91		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

8,49%

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	19,01	1,08	2,74	10,22	1.588.562,81	0,24	602.472.132,81	0,26
BRAM	BEM	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	25,21	1,13	2,91	7,25	5.965.197,49	0,89	779.684.244,77	0,77
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	21,14	1,51	3,45	10,18	5.101.895,89	0,76	815.496.559,66	0,63
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	21,45	1,32	3,47	11,12	7.874.903,60	1,17	712.927.891,24	1,10
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,63	1,14	2,74	13,14	15.251.872,59	2,27	981.079.847,94	1,55
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	19,43	1,45	2,61	1,00	6.147.015,25	0,92	1.516.010.022,90	0,41
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	20,64	0,84	2,64	8,36	5.748.143,00	0,86	483.820.683,81	1,19
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	22,84	0,82	4,49	7,85	9.253.297,47	1,38	181.425.098,24	5,10
Sub-total Artigo 8º I			20,42	1,15	3,16	9,32	56.930.888,10	8,49		
Renda Variável			20,42	1,15	3,16	9,32	56.930.888,10	8,49		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,55%

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	22,96	0,17	2,12	16,95	23.786.229,33	3,55	2.066.727.306,72	1,15
Sub-total Artigo 9º III			22,96	0,17	2,12	16,95	23.786.229,33	3,55		
Investimentos no Exterior			22,43	0,17	2,12	16,94	23.786.229,33	3,55		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

3,05%

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	0,46	0,05	0,99	6,54	20.469.227,55	3,05	1.628.550.372,57	1,26
Sub-total Artigo 10º I			0,46	0,05	0,99	13,36	20.469.227,55	3,05		
Investimentos Estruturados			16,17	0,05	0,99	13,36	20.469.227,55	3,05		
Total			3,18	0,15	0,99	8,00	670.532.665,29	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	347.374.670,68	51,81	0,00	50,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	87.618.298,87	13,07	0,00	11,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	133.861.423,71	19,96	0,00	25,00	60,00	0,00	65,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	491.927,05	0,07	0,00	0,10	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	569.346.320,31	84,91					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	56.930.888,10	8,49	0,00	5,00	30,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	56.930.888,10	8,49					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	23.786.229,33	3,55	0,00	4,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	23.786.229,33	3,55					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	20.469.227,55	3,05	0,00	4,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	20.469.227,55	3,05					15,00
Total		670.532.665,29	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	0,49 46,08	6,83 89,45	2,06 62,41	5,58 86,58	9,66 71,12	1.707.437,22	22.527.227,97
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,89 83,19	7,93 103,79	3,52 106,62	6,81 105,67	12,77 94,00	728.999,17	2.724.131,87
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,08 100,68	7,58 99,26	3,42 103,63	6,41 99,50	13,64 100,43	1.401.275,43	9.896.718,41
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	0,96 89,76	2,22 29,00	1,30 39,35	1,60 24,78	-11,77 -86,66	4.688,48	10.663,16
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	3,16 -0,11	9,32 -1,81	15,86 -0,91	5,60 -1,90	12,69 -5,51	2.011.427,69	6.278.503,59
Artigo 9º II % do CDI	0,00 0,00	6,13 80,28	0,00 0,00	1,95 30,30	3,36 24,71	0,00	160.631,81
Artigo 9º III % do CDI	2,12 197,37	16,95 221,89	8,55 258,83	12,11 187,96	7,35 54,09	492.836,28	5.089.494,82
Artigo 10º I % do CDI	0,99 92,57	13,36 174,83	3,51 106,15	6,52 101,12	10,05 73,97	201.134,37	2.260.300,49
CARAGUATATUBA (Total)						6.547.798,64	48.947.672,12

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%)	20.181.117,14	0,00	0,00	0,00	20.279.005,19	97.888,05	277.749,91
NTN-B 150525 (5,980000%)	10.300.923,43	0,00	0,00	0,00	10.351.182,86	50.259,43	677.437,99
NTN-B 150527 (6,090000%)	5.091.235,60	0,00	0,00	0,00	5.116.541,82	25.306,22	337.943,67
NTN-B 150535 (5,560000%)	16.830.448,65	0,00	0,00	0,00	16.907.025,08	76.576,43	1.069.158,74
NTN-B 150535 (5,821000%)	19.672.189,65	0,00	0,00	0,00	19.765.768,82	93.579,17	1.277.353,31
NTN-B 150545 (5,710000%)	32.144.465,53	0,00	0,00	0,00	32.294.574,89	150.109,36	2.067.480,04
NTN-B 150545 (5,760000%)	10.686.971,80	0,00	0,00	0,00	10.737.297,52	50.325,72	690.268,11
NTN-B 150545 (5,781000%)	10.668.898,31	0,00	0,00	0,00	10.719.315,06	50.416,75	690.324,46
NTN-B 150555 (5,815000%)	10.645.132,11	0,00	0,00	0,00	10.695.725,69	50.593,58	690.684,14

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150555 (5,850000%)	10.292.658,87	0,00	0,00	0,00	10.341.878,42	49.219,55	669.894,20
NTN-B 150824 (5,892000%)	5.552.596,70	0,00	0,00	0,00	5.579.324,50	26.727,80	357.189,01
NTN-B 150824 (5,910000%)	10.494.905,94	0,00	0,00	0,00	10.545.598,76	50.692,82	676.268,97
NTN-B 150824 (6,090000%)	5.242.424,87	0,00	0,00	0,00	5.268.458,70	26.033,83	342.521,89
NTN-B 150824 (6,440000%)	20.453.047,19	0,00	0,00	0,00	20.560.369,46	107.322,27	1.139.873,04
NTN-B 150824 (6,480000%)	21.294.095,58	0,00	0,00	0,00	21.406.391,60	112.296,02	1.434.146,63
NTN-B 150824 (6,680000%)	5.248.597,29	0,00	0,00	0,00	5.277.119,27	28.521,98	359.038,39
NTN-B 150824 (6,990300%)	30.323.957,11	0,00	0,00	0,00	30.496.120,84	172.163,73	494.744,33
NTN-B 150826 (6,350000%)	15.293.035,29	0,00	0,00	0,00	15.372.214,84	79.179,55	808.942,11
NTN-B 150828 (6,350000%)	15.293.464,40	0,00	0,00	0,00	15.372.645,20	79.180,80	808.971,46
NTN-B 150830 (5,708000%)	10.960.379,69	0,00	0,00	0,00	11.011.536,06	51.156,37	694.483,47
NTN-B 150840 (5,650000%)	932.428,65	0,00	0,00	0,00	936.737,87	4.309,22	58.791,62
NTN-B 150840 (5,770000%)	10.974.457,78	0,00	0,00	0,00	11.026.219,01	51.761,23	698.886,61
NTN-B 150850 (5,713000%)	11.025.730,43	0,00	0,00	0,00	11.077.245,59	51.515,16	698.812,77
NTN-B 150850 (5,780000%)	10.656.335,75	0,00	0,00	0,00	10.706.688,55	50.352,80	679.159,75
NTN-B 150850 (5,815000%)	10.950.127,19	0,00	0,00	0,00	11.002.164,05	52.036,86	699.897,54
NTN-B 150850 (5,916000%)	3.930.434,55	0,00	0,00	0,00	3.949.427,57	18.993,02	253.306,82
NTN-B 150850 (5,920000%)	10.527.173,96	0,00	0,00	0,00	10.578.093,46	50.919,50	678.780,95
					347.374.670,68	1.707.437,22	

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	12.365.322,09	0,00	0,00	0,00	12.496.212,65	130.890,56	884.832,50
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	5.000.000,00	0,00	0,00	5.031.390,76	31.390,76	31.390,76
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	10.000.000,00	0,00	0,00	10.047.953,80	47.953,80	47.953,80
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	16.799.185,26	10.000.000,00	0,00	0,00	27.013.709,30	214.524,04	643.433,70
FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	2.247.465,28	10.000.000,00	0,00	0,00	12.337.242,58	89.777,30	142.696,12
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	444.471,70	873,98	0,00	0,00	450.081,28	4.735,60	31.991,52
SANTANDER RF ATIVO FIC	0,00	616.304,14	0,00	0,00	621.003,62	4.699,48	4.699,48

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	615.140,16	0,00	-616.304,14	0,00	0,00	1.163,98	40.967,16
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	19.416.841,23	0,00	0,00	0,00	19.620.704,88	203.863,65	766.788,28
					87.618.298,87	728.999,17	

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	30.846.584,45	21.459.661,25	0,00	0,00	52.803.498,11	497.252,41	2.082.675,87
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	21.101.436,63	0,00	-5.000.000,00	0,00	16.288.851,50	187.414,87	1.288.851,50
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	65.316.226,21	4.976.663,33	-34.127.061,98	0,00	36.600.700,72	434.873,16	3.776.704,37
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	27.884.685,68	1.952,71	-7.000.000,00	0,00	21.130.441,21	243.802,82	2.240.212,28
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	0,00	7.000.000,00	0,00	0,00	7.037.932,17	37.932,17	37.967,34
					133.861.423,71	1.401.275,43	

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	487.238,57	0,00	0,00	0,00	491.927,05	4.688,48	10.663,16
					491.927,05	4.688,48	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES DIVIDENDOS	1.546.175,84	0,00	0,00	0,00	1.588.562,81	42.386,97	147.348,12
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	24.674.470,96	0,00	-20.000.000,00	0,00	5.101.895,89	427.424,93	1.935.926,46
BRADERCO F I A SELECTION	5.600.389,59	0,00	0,00	0,00	5.748.143,00	147.753,41	443.315,53
BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	5.796.521,69	0,00	0,00	0,00	5.965.197,49	168.675,80	403.128,02
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	7.610.811,98	0,00	0,00	0,00	7.874.903,60	264.091,62	788.089,72
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	14.844.645,89	0,00	0,00	0,00	15.251.872,59	407.226,70	1.770.874,24
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	5.990.503,61	0,00	0,00	0,00	6.147.015,25	156.511,64	61.116,64
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	8.855.940,85	0,00	0,00	0,00	9.253.297,47	397.356,62	673.224,18
					56.930.888,10	2.011.427,69	

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	23.293.393,05	0,00	0,00	0,00	23.786.229,33	492.836,28	5.089.494,82
					23.786.229,33	492.836,28	

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	20.268.093,18	0,00	0,00	0,00	20.469.227,55	201.134,37	1.134.222,15
					20.469.227,55	201.134,37	

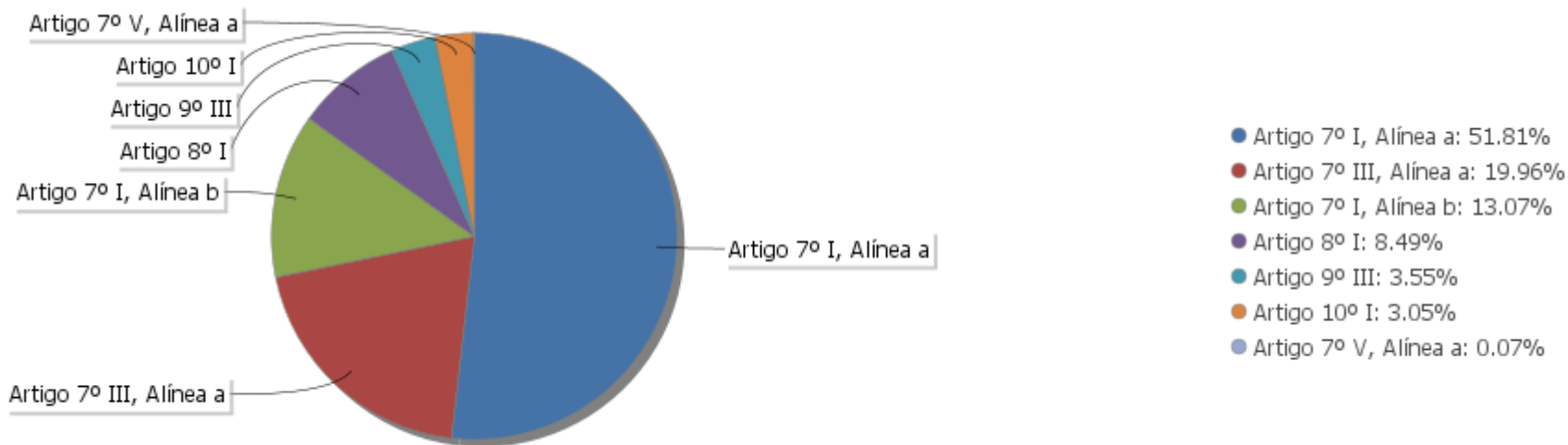
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

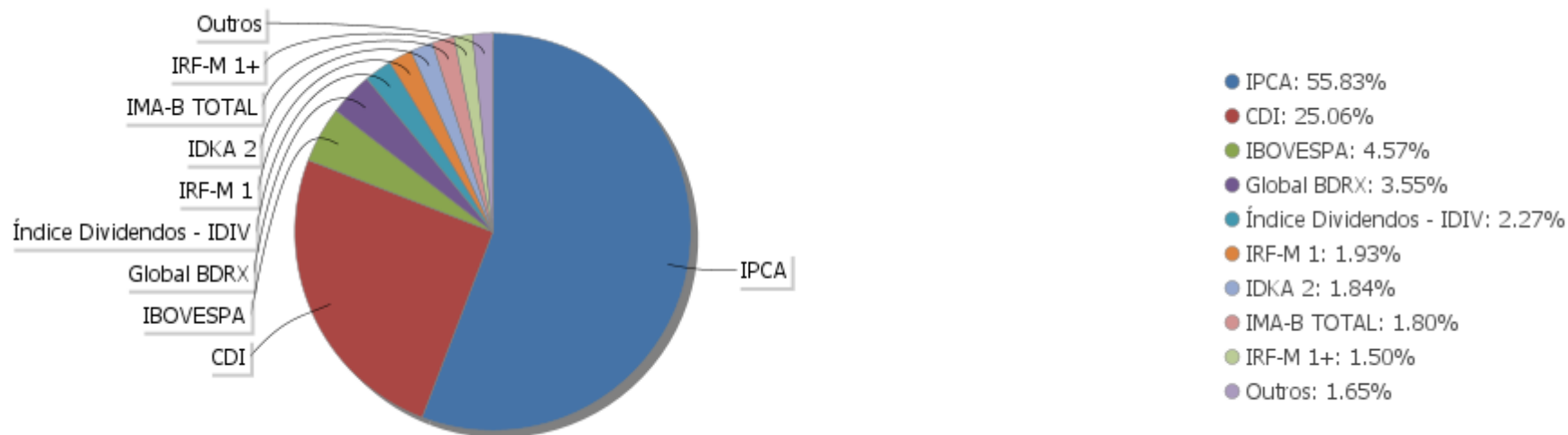
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	284.630.905,70	42,45	284.630.905,70	42,45	
de 31 dias a 365 dias	38.527.088,91	5,75	323.157.994,61	48,19	
acima de 365 dias	347.374.670,68	51,81	670.532.665,29	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

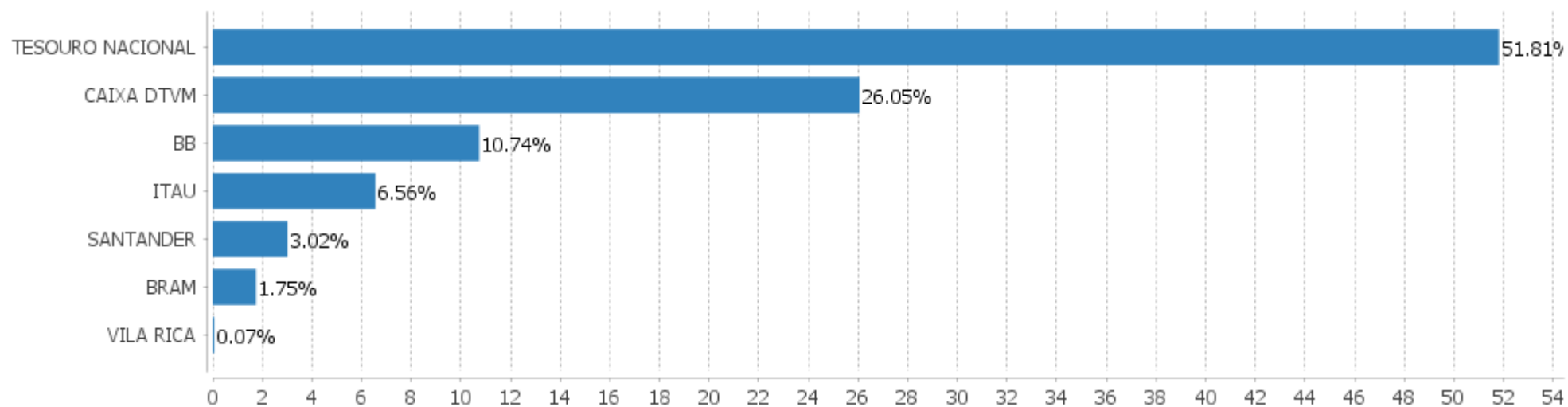


Alocação Por Estratégia



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	0,99						8,00
IPCA + 5,03%	0,96	1,19	1,16	0,96	0,66	0,33	0,53						5,94
p.p. indexador	0,79	-1,30	-0,20	0,00	1,00	1,20	0,46						2,06
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	26	47,27
Meses abaixo - Meta Atuarial	29	52,73

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

Relatório

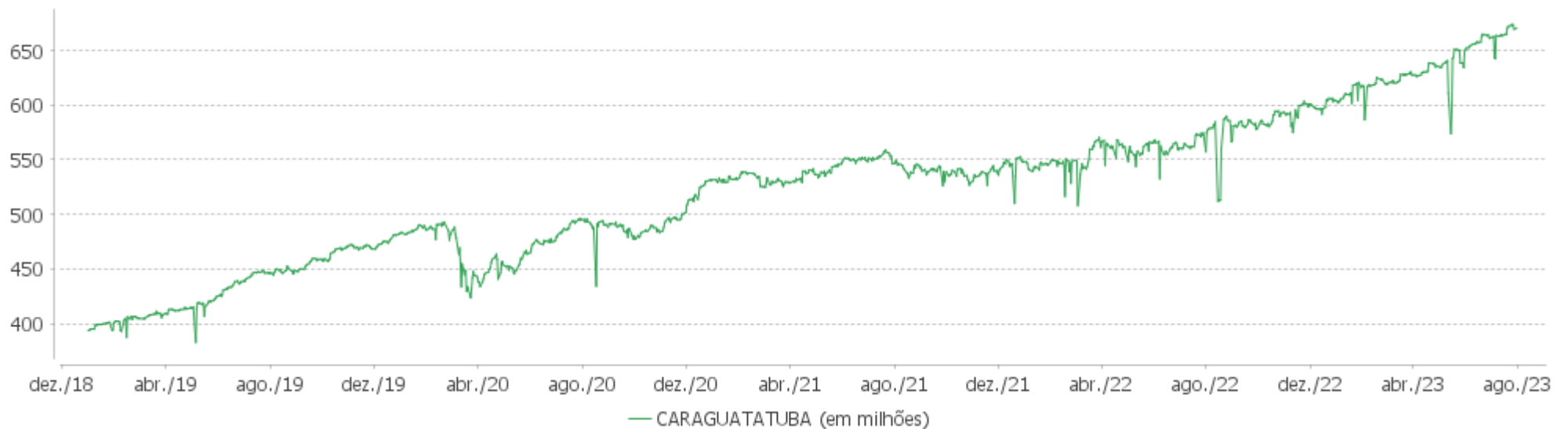
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	4,24	1,53	2,71	1,87
06 meses	6,14	4,94	1,21	1,91
12 meses	10,64	9,18	1,46	3,18
24 meses	10,40	26,39	-15,99	4,83
36 meses	15,52	45,46	-29,94	5,21
48 meses	22,54	57,69	-35,15	7,72
Desde 31/12/2018	33,92	67,05	-33,13	7,30

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

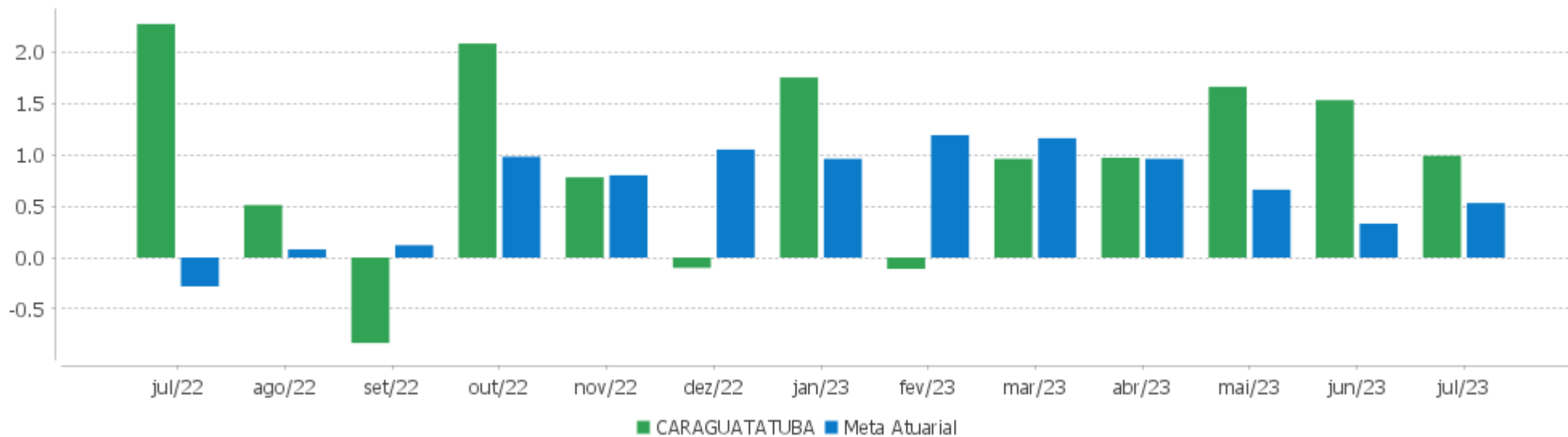


Patrimônio Líquido



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.	0,49 0,37	3,75 0,76	-0,89 -1,16	2,53 0,08	3,45 -0,54		
NTN-B 150535 (5,560000%) Var. IPCA p.p.	0,45 0,33	6,59 3,60	1,95 1,68	5,37 2,92	9,26 5,27	24,48 10,02	34,95 10,19
NTN-B 150840 (5,650000%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,34	6,65 3,65	1,97 1,70	5,41 2,96	9,35 5,36	24,69 10,23	35,28 10,52
NTN-B 150830 (5,708000%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,35	6,68 3,69	1,98 1,71	5,44 2,99	9,41 5,42	21,25 6,79	31,47 6,72
NTN-B 150840 (5,770000%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,35	6,72 3,72	2,00 1,73	5,47 3,02	9,48 5,48	21,44 6,97	31,79 7,03
NTN-B 150826 (6,350000%) Var. IPCA p.p.	0,52 0,40	7,04 4,05	2,14 1,87	5,75 3,29	6,87 2,88		
NTN-B 150824 (6,680000%) Var. IPCA p.p.	0,54 0,42	7,24 4,25	2,22 1,95	5,91 3,46	7,21 3,21	19,65 5,18	
NTN-B 150535 (5,821000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,75 3,75	2,01 1,74	5,50 3,05	9,53 5,54	25,02 10,55	35,67 10,91
NTN-B 150850 (5,920000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,80 3,81	2,03 1,76	5,54 3,09	9,63 5,64	21,65 7,19	32,11 7,35
NTN-B 150545 (5,781000%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,35	6,72 3,73	2,00 1,73	5,48 3,03	9,49 5,49	24,96 10,50	35,65 10,89
NTN-B 150824 (6,090000%) Var. IPCA p.p.	0,50 0,38	6,90 3,91	2,07 1,80	5,63 3,17	6,65 2,66	18,47 4,01	
NTN-B 150824 (5,892000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,79 3,79	2,03 1,76	5,53 3,08	9,60 5,61	21,55 7,09	31,89 7,13
NTN-B 150824 (5,910000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,80 3,80	2,03 1,76	5,54 3,09	6,48 2,48	18,10 3,64	
NTN-B 150824 (6,440000%) Var. IPCA p.p.	0,52 0,40	7,10 4,11	2,16 1,89	5,80 3,35	6,98 2,99		
NTN-B 150555 (5,850000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,76 3,77	2,02 1,75	5,51 3,06	9,56 5,57	25,07 10,61	35,81 11,05
NTN-B 150850 (5,916000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,80 3,81	2,03 1,76	5,54 3,09	9,63 5,63	21,68 7,22	32,13 7,37
NTN-B 150850 (5,713000%)	0,47	6,68	1,98	5,44	9,42	21,40	31,79

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.	0,35	3,69	1,71	2,99	5,42	6,94	7,03
NTN-B 150527 (6,090000%) Var. IPCA p.p.	0,50 0,38	6,90 3,91	2,07 1,80	5,63 3,18	9,80 5,81	21,95 7,49	
NTN-B 150850 (5,815000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,74 3,75	2,01 1,74	5,49 3,04	9,52 5,53	21,54 7,08	31,96 7,20
NTN-B 150824 (6,990300%) Var. IPCA p.p.	0,57 0,45	4,30 1,31	2,29 2,02	2,98 0,53	4,38 0,38		
NTN-B 150828 (6,350000%) Var. IPCA p.p.	0,52 0,40	7,04 4,05	2,14 1,87	5,74 3,29	6,85 2,86		
NTN-B 150545 (5,760000%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,35	6,71 3,72	1,99 1,72	5,47 3,02	9,47 5,47	24,92 10,46	35,60 10,84
NTN-B 150525 (5,980000%) Var. IPCA p.p.	0,49 0,37	6,84 3,84	2,05 1,78	5,57 3,12	9,70 5,71	21,75 7,28	32,19 7,43
NTN-B 150824 (6,480000%) Var. IPCA p.p.	0,53 0,41	7,12 4,13	2,17 1,90	5,81 3,36	7,02 3,03	19,25 4,79	29,97 5,21
NTN-B 150555 (5,815000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,74 3,75	2,01 1,74	5,49 3,04	9,52 5,53	25,04 10,58	35,77 11,01
NTN-B 150850 (5,780000%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,35	6,72 3,73	2,00 1,73	5,48 3,03	9,49 5,49	21,49 7,03	31,90 7,14
NTN-B 150545 (5,710000%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,35	6,68 3,69	1,98 1,71	5,44 2,99	9,41 5,42	24,83 10,36	35,48 10,72
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	0,80 -0,02	12,14 -0,19	6,40 -0,04	11,33 -0,20	17,85 -0,50	18,64 -0,91	14,36 -1,19
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	1,06 -0,00	7,70 -0,11	3,37 -0,07	6,56 -0,09	13,67 -0,17	22,59 -0,48	24,77 -0,75
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,80 -0,01	12,14 -0,13	5,79 -0,04	12,17 -0,09	15,29 -0,16	18,72 -0,49	21,43 -0,79
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,95 -0,02	7,94 -0,15	2,56 -0,06	6,47 -0,12	11,05 -0,23	21,95 -0,52	27,83 -0,83
SANTANDER RF ATIVO FIC % do CDI	0,79 73,55	8,60 112,52	4,20 127,22	7,59 117,79	13,04 96,02	21,18 87,34	22,72 83,29
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,89 0,77	9,23 6,23	4,88 4,61	8,11 5,66	14,71 10,72	20,86 6,40	21,94 -2,81
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	1,06 -0,01	7,62 -0,19	3,38 -0,06	6,49 -0,15	13,50 -0,34	22,42 -0,66	24,35 -1,16
FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,95	10,75	5,52	9,94			

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IDKA 2 p.p.	-0,03	2,92	3,26	3,63			
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI % do CDI	1,05 97,94	7,57 99,06	3,30 99,84	6,38 98,99	13,48 99,20	24,09 99,34	26,67 97,80
FIDC ITALIA SENIOR % do CDI	0,96 89,76	-13,30 -174,04	1,30 39,35	1,60 24,78	-11,77 -86,66	21,04 86,78	1.403,08 5.144,40
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI % do CDI	1,15 107,28	7,68 100,55	3,52 106,52	6,48 100,52	13,84 101,92	25,59 105,53	28,97 106,22
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,76 -0,04	12,59 0,32	6,21 0,38	12,66 0,39	14,67 -0,78	17,71 -1,50	20,27 -1,96
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,06 99,30	7,57 99,07	3,34 101,26	6,37 98,91	13,57 99,91	24,57 101,31	27,69 101,54
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	1,14 106,45	7,64 99,96	3,48 105,24	6,47 100,43	13,70 100,87	24,83 102,40	27,84 102,08
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	1,15 106,99	7,72 101,10	3,59 108,60	6,55 101,68	13,76 101,29	24,97 102,95	27,99 102,61
BRADERCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	2,64 -0,63	8,36 -2,77	17,40 0,63	4,26 -3,24	15,00 -3,20	-4,88 -5,00	10,97 -7,52
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p.	3,47 0,20	11,12 -0,00	16,28 -0,48	7,70 0,19	13,56 -4,65	-2,35 -2,46	10,42 -8,07
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	2,61 -0,65	1,00 -10,12	8,70 -8,07	-1,38 -8,88	9,73 -8,48	-10,65 -10,77	10,56 -7,93
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	4,49 1,22	7,85 -3,28	18,29 1,53	3,61 -3,89	1,72 -16,49		
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	2,74 -0,10	13,14 0,73	13,61 0,80	9,28 3,12	17,20 -1,53	9,32 -8,83	25,60 -9,33
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	3,45 -0,07	10,18 -1,11	17,22 -0,39	6,33 -1,08	15,96 -1,77	-4,59 -2,30	14,08 -3,94
BB AÇÕES DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	2,74 -0,52	10,22 -0,90	13,43 -3,34	6,27 -1,23	14,38 -3,82	0,76 0,65	10,32 -8,17
BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. SMALL CAP p.p.	2,91 -0,21	7,25 -9,55	20,16 -6,50	3,77 -9,71	6,71 -10,76	-19,09 1,70	-4,74 0,11
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	2,12 -0,01	16,95 -0,64	8,55 -0,13	12,11 -0,55	7,35 -1,22	-4,52 -1,52	24,72 -4,48
FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP % do CDI	0,99 92,57	7,62 99,74	3,61 109,39	6,45 100,13	13,69 100,79	25,44 104,91	27,81 101,96
CARAGUATATUBA	0,99	8,00	4,24	6,14	10,64	10,40	15,52

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA + 4,99% p.p.	0,46	2,06	2,71	1,21	1,44	-15,82	-28,91
CDI	1,07	7,64	3,30	6,44	13,58	24,25	27,27
IBOVESPA	3,27	11,13	16,77	7,50	18,20	0,12	18,49
INPC + 6,00%	0,40	6,09	1,66	5,07	9,71	28,04	49,03
IPCA + 6,00%	0,61	6,51	1,76	5,41	10,21	28,55	48,45

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 IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
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	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du		1,72

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
RPPS						
FIDC ITALIA SENIOR	Não se aplica	Não se aplica				
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du	O 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	1,90
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 RENDA FIXA IMA-B ATIVO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,50
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,18
SANTANDER RF ATIVO FIC	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
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	1,07	7,81	3,44	6,64	13,84	23,07	25,52	32,43	42,08
IRF-M 1+	0,82	12,33	6,44	11,52	18,36	19,55	15,56	29,44	53,47
IRF-M TOTAL	0,89	10,59	5,29	9,67	16,44	20,41	18,73	30,37	50,29
IMA-B 5	0,97	8,08	2,62	6,60	11,29	22,46	28,66	40,02	59,74
IMA-B 5+	0,73	15,74	8,42	17,22	19,37	15,53	15,93	24,98	73,16
IMA-B TOTAL	0,81	12,27	5,83	12,27	15,46	19,21	22,22	32,19	68,50
IMA-GERAL TOTAL	0,98	9,70	4,55	8,94	14,59	21,41	23,44	32,48	52,87
IDKA 2	0,98	7,84	2,26	6,31	10,55	21,73	28,89	40,07	57,72
IDKA 20	0,76	23,26	14,33	29,18	28,75	8,83	7,52	12,84	82,11
CDI	1,07	7,64	3,30	6,44	13,58	24,25	27,27	32,66	41,08

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,27	11,13	16,77	7,50	18,20	0,12	18,49	19,77	53,93
IBRX 100	3,32	10,13	16,52	6,40	16,39	-2,60	17,59	20,13	57,20
IBRX 50	3,70	8,84	16,09	5,28	16,73	-1,88	19,92	20,20	51,93
SMALL CAP	3,12	16,80	26,65	13,48	17,47	-20,79	-4,84	2,63	47,75
Índice Consumo - ICON	2,22	10,79	25,68	7,60	0,74	-37,60	-35,76	-27,95	-0,79
Índice Dividendos - IDIV	2,84	12,41	12,81	6,16	18,72	18,15	34,93	39,66	97,67

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	1,45	8,61	4,36	4,67	1,54	-3,34	27,84	93,91	105,76

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	1,33	11,51	11,86	13,33	13,61	13,21	16,98	20,22	48,40

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	1,88	6,14	2,36	1,41	1,33	-9,61	16,75	69,84	71,77

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,12	2,99	0,27	2,45	3,99	14,46	24,76	27,64	31,75
INPC	-0,09	2,59	0,17	2,13	3,53	14,01	25,24	28,62	32,68
IGPM	-0,72	-5,15	-4,43	-5,35	-7,72	1,58	35,94	48,54	58,04
SELIC	1,07	7,64	3,30	6,44	13,58	24,25	27,27	32,66	41,08

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,45	5,34	1,27	4,43	8,14	23,77	40,25	49,25	60,17
IPCA + 5,00%	0,53	5,93	1,52	4,92	9,17	26,15	44,31	55,05	67,99
IPCA + 5,50%	0,57	6,22	1,64	5,16	9,69	27,35	46,37	58,02	72,01
IPCA + 5,89%	0,60	6,44	1,74	5,35	10,09	28,29	47,99	60,36	75,20
IPCA + 6,00%	0,61	6,51	1,76	5,41	10,21	28,55	48,45	61,03	76,11
INPC + 4,00%	0,24	4,94	1,17	4,10	7,65	23,27	40,79	50,39	61,30
INPC + 6,00%	0,40	6,09	1,66	5,07	9,71	28,04	49,03	62,26	77,35

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%)	20.279.005,19	5,940000	20.333.217,50	5,773600	54.212,31
NTN-B 150525 (5,980000%)	10.351.182,86	5,980000	10.384.704,31	5,773600	33.521,45
NTN-B 150527 (6,090000%)	5.116.541,82	6,090000	5.269.808,13	5,175800	153.266,31
NTN-B 150535 (5,560000%)	16.907.025,08	5,560000	17.358.636,30	5,237600	451.611,22
NTN-B 150535 (5,821000%)	19.765.768,82	5,821000	20.727.992,12	5,237600	962.223,30
NTN-B 150545 (5,710000%)	32.294.574,89	5,710000	33.486.335,08	5,406400	1.191.760,19
NTN-B 150545 (5,760000%)	10.737.297,52	5,760000	11.199.533,28	5,406400	462.235,76
NTN-B 150545 (5,781000%)	10.719.315,06	5,781000	11.208.514,46	5,406400	489.199,40
NTN-B 150555 (5,815000%)	10.695.725,69	5,815000	11.297.848,69	5,426800	602.123,00
NTN-B 150555 (5,850000%)	10.341.878,42	5,850000	10.980.238,48	5,426800	638.360,06
NTN-B 150824 (5,892000%)	5.579.324,50	5,892000	5.527.906,31	6,880000	-51.418,19
NTN-B 150824 (5,910000%)	10.545.598,76	5,910000	10.450.475,35	6,880000	-95.123,41
NTN-B 150824 (6,090000%)	5.268.458,70	6,090000	5.229.441,41	6,880000	-39.017,29
NTN-B 150824 (6,440000%)	20.560.369,46	6,440000	20.476.373,87	6,880000	-83.995,59
NTN-B 150824 (6,480000%)	21.406.391,60	6,480000	21.325.527,54	6,880000	-80.864,06
NTN-B 150824 (6,680000%)	5.277.119,27	6,680000	5.267.274,99	6,880000	-9.844,28
NTN-B 150824 (6,990300%)	30.496.120,84	6,990300	30.527.494,77	6,880000	31.373,93
NTN-B 150826 (6,350000%)	15.372.214,84	6,350000	15.831.771,68	5,222800	459.556,84
NTN-B 150828 (6,350000%)	15.372.645,20	6,350000	16.167.677,36	5,117200	795.032,16
NTN-B 150830 (5,708000%)	11.011.536,06	5,708000	11.395.590,03	5,076000	384.053,97
NTN-B 150840 (5,650000%)	936.737,87	5,650000	966.801,95	5,342400	30.064,08
NTN-B 150840 (5,770000%)	11.026.219,01	5,770000	11.519.921,87	5,342400	493.702,86
NTN-B 150850 (5,713000%)	11.077.245,59	5,713000	11.476.226,27	5,442100	398.980,68
NTN-B 150850 (5,780000%)	10.706.688,55	5,780000	11.188.635,88	5,442100	481.947,33
NTN-B 150850 (5,815000%)	11.002.164,05	5,815000	11.549.265,11	5,442100	547.101,06
NTN-B 150850 (5,916000%)	3.949.427,57	5,916000	4.199.732,77	5,442100	250.305,20
NTN-B 150850 (5,920000%)	10.578.093,46	5,920000	11.257.109,78	5,442100	679.016,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
140	03/07/2023	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	0,00	616.304,14	18.379,07160576	33,5329310000
141	03/07/2023	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,00	5.000.000,00	2.740.765,26537400	1,8243080000
142	03/07/2023	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	10.000.000,00	0,00	5.502.462,90239500	1,8173680000
143	03/07/2023	FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	10.000.000,00	0,00	8.968.810,95988600	1,1149750000
144	03/07/2023	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.000.000,00	0,00	1.161.545,14310352	4,3046110000
145	03/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	10.000.000,00	0,00	3.416.972,85590900	2,9265670000
146	03/07/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	30.000.000,00	6.393.537,58153800	4,6922380000
147	03/07/2023	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	7.000.000,00	0,00	521.734,29548094	13,4167910000
148	03/07/2023	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,00	7.000.000,00	1.733,22746896	4,038,7082050000
149	04/07/2023	SANTANDER RF ATIVO FIC	616.304,14	0,00	39.553,12927008	15,5816784000
150	05/07/2023	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	0,00	20.000.000,00	6.502.145,87995959	3,0759076110
151	05/07/2023	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	873,98	0,00	21,09158344	41,4373820000
152	07/07/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	20.000.000,00	0,00	6.913.135,21750389	2,8930433690
153	07/07/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	194.487,41	0,00	67.225,88817161	2,8930433690
154	10/07/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	73.000,00	15.515,57405600	4,7049500000
155	10/07/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.961,46	841,97684900	4,7049500000
156	10/07/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.379,03	0,00	2.894,81370100	2,8944971470
157	11/07/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	32.351,89	0,00	6.872,56168400	4,7073990000
158	11/07/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.784,78	0,00	3.033,46205300	2,8959584280
159	11/07/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	46.721,45	0,00	16.133,32896918	2,8959584280
160	20/07/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	657.778,97	0,00	139.214,36607819	4,7249360000
161	20/07/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.876.959,65	0,00	820.531,67492600	4,7249360000
162	20/07/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.201.288,58	0,00	413.370,23353433	2,9060838990
163	21/07/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	376.736,49	0,00	79.691,67365000	4,7274260000
164	28/07/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	207.950,93	43.863,67454000	4,7408460000
165	28/07/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	32.836,33	0,00	6.926,25957477	4,7408460000
166	28/07/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.842.149,59	810.435,43513200	4,7408460000
167	31/07/2023	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	1.952,71	0,00	0,47824677	4,083,0594920000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
		Total	69.055.455,41	66.743.366,12		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 4.801.751,94

Value-At-Risk: 0,72%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CARAGUATATUBA		0,72	0,72			670.532.665,29	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,15%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150525 (5,940000%)		0,25	-0,00	0,25			20.279.005,19	3,02
NTN-B 150525 (5,980000%)		0,12	-0,00	0,09			10.351.182,86	1,54
NTN-B 150527 (6,090000%)		0,11	-0,00	0,09			5.116.541,82	0,76
NTN-B 150535 (5,560000%)		0,11	-0,00	0,09			16.907.025,08	2,52
NTN-B 150535 (5,821000%)		0,11	-0,00	0,09			19.765.768,82	2,95
NTN-B 150545 (5,710000%)		0,11	-0,00	0,09			32.294.574,89	4,82
NTN-B 150545 (5,760000%)		0,11	-0,00	0,09			10.737.297,52	1,60
NTN-B 150545 (5,781000%)		0,11	-0,00	0,09			10.719.315,06	1,60
NTN-B 150555 (5,815000%)		0,11	-0,00	0,09			10.695.725,69	1,60
NTN-B 150555 (5,850000%)		0,14	-0,00	0,11			10.341.878,42	1,54
NTN-B 150824 (5,892000%)		0,11	-0,00	0,09			5.579.324,50	0,83
NTN-B 150824 (5,910000%)		0,11	-0,00	0,09			10.545.598,76	1,57
NTN-B 150824 (6,090000%)		0,11	-0,00	0,09			5.268.458,70	0,79
NTN-B 150824 (6,440000%)		0,11	-0,00	0,09			20.560.369,46	3,07
NTN-B 150824 (6,480000%)		0,11	-0,00	0,09			21.406.391,60	3,19
NTN-B 150824 (6,680000%)		0,11	-0,00	0,09			5.277.119,27	0,79
NTN-B 150824 (6,990300%)		0,11	-0,00	0,09			30.496.120,84	4,55
NTN-B 150826 (6,350000%)		0,12	-0,00	0,09			15.372.214,84	2,29
NTN-B 150828 (6,350000%)		0,13	-0,00	0,10			15.372.645,20	2,29
NTN-B 150830 (5,708000%)		0,11	-0,00	0,09			11.011.536,06	1,64

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (5,650000%)		0,11	-0,00	0,09			936.737,87	0,14
NTN-B 150840 (5,770000%)		0,11	-0,00	0,09			11.026.219,01	1,64
NTN-B 150850 (5,713000%)		0,11	-0,00	0,09			11.077.245,59	1,65
NTN-B 150850 (5,780000%)		0,11	-0,00	0,09			10.706.688,55	1,60
NTN-B 150850 (5,815000%)		0,11	-0,00	0,09			11.002.164,05	1,64
NTN-B 150850 (5,916000%)		0,11	-0,00	0,09			3.949.427,57	0,59
NTN-B 150850 (5,920000%)		0,13	-0,00	0,11			10.578.093,46	1,58
Sub-total	0,06	0,11	-0,00		-8,99	0,49	347.374.670,68	51,81

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		1,43	0,01	0,89			12.337.242,58	1,84
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI		0,01	0,00	0,01			19.620.704,88	2,93
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI		0,16	-0,00	0,24			450.081,28	0,07
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,16	0,00	0,01			12.496.212,65	1,86
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,53	0,00	0,14			5.031.390,76	0,75
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP		1,74	0,01	0,03			10.047.953,80	1,50
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,80	0,01	0,82			27.013.709,30	4,03
SANTANDER RF ATIVO FIC		0,86	0,00	0,86			621.003,62	0,09
Sub-total	1,53	0,70	0,04		-0,12	0,89	87.618.298,87	13,07

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO		1,71	0,01	0,21			7.037.932,17	1,05
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,02	-0,00	0,02			36.600.700,72	5,46
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI		0,03	-0,00	0,03			21.130.441,21	3,15
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	0,00	0,02			52.803.498,11	7,87
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI		0,04	0,00	0,04			16.288.851,50	2,43
Sub-total	0,22	0,09	0,01		0,03	1,08	133.861.423,71	19,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
-------	-----------------------------	--------------------	---------------------	---------------------	--------	-------	------------	------------

Sub-total

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC ITALIA SENIOR		0,08	0,00	0,08			491.927,05	0,07
Sub-total	3,32	0,08	0,00		-0,03	0,96	491.927,05	0,07

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,90%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES DIVIDENDOS		7,48	0,02	2,41			1.588.562,81	0,24
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS		9,67	0,08	3,14			5.965.197,49	0,89
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		8,65	0,06	0,41			5.101.895,89	0,76
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS		9,03	0,10	1,28			7.874.903,60	1,17
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		7,05	0,14	1,61			15.251.872,59	2,27
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		7,06	0,05	3,68			6.147.015,25	0,92
BRADESCO F I A SELECTION		7,85	0,06	2,77			5.748.143,00	0,86
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		9,17	0,12	3,49			9.253.297,47	1,38
Sub-total	15,17	7,90	0,63		0,14	3,16	56.930.888,10	8,49

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,85%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		6,85	0,04	0,55			23.786.229,33	3,55
Sub-total	11,58	6,85	0,04		0,09	2,12	23.786.229,33	3,55

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,17%

Artigo 10º I

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP		0,17	0,00	0,17			20.469.227,55	3,05
Sub-total	0,22	0,17	0,00		-0,37	0,99	20.469.227,55	3,05