



LDB
EMPRESAS

CARAGUATATUBA
SETEMBRO 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 29.09.2023.

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

85,58%

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%)	4,12	0,04	0,71	2,88	20.576.430,63	3,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,980000%)	0,37	0,05	0,71	8,41	10.503.592,01	1,55
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,090000%)	0,37	0,04	0,71	8,50	5.192.843,59	0,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,560000%)	0,37	0,04	0,68	8,09	17.144.470,27	2,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,821000%)	0,37	0,04	0,70	8,29	20.051.802,99	2,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,710000%)	0,37	0,04	0,69	8,21	32.756.064,76	4,82
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,760000%)	0,37	0,04	0,69	8,24	10.891.611,30	1,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,781000%)	0,37	0,04	0,70	8,26	10.873.740,77	1,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,815000%)	0,37	0,04	0,70	8,29	10.850.399,54	1,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,850000%)	0,39	0,01	0,70	8,31	10.492.063,19	1,55
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,892000%)	0,37	0,04	0,70	8,34	5.498.366,60	0,81
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,910000%)	0,53	0,04	0,71	8,36	10.392.868,28	1,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,090000%)	0,53	0,04	0,73	8,49	5.193.368,50	0,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,440000%)	0,37	0,04	0,75	7,49	20.276.987,30	2,99
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,480000%)	0,37	0,04	0,75	8,79	21.112.277,94	3,11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,680000%)	0,59	0,04	0,76	8,95	5.206.037,50	0,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,990300%)	2,98	0,04	0,79	3,31	30.097.795,19	4,43
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,350000%)	0,37	0,03	0,74	7,16	15.155.794,94	2,23
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (6,350000%)	0,37	0,03	0,74	7,16	15.154.122,71	2,23
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,708000%)	0,37	0,04	0,69	8,20	10.853.488,90	1,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,650000%)	0,37	0,04	0,69	8,16	923.743,43	0,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,770000%)	0,37	0,04	0,70	8,25	10.871.575,05	1,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,713000%)	0,37	0,04	0,69	8,21	10.925.277,14	1,61
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,780000%)	0,37	0,04	0,70	8,26	10.558.353,34	1,55
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,815000%)	0,37	0,04	0,70	8,29	10.848.960,15	1,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,916000%)	0,37	0,04	0,71	8,36	3.893.611,71	0,57
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,920000%)	0,39	0,01	0,71	8,37	10.428.464,92	1,54
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,37	0,04	0,72	8,42	346.724.112,65	51,06

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	3,58	0,39	0,05	4,30	12.444.976,01	1,83	258.718.407,94	4,81
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,03	0,05	0,97	6,36	20.035.855,84	2,95	7.202.755.461,82	0,28
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,36	0,04	0,90	9,93	461.170,96	0,07	355.066.137,06	0,13

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	0,37	0,05	0,90	9,81	12.749.886,88	1,88	7.028.296.292,55	0,18
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,96	0,51	-0,96	-0,70	4.964.759,88	0,73	5.222.821.325,49	0,10
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	4,79	0,42	-0,18	0,85	10.085.051,87	1,49	1.671.746.319,73	0,60
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,42	0,17	0,40	10,36	27.293.861,20	4,02	5.614.661.167,38	0,49
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF ATIVO FIC	1,81	0,24	0,19	1,18	623.597,55	0,09	338.304.183,45	0,18
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,15	0,20	0,41	9,21	88.659.160,19	13,06		

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	5,36	0,57	-1,26	-1,20	6.916.224,08	1,02	470.464.896,61	1,47
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06	0,05	1,03	10,09	43.088.029,30	6,34	14.368.447.188,06	0,30
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,10	0,05	1,05	10,23	21.634.285,55	3,19	5.271.171.485,51	0,41
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,05	0,97	9,87	56.971.651,79	8,39	15.259.689.366,93	0,37
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,08	0,05	1,02	9,12	16.655.102,60	2,45	5.816.586.914,15	0,29
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,13	0,07	0,90	9,78	145.265.293,32	21,39		

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	19,53	11,76	11,76	14,62	551.634,91	0,08	21.682.339,69	2,54
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			19,53	11,76	11,76	14,62	551.634,91	0,08		

Renda Fixa			0,28	0,08	0,73	8,85	581.200.201,07	85,58		
-------------------	--	--	-------------	-------------	-------------	-------------	-----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

7,87%

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	18,57	0,45	1,14	6,83	1.539.581,69	0,23	562.366.558,08	0,27
BRAM	BEM	BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	24,12	0,69	-2,47	-6,15	5.219.799,51	0,77	679.097.352,39	0,77
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	20,21	0,73	0,90	5,40	4.880.271,94	0,72	762.055.294,68	0,64
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	20,70	0,75	0,07	5,49	7.475.769,36	1,10	667.446.272,97	1,12
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,01	0,26	0,54	9,82	14.805.299,05	2,18	941.897.686,26	1,57
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18,39	0,40	-0,20	-4,19	5.831.059,57	0,86	1.385.431.873,10	0,42
BRAM	BEM	BRADERCO F I A SELECTION	19,69	0,90	-0,96	0,53	5.333.120,47	0,79	431.844.819,05	1,23
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	22,55	1,39	-0,56	-2,40	8.374.402,88	1,23	153.528.152,83	5,45
Sub-total Artigo 8º I			19,62	0,67	-0,18	2,65	53.459.304,47	7,87		
Renda Variável			19,62	0,67	-0,18	2,65	53.459.304,47	7,87		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,48%

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	21,98	-0,35	-3,57	16,05	23.601.890,92	3,48	1.999.422.357,55	1,18
Sub-total Artigo 9º III			21,98	-0,35	-3,57	16,05	23.601.890,92	3,48		
Investimentos no Exterior			21,50	-0,35	-3,57	16,03	23.601.890,92	3,48		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

3,07%

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	0,45	0,08	0,86	8,42	20.830.647,67	3,07	1.550.573.133,57	1,34
Sub-total Artigo 10º I			0,45	0,08	0,86	15,36	20.830.647,67	3,07		
Investimentos Estruturados			13,24	0,08	0,86	15,36	20.830.647,67	3,07		
Total			2,60	0,11	0,50	8,92	679.092.044,13	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	346.724.112,65	51,06	0,00	50,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	88.659.160,19	13,06	0,00	17,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	145.265.293,32	21,39	0,00	18,63	60,00	0,00	65,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	551.634,91	0,08	0,00	0,07	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	581.200.201,07	85,58					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	53.459.304,47	7,87	0,00	7,00	30,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	53.459.304,47	7,87					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	23.601.890,92	3,48	0,00	3,80	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	23.601.890,92	3,48					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	20.830.647,67	3,07	0,00	3,50	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	20.830.647,67	3,07					15,00
Total		679.092.044,13	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	0,72 73,52	8,42 84,81	1,99 61,67	4,57 70,60	11,16 83,01	2.466.763,18	27.618.429,26
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,41 42,05	9,21 92,77	2,09 64,86	5,65 87,36	11,83 87,99	361.867,62	3.763.245,23
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,90 92,36	9,78 98,50	3,14 97,56	6,48 100,21	13,34 99,24	1.306.101,91	12.767.967,62
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	11,76 1.206,96	14,62 147,29	13,22 410,48	13,75 212,62	-1,64 -12,24	58.063,80	70.371,02
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-0,18 -0,89	2,65 -3,57	-3,13 -1,84	11,07 -3,34	0,15 -5,78	-97.065,59	2.806.919,96
Artigo 9º II % do CDI	0,00 0,00	6,13 61,78	0,00 0,00	0,54 8,28	14,79 109,98	0,00	160.631,81
Artigo 9º III % do CDI	-3,57 -366,77	16,05 161,64	1,32 41,13	7,00 108,27	20,13 149,74	-875.021,54	4.905.156,41
Artigo 10º I % do CDI	0,86 87,80	15,36 154,71	2,78 86,20	6,28 97,10	26,62 197,98	176.753,53	2.621.720,61
CARAGUATATUBA (Total)						3.397.462,91	54.714.441,92

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%)	20.431.693,78	0,00	0,00	0,00	20.576.430,63	144.736,85	575.175,35
NTN-B 150525 (5,980000%)	10.429.428,32	0,00	0,00	0,00	10.503.592,01	74.163,69	829.847,14
NTN-B 150527 (6,090000%)	5.156.273,47	0,00	0,00	0,00	5.192.843,59	36.570,12	414.245,44
NTN-B 150535 (5,560000%)	17.028.748,42	0,00	0,00	0,00	17.144.470,27	115.721,85	1.306.603,93
NTN-B 150535 (5,821000%)	19.912.541,71	0,00	0,00	0,00	20.051.802,99	139.261,28	1.563.387,48
NTN-B 150545 (5,710000%)	32.531.283,31	0,00	0,00	0,00	32.756.064,76	224.781,45	2.528.969,91
NTN-B 150545 (5,760000%)	10.816.466,86	0,00	0,00	0,00	10.891.611,30	75.144,44	844.581,89
NTN-B 150545 (5,781000%)	10.798.550,33	0,00	0,00	0,00	10.873.740,77	75.190,44	844.750,17
NTN-B 150555 (5,815000%)	10.775.094,59	0,00	0,00	0,00	10.850.399,54	75.304,95	845.357,99

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150555 (5,850000%)	10.418.957,18	0,00	0,00	0,00	10.492.063,19	73.106,01	820.078,97
NTN-B 150824 (5,892000%)	5.459.889,06	0,00	0,00	0,00	5.498.366,60	38.477,54	436.775,73
NTN-B 150824 (5,910000%)	10.319.976,85	0,00	0,00	0,00	10.392.868,28	72.891,43	827.047,18
NTN-B 150824 (6,090000%)	5.155.736,56	0,00	0,00	0,00	5.193.368,50	37.631,94	419.308,12
NTN-B 150824 (6,440000%)	20.126.805,73	0,00	0,00	0,00	20.276.987,30	150.181,57	1.451.177,46
NTN-B 150824 (6,480000%)	20.955.399,68	0,00	0,00	0,00	21.112.277,94	156.878,26	1.759.381,15
NTN-B 150824 (6,680000%)	5.166.564,55	0,00	0,00	0,00	5.206.037,50	39.472,95	440.931,84
NTN-B 150824 (6,990300%)	29.862.720,30	0,00	0,00	0,00	30.097.795,19	235.074,89	983.015,66
NTN-B 150826 (6,350000%)	15.044.536,37	0,00	0,00	0,00	15.155.794,94	111.258,57	1.039.483,32
NTN-B 150828 (6,350000%)	15.042.890,95	0,00	0,00	0,00	15.154.122,71	111.231,76	1.039.485,56
NTN-B 150830 (5,708000%)	10.779.025,09	0,00	0,00	0,00	10.853.488,90	74.463,81	848.369,01
NTN-B 150840 (5,650000%)	917.445,65	0,00	0,00	0,00	923.743,43	6.297,78	71.801,75
NTN-B 150840 (5,770000%)	10.796.480,43	0,00	0,00	0,00	10.871.575,05	75.094,62	854.099,87
NTN-B 150850 (5,713000%)	10.850.286,81	0,00	0,00	0,00	10.925.277,14	74.990,33	853.771,45
NTN-B 150850 (5,780000%)	10.485.351,22	0,00	0,00	0,00	10.558.353,34	73.002,12	830.060,18
NTN-B 150850 (5,815000%)	10.773.654,87	0,00	0,00	0,00	10.848.960,15	75.305,28	855.574,16
NTN-B 150850 (5,916000%)	3.866.294,53	0,00	0,00	0,00	3.893.611,71	27.317,18	309.811,15
NTN-B 150850 (5,920000%)	10.355.252,85	0,00	0,00	0,00	10.428.464,92	73.212,07	830.219,36
					346.724.112,65	2.466.763,18	

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	12.635.643,45	0,00	0,00	0,00	12.749.886,88	114.243,43	1.138.506,73
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.012.735,18	0,00	0,00	0,00	4.964.759,88	-47.975,30	-35.240,12
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	10.103.025,15	0,00	0,00	0,00	10.085.051,87	-17.973,28	85.051,87
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	27.184.083,72	0,00	0,00	0,00	27.293.861,20	109.777,48	923.585,60
FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	12.438.535,96	0,00	0,00	0,00	12.444.976,01	6.440,05	250.429,55
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	456.180,37	873,98	0,00	0,00	461.170,96	4.116,61	41.333,24
SANTANDER RF ATIVO FIC	622.436,17	0,00	0,00	0,00	623.597,55	1.161,38	7.293,41

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	19.843.778,59	0,00	0,00	0,00	20.035.855,84	192.077,25	1.181.939,24
					88.659.160,19	361.867,62	

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	54.926.791,15	1.506.110,69	0,00	0,00	56.971.651,79	538.749,95	3.238.608,17
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	16.487.181,95	0,00	0,00	0,00	16.655.102,60	167.920,65	1.655.102,60
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	43.900.410,66	5.158.930,07	-6.433.975,92	0,00	43.088.029,30	462.664,49	4.747.539,35
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	21.407.187,89	1.952,71	0,00	0,00	21.634.285,55	225.144,95	2.740.151,20
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	7.004.602,21	0,00	0,00	0,00	6.916.224,08	-88.378,13	-83.740,75
					145.265.293,32	1.306.101,91	

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	493.571,11	0,00	0,00	0,00	551.634,91	58.063,80	70.371,02
					551.634,91	58.063,80	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES DIVIDENDOS	1.522.214,41	0,00	0,00	0,00	1.539.581,69	17.367,28	98.367,00
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	4.836.635,85	0,00	0,00	0,00	4.880.271,94	43.636,09	1.714.302,51
BRADESCO F I A SELECTION	5.384.868,74	0,00	0,00	0,00	5.333.120,47	-51.748,27	28.293,00
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	5.352.143,31	0,00	0,00	0,00	5.219.799,51	-132.343,80	-342.269,96
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	7.470.190,14	0,00	0,00	0,00	7.475.769,36	5.579,22	388.955,48
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	14.725.919,56	0,00	0,00	0,00	14.805.299,05	79.379,49	1.324.300,70
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	5.842.909,32	0,00	0,00	0,00	5.831.059,57	-11.849,75	-254.839,04
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	8.421.488,73	0,00	0,00	0,00	8.374.402,88	-47.085,85	-205.670,41
					53.459.304,47	-97.065,59	

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	24.476.912,46	0,00	0,00	0,00	23.601.890,92	-875.021,54	4.905.156,41
					23.601.890,92	-875.021,54	

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	20.653.894,14	0,00	0,00	0,00	20.830.647,67	176.753,53	1.495.642,27
					20.830.647,67	176.753,53	

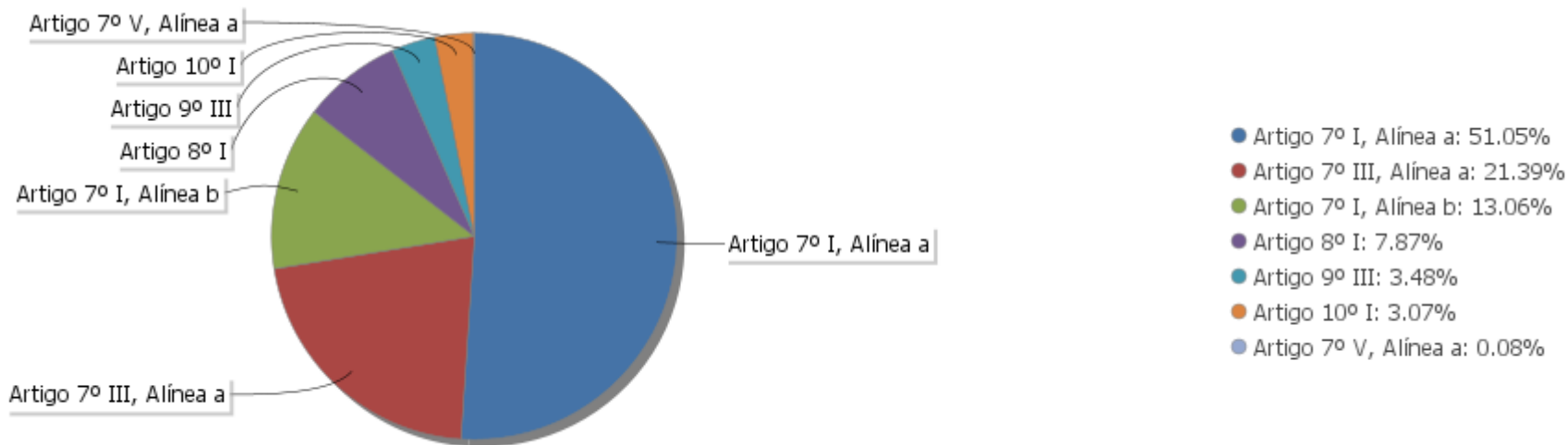
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

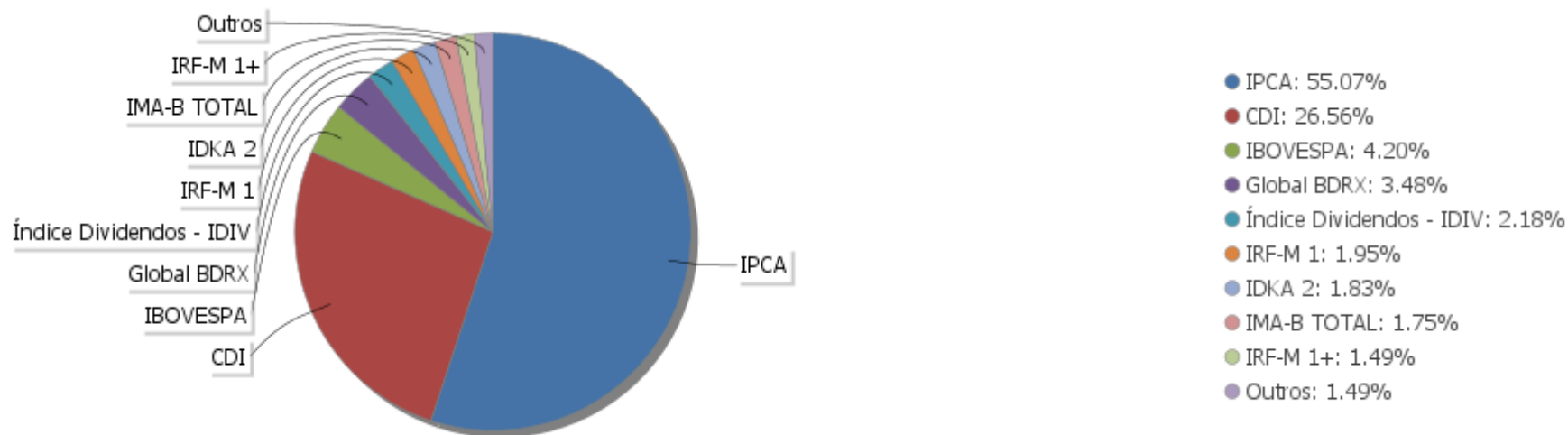
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	295.881.400,62	43,57	295.881.400,62	43,57	
de 31 dias a 365 dias	134.264.232,17	19,77	430.145.632,79	63,34	
acima de 365 dias	248.946.411,34	36,66	679.092.044,13	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

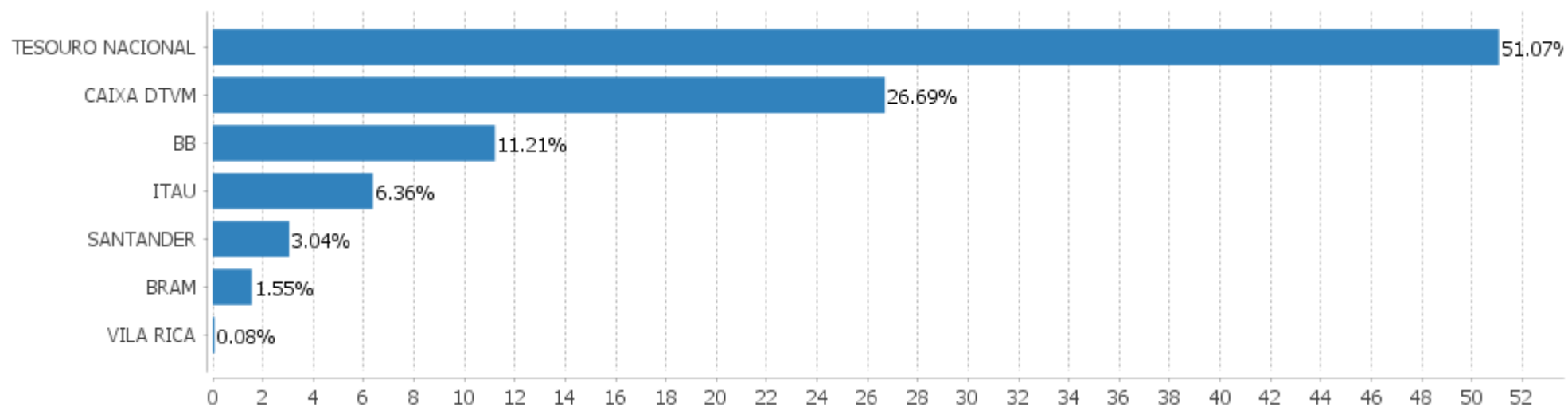


Alocação Por Estratégia



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	0,35	0,50				8,92
IPCA + 5,03%	0,96	1,19	1,16	0,96	0,66	0,33	0,53	0,68	0,65				7,36
p.p. indexador	0,79	-1,30	-0,20	0,00	1,00	1,20	0,46	-0,33	-0,15				1,57
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	45,61
Meses abaixo - Meta Atuarial	31	54,39

	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	1,85	1,87	-0,02	1,39
06 meses	6,14	3,87	2,27	1,72
12 meses	11,96	10,42	1,53	2,60
24 meses	14,32	24,38	-10,06	4,45
36 meses	20,09	44,73	-24,64	4,89
48 meses	21,21	58,10	-36,89	7,68
Desde 31/12/2018	35,07	69,28	-34,22	7,17

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

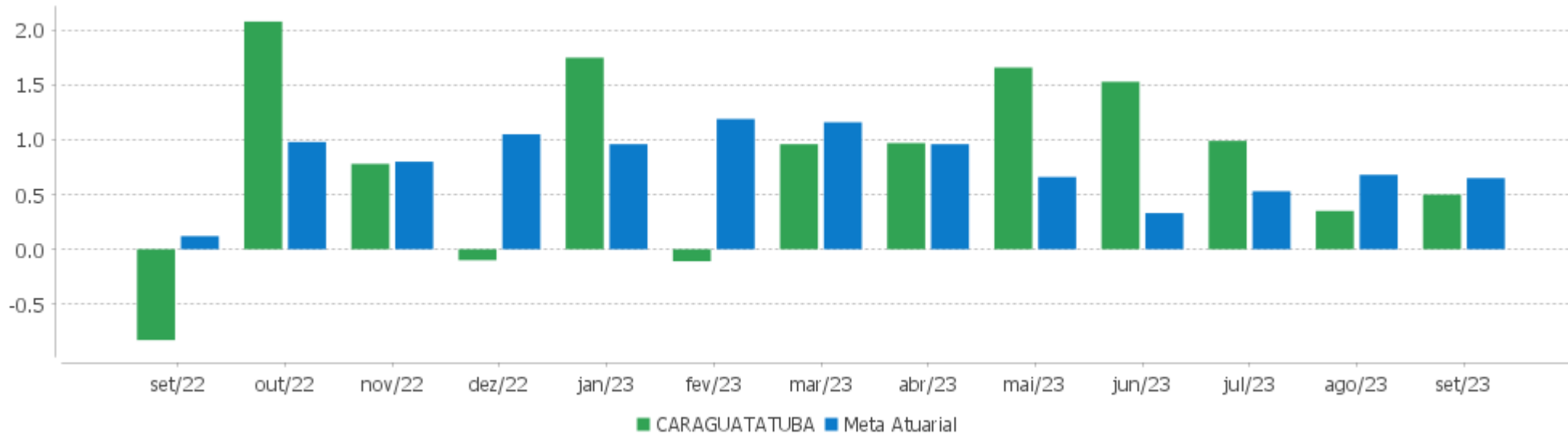


Patrimônio Líquido



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.	0,71 0,45	5,27 1,77	1,96 1,35	1,53 0,15	4,85 -0,33		
NTN-B 150535 (5,560000%) Var. IPCA p.p.	0,68 0,42	8,09 4,59	1,87 1,25	4,34 2,96	10,74 5,55	22,60 9,87	34,72 10,44
NTN-B 150840 (5,650000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,43	8,16 4,66	1,89 1,28	4,38 3,00	10,83 5,65	26,29 13,56	38,88 14,60
NTN-B 150830 (5,708000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,43	8,20 4,70	1,90 1,29	4,41 3,03	10,89 5,71	22,87 10,14	35,04 10,77
NTN-B 150840 (5,770000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,44	8,25 4,75	1,92 1,31	4,44 3,06	10,96 5,77	23,04 10,31	35,35 11,08
NTN-B 150826 (6,350000%) Var. IPCA p.p.	0,74 0,48	8,69 5,19	2,06 1,45	4,73 3,35	11,55 6,37	20,62 7,90	
NTN-B 150824 (6,680000%) Var. IPCA p.p.	0,76 0,50	8,95 5,45	2,14 1,53	4,88 3,51	11,90 6,72	21,37 8,65	
NTN-B 150535 (5,821000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,44	8,29 4,79	1,93 1,32	4,47 3,09	11,01 5,83	23,12 10,40	35,44 11,17
NTN-B 150850 (5,920000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,45	8,37 4,87	1,95 1,34	4,51 3,14	11,11 5,93	23,30 10,58	35,73 11,45
NTN-B 150824 (6,090000%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,47	8,49 4,99	1,99 1,38	4,59 3,22	11,29 6,11	20,13 7,40	
NTN-B 150545 (5,781000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,44	8,26 4,76	1,92 1,31	4,45 3,07	10,97 5,78	23,07 10,34	35,42 11,14
NTN-B 150824 (5,892000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,44	8,34 4,85	1,95 1,34	4,50 3,12	11,08 5,90	23,23 10,51	35,54 11,27
NTN-B 150824 (5,910000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,45	8,36 4,86	1,95 1,34	4,51 3,13	11,10 5,92	19,74 7,01	
NTN-B 150555 (5,850000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,44	8,31 4,81	1,94 1,33	4,48 3,10	11,04 5,86	23,18 10,45	35,58 11,31
NTN-B 150824 (6,440000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,49	8,76 5,26	2,08 1,47	4,77 3,39	11,65 6,47	20,86 8,14	
NTN-B 150850 (5,916000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,45	8,36 4,86	1,95 1,34	4,51 3,14	11,11 5,92	23,33 10,60	35,76 11,48
NTN-B 150850 (5,713000%)	0,69	8,21	1,90	4,41	10,90	22,95	35,29

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.	0,43	4,71	1,29	3,04	5,71	10,23	11,02
NTN-B 150527 (6,090000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,45	8,50 5,00	2,00 1,38	4,60 3,22	11,29 6,10	20,11 7,38	
NTN-B 150850 (5,815000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,44	8,29 4,79	1,93 1,32	4,46 3,09	11,00 5,82	23,14 10,42	35,53 11,25
NTN-B 150824 (6,990300%) Var. IPCA p.p.	0,79 0,53	6,01 2,51	2,21 1,60	5,04 3,66	8,97 3,78		
NTN-B 150828 (6,350000%) Var. IPCA p.p.	0,74 0,48	8,68 5,18	2,06 1,45	4,72 3,35	11,55 6,36	20,59 7,86	
NTN-B 150545 (5,760000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,43	8,24 4,74	1,91 1,30	4,44 3,06	10,95 5,76	23,03 10,30	35,37 11,09
NTN-B 150525 (5,980000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,45	8,41 4,91	1,97 1,36	4,54 3,16	11,17 5,99	19,90 7,17	31,97 7,69
NTN-B 150824 (6,480000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,49	8,79 5,29	2,09 1,48	4,79 3,41	11,69 6,51	20,95 8,23	33,65 9,37
NTN-B 150555 (5,815000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,44	8,29 4,79	1,93 1,32	4,46 3,09	11,00 5,82	23,15 10,42	35,54 11,27
NTN-B 150850 (5,780000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,44	8,26 4,76	1,92 1,31	4,45 3,07	10,97 5,78	23,08 10,35	35,45 11,17
NTN-B 150545 (5,710000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,43	8,21 4,71	1,90 1,29	4,41 3,03	10,90 5,71	22,93 10,21	35,25 10,97
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	-0,18 -0,03	12,55 -0,27	1,18 -0,09	8,11 -0,13	13,58 -0,48	21,42 -0,89	17,30 -1,17
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,90 -0,03	9,93 -0,13	3,16 -0,02	6,40 -0,10	13,35 -0,19	24,28 -0,40	27,21 -0,58
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,96 -0,01	10,65 -0,14	-0,53 -0,01	6,49 -0,06	10,76 -0,28	18,68 -0,41	23,96 -0,74
SANTANDER RF ATIVO FIC % do CDI	0,19 19,14	9,05 91,16	1,21 37,56	5,61 86,78	11,22 83,44	21,04 81,55	23,95 80,99
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,40 0,14	10,36 6,86	1,94 1,33	6,89 5,51	12,82 7,63	23,47 10,75	24,53 0,25
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,90 -0,03	9,81 -0,26	3,11 -0,07	6,35 -0,15	13,19 -0,34	24,03 -0,65	26,71 -1,08
FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO Var. IDKA 2 p.p.	0,05 -0,23	11,72 2,75	1,83 -0,22	7,29 3,21	12,62 1,20		
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,97	9,84	3,19	6,42	13,31	25,63	29,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	99,31	99,16	99,01	99,21	99,02	99,31	98,87
FIDC ITALIA SENIOR	11,76	-2,77	13,22	13,75	-1,64	27,91	68,88
% do CDI	1.206,96	-27,94	410,48	212,62	-12,24	108,18	232,98
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	1,05	10,23	3,54	6,91	13,89	27,22	31,63
% do CDI	107,90	103,04	110,04	106,81	103,35	105,48	106,98
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	-1,26	10,64	-0,98	6,42	10,10	16,54	22,54
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,32	-0,15	-0,46	-0,13	-0,94	-2,56	-2,16
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,97	9,87	3,22	6,49	13,40	26,08	30,15
% do CDI	99,52	99,39	100,12	100,34	99,70	101,09	101,99
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,03	10,09	3,44	6,80	13,67	26,38	30,56
% do CDI	105,29	101,61	106,94	105,20	101,69	102,24	103,37
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	1,02	10,15	3,42	6,85	13,67	26,52	30,71
% do CDI	104,49	102,21	106,25	105,96	101,70	102,77	103,86
BRADERCO F I A SELECTION	-0,96	0,53	-4,77	8,93	-0,40	-1,54	7,08
Var. IBOVESPA p.p.	-1,67	-5,69	-3,48	-5,48	-6,33	-6,58	-16,14
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	0,07	5,49	-1,77	13,76	1,07	3,72	13,41
Var. IBOVESPA p.p.	-0,64	-0,74	-0,49	-0,65	-4,86	-1,31	-9,80
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-0,20	-4,19	-2,66	4,48	-1,31	-7,29	10,57
Var. IBOVESPA p.p.	-0,91	-10,41	-1,37	-9,93	-7,25	-12,32	-12,64
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	-0,56	-2,40	-5,44	9,05	-12,43		
Var. IBOVESPA p.p.	-1,27	-8,62	-4,15	-5,36	-18,37		
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	0,54	9,82	-0,27	14,91	9,96	14,99	33,34
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,78	-0,85	-1,52	-0,47	-4,20	-7,40	-13,02
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	0,90	5,40	-1,05	14,24	4,22	1,06	18,80
Var. IGCT p.p.	-0,05	-1,36	-0,34	-1,06	-1,80	-2,62	-4,23
BB AÇÕES DIVIDENDOS	1,14	6,83	-0,43	13,73	4,98	8,16	16,15
Var. IBOVESPA p.p.	0,43	0,60	0,86	-0,68	-0,95	3,13	-7,07
BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	-2,47	-6,15	-9,95	4,31	-11,45	-24,24	-10,81
Var. SMALL CAP p.p.	0,37	-11,21	-2,70	-11,79	-8,51	-3,41	-2,45
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-3,57	16,05	1,32	7,00	20,13	-7,28	9,65
Var. Global BDRX p.p.	-0,12	-1,18	-0,49	-0,82	-1,72	-1,99	-4,99
FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	0,86	9,52	2,78	6,24	12,70	26,53	29,95
% do CDI	87,80	95,90	86,20	96,48	94,48	102,83	101,30
CARAGUATATUBA	0,50	8,92	1,85	6,14	11,96	14,32	20,09
Var. IPCA + 4,99% p.p.	-0,15	1,57	-0,02	2,27	1,52	-9,98	-23,81
CDI	0,97	9,93	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IBOVESPA	0,71	6,22	-1,29	14,41	5,93	5,03	23,21
INPC + 6,00%	0,57	7,49	1,71	3,97	10,73	25,81	47,70
IPCA + 6,00%	0,72	8,10	2,11	4,35	11,44	26,60	47,91

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 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	0,93	10,06	3,18	6,50	13,54	24,68	27,79	33,59	43,54
IRF-M 1+	-0,15	12,82	1,26	8,24	14,06	22,31	18,47	27,49	54,02
IRF-M TOTAL	0,17	11,62	1,83	7,45	13,57	22,67	21,42	29,39	51,16
IMA-B 5	0,13	8,89	1,73	4,32	11,65	21,97	29,23	38,58	59,92
IMA-B 5+	-1,92	12,08	-2,46	8,17	10,15	15,88	19,59	17,59	70,32
IMA-B TOTAL	-0,95	10,79	-0,52	6,55	11,05	19,09	24,70	27,33	67,28
IMA-GERAL TOTAL	0,18	10,59	1,80	6,72	12,50	22,90	25,94	31,42	53,46
IDKA 2	0,29	8,97	2,05	4,08	11,42	21,35	28,89	39,21	57,10
IDKA 20	-3,53	15,28	-5,76	12,78	8,75	9,82	12,05	2,09	75,69
CDI	0,97	9,93	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57	34,18	42,60

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,71	6,22	-1,29	14,41	5,93	5,03	23,21	11,28	46,91
IBRX 100	0,84	5,50	-1,02	13,78	5,09	3,69	22,17	11,68	50,59
IBRX 50	1,21	4,92	-0,03	13,75	5,32	5,93	25,49	12,91	45,69
SMALL CAP	-2,84	5,06	-7,25	16,09	-2,94	-20,83	-8,36	-10,00	41,57
Índice Consumo - ICON	-4,02	-4,75	-12,11	9,02	-17,82	-40,64	-41,63	-42,24	-10,67
Índice Dividendos - IDIV	1,32	10,67	1,25	15,38	14,16	22,39	46,36	32,00	101,74

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	-3,22	7,19	0,12	2,85	10,76	-8,35	13,20	73,22	84,04

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,20	12,28	2,03	16,60	7,64	18,54	15,18	19,93	50,80

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-2,61	4,13	-0,05	0,10	9,93	-14,78	3,18	51,70	56,69

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,26	3,50	0,61	1,38	5,19	12,73	24,28	28,17	31,88
INPC	0,11	2,91	0,22	1,01	4,51	12,02	24,10	28,93	32,69
IGPM	0,37	-4,93	-0,49	-5,12	-5,97	1,79	27,09	49,89	54,94
SELIC	0,97	9,93	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57	34,18	42,60

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,57	6,57	1,62	3,37	9,36	21,89	39,73	49,87	60,35
IPCA + 5,00%	0,65	7,34	1,87	3,86	10,40	24,23	43,78	55,70	68,19
IPCA + 5,50%	0,69	7,72	1,99	4,10	10,92	25,41	45,84	58,68	72,22
IPCA + 5,89%	0,72	8,01	2,08	4,30	11,33	26,34	47,45	61,03	75,41
IPCA + 6,00%	0,72	8,10	2,11	4,35	11,44	26,60	47,91	61,70	76,32
INPC + 4,00%	0,42	5,97	1,22	3,00	8,65	21,12	39,53	50,75	61,34
INPC + 6,00%	0,57	7,49	1,71	3,97	10,73	25,81	47,70	62,65	77,41

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%)	20.576.430,63	5,940000	20.635.923,85	5,740000	59.493,22
NTN-B 150525 (5,980000%)	10.503.592,01	5,980000	10.539.304,34	5,740000	35.712,33
NTN-B 150527 (6,090000%)	5.192.843,59	6,090000	5.271.343,24	5,600000	78.499,65
NTN-B 150535 (5,560000%)	17.144.470,27	5,560000	16.972.595,97	5,686500	-171.874,30
NTN-B 150535 (5,821000%)	20.051.802,99	5,821000	20.267.020,37	5,686500	215.217,38
NTN-B 150545 (5,710000%)	32.756.064,76	5,710000	32.319.815,18	5,825200	-436.249,58
NTN-B 150545 (5,760000%)	10.891.611,30	5,760000	10.809.389,71	5,825200	-82.221,59
NTN-B 150545 (5,781000%)	10.873.740,77	5,781000	10.818.058,03	5,825200	-55.682,74
NTN-B 150555 (5,815000%)	10.850.399,54	5,815000	10.780.811,16	5,862000	-69.588,38
NTN-B 150555 (5,850000%)	10.492.063,19	5,850000	10.477.736,15	5,862000	-14.327,04
NTN-B 150824 (5,892000%)	5.498.366,60	5,892000	5.478.298,58	6,346000	-20.068,02
NTN-B 150824 (5,910000%)	10.392.868,28	5,910000	10.356.692,22	6,346000	-36.176,06
NTN-B 150824 (6,090000%)	5.193.368,50	6,090000	5.182.512,12	6,346000	-10.856,38
NTN-B 150824 (6,440000%)	20.276.987,30	6,440000	20.292.617,78	6,346000	15.630,48
NTN-B 150824 (6,480000%)	21.112.277,94	6,480000	21.134.151,10	6,346000	21.873,16
NTN-B 150824 (6,680000%)	5.206.037,50	6,680000	5.220.006,17	6,346000	13.968,67
NTN-B 150824 (6,990300%)	30.097.795,19	6,990300	30.253.539,38	6,346000	155.744,19
NTN-B 150826 (6,350000%)	15.155.794,94	6,350000	15.446.877,48	5,596700	291.082,54
NTN-B 150828 (6,350000%)	15.154.122,71	6,350000	15.607.763,17	5,620000	453.640,46
NTN-B 150830 (5,708000%)	10.853.488,90	5,708000	10.923.855,78	5,588200	70.366,88
NTN-B 150840 (5,650000%)	923.743,43	5,650000	911.696,66	5,777400	-12.046,77
NTN-B 150840 (5,770000%)	10.871.575,05	5,770000	10.863.315,16	5,777400	-8.259,89
NTN-B 150850 (5,713000%)	10.925.277,14	5,713000	10.726.683,88	5,853300	-198.593,26
NTN-B 150850 (5,780000%)	10.558.353,34	5,780000	10.457.876,76	5,853300	-100.476,58
NTN-B 150850 (5,815000%)	10.848.960,15	5,815000	10.794.952,35	5,853300	-54.007,80
NTN-B 150850 (5,916000%)	3.893.611,71	5,916000	3.925.437,22	5,853300	31.825,51
NTN-B 150850 (5,920000%)	10.428.464,92	5,920000	10.521.878,46	5,853300	93.413,54

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
186	01/09/2023	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	873,98	0,00	20,65729959	42,3085310000
187	04/09/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.784,78	0,00	2.974,71821500	2,9531469420
188	05/09/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	49.121,86	0,00	10.214,24991942	4,8091500000
189	06/09/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	8.379,03	0,00	2.834,58154300	2,9560024540
190	06/09/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	58.000,00	12.053,95683603	4,8116980000
191	11/09/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	240.936,85	0,00	81.428,71556500	2,9588683590
192	20/09/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.201.288,58	0,00	404.629,16630900	2,9688630480
193	20/09/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	46.721,45	0,00	15.737,15231800	2,9688630480
194	20/09/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.262.318,96	0,00	881.722,15460054	4,8340840000
195	20/09/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	657.778,97	0,00	136.071,06744525	4,8340840000
196	26/09/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	105.824,78	0,00	21.847,33568271	4,8438300000
197	26/09/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	2.280.059,66	470.714,21994579	4,8438300000
198	28/09/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	32.836,33	0,00	6.771,86852693	4,8489320000
199	28/09/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.884.115,73	801.024,99478236	4,8489320000
200	28/09/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	211.800,53	43.679,83094009	4,8489320000
201	29/09/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	51.049,17	0,00	10.522,70126771	4,8513370000
202	29/09/2023	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	1.952,71	0,00	0,46719358	4.179,6593060000
Total			6.667.867,45	6.433.975,92		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 4.397.093,80

Value-At-Risk: 0,65%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CARAGUATATUBA		0,65		0,65			679.092.044,13	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,14%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150525 (5,940000%)		0,20	-0,00	0,21			20.576.430,63	3,03
NTN-B 150525 (5,980000%)		0,08	0,00	0,08			10.503.592,01	1,55
NTN-B 150527 (6,090000%)		0,07	0,00	0,07			5.192.843,59	0,76
NTN-B 150535 (5,560000%)		0,07	0,00	0,07			17.144.470,27	2,52
NTN-B 150535 (5,821000%)		0,07	0,00	0,07			20.051.802,99	2,95
NTN-B 150545 (5,710000%)		0,07	0,00	0,07			32.756.064,76	4,82
NTN-B 150545 (5,760000%)		0,07	0,00	0,07			10.891.611,30	1,60
NTN-B 150545 (5,781000%)		0,07	0,00	0,07			10.873.740,77	1,60
NTN-B 150555 (5,815000%)		0,07	0,00	0,07			10.850.399,54	1,60
NTN-B 150555 (5,850000%)		0,12	0,00	0,12			10.492.063,19	1,55
NTN-B 150824 (5,892000%)		0,07	0,00	0,07			5.498.366,60	0,81
NTN-B 150824 (5,910000%)		0,07	0,00	0,07			10.392.868,28	1,53
NTN-B 150824 (6,090000%)		0,07	0,00	0,07			5.193.368,50	0,76
NTN-B 150824 (6,440000%)		0,07	0,00	0,07			20.276.987,30	2,99
NTN-B 150824 (6,480000%)		0,07	0,00	0,07			21.112.277,94	3,11
NTN-B 150824 (6,680000%)		0,07	0,00	0,07			5.206.037,50	0,77
NTN-B 150824 (6,990300%)		0,07	0,00	0,07			30.097.795,19	4,43
NTN-B 150826 (6,350000%)		0,08	0,00	0,08			15.155.794,94	2,23
NTN-B 150828 (6,350000%)		0,10	0,00	0,09			15.154.122,71	2,23
NTN-B 150830 (5,708000%)		0,07	0,00	0,07			10.853.488,90	1,60

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (5,650000%)		0,07	0,00	0,07			923.743,43	0,14
NTN-B 150840 (5,770000%)		0,07	0,00	0,07			10.871.575,05	1,60
NTN-B 150850 (5,713000%)		0,07	0,00	0,07			10.925.277,14	1,61
NTN-B 150850 (5,780000%)		0,07	0,00	0,07			10.558.353,34	1,55
NTN-B 150850 (5,815000%)		0,07	0,00	0,07			10.848.960,15	1,60
NTN-B 150850 (5,916000%)		0,07	0,00	0,07			3.893.611,71	0,57
NTN-B 150850 (5,920000%)		0,12	0,00	0,11			10.428.464,92	1,54
Sub-total	0,13	0,07	0,00		-1,94	0,72	346.724.112,65	51,06

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		1,08	0,01	0,76			12.444.976,01	1,83
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI		0,02	0,00	0,02			20.035.855,84	2,95
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI		0,13	-0,00	0,18			461.170,96	0,07
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,12	0,00	0,01			12.749.886,88	1,88
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,83	0,01	0,04			4.964.759,88	0,73
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP		1,48	0,01	0,02			10.085.051,87	1,49
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,86	0,02	0,87			27.293.861,20	4,02
SANTANDER RF ATIVO FIC		1,05	0,00	1,05			623.597,55	0,09
Sub-total	1,43	0,67	0,05		-0,40	0,41	88.659.160,19	13,06

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		2,08	0,01	0,28			6.916.224,08	1,02
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,02	-0,00	0,02			43.088.029,30	6,34
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI		0,05	-0,00	0,05			21.634.285,55	3,19
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	0,00	0,02			56.971.651,79	8,39
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI		0,04	0,00	0,04			16.655.102,60	2,45
Sub-total	0,27	0,10	0,01		-0,27	0,90	145.265.293,32	21,39

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC ITALIA SENIOR		0,58	0,00	0,58			551.634,91	0,08
Sub-total	39,48	0,58	0,00		0,27	11,76	551.634,91	0,08

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,96%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES DIVIDENDOS		6,64	0,01	1,82			1.539.581,69	0,23
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS		9,02	0,06	2,96			5.219.799,51	0,77
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		7,25	0,05	0,28			4.880.271,94	0,72
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS		7,13	0,07	1,15			7.475.769,36	1,10
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		6,26	0,12	1,34			14.805.299,05	2,18
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		6,46	0,05	2,87			5.831.059,57	0,86
BRADESCO F I A SELECTION		7,66	0,06	2,69			5.333.120,47	0,79
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		8,34	0,09	3,52			8.374.402,88	1,23
Sub-total	15,81	6,96	0,51		-0,07	-0,18	53.459.304,47	7,87

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,88%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		6,88	0,07	0,68			23.601.890,92	3,48
Sub-total	10,48	6,88	0,07		-0,43	-3,57	23.601.890,92	3,48

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,17%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP		0,17	0,00	0,17			20.830.647,67	3,07
Sub-total	0,25	0,17	0,00		-0,47	0,86	20.830.647,67	3,07

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

- (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 (%)