

VILA VELHA - CONSOLIDADO
DEZEMBRO 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 29.12.2023.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela i9 ADVISORY.

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

Equipe i9 Advisory.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA **91,75%**

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 150824 (Curva) ⁽¹⁾	2,43	0,05	0,85	6,89	252.752.349,61	36,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (Curva) ⁽¹⁾	0,31	0,04	0,73	10,07	27.922.405,30	4,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (Curva) ⁽¹⁾	0,31	0,04	0,73	10,09	33.643.387,08	4,87
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (Curva) ⁽¹⁾	0,31	0,04	0,72	10,04	50.912.708,77	7,37
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (Curva) ⁽¹⁾	0,31	0,04	0,73	10,12	28.097.028,86	4,07
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (Curva) ⁽¹⁾	0,31	0,04	0,73	10,08	22.247.354,09	3,22
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,31	0,04	0,80	11,11	415.575.233,71	60,17

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				
BANESTES	BANESTES	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,04	0,03	0,66	9,72	3.611.797,90	0,52	1.465.080.401,12	0,25
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	1,37	0,10	0,92	11,12	901.828,09	0,13	106.891.504,95	0,84
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TIT PUB X FI	1,37	0,10	0,92	11,13	2.793.490,86	0,40	215.228.460,08	1,30
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIF RESP LIMITADA	4,45	0,09	2,74	2,29	16.046.035,53	2,32	5.283.374.941,87	0,30
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FIF RESP LIMITADA	2,64	0,04	1,46	9,33	36.327.602,55	5,26	4.067.997.534,34	0,89
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF LP- RESP LIMITADA	1,98	0,09	1,40	11,90	73.524,74	0,01	5.218.373.540,00	0,00
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF LP	1,96	0,10	1,44	6,59	10.235.306,47	1,48	7.603.591.100,02	0,13

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
		- RESP LIMITADA								
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,15	0,10	0,92	11,15	16.249.107,45	2,35	499.145.687,94	3,26
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,38	0,10	0,92	11,17	21.637.214,37	3,13	3.886.422.398,07	0,56
SAFRA	SAFRA ASSET CTVM	SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIF	0,04	0,04	0,88	12,84	262.182,27	0,04	5.390.177.797,31	0,00
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,51	0,08	1,36	11,59	108.138.090,23	15,66		

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				
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI RESP LIMITADA	0,71	0,04	0,94	10,88	14.463.110,96	2,09	2.927.068.052,50	0,49
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FIC FIF RESP LIMITADA	0,04	0,04	0,82	11,93	4.482.015,76	0,65	4.049.178.389,19	0,11
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF REFERENCIADO DI LP PERFIL FIC FIF RESP LIMITADA	0,08	0,04	0,90	12,98	33.852.370,55	4,90	16.475.113.370,57	0,21
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC CLASSE FIF RENDA FIXA SIMPLES RESP LIMITADA	0,03	0,04	0,81	11,58	324.557,22	0,05	959.626.212,50	0,03
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BRASIL MATRIZ FIF RENDA FIXA - RESP LIMITADA	0,09	0,04	0,93	13,39	56.787.011,15	8,22	5.463.046.966,63	1,04
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,22	0,04	0,92	12,64	109.909.065,64	15,91		
Renda Fixa			0,35	0,05	0,92	11,39	633.622.389,58	91,75		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

2,62%

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 BOLSA AMERICANA FIF RESP LIMITADA	12,67	-0,05	5,08	27,53	27.713,99	0,00	1.203.790.958,87	0,00
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA IS FIF RESP LIMITADA	17,15	0,00	5,52	20,23	338.578,95	0,05	783.566.811,58	0,04
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	16,85	0,00	5,36	21,74	13.403.434,65	1,94	424.700.729,97	3,16
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA DIVIDENDOS	14,53	-0,01	6,71	24,99	4.324.920,43	0,63	260.031.743,25	1,66
Sub-total Artigo 8º I			16,15	0,00	5,68	22,48	18.094.648,02	2,62		
Renda Variável			16,15	0,00	5,68	22,48	18.094.648,02	2,62		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,12%

Artigo 9º III (4.963) (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIF AÇÕES RESP LIMITADA	13,90	-0,13	2,95	16,61	5.471.663,61	0,79	648.513.623,59	0,84
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIF AÇÕES RESP LIMITADA	15,18	0,00	2,59	24,92	18.679.459,42	2,70	1.995.875.754,00	0,94
SAFRA	SAFRA ASSET CTVM	SAFRA CONSUMO AMERICANO PB BDR-AÇÕES FIF	13,81	0,01	2,51	17,40	4.287.371,65	0,62	658.947.271,35	0,65
Sub-total Artigo 9º III (4.963)			14,45	-0,03	2,65	22,07	28.438.494,68	4,12		
Investimentos no Exterior			14,45	-0,03	2,65	22,07	28.438.494,68	4,12		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

1,52%

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	CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FIF MULTIMERCADO LONGO PRAZO RESP LIMITADA	13,23	0,04	5,19	33,30	10.473.411,54	1,52	1.635.814.462,49	0,64
Sub-total Artigo 10º I			13,23	0,04	5,19	33,30	10.473.411,54	1,52		
Investimentos Estruturados			13,23	0,04	5,19	33,30	10.473.411,54	1,52		
Total			1,36	0,05	1,17	12,90	690.628.943,82	100,00		

(1) Existem aplicações consolidadas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

				Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 2	
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	415.575.233,71	60,17	30,00	55,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	108.138.090,23	15,66	0,00	10,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	109.909.065,64	15,91	5,00	15,00	60,00	0,00	70,00
	Total Renda Fixa	633.622.389,58	91,75					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	18.094.648,02	2,62	0,00	7,00	30,00	0,00	40,00
	Total Renda Variável	18.094.648,02	2,62					40,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III (4.963)	Fundos de Ações - BDR Nível I	28.438.494,68	4,12	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	28.438.494,68	4,12					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	10.473.411,54	1,52	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	10.473.411,54	1,52					15,00
Total		690.628.943,82	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	Atribuição Desemp. (%)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,80 89,66	11,11 85,15	2,30 81,04	4,39 71,37	11,11 85,15	3.313.165,29	0,48	42.171.750,05
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,36 151,72	11,59 88,82	3,25 114,64	5,24 85,17	11,59 88,82	1.530.024,80	0,22	8.598.409,51
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,92 102,61	12,64 96,88	2,88 101,59	6,26 101,73	12,64 96,88	969.527,37	0,14	7.913.210,41
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	5,68 0,30	22,48 0,20	14,70 -0,42	13,85 0,22	22,48 0,20	972.572,95	0,14	3.321.312,56
Artigo 9º III (4.963) % do CDI	2,65 295,16	22,07 169,13	7,44 262,16	9,05 147,20	22,07 169,13	732.977,93	0,11	5.141.154,63
Artigo 10º I % do CDI	5,19 579,10	33,30 255,25	13,06 460,26	10,93 177,70	33,30 255,25	516.801,11	0,08	7.823.739,56
VILA VELHA - CONSOLIDADO (Total)						8.035.069,45	1,17	74.969.576,72

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 150545 (3,680000%) ..	7.674.023,83	0,00	0,00	0,00	7.720.475,37	46.451,54	620.610,09
NTN-B 150545 (4,290000%) ..	391.940,22	0,00	0,00	0,00	394.496,04	2.555,82	33.956,36
NTN-B 150545 (5,100000%) ..	15.263.658,94	0,00	0,00	0,00	15.372.634,12	108.975,18	1.438.671,79
NTN-B 150545 (5,730000%)	27.217.770,84	0,00	0,00	0,00	27.425.103,24	207.332,40	2.725.984,01
NTN-B 150555 (5,260000%)	22.086.979,38	0,00	0,00	0,00	22.247.354,09	160.374,71	2.113.629,35
NTN-B 150824 (6,561800%)	51.799.679,81	0,00	0,00	0,00	52.226.729,03	427.049,22	5.148.214,28
NTN-B 150824 (7,060000%)	198.812.235,36	0,00	0,00	0,00	200.525.620,58	1.713.385,22	11.292.930,17
NTN-B 150830 (5,250000%)	27.721.338,09	0,00	0,00	0,00	27.922.405,30	201.067,21	2.615.784,07
NTN-B 150840 (5,270000%)	33.400.602,74	0,00	0,00	0,00	33.643.387,08	242.784,34	3.155.062,02
NTN-B 150850 (5,290000%)	27.893.839,21	0,00	0,00	0,00	28.097.028,86	203.189,65	2.638.697,59
	412.262.068,42	0,00	0,00	0,00	415.575.233,71	3.313.165,29	42.171.750,05

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	3.082.921,64	19.478.705,68	-19.000.508,88	0,00	3.611.797,90	50.679,46	403.148,41
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	893.618,61	0,00	0,00	0,00	901.828,09	8.209,48	92.559,95
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	2.768.031,41	0,00	0,00	0,00	2.793.490,86	25.459,45	286.980,07
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIF RESP LIMITADA	15.617.563,93	0,00	0,00	0,00	16.046.035,53	428.471,60	371.363,04
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FIF RESP LIMITADA	35.805.197,59	0,00	0,00	0,00	36.327.602,55	522.404,96	2.294.926,03
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF LP-RESP LIMITADA	72.508,30	0,00	0,00	0,00	73.524,74	1.016,44	7.819,13
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF LP - RESP LIMITADA	10.090.156,37	0,00	0,00	0,00	10.235.306,47	145.150,10	570.156,78
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.100.655,61	0,00	0,00	0,00	16.249.107,45	148.451,84	1.670.007,64
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	21.439.326,87	0,00	0,00	0,00	21.637.214,37	197.887,50	2.226.818,04
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIF	259.888,30	0,00	0,00	0,00	262.182,27	2.293,97	52.634,30
	106.129.868,63	19.478.705,68	-19.000.508,88	0,00	108.138.090,23	1.530.024,80	8.598.409,51

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BANESTES LIQUIDEZ FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI RESP LIMITADA	8.902.152,29	5.460.000,00	0,00	0,00	14.463.110,96	100.958,67	507.995,49
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FIC FIF RESP LIMITADA	4.329.022,66	502.343,48	-385.072,65	0,00	4.482.015,76	35.722,27	359.304,41
BB PREVIDENCIÁRIO RF REFERENCIADO DI LP PERFIL FIC FIF RESP LIMITADA	33.549.692,16	0,00	0,00	0,00	33.852.370,55	302.678,39	3.857.630,94
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC CLASSE FIF RENDA FIXA SIMPLES RESP LIMITADA	196.218,18	953.066,25	-828.986,11	0,00	324.557,22	4.258,90	68.348,27
CAIXA BRASIL MATRIZ FIF RENDA FIXA - RESP LIMITADA	56.261.102,01	0,00	0,00	0,00	56.787.011,15	525.909,14	3.154.020,55
	103.238.187,30	6.915.409,73	-1.214.058,76	0,00	109.909.065,64	969.527,37	7.913.210,41

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIF RESP LIMITADA	26.374,84	0,00	0,00	0,00	27.713,99	1.339,15	5.982,27
BB AÇÕES GOVERNANÇA IS FIF RESP LIMITADA	320.867,76	0,00	0,00	0,00	338.578,95	17.711,19	56.962,51
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	12.721.689,08	0,00	0,00	0,00	13.403.434,65	681.745,57	2.393.530,09
FIA CAIXA DIVIDENDOS	4.053.143,39	0,00	0,00	0,00	4.324.920,43	271.777,04	864.837,69
	17.122.075,07	0,00	0,00	0,00	18.094.648,02	972.572,95	3.321.312,56

Artigo 9º III (4.963) (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIF AÇÕES RESP LIMITADA	5.314.842,69	0,00	0,00	0,00	5.471.663,61	156.820,92	779.267,68
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIF AÇÕES RESP LIMITADA	18.208.145,31	0,00	0,00	0,00	18.679.459,42	471.314,11	3.726.524,82
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB BDR-AÇÕES FIF	4.182.528,75	0,00	0,00	0,00	4.287.371,65	104.842,90	635.362,13
	27.705.516,75	0,00	0,00	0,00	28.438.494,68	732.977,93	5.141.154,63

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FIF MULTIMERCADO LONGO PRAZO RESP LIMITADA	9.956.610,43	0,00	0,00	0,00	10.473.411,54	516.801,11	7.823.739,56
	9.956.610,43	0,00	0,00	0,00	10.473.411,54	516.801,11	7.823.739,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	275.053.710,11	39,83	275.053.710,11	39,83	
de 31 dias a 365 dias	252.752.349,61	36,60	527.806.059,72	76,42	
acima de 365 dias	162.822.884,10	23,58	690.628.943,82	100,00	

DE 0 A 30 DIAS

Ativo	Liquidação	Vencimento	Valor (R\$)
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	D+0		3.611.797,90
BANESTES LIQUIDEZ FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI RESP LIMITADA	D+0		14.463.110,96
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	D+0		901.828,09
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	D+0		2.793.490,86
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FIC FIF RESP LIMITADA	D+0		4.482.015,76
BB PREVIDENCIÁRIO RF REFERENCIADO DI LP PERFIL FIC FIF RESP LIMITADA	D+0		33.852.370,55
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC CLASSE FIF RENDA FIXA SIMPLES RESP LIMITADA	D+0		324.557,22
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF LP- RESP LIMITADA	D+0		73.524,74
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF LP - RESP LIMITADA	D+0		10.235.306,47
CAIXA BRASIL MATRIZ FIF RENDA FIXA - RESP LIMITADA	D+0		56.787.011,15
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0		16.249.107,45
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0		21.637.214,37
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIF	D+0		262.182,27
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIF RESP LIMITADA	D+1		16.046.035,53
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FIF RESP LIMITADA	D+1		36.327.602,55
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FIF MULTIMERCADO LONGO PRAZO RESP LIMITADA	D+1		10.473.411,54
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIF RESP LIMITADA	D+2		27.713,99
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIF AÇÕES RESP LIMITADA	D+3		18.679.459,42
BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIF AÇÕES RESP LIMITADA	D+4		5.471.663,61
BB AÇÕES GOVERNANÇA IS FIF RESP LIMITADA	D+3		338.578,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Liquidação	Vencimento	Valor (R\$)
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	D+3 du		13.403.434,65
FIA CAIXA DIVIDENDOS	D+3 du		4.324.920,43
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB BDR-AÇÕES FIF	D+4		4.287.371,65

DE 31 DIAS A 365 DIAS

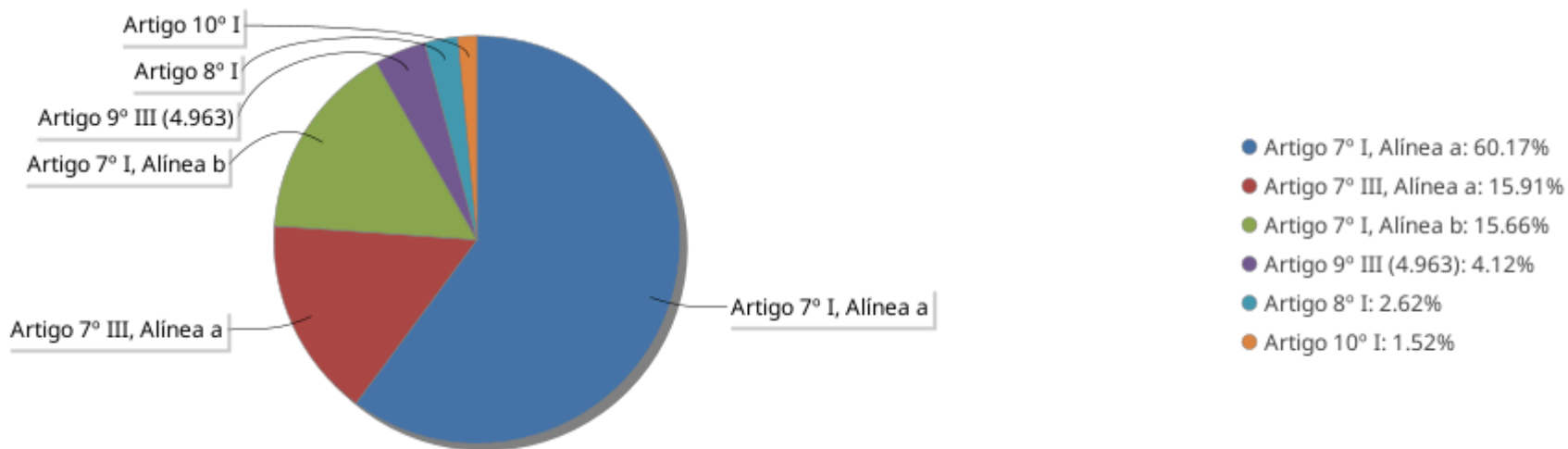
Ativo	Liquidação	Vencimento	Valor (R\$)
NTN-B 150824 (6,561800%)		15/08/2024	52.226.729,03
NTN-B 150824 (7,060000%)		15/08/2024	200.525.620,58

ACIMA DE 365 DIAS

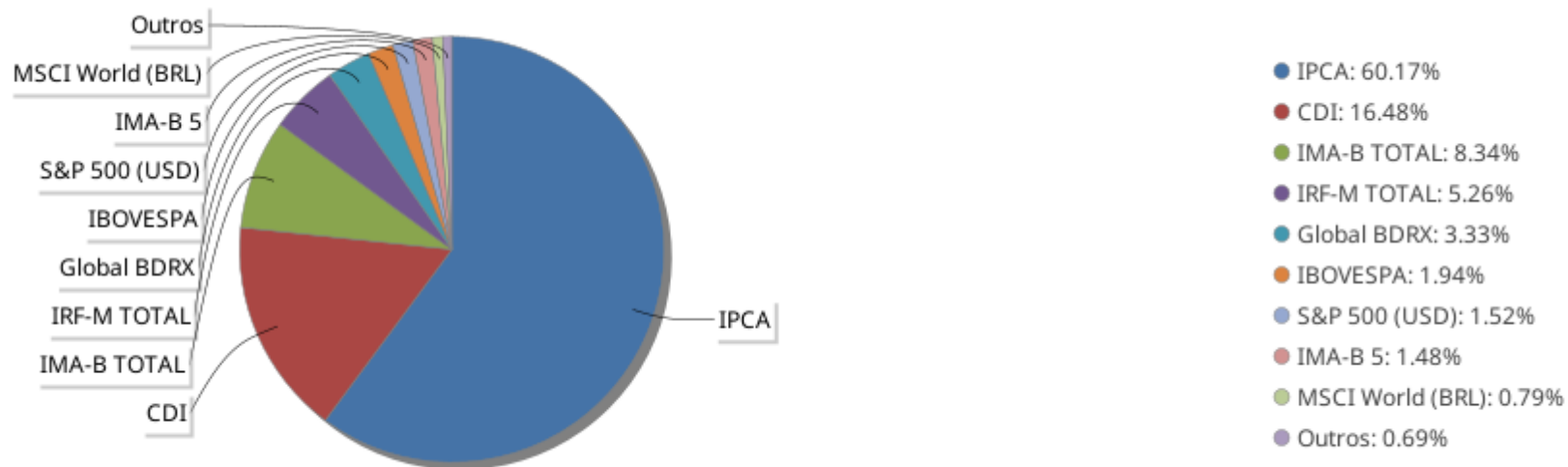
Ativo	Liquidação	Vencimento	Valor (R\$)
NTN-B 150830 (5,250000%)		15/08/2030	27.922.405,30
NTN-B 150840 (5,270000%)		15/08/2040	33.643.387,08
NTN-B 150545 (3,680000%) ..		15/05/2045	7.720.475,37
NTN-B 150545 (4,290000%) ..		15/05/2045	394.496,04
NTN-B 150545 (5,100000%) ..		15/05/2045	15.372.634,12
NTN-B 150545 (5,730000%)		15/05/2045	27.425.103,24
NTN-B 150850 (5,290000%)		15/08/2050	28.097.028,86
NTN-B 150555 (5,260000%)		15/05/2055	22.247.354,09

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

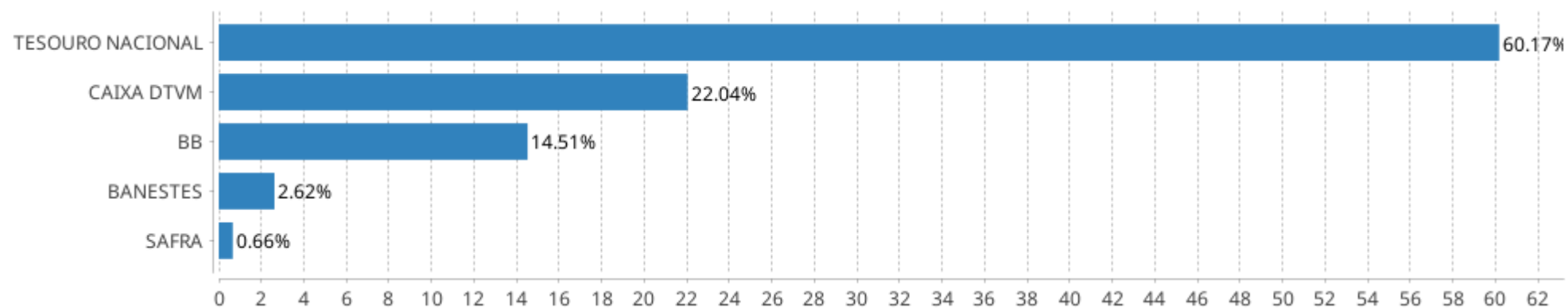


Alocação Por Estratégia



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	1,66	0,58	1,53	0,97	1,22	1,23	0,94	0,62	0,20	0,49	1,58	1,17	12,90
IPCA + 5,09%	0,97	1,20	1,17	0,97	0,67	0,33	0,54	0,69	0,66	0,66	0,68	0,96	9,88
p.p. indexador	0,69	-0,62	0,37	0,00	0,56	0,89	0,41	-0,06	-0,45	-0,17	0,91	0,22	3,02
2022	-1,78	-0,48	1,88	-0,54	0,98	-0,27	1,69	0,00	-0,58	1,41	1,38	0,26	3,95
IPCA + 4,92%	0,94	1,38	2,05	1,43	0,89	1,07	-0,28	0,08	0,11	0,97	0,79	1,04	10,97
p.p. indexador	-2,72	-1,86	-0,16	-1,97	0,09	-1,35	1,97	-0,08	-0,69	0,43	0,59	-0,78	-7,02
2021	-0,48	-1,03	1,05	1,06	0,94	0,42	0,32	0,32	-1,16	1,81	0,80	2,14	6,31
IPCA + 5,43%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,28	0,97	1,43	1,34	1,61	1,68	1,37	1,22	16,01
p.p. indexador	-1,15	-2,27	-0,37	0,33	-0,33	-0,56	-1,10	-1,02	-2,77	0,13	-0,57	0,93	-9,70
2020	0,49	-0,79	-6,98	1,89	2,02	2,02	2,94	-0,49	-1,49	-0,01	2,81	3,55	5,63
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,63
p.p. indexador	-0,22	-1,45	-7,55	1,75	1,95	1,28	2,06	-1,21	-2,61	-1,35	1,46	1,69	-5,00
2019	2,66	0,46	0,52	1,25	2,07	2,43	1,16	-0,08	2,05	2,10	-0,88	2,10	16,97
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	1,83	-0,43	-0,68	0,19	1,43	1,98	0,44	-0,70	1,60	1,47	-1,85	0,46	6,38
2018								0,28	0,40	3,39	0,72	1,12	6,02
IPCA + 6,00%								0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	3,23
p.p. indexador								-0,17	-0,52	2,42	0,47	0,51	2,78

Performance Sobre a Meta Atuarial

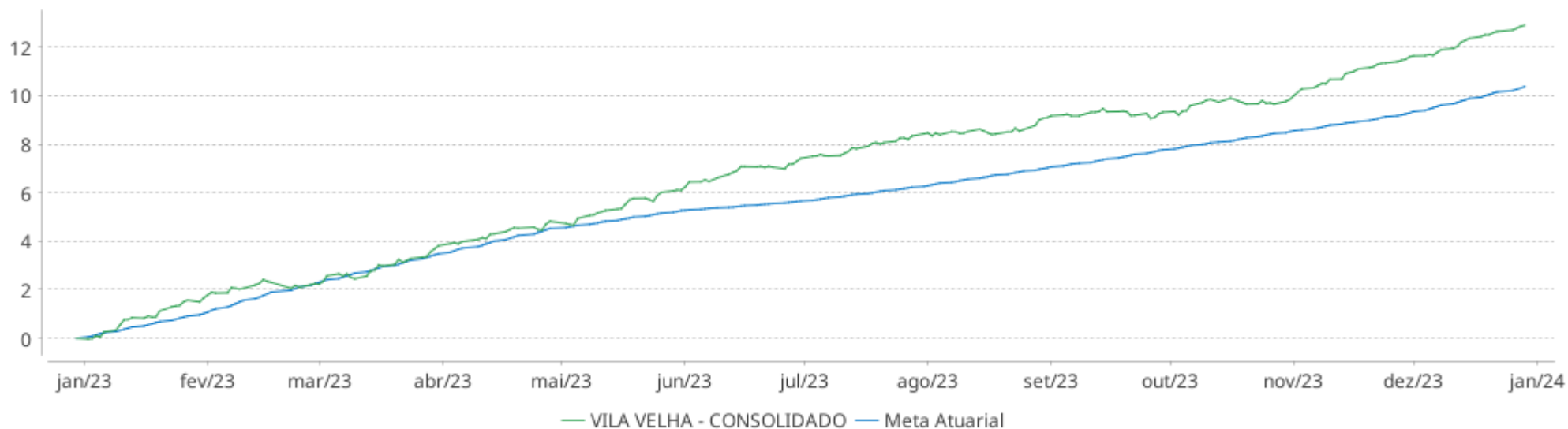
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	32	49,23
Meses abaixo - Meta Atuarial	33	50,77
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,55	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-6,98	2020-03

Relatório

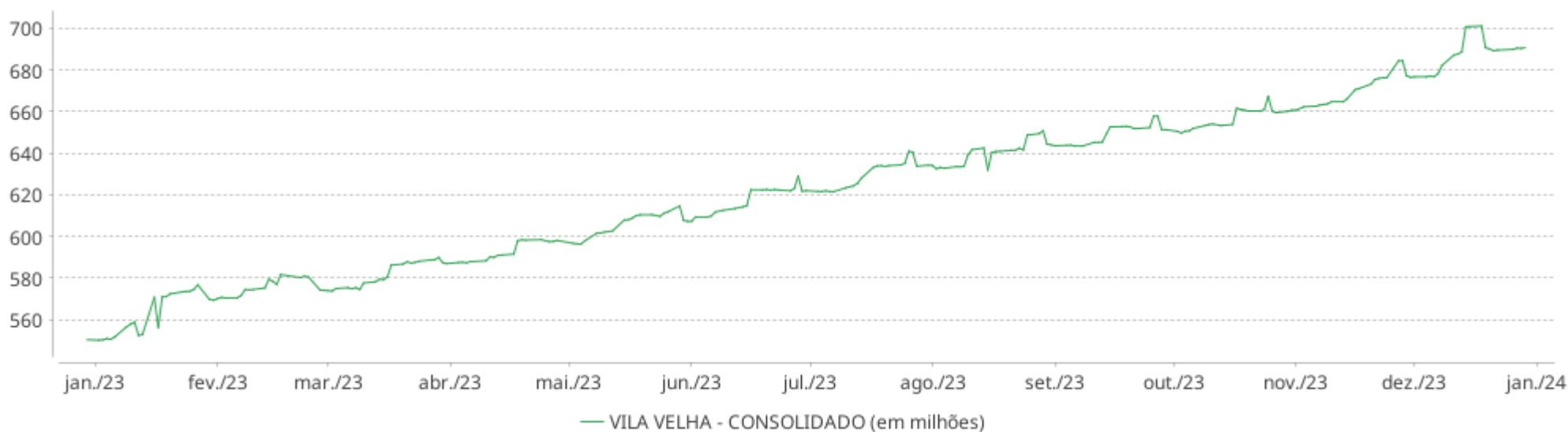
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	3,28	2,31	0,97	1,16
06 meses	5,11	4,24	0,87	1,23
12 meses	12,90	9,88	3,02	1,36
24 meses	17,36	21,93	-4,58	3,19
36 meses	24,76	41,46	-16,70	3,77
48 meses	31,79	56,49	-24,71	5,45
60 meses	54,15	73,06	-18,92	5,07
Desde 31/07/2018	63,42	78,66	-15,24	4,94

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução No Ano



Patrimônio Líquido No Ano



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

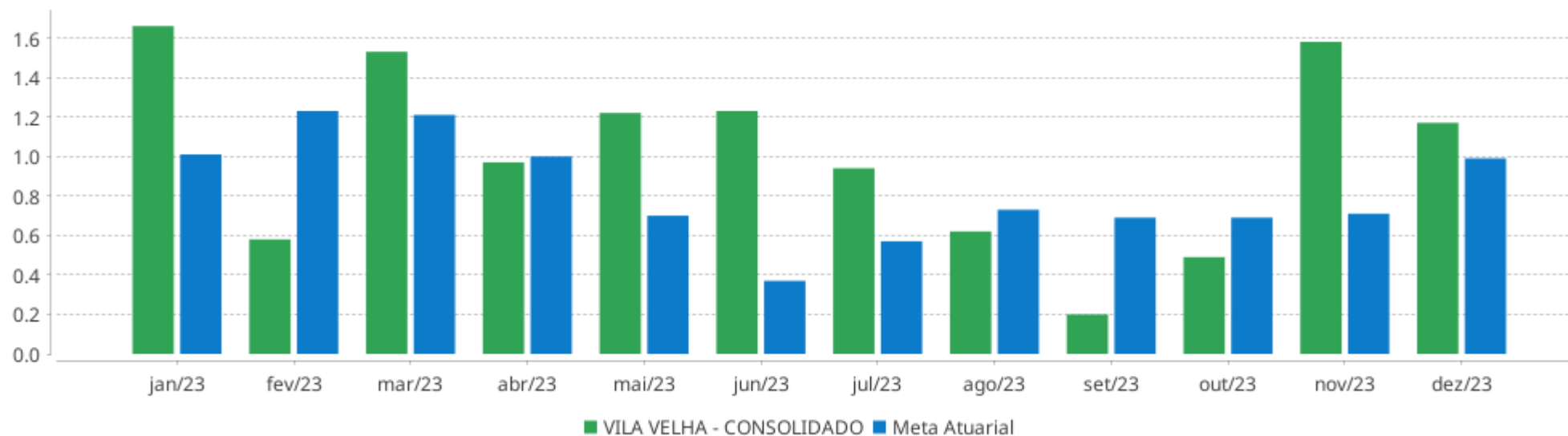


Patrimônio Líquido



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
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,92 -1,83	11,12 -4,94	2,15 -2,61	5,30 1,09	11,12 -4,94	22,78 -0,66	29,34 7,46
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA % do CDI	0,66 73,76	9,72 74,49	2,11 74,20	4,58 74,51	9,72 74,49	19,79 73,20	22,58 69,22
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF LP - RESP LIMITADA Var. IMA-B 5 p.p.	1,44 -0,02	11,96 -0,16	2,92 -0,05	4,64 -0,11	11,96 -0,16	22,79 -0,30	28,09 -0,63
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,92 -1,83	7,95 -8,11	2,16 -2,60	5,31 1,10	7,95 -8,11	14,42 -9,02	11,90 -9,98
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,92 -1,83	11,17 -4,89	2,16 -2,60	5,32 1,11	11,17 -4,89	21,23 -2,22	24,81 2,93
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF LP- RESP LIMITADA Var. IDKA 2 p.p.	1,40 -0,05	11,90 -0,23	2,86 -0,04	4,97 -0,03	11,90 -0,23	22,02 -0,59	27,70 -0,99
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIF RESP LIMITADA Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,74 -0,01	15,77 -0,28	4,71 -0,04	4,04 -0,17	15,77 -0,28	22,83 -0,62	20,97 -0,92
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FIF RESP LIMITADA Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,46 -0,02	16,06 -0,45	4,33 -0,05	6,05 -0,24	16,06 -0,45	26,02 -0,77	23,15 -1,12
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIF % do CDI	0,88 98,48	12,84 98,44	2,78 97,94	6,04 98,26	12,84 98,44	26,73 98,88	32,18 98,67
BB PREVIDENCIÁRIO RF TIT PUB X FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,92 -1,83	11,13 -4,93	2,15 -2,61	5,30 1,09	11,13 -4,93	22,49 -0,95	28,49 6,60
NTN-B 150545 (5,100000%) .. Var. IPCA p.p.	0,71 0,15	9,92 5,30	2,02 0,94	3,81 2,11	9,92 5,30	22,19 11,51	41,74 19,93
NTN-B 150850 (5,290000%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,17	10,12 5,49	2,07 0,98	3,90 2,20	10,12 5,49	22,62 11,95	35,18 13,37
NTN-B 150545 (4,290000%) .. Var. IPCA p.p.	0,65 0,09	9,08 4,46	1,83 0,75	3,41 1,71	9,08 4,46	20,32 9,65	38,51 16,70
NTN-B 150545 (3,680000%) .. Var. IPCA p.p.	0,61 0,05	8,45 3,83	1,69 0,60	3,11 1,41	8,45 3,83	18,93 8,26	36,11 14,30
NTN-B 150840 (5,270000%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,17	10,09 5,47	2,06 0,98	3,89 2,19	10,09 5,47	22,58 11,90	34,99 13,18
NTN-B 150824 (6,561800%) Var. IPCA p.p.	0,82 0,26	11,43 6,81	2,36 1,28	4,53 2,82	11,43 6,81	18,40 7,73	
NTN-B 150824 (7,060000%)	0,86	8,69	2,48	4,77	8,69	15,96	

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.	0,30	4,07	1,40	3,07	4,07	5,28	
NTN-B 150555 (5,260000%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,17	10,08 5,46	2,06 0,98	3,89 2,19	10,08 5,46	22,55 11,88	38,72 16,91
NTN-B 150830 (5,250000%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,17	10,07 5,45	2,06 0,97	3,89 2,18	10,07 5,45	22,53 11,86	34,69 12,88
NTN-B 150545 (5,730000%) Var. IPCA p.p.	0,76 0,20	10,57 5,95	2,17 1,09	4,12 2,42	10,57 5,95	23,64 12,97	36,40 14,59
BANESTES LIQUIDEZ FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI RESP LIMITADA % do CDI	0,94 105,42	10,88 83,36	2,94 103,47	6,45 104,93	10,88 83,36	25,22 93,29	32,11 98,45
BB PREVIDENCIÁRIO RF REFERENCIADO DI LP PERFIL FIC FIF RESP LIMITADA % do CDI	0,90 100,65	12,98 99,47	2,83 99,76	6,15 99,95	12,98 99,47	27,20 100,61	33,08 101,42
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FIC FIF RESP LIMITADA % do CDI	0,82 91,56	11,93 91,44	2,58 90,82	5,62 91,31	11,93 91,44	24,53 90,75	28,60 87,69
CAIXA BRASIL MATRIZ FIF RENDA FIXA - RESP LIMITADA % do CDI	0,93 104,29	13,39 102,59	2,94 103,59	6,46 105,08	13,39 102,59	27,85 103,01	33,62 103,08
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC CLASSE FIF RENDA FIXA SIMPLES RESP LIMITADA % do CDI	0,81 90,81	11,58 88,77	2,59 91,25	5,63 91,52	11,58 88,77	23,39 86,50	27,44 84,13
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	5,36 -0,02	21,74 -0,54	14,92 -0,20	13,44 -0,20	21,74 -0,54	27,74 -0,27	12,27 -0,47
FIA CAIXA DIVIDENDOS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	6,71 -0,20	24,99 -1,85	14,10 -0,51	15,25 -0,80	24,99 -1,85	39,28 -3,60	26,25 -7,47
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIF RESP LIMITADA Var. S&P 500 (USD) p.p.	5,08 0,65	27,53 3,30	12,14 0,90	9,59 2,41	27,53 3,30	10,54 10,46	44,03 17,04
BB AÇÕES GOVERNANÇA IS FIF RESP LIMITADA Var. IGCT p.p.	5,52 -0,16	20,23 -2,01	14,07 -0,43	12,88 -0,82	20,23 -2,01	23,14 -3,41	8,94 -3,93
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIF AÇÕES RESP LIMITADA Var. Global BDRX p.p.	2,59 -0,25	24,92 -1,41	7,65 -0,12	9,07 -0,65	24,92 -1,41	-10,73 -1,62	16,51 -4,97
BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIF AÇÕES RESP LIMITADA Var. MSCI World (BRL) p.p.	2,95 0,14	16,61 3,63	7,34 -0,04	8,82 1,51	16,61 3,63	-13,59 1,34	14,21 4,45
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB BDR-AÇÕES FIF Var. Global BDRX p.p.	2,51 -0,34	17,40 -8,94	6,67 -1,10	9,25 -0,47	17,40 -8,94	-18,28 -9,17	9,44 -12,04
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FIF MULTIMERCADO LONGO PRAZO RESP LIMITADA Var. S&P 500 (USD) p.p.	5,19 0,77	33,22 8,99	12,99 1,75	10,86 3,68	33,22 8,99	17,27 17,19	55,76 28,77
VILA VELHA - CONSOLIDADO Var. IPCA + 5,56% p.p.	1,17 0,22	12,90 3,02	3,28 0,97	5,11 0,87	12,90 3,02	17,36 -4,77	24,76 -16,47
CDI	0,90	13,05	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IBOVESPA	5,38	22,28	15,12	13,63	22,28	28,01	12,74
INPC + 6,00%	1,02	9,85	2,20	3,95	9,85	23,32	43,97
IPCA + 6,00%	1,03	10,82	2,52	4,68	10,82	24,24	44,91

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Cotização

Fundo	CNPJ	Aplicação Cotização	Resgate Cotização	Resgate Liquidação
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	36.347.706/0001-71	-	D+0	D+0
BANESTES LIQUIDEZ FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI RESP LIMITADA	20.230.719/0001-26	D+0	D+0	D+0
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIF RESP LIMITADA	36.178.569/0001-99	D+1 du	D+1	D+2
BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIF AÇÕES RESP LIMITADA	22.632.237/0001-28	D+1	D+1	D+4
BB AÇÕES GOVERNANÇA IS FIF RESP LIMITADA	10.418.335/0001-88	D+1	D+1	D+3
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	19.523.306/0001-50	D+0	D+0	D+0
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	20.734.931/0001-20	D+0	D+0	D+0
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FIC FIF RESP LIMITADA	13.077.415/0001-05	D+0	D+0	D+0
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIF RESP LIMITADA	07.442.078/0001-05	D+0	D+1	D+1
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FIF RESP LIMITADA	07.111.384/0001-69	D+0	D+1	D+1
BB PREVIDENCIÁRIO RF REFERENCIADO DI LP PERFIL FIC FIF RESP LIMITADA	13.077.418/0001-49	D+0	D+0	D+0
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC CLASSE FIF RENDA FIXA SIMPLES RESP LIMITADA	14.508.643/0001-55	D+0	D+0	D+0
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF LP- RESP LIMITADA	14.386.926/0001-71	D+0	D+0	D+0
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF LP - RESP LIMITADA	11.060.913/0001-10	D+0	D+0	D+0
CAIXA BRASIL MATRIZ FIF RENDA FIXA - RESP LIMITADA	23.215.008/0001-70	D+0	D+0	D+0
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FIF MULTIMERCADO LONGO PRAZO RESP LIMITADA	30.036.235/0001-02	D+0	D+0	D+1
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIF AÇÕES RESP LIMITADA	17.502.937/0001-68	D+1	D+1	D+3
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.598.288/0001-03	D+0	D+0	D+0
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.139.595/0001-78	D+0	D+0	D+0

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	CNPJ	Aplicação Cotização	Resgate Cotização	Resgate Liquidação
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	13.058.816/0001-18	D+1 du	D+1 du	D+3 du
FIA CAIXA DIVIDENDOS	05.900.798/0001-41	D+1 du	D+1 du	D+3 du
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB BDR-AÇÕES FIF	19.436.818/0001-80	D+1	D+1	D+4
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIF	10.347.195/0001-02	D+0	D+0	D+0

Taxas

Fundo	CNPJ	Performance	Administração	Gestão	Distribuição	Custódia	Global
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	36.347.706/0001-71	-	3,50%	-	-	-	-
BANESTES LIQUIDEZ FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI RESP LIMITADA	20.230.719/0001-26	Não possui	-	-	-	0,01%	0,20%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIF RESP LIMITADA	36.178.569/0001-99	10% do que exceder 104% do S&P 500	0,08%	0,2745%	0,6455%	0,01%	1,00%
BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIF AÇÕES RESP LIMITADA	22.632.237/0001-28	Não possui	0,0850% até 0,2167%	0,2695% até 0,6378%	0,6455%	Não possui	1,00% até 1,50%
BB AÇÕES GOVERNANÇA IS FIF RESP LIMITADA	10.418.335/0001-88	Não possui	0,08%	0,2745%	0,6455%	0,01%	1,00%
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	19.523.306/0001-50	-	0,20%	-	-	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO RF TIT PUB X FI	20.734.931/0001-20	-	0,20%	-	-	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FIC FIF RESP LIMITADA	13.077.415/0001-05	Não possui	0,0850%	0,2695%	0,6455%	Não possui	1,00%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIF RESP LIMITADA	07.442.078/0001-05	Não possui	0,0213%	0,0496%	0,1291%	0,01%	0,20%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FIF RESP LIMITADA	07.111.384/0001-69	Não possui	0,0213%	0,0496%	0,1291%	0,01%	0,20%
BB PREVIDENCIÁRIO RF REFERENCIADO DI LP PERFIL FIC FIF RESP LIMITADA	13.077.418/0001-49	Não possui	0,0213% a 0,0616%	0,0496% a 0,1093%	0,1291%	Não possui	0,20% até 0,30%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC CLASSE FIF RENDA FIXA SIMPLES RESP LIMITADA	14.508.643/0001-55	Não possui	-	-	-	0,0025%	0,80%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF LP- RESP LIMITADA	14.386.926/0001-71	Não possui	-	-	-	0,005%	0,20%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF LP - RESP LIMITADA	11.060.913/0001-10	Não possui	-	-	-	Não possui	0,20%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	CNPJ	Performance	Administração	Gestão	Distribuição	Custódia	Global
CAIXA BRASIL MATRIZ FIF RENDA FIXA - RESP LIMITADA	23.215.008/0001-70	Não possui	-	-	-	0,005% sobre o patrimônio líquido	0,20%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FIF MULTIMERCADO LONGO PRAZO RESP LIMITADA	30.036.235/0001-02	Não possui	-	-	-	0,005%	0,80%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIF AÇÕES RESP LIMITADA	17.502.937/0001-68	Não possui	0,0158%	0,595%	0,0892%	0,005%	0,70%
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.598.288/0001-03	-	0,20%	-	-	-	-
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.139.595/0001-78	-	0,20%	-	-	-	-
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	13.058.816/0001-18	-	0,50%	-	-	-	-
FIA CAIXA DIVIDENDOS	05.900.798/0001-41	-	1,50%	-	-	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB BDR-AÇÕES FIF	19.436.818/0001-80	Não possui	-	-	-	0,075%	1,50%
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIF	10.347.195/0001-02	Não possui	0,0315%	0,0405%	0,018%	0,075%	0,09% até 0,15%

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	0,91	13,25	2,89	6,16	13,25	26,86	30,57	35,59	44,75
IRF-M 1+	1,73	18,52	5,05	6,37	18,52	27,30	20,95	31,18	49,86
IRF-M TOTAL	1,48	16,51	4,38	6,28	16,51	26,79	24,26	32,58	48,53
IMA-B 5	1,46	12,13	2,97	4,75	12,13	23,09	28,71	39,06	57,35
IMA-B 5+	3,94	19,28	6,42	3,80	19,28	23,21	15,14	21,47	58,36
IMA-B TOTAL	2,75	16,05	4,76	4,21	16,05	23,45	21,89	29,69	59,46
IMA-GERAL TOTAL	1,63	14,80	3,81	5,67	14,80	25,89	27,10	33,88	51,04
IDKA 2	1,45	12,13	2,89	5,00	12,13	22,60	28,70	39,79	56,32
IDKA 20	6,58	27,13	10,28	3,92	27,13	24,70	6,62	8,97	57,20
CDI	0,90	13,05	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62	36,29	44,42

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	5,38	22,28	15,12	13,63	22,28	28,01	12,74	16,03	52,68
IBRX 100	5,48	21,27	14,95	13,77	21,27	26,15	12,05	15,97	54,69
IBRX 50	5,31	20,06	14,43	14,39	20,06	26,93	13,55	17,66	51,96
SMALL CAP	7,05	17,12	11,48	3,40	17,12	-0,52	-16,63	-17,18	31,02
Índice Consumo - ICON	5,98	6,98	12,32	-1,29	6,98	-20,15	-40,99	-40,51	-7,65
Índice Dividendos - IDIV	6,90	26,84	14,61	16,04	26,84	42,88	33,72	32,38	92,17

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	4,25	15,50	2,86	4,95	15,50	18,06	15,37	3,56	40,82

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI (BRL)	2,70	11,43	7,01	6,95	11,43	-16,44	4,80	54,48	99,34
MSCI ACWI (USD)	4,70	20,09	10,68	6,47	20,09	-3,69	12,49	28,62	59,55
S&P 500 (BRL)	2,43	15,27	7,54	7,67	15,27	-13,18	18,31	77,33	137,73
S&P 500 (USD)	4,42	24,23	11,24	7,18	24,23	0,08	26,99	47,64	90,27

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,56	4,62	1,08	1,70	4,62	10,67	21,81	27,31	32,79
INPC	0,55	3,71	0,77	0,99	3,71	9,86	21,02	27,61	33,33
IGPM	0,74	-3,18	1,84	1,34	-3,18	2,10	20,25	48,08	58,89
SELIC	0,90	13,05	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62	36,29	44,42

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,87	8,76	2,05	3,70	8,76	19,63	36,91	48,80	61,44
IPCA + 5,00%	0,95	9,79	2,28	4,19	9,79	21,92	40,87	54,57	69,32
IPCA + 5,50%	0,99	10,30	2,40	4,44	10,30	23,08	42,88	57,51	73,37
IPCA + 5,89%	1,02	10,71	2,49	4,63	10,71	23,98	44,46	59,84	76,59
IPCA + 6,00%	1,03	10,82	2,52	4,68	10,82	24,24	44,91	60,50	77,50
INPC + 4,00%	0,86	7,80	1,73	2,98	7,80	18,75	36,03	49,15	62,09
INPC + 6,00%	1,02	9,85	2,20	3,95	9,85	23,32	43,97	60,89	78,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150824 (6,561800%)	52.226.729,03	6,561800	52.239.416,99	6,618000	12.687,96
NTN-B 150824 (7,060000%)	200.525.620,58	7,060000	201.148.156,16	6,618000	622.535,58
NTN-B 150824	252.752.349,61	6,957289	253.387.573,15	6,618000	635.223,54
NTN-B 150830 (5,250000%)	27.922.405,30	5,250000	28.005.284,76	5,220000	82.879,46
NTN-B 150830	27.922.405,30	5,250000	28.005.284,76	5,220000	82.879,46
NTN-B 150840 (5,270000%)	33.643.387,08	5,270000	33.330.966,91	5,381900	-312.420,17
NTN-B 150840	33.643.387,08	5,270000	33.330.966,91	5,381900	-312.420,17
NTN-B 150545 (3,680000%) ..	7.720.475,37	3,680000	6.182.859,53	5,477000	-1.537.615,84
NTN-B 150545 (4,290000%) ..	394.496,04	4,290000	341.743,51	5,477000	-52.752,53
NTN-B 150545 (5,100000%) ..	15.372.634,12	5,100000	14.726.447,26	5,477000	-646.186,86
NTN-B 150545 (5,730000%)	27.425.103,24	5,730000	28.328.738,26	5,477000	903.635,02
NTN-B 150545	50.912.708,77	5,277303	49.579.788,56	5,477000	-1.332.920,21
NTN-B 150850 (5,290000%)	28.097.028,86	5,290000	27.504.046,49	5,471800	-592.982,37
NTN-B 150850	28.097.028,86	5,290000	27.504.046,49	5,471800	-592.982,37
NTN-B 150555 (5,260000%)	22.247.354,09	5,260000	21.639.162,17	5,472400	-608.191,92
NTN-B 150555	22.247.354,09	5,260000	21.639.162,17	5,472400	-608.191,92
Total	415.575.233,71	6,328750	413.446.822,05	6,167862	-2.128.411,66

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2412	01/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	4.721,82	0,00	484,09620301	9,7538877000
2437	01/12/2023	CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC CLASSE FIF RENDA FIXA SIMPLES RESP LIMITADA	0,00	88.645,05	37.251,97059851	2,3796070000
2418	04/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	23,35	0,00	2,39310444	9,7572005600
2411	04/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	1.962,09	201,09149006	9,7572005600
2445	04/12/2023	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FIC FIF RESP LIMITADA	0,00	20.916,81	7.749,45766700	2,6991321070
2419	05/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	1.164,55	0,00	119,31247687	9,7605047700
2417	06/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	963,10	0,00	98,64018289	9,7637694100
2410	06/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	4.078,54	417,72186848	9,7637694100
2444	07/12/2023	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FIC FIF RESP LIMITADA	0,00	455,06	168,38347400	2,7025217440
2436	07/12/2023	CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC CLASSE FIF RENDA FIXA SIMPLES RESP LIMITADA	767.727,84	0,00	322.094,42306409	2,3835490000
2396	08/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	447.149,74	0,00	45.765,75482602	9,7704002000
2416	08/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	2.810.447,38	0,00	287.649,15695691	9,7704002000
2398	11/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	76.496,22	0,00	7.826,69262818	9,7737606000
2415	11/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	4.541.990,13	0,00	464.712,64420275	9,7737606000
2440	11/12/2023	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FIC FIF RESP LIMITADA	1.746,34	0,00	645,63701500	2,7048325280
2399	12/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	3.111,31	0,00	318,22702133	9,7770138700
2397	14/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	11.580.018,22	0,00	1.183.629,86120096	9,7834792800
2443	14/12/2023	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FIC FIF RESP LIMITADA	0,00	45.627,65	16.848,04440000	2,7081867140
2400	15/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	345.668,46	35.320,73647761	9,7865586800
2430	15/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	40.929,10	4.182,17489489	9,7865586800
2438	18/12/2023	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FIC FIF RESP LIMITADA	0,00	230.576,25	85.072,72805310	2,7103427300
2405	19/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	8.156.817,87	832.927,58023528	9,7929496700
2406	19/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	3.116,38	318,22702133	9,7929496700
2407	19/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	76.646,41	7.826,69262818	9,7929496700
2408	19/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	448.181,73	45.765,75482602	9,7929496700
2409	19/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	850.836,76	86.882,58238891	9,7929496700
2420	19/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	758,24	77,42758532	9,7929496700
2421	19/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	2.560.021,28	261.414,72864604	9,7929496700

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2422	19/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	2.816.933,72	287.649,15695691	9,7929496700
2424	19/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	965,98	98,64018289	9,7929496700
2425	19/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	1.168,42	119,31247687	9,7929496700
2426	19/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	23,44	2,39310444	9,7929496700
2427	19/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	1.703.473,88	173.949,00843105	9,7929496700
2428	19/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	4.740,73	484,09620301	9,7929496700
2429	19/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	148.419,62	15.155,76254282	9,7929496700
2395	19/12/2023	BANESTES LIQUIDEZ FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI RESP LIMITADA	5.460.000,00	0,00	2.402.314,90432702	2,2728077800
2439	19/12/2023	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FIC FIF RESP LIMITADA	500.597,14	0,00	184.626,67367100	2,7114020420
2414	20/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	10.115,26	0,00	1.032,62053554	9,7957184200
2434	20/12/2023	CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC CLASSE FIF RENDA FIXA SIMPLES RESP LIMITADA	0,00	621.341,06	259.727,67390426	2,3922790000
2404	21/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	1.423.411,87	145.262,50049899	9,7988941800
2423	21/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	14.357,15	1.465,18063604	9,7988941800
2441	21/12/2023	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FIC FIF RESP LIMITADA	0,00	63.818,21	23.518,40012600	2,7135438490
2432	21/12/2023	CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC CLASSE FIF RENDA FIXA SIMPLES RESP LIMITADA	66.338,41	0,00	27.719,19539702	2,3932300000
2403	22/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	1.556,22	158,76554216	9,8020009800
2413	27/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	2.504,60	0,00	255,35387189	9,8083494200
2402	27/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	175,50	17,89291884	9,8083494200
2435	27/12/2023	CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC CLASSE FIF RENDA FIXA SIMPLES RESP LIMITADA	119.000,00	0,00	49.664,53484781	2,3960760000
2401	28/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	354.215,96	36.102,48271179	9,8114016900
2431	28/12/2023	BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,00	42.049,53	4.285,78212530	9,8114016900
2442	28/12/2023	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FIC FIF RESP LIMITADA	0,00	23.678,67	8.712,17621800	2,7178823530
2433	28/12/2023	CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC CLASSE FIF RENDA FIXA SIMPLES RESP LIMITADA	0,00	119.000,00	49.644,83086757	2,3970270000
Total			26.394.115,41	20.214.567,64		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 3.246.930,30

Value-At-Risk: 0,47%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,21	0,17		0,08	0,10	0,92	633.622.389,58	91,75
Artigo 8º	11,89	6,67		0,13	0,40	5,68	18.094.648,02	2,62
Artigo 9º	8,75	6,09		0,17	0,20	2,65	28.438.494,68	4,12
Artigo 10º	8,89	6,36		0,09	0,48	5,19	10.473.411,54	1,52
VILA VELHA - CONSOLIDADO		0,47		0,47			690.628.943,82	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,17%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150824 (6,561800%)	0,08	0,07	0,00	0,08	-0,85	0,82	52.226.729,03	7,56
NTN-B 150824 (7,060000%)	0,08	0,07	0,00	0,08	-0,41	0,86	200.525.620,58	29,04
NTN-B 150830 (5,250000%)	0,08	0,07	0,00	0,08	-2,03	0,73	27.922.405,30	4,04
NTN-B 150840 (5,270000%)	0,08	0,07	0,00	0,08	-2,01	0,73	33.643.387,08	4,87
NTN-B 150545 (3,680000%) ..	0,08	0,07	0,00	0,08	-3,45	0,61	7.720.475,37	1,12
NTN-B 150545 (4,290000%) ..	0,08	0,07	0,00	0,08	-2,90	0,65	394.496,04	0,06
NTN-B 150545 (5,100000%) ..	0,08	0,07	0,00	0,08	-2,16	0,71	15.372.634,12	2,23
NTN-B 150545 (5,730000%)	0,08	0,07	0,00	0,08	-1,60	0,76	27.425.103,24	3,97
NTN-B 150850 (5,290000%)	0,08	0,07	0,00	0,08	-1,99	0,73	28.097.028,86	4,07
NTN-B 150555 (5,260000%)	0,08	0,07	0,00	0,08	-2,02	0,73	22.247.354,09	3,22
Sub-total	0,08	0,07	0,00		-1,10	0,80	415.575.233,71	60,17

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA	0,03	0,02	0,00	0,01	-8,73	0,66	3.611.797,90	0,52
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	0,70	0,36	0,00	2,14	0,03	0,92	901.828,09	0,13

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	0,71	0,36	0,00	2,14	0,03	0,92	2.793.490,86	0,40
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIF RESP LIMITADA	3,07	2,21	0,03	0,02	0,60	2,74	16.046.035,53	2,32
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FIF RESP LIMITADA	1,39	1,35	0,04	0,03	0,40	1,46	36.327.602,55	5,26
CAIXA BRASIL IDKA IPKA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF LP- RESP LIMITADA	0,90	0,98	0,00	0,31	0,56	1,40	73.524,74	0,01
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF LP - RESP LIMITADA	1,02	1,24	0,01	0,01	0,53	1,44	10.235.306,47	1,48
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,71	0,36	0,00	2,14	0,04	0,92	16.249.107,45	2,35
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,71	0,36	0,00	2,14	0,04	0,92	21.637.214,37	3,13
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIF	0,02	0,01	0,00	0,01	-0,84	0,88	262.182,27	0,04
Sub-total	0,90	0,92	0,08		0,52	1,36	108.138.090,23	15,66

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BANESTES LIQUIDEZ FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI RESP LIMITADA	0,05	0,03	0,00	0,03	0,92	0,94	14.463.110,96	2,09
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FIC FIF RESP LIMITADA	0,02	0,01	0,00	0,01	-3,05	0,82	4.482.015,76	0,65
BB PREVIDENCIÁRIO RF REFERENCIADO DI LP PERFIL FIC FIF RESP LIMITADA	0,02	0,02	0,00	0,01	0,27	0,90	33.852.370,55	4,90
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC CLASSE FIF RENDA FIXA SIMPLES RESP LIMITADA	0,01	0,02	0,00	0,00	-5,75	0,81	324.557,22	0,05
CAIXA BRASIL MATRIZ FIF RENDA FIXA - RESP LIMITADA	0,04	0,03	0,00	0,03	0,92	0,93	56.787.011,15	8,22
Sub-total	0,03	0,02	0,00		0,74	0,92	109.909.065,64	15,91

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,67%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIF RESP LIMITADA	9,75	6,38	0,00	1,30	0,43	5,08	27.713,99	0,00
BB AÇÕES GOVERNANÇA IS FIF RESP LIMITADA	12,97	7,18	0,00	0,21	0,36	5,52	338.578,95	0,05

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	12,73	7,02	0,10	0,21	0,35	5,36	13.403.434,65	1,94
FIA CAIXA DIVIDENDOS	9,48	5,80	0,03	0,17	0,61	6,71	4.324.920,43	0,63
Sub-total	11,89	6,67	0,13		0,40	5,68	18.094.648,02	2,62

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,09%

Artigo 9º III (4.963)

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES GLOBAIS FIC FIF AÇÕES RESP LIMITADA	9,65	6,24	0,03	3,86	0,21	2,95	5.471.663,61	0,79
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIF AÇÕES RESP LIMITADA	8,58	6,24	0,11	0,59	0,20	2,59	18.679.459,42	2,70
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB BDR-AÇÕES FIF	11,76	6,00	0,02	3,03	0,14	2,51	4.287.371,65	0,62
Sub-total	8,75	6,09	0,17		0,20	2,65	28.438.494,68	4,12

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 6,36%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FIF MULTIMERCADO LONGO PRAZO RESP LIMITADA	8,89	6,36	0,09	0,48	0,48	5,19	10.473.411,54	1,52
Sub-total	8,89	6,36	0,09		0,48	5,19	10.473.411,54	1,52

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)

(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)