PAUTA ORDINÁRIA Nº 07

REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

17/08/2023

1. **Demonstrativos dos Fundos de Investimentos da CAPSECI – Julho/2023;**

1.1. *Relatório das Aplicações Financeiras com detalhamento por contas bancárias;*

1.2. *Posição de Ativos e Enquadramento da Carteira.*

2. ***Análise do Credenciamento de Instituições Financeiras e de Fundos de Investimento.***

CAPSECI - CAIXA DE APOSENTAD E PENSÕES DOS SERV PÚBL DO MUNICÍPIO DE CIANORTE
RELATÓRIO DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS POR CONTAS BANCÁRIAS JULHO/2023

Conta	Fundo de Investimento	Cód	Saldo (R$)	Rend Mês (R$)	Rend Ano (R$)
384-4 / Fonte 040 (Aporte)	CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	**13**	9.812.704,41	110.711,70	577.373,61
	CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	**5**	0,00	0,00	123.851,12
	CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	**6**	366.858,39	3.888,63	26.316,99
	CAIXA FI DISPONIBILIDADES RF	**11**	0,00	0,00	2.314,36
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	**7**	204.302,48	1.808,36	173.546,42
Total da conta			**10.383.865,28**	**116.408,69**	**903.402,50**
500009-6 / Fonte 100 (Tx adm)	CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	**13**	0,00	0,00	0,08
	CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	**5**	0,00	0,00	6,14
	CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	**6**	629.639,09	6.674,07	45.167,86
	CAIXA FI DISPONIBILIDADES RF	**11**	0,00	0,00	11,25
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	**7**	82.648,07	731,55	8.629,09
Total da conta			**712.287,16**	**7.405,62**	**53.814,42**
500033-9 / Fonte 040 (Repasses)	CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	**13**	7.308.268,23	114.724,38	866.953,01
	CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	**5**	0,00	0,00	13.394,17
	CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	**6**	703.208,10	7.453,88	50.445,41
	CAIXA FI DISPONIBILIDADES RF	**11**	0,02	0,00	50,89
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	**7**	8.477.224,62	52.197,05	850.342,93
	CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA-B RF LP	**18**	3.112.609,81	25.425,34	112.609,81
	CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIM	**29**	3.126.083,17	45.497,71	237.897,05
	CAIXA FIC CAP PROTEGIDO BV VI MM	**30**	1.559.565,79	26.486,78	59.565,79
Total da conta			**24.286.959,74**	**271.785,14**	**2.191.259,06**
500051-7 / Fonte 551 (Compensação)	CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	**13**	6.008.623,69	67.792,23	414.746,00
	CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	**5**	2.273.738,58	20.642,46	172.079,72
	CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	**6**	515.456,98	5.463,75	36.976,87
	CAIXA FI DISPONIBILIDADES RF	**11**	109,72	1,07	109,72
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	**7**	540.058,17	4.780,26	45.623,36
Total da conta			**9.337.987,14**	**98.679,77**	**669.535,67**
40674-0 / Fonte 551 (Compensação)	BB PREVID TP IPCA		0,00	0,00	272.700,06
	BB PREVID RF FLUXO	**15**	0,00	1.350,13	15.594,87
	BB PREVID RF PERFIL	**14**	15.067.454,32	156.764,17	725.930,65
	BB PREVID IPCA III	**19**	3.774.768,41	36.621,13	270.583,97
	BB PREVIDENCIÁRIO ACOES ALOC FIC	**23**	2.778.416,21	97.788,55	262.892,77
	BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVID	**24**	3.617.910,31	133.267,17	269.227,32
Total da conta			**25.238.549,25**	**425.791,15**	**1.816.929,64**
59325-7 / Fonte 040 (Repasses)	BB PREVID TP IPCA		0,00	0,00	112.496,42
	BB PREVID RF IDKA 2	**10**	3.303.949,47	30.875,01	103.949,47
	BB PREVID RF FLUXO	**15**	0,00	21.413,16	113.030,67
	BB PREVID RF PERFIL	**14**	8.653.541,12	106.753,57	642.847,22
	BB PREVID RF TP XXI FI	**9**	2.128.409,48	22.268,78	134.564,52
	BB PREVIDENCIÁRIO ACOES ALOC FIC	**23**	1.168.302,84	41.119,34	110.544,41
Total da conta			**15.254.202,91**	**222.429,86**	**1.217.432,71**
64921-X / Fonte 100 (Tx adm)	BB PREVID RF FLUXO	**15**	882,68	777,73	4.903,65
	BB PREVID RF PERFIL	**14**	1.340.237,52	13.996,63	85.478,21
Total da conta			**1.341.120,20**	**14.774,36**	**90.381,86**
68200-4 / Fonte 040 (Aporte)	BB PREVID RF FLUXO	**15**	0,00	7.362,03	11.011,45
	BB PREVID RF PERFIL	**14**	4.596.559,64	34.026,90	476.709,51
Total da conta			**4.596.559,64**	**41.388,93**	**487.720,96**
23192-0 / Fonte 040 (Repasses)	BTG ABSOLUTO INST. FIQ FI AÇÕES	**20**	1.393.830,81	41.441,06	125.831,69
	LA SHOPPING CENTERS MULTIESTR FIP	**31**	1.304.772,90	-1.426,60	663.700,36

Total da conta			**2.698.603,71**	**40.014,46**	**789.532,05**
28418-1 / Fonte 040 (Aporte)	ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX	**22**	1.082.470,02	47.244,88	86.172,94
	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	**25**	1.042.888,63	26.553,41	10.368,91
	ITAÚ MOMENTO 30 II	**27**	1.616.794,88	69.428,68	117.630,01
	ITAÚ INST. ALOC DINAM RF FIC FII	**8**	5.809.252,12	51.707,82	729.067,83
Total da conta			**9.551.405,65**	**194.934,79**	**943.239,69**
61272-0 / Fonte 040 (Repasses)	ITAÚ INST RENDA FIXA REF DI FI	**17**	13.398.157,33	152.326,99	955.831,00
	ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	**16**	6.877.797,53	42.953,53	340.784,62
	ITAÚ INST. ALOC DINAM RF FIC FII	**8**	782.444,27	6.964,49	79.243,30
Total da conta			**21.058.399,13**	**202.245,01**	**1.375.858,92**
61535-1 / Fonte 040 (Repasses)	SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M1 LP	**12**	5.255.598,00	58.442,60	298.700,35
	SCHRODERS IBOVESPA FIA	**28**	1.254.906,74	32.609,87	123.969,75
Total da conta			**6.510.504,74**	**91.052,47**	**422.670,10**
471492-0 F 040	BRADESCO FIA SELECTION	**26**	926.952,07	23.826,88	71.489,56
BEM - F 040	SOMMA BRASIL FIA	**21**	2.615.127,38	67.375,92	113.999,98
40810-7 - F 551	GRAVEYARD AND DEATH CARE SERV FII	**32**	405.018,73	-14.246,89	-168.927,41
81035-1 - F 040 Aporte	NTN-B - AGO/2024 (IPCA+6,63%)	**1**	4.104.003,42	22.022,48	222.780,31
	NTN-B - MAI/2028 (IPCA+5,54%)	**2**	3.543.123,42	15.985,28	41.143,93
	NTN-B - MAI/2033 (IPCA+5,69%)	**3**	4.044.584,56	18.721,27	48.086,53
	NTN-B - MAI/2033 (IPCA+6,21%)	**4**	6.032.065,37	30.397,07	212.301,02
Total da conta			**17.723.776,77**	**87.126,10**	**524.311,79**
	Total em aplicações financeiras		**152.641.319,50**	**1.890.992,26**	**11.502.651,50**
	Renda Fixa		128.748.279,02	1.254.025,50	9.418.288,37
	Renda Variável		23.893.040,48	636.966,76	2.084.363,13

Seguimento	Classificação	Tipo de Ativo / Fundo de Investimento	CNPJ DO FUNDO	VALOR R$	% Aplicado	Limites da Política de Investimentos			
						Limite Res CMN	Limite Inferior	Estratégia Alvo	Limite Superior
RENDA FIXA - Art. 7º	**Art. 7º, I, "a"**	**Títulos Públicos**		**17.723.776,77**	**11,61%**	**100,00%**	**0,00%**	**10,00%**	**100,00%**
		1 NTN-B - AGO/2024 (IPCA+6,63%)		4.104.003,42	2,69%				
		2 NTN-B - MAI/2028 (IPCA+5,54%)		3.543.123,42	2,32%				
		3 NTN-B - MAI/2033 (IPCA+5,69%)		4.044.584,56	2,65%				
		4 NTN-B - MAI/2033 (IPCA+6,21%)		6.032.065,37	3,95%				
	Art. 7º, I, "b"	**Fundos 100% Títulos Públicos**		**25.817.189,82**	**16,91%**	**100,00%**	**0,00%**	**45,00%**	**100,00%**
		5 CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	14.386.926/0001-71	2.273.738,58	1,49%				
		6 CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	10.740.670/0001-06	2.215.162,56	1,45%				
		7 CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	23.215.097/0001-55	9.304.233,34	6,10%				
		8 ITAÚ INST. ALOC DINAM RF FIC FI I	21.838.150/0001-49	6.591.696,39	4,32%				
		9 BB PREVID RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	44.345.590/0001-60	2.128.409,48	1,39%				
		10 BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	13.322.205/0001-35	3.303.949,47	2,16%				
	Art. 7º, I, "c"	**Fundos de Índice 100% Títulos Públicos**				100,00%	0,00%	0,00%	100,00%
	Art. 7º, II	**Operações Compromissadas**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
	Art. 7º, III, "a"	**Fundos Renda Fixa**		**81.432.544,02**	**53,35%**	**60,00%**	**0,00%**	**25,00%**	**60,00%**
		11 CAIXA FI DISPONIBILIDADES RF	14.508.643/0001-55	109,74	0,00%				
		12 SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M 1 LP	19.196.599/0001-09	5.255.598,00	3,44%				
		13 CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	23.129.596,33	15,15%				
		14 BB PREVID RF PERFIL	13.077.418/0001-49	29.657.792,60	19,43%				
		15 BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI	13.077.415/0001-05	882,68	0,00%				
		16 ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	05.073.656/0001-58	6.877.797,53	4,51%				
		17 ITAÚ INST RENDA FIXA REF DI FI	00.832.435/0001-00	13.398.157,33	8,78%				
		18 CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA-B RF LP	10.646.895/0001-90	3.112.609,81	2,04%				
	Art. 7º, III, "b"	**Fundos de Índice Renda Fixa**				60,00%	0,00%	0,00%	60,00%
	Art. 7º, IV	**Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)**		**0,00**	**0,00%**	20,00%	0,00%	0,00%	20,00%
	Art. 7º, V, "a"	**Cota Sênior de FIDC**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
	Art. 7º, V, "b"	**Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"**		**3.774.768,41**	**2,47%**	**5,00%**	**0,00%**	**3,00%**	**5,00%**
		19 BB PREVID RF CP IPCA III FI	14.091.645/0001-91	3.774.768,41	2,47%				
	Art. 7º, V, "c"	**Fundo de Debêntures Incentivadas**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
SUBTOTAL RENDA FIXA				**128.748.279,02**	**84,35%**	**460,00%**	**0,00%**	**83,00%**	**460,00%**
FUNDOS DE AÇÕES - Art. 8º	**Art. 8º, I**	**Fundos de Ações**		**14.882.472,51**	**9,75%**	**30,00%**	**0,00%**	**10,00%**	**30,00%**
		20 BTG ABSOLUTO INST. FIQ FI AÇÕES	11.977.794/0001-64	1.393.830,81	0,91%				
		22 ITAÚ INST AÇÕES PHOENIX FIC DE FI	23.731.629/0001-07	1.082.470,02	0,71%				
		23 BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES ALOCAÇÃO FIC DE FI	18.270.783/0001-99	3.946.719,05	2,59%				
		24 BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVID	29.258.294/0001-38	3.617.910,31	2,37%				
		25 ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI	24.571.992/0001-75	1.042.888,63	0,68%				
		26 BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	03.660.879/0001-96	926.952,07	0,61%				
		27 ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	42.318.981/0001-60	1.616.794,88	1,06%				
		28 SCHRODERS IBOVESPA FIA	06.051.151/0001-55	1.254.906,74	0,82%				
	Art. 8º, II	**FI em Índices de Ações**		**2.615.127,38**	**1,71%**	30,00%	0,00%	0,00%	30,00%
		21 SOMMA BRASIL FIA	14.550.994/0001-24	2.615.127,38	1,71%				
EXTERIOR - Art. 9º	Art. 9º, I	**Renda Fixa - Dívida Externa**				10,00%	0,00%	0,00%	10,00%
	Art. 9º, II	**Fundos de Investimento no Exterior**				10,00%	0,00%	0,00%	10,00%
	Art. 9º, III	**Ações - BDR Nível I**				10,00%	0,00%	1,00%	10,00%
ESTRUTURADOS - Art. 10º	**Art. 10º, I**	**Fundos Multimercados**		**4.685.648,96**	**3,07%**	**10,00%**	**0,00%**	**5,00%**	**10,00%**
		29 CAIXA ALOC MACRO FIC MULTIMERCADO LP	08.070.841/0001-87	3.126.083,17	2,05%				
		30 CAIXA FIC CAP PROTEGIDO BV VI MM	50.568.125/0001-90	1.559.565,79	1,02%				
	Art. 10º, II	**Fundo de Participação**		**1.304.772,90**	**0,85%**	**5,00%**	**0,00%**	**0,50%**	**5,00%**
		31 LA SHOPPING CENTERS MULTIESTRAT FIP	16.685.929/0001-31	1.304.772,90	0,85%				
	Art. 10º, III	**Fundos de Ações - Mercado de Acesso**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
IMOBILIÁRIOS - Art. 11º	**Art. 11º**	**Fundo de Investimento Imobiliário**		**405.018,73**	**0,27%**	**5,00%**	**0,00%**	**0,50%**	**5,00%**
		32 GRAVEYARD AND DEATH CARE SERV FII	13.584.584/0001-31	405.018,73	0,27%				
CONS - Art. 12º	Art. 12º	**Empréstimo Consign - Sem Pró Gestão**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
SUBTOTAL RENDA VARIÁVEL				**23.893.040,48**	**15,65%**	**120,00%**	**0,00%**	**17,00%**	**120,00%**
TOTAL EM INVESTIMENTOS FINANCEIROS				**152.641.319,50**	**100,00%**	**580,00%**	**0,00%**	**100,00%**	**580,00%**
DISP FINANC		**Disponibilidades Financeiras**		295.321,47					
IMÓVEIS VINCULADOS AO RPPS		**Terreno**		11.351.500,00					
		Prédio Comercial		1.070.000,00					
		Apartamento		360.000,00					
SUBTOTAL				**13.076.821,47**					
TOTAL GERAL				**165.718.140,97**					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA **84,35%**

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%) Dia	Mês	Ano	Valor (R$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (5,690000%)	4,02	0,06	0,47	1,20	4.044.584,56	2,65
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (6,210000%)	2,98	0,03	0,51	3,58	6.032.065,37	3,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,630000%)	3,03	0,03	0,54	5,73	4.104.003,42	2,69
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,540000%)	4,08	0,04	0,45	1,17	3.543.123,42	2,32
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea a	**0,36**	**0,04**	**0,49**	**5,57**	**17.723.776,77**	**11,61**

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%) Dia	Mês	Ano	Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,35	0,06	1,07	7,73	2.215.162,56	1,45	7.409.323.495,01	0,03
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,48	0,09	0,94	3,25	3.303.949,47	2,16	6.277.767.899,83	0,05
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,58	0,09	0,92	7,57	2.273.738,58	1,49	5.655.699.960,16	0,04
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,96	0,17	0,90	11,27	6.591.696,39	4,32	2.143.764.034,65	0,31
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,45	0,12	0,89	9,23	9.304.233,34	6,10	5.462.057.088,14	0,17
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2,22	0,04	1,06	6,67	2.128.409,48	1,39	3.548.133.366,37	0,06
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	**2,09**	**0,12**	**0,94**	**9,48**	**25.817.189,82**	**16,91**		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%) Dia	Mês	Ano	Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	5,68	0,28	0,76	12,59	6.877.797,53	4,51	436.690.031,12	1,57

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06	0,05	1,14	7,64	23.129.596,33	15,15	14.867.599.167,79	0,16
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,10	0,06	1,15	7,68	13.398.157,33	8,78	5.292.207.615,10	0,25
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	5,33	0,27	0,82	3,75	3.112.609,81	2,04	1.359.618.949,84	0,23
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,05	1,06	7,57	29.657.792,60	19,43	14.673.774.494,53	0,20
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,05	0,98	7,02	882,68	0,00	3.542.574.797,77	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,02	0,05	0,98	6,67	109,74	0,00	721.224.783,88	0,00
SICREDI	SICREDI	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,34	0,07	1,12	7,90	5.255.598,00	3,44	597.896.762,85	0,88
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	**0,42**	**0,08**	**1,08**	**7,54**	**81.432.544,02**	**53,35**		

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	2,19	0,07	0,98	7,72	3.774.768,41	2,47	312.755.409,33	1,21
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea b	**2,19**	**0,07**	**0,98**	**7,72**	**3.774.768,41**	**2,47**		
		Renda Fixa	**1,14**	**0,08**	**0,97**	**7,86**	**128.748.279,02**	**84,35**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL 11,46%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	20,87	0,47	3,06	9,92	1.393.830,81	0,91	1.488.977.770,22	0,09
SOMMA	BEM	SOMMA BRASIL FIA	20,64	1,25	2,64	4,56	2.615.127,38	1,71	333.202.029,15	0,78
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	20,13	1,59	3,65	10,45	3.946.719,05	2,59	335.529.912,90	1,18
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	19,43	1,45	2,61	1,00	1.042.888,63	0,68	1.516.010.022,90	0,07
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	22,74	0,82	4,56	8,65	1.082.470,02	0,71	346.878.154,58	0,31
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	20,68	1,52	3,82	8,04	3.617.910,31	2,37	898.643.728,78	0,40
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	20,64	0,84	2,64	8,36	926.952,07	0,61	483.820.683,81	0,19
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	22,84	0,82	4,49	7,85	1.616.794,88	1,06	181.425.098,24	0,89
SCHRODER	SICREDI	SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	20,75	0,92	2,67	10,96	1.254.906,74	0,82	237.732.806,48	0,53
		Sub-total Artigo 8º I	**20,12**	**1,22**	**3,43**	**7,97**	**17.497.599,89**	**11,46**		
		Renda Variável	**20,12**	**1,22**	**3,43**	**7,97**	**17.497.599,89**	**11,46**		

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	FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	5,36	0,60	1,73	3,97	1.559.565,79	1,02	133.082.465,86	1,17
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	4,25	0,35	1,48	8,24	3.126.083,17	2,05	1.577.035.964,16	0,20
		Sub-total Artigo 10º I	**4,37**	**0,43**	**1,56**	**8,46**	**4.685.648,96**	**3,07**		
		Investimentos Estruturados	**16,71**	**0,34**	**1,22**	**26,11**	**4.685.648,96**	**3,07**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS 1,12%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
LEGATUS	BTG PACTUAL	FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	68,46	-0,11	-0,11	103,53	1.304.772,90	0,85	314.969.248,26	0,41
PLANNER	PLANNER	CARE11	34,01	2,58	-3,40	-29,43	405.018,73	0,27	297.789.759,05	0,14
		Sub-total Artigo 11º	**33,98**	**2,22**	**-3,74**	**-29,68**	**1.709.791,63**	**1,12**		
		Fundos Imobiliários	**33,98**	**2,22**	**-3,74**	**-29,68**	**1.709.791,63**	**1,12**		
		Total	**3,24**	**0,23**	**1,24**	**8,18**	**152.641.319,50**	**100,00**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

				Política de Investimentos				
Artigo	**Tipo de Ativo**	**Valor(R$)**	**% Carteira**	**Mínimo**	**Objetivo**	**Máximo**	**ALM**	**Limite Legal**
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	17.723.776,77	11,61	0,00	10,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	25.817.189,82	16,91	0,00	45,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	81.432.544,02	53,35	0,00	25,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	3.774.768,41	2,47	0,00	3,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	**128.748.279,02**	**84,35**					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	17.497.599,89	11,46	0,00	10,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	**17.497.599,89**	**11,46**					30,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	4.685.648,96	3,07	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	**4.685.648,96**	**3,07**					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	1.709.791,63	1,12	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	**1.709.791,63**	**1,12**					5,00
Total		**152.641.319,50**	**100,00**					

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	5,57 88,69	2,08 63,06			87.126,10	524.211,79
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,94 87,48	9,48 124,05	4,75 143,95	8,36 129,74	13,02 95,88	215.456,11	3.178.804,56
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,08 100,61	7,54 98,68	3,32 100,39	6,39 99,10	13,39 98,58	914.822,16	5.444.587,91
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,98 91,39	7,72 101,07	2,54 77,01	6,30 97,81	10,98 80,79	36.621,13	270.583,97
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	3,43 0,17	7,97 -3,15	16,00 -0,77	4,22 -3,29	10,57 -7,64	580.655,76	1.292.127,34
Artigo 10º I % do CDI	1,56 145,55	8,46 110,78	5,41 163,93	7,17 111,30	14,32 105,45	71.984,49	297.462,84
Artigo 10º II % do CDI	0,00 0,00	103,75 1.357,98	-0,21 -6,39	2,97 46,04	102,76 756,45	0,00	665.126,96
Artigo 11º % do CDI	-3,74 -348,73	-29,68 -388,49	4,92 148,96	-21,93 -340,28	-56,80 -418,11	-15.673,49	-170.354,01
CIANORTE (Total)						**1.890.992,26**	**11.502.551,36**

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 150533 (5,690000%)	4.025.863,29	0,00	0,00	0,00	4.044.584,56	18.721,27	48.086,53
NTN-B 150533 (6,210000%)	6.001.668,30	0,00	0,00	0,00	6.032.065,37	30.397,07	212.301,02
NTN-B 150824 (6,630000%)	4.081.980,94	0,00	0,00	0,00	4.104.003,42	22.022,48	222.680,31
NTN-B 150828 (5,540000%)	3.527.138,14	0,00	0,00	0,00	3.543.123,42	15.985,28	41.143,93
					17.723.776,77	87.126,10	

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
BB PREV RF IDKA2	3.273.074,46	0,00	0,00	0,00	3.303.949,47	30.875,01	103.949,47
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2.106.140,70	0,00	0,00	0,00	2.128.409,48	22.268,78	134.564,52
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.253.096,12	0,00	0,00	0,00	2.273.738,58	20.642,46	309.331,15
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.191.682,23	0,00	0,00	0,00	2.215.162,56	23.480,33	158.907,13
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	6.244.716,12	3.000.000,00	0,00	0,00	9.304.233,34	59.517,22	1.078.141,80
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	6.533.024,08	0,00	0,00	0,00	6.591.696,39	58.672,31	808.311,13
					25.817.189,82	215.456,11	

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 FLUXO FIC	3.509,03	4.910.381,53	-4.943.910,93	0,00	882,68	30.903,05	144.540,50
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	29.268.392,17	1.777.859,16	-1.700.000,00	0,00	29.657.792,60	311.541,27	1.930.965,59
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	108,67	0,00	0,00	0,00	109,74	1,07	2.486,22
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	25.836.368,02	0,00	-3.000.000,00	0,00	23.129.596,33	293.228,31	1.859.072,70
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	3.087.184,47	0,00	0,00	0,00	3.112.609,81	25.425,34	112.609,81
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	13.245.830,34	0,00	0,00	0,00	13.398.157,33	152.326,99	955.831,00
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	4.934.844,00	1.900.000,00	0,00	0,00	6.877.797,53	42.953,53	340.784,62
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	5.197.155,40	0,00	0,00	0,00	5.255.598,00	58.442,60	298.700,35
					81.432.544,02	914.822,16	

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3.738.147,28	0,00	0,00	0,00	3.774.768,41	36.621,13	270.583,97
					3.774.768,41	36.621,13	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	3.807.811,16	0,00	0,00	0,00	3.946.719,05	138.907,89	373.437,18

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	3.484.643,14	0,00	0,00	0,00	3.617.910,31	133.267,17	269.227,32
BRADESCO F I A SELECTION	903.125,19	0,00	0,00	0,00	926.952,07	23.826,88	71.489,56
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	1.352.389,75	0,00	0,00	0,00	1.393.830,81	41.441,06	125.831,69
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	1.016.335,22	0,00	0,00	0,00	1.042.888,63	26.553,41	10.368,91
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	1.035.225,14	0,00	0,00	0,00	1.082.470,02	47.244,88	86.172,94
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	1.547.366,20	0,00	0,00	0,00	1.616.794,88	69.428,68	117.630,01
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	1.222.296,87	0,00	0,00	0,00	1.254.906,74	32.609,87	123.969,75
SOMMA BRASIL FIA	2.547.751,46	0,00	0,00	0,00	2.615.127,38	67.375,92	113.999,98
					17.497.599,89	580.655,76	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	3.080.585,46	0,00	0,00	0,00	3.126.083,17	45.497,71	237.897,05
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	1.533.079,01	0,00	0,00	0,00	1.559.565,79	26.486,78	59.565,79
					4.685.648,96	71.984,49	

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	1.306.199,50	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
					0,00	0,00	

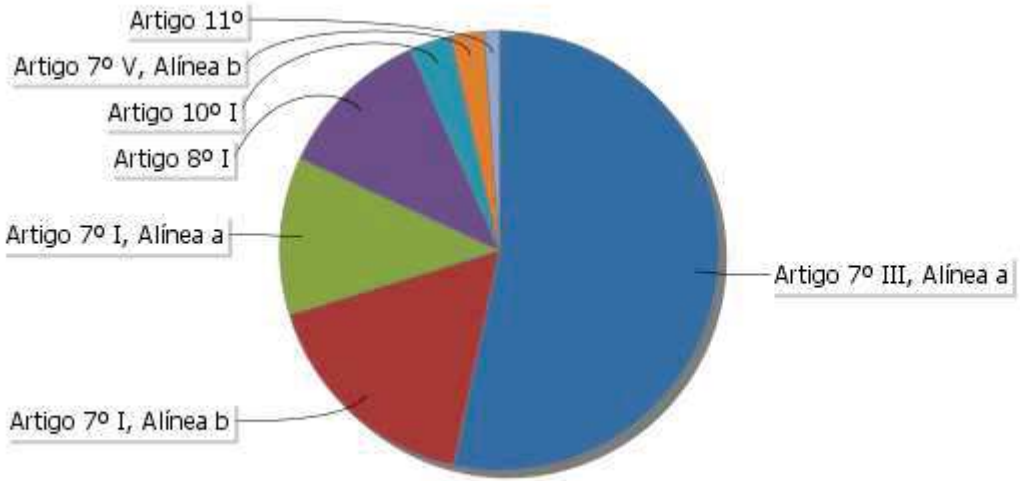
Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
CARE11	419.265,62	0,00	0,00	0,00	0,00	405.018,73	-14.246,89	-168.927,41
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	1.304.772,90	-1.426,60	663.700,36
						1.709.791,63	-15.673,49	

Análise de Liquidez

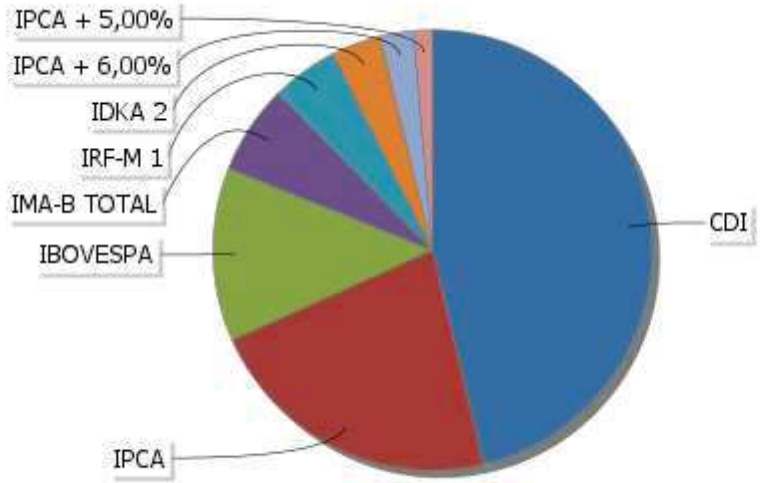
Período	Valor (R$)	(%)	Valor Acumulado (R$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino
de 0 a 30 dias	117.396.131,50	76,91	117.396.131,50	76,91	75,00
de 31 dias a 365 dias	8.753.894,65	5,73	126.150.026,15	82,64	85,00
acima de 365 dias	26.491.293,35	17,36	152.641.319,50	100,00	100,00

Alocação por Artigo



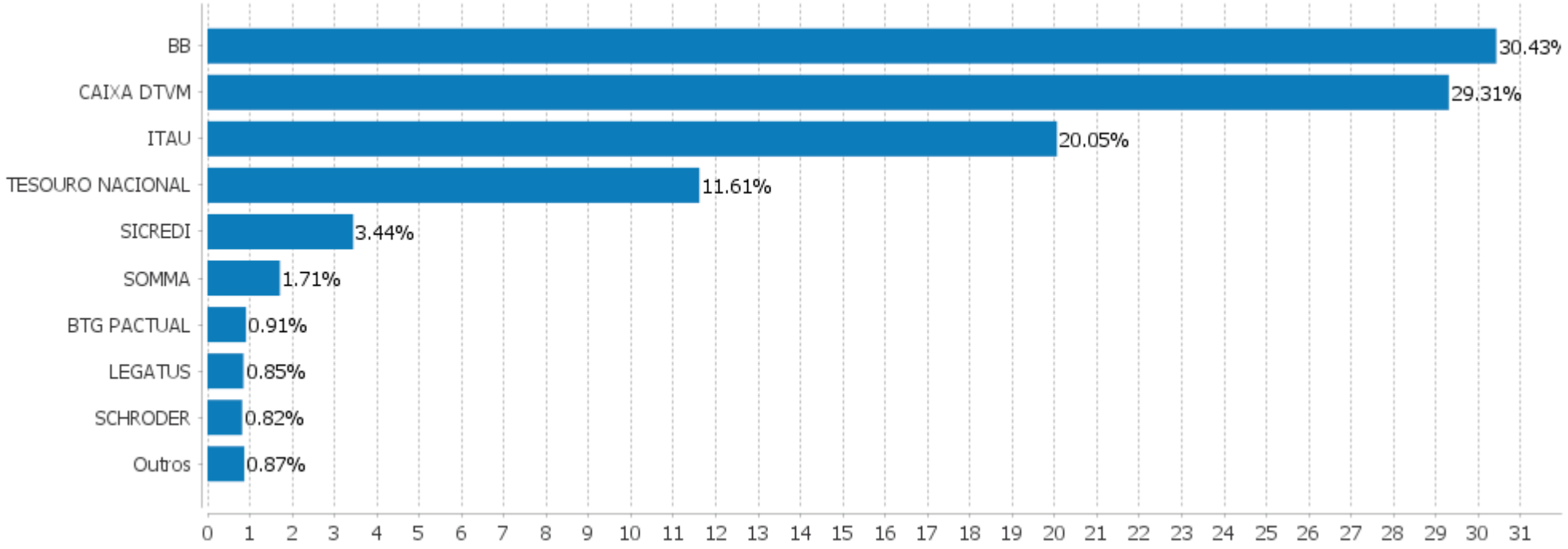
- Artigo 7º III, Alínea a: 53.36%
- Artigo 7º I, Alínea b: 16.91%
- Artigo 7º I, Alínea a: 11.61%
- Artigo 8º I: 11.46%
- Artigo 10º I: 3.07%
- Artigo 7º V, Alínea b: 2.47%
- Artigo 11º: 1.12%

Alocação Por Estratégia



- CDI: 46.26%
- IPCA: 22.03%
- IBOVESPA: 12.75%
- IMA-B TOTAL: 6.55%
- IRF-M 1: 4.89%
- IDKA 2: 3.65%
- IPCA + 6,00%: 2.47%
- IPCA + 5,00%: 1.39%

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	1,77	-0,15	0,71	0,90	1,47	1,97	1,24						8,18
IPCA + 4,85%	0,95	1,18	1,15	0,95	0,65	0,32	0,52						5,84
p.p. indexador	0,83	-1,33	-0,44	-0,05	0,82	1,66	0,73						2,34
2022	0,97	0,86	2,43	-0,37	1,27	-1,31	1,01	1,35	0,67	1,73	-0,59	0,43	8,71
IPCA + 5,04%	0,95	1,39	2,06	1,44	0,90	1,08	-0,27	0,09	0,12	0,98	0,80	1,05	11,10
p.p. indexador	0,02	-0,53	0,38	-1,81	0,37	-2,40	1,28	1,26	0,55	0,74	-1,39	-0,62	-2,38
2021	-0,54	-0,98	0,78	1,26	1,38	0,14	-0,81	-0,76	-0,58	-2,10	-0,35	1,10	-1,51
IPCA + 5,40%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,42	1,33	1,60	1,67	1,37	1,21	15,98
p.p. indexador	-1,21	-2,22	-0,63	0,53	0,11	-0,84	-2,23	-2,09	-2,19	-3,77	-1,72	-0,11	-17,49

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	13	41,94
Meses abaixo - Meta Atuarial	18	58,06

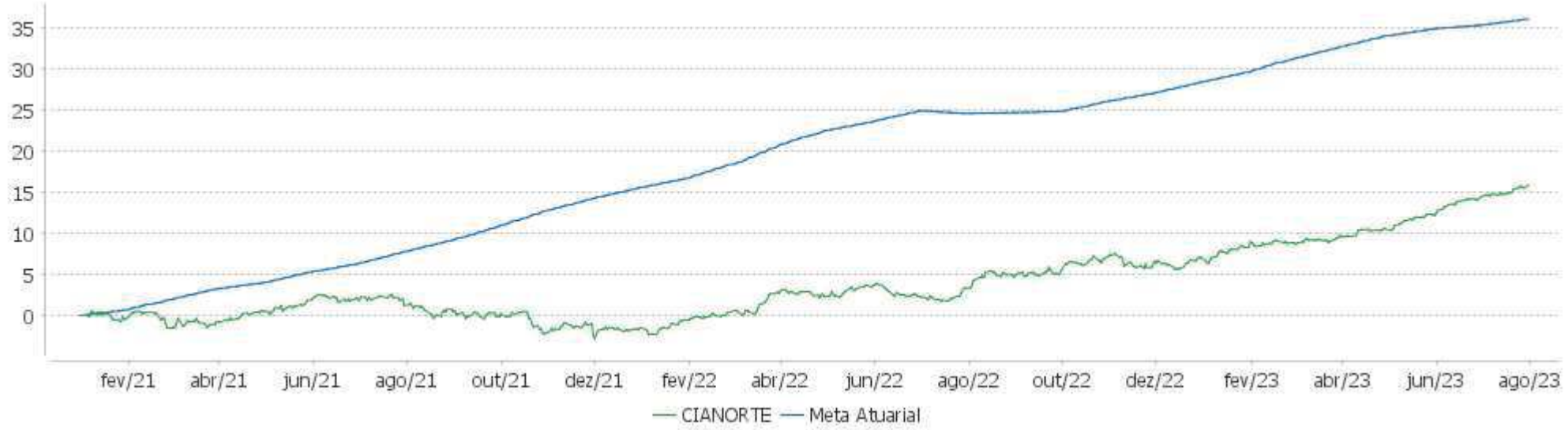
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,43	2022-03
Menor rentabilidade da Carteira	-2,10	2021-10

Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	4,76	1,48	3,27	2,02
06 meses	6,29	4,85	1,44	2,17
12 meses	12,09	9,10	2,99	3,24
24 meses	14,45	26,29	-11,85	3,68
Desde 31/12/2020	15,82	36,37	-20,55	3,80

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

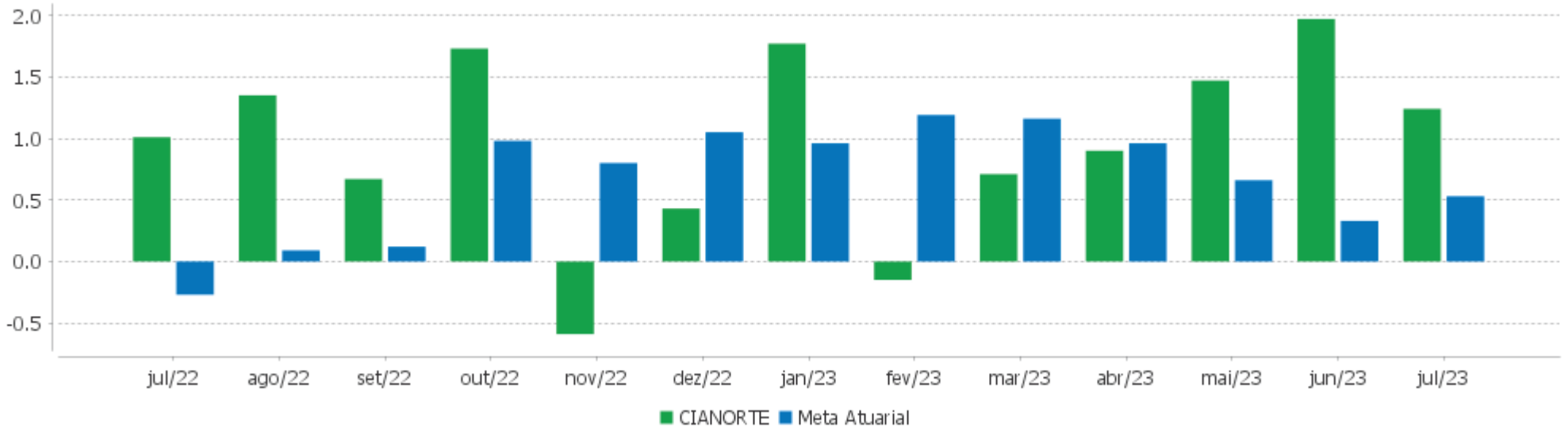
Evolução



Patrimônio Líquido



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	0,98	7,72	2,54	6,30	10,98	21,92	27,69
Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,37	1,22	0,78	0,90	0,77	-6,63	-20,77
NTN-B 150828 (5,540000%)	0,45	3,60	1,96	2,41	3,20		
Var. IPCA p.p.	0,33	0,61	1,69	-0,04	-0,79		
NTN-B 150824 (6,630000%)	0,54	7,21	2,21	5,89	7,16		
Var. IPCA p.p.	0,42	4,22	1,94	3,44	3,17		
NTN-B 150533 (6,210000%)	0,51	6,97	2,10	5,69	6,73		
Var. IPCA p.p.	0,39	3,98	1,83	3,23	2,74		
NTN-B 150533 (5,690000%)	0,47	3,71	-0,85	2,51	3,38		
Var. IPCA p.p.	0,35	0,71	-1,12	0,05	-0,62		
BB PREV RF IDKA2	0,94	7,57	2,37	6,04	10,71	21,24	28,04
Var. IDKA 2 p.p.	-0,04	-0,27	0,11	-0,26	0,16	-0,49	-0,84
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,89	9,23	4,88	8,11	14,71	20,86	21,94
Var. IPCA p.p.	0,77	6,23	4,61	5,66	10,72	6,40	-2,81
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,92	7,57	2,34	6,08	10,55	20,96	27,56
Var. IDKA 2 p.p.	-0,07	-0,26	0,08	-0,23	0,01	-0,77	-1,33
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,06	6,67	1,99	5,21	9,90		
Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,53	0,75	0,47	0,29	0,73		
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,07	7,73	3,39	6,53	13,63	22,57	24,71
Var. IRF-M 1 p.p.	0,00	-0,09	-0,05	-0,11	-0,21	-0,51	-0,81
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,90	11,27	5,57	10,71	13,06	23,97	25,45
Var. IPCA p.p.	0,78	8,28	5,30	8,26	9,07	9,51	0,69
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	1,15	7,68	3,52	6,48	13,84	25,59	28,97
% do CDI	107,28	100,55	106,52	100,52	101,92	105,53	106,22
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	1,12	7,90	3,56	6,72	13,93	23,60	25,48
Var. IRF-M 1 p.p.	0,06	0,08	0,12	0,08	0,09	0,52	-0,04
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	0,76	12,59	6,21	12,66	14,67	17,71	20,27
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,04	0,32	0,38	0,39	-0,78	-1,50	-1,96
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	0,82	12,21	5,87	12,31	15,19	18,61	21,29
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,02	-0,06	0,04	0,04	-0,27	-0,59	-0,93
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1,06	7,57	3,34	6,37	13,57	24,57	27,69
% do CDI	99,30	99,07	101,26	98,91	99,91	101,31	101,54
BB PREV RF FLUXO FIC	0,98	7,02	3,06	5,93	12,47	21,74	23,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	91,73	91,90	92,50	91,96	91,82	89,64	85,51
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,14	7,64	3,48	6,47	13,70	24,83	27,84
% do CDI	106,45	99,96	105,24	100,43	100,87	102,40	102,08
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,99	6,68	2,97	5,66	11,77	20,50	22,38
% do CDI	92,01	87,42	90,02	87,88	86,67	84,54	82,04
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	3,06	9,92	21,12	5,03	11,27	-28,30	-22,39
Var. IBOVESPA p.p.	-0,20	-1,20	4,35	-2,47	-6,93	-28,42	-40,88
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	3,65	10,45	16,02	6,90	14,66	-2,73	15,12
Var. IBOVESPA p.p.	0,38	-0,67	-0,75	-0,61	-3,54	-2,84	-3,38
BRADESCO F I A SELECTION	2,64	8,36	17,40	4,26	15,00	-4,88	10,97
Var. IBOVESPA p.p.	-0,63	-2,77	0,63	-3,24	-3,20	-5,00	-7,52
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	4,56	8,65	18,56	4,23	3,94	-25,26	-14,97
Var. IBOVESPA p.p.	1,30	-2,48	1,80	-3,27	-14,26	-25,37	-33,46
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	2,61	1,00	8,70	-1,38	9,73	-10,65	10,56
Var. IBOVESPA p.p.	-0,65	-10,12	-8,07	-8,88	-8,48	-10,77	-7,93
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	2,67	10,96	15,51	7,19	17,49	3,31	19,17
Var. IBOVESPA p.p.	-0,60	-0,16	-1,26	-0,31	-0,71	3,19	0,68
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	4,49	7,85	18,29	3,61	1,72		
Var. IBOVESPA p.p.	1,22	-3,28	1,53	-3,89	-16,49		
SOMMA BRASIL FIA	2,64	4,56	14,71	0,82	10,36	-11,29	0,04
Var. IBOVESPA p.p.	-0,62	-6,57	-2,06	-6,69	-7,84	-11,41	-18,46
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	3,82	8,04	15,36	4,55	9,45	-2,72	20,78
Var. IBOVESPA p.p.	0,56	-3,09	-1,41	-2,95	-8,75	-2,84	2,28
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	1,48	8,24	5,19	6,95	14,09	18,57	25,65
% do CDI	137,77	107,81	157,24	107,82	103,69	76,56	94,05
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	1,73	4,57					
Var. IBOVESPA p.p.	-1,54	-7,27					
CARE11	-3,40	-29,43	5,29	-21,65	-56,64	-48,08	-57,54
Var. IBOVESPA p.p.	-6,66	-40,56	-11,48	-29,16	-74,85	-48,20	-76,03
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	-0,11	103,53	-0,32	2,85	102,54	-40,09	-41,16
% do CDI	-10,19	1.355,07	-9,69	44,30	754,82	-165,30	-150,92
CIANORTE	1,24	8,18	4,76	6,29	12,09	14,45	
Var. IPCA + 5,04% p.p.	0,73	2,34	3,27	1,44	3,07	-11,34	
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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
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

Cotização e Taxas

	Aplicação		Resgate		Taxas	
Fundo	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32		2,00
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	D+0	D+0	D+30 ou D+0 a D+2880 (isento de taxa de resgate de acordo com a data de solicitação)	D+30 ou D+0 a D+2880 (isento de taxa de resgate de acordo com a data de solicitação)		0,20
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREV RF IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI			D+0	D+0		
BRADESCO F I A SELECTION	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)	D+4 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)		3,00
CARE11	Não se aplica	Não se aplica				
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,80
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	Não se aplica	Não se aplica				
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,50
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+2		
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE	1,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

	Aplicação		Resgate		Taxas	
Fundo	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	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	2,50
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
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
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,20
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
SOMMA BRASIL FIA	D+0	D+0	D+1 du	D+3 du	-	2,00

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 150533 (5,690000%)	4.044.584,56	5,690000	4.172.448,48	5,248700	127.863,92
NTN-B 150533 (6,210000%)	6.032.065,37	6,210000	6.457.150,72	5,248700	425.085,35
NTN-B 150824 (6,630000%)	4.104.003,42	6,630000	4.094.434,03	6,880000	-9.569,39
NTN-B 150828 (5,540000%)	3.543.123,42	5,540000	3.604.539,27	5,117200	61.415,85

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1506	03/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.205,73	0,00	468,12529100	2,5756566070
1513	04/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	20.968,77	0,00	8.137,40584053	2,5768371900
1519	04/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	185.108,83	0,00	71.835,67154200	2,5768371900
1511	05/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	4.081,63	0,00	1.583,24974400	2,5780076800
1520	05/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	97.543,11	0,00	37.836,62506300	2,5780076800
1521	06/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.704.760,19	0,00	660.961,37241100	2,5792130390
1503	07/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	192.518,74	0,00	74.607,48121100	2,5804213850
1514	07/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	28.064,94	0,00	10.876,10735300	2,5804213850
1507	10/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	62.282,56	0,00	24.125,48398547	2,5816087270
1522	11/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.158.029,02	0,00	448.356,45358378	2,5828311620
1523	12/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	20.872,70	0,00	8.077,63791800	2,5840103520
1508	13/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	144,08	0,00	55,73295300	2,5851850810
1524	13/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	3.455,09	0,00	1.336,49618500	2,5851850810
1531	13/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.427.471,36	0,00	552.173,75749600	2,5851850810
1509	19/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	547,56	0,00	211,41890400	2,5899292250
1526	19/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	3.327,22	0,00	1.284,67603200	2,5899292250
1510	21/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	800,00	308,59840500	2,5923659550
1512	24/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	35.778,27	13.794,94879300	2,5935775870
1515	27/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	46.453,98	17.885,68774157	2,5972711070
1525	27/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.394.265,73	921.838,97304700	2,5972711070
1504	28/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	193.868,87	74.607,48121100	2,5985178920
1505	28/07/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	193.868,87	0,00	66.505,84188583	2,9150652710
1516	28/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	16.318,06	6.279,75664500	2,5985178920
1518	28/07/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	12.000,00	0,00	4.116,54590300	2,9150652710
1527	28/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	174.102,46	67.000,67778500	2,5985178920
1529	28/07/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.700.000,00	583.177,33634000	2,9150652710
1532	28/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.434.833,39	552.173,75813243	2,5985178920
1533	28/07/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.434.833,39	0,00	492.213,12616022	2,9150652710

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1534	28/07/2023	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	3.000.000,00	0,00	1.642.209,60397000	1,8268070000
1535	28/07/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.000.000,00	632.798,44989692	4,7408460000
1536	28/07/2023	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	1.900.000,00	0,00	141.239,14753700	13,4523610000
1517	31/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	21.349,03	8.212,04403200	2,5997218130
1528	31/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	626.141,14	240.849,28505387	2,5997218130
1530	31/07/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	137.156,90	0,00	47.027,08030300	2,9165514660
	Total		**11.588.240,69**	**9.643.910,93**		

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% **Value-At-Risk (R$): 1.659.886,09** **Value-At-Risk: 1,09%**

	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
CIANORTE		1,09	1,09			152.641.319,50	100,00

Renda Fixa **Value-At-Risk: 0,30%**

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
NTN-B 150533 (5,690000%)		0,26	-0,00	0,27			4.044.584,56	2,65
NTN-B 150533 (6,210000%)		0,11	-0,00	0,09			6.032.065,37	3,95
NTN-B 150824 (6,630000%)		0,11	-0,00	0,09			4.104.003,42	2,69
NTN-B 150828 (5,540000%)		0,11	-0,00	0,09			3.543.123,42	2,32
Sub-total	0,10	0,11	-0,00		-5,97	0,49	17.723.776,77	11,61

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,16	0,00	0,01			2.215.162,56	1,45
BB PREV RF IDKA2		0,77	0,01	0,19			3.303.949,47	2,16
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,83	0,01	0,16			2.273.738,58	1,49
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		1,40	0,03	1,40			6.591.696,39	4,32
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,80	0,02	0,82			9.304.233,34	6,10
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		0,70	0,00	0,71			2.128.409,48	1,39
Sub-total	1,70	0,79	0,07		-0,08	0,94	25.817.189,82	16,91

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	0,04	0,21			6.877.797,53	4,51
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,02	-0,00	0,02			23.129.596,33	15,15

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade[1]	VaR[2]	CVaR[3]	BVaR[4]	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI		0,03	0,00	0,03			13.398.157,33	8,78
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP		1,58	0,02	0,10			3.112.609,81	2,04
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	0,00	0,02			29.657.792,60	19,43
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	0,00	0,01			882,68	0,00
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,01	0,00	0,01			109,74	0,00
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO		0,15	0,00	0,03			5.255.598,00	3,44
Sub-total	0,36	0,21	0,07		0,02	1,08	81.432.544,02	53,35

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade[1]	VaR[2]	CVaR[3]	BVaR[4]	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI		0,66	0,01	0,66			3.774.768,41	2,47
Sub-total	1,12	0,66	0,01		-0,08	0,98	3.774.768,41	2,47

Renda Variável **Value-At-Risk: 8,00%**

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade[1]	VaR[2]	CVaR[3]	BVaR[4]	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		9,17	0,08	4,05			1.393.830,81	0,91
SOMMA BRASIL FIA		8,36	0,14	1,55			2.615.127,38	1,71
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA		7,65	0,19	1,70			3.946.719,05	2,59
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		7,06	0,04	3,68			1.042.888,63	0,68
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI		9,01	0,06	3,40			1.082.470,02	0,71
BB AÇÕES VALOR FIC FIA		7,93	0,18	1,44			3.617.910,31	2,37
BRADESCO F I A SELECTION		7,85	0,05	2,77			926.952,07	0,61
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		9,17	0,09	3,49			1.616.794,88	1,06
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA		8,86	0,07	1,53			1.254.906,74	0,82
Sub-total	15,60	8,00	0,89		0,15	3,43	17.497.599,89	11,46

Investimentos Estruturados **Value-At-Risk: 1,79%**

Artigo 10º I

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP		2,68	0,02	6,90			1.559.565,79	1,02
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP		1,49	0,03	1,49			3.126.083,17	2,05
Sub-total	4,44	1,79	0,05		0,11	1,56	4.685.648,96	3,07

Fundos Imobiliários **Value-At-Risk: 3,22%**

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING		0,03	0,00	0,03			1.304.772,90	0,85
CARE11		13,60	0,00	16,05			405.018,73	0,27
Sub-total	16,11	3,22	0,00		-0,30	-3,74	1.709.791,63	1,12

Expectativas de Mercado

18 de agosto de 2023

▲Aumento ▼Diminuição =Estabilidade

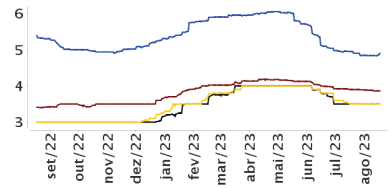
Mediana - Agregado

	2023							2024							2025							2026						
	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **
IPCA (variação %)	4,90	4,84	4,90	▲	(1)	154	4,90	109	3,90	3,86	3,86	=	(1)	152	3,82	109	3,50	3,50	3,50	=	(4)	135	3,50	3,50	3,50	=	(7)	128
PIB Total (variação % sobre ano anterior)	2,24	2,29	2,29	=	(1)	115	2,37	66	1,30	1,30	1,33	▲	(1)	109	1,34	65	1,90	1,90	1,90	=	(4)	78	2,00	2,00	2,00	=	(2)	72
Câmbio (R$/US$)	4,97	4,93	4,95	▲	(2)	127	4,95	73	5,05	5,00	5,00	=	(3)	122	5,00	72	5,12	5,09	5,09	=	(1)	90	5,20	5,10	5,15	▲	(1)	81
Selic (% a.a)	12,00	11,75	11,75	=	(2)	147	11,75	80	9,50	9,00	9,00	=	(2)	146	9,00	80	9,00	8,50	8,50	=	(2)	120	8,63	8,50	8,50	=	(3)	109
IGP-M (variação %)	-2,92	-3,49	-3,43	▲	(1)	76	-3,30	49	4,00	4,00	4,00	=	(9)	70	4,00	48	4,00	4,00	4,00	=	(26)	58	4,00	4,00	4,00	=	(26)	55
IPCA Administrados (variação %)	8,83	9,03	9,93	▲	(4)	98	10,11	74	4,41	4,35	4,30	▼	(2)	88	4,40	69	3,81	3,76	3,80	▲	(1)	63	3,50	3,50	3,50	=	(4)	53
Conta corrente (US$ bilhões)	-42,00	-43,00	-43,00	=	(2)	33	-43,00	19	-50,00	-50,20	-50,00	▲	(1)	32	-49,80	18	-50,00	-50,00	-50,10	▼	(1)	22	-49,50	-51,00	-51,00	=	(1)	19
Balança comercial (US$ bilhões)	67,56	70,00	71,70	▲	(3)	33	70,10	17	60,00	60,00	60,00	=	(5)	30	60,00	15	60,00	59,30	58,65	▼	(4)	20	57,00	57,00	57,00	=	(1)	17
Investimento direto no país (US$ bilhões)	80,00	80,00	80,00	=	(5)	30	80,00	18	80,00	80,00	80,00	=	(29)	29	80,00	17	80,50	81,70	81,70	=	(1)	20	80,00	80,00	80,00	=	(13)	17
Dívida líquida do setor público (% do PIB)	60,50	60,40	60,40	=	(1)	29	60,60	17	63,95	63,95	63,90	▼	(2)	29	64,00	17	65,60	65,55	65,80	▲	(1)	24	67,80	67,90	67,90	=	(2)	22
Resultado primário (% do PIB)	-1,00	-1,00	-1,00	=	(6)	40	-1,00	21	-0,80	-0,80	-0,75	▲	(1)	39	-0,80	21	-0,50	-0,60	-0,60	=	(3)	31	-0,30	-0,30	-0,35	▼	(1)	26
Resultado nominal (% do PIB)	-7,45	-7,45	-7,40	▲	(2)	27	-7,35	14	-7,00	-6,90	-6,75	▲	(1)	26	-7,00	14	-6,50	-6,31	-6,30	▲	(1)	20	-6,00	-6,00	-5,80	▲	(1)	17

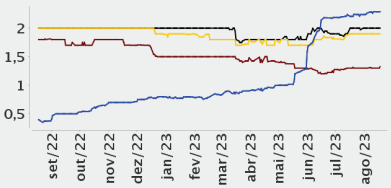
* comportamento dos indicadores desde o Focus-Relatório de Mercado anterior; os valores entre parênteses expressam o número de semanas em que vem ocorrendo o último comportamento ** respondentes nos últimos 30 dias *** respondentes nos últimos 5 dias úteis

2023 2024 2025 2026

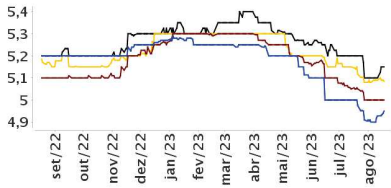
IPCA



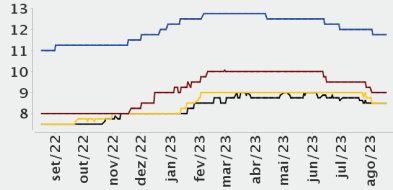
PIB Total



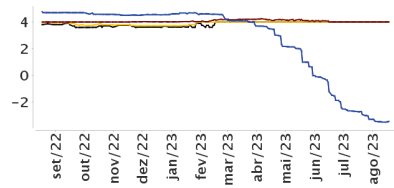
Câmbio



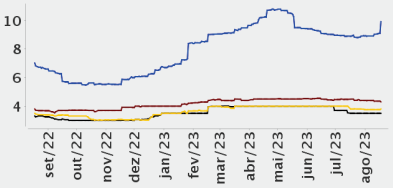
Selic



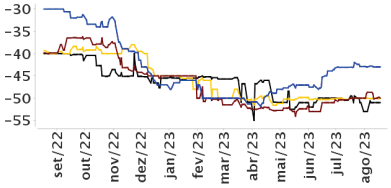
IGP-M



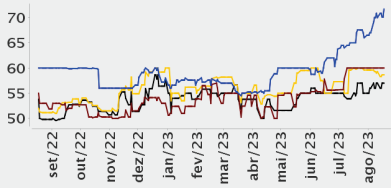
IPCA Administrados



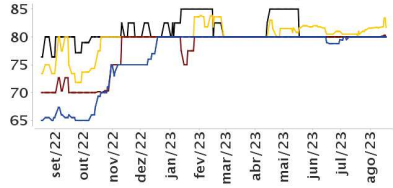
Conta corrente



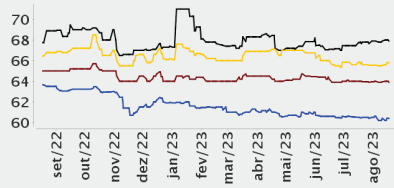
Saldo



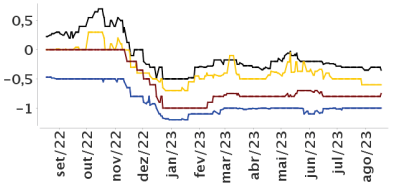
Investimento direto no país



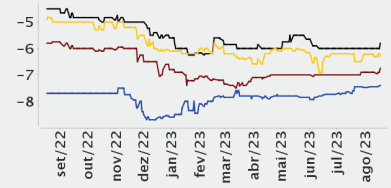
Dívida líquida do setor público



Resultado primário



Resultado nominal



Expectativas de Mercado

18 de agosto de 2023

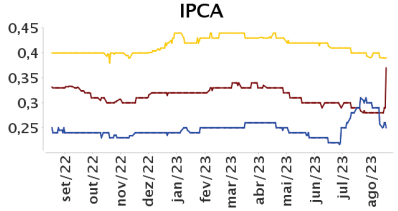
▲Aumento ▼Diminuição =Estabilidade

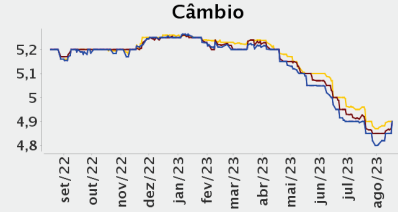
Mediana - Agregado

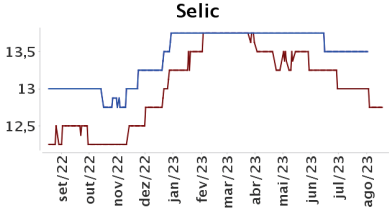
	ago/2023							set/2023							out/2023							Infl. 12 m suav.						
	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje		Comp. semanal *	Resp. **	5 dias úteis	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje		Comp. semanal *	Resp. **	5 dias úteis	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje		Comp. semanal *	Resp. **	5 dias úteis	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje		Comp. semanal *	Resp. **	5 dias úteis
IPCA (variação %)	0,31	0,26	0,25	▼	(4)	151	0,24	0,28	0,28	0,37	▲	(1)	151	0,43	0,40	0,39	0,39	=	(1)	151	0,38	4,18	4,13	4,17	▲	(1)	139	4,18
Câmbio (R$/US$)	4,85	4,85	4,90	▲	(2)	117	4,91	4,87	4,86	4,90	▲	(2)	117	4,90	4,90	4,89	4,90	▲	(2)	117	4,93							
Selic (% a.a)	13,50	-	-					13,00	12,75	12,75	=	(2)	146	12,75	-	-	-											
IGP-M (variação %)	0,20	0,00	0,05	▲	(1)	72	0,05	0,40	0,31	0,40	▲	(1)	72	0,42	0,43	0,42	0,40	▼	(1)	72	0,40	4,07	4,05	4,11	▲	(2)	62	4,09

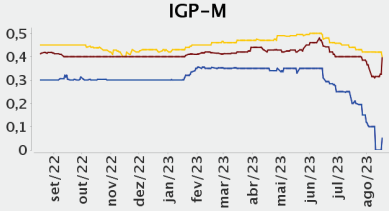
* comportamento dos indicadores desde o Focus-Relatório de Mercado anterior; os valores entre parênteses expressam o número de semanas em que vem ocorrendo o último comportamento ** respondentes nos últimos 30 dias

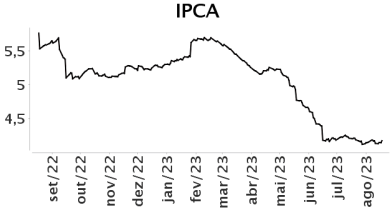
ago/2023 set/2023 out/2023 Infl. 12 m suav.

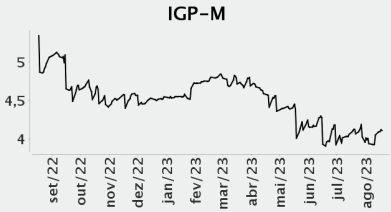












IMA - Índice de Mercado ANBIMA

Índice	Data de Referência	Número Índice	Variação Diária (%)	Variação no Mês (%)	Variação no Ano (%)	Variação 12 Meses (%)	Variação 24 Meses (%)	Peso (%)	Duration (d.u.)	C
IRF-M 1	18/08/2023	14.579,222494	0,0488	0,7124	8,5829	13,7705	23,7682	7,86	122	45
IRF-M 1+	18/08/2023	18.940,211107	0,0998	0,2118	12,5653	16,0027	22,2688	17,75	648	1.0
IRF-M	18/08/2023	17.093,894402	0,0842	0,3650	10,9951	14,9558	22,3951	25,60	487	1.4
IMA-B 5	18/08/2023	8.715,659130	0,0033	0,7209	8,8639	11,5853	24,2230	13,72	627	8(
IMA-B 5+	18/08/2023	11.330,787292	-0,1954	0,6190	16,4591	15,9837	22,2488	15,48	2.851	9(
IMA-B	18/08/2023	9.648,346572	-0,1021	0,6747	13,0233	14,0825	23,5636	29,21	1.806	1.7
IMA-S	18/08/2023	6.125,055297	0,0457	0,7156	8,5457	13,8382	25,6568	43,62	1	2.5
IMA-GERAL ex-C	18/08/2023	7.527,119056	0,0118	0,6128	10,5860	14,2898	24,0578	98,43	663	5.7
IMA-GERAL	18/08/2023	7.644,196412	0,0155	0,6271	10,3865	13,8114	23,6753	100,00	674	5.8

* Segmento Extragrupo. Dados Provisórios

Fonte: ANBIMA