



LDB
CONSULTORIA

RELATÓRIO MACROECONÔMICO

SETEMBRO/2023

Handwritten signature and initials on the right edge of the cover.

Prezados(as) Senhores(as),

Este documento tem por objetivo apresentar as principais informações macroeconômicas para o mês de setembro de 2023, na intenção de ajudá-los na tomada de decisão e acompanhamento da carteira de investimentos.

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.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o último dia útil do mês de referência, sendo disponibilizado em 13.09.2023.

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

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

Equipe LDB Empresas.

[Handwritten signatures and initials in blue ink]

“Tudo é considerado impossível até acontecer.”
-Nelson Mandela-

1. COMENTÁRIO DO MÊS:

MERCADOS INTERNACIONAIS

No mês de agosto, no cenário internacional, os juros globais tiveram alta, especialmente os mais longos, seguindo a expectativa de que a atividade econômica mais resiliente nos EUA possa resultar em taxas de juros mais altas por mais tempo

Nos EUA, os dados mostram uma economia sólida, avançando além do esperado, sugerindo que a alta das taxas de juros até agora vem tendo efeito menos restritivo que o previsto. O mercado de trabalho segue aquecido, ainda que em trajetória de desaceleração. Esse ambiente aponta para uma chance menor de recessão.

Ainda nos EUA, não houve alteração relevante nas expectativas para a política monetária. É provável que o FED tenha encerrado o ciclo de alta dos juros, com a taxa seguindo em 5,5%, ainda que um ajuste residual seja possível. Ao longo do ano de 2024, espera-se o início de um movimento de redução dos juros, que deve ocorrer de forma suave.

Na zona do euro, os dados econômicos seguem demonstrando sinais de fraquezas no lado da atividade, mas ainda exibe uma inflação resiliente, com destaque para desaceleração mais forte do crédito e acomodação da expectativa de crescimento, entretanto, ainda apresenta um fraco desempenho na Alemanha.

A China tem realizado esforços para conter a desaceleração do setor de construção civil, que apresenta graves problemas de excesso de oferta, falta de demanda e dificuldades financeiras das empresas. O desempenho do setor será fundamental para ditar os rumos da economia chinesa, com repercussões importantes nos mercados emergentes. Nesse ambiente, a China deverá continuar crescendo abaixo do potencial.

Assim, no mês de agosto de 2023, os principais índices de ações globais encerraram o mês em território negativo, acompanhando o movimento de alta das curvas de juros, o MSCI ACWI e S&P 500, respectivamente, desvalorizaram -2,96% e -1,77%, todos em “moeda original”, ou seja, considerando apenas a performance dos índices estrangeiros. Observando no acumulado nos últimos 12 meses, esses índices apresentam retornos de +11,91% e +13,97%, respectivamente.

Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, renderam cerca de +0,73% e +1,97%, devido à valorização do Dólar frente ao Real. Assim, acumulam retornos de +6,36% e +8,32% nos últimos 12 meses.

BRASIL

Localmente, as curvas de juros tiveram alta, acompanhando o movimento do exterior. O mercado passou a refletir expectativas de queda de juros em um ritmo mais lento que o esperado. Assim, o Ibovespa teve retornos negativos, com queda mais acentuada que a das Bolsas globais.

O PIB voltou a surpreender favoravelmente no segundo trimestre, superando as expectativas, com contribuição positiva dos setores industrial e de serviços, reforçando a percepção de uma economia resiliente. O setor agropecuário mostrou leve queda, após uma performance forte no primeiro trimestre, quando havia sido o principal fator impulsionando o crescimento naquele período.

A inflação continua seguindo em uma direção mais construtiva. O núcleo do IPCA vem passando por desaceleração, com efeito benigno dos preços de bens, enquanto a inflação de serviços passa por descompressão mais gradual. Espera-se uma continuidade desse movimento nos próximos meses, ainda que num ritmo gradual.

Já no começo de agosto, em acordo com as expectativas do mercado, o Copom iniciou o ciclo de redução dos juros com um corte de 0,50% da taxa Selic para 13,25% e a sinalização de que este ritmo deverá ser mantido nas próximas reuniões.

Aqui, somente a título de exemplo da “Estrutura a Termo das Taxas de Juros - ETTJ” para o IPCA, estimada e divulgada pela ANBIMA para o fechamento de 11.09.2023, e apresentada no item 3 deste relatório como “Taxa de Juros Real”, a taxa de juros real com vencimento para 9 anos apresentava taxa de retorno estimada em 5,42% a.a., continuando acima da taxa máxima pré-fixada de 4,90% limitada pela SPREV para o ano de 2023.

O Ibovespa fechou o mês com performance negativa, seguindo a direção dos índices globais. Apresentando um retorno negativo de -5,09% no mês. Sendo assim, o Ibovespa possui um comportamento positivo anual de +5,47% e de +5,68% nos últimos 12 meses.

Mediante a todo esse cenário exposto acima e em linha com o último relatório disponibilizado, tentando elucidar muitos questionamentos recebidos acerca dos prêmios trazidos pelas NTN-Bs atualmente, a estratégia de compra direta de NTN-Bs, respaldada por um estudo de ALM, pode auxiliar na “ancoragem de rentabilidade” ainda acima da meta atuarial dos RPPS. Tal estratégia, em especial para carregamento até o vencimento, pode contribuir proporcionalmente para a redução da volatilidade global da carteira de investimentos do RPPS, devido ao benefício da “marcação na curva” do preço desse ativo.

2. EXPECTATIVAS DE MERCADO

2.1. BOLETIM FOCUS

Mediana - Agregado	2023							2024						
	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. ***
IPCA (variação %)	4,84	4,92	4,93	▲ (2)	151	4,93	67	3,86	3,88	3,89	▲ (3)	149	3,82	66
PIB Total (variação % sobre ano anterior)	2,29	2,56	2,64	▲ (3)	110	2,96	54	1,30	1,32	1,47	▲ (1)	104	1,60	51
Câmbio (R\$/US\$)	4,93	4,98	5,00	▲ (1)	116	5,00	47	5,00	5,00	5,02	▲ (1)	113	5,04	46
Selic (% a.a)	11,75	11,75	11,75	= (5)	136	11,75	57	9,00	9,00	9,00	= (5)	135	9,00	56
IGP-M (variação %)	-3,49	-3,56	-3,54	▲ (1)	72	-3,53	32	4,00	4,00	4,00	= (12)	68	4,00	30
IPCA Administrados (variação %)	9,03	10,02	10,10	▲ (7)	97	10,19	37	4,35	4,28	4,28	= (1)	86	4,27	32
Conta corrente (US\$ bilhões)	-43,00	-43,00	-42,80	▲ (1)	31	-44,15	14	-50,20	-50,20	-50,00	▲ (1)	30	-51,00	13
Balança comercial (US\$ bilhões)	70,00	72,35	70,10	▼ (1)	31	70,85	16	60,00	60,00	60,00	= (8)	28	60,00	13
Investimento direto no país (US\$ bilhões)	80,00	80,00	80,00	= (8)	28	80,00	13	80,00	80,00	80,00	= (32)	27	80,00	12
Dívida líquida do setor público (% do PIB)	60,40	60,45	60,40	▼ (2)	31	60,15	15	63,95	63,95	63,90	▼ (1)	31	64,00	15
Resultado primário (% do PIB)	-1,00	-1,00	-1,00	= (9)	42	-1,00	20	-0,80	-0,71	-0,71	= (1)	40	-0,73	20
Resultado nominal (% do PIB)	-7,45	-7,45	-7,40	▲ (1)	30	-7,30	14	-6,90	-6,80	-6,80	= (1)	29	-6,60	14

Relatório Focus de 08.09.2023. Fonte: <https://www.bcb.gov.br/publicacoes/focus>

2.2. DINÂMICA DAS EXPECTATIVAS DE MERCADO

Como destaques para o final de 2023, o último Boletim Focus apresentou expectativas estáveis para a taxa Selic e elevadas para a inflação, o PIB e Câmbio.

Inflação (IPCA): Para o final de 2023 e 2024 tivemos a elevação das expectativas para 4,93% e para 3,89%.

SELIC: Para o final de 2023 e 2024 tivemos a estabilidade das expectativas, respectivamente, para 11,75% e 9%.

PIB: Para o final de 2023 tivemos o aumento da expectativa para 2,64%. Para 2024, em relação ao último relatório, foi elevada para 1,47%.

Câmbio (Dólar/ Real): Para 2023 as expectativas foram aumentadas para R\$ 5,00. Enquanto, para o final 2024 a expectativa elevou para R\$ 5,02.

3. CURVA DE JUROS E INFLAÇÃO

Taxa de Juros Real: A curva de juros real calculada pela ANBIMA, projetada em 11.09.2023, estima uma taxa real de juros de 5,42% a.a. para 9 anos.

Curva de Juros Real		
Ano	Taxa*	
	Ago/23	Set/23
1	6.70%	6.25%
2	5.23%	5.35%
3	4.89%	5.21%
4	4.84%	5.22%
5	4.87%	5.26%
6	4.98%	5.34%
7	4.98%	5.34%
8	5.03%	5.38%
9	5.08%	5.42%



* FONTE: ANBIMA; Referência ago/23 divulgada em 10.08.2023 e referência set/23 divulgada em 11.09.2023.

Taxa de Inflação Implícita: A curva de inflação implícita calculada pela ANBIMA, projetada em 11.09.2023, estima uma taxa de inflação máxima de 5,72% a.a. para 9 anos.

Curva de Inflação Implícita		
Ano	Taxa*	
	Ago/23	Set/23
1	4.02%	4.33%
2	4.56%	4.65%
3	4.93%	4.95%
4	5.21%	5.21%
5	5.41%	5.40%
6	5.53%	5.54%
7	5.61%	5.62%
8	5.66%	5.68%
9	5.69%	5.72%



* FONTE: ANBIMA; Referência ago/23 divulgada em 10.08.2023 e referência set/23 divulgada em 11.09.2023.

Taxa de Juros Prefixados: A curva de juros prefixada calculada pela ANBIMA, projetada em 11.09.2023, estima uma taxa prefixada de juros de 11,45% a.a. para 9 anos.

Curva de Juros Pré		
Ano	Taxa*	
	Ago/23	Set/23
1	10.99%	10.85%
2	10.03%	10.25%
3	10.06%	10.42%
4	10.30%	10.71%
5	10.54%	10.95%
6	10.72%	11.13%
7	10.87%	11.27%
8	10.98%	11.37%
9	11.07%	11.45%

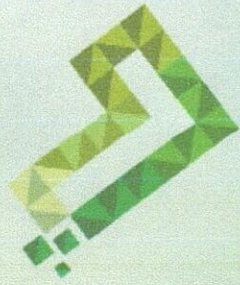


* FONTE: ANBIMA; Referência ago/23 divulgada em 10.08.2023 e referência set/23 divulgada em 11.09.2023.

Handwritten signatures and initials on the right margin.

4. INDICADORES

Indicadores	Índices Financeiros													No ano (2023)	Acumulado 12 meses
	2022				2023										
	setembro	outubro	novembro	dezembro	janeiro	fevereiro	março	abril	maio	junho	julho	Agosto			
Renda Fixa															
IDKa IPCA 20A	5.00%	-0.33%	-2.10%	-3.32%	-4.58%	0.79%	6.29%	5.47%	7.14%	5.91%	0.76%	-3.05%	19.50%	18.37%	
IRF-M 1+	1.58%	0.92%	-1.42%	1.62%	0.72%	0.79%	2.67%	1.25%	2.85%	2.65%	0.82%	0.59%	12.99%	16.04%	
IMA-B5+	2.39%	0.65%	-1.18%	-1.19%	-1.26%	1.17%	3.73%	3.03%	4.13%	3.37%	0.73%	-1.27%	14.28%	15.00%	
IRF-M	1.40%	0.93%	-0.66%	1.48%	0.84%	0.86%	2.15%	1.10%	2.20%	2.12%	0.89%	0.76%	11.43%	14.96%	
IMA-S	1.11%	1.08%	1.01%	1.11%	1.15%	0.96%	1.15%	0.86%	1.21%	1.14%	1.06%	1.18%	9.04%	13.81%	
IMA-B	1.48%	1.23%	-0.79%	-0.19%	0.00%	1.28%	2.66%	2.02%	2.53%	2.39%	0.81%	-0.38%	11.84%	13.76%	
IRF-M 1	1.11%	1.00%	0.94%	1.18%	1.10%	0.98%	1.23%	0.86%	1.14%	1.19%	1.07%	1.15%	9.05%	13.74%	
IMA-GERAL	1.26%	1.01%	-0.06%	0.77%	0.70%	1.03%	1.86%	1.25%	1.77%	1.74%	0.98%	0.63%	10.39%	13.72%	
CDI	1.07%	1.02%	1.02%	1.12%	1.12%	0.92%	1.17%	0.92%	1.12%	1.07%	1.07%	1.14%	8.87%	13.55%	
IMA-B5	0.42%	1.91%	-0.33%	0.94%	1.40%	1.41%	1.52%	0.90%	0.57%	1.05%	0.97%	0.61%	8.75%	11.97%	
IDKa IPCA 2A	0.62%	1.78%	-0.77%	1.24%	1.44%	1.62%	1.58%	0.71%	0.29%	0.97%	0.98%	0.77%	8.66%	11.80%	
Renda Variável															
IDIV	-1.80%	4.03%	0.78%	-1.61%	5.89%	-7.55%	-2.02%	3.89%	0.84%	8.78%	2.84%	-2.83%	9.22%	10.64%	
IFIX	0.49%	0.02%	-4.15%	0.00%	-1.60%	-0.45%	-1.69%	3.52%	5.43%	4.71%	1.33%	0.49%	12.06%	7.95%	
Ibovespa	0.47%	5.45%	-3.06%	-2.45%	3.37%	-7.49%	-2.91%	2.50%	3.74%	9.00%	3.27%	-5.09%	5.47%	5.68%	
IBRX - 50	0.48%	5.32%	-2.19%	-2.55%	3.38%	-7.54%	-3.50%	1.64%	2.92%	8.77%	3.70%	-4.76%	3.66%	4.56%	
IBrX - 100	-0.05%	5.57%	-3.11%	-2.63%	3.51%	-7.59%	-3.07%	1.93%	3.59%	8.87%	3.32%	-5.01%	4.62%	4.16%	
IVBX-2	-2.48%	8.89%	-7.47%	-3.14%	3.27%	-8.11%	-3.52%	1.49%	7.52%	8.43%	3.03%	-6.92%	3.90%	-1.13%	
SMLL	-1.84%	7.30%	-11.23%	-3.01%	2.92%	-10.52%	-1.74%	1.91%	13.54%	8.17%	3.12%	-7.43%	8.13%	-1.94%	
ISE	-2.54%	7.65%	-10.48%	-4.37%	2.25%	-8.16%	-1.21%	3.23%	9.02%	9.00%	1.27%	-7.55%	6.55%	-4.30%	
Investimentos no Exterior															
Global BDRX	-8.38%	1.33%	7.09%	-4.22%	4.37%	1.15%	2.99%	-0.49%	5.90%	0.48%	2.13%	3.26%	21.43%	15.64%	
S&P 500 (M. Orig.)	-9.34%	7.99%	5.38%	-5.90%	6.18%	-2.61%	3.51%	1.46%	0.25%	6.47%	3.11%	-1.77%	17.40%	13.97%	
MSCI ACWI (M.Orig.)	-9.74%	5.96%	7.60%	-4.05%	7.10%	-2.98%	2.82%	1.27%	-1.32%	5.64%	3.55%	-2.96%	13.34%	11.91%	
S&P 500	-5.36%	5.00%	6.12%	-7.26%	3.77%	-0.54%	0.97%	-0.13%	2.16%	0.69%	1.45%	1.97%	10.75%	8.32%	
MSCI ACWI	-5.78%	3.03%	8.36%	-5.43%	4.67%	-0.92%	0.30%	-0.32%	0.56%	-0.09%	1.88%	0.73%	6.92%	6.36%	
Índices Econômicos															
SELIC	1.07%	1.02%	1.02%	1.12%	1.12%	0.92%	1.17%	0.92%	1.12%	1.07%	1.07%	1.14%	8.87%	13.55%	
IPCA	-0.29%	0.59%	0.41%	0.62%	0.53%	0.84%	0.71%	0.61%	0.23%	-0.08%	0.12%	0.23%	3.23%	4.61%	
INPC	-0.32%	0.47%	0.38%	0.69%	0.46%	0.77%	0.64%	0.53%	0.36%	-0.10%	-0.09%	0.20%	2.80%	4.06%	
DÓLAR	4.39%	-2.77%	0.71%	-1.44%	-2.27%	2.13%	-2.45%	-1.57%	1.90%	-5.43%	-1.61%	3.80%	-5.67%	-4.96%	
IGPM	-0.95%	-0.97%	-0.56%	0.45%	0.21%	-0.06%	0.05%	-0.95%	-1.84%	-1.93%	-0.72%	-0.14%	-5.28%	-7.20%	
Meta Atuarial															
IPCA + 6% a.a.	0.20%	1.06%	0.88%	1.13%	1.04%	1.26%	1.25%	1.03%	0.74%	0.41%	0.61%	0.76%	7.32%	10.86%	
INPC + 6% a.a.	0.17%	0.94%	0.85%	1.20%	0.97%	1.19%	1.18%	0.95%	0.87%	0.39%	0.40%	0.73%	6.87%	10.27%	
IPCA + 5% a.a.	0.12%	0.98%	0.80%	1.05%	0.96%	1.19%	1.16%	0.96%	0.66%	0.33%	0.53%	0.68%	6.64%	9.82%	
INPC + 5% a.a.	0.09%	0.86%	0.77%	1.12%	0.89%	1.12%	1.09%	0.88%	0.79%	0.31%	0.32%	0.65%	6.20%	9.24%	
IPCA + 4% a.a.	0.04%	0.90%	0.72%	0.97%	0.87%	1.12%	1.07%	0.89%	0.57%	0.25%	0.45%	0.59%	5.97%	8.78%	
INPC + 4% a.a.	0.01%	0.78%	0.69%	1.04%	0.80%	1.05%	1.00%	0.81%	0.70%	0.23%	0.24%	0.56%	5.52%	8.20%	

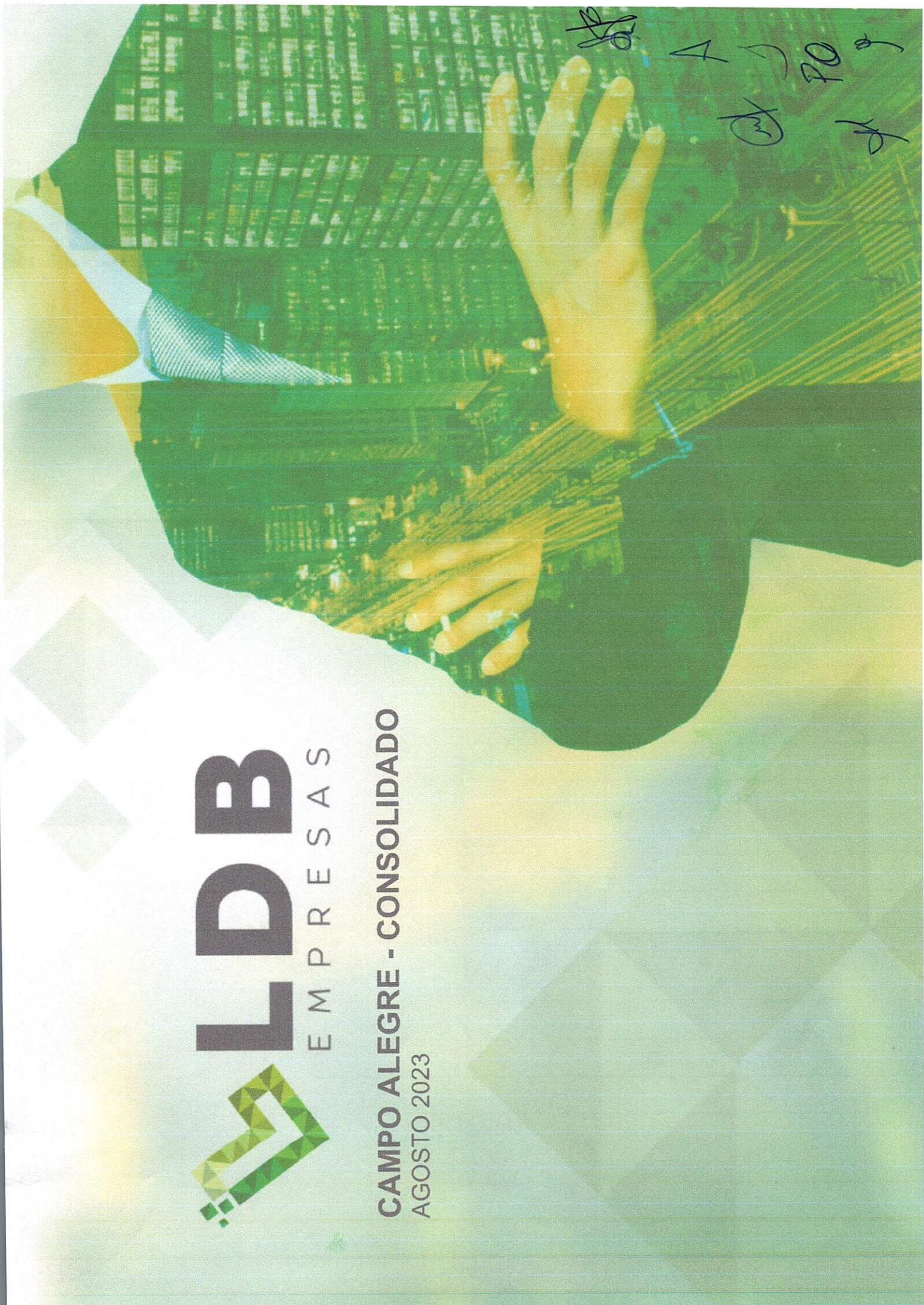


LDDB

EMPRERAS

CAMPO ALEGRE - CONSOLIDADO

AGOSTO 2023



Handwritten notes in the top right corner, including the letter 'A', a circled 'P', and the number '70'.

Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.08.2023.

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

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

Equipe LDB Empresas.



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

88,57%

RENDA FIXA

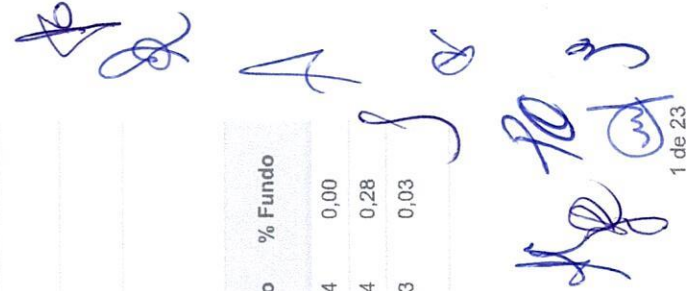
Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatili- d.a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,0200000%)	2,94	0,03	0,76	7,67	14.432.754,01	23,71
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,5000000%)	3,87	0,03	0,71	1,00	3.488.277,34	5,73
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,3900000%)	3,77	0,03	0,63	0,63	3.008.734,87	4,94
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,7100000%)	2,97	0,04	0,82	2,83	6.183.414,30	10,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,8300000%)	4,10	0,04	0,83	9,66	2.511.949,73	4,13
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,4000000%)	2,76	0,03	0,71	0,99	1.724.326,09	2,83
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,4100000%)	5,25	0,03	0,47	0,47	1.954.955,99	3,21
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea a	0,68	0,03	0,75	8,22	33.304.412,33	54,71

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatili- d.a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	0,01	0,04	0,90	6,99	4.896.142,13	8,04	131.111.677.476,74	0,00
BB	BB	BB PREV RF IPCA	1,01	0,05	1,12	9,33	528.514,88	0,87	188.312.072,54	0,28
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,02	0,05	1,13	8,69	3.376.945,09	5,55	10.508.951.085,13	0,03
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,04	1,01	7,87	8.801.602,10	14,46		

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



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatili- d. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB RENDA FIXA REFERENCIADO DI PLUS ÁGIL FIC FI	0,02	0,00	0,05	7,08	0,00	33.080.361.683,23	0,00	
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,05	1,24	8,92	1.346.232,03	14.797.589.893,96	0,01	
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,04	1,16	8,81	7.529.318,97	14.734.335.445,36	0,05	
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,08	0,04	1,22	9,04	1.897.470,13	5.670.273.448,55	0,03	
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,10	0,04	1,18	8,78	10.773.021,13		17,70	

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatili- d. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
PETRA	FINAXIS	FIDC PREMIUM	13,59	-0,45	-0,45	-8,83	112.396,95	0,18	31.424.912,92	0,36
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			13,59	-0,45	-0,45	-8,83	112.396,95	0,18		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatili- d. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO	2,21	-0,23	0,93	9,15	924.718,00	1,52	225.557.887,64	0,41
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			2,21	-0,23	0,93	9,15	924.718,00	1,52		
Renda Fixa			0,31	0,03	0,88	8,11	53.916.150,51	88,57		

Handwritten signatures and initials:
 - Top right: "A" with a checkmark
 - Middle right: "F J" and "R" with a checkmark
 - Bottom right: "R" and "C" with a checkmark

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

10,74%

RENDA VARIÁVEL

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	AdmIn.	Ativo	Volatild. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC DE FI	20,47	-1,52	-5,09	5,08	2.893.144,44	4,75	232.716.128,42	1,24
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	20,31	-1,50	-4,95	5,23	3.199.142,16	5,26	414.672.331,46	0,77
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	20,29	-1,68	-5,81	1,76	446.557,77	0,73	838.931.503,08	0,05
Sub-total Artigo 8º I			17,81	-1,52	-5,07	4,92	6.538.844,37	10,74		
Renda Variável			17,46	-1,52	-5,07	8,18	6.538.844,37	10,74		

Handwritten signatures and initials: J A, TO, and others.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

0,69%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatild. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	22,70	0,86	5,63	41,40	420.000,00	0,69	144.377.421,22	0,29
Sub-total Artigo 11º			22,70	0,86	5,63	41,40	420.000,00	0,69		
Fundos Imobiliários			24,76	0,86	5,63	41,38	420.000,00	0,69		
Total			1,98	-0,13	0,23	8,00	60.874.994,88	100,00		

Handwritten signatures and initials in blue ink, including a large signature at the top and several smaller ones below.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nivel 1	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	33.304.412,33	54,71	0,00	30,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	8.801.602,10	14,46	10,00	30,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	10.773.021,13	17,70	10,00	20,00	65,00	0,00	65,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	112.396,95	0,18	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	924.718,00	1,52	1,00	1,50	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	53.916.150,51	88,57					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	6.538.844,37	10,74	0,00	12,00	30,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	6.538.844,37	10,74					35,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	420.000,00	0,69	0,00	1,00	1,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	420.000,00	0,69					5,00
Total		60.874.994,88	100,00					

Handwritten signatures and initials: "inf to", "S A", "to p", "to p".

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

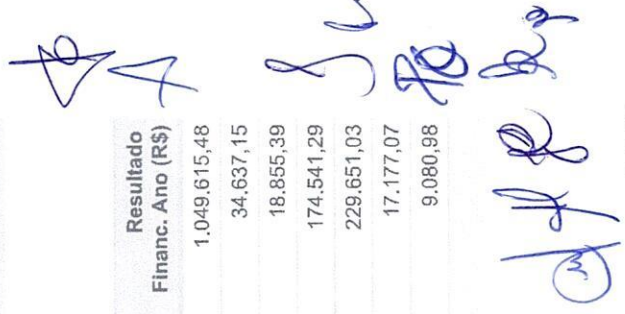
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alinea a % do CDI	0,75 66,04	8,22 92,69	1,77 53,25	5,45 81,54		245.649,21	1.533.558,42
Artigo 7º I, Alinea b % do CDI	1,01 88,24	7,87 88,73	2,94 88,66	5,92 88,69		85.300,68	569.227,88
Artigo 7º III, Alinea a % do CDI	1,18 103,17	8,78 99,04	3,38 101,77	6,70 100,37		127.212,32	1.831.187,06
Artigo 7º V, Alinea a % do CDI	-0,45 -39,28	-8,83 -99,61	-1,41 -42,58	-8,73 -130,74		-505,27	-10.889,08
Artigo 7º V, Alinea b % do CDI	0,93 81,62	9,15 103,16	3,13 94,39	6,21 93,06		8.519,20	77.496,00
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-5,07 0,01	4,92 -0,55	6,65 -0,19	9,72 -0,58		-349.273,14	306.684,42
Artigo 11º % do CDI	5,63 493,79	41,40 466,94	25,10 756,04	41,98 628,61		22.450,00	124.850,00
CAMPO ALEGRE - CONSOLIDADO (Total)						139.353,00	4.432.114,70

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150527 (6,020000%)	14.323.913,10	0,00	0,00	0,00	14.432.754,01	108.840,91	1.049.615,48
NTN-B 150545 (5,500000%)	3.463.523,16	0,00	0,00	0,00	3.488.277,34	24.754,18	34.637,15
NTN-B 150555 (5,390000%)	0,00	2.989.879,47	0,00	0,00	3.008.734,87	18.855,39	18.855,39
NTN-B 150824 (6,710000%)	6.315.611,20	0,00	0,00	183.130,75	6.183.414,30	50.933,85	174.541,29
NTN-B 150824 (6,830000%)	2.565.474,05	0,00	0,00	74.473,17	2.511.949,73	20.948,85	229.651,03
NTN-B 150840 (5,400000%)	1.759.705,05	0,00	0,00	47.613,99	1.724.326,09	12.235,03	17.177,07
NTN-B 150850 (5,410000%)	0,00	1.945.875,00	0,00	0,00	1.954.955,99	9.080,98	9.080,98
					33.304.412,33	245.649,21	

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



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado	
						Financ. Mês (R\$)	Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IPCA	522.644,29	0,00	0,00	0,00	528.514,88	5.870,59	45.123,73
BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	4.221.319,19	6.214.504,11	-5.581.411,81	0,00	4.896.142,13	41.730,64	264.000,94
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	3.339.245,64	0,00	0,00	0,00	3.376.945,09	37.699,45	233.868,75
					8.801.602,10	85.300,68	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado	
						Financ. Mês (R\$)	Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	9.759.425,54	165.328,16	-2.482.088,30	0,00	7.529.318,97	86.653,57	638.609,29
BB RENDA FIXA REFERENCIADO DI PLUS ÁGIL FIC FI	2.766.048,13	0,00	-2.767.339,73	0,00	0,00	1.291,60	271.911,90
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	1.871.809,23	2.850,00	0,00	0,00	1.897.470,13	22.810,90	268.188,51
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.333.092,07	0,00	-3.316,29	0,00	1.346.232,03	16.456,25	579.274,39
					10.773.021,13	127.212,32	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado	
						Financ. Mês (R\$)	Financ. Ano (R\$)
FIDC PREMIUM	112.902,22	0,00	0,00	0,00	112.396,95	-505,27	-10.889,08
					112.396,95	-505,27	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado	
						Financ. Mês (R\$)	Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO	916.198,80	0,00	0,00	0,00	924.718,00	8.519,20	77.496,00
					924.718,00	8.519,20	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado	
						Financ. Mês (R\$)	Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC DE FI	3.048.393,03	0,00	0,00	0,00	2.893.144,44	-155.248,59	139.939,05
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	474.124,88	0,00	0,00	0,00	446.557,77	-27.567,11	7.714,96
FIA CAIXA BRASIL IBOVSPA	3.365.599,60	0,00	0,00	0,00	3.199.142,16	-166.457,44	159.030,41

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado	
						Financ. Mês (R\$)	Financ. Ano (R\$)
					6.538.844,37	-349.273,14	
Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)							
Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	400.400,00	0,00	0,00	2.850,00	420.000,00	22.450,00	124.850,00
					420.000,00	22.450,00	124.850,00

Handwritten signatures and initials in blue ink.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

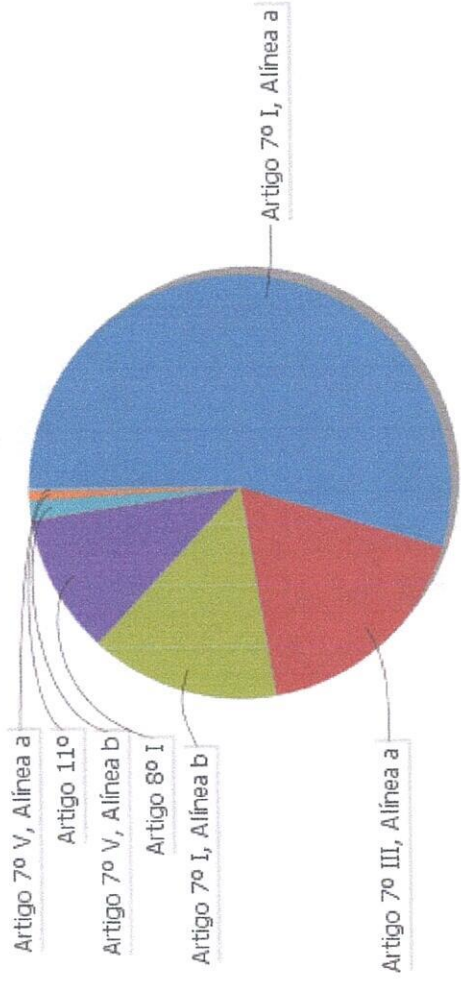
Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	27.124.024,78	44,56	27.124.024,78	44,56	
de 31 dias a 365 dias	9.141.921,80	15,02	36.265.946,58	59,57	
acima de 365 dias	24.609.048,30	40,43	60.874.994,88	100,00	

[Handwritten signatures and initials in blue ink]

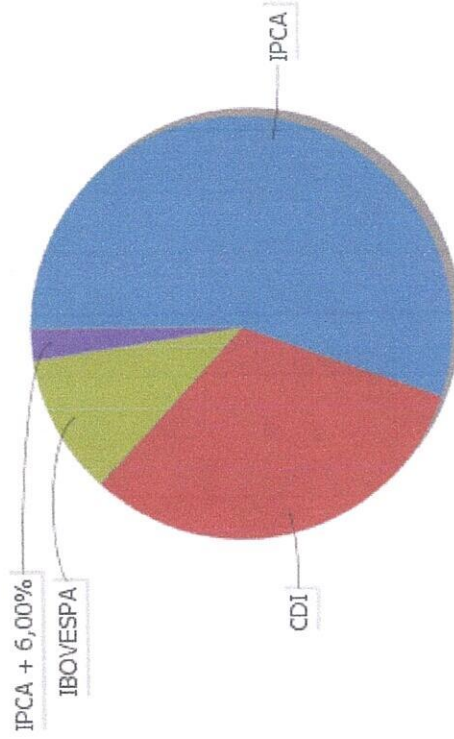
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



- Artigo 7º I, Alínea a: 54.71%
- Artigo 7º III, Alínea a: 17.70%
- Artigo 7º I, Alínea b: 14.46%
- Artigo 8º I: 10.74%
- Artigo 7º V, Alínea b: 1.52%
- Artigo 11º: 0.69%
- Artigo 7º V, Alínea a: 0.18%

Alocação Por Estratégia

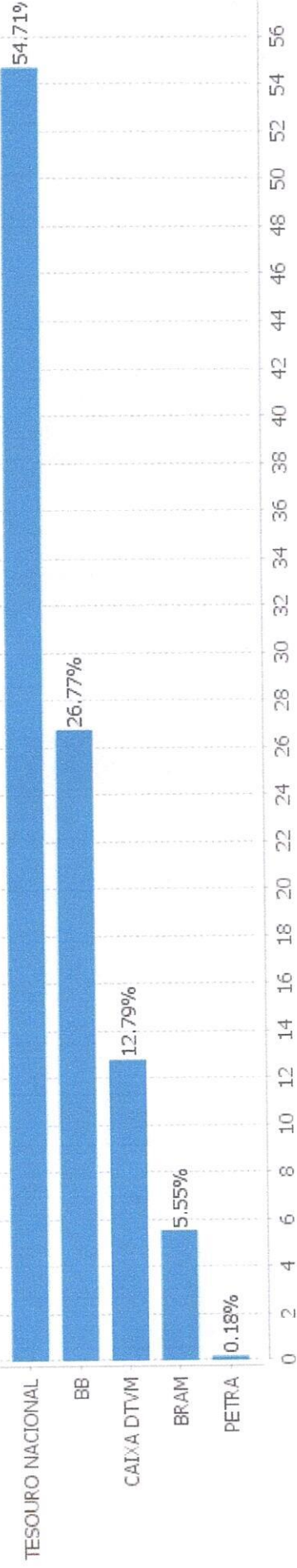


- IPCA: 55.40%
- CDI: 31.47%
- IBOVESPA: 10.74%
- IPCA + 6,00%: 2.39%

[Handwritten signatures and initials]

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



[Handwritten signatures and initials in blue ink]

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	1,38	0,04	0,82	1,05	1,42	1,74	1,07	0,23					8,00
IPCA + 5,03%	0,96	1,19	1,16	0,96	0,66	0,33	0,53	0,68					6,66
p.p. indexador	0,42	-1,16	-0,35	0,09	0,76	1,41	0,54	-0,45					1,33

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	5	62,50	03 meses	3,06	1,55	1,52	1,76
Meses abaixo - Meta Atuarial	3	37,50	06 meses	6,49	4,40	2,09	1,83

12 meses

24 meses

Desde 30/12/2022

1,74

0,04

2023-06

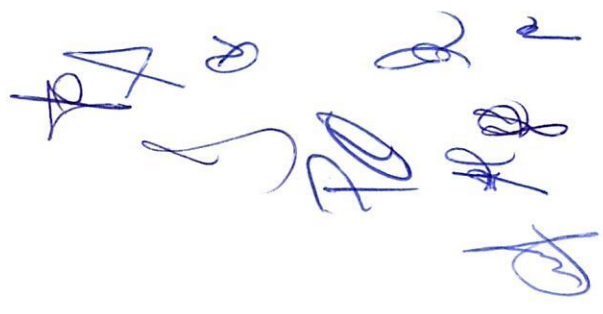
2023-02

8,00

6,66

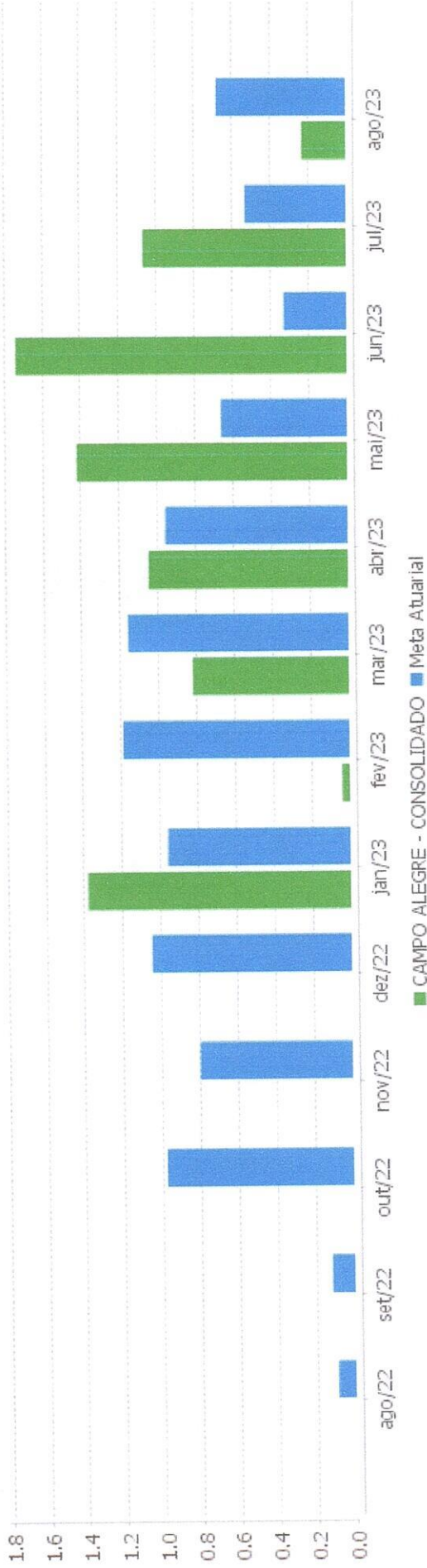
1,33

1,98



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Handwritten signatures and initials:
 A. S. L. R.
 J. P. R.
 P. R.
 C. P.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Varição da Estratégia							
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO	0,93	9,15	3,13	6,21	12,36	23,15	26,05
Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,17	1,83	1,34	1,32	1,50	-4,61	-22,46
NTN-B 150824 (6,7100000%)	0,82	5,01	1,91	5,72	8,08		
Var. IPCA p.p.	0,59	1,78	1,64	3,89	3,47		
NTN-B 150840 (5,4000000%)	0,71	4,36	1,58	5,06	6,98		
Var. IPCA p.p.	0,48	1,13	1,31	3,23	2,37		
NTN-B 150545 (5,5000000%)	0,71	4,42	1,61	2,27	4,18		
Var. IPCA p.p.	0,48	1,19	1,34	0,44	-0,43		
NTN-B 150527 (6,0200000%)	0,76	7,67	1,74	5,37	7,41	17,62	
Var. IPCA p.p.	0,53	4,44	1,47	3,54	2,80	3,89	
NTN-B 150824 (6,8300000%)	0,83	8,22	1,94	5,78	11,42		
Var. IPCA p.p.	0,60	4,99	1,67	3,95	6,82		
NTN-B 150850 (5,4100000%)	-1,97	1,64	-1,11	2,28	4,19		
Var. IPCA p.p.	-2,20	-1,59	-1,38	0,44	-0,42		
NTN-B 150555 (5,3900000%)	0,70	4,42	1,58	2,29	4,22		
Var. IPCA p.p.	0,47	1,19	1,31	0,46	-0,39		
BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	0,90	6,99	2,62	5,28	10,64		
% do CDI	79,02	78,82	79,05	79,02	78,48		
BB PREV RF IPCA	1,12	9,33	3,27	6,74	13,78	25,08	30,54
Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,36	2,02	1,48	1,85	2,92	-2,69	-17,97
BRADESCO FIFR REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	1,13	8,69	3,27	6,54	13,28	24,58	27,53
% do CDI	99,10	98,01	98,51	97,94	97,97	97,77	96,52
FIDC PREMIUM	-0,45	-8,83	-1,41	-8,73	0,98	-59,62	-61,75
% do CDI	-39,28	-99,61	-42,58	-130,74	7,27	-237,19	-216,55
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1,16	8,81	3,35	6,69	13,54	25,45	28,93
% do CDI	101,39	99,38	100,89	100,21	99,91	101,24	101,46
BB RENDA FIXA REFERENCIADO DI PLUS ÁGIL FIC FI	1,06	8,17	3,08	6,16	12,48	22,87	24,96
% do CDI	93,01	92,13	92,74	92,21	92,07	91,00	87,54
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	1,22	9,04	3,56	7,00	13,78	25,89	29,36
% do CDI	106,87	101,91	107,34	104,85	101,68	102,99	102,95
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,24	8,97	3,53	6,93	13,76	25,76	29,23
% do CDI	108,60	101,16	106,48	103,85	101,52	102,49	102,51
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	-4,95	5,23	6,78	10,05	5,56	-2,59	16,08

[Handwritten signatures and initials]

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC DE FI	D+0	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 IPCA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB RENDA FIXA REFERENCIADO DI PLUS ÁGIL FIC FI			D+0	D+0		1,00
BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	Não se aplica	Não se aplica				
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,50
FIDC PREMIUM	Não se aplica	Não se aplica				



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	1,15	9,05	3,44	6,81	13,74	24,03	26,80	33,22	43,08
IRF-M 1+	0,59	12,99	4,10	11,31	16,04	21,61	17,57	30,08	56,68
IRF-M TOTAL	0,76	11,43	3,81	9,56	14,96	22,06	20,53	31,03	52,86
IMA-B 5	0,61	8,75	2,66	5,76	11,97	23,03	28,90	40,81	61,13
IMA-B 5+	-1,27	14,28	2,80	14,40	15,00	16,66	18,76	24,36	71,86
IMA-B TOTAL	-0,38	11,84	2,83	10,43	13,76	20,07	23,99	32,22	68,62
IMA-GERAL TOTAL	0,63	10,39	3,38	8,50	13,72	22,67	24,97	33,10	54,16
IDKA 2	0,77	8,66	2,75	5,42	11,80	22,33	28,55	41,03	58,78
IDKA 20	-3,05	19,50	3,45	24,26	18,37	10,39	11,16	10,89	77,63
CDI	1,14	8,87	3,32	6,68	13,55	25,14	28,52	33,50	41,88

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-5,09	5,47	6,84	10,30	5,68	-2,56	16,48	14,44	50,95
IBRX 100	-5,01	4,62	6,85	9,37	4,16	-4,36	15,60	14,31	54,15
IBRX 50	-4,76	3,66	7,43	8,45	4,56	-3,16	18,26	15,68	49,30
SMALL CAP	-7,43	8,13	3,26	17,40	-1,94	-23,76	-10,81	-5,44	42,85
Índice Consumo - ICON	-10,42	-0,75	0,30	6,83	-15,38	-41,83	-41,59	-38,22	-6,46
Índice Dividendos - IDIV	-2,83	9,22	8,71	11,58	10,64	15,38	37,76	32,74	99,45



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	1,97	10,75	4,16	7,31	8,32	-4,62	15,85	83,19	84,91

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
FIX	0,49	12,06	6,62	14,40	7,95	16,84	15,48	20,93	50,17

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	0,73	6,92	2,53	3,09	6,36	-11,42	5,54	59,73	56,19

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,23	3,23	0,27	1,83	4,61	13,74	24,75	27,79	32,17
INPC	0,20	2,80	0,01	1,55	4,06	13,24	25,04	28,72	32,95
IGPM	-0,14	-5,28	-2,77	-5,42	-7,20	0,77	32,13	49,34	56,73
SELIC	1,14	8,87	3,32	6,68	13,55	25,14	28,52	33,50	41,88

Meta Atuarial






Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,59	5,97	1,29	3,88	8,78	23,00	40,28	49,45	60,68
IPCA + 5,00%	0,68	6,64	1,54	4,39	9,82	25,37	44,35	55,27	68,52
IPCA + 5,50%	0,72	6,98	1,66	4,64	10,34	26,57	46,42	58,24	72,56
IPCA + 5,89%	0,75	7,25	1,76	4,84	10,74	27,50	48,05	60,59	75,76
IPCA + 6,00%	0,76	7,32	1,79	4,89	10,86	27,77	48,51	61,26	76,67
INPC + 4,00%	0,56	5,52	1,03	3,59	8,20	22,46	40,61	50,54	61,62
INPC + 6,00%	0,73	6,87	1,52	4,60	10,27	27,21	48,86	62,43	77,71

Handwritten signatures and initials: AP, J20, and others.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

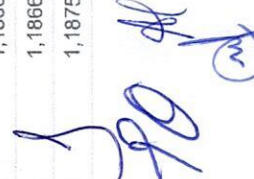
Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150527 (6,020000%)	14.432.754,01	6,020000	14.781.138,61	5,260000	348.384,60
NTN-B 150545 (5,500000%)	3.488.277,34	5,500000	3.448.184,46	5,597500	-40.092,88
NTN-B 150555 (5,390000%)	3.008.734,87	5,390000	2.909.232,34	5,627600	-99.502,53
NTN-B 150824 (6,710000%)	6.183.414,30	6,710000	6.180.045,87	6,772200	-3.368,43
NTN-B 150824 (6,830000%)	2.511.949,73	6,830000	2.513.218,66	6,772200	1.268,93
NTN-B 150840 (5,400000%)	1.724.326,09	5,400000	1.707.765,08	5,492000	-16.561,01
NTN-B 150850 (5,410000%)	1.954.955,99	5,410000	1.896.485,63	5,636800	-58.470,36

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
183	01/08/2023	BB RENDA FIXA REFERENCIADO DI PLUS ÁGIL FIC FI	0,00	2.767.339,73	451.425,07517593	6,1302304240
184	01/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.482.088,30	850.599,47079612	2,9180459020
185	01/08/2023	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	5.249,428,03	0,00	4.458.472,52452992	1,1774050420
172	01/08/2023	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	0,00	911,90	774,49982586	1,1774050420
186	02/08/2023	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	0,00	4.980.449,44	4.228,314,75620524	1,1779804860
195	02/08/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.316,29	698,31656411	4,7489780000
173	02/08/2023	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	0,00	537,96	456,71866237	1,1779804860
187	03/08/2023	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	0,00	591.566,96	502,026,87145714	1,1783571630
197	03/08/2023	NTN-B 150555 (5,3900000%)	2.989,879,47	0,00	655,00000000	4,564,7014920000
196	03/08/2023	NTN-B 150850 (5,4100000%)	1.945,875,00	0,00	435,00000000	4,473,2758753700
174	03/08/2023	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	27,911,79	0,00	23,687,03723830	1,1783571630
171	07/08/2023	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	20,669,14	0,00	17,526,91003112	1,1792803160
188	08/08/2023	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	147,135,66	0,00	124,720,36033784	1,1797244620
170	09/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	165,328,16	0,00	56,482,38952915	2,9270744630
194	11/08/2023	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	2,850,00	0,00	1,537,51454570	1,8536410000
175	11/08/2023	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	0,00	1.886,50	1,597,24109312	1,1810990890
189	16/08/2023	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	358,325,84	0,00	303,029,52833481	1,1824782950
176	16/08/2023	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	0,00	554,90	469,26865579	1,1824782950
190	17/08/2023	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	188,487,90	0,00	159,338,43641587	1,1829405650
177	17/08/2023	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	0,00	180,88	152,90709048	1,1829405650
178	21/08/2023	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	0,00	59,59	50,33570328	1,1838515430
191	22/08/2023	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	111,850,63	0,00	94,443,67124255	1,1843104840
179	23/08/2023	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	0,00	3.401,88	2,871,33656228	1,1847722920
192	28/08/2023	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	110,637,62	0,00	93,274,56794487	1,1861499060
193	29/08/2023	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	57,50	0,00	48,45742594	1,1866086340
180	29/08/2023	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	0,00	218,80	184,39103992	1,1866086340
181	31/08/2023	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	0,00	1,643,00	1,383,54946233	1,1875253070
Total			11.318.436,74	10.834.156,13		



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nivel de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 494.887,07 Value-At-Risk: 0,81%

Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
	0,81	0,81			60.874.994,88	100,00

CAMPO ALEGRE - CONSOLIDADO

Renda Fixa Value-At-Risk: 0,06%

Artigo 7º I, Alinea a

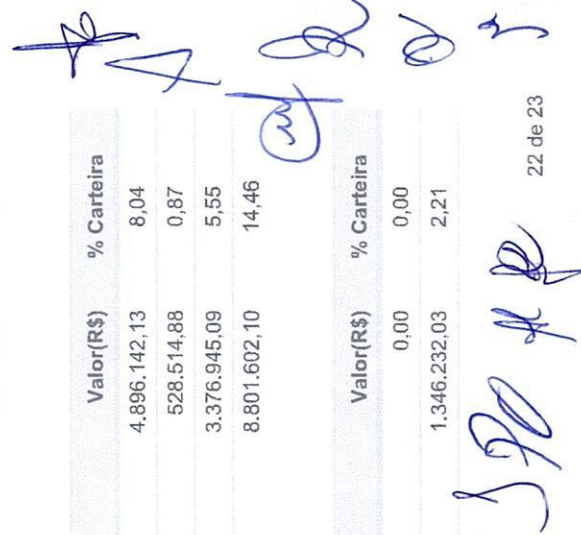
Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150527 (6,020000%)	0,10	0,00	0,00	0,11			14.432.754,01	23,71
NTN-B 150545 (5,500000%)	0,22	0,00	0,00	0,25			3.488.277,34	5,73
NTN-B 150555 (5,390000%)	0,22	0,00	0,00	0,24			3.008.734,87	4,94
NTN-B 150824 (6,710000%)	0,10	0,00	0,00	0,11			6.183.414,30	10,16
NTN-B 150824 (6,830000%)	0,10	0,00	0,00	0,11			2.511.949,73	4,13
NTN-B 150840 (5,400000%)	0,10	0,00	0,00	0,11			1.724.326,09	2,83
NTN-B 150850 (5,410000%)	0,23	0,00	0,00	0,25			1.954.955,99	3,21
Sub-total	0,76	0,09	0,00		-0,51	0,75	33.304.412,33	54,71

Artigo 7º I, Alinea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	0,01	0,01	-0,00	0,01			4.896.142,13	8,04
BB PREV RF IPCA	0,07	0,07	-0,00	0,13			528.514,88	0,87
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,01	0,01	0,00	0,01			3.376.945,09	5,55
Sub-total	0,01	0,01	-0,00		-11,61	1,01	8.801.602,10	14,46

Artigo 7º III, Alinea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB RENDA FIXA REFERENCIADO DI PLUS ÁGIL FIC FI	NaN	NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,02	0,02	-0,00	0,02			1.346.232,03	2,21



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF D I LP PERFIL FIC FI		0,02	0,00	0,02			7.529.318,97	12,37
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI		0,04	0,00	0,04			1.897.470,13	3,12
Sub-total	0,04	0,02	0,00		0,84	1,18	10.773.021,13	17,70

Artigo 7º V, Alinea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC PREMIUM		0,40	0,00	0,40			112.396,95	0,18
Sub-total	1,48	0,40	0,00		-1,07	-0,45	112.396,95	0,18

Artigo 7º V, Alinea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO		0,81	0,00	0,82			924.718,00	1,52
Sub-total	2,12	0,81	0,00		-0,10	0,93	924.718,00	1,52

Renda Variável Value-At-Risk: 7,50%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC DE FI		7,58	0,36	0,10			2.893.144,44	4,75
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA		7,45	0,39	0,18			3.199.142,16	5,26
BB AÇÕES VALOR FIC FIA		7,36	0,05	1,04			446.557,77	0,73
Sub-total	13,18	7,50	0,80		-0,47	-5,07	6.538.844,37	10,74

Fundos Imobiliários Value-At-Risk: 12,65%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII		12,65	0,01	12,65			420.000,00	0,69
Sub-total	11,26	12,65	0,01		0,40	5,63	420.000,00	0,69

