

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

SISTEMA ÚNICO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ - SUPSEC

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

Período: Março de 2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

REDA FIXA

84,90%

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	4,10	0,87	0,87	79.980.369,00	7,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	4,08	0,56	0,56	120.534.130,65	11,23
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	4,07	0,58	0,58	39.779.463,07	3,71
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	3,90	0,07	0,07	83.065.628,34	7,74
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	4,11	0,87	0,87	78.734.485,32	7,34
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,62	0,88	0,88	402.094.076,38	37,47

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,72	0,87	2,22	144.951.832,89	13,51	5.633.845.930,29	2,57
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,68	2,59	3,76	21.050.795,38	1,96	11.602.279.538,38	0,18
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,60	0,53	1,70	0,00	0,00	8.945.530.970,72	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,71	2,63	3,82	21.038.016,31	1,96	10.820.442.688,05	0,19
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,55	0,85	1,38	2.384.335,73	0,22	911.106.734,08	0,26
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,71	0,50	1,63	0,00	0,00	6.475.752.452,47	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,43	2,66	3,71	199.049.020,07	18,55	1.742.591.187,52	11,42
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	6,64	3,64	2,58	29.208.616,86	2,72	220.893.647,33	13,22
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,65	-0,40	0,25	0,00	0,00	6.199.415.029,16	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,10	0,19	1,68	0,00	0,00	9.043.444.595,41	0,00
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	3,17	2,66	3,36	12.058.135,93	1,12	1.018.840.313,20	1,18
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,32	2,00	3,08	429.740.753,17	40,05		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,21	0,93	2,55	49.731.535,97	4,63	11.946.672.563,32	0,42
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,17	0,04	0,04	0,00	0,00	3.423.570.144,27	0,00
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	4,29	-0,85	-0,86	0,00	0,00	284.993.558,94	0,00
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,17	0,67	0,67	835.433,70	0,08	8.985.171.639,75	0,01
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,77	0,81	2,57	28.532.538,51	2,66	865.952.229,89	3,29
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,05	0,61	1,78	79.099.508,18	7,37		
Renda Fixa			2,24	1,55	2,65	910.934.337,73	84,90		

Fonte: LDB Consultoria.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

5,11%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	23,83	5,46	5,07	16.409.753,34	1,53	195.664.263,77	8,39
BB	BB	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	21,39	6,68	8,43	14.261.185,58	1,33	140.756.941,43	10,13
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	25,39	8,57	7,01	8.390.445,08	0,78	890.450.777,50	0,94
BB	BB	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	19,00	4,00	0,35	15.715.944,64	1,46	285.864.427,08	5,50
Sub-total Artigo 8º I			21,20	5,81	4,79	54.777.328,64	5,11		
Renda Variável			15,96	5,81	4,79	54.777.328,64	5,11		

Fonte: LDB Consultoria.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,06%

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	18,89	-4,11	-19,62	22.148.712,88	2,06	2.671.897.209,12	0,83
Sub-total Artigo 9º III			18,89	-4,11	-19,62	22.148.712,88	2,06		
Investimentos no Exterior			18,89	-4,11	-19,62	22.148.712,88	2,06		

Fonte: LDB Consultoria.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

7,93%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	14,97	4,51	-3,31	10.502.430,18	0,98	250.893.848,31	4,19
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	15,02	4,57	-3,05	74.636.088,51	6,96	2.963.569.112,96	2,52
Sub-total Artigo 10º I			20,72	4,56	-3,08	85.138.518,69	7,93		
Investimentos Estruturados			20,72	4,56	-3,08	85.138.518,69	7,93		
Total			3,12	1,90	1,66	1.072.998.897,94	100,00		

Fonte: LDB Consultoria.

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	402.094.076,38	37,47	0,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	429.740.753,17	40,05	0,00	29,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	79.099.508,18	7,37	0,00	10,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	910.934.337,73	84,90					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	54.777.328,64	5,11	0,00	5,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	54.777.328,64	5,11					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	22.148.712,88	2,06	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	22.148.712,88	2,06					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	85.138.518,69	7,93	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	85.138.518,69	7,93					15,00

Fonte: LDB Consultoria.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,88 182,84	0,88 182,84				2.325.337,75	2.325.337,75
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	2,00 216,17	3,08 127,13	3,08 127,13	4,88 113,24	5,93 92,44	10.126.938,63	17.405.227,64
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,61 65,70	1,78 73,53	1,78 73,53			1.226.950,68	2.944.372,72
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	5,81 -0,25	4,79 -9,69	4,79 -9,69			3.009.271,96	2.505.562,23
Artigo 9º III % do CDI	-4,11 -445,27	-19,62 -809,07	-19,62 -809,07	-10,12 -234,80	-7,40 -115,44	-949.761,50	-5.404.989,05
Artigo 10º I % do CDI	4,56 493,97	-3,08 -127,13	-3,08 -127,13			3.714.240,55	-2.707.678,45
PREVID (Total)						19.452.978,07	17.067.832,84

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 150535 (5,909200%)	0,00	79.290.081,94	0,00	0,00	79.980.369,00	690.287,06	690.287,06
NTN-B 150545 (5,900200%)	0,00	119.862.579,72	0,00	0,00	120.534.130,65	671.550,93	671.550,93
NTN-B 150832 (5,763300%)	0,00	39.550.269,03	0,00	0,00	39.779.463,07	229.194,04	229.194,04
NTN-B 150860 (5,599600%)	0,00	83.007.659,28	0,00	0,00	83.065.628,34	57.969,06	57.969,06
NTN-B 150860 (5,959200%)	0,00	78.058.148,66	0,00	0,00	78.734.485,32	676.336,66	676.336,66
					402.094.076,38	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	28.449.076,85	0,00	-28.334.452,30	0,00	0,00	-114.624,55	70.289,30
BB PREV RF IDKA2	39.587.630,71	0,00	-39.797.450,62	0,00	0,00	209.819,91	666.256,31
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	41.521.223,73	0,00	-41.727.531,54	0,00	0,00	206.307,81	671.060,51

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	11.746.105,63	0,00	0,00	0,00	12.058.135,93	312.030,30	393.218,41
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	193.894.137,19	0,00	0,00	0,00	199.049.020,07	5.154.882,88	7.157.911,97
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.184.112,66	0,00	0,00	0,00	29.208.616,86	1.024.504,20	732.009,75
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	104.885.201,72	0,00	-85.000.000,00	0,00	21.038.016,31	1.152.814,59	2.360.941,77
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	42.433.287,53	0,00	-22.000.000,00	0,00	21.050.795,38	617.507,85	1.096.729,06
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	136.704.829,73	110.413.811,01	-103.590.308,33	0,00	144.951.832,89	1.423.500,48	3.202.211,71
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.364.169,09	0,00	0,00	0,00	2.384.335,73	20.166,64	32.380,16
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	61.913.339,99	0,00	-62.033.368,51	0,00	0,00	120.028,52	1.022.218,69
					429.740.753,17	0,00	0,00

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	0,00	2.523.606,30	-2.524.500,63	0,00	0,00	894,33	5.043,14
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	38.231.637,79	0,00	-37.906.203,23	0,00	0,00	-325.434,56	-321.208,92
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	399.799.900,53	-399.705.993,46	0,00	835.433,70	741.526,63	741.526,63
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	77.152.210,75	0,00	-28.000.000,00	0,00	49.731.535,97	579.325,22	1.803.627,31
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	28.301.899,45	0,00	0,00	0,00	28.532.538,51	230.639,06	715.384,56
					79.099.508,18	0,00	0,00

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES CONSUMO FIC	15.559.914,10	0,00	0,00	0,00	16.409.753,34	849.839,24	791.217,91
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	15.111.276,69	0,00	0,00	0,00	15.715.944,64	604.667,95	55.528,24
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	13.368.441,08	0,00	0,00	0,00	14.261.185,58	892.744,50	1.108.978,73
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	7.728.424,81	0,00	0,00	0,00	8.390.445,08	662.020,27	549.837,35
					54.777.328,64	0,00	0,00

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Fonte: LDB Consultoria.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	23.098.474,38	0,00	0,00	0,00	22.148.712,88	-949.761,50	-5.404.989,05
					22.148.712,88	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	10.049.564,46	0,00	0,00	0,00	10.502.430,18	452.865,72	-359.815,71
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	71.374.713,68	0,00	0,00	0,00	74.636.088,51	3.261.374,83	-2.347.862,74
					85.138.518,69	0,00	0,00

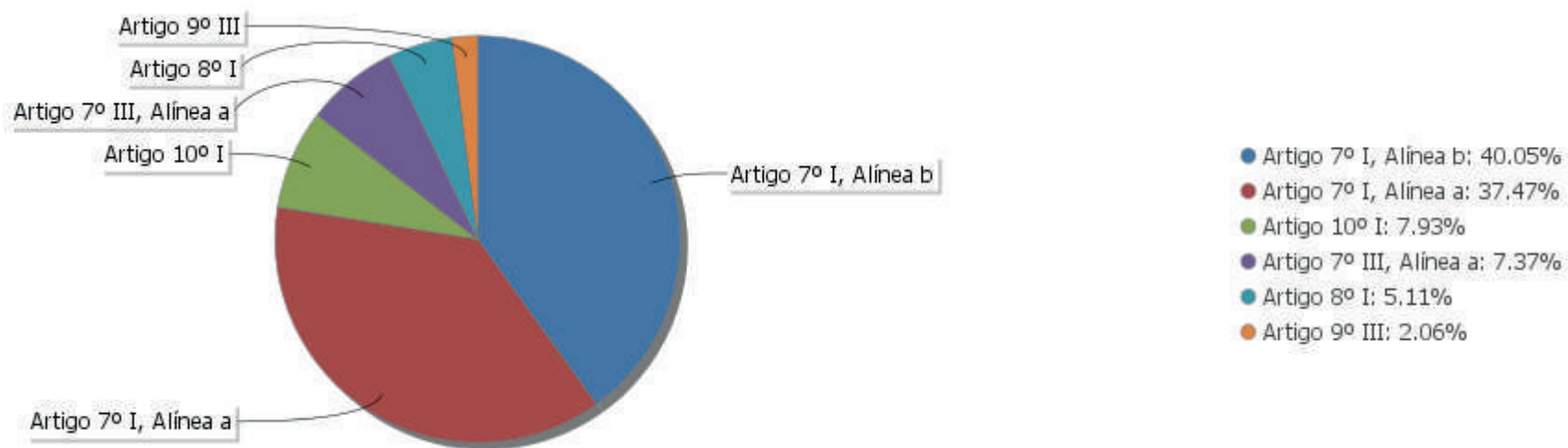
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

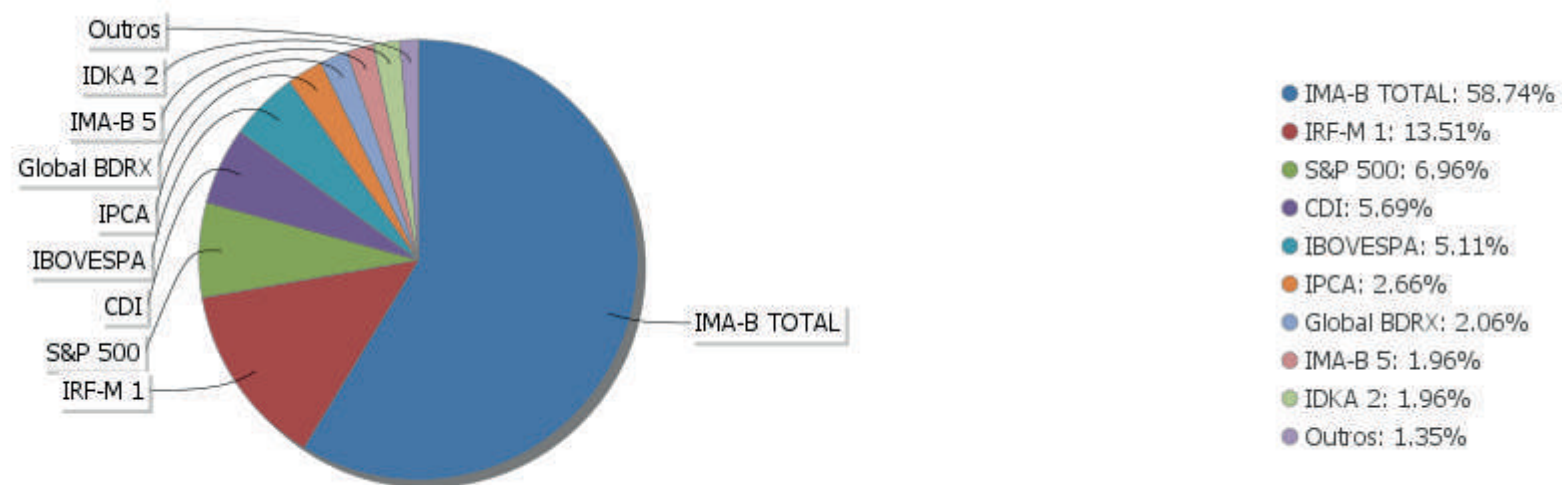
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	442.647.184,63	41,25	442.647.184,63	41,25
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	442.647.184,63	41,25
acima de 365 dias	630.351.713,31	58,75	1.072.998.897,94	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

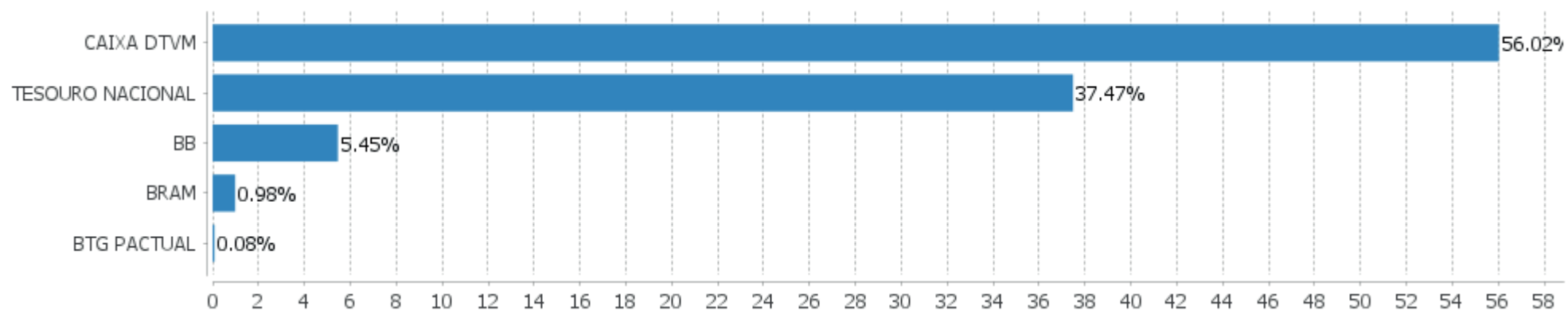


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Fonte: LDB Consultoria.

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
2022	-0,48	0,24	1,90										1,66
IPCA + 4,00%	0,87	1,31	1,97										4,20
p.p. indexador	-1,35	-1,07	-0,06										-2,54
2021	-0,27	-0,67	0,24	0,99	0,50	0,17	-0,24	-0,41	-0,11	-0,86	1,23	1,49	2,04
IPCA + 2,00%	0,41	1,00	1,11	0,47	1,00	0,70	1,13	1,04	1,33	1,41	1,11	0,91	12,25
p.p. indexador	-0,68	-1,67	-0,87	0,52	-0,49	-0,53	-1,38	-1,45	-1,44	-2,27	0,12	0,58	-10,22
2020	0,56	0,48	-0,70	0,62	1,27	0,76	0,92	-0,20	-0,36	-0,13	1,20	1,74	6,32
IPCA + 3,75%	0,53	0,51	0,39	-0,02	-0,09	0,57	0,70	0,55	0,95	1,17	1,19	1,68	8,42
p.p. indexador	0,03	-0,03	-1,09	0,64	1,36	0,20	0,22	-0,75	-1,30	-1,30	0,02	0,07	-2,10

Performance Sobre a Meta Atuarial

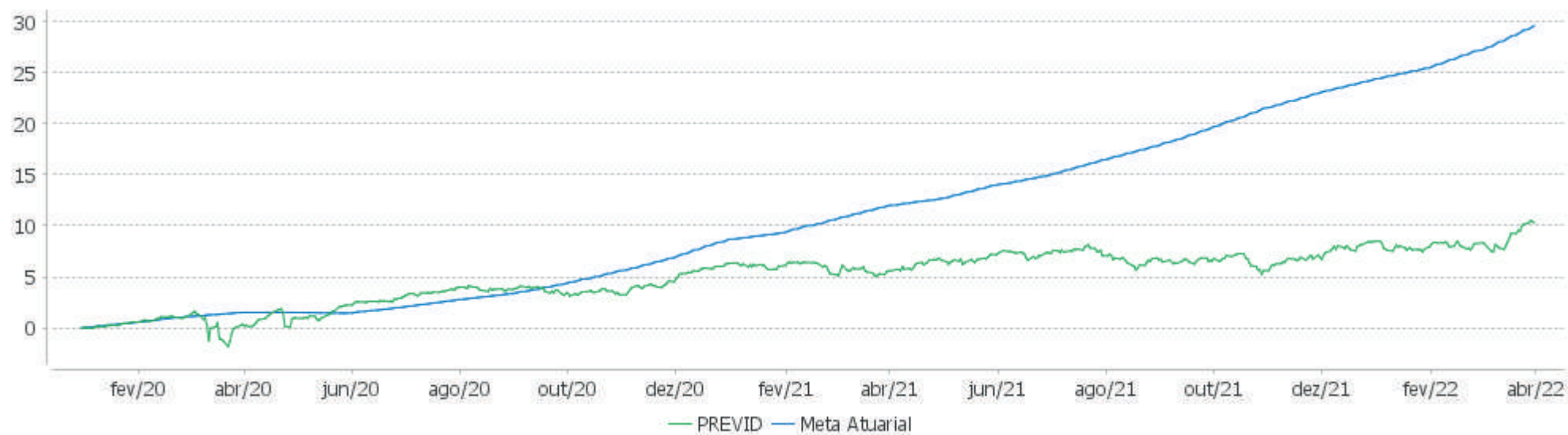
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	10	37,04	03 meses	1,66	4,20	-2,54	3,50
Meses abaixo - Meta Atuarial	17	62,96	06 meses	3,54	7,82	-4,28	3,44
			12 meses	4,46	14,07	-9,61	3,12
			24 meses	9,92	25,01	-15,09	2,95
Maior rentabilidade da Carteira	1,90	2022-03	Desde 31/12/2019	10,29	26,82	-16,53	3,44
Menor rentabilidade da Carteira	-0,86	2021-10					

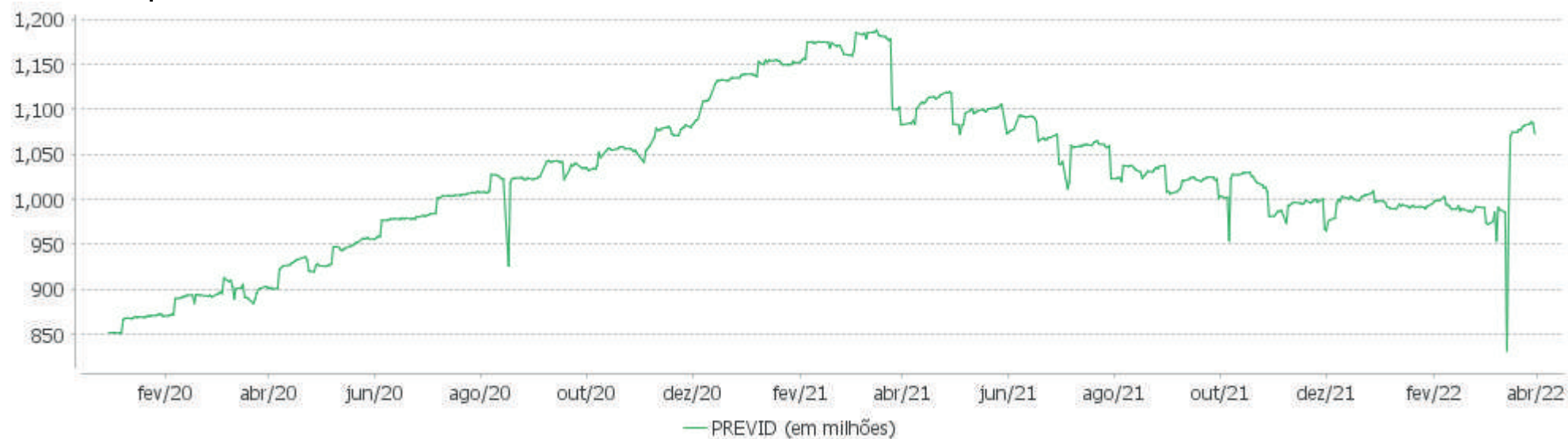
Fonte: LDB Consultoria.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

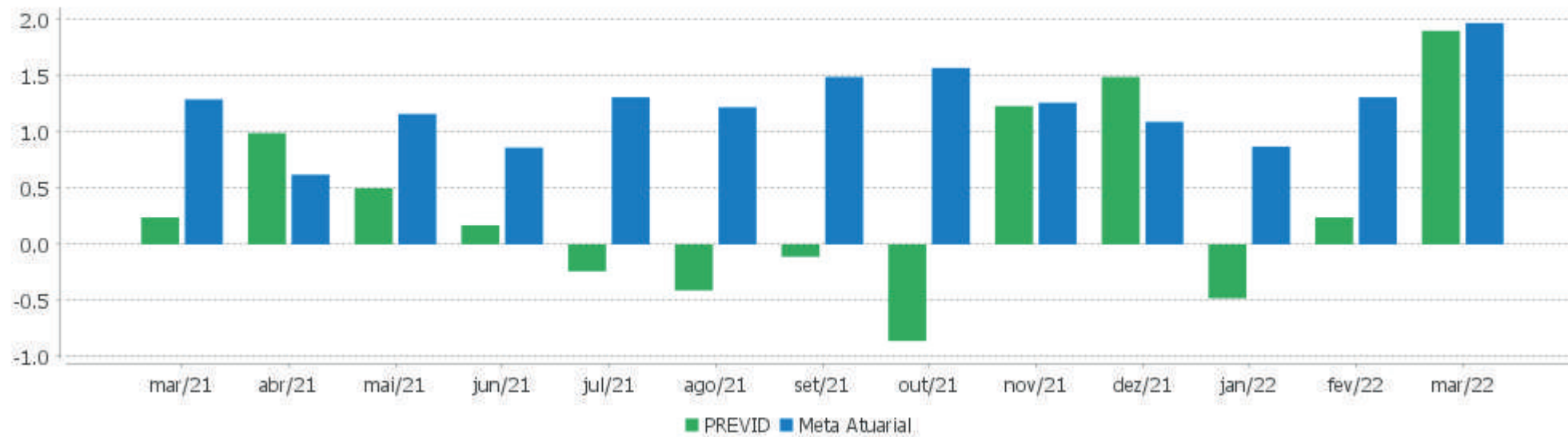


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Fonte: LDB Consultoria.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	2,59 -0,02	3,76 -0,06	3,76 -0,06	5,80 -0,12	8,48 -0,24	17,37 -0,59	27,97 -1,01
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	2,62 0,08	3,82 -0,06	3,82 -0,06	5,75 -0,05	8,64 -0,45	18,02 -0,43	27,20 -2,04
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	1,34	2,01	2,01	3,02	3,54	8,04	17,28
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,66 -0,41	3,71 0,84	3,71 0,84	5,82 1,86	8,43 3,93	17,58 2,22	31,55 5,65
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,82 -0,80	2,32 -0,89	2,32 -0,89	3,41 -2,85	2,39 -8,91	7,61 -10,48	22,09 0,11
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,64 0,56	2,58 -0,29	2,58 -0,29	4,79 0,83	4,93 0,43	14,88 -0,47	23,57 -2,33
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	2,63 0,09	3,82 -0,06	3,82 -0,06	5,71 -0,08	8,69 -0,41	17,87 -0,58	27,34 -1,91
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	2,58 -0,03	3,74 -0,07	3,74 -0,07	5,75 -0,17	8,38 -0,33	17,29 -0,67	27,99 -0,98
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	2,66 0,60	3,31 -0,39					
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,87 -0,02	2,22 -0,06	2,22 -0,06	3,33 -0,10	4,92 -0,22	7,31 -0,46	14,24 -0,71
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,85 0,01	1,38 0,02	1,38 0,02	2,36 0,01	2,00 -0,19	4,12 -0,37	15,35 -0,74
BRANDESCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	0,86 93,39	0,85 35,07	0,85 35,07	1,27 29,55	0,26 3,99	1,99 22,63	15,12 102,83
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,83 90,19	2,18 89,84	2,18 89,84	3,79 88,01	5,27 82,24	6,45 73,43	11,03 75,02
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,92 99,14	2,47 101,98	2,47 101,98	4,36 101,26	6,43 100,23	7,94 90,38	13,57 92,24
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,93 100,44	2,55 105,38	2,55 105,38	4,49 104,26	6,91 107,69	9,00 102,47	14,44 98,16
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,81 -0,81	2,57 -0,63	2,57 -0,63	4,13 -2,12	3,40 -7,90		
NTN-B 150535 (5,909200%)	1,76	4,10	4,10	5,75	10,61	16,87	21,31

Fonte: LDB Consultoria.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,31	1,23	1,23	1,79	6,11	1,51	-4,59
NTN-B 150832 (5,763300%)	1,78	1,16	1,16	5,74	10,56	16,72	21,06
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,29	-1,71	-1,71	1,78	6,05	1,36	-4,84
NTN-B 150860 (5,599600%)	1,74	1,22	1,22	5,75	10,62	16,87	21,31
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,33	-1,66	-1,66	1,79	6,11	1,52	-4,59
NTN-B 150545 (5,900200%)	1,77	4,11	4,11	5,77	10,64	16,92	21,39
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,30	1,24	1,24	1,81	6,14	1,56	-4,51
NTN-B 150860 (5,959200%)	1,76	1,14	1,14	5,77	10,65	16,96	21,45
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,31	-1,73	-1,73	1,80	6,15	1,60	-4,45
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	8,57	7,01	7,01	-5,41	-10,49	43,86	24,02
Var. IBOVESPA p.p.	2,51	-7,47	-7,47	-13,54	-13,37	-20,48	-1,75
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	4,00	0,35	0,35	-3,16	1,85	94,22	56,99
Var. IBOVESPA p.p.	-2,06	-14,12	-14,12	-11,29	-1,04	29,89	31,22
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	6,68	8,43	8,43	4,20	5,07	86,32	50,40
Var. IBOVESPA p.p.	0,62	-6,05	-6,05	-3,93	2,19	21,99	24,63
BB AÇÕES CONSUMO FIC	5,46	5,07	5,07	-12,45	-19,74	19,28	11,14
Var. IBOVESPA p.p.	-0,60	-9,41	-9,41	-20,58	-22,63	-45,06	-14,63
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-4,11	-19,62	-19,62	-10,12	-7,40	52,03	93,17
Var. Global BDRX p.p.	-0,13	-0,29	-0,29	-0,72	-2,26	-4,80	-5,60
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS % do CDI	4,51 487,99	-3,31 -136,63	-3,31 -136,63	8,99 208,64	19,40 302,51	80,89 921,16	65,60 445,99
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	4,57	-3,05	-3,05	9,62	20,58	82,26	66,50
Var. S&P 500 p.p.	9,32	16,25	16,25	18,02	25,75	22,52	-27,84
PREVID	1,90	1,66	1,66	3,54	4,46	9,92	
Var. IPCA + 4,00% p.p.	-0,06	-2,54	-2,54	-4,80	-11,29	-17,77	
CDI	0,92	2,42	2,42	4,31	6,41	8,78	14,71
IBOVESPA	6,06	14,48	14,48	8,13	2,89	64,34	25,77
INPC + 6,00%	2,23	4,91	4,91	9,38	18,43	34,19	47,02
IPCA + 6,00%	2,14	4,69	4,69	9,37	17,98	32,62	45,29

Fonte: LDB Consultoria.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES CONSUMO FIC	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
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 IMA-B 5 LP FIC FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI						
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	D+0	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 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 IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	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 INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	D+0	D+0		D +1		

Fonte: LDB Consultoria.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,89	2,28	2,28	3,43	5,14	7,77	14,95	22,64	34,09
IRF-M 1+	0,81	0,79	0,79	1,73	0,56	2,39	15,66	27,47	45,50
IRF-M TOTAL	0,84	1,35	1,35	2,35	2,19	4,49	16,08	26,70	43,00
IMA-B 5	2,61	3,81	3,81	5,92	8,72	17,96	28,97	40,83	57,68
IMA-B 5+	3,56	1,91	1,91	1,99	0,35	12,40	21,66	42,68	57,29
IMA-B TOTAL	3,07	2,87	2,87	3,96	4,50	15,36	25,90	43,16	58,53
IMA-GERAL TOTAL	1,57	2,54	2,54	3,91	4,91	10,14	19,47	30,83	44,94
IDKA 2	2,54	3,88	3,88	5,80	9,10	18,45	29,25	41,12	58,63
IDKA 20	4,00	0,37	0,37	-2,51	-7,51	6,54	12,87	41,87	51,51
CDI	0,92	2,42	2,42	4,31	6,41	8,78	14,71	21,98	32,24

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,06	14,48	14,48	8,13	2,89	64,34	25,77	40,57	84,66
IBRX 100	5,96	14,89	14,89	8,55	2,79	66,70	29,68	46,11	91,79
IBRX 50	5,43	15,47	15,47	10,28	4,13	71,54	27,56	41,05	86,31
SMALL CAP	8,81	6,69	6,69	-5,35	-9,80	48,46	30,68	46,05	95,46
IFIX	1,42	-0,88	-0,88	2,37	-2,35	11,46	11,96	17,92	36,76
Índice Consumo - ICON	5,74			-11,99	-18,58	22,89	14,32	13,52	40,45
Índice Dividendos - IDIV	10,00	15,48	15,48	13,37	11,66	55,59	43,49	63,17	97,87

Fonte: LDB Consultoria.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	1,62	3,20	3,20	6,25	11,30	18,09	21,99	27,57	30,99
INPC	1,71	3,42	3,42	6,26	11,73	19,48	23,44	29,20	31,22
IGPM	1,74	5,49	5,49	7,11	14,77	50,46	60,70	73,99	74,34
SELIC	0,92	2,42	2,42	4,31	6,41	8,78	14,71	21,99	32,26

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-4,75	-19,30	-19,30	-8,39	-5,17	59,75	94,34	144,53	186,72
MSCI ACWI	-6,10	-19,97	-19,97	-12,65	-12,11	46,60	70,12	100,67	137,04

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,97	4,20	4,20	8,34	15,75	27,68	37,22	49,19	59,20
IPCA + 5,00%	2,05	4,45	4,45	8,86	16,86	30,14	41,22	55,00	66,95
IPCA + 5,50%	2,10	4,57	4,57	9,11	17,42	31,38	43,24	57,97	70,94
IPCA + 5,89%	2,13	4,66	4,66	9,31	17,85	32,35	44,84	60,31	74,11
IPCA + 6,00%	2,14	4,69	4,69	9,37	17,98	32,62	45,29	60,98	75,01
INPC + 4,00%	2,06	4,42	4,42	8,35	16,20	29,19	38,85	51,10	59,47
INPC + 6,00%	2,23	4,91	4,91	9,38	18,43	34,19	47,02	63,04	75,31

Fonte: LDB Consultoria.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1375	02/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	176.426,17	0,00	64.882,57591200	2,7191610000
1376	02/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.183.426,62	802.978,05763600	2,7191610000
1377	03/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	15.488.333,01	5.697.490,99878000	2,7184480000
1378	07/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.814.787,41	0,00	2.875.868,54696700	2,7173660000
1379	08/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.105.855,94	0,00	7.394.531,16328400	2,7190170000
1380	08/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.091.673,36	3.711.515,35829000	2,7190170000
1372	09/03/2022	BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	0,00	37.906.203,23	23.413.399,96616860	1,6189961000
1374	09/03/2022	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	22.000.000,00	6.432.660,13672900	3,4200470000
1381	09/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	470.908,92	0,00	173.010,73388300	2,7218480000
1412	09/03/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	22.000.000,00	0,00	6.684.515,53852100	3,2911884000
1367	10/03/2022	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,00	41.727.531,54	1.907.240,88405300	21,8784800020
1368	10/03/2022	BB PREV RF IDKA2	0,00	39.797.450,62	12.933.366,07964200	3,0771146790
1369	10/03/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	2.523.606,30	0,00	1.137.736,03707300	2,2180947230
1413	10/03/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	79.001.375,86	0,00	23.994.454,96588000	3,2924847000
1414	10/03/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	37.906.081,33	0,00	11.512.910,39560500	3,2924847000
1370	11/03/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.524.500,63	1.137.736,03707300	2,2188807840
1382	11/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	132.164,19	0,00	48.557,57064000	2,7218040000
1383	11/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.234.774,21	453.660,22273500	2,7218040000
1415	11/03/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	2.524.500,63	0,00	766.450,73376100	3,2937546000
1371	14/03/2022	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	0,00	28.334.452,30	18.573.277,16603900	1,5255494250
1416	14/03/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	27.527.779,14	0,00	8.354.241,09814600	3,2950664000
1384	15/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.458,92	0,00	3.104,87446700	2,7244000000
1421	15/03/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	10.237.481,05	3.105.679,84466300	3,2963736000
1422	15/03/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	79.094.687,90	23.994.454,96711900	3,2963736000
1423	15/03/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	37.950.853,89	11.512.910,39644200	3,2963736000
1424	15/03/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	2.526.507,96	766.450,73240400	3,2963736000
1425	15/03/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	27.538.699,80	8.354.241,09694300	3,2963736000
1409	16/03/2022	NTN-B 150535 (5,909200%)	79.290.081,94	0,00	20.000,00000000	3.964,5040970000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1433	16/03/2022	NTN-B 150860 (5,959200%)	78.058.148,66	0,00	20.000,00000000	3.902,9074330000
1373	16/03/2022	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	85.000.000,00	33.246.722,36147600	2,5566430000
1417	16/03/2022	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	806.673,16	0,00	244.617,99311200	3,2976853000
1418	16/03/2022	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	168.804.332,00	0,00	51.188.732,89698100	3,2976853000
1397	16/03/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	28.000.000,00	7.014.477,88062700	3,9917440000
1398	16/03/2022	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	62.033.368,51	40.332.163,79586800	1,5380620000
1385	17/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	80.276.586,01	0,00	29.418.392,55801700	2,7287890000
1386	18/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.229.036,51	2.281.351,55601700	2,7304150000
1387	18/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.920,08	3.266,93178000	2,7304150000
1419	18/03/2022	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	6.229.036,51	0,00	1.887.378,58044200	3,3003641000
1388	21/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	834.193,25	0,00	305.424,21614000	2,7312610000
1389	21/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	834.193,25	305.424,21595900	2,7312610000
1411	23/03/2022	NTN-B 150545 (5,900200%)	119.862.579,72	0,00	30.000,00000000	3.995,4193240000
1410	23/03/2022	NTN-B 150832 (5,763300%)	39.550.269,03	0,00	10.000,00000000	3.955,0269030000
1390	23/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.237,89	0,00	2.648,11058500	2,7332280000
1391	23/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	243,93	89,24592400	2,7332280000
1426	23/03/2022	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	152.304.535,22	46.087.516,41346000	3,3046809000
1427	23/03/2022	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	808.384,41	244.617,99322200	3,3046809000
1428	23/03/2022	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	6.237.183,95	1.887.378,58169600	3,3046809000
1392	24/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.344.853,64	491.585,70974700	2,7357460000
1393	24/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	55.000.000,00	20.104.205,57888700	2,7357460000
1420	24/03/2022	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	55.000.121,90	0,00	16.635.813,42111500	3,3061276000
1432	30/03/2022	NTN-B 150860 (5,599600%)	83.007.659,28	0,00	20.000,00000000	4.150,3829640000
1394	30/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	100,00	36,47724800	2,7414260000
1429	30/03/2022	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	11.017.544,21	3.326.688,50088800	3,3118653000
1430	30/03/2022	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	16.894.541,86	5.101.216,48365300	3,3118653000
1431	30/03/2022	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	55.095.573,21	16.635.813,42212100	3,3118653000
1395	31/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	587.192,31	0,00	214.065,79036500	2,7430460000
1396	31/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.174.753,72	4.073.848,45557000	2,7430460000
Total			912.506.056,47	850.619.808,62		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 15.488.751,21

Value-At-Risk: 1,44%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PREVID		1,44	1,44			1.072.998.897,94	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,49%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,909200%)		0,25	0,00	1,95			79.980.369,00	7,45
NTN-B 150545 (5,900200%)		0,25	0,00	1,95			120.534.130,65	11,23
NTN-B 150832 (5,763300%)		0,30	-0,00	2,01			39.779.463,07	3,71
NTN-B 150860 (5,599600%)		0,24	-0,00	1,99			83.065.628,34	7,74
NTN-B 150860 (5,959200%)		0,25	-0,00	2,00			78.734.485,32	7,34
Sub-total	0,62	0,18	-0,00		-0,08	0,88	402.094.076,38	37,47

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		0,31	0,02	0,01			144.951.832,89	13,51
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,06	0,01	0,01			21.050.795,38	1,96
BB PREV RF IDKA2		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,11	0,01	0,20			21.038.016,31	1,96
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,59	0,00	0,02			2.384.335,73	0,22
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,40	0,12	1,07			199.049.020,07	18,55
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		2,61	0,04	0,89			29.208.616,86	2,72
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		1,68	0,01	1,65			12.058.135,93	1,12

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	2,37	1,03	0,20		0,45	2,00	429.740.753,17	40,05

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,06	0,00	0,04			49.731.535,97	4,63
BB PREV RF FLUXO FIC		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI		0,04	0,00	0,01			835.433,70	0,08
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		0,09	0,00	0,14			28.532.538,51	2,66
Sub-total	0,80	0,06	0,00		-0,40	0,61	79.099.508,18	7,37

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 9,54%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS		9,16	0,08	9,16			10.502.430,18	0,98
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		9,59	0,59	6,57			74.636.088,51	6,96
Sub-total	22,19	9,54	0,67		0,16	4,56	85.138.518,69	7,93

Renda Variável

Value-At-Risk: 11,19%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		15,26	0,16	9,98			16.409.753,34	1,53
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI		10,55	0,10	3,76			14.261.185,58	1,33
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		13,66	0,08	8,25			8.390.445,08	0,78
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI		9,84	0,10	4,93			15.715.944,64	1,46
Sub-total	24,03	11,19	0,45		0,20	5,81	54.777.328,64	5,11

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 10,42%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		10,42	0,12	0,97			22.148.712,88	2,06
Sub-total	25,75	10,42	0,12		-0,20	-4,11	22.148.712,88	2,06

Fonte: LDB Consultoria.