

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

CONSOLIDADO

Período: abril de 2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

91,34%

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 (5,634200%)	4,02	0,72	0,72	30.007.038,28	2,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	4,12	1,79	2,68	81.414.441,30	6,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	4,10	1,78	2,35	122.683.166,31	9,18
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	4,09	1,75	2,34	40.475.832,79	3,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	3,92	1,77	1,84	84.535.664,12	6,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	4,03	0,72	0,72	69.862.013,28	5,23
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	4,13	1,80	2,68	80.152.961,16	6,00
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,86	1,77	2,67	509.131.117,24	38,09

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	0,73	0,72	2,96	342.764.947,60	25,64	5.550.599.804,03	6,18
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,64	1,54	5,35	21.374.093,56	1,60	11.887.667.806,21	0,18
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,68	1,40	5,28	21.332.648,87	1,60	11.053.598.876,15	0,19
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,53	-0,17	1,20	2.380.227,47	0,18	836.195.248,59	0,28
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,27	1,25	5,00	201.532.397,98	15,08	1.805.286.612,95	11,16
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	6,52	0,84	3,45	29.454.473,00	2,20	222.752.962,69	13,22
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	3,01	1,25	4,65	12.208.658,11	0,91	1.056.232.725,37	1,16
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,98	0,97	3,77	631.047.446,59	47,21		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/04/2022

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	0,80	3,38	50.129.445,19	3,75	12.423.449.197,43	0,40
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,16	0,75	1,43	1.769.190,34	0,13	9.680.607.856,17	0,02
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,71	0,95	3,55	28.803.719,49	2,16	955.504.680,82	3,01
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,93	0,84	2,64	80.702.355,02	6,04		
Renda Fixa			1,95	1,25	3,83	1.220.880.918,85	91,34		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/04/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDÁ VARIÁVEL

3,25%

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	24,30	-14,21	-9,87	14.077.560,51	1,05	165.235.958,50	8,52
BB	BB	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	21,64	-7,09	0,74	10.410.985,10	0,78	125.194.150,47	8,32
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	25,89	-8,34	-1,91	7.690.537,54	0,58	813.410.237,12	0,95
BB	BB	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	19,32	-7,64	-7,32	11.243.644,43	0,84	255.047.005,10	4,41
Sub-total Artigo 8º I			20,83	-9,77	-5,44	43.422.727,58	3,25		
Renda Variável			16,63	-9,77	-5,44	43.422.727,58	3,25		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/04/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,54%

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	19,09	-6,82	-25,10	20.638.245,93	1,54	2.463.741.029,36	0,84
Sub-total Artigo 9º III			19,09	-6,82	-25,10	20.638.245,93	1,54		
Investimentos no Exterior			19,09	-6,82	-25,10	20.638.245,93	1,54		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/04/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

3,86%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRDESCO	BRDESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	16,65	-0,99	-4,27	0,00	0,00	208.590.357,57	0,00
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	16,76	-7,84	-7,84	27.649.400,95	2,07	431.935.926,69	6,40
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	16,64	-8,69	-11,48	23.989.985,88	1,79	2.579.874.392,90	0,93
Sub-total Artigo 10º I			22,39	-8,72	-11,54	51.639.386,83	3,86		
Investimentos Estruturados			22,39	-8,72	-11,54	51.639.386,83	3,86		
Total			2,77	0,23	1,89	1.336.581.279,19	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	509.131.117,24	38,09	0,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	631.047.446,59	47,21	0,00	29,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	80.702.355,02	6,04	0,00	10,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	1.220.880.918,85	91,34					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	43.422.727,58	3,25	0,00	5,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	43.422.727,58	3,25					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	20.638.245,93	1,54	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	20.638.245,93	1,54					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	51.639.386,83	3,86	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	51.639.386,83	3,86					15,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	1,77 212,72	2,67 202,39				7.883.699,23	10.209.036,98
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,97 116,42	3,77 114,94	3,52 139,35	6,56 140,12	5,94 83,95	5.766.561,00	27.852.003,37
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,84 100,86	2,64 80,49	2,21 87,28			756.188,47	3.700.561,19
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-9,77 0,33	-5,44 -8,36	-7,17 -3,36			-4.854.601,06	-2.349.038,83
Artigo 9º III % do CDI	-6,82 -817,39	-25,10 -765,40	-17,01 -672,78	-24,50 -523,74	-14,24 -201,23	-1.510.466,95	-6.915.456,00
Artigo 10º I % do CDI	-8,72 -1.045,58	-11,54 -351,84	-6,58 -260,17			-5.100.887,01	-7.808.565,46
CONSOLIDADO (Total)						2.940.493,68	24.688.541,25

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 (5,634200%)	0,00	29.793.194,02	0,00	0,00	30.007.038,28	213.844,26	213.844,26
NTN-B 150535 (5,909200%)	79.980.369,00	0,00	0,00	0,00	81.414.441,30	1.434.072,30	2.124.359,36
NTN-B 150545 (5,900200%)	120.534.130,65	0,00	0,00	0,00	122.683.166,31	2.149.035,66	2.820.586,59
NTN-B 150832 (5,763300%)	39.779.463,07	0,00	0,00	0,00	40.475.832,79	696.369,72	925.563,76
NTN-B 150860 (5,599600%)	83.065.628,34	0,00	0,00	0,00	84.535.664,12	1.470.035,78	1.528.004,84
NTN-B 150860 (5,788000%)	0,00	69.360.147,61	0,00	0,00	69.862.013,28	501.865,67	501.865,67
NTN-B 150860 (5,959200%)	78.734.485,32	0,00	0,00	0,00	80.152.961,16	1.418.475,84	2.094.812,50
					509.131.117,24	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 PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	12.058.135,93	0,00	0,00	0,00	12.208.658,11	150.522,18	543.740,59

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/04/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	199.049.020,07	0,00	0,00	0,00	201.532.397,98	2.483.377,91	9.641.289,88
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.208.616,86	0,00	0,00	0,00	29.454.473,00	245.856,14	977.865,89
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.038.016,31	0,00	0,00	0,00	21.332.648,87	294.632,56	2.655.574,33
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.050.795,38	0,00	0,00	0,00	21.374.093,56	323.298,18	1.420.027,24
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	288.828.098,20	317.447.644,83	-265.783.777,72	0,00	342.764.947,60	2.272.982,29	10.155.408,73
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.384.335,73	0,00	0,00	0,00	2.380.227,47	-4.108,26	28.271,90
					631.047.446,59	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\$)
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	835.433,70	100.000.000,00	-99.153.341,63	0,00	1.769.190,34	87.098,27	828.624,90
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	49.731.535,97	0,00	0,00	0,00	50.129.445,19	397.909,22	2.201.536,53
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	28.532.538,51	0,00	0,00	0,00	28.803.719,49	271.180,98	986.565,54
					80.702.355,02	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	16.409.753,34	0,00	0,00	0,00	14.077.560,51	-2.332.192,83	-1.540.974,92
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	15.715.944,64	0,00	-3.500.000,00	0,00	11.243.644,43	-972.300,21	-916.771,97
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	14.261.185,58	0,00	-3.000.000,00	0,00	10.410.985,10	-850.200,48	258.778,25
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	8.390.445,08	0,00	0,00	0,00	7.690.537,54	-699.907,54	-150.070,19
					43.422.727,58	0,00	0,00

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	22.148.712,88	0,00	0,00	0,00	20.638.245,93	-1.510.466,95	-6.915.456,00
					20.638.245,93	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/04/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	10.502.430,18	0,00	-10.398.244,85	0,00	0,00	-104.185,33	-464.001,04
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	0,00	30.000.000,00	0,00	0,00	27.649.400,95	-2.350.599,05	-2.350.599,05
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	74.636.088,51	0,00	-48.000.000,00	0,00	23.989.985,88	-2.646.102,63	-4.993.965,37
					51.639.386,83	0,00	0,00

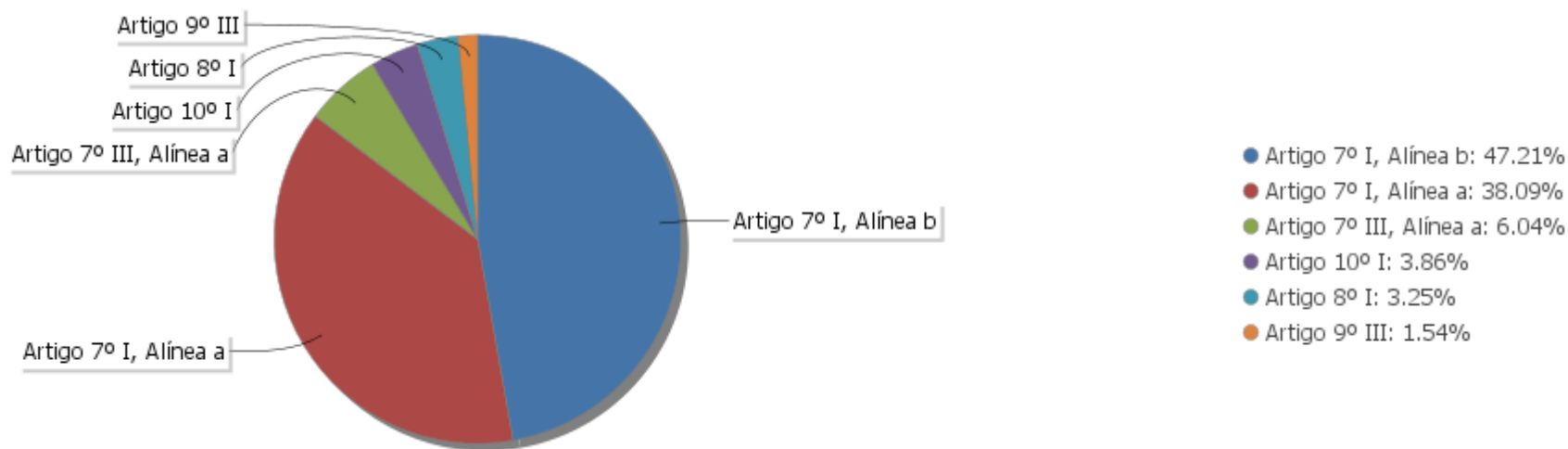
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

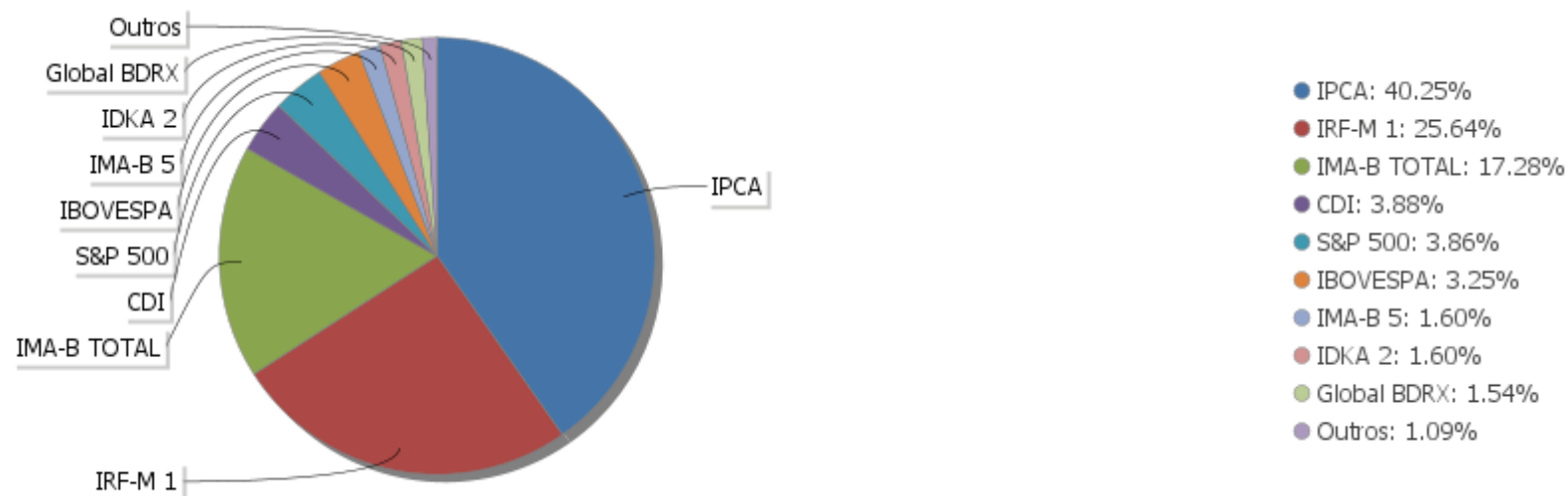
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	584.254.632,86	43,71	584.254.632,86	43,71
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	584.254.632,86	43,71
acima de 365 dias	752.326.646,33	56,29	1.336.581.279,19	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

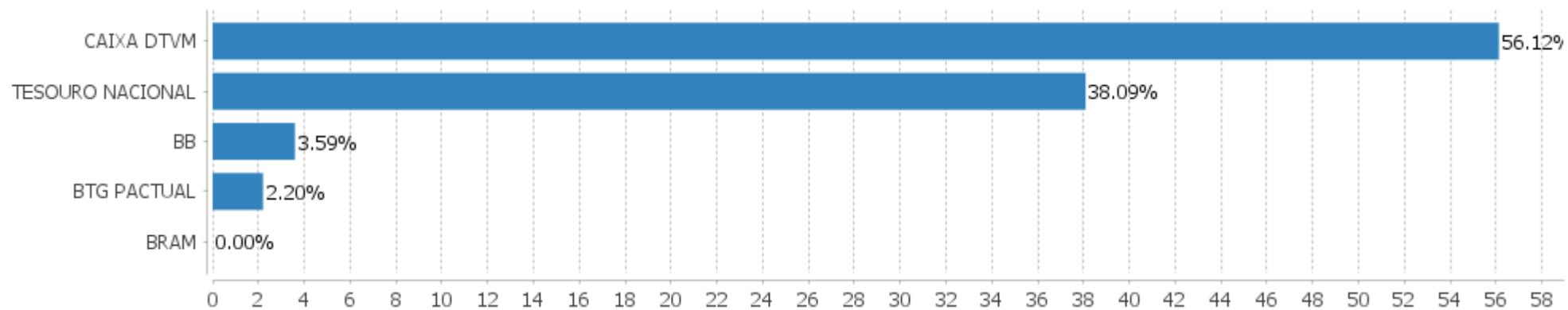


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2022	-0,32	0,33	1,64	0,23									1,89
IPCA + 4,00%	0,87	1,31	1,97	1,36									5,62
p.p. indexador	-1,18	-0,98	-0,33	-1,13									-3,73
2021	-0,23	-0,56	-0,27	0,90	0,46	0,19	-0,17	-0,33	-0,08	-0,80	1,22	1,45	1,79
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	-0,64	-1,56	-1,38	0,44	-0,53	-0,50	-1,30	-1,38	-1,41	-2,21	0,11	0,54	-10,47
2020	0,52	0,46	-0,47	0,59	1,11	0,70	0,84	-0,16	-0,27	-0,10	1,14	1,59	6,09
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	-0,01	-0,06	-0,87	0,61	1,20	0,13	0,14	-0,71	-1,22	-1,27	-0,04	-0,09	-2,33

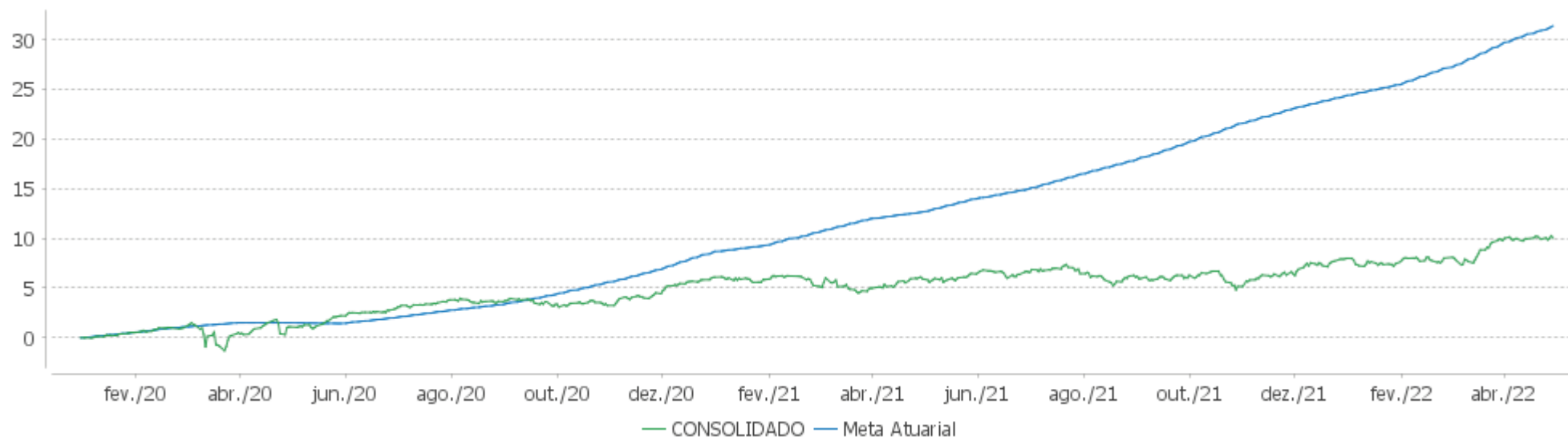
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

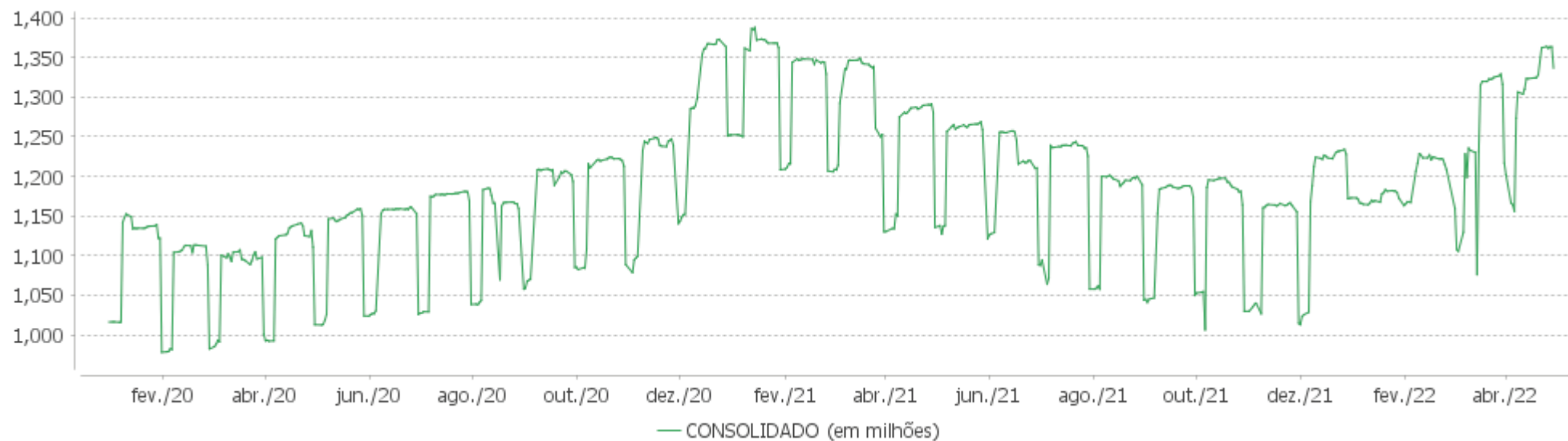
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	7	25,00	03 meses	2,21	4,71	-2,50	2,89
Meses abaixo - Meta Atuarial	21	75,00	06 meses	4,63	7,76	-3,14	2,81
			12 meses	3,87	15,08	-11,21	2,77
			24 meses	8,84	26,73	-17,90	2,49
Maior rentabilidade da Carteira	1,64	2022-03	Desde 31/12/2019	10,03	28,54	-18,51	2,99
Menor rentabilidade da Carteira	-0,80	2021-10					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

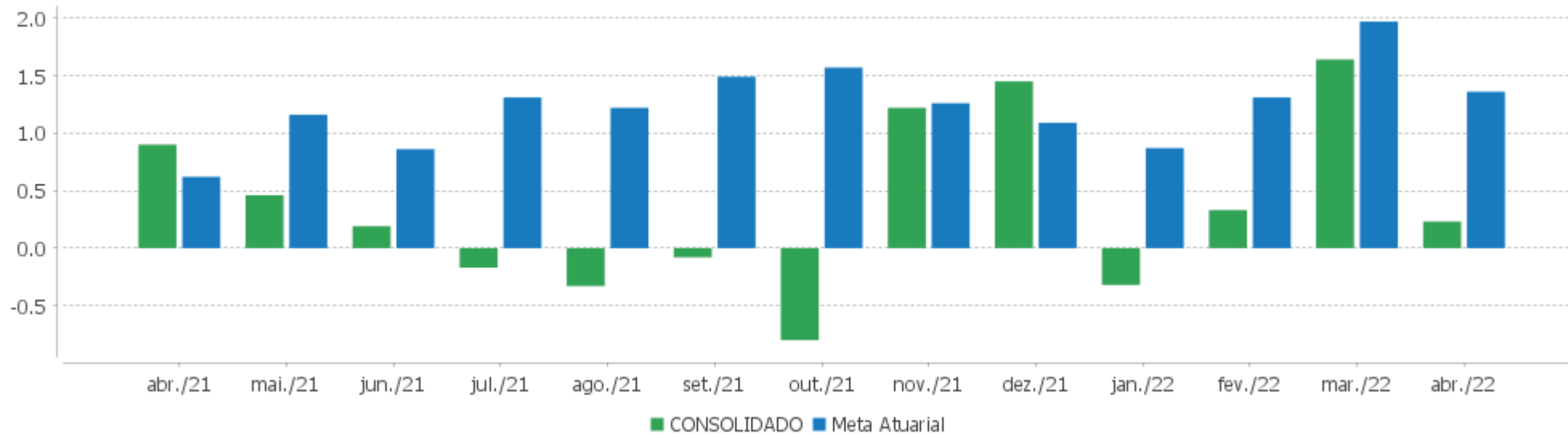


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	1,79 0,73	5,97 1,67	4,76 1,03	6,06 0,01	11,53 -0,60	18,53 -1,18	21,95 -0,63
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	1,77 0,71	5,88 1,58	4,70 0,96	6,00 -0,05	11,40 -0,74	18,26 -1,45	21,54 -1,04
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	1,75 0,69	2,93 -1,36	1,77 -1,96	6,02 -0,03	11,43 -0,70	18,34 -1,37	21,66 -0,92
NTN-B 150860 (5,599600%) Var. IPCA p.p.	1,77 0,71	3,01 -1,29	1,86 -1,87	6,07 0,01	11,53 -0,60	18,54 -1,17	21,95 -0,63
NTN-B 150545 (5,900200%) Var. IPCA p.p.	1,78 0,72	5,96 1,67	4,76 1,02	6,07 0,02	11,55 -0,58	18,57 -1,14	22,01 -0,57
NTN-B 150860 (5,788000%) Var. IPCA p.p.	1,78 0,72	2,99 -1,31	1,82 -1,91	6,08 0,02	11,55 -0,58	18,59 -1,12	22,03 -0,56
NTN-B 150860 (5,959200%) Var. IPCA p.p.	1,80 0,74	2,97 -1,33	1,79 -1,94	6,09 0,03	11,57 -0,56	18,63 -1,08	22,09 -0,49
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,54 -0,02	5,35 -0,08	5,26 -0,05	8,78 -0,14	9,20 -0,25	18,62 -0,59	28,55 -1,00
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,25 0,42	5,00 1,28	5,04 0,54	8,77 1,20	8,17 3,48	18,22 3,41	31,64 6,57
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,84 0,01	3,45 -0,28	4,41 -0,09	8,27 0,70	5,20 0,51	14,15 -0,66	22,99 -2,07
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,40 -0,11	5,28 -0,17	5,26 -0,14	8,60 -0,39	9,10 -0,17	19,01 -0,54	27,75 -2,10
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	1,25 -0,18	4,59 -0,59	5,04 0,09				
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,72 -0,02	2,96 -0,09	2,33 -0,07	4,64 -0,13	5,38 -0,25	7,62 -0,48	14,49 -0,74
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,17 -0,05	1,20 -0,03	1,27 -0,03	4,96 -0,03	1,04 -0,17	2,78 -0,40	14,50 -0,74
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,75 90,24	3,24 98,93	2,47 97,88	4,62 98,79	7,08 100,05	8,47 90,33	13,85 91,91
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,80 95,90	3,38 102,94	2,57 101,59	4,80 102,68	7,48 105,64	9,87 105,22	14,77 98,03
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,95	3,55	2,71	5,06	3,84	8,13	

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/04/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	-0,11	-0,75	-1,02	-0,99	-8,29	-11,58	
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-8,34	-1,91	-5,67	-1,07	-21,39	18,44	12,31
Var. IBOVESPA p.p.	1,76	-4,83	-1,86	-5,30	-12,12	-15,56	0,35
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	-7,64	-7,32	-6,67	-5,03	-12,03	54,85	44,26
Var. IBOVESPA p.p.	2,46	-10,23	-2,86	-9,26	-2,77	20,86	32,30
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	-7,09	0,74	-2,29	8,18	-9,40	56,53	43,26
Var. IBOVESPA p.p.	3,01	-2,17	1,52	3,95	-0,13	22,53	31,30
BB AÇÕES CONSUMO FIC	-14,21	-9,87	-11,89	-16,74	-31,80	-13,07	-12,04
Var. IBOVESPA p.p.	-4,11	-12,78	-8,09	-20,96	-22,53	-47,07	-24,00
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-6,82	-25,10	-17,01	-24,50	-14,24	22,16	70,60
Var. Global BDRX p.p.	0,14	-0,16	-0,25	-0,33	-1,64	-3,29	-4,39
BRDESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS % do CDI	-8,70 -1.043,27	-11,73 -357,68	-6,74 -266,70	-7,50 -160,29	3,40 48,04	47,68 508,43	44,92 298,08
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-8,69	-11,48	-6,52	-7,01	4,48	48,89	45,55
Var. S&P 500 p.p.	-3,39	12,10	9,46	14,78	14,52	20,29	-29,33
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	-8,77	-11,40	-6,54	-6,94	4,95	51,63	
Var. S&P 500 p.p.	-3,46	12,18	9,44	14,85	14,99	23,03	
CONSOLIDADO	0,23	1,89	2,21	4,63	3,87	8,84	
Var. IPCA + 4,00% p.p.	-1,13	-3,73	-2,50	-3,49	-12,73	-20,58	
CDI	0,83	3,28	2,53	4,68	7,08	9,38	15,07
IBOVESPA	-10,10	2,91	-3,81	4,23	-9,27	34,00	11,96
INPC + 6,00%	1,48	6,47	5,25	9,23	19,19	35,86	47,59
IPCA + 6,00%	1,50	6,27	5,18	9,14	18,83	34,41	45,93

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 PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI			D+0	D+0		
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	D+0	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+0	D+2 du		
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 FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	D+0	D+0		D +1		

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	0,75	3,04	2,40	4,76	5,63	8,09	15,23	22,93	33,92
IRF-M 1+	-0,53	0,26	0,76	4,79	-1,08	0,34	14,30	26,22	44,13
IRF-M TOTAL	-0,12	1,23	1,31	4,98	1,22	3,18	15,24	25,96	42,07
IMA-B 5	1,56	5,43	5,31	8,92	9,45	19,21	29,55	42,42	59,01
IMA-B 5+	0,08	1,99	3,65	6,19	-0,03	10,27	19,61	43,70	58,71
IMA-B TOTAL	0,83	3,73	4,49	7,56	4,69	14,81	25,06	44,56	60,36
IMA-GERAL TOTAL	0,54	3,09	2,88	5,86	4,95	9,79	19,09	31,12	45,31
IDKA 2	1,51	5,45	5,39	8,99	9,27	19,55	29,85	42,08	59,55
IDKA 20	-1,21	-0,85	2,14	2,79	-8,97	3,42	9,22	42,00	53,49
CDI	0,83	3,28	2,53	4,68	7,08	9,38	15,07	22,37	32,30

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-10,10	2,91	-3,81	4,23	-9,27	34,00	11,96	25,27	64,94
IBRX 100	-10,11	3,27	-3,37	4,71	-10,15	35,89	15,35	30,27	70,90
IBRX 50	-10,51	3,33	-4,01	5,29	-9,44	38,94	13,39	25,43	65,73
SMALL CAP	-8,36	-2,23	-5,46	-0,84	-20,81	23,46	17,79	30,74	73,22
IFIX	1,19	0,29	1,30	5,13	-1,68	8,04	12,14	20,36	38,18
Índice Consumo - ICON	-14,19		-11,54	-16,34	-30,65	-10,38	-9,46	-1,52	13,09
Índice Dividendos - IDIV	-5,19	9,49	1,87	12,24	3,76	42,18	31,97	56,94	85,91

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/04/2022

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	1,06	4,29	3,73	6,05	12,13	19,71	22,58	28,64	32,19
INPC	1,04	4,49	3,80	6,14	12,47	21,00	23,98	30,27	32,47
IGPM	1,41	6,98	5,07	7,93	14,66	51,37	61,49	75,44	78,75
SELIC	0,83	3,28	2,53	4,68	7,08	9,38	15,07	22,37	32,32

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	-5,31	-23,58	-15,98	-21,79	-10,04	28,59	74,88	120,49	166,54
MSCI ACWI	-4,62	-23,67	-16,34	-23,54	-15,21	21,12	55,29	81,22	120,87

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,36	5,62	4,71	8,12	16,60	29,42	37,85	50,40	60,68
IPCA + 5,00%	1,43	5,94	4,95	8,63	17,72	31,90	41,85	56,24	68,52
IPCA + 5,50%	1,47	6,10	5,07	8,89	18,27	33,16	43,88	59,23	72,55
IPCA + 5,89%	1,50	6,23	5,16	9,08	18,71	34,14	45,48	61,58	75,75
IPCA + 6,00%	1,50	6,27	5,18	9,14	18,83	34,41	45,93	62,25	76,66
INPC + 4,00%	1,34	5,82	4,77	8,21	16,95	30,82	39,42	52,30	61,02
INPC + 6,00%	1,48	6,47	5,25	9,23	19,19	35,86	47,59	64,31	77,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1484	01/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.180.030,65	429.840,59877500	2,7452750000
1453	01/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.049.099,66	1.110.671,84881500	2,7452750000
1452	01/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	81.552,48	0,00	29.706,48842100	2,7452750000
1434	01/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.005.302,37	4.737.340,47565700	2,7452750000
1485	04/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	638.790,93	0,00	232.582,86428300	2,7465090000
1454	04/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.731.840,58	0,00	8.640.729,22389800	2,7465090000
1455	04/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	61.486.249,61	22.387.055,56989400	2,7465090000
1456	05/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	139.626,86	50.834,70098900	2,7466840000
1486	06/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	228.012,05	0,00	82.990,45769300	2,7474490000
1441	06/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.537,72	0,00	559,69009700	2,7474490000
1458	06/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	148.518,66	54.056,93039400	2,7474490000
1457	06/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	886.704,90	0,00	322.737,52852100	2,7474490000
1435	06/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.865.551,76	0,00	1.406.960,33302100	2,7474490000
1436	06/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.910.498,20	4.335.111,66052200	2,7474490000
1504	07/04/2022	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,00	18.000.000,00	10.571.103,88853300	1,7027550000
1503	07/04/2022	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,00	30.000.000,00	17.618.506,48095200	1,7027550000
1487	07/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	34.738.117,40	0,00	12.638.030,81969300	2,7486970000
1488	07/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	25.833.699,81	9.398.525,84908700	2,7486970000
1442	07/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.539,90	0,00	2.379,27279700	2,7486970000
1459	07/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	132.612.119,73	0,00	48.245.448,56344600	2,7486970000
1460	07/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	200.505,40	72.945,61707400	2,7486970000
1438	07/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	15.307.324,89	5.568.938,62323000	2,7486970000
1437	07/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	38.273.495,00	0,00	13.924.232,09979100	2,7486970000
1482	08/04/2022	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	0,00	3.500.000,00	265.763,54703700	13,1696014710
1483	08/04/2022	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	0,00	3.000.000,00	2.426.830,72991600	1,2361801600
1507	08/04/2022	BRANCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	0,00	3.382.649,67	913.783,29709000	3,7018073000
1505	08/04/2022	BRANCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	0,00	3.583.946,70	968.161,33673000	3,7018073000
1506	08/04/2022	BRANCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	0,00	3.431.648,48	927.019,75201000	3,7018073000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/04/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1508	08/04/2022	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	30.000.000,00	0,00	16.111.017,36885800	1,8620798000
1489	08/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.000.000,00	0,00	6.551.672,67843200	2,7473900000
1490	08/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	24.566,93	0,00	8.941,91578100	2,7473900000
1461	08/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.186.912,43	0,00	432.014,54107300	2,7473900000
1443	08/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.737,71	0,00	1.724,44028600	2,7473900000
1462	08/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	27.571,98	10.035,69861700	2,7473900000
1509	11/04/2022	BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	100.000.000,00	0,00	30.097.366,78739900	3,3225498000
1491	11/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	95.817,51	0,00	34.879,94463900	2,7470660000
1492	11/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	100.000.000,00	36.402.474,49748400	2,7470660000
1464	11/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	20.254,90	7.373,28442800	2,7470660000
1444	11/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.154,92	0,00	1.512,49369300	2,7470660000
1463	11/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	143.341,20	0,00	52.179,74377000	2,7470660000
1493	12/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.500.000,00	0,00	2.365.156,94453700	2,7482320000
1466	12/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	317.445,57	115.509,01393400	2,7482320000
1465	12/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.766,90	0,00	1.006,79273000	2,7482320000
1510	13/04/2022	BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	99.153.341,63	29.819.534,18013900	3,3251137000
1494	13/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.463.754,05	0,00	3.805.101,09719200	2,7499280000
1467	13/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	350.544,16	0,00	127.473,94113500	2,7499280000
1511	13/04/2022	NTN-B 150535 (5,634200%)	29.793.194,02	0,00	7.200,00000000	4.137,9436140000
1512	13/04/2022	NTN-B 150860 (5,788000%)	69.360.147,61	0,00	17.000,00000000	4.080,0086830000
1439	14/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.129,50	0,00	410,61230100	2,7507700000
1495	14/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.460,04	0,00	1.621,37874100	2,7507700000
1469	18/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	26.463,42	9.613,96483100	2,7526020000
1445	18/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.149,63	0,00	1.870,82258800	2,7526020000
1468	18/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.198,72	0,00	3.341,82711400	2,7526020000
1446	19/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.821,35	0,00	1.024,45124500	2,7540110000
1470	19/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	568.354,29	206.373,28231700	2,7540110000
1440	19/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	570.787,19	207.256,68470900	2,7540110000
1496	19/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	570.787,19	207.256,68465200	2,7540110000
1472	20/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.216,42	804,51002400	2,7549930000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/04/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1471	20/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.514.632,70	0,00	1.275.731,98915500	2,7549930000
1447	20/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.825,69	0,00	1.025,66140800	2,7549930000
1448	22/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	65.785,08	0,00	23.864,91859400	2,7565600000
1473	22/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	21.249,73	7.708,78504900	2,7565600000
1497	22/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	37.464.874,47	0,00	13.591.169,59906500	2,7565600000
1498	22/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	115,30	41,82741800	2,7565600000
1474	25/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.501,84	1.631,74847200	2,7589050000
1449	25/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.210,69	0,00	438,82989800	2,7589050000
1499	25/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.507,30	0,00	3.083,57844800	2,7589050000
1450	26/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	237.928,03	0,00	86.226,86482100	2,7593260000
1475	26/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.800,00	0,00	1.014,74055600	2,7593260000
1476	26/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	119.126,18	43.172,20150200	2,7593260000
1477	27/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.204,62	3.333,68817200	2,7610920000
1500	27/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	219,86	79,62784400	2,7610920000
1478	28/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.620.734,20	0,00	586.853,62643400	2,7617350000
1451	28/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	360.268,03	0,00	130.449,89110100	2,7617350000
1479	28/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.210.369,69	1.886.629,12641700	2,7617350000
1481	29/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.107.285,29	4.744.045,47476500	2,7628920000
1480	29/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.692.742,39	0,00	612.670,48802400	2,7628920000
1502	29/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.946.968,14	4.686.020,34995600	2,7628920000
1501	29/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	611.718,75	0,00	221.405,23408000	2,7628920000
Total			546.600.986,46	429.835.364,20		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 12.178.427,97

Value-At-Risk: 0,91%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		0,91	0,91			1.336.581.279,19	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,39%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,634200%)		0,28	-0,00	0,27			30.007.038,28	2,25
NTN-B 150535 (5,909200%)		0,12	-0,00	0,14			81.414.441,30	6,09
NTN-B 150545 (5,900200%)		0,12	-0,00	0,14			122.683.166,31	9,18
NTN-B 150832 (5,763300%)		0,30	-0,00	0,32			40.475.832,79	3,03
NTN-B 150860 (5,599600%)		0,25	-0,00	0,27			84.535.664,12	6,32
NTN-B 150860 (5,788000%)		0,41	-0,00	0,42			69.862.013,28	5,23
NTN-B 150860 (5,959200%)		0,25	-0,00	0,28			80.152.961,16	6,00
Sub-total	0,99	0,18	-0,00		0,95	1,77	509.131.117,24	38,09

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	0,04	0,01			342.764.947,60	25,64
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,04	0,01	0,01			21.374.093,56	1,60
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,17	0,01	0,23			21.332.648,87	1,60
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,63	0,00	0,02			2.380.227,47	0,18
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,34	0,12	1,14			201.532.397,98	15,08
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		2,53	0,04	0,78			29.454.473,00	2,20
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		1,49	0,01	1,47			12.208.658,11	0,91
Sub-total	1,53	0,76	0,23		0,09	0,97	631.047.446,59	47,21

Artigo 7º III, Alínea a

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/04/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,04	-0,00	0,04			50.129.445,19	3,75
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI		0,03	0,00	0,03			1.769.190,34	0,13
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		0,16	0,00	0,19			28.803.719,49	2,16
Sub-total	0,23	0,07	0,00		0,03	0,84	80.702.355,02	6,04

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 10,02%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRAPRESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO		10,03	0,18	7,96			27.649.400,95	2,07
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		10,02	0,16	7,99			23.989.985,88	1,79
Sub-total	27,14	10,02	0,33		-0,35	-8,72	51.639.386,83	3,86

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,87%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		11,95	0,09	7,22			14.077.560,51	1,05
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI		10,01	0,06	3,51			10.410.985,10	0,78
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		12,52	0,05	7,61			7.690.537,54	0,58
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI		8,92	0,05	5,08			11.243.644,43	0,84
Sub-total	18,07	9,87	0,25		-0,59	-9,77	43.422.727,58	3,25

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 11,09%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		11,09	0,10	1,05			20.638.245,93	1,54
Sub-total	23,26	11,09	0,10		-0,33	-6,82	20.638.245,93	1,54

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS