

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

CONSOLIDADO

Período: agosto de 2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

91,32%

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%)	2,86	-0,05	3,61	30.009.583,19	2,29
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	4,05	-0,03	1,14	30.450.989,66	2,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	2,93	-0,02	5,72	81.439.302,18	6,23
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	2,92	-0,02	5,38	122.733.459,93	9,38
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	2,94	-0,04	5,32	40.478.915,63	3,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	2,82	-0,05	4,75	84.599.822,16	6,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	2,90	-0,03	3,66	69.903.693,61	5,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	2,97	-0,02	1,18	68.253.956,08	5,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	2,97	-0,02	5,74	80.188.334,04	6,13
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,75	-0,03	5,68	608.058.056,48	46,49

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	0,74	1,21	7,22	201.676.094,27	15,42	4.998.574.700,28	4,03
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,62	0,05	6,58	21.624.132,79	1,65	9.644.358.000,69	0,22
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,82	-0,11	5,99	21.476.475,51	1,64	9.773.675.955,20	0,22
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,70	2,04	5,40	2.479.051,04	0,19	1.901.885.299,87	0,13
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,15	-0,16	5,66	196.759.153,44	15,04	2.774.773.817,72	7,09

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/08/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	6,57	1,04	4,41	28.926.477,92	2,21	218.759.981,24	13,22
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	3,02	-0,17	5,28	11.937.355,34	0,91	2.163.421.204,97	0,55
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,84	0,76	6,38	484.878.740,31	37,07		

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	0,18	0,66	7,37	0,00	0,00	14.286.717.843,06	0,00
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,16	0,05	0,05	0,00	0,00	3.244.269.098,03	0,00
BRAM	BRANCO	BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,16	0,53	0,53	52.338.855,10	4,00	6.775.226.177,02	0,77
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,15	1,16	5,79	19.366.911,94	1,48	10.495.966.845,49	0,18
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,58	1,57	7,26	29.835.776,42	2,28	798.552.666,46	3,74
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,91	1,33	6,92	101.541.543,46	7,76		
Renda Fixa			1,56	0,40	6,75	1.194.478.340,25	91,32		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/08/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDÁ VARIÁVEL

3,18%

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	26,42	6,44	-13,35	13.533.133,24	1,03	152.133.527,10	8,90
BB	BB	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	22,44	5,50	-0,26	10.307.789,46	0,79	107.845.867,12	9,56
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	28,11	10,67	-6,43	7.336.312,11	0,56	661.789.432,80	1,11
BB	BB	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	20,83	2,12	-14,29	10.397.957,37	0,79	206.902.428,13	5,03
Sub-total Artigo 8º I			21,12	5,80	-9,47	41.575.192,18	3,18		
Renda Variável			19,57	5,80	-9,47	41.575.192,18	3,18		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/08/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,58%

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	22,38	-3,92	-25,19	20.612.259,23	1,58	2.252.028.422,82	0,92
Sub-total Artigo 9º III			22,38	-3,92	-25,19	20.612.259,23	1,58		
Investimentos no Exterior			22,38	-3,92	-25,19	20.612.259,23	1,58		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/08/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

3,92%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	21,21	-3,14	-8,37	27.487.580,29	2,10	415.457.333,78	6,62
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	21,09	-3,24	-12,18	23.799.632,39	1,82	1.976.589.170,89	1,20
Sub-total Artigo 10º I			23,73	-3,18	-12,14	51.287.212,68	3,92		
Investimentos Estruturados			23,73	-3,18	-12,14	51.287.212,68	3,92		
Total			2,60	0,37	4,36	1.307.953.004,34	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	608.058.056,48	46,49	0,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	484.878.740,31	37,07	0,00	29,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	101.541.543,46	7,76	0,00	10,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	1.194.478.340,25	91,32					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	41.575.192,18	3,18	0,00	5,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	41.575.192,18	3,18					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	20.612.259,23	1,58	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	20.612.259,23	1,58					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	51.287.212,68	3,92	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	51.287.212,68	3,92					15,00
Total		1.307.953.004,34	100,00					

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	-0,03 -2,57	5,68 99,77	1,45 44,67			-194.067,18	26.143.265,67
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,76 65,06	6,38 82,51	1,56 47,97	5,20 84,46	8,70 85,32	3.919.611,58	43.048.952,33
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,33 114,05	6,92 89,47	2,99 92,10	5,69 92,35		1.189.190,89	7.300.998,17
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	5,80 -0,36	-9,47 -13,95	-3,99 -2,35	-8,59 -5,39		2.279.604,47	-4.196.574,23
Artigo 9º III % do CDI	-3,92 -335,31	-25,19 -325,67	4,51 138,79	-10,76 -174,83	-16,57 -162,40	-839.875,22	-6.941.442,70
Artigo 10º I % do CDI	-3,18 -272,65	-12,14 -156,94	-1,67 -51,31	-5,21 -84,64		-1.686.375,54	-8.160.739,61
CONSOLIDADO (Total)						4.668.089,00	57.194.459,63

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%)	30.023.698,25	0,00	0,00	0,00	30.009.583,19	-14.115,06	1.057.837,58
NTN-B 150535 (5,784900%)	30.461.338,81	0,00	0,00	0,00	30.450.989,66	-10.349,15	344.045,40
NTN-B 150535 (5,909200%)	81.458.244,88	0,00	0,00	0,00	81.439.302,18	-18.942,70	4.486.576,94
NTN-B 150545 (5,900200%)	122.762.994,12	0,00	0,00	0,00	122.733.459,93	-29.534,19	6.376.915,26
NTN-B 150832 (5,763300%)	41.668.890,37	0,00	0,00	1.174.000,95	40.478.915,63	-15.973,79	2.102.647,55
NTN-B 150860 (5,599600%)	86.993.222,06	0,00	0,00	2.348.001,90	84.599.822,16	-45.398,00	3.940.164,78
NTN-B 150860 (5,788000%)	71.925.515,39	0,00	0,00	1.995.801,62	69.903.693,61	-26.020,16	2.539.347,62
NTN-B 150860 (5,949840%)	70.265.572,27	0,00	0,00	1.995.801,62	68.253.956,08	-15.814,57	817.543,26
NTN-B 150860 (5,959200%)	82.554.255,50	0,00	0,00	2.348.001,90	80.188.334,04	-17.919,56	4.478.187,28
					608.058.056,48	0,00	0,00

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

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/08/2022

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	12.303.224,33	0,00	-347.430,04	0,00	11.937.355,34	-18.438,95	619.867,86
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	203.117.737,78	0,00	0,00	6.072.144,14	196.759.153,44	-286.440,20	10.940.189,48
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.425.590,39	0,00	0,00	811.887,87	28.926.477,92	312.775,40	1.261.758,68
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.499.856,80	0,00	0,00	0,00	21.476.475,51	-23.381,29	2.799.400,97
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.613.842,32	0,00	0,00	0,00	21.624.132,79	10.290,47	1.670.066,47
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	206.590.828,68	247.079.962,19	-255.869.882,72	0,00	201.676.094,27	3.875.186,12	23.200.748,59
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.429.431,01	0,00	0,00	0,00	2.479.051,04	49.620,03	127.095,47
					484.878.740,31	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	347.430,04	-347.590,54	0,00	0,00	160,50	5.203,64
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	52.065.784,48	0,00	0,00	52.338.855,10	273.070,62	273.070,62
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	2.162.558,92	17.093.230,49	0,00	0,00	19.366.911,94	111.122,53	1.187.434,54
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	51.722.074,43	0,00	-52.065.784,48	0,00	0,00	343.710,05	4.137.875,82
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	29.374.649,23	0,00	0,00	0,00	29.835.776,42	461.127,19	2.018.622,47
					101.541.543,46	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	12.714.166,79	0,00	0,00	0,00	13.533.133,24	818.966,45	-2.085.402,19
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	10.182.108,48	0,00	0,00	0,00	10.397.957,37	215.848,89	-1.762.459,03
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	9.770.499,96	0,00	0,00	0,00	10.307.789,46	537.289,50	155.582,61
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	6.628.812,48	0,00	0,00	0,00	7.336.312,11	707.499,63	-504.295,62
					41.575.192,18	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	21.452.134,45	0,00	0,00	0,00	20.612.259,23	-839.875,22	-6.941.442,70

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/08/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					20.612.259,23	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	28.377.238,72	0,00	0,00	0,00	27.487.580,29	-889.658,43	-2.512.419,71
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	24.596.349,50	0,00	0,00	0,00	23.799.632,39	-796.717,11	-5.184.318,86
					51.287.212,68	0,00	0,00

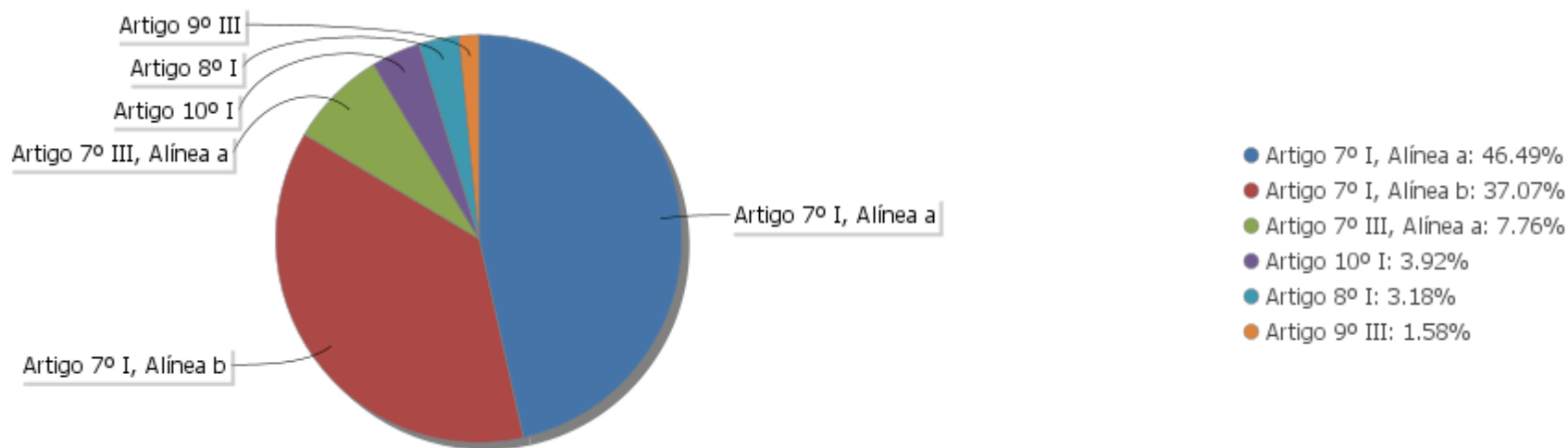
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

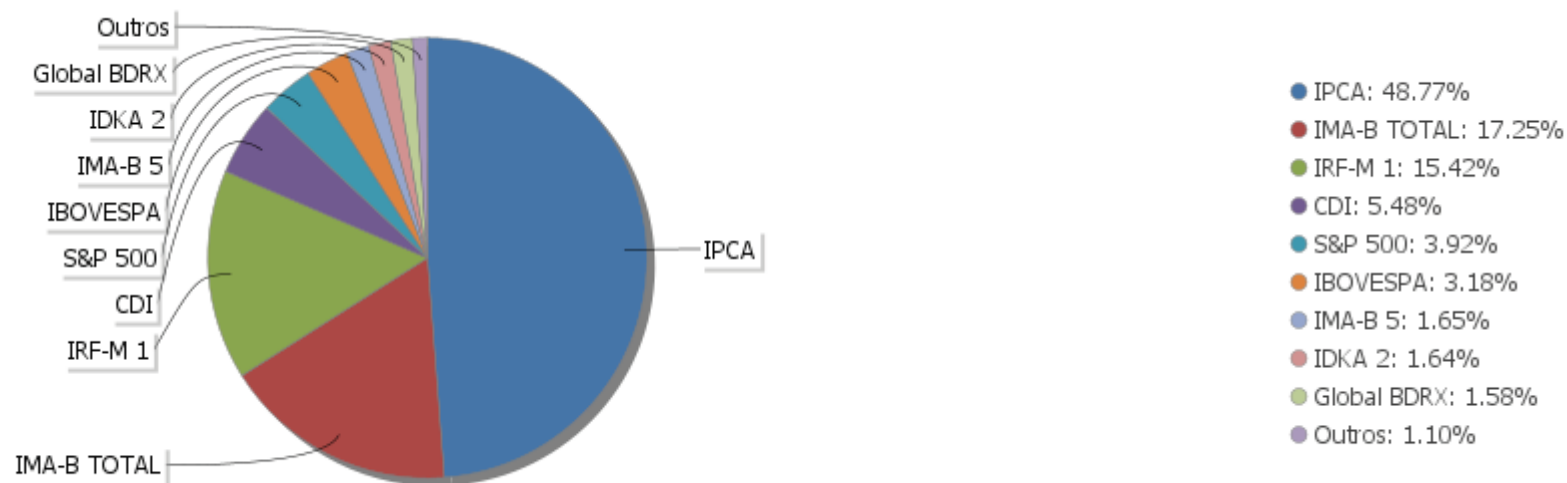
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	462.271.961,16	35,34	462.271.961,16	35,34
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	462.271.961,16	35,34
acima de 365 dias	845.681.043,18	64,66	1.307.953.004,34	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

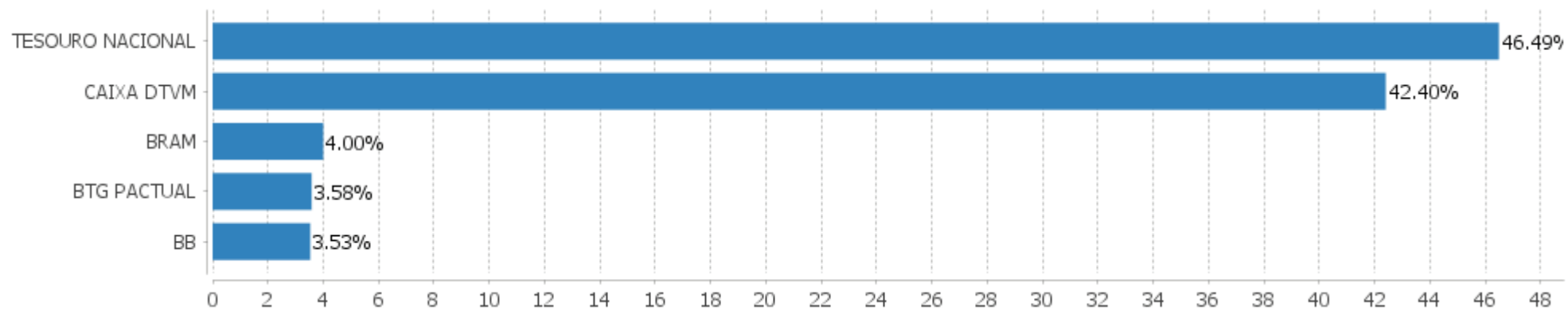


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/08/2022

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	1,01	-0,01	1,05	0,37					4,36
IPCA + 4,00%	0,87	1,31	1,97	1,36	0,81	1,00	-0,35	-0,00					7,16
p.p. indexador	-1,18	-0,98	-0,33	-1,13	0,20	-1,01	1,40	0,37					-2,79
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

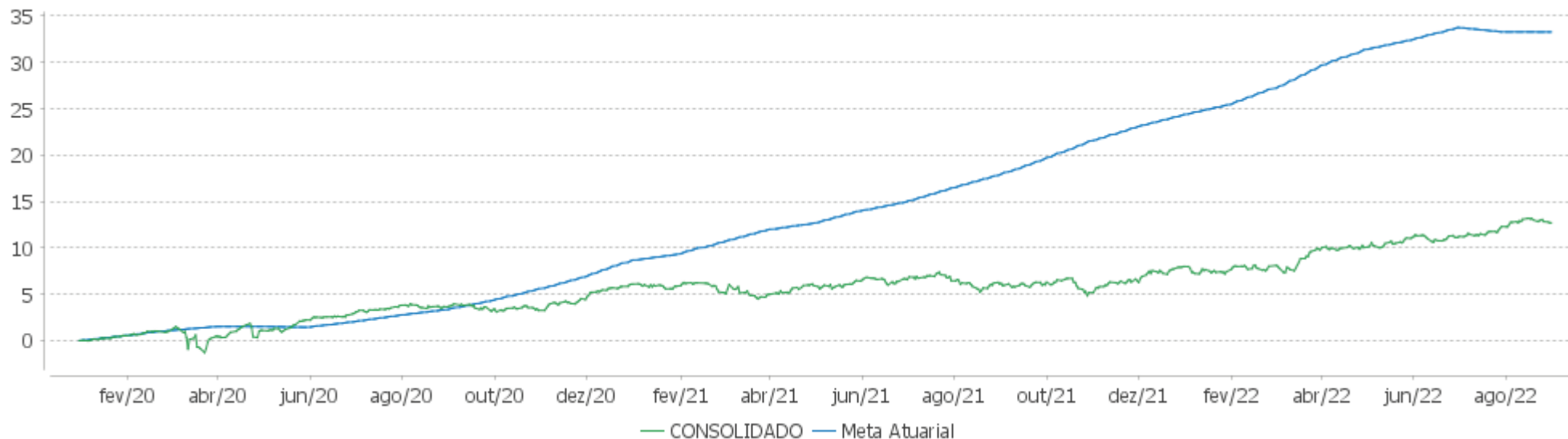
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

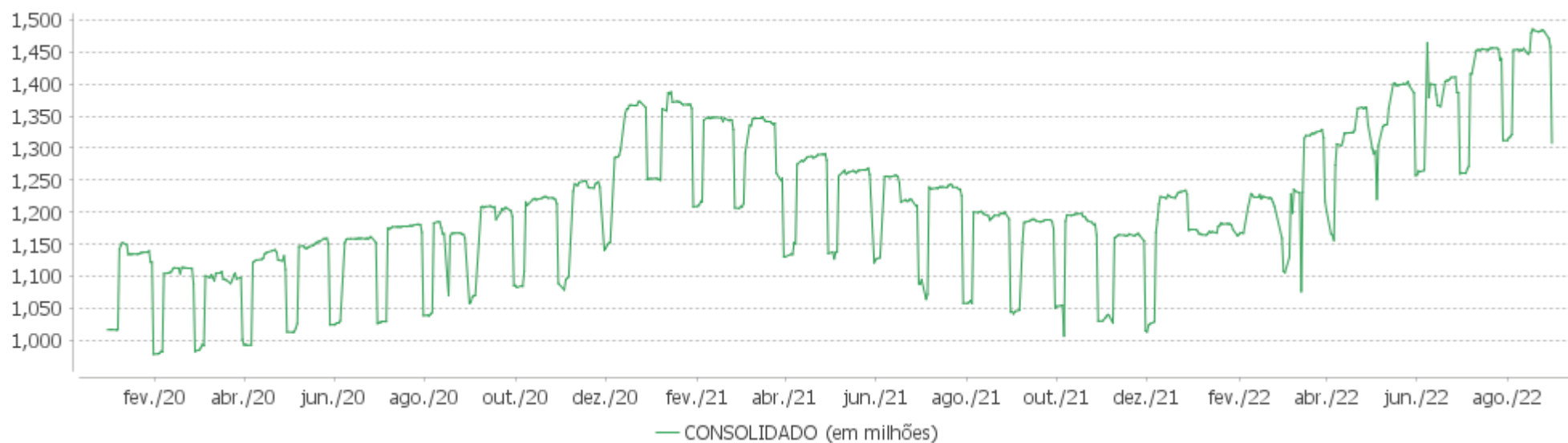
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	10	31,25	03 meses	1,41	0,64	0,77	1,86
Meses abaixo - Meta Atuarial	22	68,75	06 meses	4,35	4,86	-0,52	2,40
			12 meses	6,23	12,35	-6,12	2,60
			24 meses	8,75	26,39	-17,64	2,53
Maior rentabilidade da Carteira	1,64	2022-03	Desde 31/12/2019	12,70	30,42	-17,71	2,88
Menor rentabilidade da Carteira	-0,80	2021-10					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

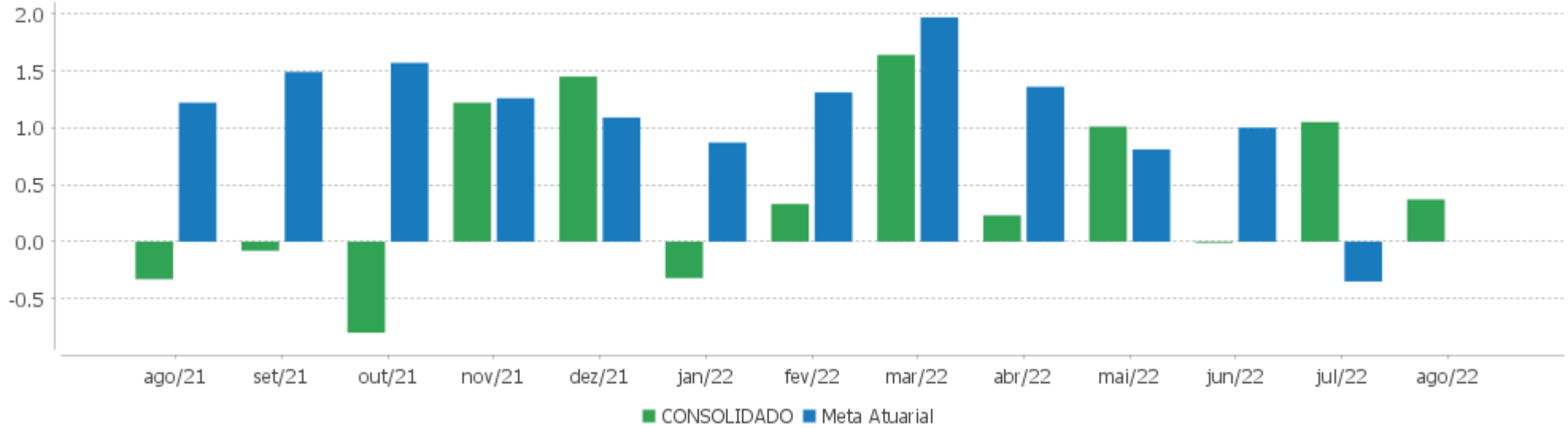


Patrimônio Líquido



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 (5,784900%) Var. IPCA p.p.	-0,03 0,33	5,95 1,56	1,44 1,82	3,59 0,80	9,40 0,67	19,41 0,15	22,12 -0,04
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	-0,05 0,31	8,91 4,52	1,40 1,78	6,51 3,72	12,45 3,72	22,66 3,41	25,37 3,21
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	-0,02 0,34	9,10 4,71	1,47 1,85	6,65 3,86	12,67 3,94	23,03 3,78	25,89 3,73
NTN-B 150860 (5,949840%) Var. IPCA p.p.	-0,02 0,34	6,03 1,64	1,48 1,86	6,67 3,88	12,71 3,98	23,13 3,88	26,04 3,88
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	-0,04 0,32	5,93 1,54	1,44 1,81	6,58 3,78	12,54 3,81	22,80 3,54	25,55 3,39
NTN-B 150860 (5,599600%) Var. IPCA p.p.	-0,05 0,31	5,95 1,56	1,39 1,77	6,49 3,70	12,50 3,77	22,85 3,60	25,71 3,55
NTN-B 150545 (5,900200%) Var. IPCA p.p.	-0,02 0,34	9,10 4,70	1,47 1,84	6,65 3,85	12,67 3,94	23,06 3,81	25,94 3,78
NTN-B 150860 (5,788000%) Var. IPCA p.p.	-0,03 0,33	5,99 1,60	1,44 1,82	6,59 3,80	12,61 3,89	23,00 3,75	25,89 3,73
NTN-B 150860 (5,959200%) Var. IPCA p.p.	-0,02 0,34	6,03 1,64	1,48 1,86	6,68 3,88	12,72 3,99	23,14 3,88	26,04 3,88
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,05 0,05	6,58 -0,04	0,40 0,06	5,38 -0,00	9,75 -0,13	14,69 -0,43	24,92 -0,83
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,16 -1,27	5,66 1,09	-0,26 -0,11	4,59 -0,19	8,85 3,31	12,20 3,21	24,41 8,18
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	-0,11 0,25	5,99 -0,29	-0,18 -0,11	4,77 -0,14	9,08 -0,34	14,35 -0,63	24,46 -1,68
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,04 -0,07	4,41 -0,16	-0,18 -0,03	5,49 0,71	6,14 0,60	7,71 -1,28	16,27 0,05
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	1,21 -0,02	7,22 -0,18	3,19 -0,06	5,80 -0,13	8,80 -0,24	10,97 -0,51	16,36 -0,76
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	-0,17 -0,26	5,22 -1,85	-0,28 -1,17	4,56 -0,81			
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	2,04 -0,01	5,40 -0,08	3,54 -0,06	4,86 -0,10	6,03 -0,14	4,45 -0,40	13,31 -0,66
BRANDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	1,21	8,14	3,40	6,43	10,90	14,08	17,79

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/08/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	103,60	105,29	104,69	104,45	106,83	106,86	101,27
BB PREV RF FLUXO FIC	1,08	7,01	2,99	5,60	9,08	10,75	13,83
% do CDI	92,53	90,63	92,07	90,98	89,02	81,55	78,73
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	1,16	7,68	3,23	6,05	10,16	12,30	16,38
% do CDI	99,41	99,34	99,43	98,24	99,61	93,34	93,22
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,19	7,93	3,29	6,21	10,55	13,60	17,42
% do CDI	101,68	102,46	101,22	100,92	103,42	103,23	99,18
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,57	7,26	2,29	5,42	9,43	9,06	
Var. IPCA p.p.	1,93	2,86	2,66	2,63	0,70	-10,19	
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	10,67	-6,43	-2,74	-5,07	-22,69	-11,35	-7,87
Var. IBOVESPA p.p.	4,51	-10,92	-1,10	-1,87	-14,90	-21,57	-16,17
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	5,50	-0,26	-3,14	-1,87	-6,71	19,03	27,54
Var. IBOVESPA p.p.	-0,66	-4,74	-1,50	1,33	1,08	8,81	19,24
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	2,12	-14,29	-9,44	-11,17	-18,50	14,91	31,74
Var. IBOVESPA p.p.	-4,04	-18,77	-7,80	-7,97	-10,71	4,69	23,45
BB AÇÕES CONSUMO FIC	6,44	-13,35	-0,77	-13,03	-32,26	-33,14	-29,19
Var. IBOVESPA p.p.	0,28	-17,84	0,88	-9,83	-24,46	-43,35	-37,48
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-3,92	-25,19	4,51	-10,76	-16,57	-3,06	63,70
Var. Global BDRX p.p.	-0,87	-0,74	-0,69	-0,68	-1,26	-3,72	-5,37
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-3,24	-12,18	-1,75	-5,28	-5,31	23,21	44,11
Var. S&P 500 p.p.	1,18	10,81	-6,57	3,82	6,64	16,25	-25,02
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	-3,14	-11,92	-1,60	-5,07	-4,92	25,53	
Var. S&P 500 p.p.	1,28	11,07	-6,42	4,03	7,03	18,58	
CONSOLIDADO	0,37	4,36	1,41	4,35	6,23	8,75	
Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,37	-2,79	0,77	-0,52	-6,85	-20,22	
CDI	1,17	7,74	3,25	6,16	10,20	13,18	17,57
IBOVESPA	6,16	4,48	-1,64	-3,20	-7,79	10,22	8,29
INPC + 6,00%	0,22	8,80	1,22	6,02	15,36	34,99	47,30
IPCA + 6,00%	0,17	8,53	1,13	5,88	15,25	33,96	45,46

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 FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI			D+0	D+0		
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
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	1,23	7,40	3,25	5,94	9,04	11,48	17,12	25,79	34,47
IRF-M 1+	2,60	4,60	3,92	4,62	4,80	1,32	12,10	35,02	42,44
IRF-M TOTAL	2,05	5,49	3,60	4,96	6,17	4,85	13,97	32,97	40,86
IMA-B 5	0,00	6,62	0,35	5,38	9,88	15,12	25,75	43,90	53,48
IMA-B 5+	2,49	2,65	-0,51	4,31	1,44	3,27	8,13	49,44	53,36
IMA-B TOTAL	1,10	4,57	-0,15	4,78	5,54	8,99	16,23	48,22	54,99
IMA-GERAL TOTAL	1,40	6,45	2,32	5,44	7,87	9,89	17,04	35,56	43,86
IDKA 2	-0,36	6,28	-0,07	4,90	9,42	14,98	26,14	42,02	53,43
IDKA 20	5,45	-0,98	-1,32	2,60	-6,74	-6,09	-6,32	50,07	49,07
CDI	1,17	7,74	3,25	6,16	10,20	13,18	17,57	24,95	33,50

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,16	4,48	-1,64	-3,20	-7,79	10,22	8,29	42,84	54,62
IBRX 100	6,15	4,48	-2,00	-3,64	-8,18	10,99	9,74	48,00	58,88
IBRX 50	6,33	4,81	-1,81	-4,31	-7,38	13,10	10,63	42,79	55,02
SMALL CAP	10,90	-6,34	-2,42	-4,48	-22,25	-9,05	-3,57	45,68	42,28
IFIX	5,76	6,11	5,52	8,58	8,23	6,98	12,03	39,12	42,81
Índice Consumo - ICON	6,66		-0,20	-12,18	-31,25	-30,97	-26,99	10,55	-1,44
Índice Dividendos - IDIV	4,27	11,21	-2,58	5,93	4,28	24,51	19,98	80,27	80,79

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/08/2022

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	-0,36	4,39	-0,37	2,79	8,73	19,25	22,16	26,35	31,65
INPC	-0,31	4,65	-0,29	2,93	8,83	20,17	23,70	27,76	32,42
IGPM	-0,70	7,63	0,09	3,81	8,59	42,37	60,92	68,88	83,90
SELIC	1,17	7,74	3,25	6,16	10,20	13,18	17,57	24,95	33,51

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	-4,42	-22,99	4,82	-9,10	-11,94	6,95	69,12	70,71	163,33
MSCI ACWI	-4,03	-24,62	2,86	-11,55	-16,72	-0,77	50,18	46,85	110,90

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	-0,00	7,16	0,64	4,86	13,08	28,96	37,39	47,72	60,02
IPCA + 5,00%	0,08	7,84	0,89	5,37	14,16	31,45	41,39	53,46	67,82
IPCA + 5,50%	0,13	8,19	1,01	5,63	14,71	32,70	43,41	56,39	71,84
IPCA + 5,89%	0,16	8,45	1,11	5,83	15,13	33,68	45,01	58,71	75,02
IPCA + 6,00%	0,17	8,53	1,13	5,88	15,25	33,96	45,46	59,36	75,93
INPC + 4,00%	0,05	7,43	0,72	5,00	13,18	29,95	39,12	49,37	60,95
INPC + 6,00%	0,22	8,80	1,22	6,02	15,36	34,99	47,30	61,15	76,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1692	02/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.154,19	0,00	756,88448000	2,8461278500
1703	02/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	58.140,15	20.427,80576600	2,8461278500
1702	02/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.619.931,54	0,00	1.271.879,45545000	2,8461278500
1734	02/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	637.499,60	0,00	223.988,39180700	2,8461278500
1704	03/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	524.759,46	184.295,73773700	2,8473770600
1693	03/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	21.638,40	0,00	7.599,41502000	2,8473770600
1705	04/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.472,30	0,00	9.288,04392400	2,8501480200
1707	05/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	57.183.360,68	20.057.058,90144100	2,8510341900
1706	05/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	127.489.812,00	0,00	44.717.040,73110300	2,8510341900
1724	05/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	48.086.293,84	0,00	16.866.263,48034000	2,8510341900
1725	05/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.951.527,88	684.498,23786200	2,8510341900
1735	05/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	27.196.421,16	0,00	9.539.142,41203800	2,8510341900
1736	05/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.765.984,34	4.126.918,06093300	2,8510341534
1708	08/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	78.284,00	0,00	27.439,00504800	2,8530189000
1694	08/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.825,83	0,00	639,96421400	2,8530189000
1737	08/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	54.178,60	0,00	18.989,91976500	2,8530189000
1709	09/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.253,65	0,00	789,52921900	2,8544225400
1711	10/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	665.051,87	232.855,20913800	2,8560746900
1710	10/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.195,66	0,00	768,76841000	2,8560746900
1695	10/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.719,48	0,00	1.302,30487700	2,8560746900
1726	10/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	664.532,30	232.673,29147800	2,8560746900
1738	10/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	661.698,12	231.680,95711200	2,8560746900
1712	11/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	110.567,68	0,00	38.693,52140800	2,8575243600
1739	11/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	108.357,20	0,00	37.919,95669900	2,8575243600
1713	12/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	14.458,51	5.056,41973800	2,8594360300
1730	15/08/2022	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,00	347.430,04	327.471,92925000	1,0609460200
1728	16/08/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	347.430,04	0,00	149.480,89983000	2,3242437020
1746	16/08/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	9.861.607,94	0,00	2.848.374,97242400	3,4621874000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/08/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1715	17/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	23.009,29	8.035,60864700	2,8634157700
1714	17/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.801.061,26	0,00	7.264.422,26027100	2,8634157700
1729	17/08/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	347.590,54	149.480,89983000	2,3253174160
1731	17/08/2022	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	46.834.971,50	0,00	3.376.944,12800000	13,8690395000
1740	17/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.174.222,35	0,00	5.299.343,01158000	2,8634157700
1733	17/08/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	52.065.784,48	12.398.243,30144600	4,1994485200
1747	17/08/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	347.590,54	0,00	100.344,59317300	3,4639688000
1732	18/08/2022	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	5.230.812,98	0,00	376.962,01000000	13,8762338000
1716	19/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.386,98	1.880,00254900	2,8654108300
1741	19/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.884.032,01	2.402.458,98951000	2,8654108300
1742	19/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.833,79	988,96402900	2,8654108300
1748	19/08/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	6.884.032,01	0,00	1.985.281,24691700	3,4675349000
1717	22/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.372,65	0,00	478,80978100	2,8667960700
1696	22/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.403,92	0,00	9.907,89693600	2,8667960700
1697	23/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.824,19	0,00	984,54632500	2,8685191600
1698	24/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	94.122,71	0,00	32.797,80974600	2,8697864500
1699	26/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.879,65	0,00	2.394,76019800	2,8727928600
1718	26/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	39.683,76	13.813,65156000	2,8727928600
1720	29/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.840.969,15	3.424.197,99864100	2,8739486300
1700	29/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	459,29839700	2,8739486300
1719	29/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	79.053,43	0,00	27.506,90432400	2,8739486300
1743	29/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.890,64	0,00	5.529,20112500	2,8739486300
1721	30/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.696.113,27	4.067.496,47039200	2,8755066800
1723	31/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	84.290.958,21	29.294.562,95913400	2,8773584480
1722	31/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.776.209,50	0,00	964.846,59393000	2,8773584500
1701	31/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.890,62	0,00	1.699,69090900	2,8773584500
1727	31/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	37.476.140,25	13.024.494,82857800	2,8773584500
1745	31/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	32.121.242,70	11.163.448,43874200	2,8773584500
1744	31/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	652.106,14	0,00	226.633,61250600	2,8773584500
Total			316.586.407,20	308.630.687,78		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/08/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 14.986.000,64

Value-At-Risk: 1,15%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		1,15	1,15			1.307.953.004,34	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,44%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,634200%)		0,24	0,00	0,20			30.009.583,19	2,29
NTN-B 150535 (5,784900%)		0,37	-0,00	0,42			30.450.989,66	2,33
NTN-B 150535 (5,909200%)		0,24	0,00	0,20			81.439.302,18	6,23
NTN-B 150545 (5,900200%)		0,24	0,00	0,20			122.733.459,93	9,38
NTN-B 150832 (5,763300%)		0,24	0,00	0,20			40.478.915,63	3,09
NTN-B 150860 (5,599600%)		0,24	0,00	0,20			84.599.822,16	6,47
NTN-B 150860 (5,788000%)		0,24	0,00	0,20			69.903.693,61	5,34
NTN-B 150860 (5,949840%)		0,24	0,00	0,20			68.253.956,08	5,22
NTN-B 150860 (5,959200%)		0,24	0,00	0,20			80.188.334,04	6,13
Sub-total	0,20	0,23	0,00		-6,13	-0,03	608.058.056,48	46,49

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		0,20	0,01	0,00			201.676.094,27	15,42
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,10	0,01	0,04			21.624.132,79	1,65
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,49	0,01	0,44			21.476.475,51	1,64
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,61	0,00	0,03			2.479.051,04	0,19
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,55	0,13	1,39			196.759.153,44	15,04
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		3,02	0,03	0,99			28.926.477,92	2,21
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		1,55	0,01	1,54			11.937.355,34	0,91

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/08/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	1,88	0,98	0,21		-0,22	0,76	484.878.740,31	37,07

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		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BB PREV RF FLUXO FIC		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,02	0,00	0,02			52.338.855,10	4,00
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI		0,04	0,00	0,02			19.366.911,94	1,48
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		1,45	0,01	1,47			29.835.776,42	2,28
Sub-total	0,50	0,43	0,01		0,33	1,33	101.541.543,46	7,76

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 14,57%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO		14,52	0,28	8,35			27.487.580,29	2,10
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		14,64	0,24	8,42			23.799.632,39	1,82
Sub-total	19,04	14,57	0,52		-0,23	-3,18	51.287.212,68	3,92

Renda Variável

Value-At-Risk: 10,58%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		12,23	0,10	8,48			13.533.133,24	1,03
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI		11,92	0,07	3,65			10.307.789,46	0,79
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		12,78	0,06	7,87			7.336.312,11	0,56
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI		9,77	0,06	4,42			10.397.957,37	0,79
Sub-total	22,17	10,58	0,29		0,21	5,80	41.575.192,18	3,18

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 12,06%

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/08/2022

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		12,06	0,12	2,87			20.612.259,23	1,58
Sub-total	22,60	12,06	0,12		-0,22	-3,92	20.612.259,23	1,58