

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

CONSOLIDADO

Período: junho de 2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

91,66%

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%)	2,85	0,98	3,18	29.885.033,21	2,37
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	4,04	0,70	0,70	30.317.047,23	2,41
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	2,92	1,00	5,23	81.064.494,90	6,43
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	2,90	1,00	4,90	122.170.420,74	9,70
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	4,08	0,99	4,86	41.472.196,82	3,29
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	3,91	0,98	4,32	86.593.791,68	6,87
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	4,02	0,99	3,21	71.584.632,89	5,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	4,12	0,71	0,71	69.923.639,85	5,55
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	4,12	1,01	5,24	82.151.988,90	6,52
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,68	1,00	5,20	615.163.246,22	48,83

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	0,91	4,86	165.718.985,03	13,15	5.096.804.349,76	3,25
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,58	0,33	6,51	21.609.373,39	1,72	11.084.704.335,99	0,19
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,67	0,22	6,41	21.562.919,39	1,71	11.226.926.091,22	0,19
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,66	0,34	2,15	2.402.485,00	0,19	664.050.646,23	0,36
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,15	0,22	6,17	203.771.565,27	16,17	2.358.630.614,34	8,64

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2022

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	6,51	-0,05	4,55	29.768.063,91	2,36	225.124.642,47	13,22
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2,95	0,22	5,81	12.343.760,19	0,98	1.527.534.423,49	0,81
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,93	0,54	5,31	457.177.152,18	36,29		
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	0,20	1,06	5,60	51.206.480,59	4,06	12.613.402.228,26	0,41
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,17	1,02	3,52	2.140.682,61	0,17	9.618.019.391,20	0,02
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,96	0,09	4,95	29.193.363,84	2,32	855.763.788,80	3,41
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,94	0,76	4,61	82.540.527,04	6,55		
Renda Fixa			1,83	0,78	5,86	1.154.880.925,44	91,66		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDÁ VARIÁVEL

2,94%

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	25,30	-14,47	-25,32	11.663.969,33	0,93	132.180.156,62	8,82
BB	BB	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	22,51	-12,89	-10,30	9.269.830,42	0,74	103.661.319,75	8,94
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	27,24	-16,29	-19,47	6.314.292,56	0,50	616.162.344,30	1,02
BB	BB	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	20,70	-14,42	-19,00	9.826.755,08	0,78	204.737.179,56	4,80
Sub-total Artigo 8º I			21,33	-14,39	-19,27	37.074.847,39	2,94		
Renda Variável			18,39	-14,39	-19,27	37.074.847,39	2,94		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2022

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	21,13	0,83	-27,83	19.885.727,46	1,58	2.225.410.384,30	0,89
Sub-total Artigo 9º III			21,13	0,83	-27,83	19.885.727,46	1,58		
Investimentos no Exterior			21,13	0,83	-27,83	19.885.727,46	1,58		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

3,82%

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	20,08	-7,82	-14,17	25.748.716,57	2,04	393.628.937,87	6,54
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	19,96	-7,78	-17,57	22.338.863,91	1,77	2.072.988.175,00	1,08
Sub-total Artigo 10º I			25,06	-7,80	-17,62	48.087.580,48	3,82		
Investimentos Estruturados			25,06	-7,80	-17,62	48.087.580,48	3,82		
Total			2,75	-0,01	2,90	1.259.929.080,77	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	615.163.246,22	48,83	0,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	457.177.152,18	36,29	0,00	29,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	82.540.527,04	6,55	0,00	10,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	1.154.880.925,44	91,66					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	37.074.847,39	2,94	0,00	5,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	37.074.847,39	2,94					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	19.885.727,46	1,58	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	19.885.727,46	1,58					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	48.087.580,48	3,82	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	48.087.580,48	3,82					15,00
Total		1.259.929.080,77	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	1,00 98,48	5,20 153,07	4,29 147,61				23.386.847,42
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,54 53,20	5,31 98,37	2,47 85,14	5,31 98,37	7,08 81,83	3.125.610,56	36.977.066,09
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,76 75,25	4,61 85,26	2,77 95,40	4,61 85,26		735.089,92	5.393.051,74
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-14,39 -2,88	-19,27 -13,28	-22,96 -5,08	-19,27 -13,28		-6.229.503,02	-8.696.919,02
Artigo 9º III % do CDI	0,83 81,64	-27,83 -515,21	-10,22 -351,53	-27,83 -515,21	-13,08 -151,09	163.198,72	-7.667.974,47
Artigo 10º I % do CDI	-7,80 -769,82	-17,62 -326,23	-15,00 -516,14	-17,62 -326,23		-4.069.539,95	-11.360.371,81
CONSOLIDADO (Total)						-488.928,50	38.031.699,95

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%)	29.594.215,86	0,00	0,00	0,00	29.885.033,21	290.817,35	933.287,60
NTN-B 150535 (5,784900%)	0,00	30.106.944,26	0,00	0,00	30.317.047,23	210.102,97	210.102,97
NTN-B 150535 (5,909200%)	80.258.237,84	0,00	0,00	0,00	81.064.494,90	806.257,06	4.111.769,66
NTN-B 150545 (5,900200%)	120.956.269,17	0,00	0,00	0,00	122.170.420,74	1.214.151,57	5.813.876,07
NTN-B 150832 (5,763300%)	41.064.460,21	0,00	0,00	0,00	41.472.196,82	407.736,61	1.921.927,79
NTN-B 150860 (5,599600%)	85.753.481,92	0,00	0,00	0,00	86.593.791,68	840.309,76	3.586.132,40
NTN-B 150860 (5,788000%)	70.879.454,05	0,00	0,00	0,00	71.584.632,89	705.178,84	2.224.485,28
NTN-B 150860 (5,949840%)	0,00	69.432.214,44	0,00	0,00	69.923.639,85	491.425,41	491.425,41
NTN-B 150860 (5,959200%)	81.331.753,20	0,00	0,00	0,00	82.151.988,90	820.235,70	4.093.840,24
					615.163.246,22	0,00	0,00

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

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2022

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	12.316.885,24	0,00	0,00	0,00	12.343.760,19	26.874,95	678.842,67
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	203.321.377,06	0,00	0,00	0,00	203.771.565,27	450.188,21	11.880.457,17
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.783.914,39	0,00	0,00	0,00	29.768.063,91	-15.850,48	1.291.456,80
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.514.653,93	0,00	0,00	0,00	21.562.919,39	48.265,46	2.885.844,85
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.537.528,68	0,00	0,00	0,00	21.609.373,39	71.844,71	1.655.307,07
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	253.069.173,97	281.753.565,18	-371.639.800,80	0,00	165.718.985,03	2.536.046,68	16.104.803,29
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.394.243,97	0,00	0,00	0,00	2.402.485,00	8.241,03	50.529,43
					457.177.152,18	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 TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	8.507.124,59	93.000.000,00	-99.539.158,68	0,00	2.140.682,61	172.716,70	1.054.435,70
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	50.669.078,73	0,00	0,00	0,00	51.206.480,59	537.401,86	3.278.571,93
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	29.168.392,48	0,00	0,00	0,00	29.193.363,84	24.971,36	1.376.209,89
					82.540.527,04	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	13.637.598,68	0,00	0,00	0,00	11.663.969,33	-1.973.629,35	-3.954.566,10
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	11.482.051,80	0,00	0,00	0,00	9.826.755,08	-1.655.296,72	-2.333.661,32
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	10.641.751,52	0,00	0,00	0,00	9.269.830,42	-1.371.921,10	-882.376,43
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	7.542.948,41	0,00	0,00	0,00	6.314.292,56	-1.228.655,85	-1.526.315,17
					37.074.847,39	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	19.722.528,74	0,00	0,00	0,00	19.885.727,46	163.198,72	-7.667.974,47
					19.885.727,46	0,00	0,00

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	27.933.625,08	0,00	0,00	0,00	25.748.716,57	-2.184.908,51	-4.251.283,43
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	24.223.495,35	0,00	0,00	0,00	22.338.863,91	-1.884.631,44	-6.645.087,34
					48.087.580,48	0,00	0,00

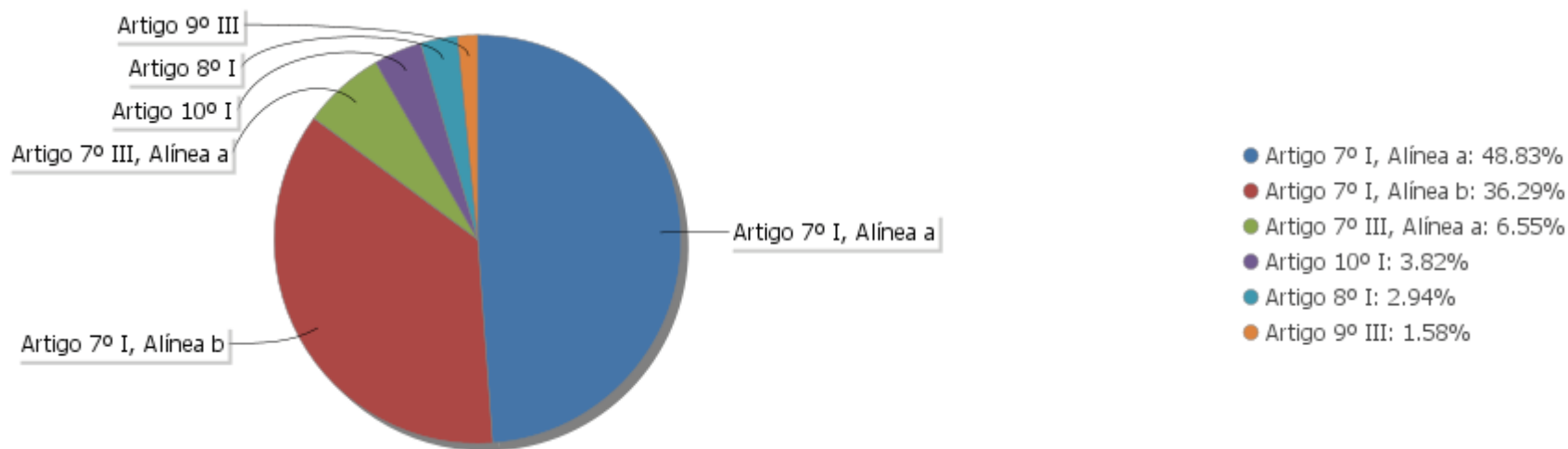
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

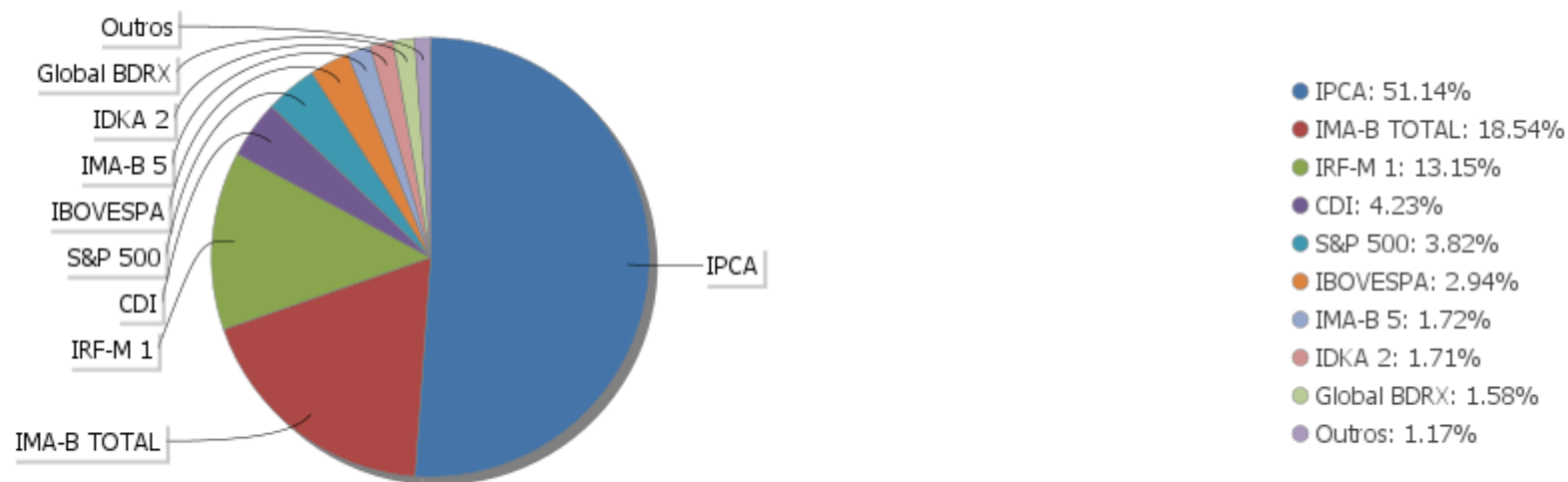
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	398.882.445,18	31,66	398.882.445,18	31,66
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	398.882.445,18	31,66
acima de 365 dias	861.046.635,59	68,34	1.259.929.080,77	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

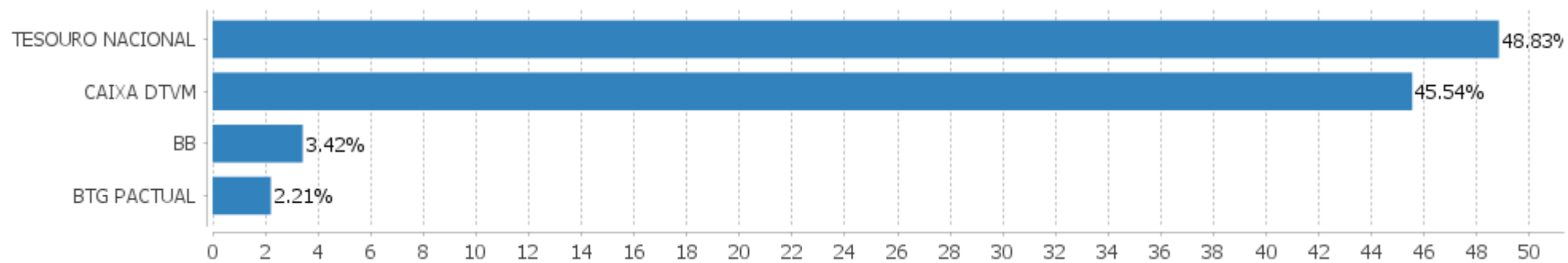


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2022

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							2,90
IPCA + 4,00%	0,87	1,31	1,97	1,36	0,81	1,00							7,54
p.p. indexador	-1,18	-0,98	-0,33	-1,13	0,20	-1,01							-4,64
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

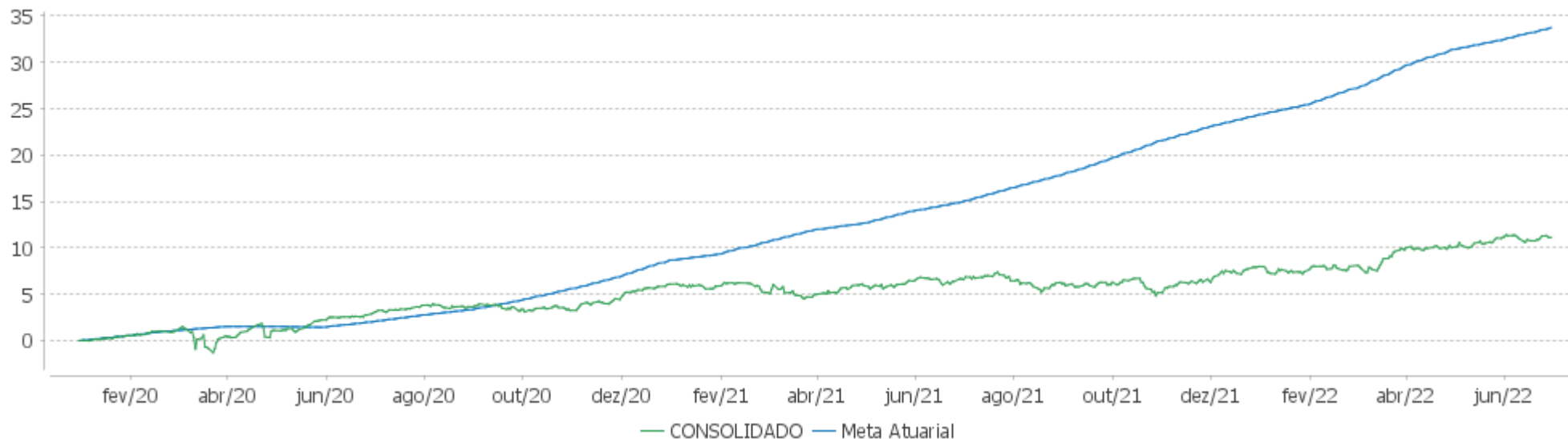
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

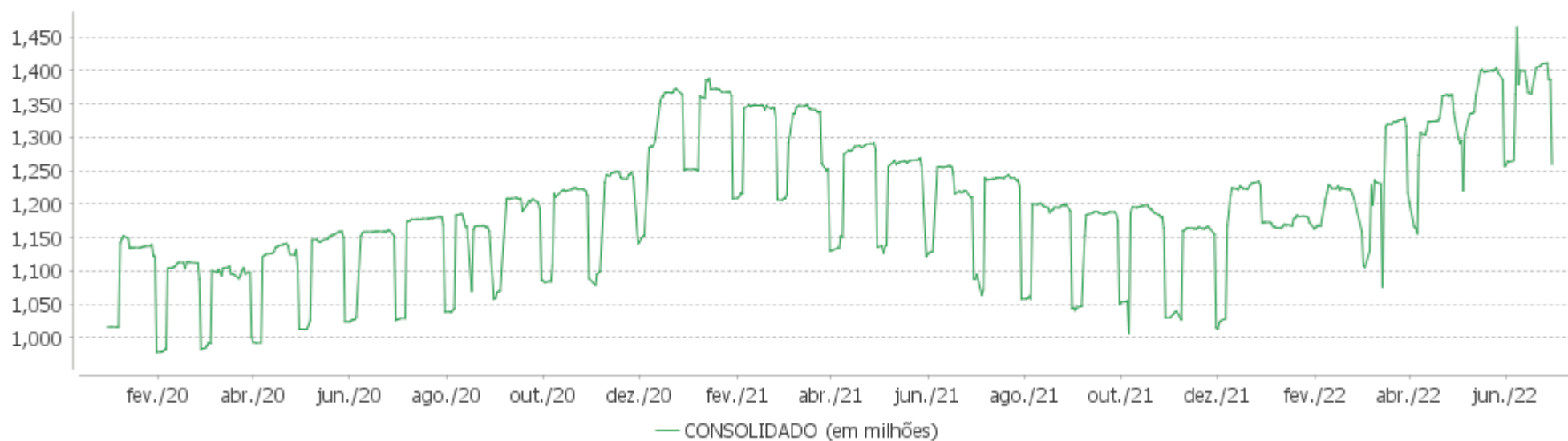
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	8	26,67	03 meses	1,22	3,21	-1,98	2,31
Meses abaixo - Meta Atuarial	22	73,33	06 meses	2,90	7,54	-4,64	2,65
			12 meses	4,22	15,22	-11,00	2,75
			24 meses	7,95	28,43	-20,48	2,52
Maior rentabilidade da Carteira	1,64	2022-03	Desde 31/12/2019	11,13	30,89	-19,76	2,95
Menor rentabilidade da Carteira	-0,80	2021-10					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

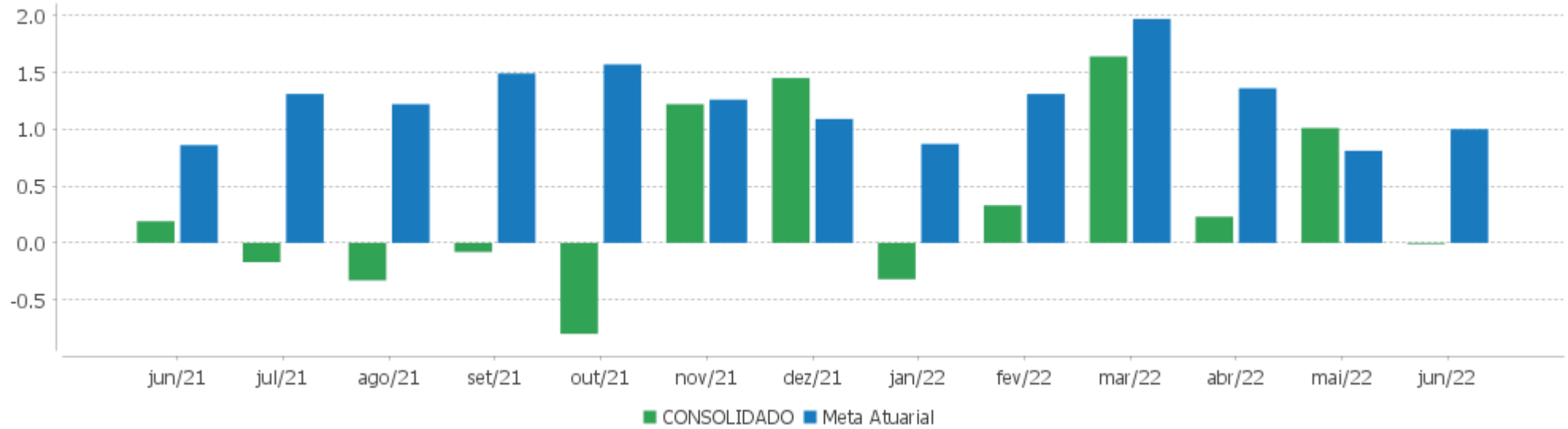


Patrimônio Líquido



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.	0,99 0,32	5,48 -0,00	1,35 -0,86	5,48 -0,00	11,70 -0,19	20,76 -0,46	23,15 -0,66
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,31	8,46 2,97	4,25 2,03	8,46 2,97	14,82 2,93	24,05 2,83	26,43 2,62
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,33	8,60 3,11	4,32 2,11	8,60 3,11	15,03 3,15	24,43 3,21	26,96 3,15
NTN-B 150860 (5,949840%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,34	5,53 0,05	4,33 2,11	5,53 0,05	11,81 -0,08	20,99 -0,24	23,49 -0,32
NTN-B 150860 (5,599600%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,31	5,51 0,03	4,25 2,03	5,51 0,03	11,76 -0,12	20,90 -0,33	23,35 -0,46
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,32	5,47 -0,02	4,26 2,04	5,47 -0,02	11,67 -0,22	20,70 -0,53	23,05 -0,76
NTN-B 150545 (5,900200%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,33	8,60 3,11	4,31 2,10	8,60 3,11	15,04 3,15	24,46 3,23	27,00 3,19
NTN-B 150860 (5,788000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,32	5,52 0,04	4,29 2,07	5,52 0,04	11,79 -0,10	20,95 -0,28	23,42 -0,39
NTN-B 150860 (5,959200%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,34	5,53 0,05	4,34 2,13	5,53 0,05	11,81 -0,08	20,99 -0,24	23,49 -0,32
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,33 -0,00	6,51 -0,10	2,65 -0,04	6,51 -0,10	9,84 -0,22	16,18 -0,56	26,06 -0,96
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,22 0,59	6,17 1,82	2,37 0,94	6,17 1,82	9,15 5,38	14,46 2,98	26,24 9,24
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,05 0,31	4,55 0,20	1,92 0,48	4,55 0,20	4,74 0,96	10,20 -1,28	15,10 -1,90
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,22 -0,25	6,41 -0,43	2,50 -0,36	6,41 -0,43	9,66 -0,45	16,68 -1,21	26,24 -1,99
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,91 -0,02	4,86 -0,13	2,58 -0,07	4,86 -0,13	6,94 -0,24	8,89 -0,48	15,19 -0,76
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,22 -0,86	5,75 -1,52	2,37 -1,08				
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,34 -0,02	2,15 -0,04	0,76 -0,07	2,15 -0,04	1,63 -0,13	1,54 -0,37	11,23 -0,68
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	1,02	5,37	2,83	5,37	8,65	10,24	15,06

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	100,17	99,46	97,36	99,46	99,92	92,10	92,68
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,06	5,60	2,97	5,60	9,19	11,59	16,08
% do CDI	104,64	103,61	102,04	103,61	106,13	104,22	98,96
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,09	4,95	2,32	4,95	4,93	7,33	
Var. IPCA p.p.	-0,58	-0,54	0,10	-0,54	-6,96	-13,90	
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-16,29	-19,47	-24,74	-19,47	-40,12	-17,78	-14,84
Var. IBOVESPA p.p.	-4,79	-13,48	-6,86	-13,48	-17,83	-21,45	-12,44
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	-12,89	-10,30	-17,28	-10,30	-21,50	14,46	18,13
Var. IBOVESPA p.p.	-1,39	-4,31	0,60	-4,31	0,78	10,79	20,53
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	-14,42	-19,00	-19,28	-19,00	-25,47	22,35	23,42
Var. IBOVESPA p.p.	-2,91	-13,00	-1,40	-13,00	-3,18	18,68	25,82
BB AÇÕES CONSUMO FIC	-14,47	-25,32	-28,92	-25,32	-47,15	-39,19	-30,37
Var. IBOVESPA p.p.	-2,97	-19,33	-11,04	-19,33	-24,87	-42,85	-27,97
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,83	-27,83	-10,22	-27,83	-13,08	9,72	69,62
Var. Global BDRX p.p.	0,03	-0,22	0,06	-0,22	-0,98	-2,78	-4,54
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-7,78	-17,57	-14,98	-17,57	-5,74	30,65	35,22
Var. S&P 500 p.p.	-9,25	7,88	-7,35	7,88	2,03	13,86	-40,66
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	-7,82	-17,49	-15,04	-17,49	-5,39	33,16	
Var. S&P 500 p.p.	-9,29	7,96	-7,41	7,96	2,37	16,37	
CONSOLIDADO	-0,01	2,90	1,22	2,90	4,22	7,95	
Var. IPCA + 4,00% p.p.	-1,01	-4,64	-1,98	-4,64	-12,14	-23,14	
CDI	1,01	5,40	2,91	5,40	8,66	11,12	16,25
IBOVESPA	-11,50	-5,99	-17,88	-5,99	-22,29	3,67	-2,40
INPC + 6,00%	1,11	8,68	3,60	8,68	18,63	37,32	49,01
IPCA + 6,00%	1,16	8,56	3,69	8,56	18,60	36,18	47,46

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 PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI			D+0	D+0		
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	0,93	4,99	2,65	4,99	7,19	9,37	15,94	24,32	34,03
IRF-M 1+	0,09	0,73	-0,06	0,73	-1,02	-2,10	9,44	30,43	42,54
IRF-M TOTAL	0,37	2,19	0,83	2,19	1,76	1,90	11,90	29,50	41,08
IMA-B 5	0,33	6,61	2,69	6,61	10,06	16,74	27,03	45,64	59,81
IMA-B 5+	-1,10	2,03	0,12	2,03	-2,16	6,18	8,27	52,42	61,74
IMA-B TOTAL	-0,36	4,35	1,43	4,35	3,78	11,48	17,00	50,64	62,99
IMA-GERAL TOTAL	0,43	4,49	1,90	4,49	5,34	9,08	16,19	34,66	46,06
IDKA 2	0,47	6,85	2,86	6,85	10,11	17,88	28,22	45,20	59,68
IDKA 20	-2,95	-2,61	-2,97	-2,61	-13,58	-2,92	-7,47	53,52	57,70
CDI	1,01	5,40	2,91	5,40	8,66	11,12	16,25	23,60	32,71

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-11,50	-5,99	-17,88	-5,99	-22,29	3,67	-2,40	35,43	56,67
IBRX 100	-11,56	-5,72	-17,94	-5,72	-23,04	4,91	0,02	40,80	61,46
IBRX 50	-11,67	-5,71	-18,35	-5,71	-22,70	6,28	-1,09	35,60	56,73
SMALL CAP	-16,33	-19,69	-24,72	-19,69	-39,59	-15,65	-11,30	25,69	43,26
IFIX	-0,88	-0,33	0,56	-0,33	1,48	-0,38	6,46	31,54	34,78
Índice Consumo - ICON	-14,29		-28,67		-46,23	-37,15	-28,35	-3,87	-2,44
Índice Dividendos - IDIV	-8,38	4,58	-9,43	4,58	-4,10	18,72	18,53	75,13	90,63

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2022

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	0,67	5,49	2,22	5,49	11,89	21,23	23,81	27,98	33,60
INPC	0,62	5,61	2,12	5,61	11,92	22,24	25,11	29,26	33,82
IGPM	0,59	8,16	2,54	8,16	10,70	50,28	61,27	71,77	83,66
SELIC	1,01	5,40	2,91	5,40	8,66	11,12	16,25	23,60	32,72

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	1,47	-25,45	-7,62	-25,45	-7,76	16,79	75,88	89,17	147,32
MSCI ACWI	1,26	-25,79	-7,28	-25,79	-13,20	8,75	55,83	60,47	103,16

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,00	7,54	3,21	7,54	16,36	31,10	39,27	49,65	62,39
IPCA + 5,00%	1,08	8,05	3,45	8,05	17,48	33,63	43,33	55,47	70,31
IPCA + 5,50%	1,12	8,30	3,57	8,30	18,04	34,90	45,38	58,44	74,39
IPCA + 5,89%	1,15	8,50	3,66	8,50	18,48	35,90	47,00	60,79	77,62
IPCA + 6,00%	1,16	8,56	3,69	8,56	18,60	36,18	47,46	61,46	78,54
INPC + 4,00%	0,95	7,67	3,11	7,67	16,40	32,20	40,73	51,14	62,66
INPC + 6,00%	1,11	8,68	3,60	8,68	18,63	37,32	49,01	63,07	78,83

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1604	01/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	95.902,68	34.378,35250500	2,7896240000
1595	01/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.040,26	0,00	2.523,73079600	2,7896240000
1581	02/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	601.281,18	0,00	215.459,60480700	2,7906910000
1607	02/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	15.195,15	5.444,93990600	2,7906910000
1606	02/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.528.494,22	0,00	1.264.380,11947500	2,7906910000
1582	03/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.358,61	0,00	486,58080400	2,7921570000
1608	03/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	127.321,26	45.599,60397300	2,7921570000
1584	06/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	93.000.000,00	33.293.476,62814300	2,7933400000
1583	06/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.025,07	0,00	5.736,88487600	2,7933400000
1609	06/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.017.497,15	0,00	722.252,62588800	2,7933400000
1638	06/06/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	93.000.000,00	0,00	27.521.720,55616800	3,3791492000
1586	07/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.854.732,25	4.242.502,80336200	2,7942780000
1585	07/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	32.676.090,30	0,00	11.693.929,63048000	2,7942780000
1605	07/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	58.274.039,62	20.854.775,22898400	2,7942780000
1610	07/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	130.104.242,48	0,00	46.560.951,51591900	2,7942780000
1596	07/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.595,15	0,00	10.949,21478800	2,7942780000
1629	07/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.317.935,12	0,00	8.344.887,34478100	2,7942780000
1630	07/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	17.336.360,58	6.204.236,15157200	2,7942780000
1587	08/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	429.155,67	0,00	153.510,61968900	2,7956090000
1611	08/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	689.904,46	0,00	246.781,45620500	2,7956090000
1597	08/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	21.989,67	0,00	7.865,78881300	2,7956090000
1612	08/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.101,78	1.824,92610300	2,7956090000
1636	08/06/2022	NTN-B 150860 (5,949840%)	69.432.214,44	0,00	17.000,00000000	4.084,2479080000
1637	08/06/2022	NTN-B 150535 (5,784900%)	30.106.944,26	0,00	7.400,00000000	4.068,5059810000
1588	09/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.783.436,82	0,00	637.411,35701000	2,7979370000
1589	09/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	963,02	344,18848500	2,7979370000
1614	09/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.101,78	1.823,40763500	2,7979370000
1613	09/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.524.436,29	0,00	5.191.123,42057700	2,7979370000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1631	09/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.448,54	3.376,96663100	2,7979370000
1639	09/06/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	6.408.947,92	1.893.964,07745300	3,3838804000
1640	09/06/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	93.130.210,76	27.521.720,55489900	3,3838804000
1615	10/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	118.970,98	0,00	42.499,15248800	2,7993730000
1632	10/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	22.866.615,91	0,00	8.168.477,69482600	2,7993730000
1590	13/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	782.864,21	279.672,96805900	2,7992130000
1617	13/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	786.019,33	280.800,11402900	2,7992130000
1598	13/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.137,25	0,00	763,51817400	2,7992130000
1616	13/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.669.193,18	0,00	2.025.281,09865100	2,7992130000
1633	13/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	786.019,31	280.800,10702600	2,7992130000
1618	14/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	15.413.811,80	5.506.301,49633000	2,7993040000
1634	14/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.211,77	790,11419300	2,7993040000
1591	15/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	19.916.838,86	7.109.510,57250000	2,8014360000
1620	15/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	138.921,15	49.589,26397500	2,8014360000
1619	15/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.135,15	0,00	2.190,00184100	2,8014360000
1592	20/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	37.825.428,25	0,00	13.487.905,50621200	2,8043960000
1621	20/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.136.616,75	0,00	405.298,23534100	2,8043960000
1599	20/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.655,51	0,00	590,32675800	2,8043960000
1622	21/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.585,80	1.634,35568400	2,8058760000
1600	21/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	27.591,36	0,00	9.833,42100600	2,8058760000
1623	22/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.386,96	1.206,44641000	2,8073840000
1601	23/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.504,29	0,00	1.247,48672100	2,8090800000
1625	28/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	23.775.781,84	8.457.950,81652800	2,8110570000
1624	28/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.710.164,99	0,00	608.370,79788800	2,8110570000
1602	29/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.261,91	0,00	9.337,82696900	2,8124220000
1626	29/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.085,36	0,00	9.275,05189400	2,8124220000
1594	30/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.991.939,34	10.303.083,48240100	2,8139090000
1593	30/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	665.764,92	0,00	236.597,88571600	2,8139090000
1603	30/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	103.881,08	0,00	36.917,00051400	2,8139090000
1628	30/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	69.146.066,42	24.572.957,55374200	2,8139090000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1627	30/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.814.075,84	0,00	644.681,77186900	2,8139090000
1635	30/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	31.167.187,35	11.076.117,72266500	2,8139090000
Total			474.292.723,88	471.178.959,48		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 14.131.668,69

Value-At-Risk: 1,12%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		1,12	1,12			1.259.929.080,77	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,43%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,634200%)		0,27	0,00	0,27			29.885.033,21	2,37
NTN-B 150535 (5,784900%)		0,24	-0,00	0,25			30.317.047,23	2,41
NTN-B 150535 (5,909200%)		0,12	0,00	0,15			81.064.494,90	6,43
NTN-B 150545 (5,900200%)		0,12	0,00	0,15			122.170.420,74	9,70
NTN-B 150832 (5,763300%)		0,29	-0,00	0,31			41.472.196,82	3,29
NTN-B 150860 (5,599600%)		0,24	-0,00	0,27			86.593.791,68	6,87
NTN-B 150860 (5,788000%)		0,40	-0,00	0,42			71.584.632,89	5,68
NTN-B 150860 (5,949840%)		0,25	-0,00	0,27			69.923.639,85	5,55
NTN-B 150860 (5,959200%)		0,25	-0,00	0,27			82.151.988,90	6,52
Sub-total	0,37	0,18	-0,00		-0,04	1,00	615.163.246,22	48,83

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		0,26	0,02	0,01			165.718.985,03	13,15
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,11	0,01	0,02			21.609.373,39	1,72
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,39	0,01	0,37			21.562.919,39	1,71
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,60	0,00	0,03			2.402.485,00	0,19
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,51	0,14	1,14			203.771.565,27	16,17
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		2,82	0,04	0,90			29.768.063,91	2,36
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		1,51	0,01	1,50			12.343.760,19	0,98

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	1,67	1,04	0,23		-0,28	0,54	457.177.152,18	36,29

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		0,04	0,00	0,04			51.206.480,59	4,06
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI		0,03	-0,00	0,02			2.140.682,61	0,17
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		1,34	0,01	1,35			29.193.363,84	2,32
Sub-total	1,09	0,48	0,01		-0,23	0,76	82.540.527,04	6,55

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 14,19%

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		14,21	0,26	8,36			25.748.716,57	2,04
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		14,16	0,23	8,35			22.338.863,91	1,77
Sub-total	29,11	14,19	0,49		-0,30	-7,80	48.087.580,48	3,82

Renda Variável

Value-At-Risk: 10,42%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		12,58	0,09	8,23			11.663.969,33	0,93
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI		10,81	0,06	3,12			9.269.830,42	0,74
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		12,48	0,05	7,72			6.314.292,56	0,50
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI		10,03	0,06	5,08			9.826.755,08	0,78
Sub-total	20,36	10,42	0,26		-0,76	-14,39	37.074.847,39	2,94

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 12,84%

Artigo 9º III

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		12,84	0,13	2,47			19.885.727,46	1,58
Sub-total	26,20	12,84	0,13		-0,01	0,83	19.885.727,46	1,58