

**CEARAPREV**  
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA  
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



**CEARÁ**  
GOVERNO DO ESTADO  
SECRETARIA DO  
PLANEJAMENTO E GESTÃO

# RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

# **CONSOLIDADO**

Período: maio de 2022

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Posição de Ativos e Enquadramento

**RENDA FIXA** **90,84%**

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	1,44	2,17	29.594.215,86	2,35
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	2,91	1,47	4,18	80.258.237,84	6,38
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	2,90	1,47	3,85	120.956.269,17	9,62
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	4,08	1,45	3,83	41.064.460,21	3,27
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	3,91	1,44	3,31	85.753.481,92	6,82
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	4,02	1,46	2,19	70.879.454,05	5,64
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	4,12	1,47	4,19	81.331.753,20	6,47
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>0,73</b>	<b>1,46</b>	<b>4,16</b>	<b>509.837.872,25</b>	<b>40,55</b>

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	0,93	3,91	253.069.173,97	20,13	5.274.375.201,05	4,80
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,64	0,76	6,16	21.537.528,68	1,71	12.390.634.636,61	0,17
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,70	0,85	6,17	21.514.653,93	1,71	11.182.665.779,99	0,19
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,58	0,59	1,80	2.394.243,97	0,19	712.575.451,32	0,34
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,24	0,89	5,94	203.321.377,06	16,17	2.159.396.684,37	9,42
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	6,51	1,12	4,60	29.783.914,39	2,37	225.244.392,78	13,22
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2,93	0,89	5,58	12.316.885,24	0,98	1.254.589.044,69	0,98
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>1,95</b>	<b>0,94</b>	<b>4,75</b>	<b>543.937.777,24</b>	<b>43,26</b>		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2022

### 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	0,20	1,08	4,49	50.669.078,73	4,03	12.704.053.440,98	0,40
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,17	1,04	2,48	8.507.124,59	0,68	11.392.702.156,84	0,07
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,79	1,27	4,86	29.168.392,48	2,32	907.582.694,19	3,21
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,91</b>	<b>1,14</b>	<b>3,81</b>	<b>88.344.595,80</b>	<b>7,03</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>1,90</b>	<b>1,17</b>	<b>5,04</b>	<b>1.142.120.245,29</b>	<b>90,84</b>		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2022

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### RENDÁ VARIÁVEL

3,44%

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	24,84	-3,13	-12,68	13.637.598,68	1,08	156.764.123,27	8,70
BB	BB	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	21,88	2,22	2,97	10.641.751,52	0,85	123.390.859,59	8,62
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	26,52	-1,92	-3,80	7.542.948,41	0,60	748.259.041,27	1,01
BB	BB	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	19,80	2,12	-5,35	11.482.051,80	0,91	246.112.620,61	4,67
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>21,15</b>	<b>-0,27</b>	<b>-5,70</b>	<b>43.304.350,41</b>	<b>3,44</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>17,41</b>	<b>-0,27</b>	<b>-5,70</b>	<b>43.304.350,41</b>	<b>3,44</b>		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2022

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,57%

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	20,04	-4,44	-28,42	19.722.528,74	1,57	2.266.073.116,40	0,87
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>20,04</b>	<b>-4,44</b>	<b>-28,42</b>	<b>19.722.528,74</b>	<b>1,57</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>20,04</b>	<b>-4,44</b>	<b>-28,42</b>	<b>19.722.528,74</b>	<b>1,57</b>		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2022

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

4,15%

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	18,44	1,03	-6,89	27.933.625,08	2,22	433.262.043,95	6,45
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	18,35	0,97	-10,62	24.223.495,35	1,93	2.423.271.241,40	1,00
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>24,24</b>	<b>1,00</b>	<b>-10,65</b>	<b>52.157.120,43</b>	<b>4,15</b>		
<b>Investimentos Estruturados</b>			<b>24,24</b>	<b>1,00</b>	<b>-10,65</b>	<b>52.157.120,43</b>	<b>4,15</b>		
<b>Total</b>			<b>2,77</b>	<b>1,01</b>	<b>2,92</b>	<b>1.257.304.244,87</b>	<b>100,00</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	509.837.872,25	40,55	0,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	543.937.777,24	43,26	0,00	29,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	88.344.595,80	7,03	0,00	10,00	60,00	0,00	60,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>1.142.120.245,29</b>	<b>90,84</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	43.304.350,41	3,44	0,00	5,00	30,00	0,00	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>43.304.350,41</b>	<b>3,44</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	19.722.528,74	1,57	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>19.722.528,74</b>	<b>1,57</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	52.157.120,43	4,15	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>52.157.120,43</b>	<b>4,15</b>					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	1,46 141,50	4,16 176,29				7.391.595,17	17.600.632,15
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,94 91,61	4,75 109,32	3,58 127,35	5,63 109,56	6,59 83,49	5.999.452,16	33.851.455,53
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,14 110,94	3,81 87,79	2,61 92,86			957.400,63	4.657.961,82
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-0,27 -3,49	-5,70 -11,93	-4,78 -3,20			-118.377,17	-2.467.416,00
Artigo 9º III % do CDI	-4,44 -430,35	-28,42 -654,28	-14,62 -519,25	-27,20 -529,17	-14,82 -187,70	-915.717,19	-7.831.173,19
Artigo 10º I % do CDI	1,00 97,24	-10,65 -245,17	-3,60 -128,01			517.733,60	-7.290.831,86
<b>CONSOLIDADO (Total)</b>						<b>13.832.087,20</b>	<b>38.520.628,45</b>

**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%)	30.007.038,28	0,00	0,00	841.448,41	29.594.215,86	428.625,99	642.470,25
NTN-B 150535 (5,909200%)	81.414.441,30	0,00	0,00	2.337.356,70	80.258.237,84	1.181.153,24	3.305.512,60
NTN-B 150545 (5,900200%)	122.683.166,31	0,00	0,00	3.506.035,05	120.956.269,17	1.779.137,91	4.599.724,50
NTN-B 150832 (5,763300%)	40.475.832,79	0,00	0,00	0,00	41.064.460,21	588.627,42	1.514.191,18
NTN-B 150860 (5,599600%)	84.535.664,12	0,00	0,00	0,00	85.753.481,92	1.217.817,80	2.745.822,64
NTN-B 150860 (5,788000%)	69.862.013,28	0,00	0,00	0,00	70.879.454,05	1.017.440,77	1.519.306,44
NTN-B 150860 (5,959200%)	80.152.961,16	0,00	0,00	0,00	81.331.753,20	1.178.792,04	3.273.604,54
					509.837.872,25	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	12.208.658,11	0,00	0,00	0,00	12.316.885,24	108.227,13	651.967,72



Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2022

### 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	201.532.397,98	0,00	0,00	0,00	203.321.377,06	1.788.979,08	11.430.268,96
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.454.473,00	0,00	0,00	0,00	29.783.914,39	329.441,39	1.307.307,28
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.332.648,87	0,00	0,00	0,00	21.514.653,93	182.005,06	2.837.579,39
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.374.093,56	0,00	0,00	0,00	21.537.528,68	163.435,12	1.583.462,36
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	342.764.947,60	262.702.072,85	-355.811.194,36	0,00	253.069.173,97	3.413.347,88	13.568.756,61
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.380.227,47	0,00	0,00	0,00	2.394.243,97	14.016,50	42.288,40
					543.937.777,24	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	1.769.190,34	6.684.840,15	0,00	0,00	8.507.124,59	53.094,10	881.719,00
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	50.129.445,19	0,00	0,00	0,00	50.669.078,73	539.633,54	2.741.170,07
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	28.803.719,49	0,00	0,00	0,00	29.168.392,48	364.672,99	1.351.238,53
					88.344.595,80	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	14.077.560,51	0,00	0,00	0,00	13.637.598,68	-439.961,83	-1.980.936,75
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	11.243.644,43	0,00	0,00	0,00	11.482.051,80	238.407,37	-678.364,60
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	10.410.985,10	0,00	0,00	0,00	10.641.751,52	230.766,42	489.544,67
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	7.690.537,54	0,00	0,00	0,00	7.542.948,41	-147.589,13	-297.659,32
					43.304.350,41	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	20.638.245,93	0,00	0,00	0,00	19.722.528,74	-915.717,19	-7.831.173,19
					19.722.528,74	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2022

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	27.649.400,95	0,00	0,00	0,00	27.933.625,08	284.224,13	-2.066.374,92
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	23.989.985,88	0,00	0,00	0,00	24.223.495,35	233.509,47	-4.760.455,90
					52.157.120,43	0,00	0,00

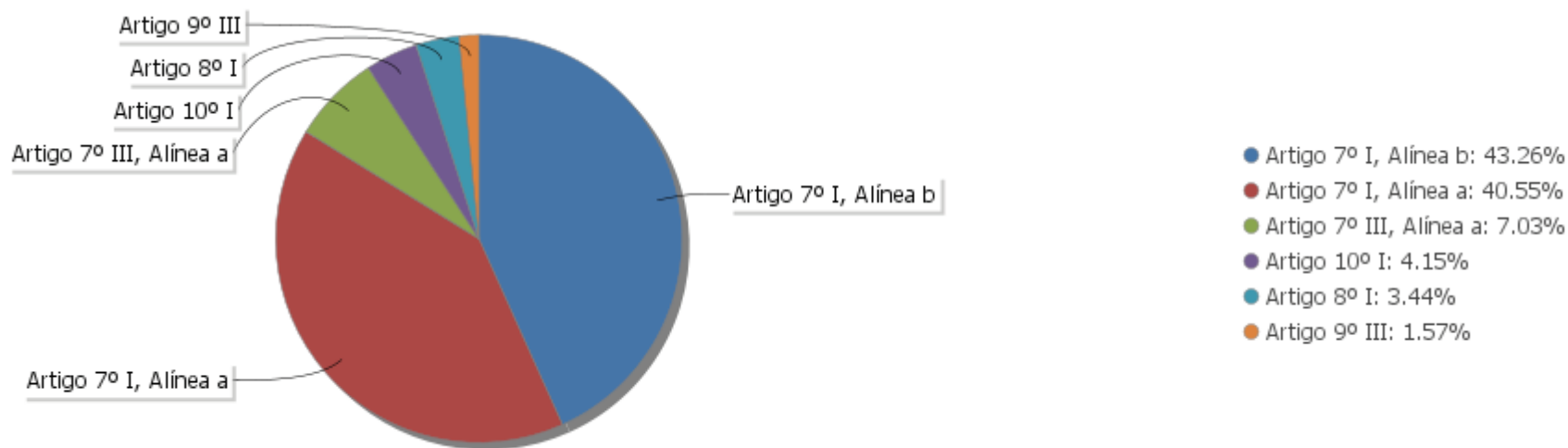
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Liquidez

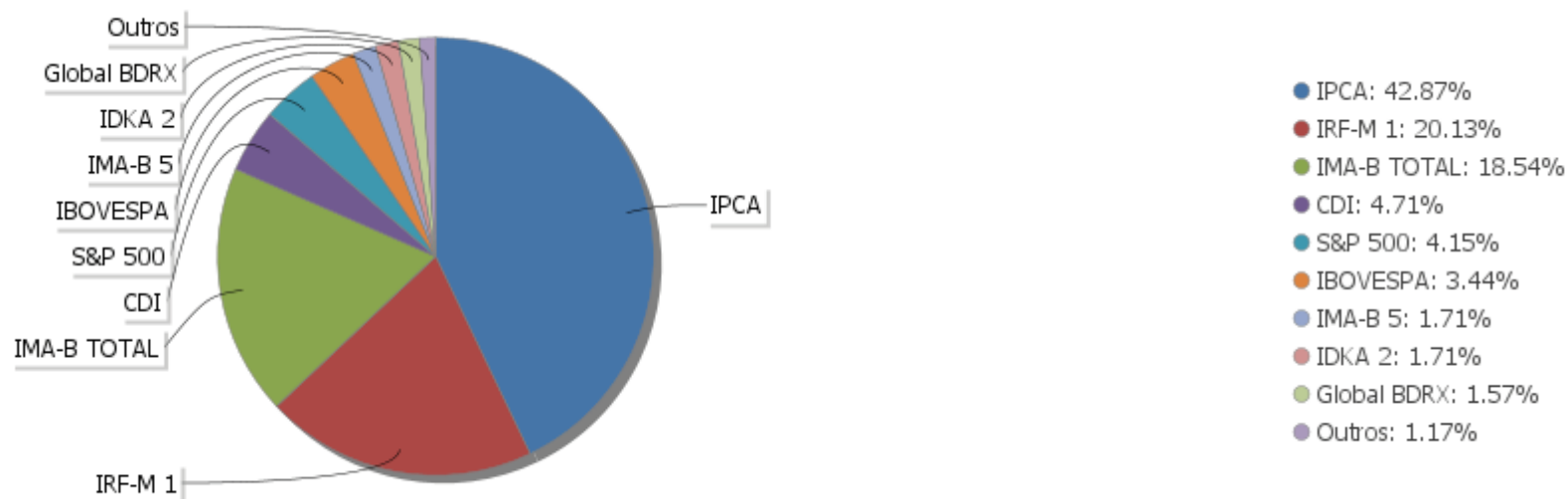
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	502.044.195,93	39,93	502.044.195,93	39,93
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	502.044.195,93	39,93
acima de 365 dias	755.260.048,94	60,07	1.257.304.244,87	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

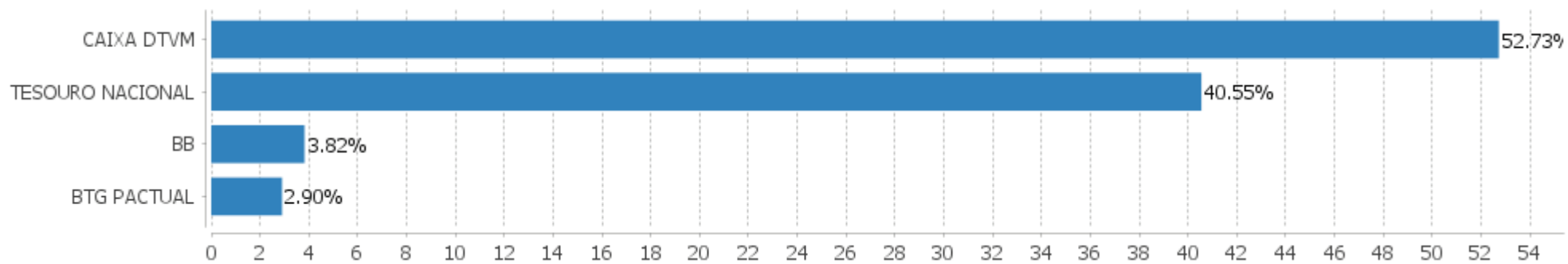


Alocação Por Estratégia



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Gestor



Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2022

## 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								2,92
IPCA + 4,00%	0,87	1,31	1,97	1,36	0,81								6,48
p.p. indexador	-1,18	-0,98	-0,33	-1,13	0,20								-3,56
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

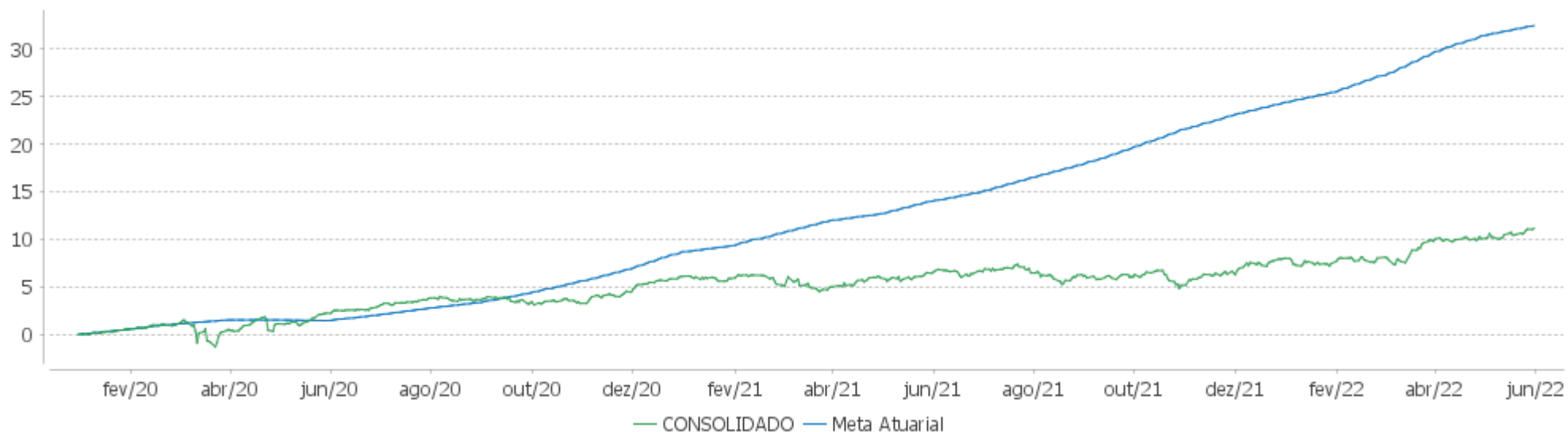
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	8	27,59
Meses abaixo - Meta Atuarial	21	72,41
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,64	2022-03
Menor rentabilidade da Carteira	-0,80	2021-10

### Relatório

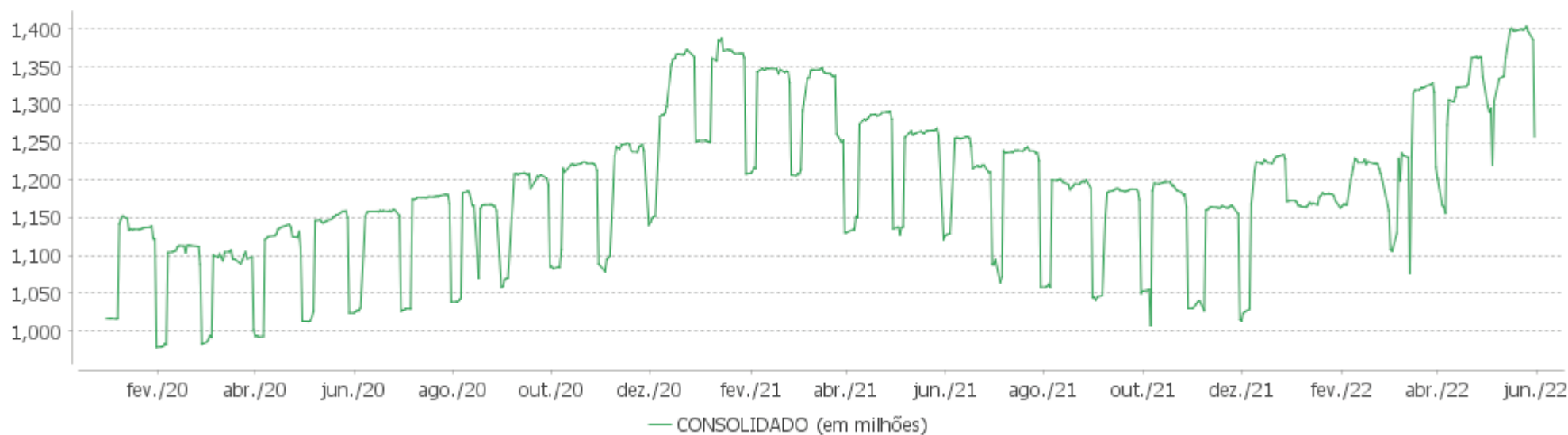
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,90	4,20	-1,30	2,85
06 meses	4,41	7,45	-3,04	2,74
12 meses	4,43	14,87	-10,44	2,77
24 meses	8,73	27,88	-19,15	2,50
Desde 31/12/2019	11,14	29,59	-18,45	2,97

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

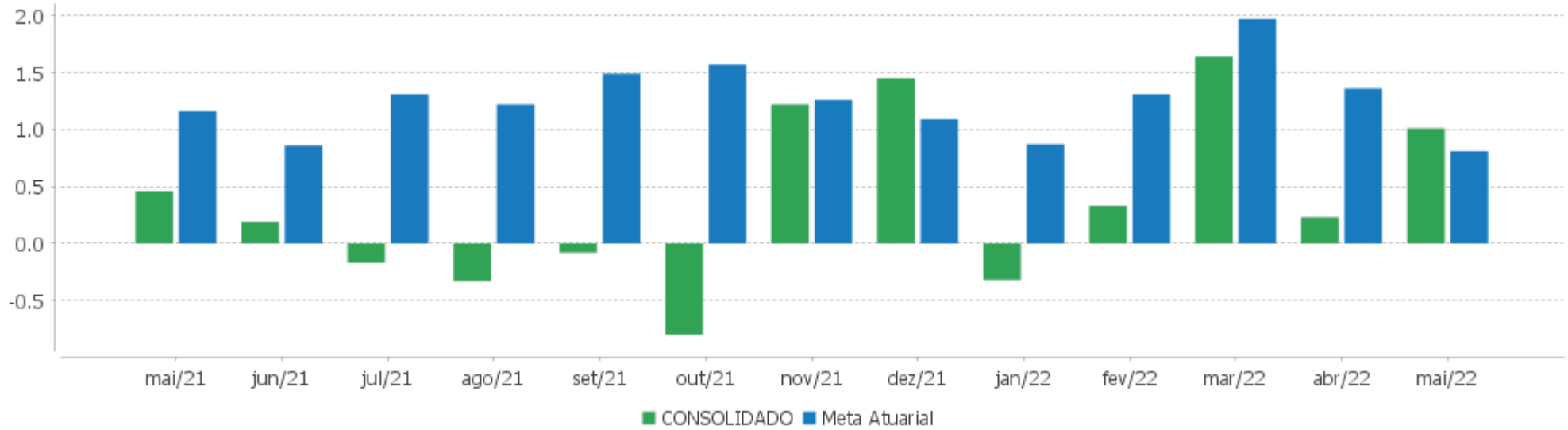


Patrimônio Líquido



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
BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	1,04 100,46	4,31 99,30	2,73 96,93	5,09 99,09	7,89 99,91	9,35 91,29	14,42 92,31
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	1,08 104,41	4,49 103,32	2,83 100,55	5,28 102,65	8,37 106,04	10,69 104,34	15,39 98,47
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	1,27 0,80	4,86 0,07	3,06 -0,12	5,64 0,09	4,95 -6,78	7,95 -12,79	
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	1,44 0,97	7,41 2,62	5,04 1,86	8,76 3,21	15,09 3,36	23,38 2,65	25,71 2,71
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	1,47 1,00	7,52 2,74	5,11 1,93	8,91 3,36	15,31 3,58	23,76 3,03	26,23 3,23
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	1,45 0,98	4,43 -0,35	5,07 1,89	5,76 0,21	11,94 0,21	20,05 -0,69	22,35 -0,65
NTN-B 150860 (5,599600%) Var. IPCA p.p.	1,44 0,97	4,49 -0,29	5,03 1,85	5,81 0,26	12,03 0,30	20,24 -0,49	22,64 -0,36
NTN-B 150545 (5,900200%) Var. IPCA p.p.	1,47 1,00	7,52 2,73	5,10 1,92	8,90 3,35	15,32 3,59	23,79 3,05	26,28 3,28
NTN-B 150860 (5,788000%) Var. IPCA p.p.	1,46 0,99	4,49 -0,30	5,08 1,90	5,82 0,27	12,06 0,33	20,29 -0,44	22,72 -0,28
NTN-B 150860 (5,959200%) Var. IPCA p.p.	1,47 1,00	4,48 -0,31	5,12 1,94	5,83 0,28	12,08 0,35	20,34 -0,39	22,78 -0,22
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,76 -0,02	6,16 -0,10	4,96 -0,06	6,97 -0,12	9,31 -0,24	17,06 -0,59	27,78 -1,00
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,89 -0,08	5,94 1,21	4,86 -0,07	6,84 1,87	8,56 3,96	15,62 1,44	29,71 7,90
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,85 0,00	6,17 -0,17	4,95 -0,02	6,94 -0,29	9,11 -0,13	17,79 -0,70	27,49 -1,70
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,12 0,15	4,60 -0,12	5,68 0,75	5,31 0,35	5,55 0,96	13,42 -0,76	19,37 -2,44
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,89 -0,01	5,52 -0,61	4,86 0,41				
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,93 -0,02	3,91 -0,11	2,54 -0,07	4,79 -0,14	6,18 -0,25	8,19 -0,48	14,80 -0,74
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,59	1,80	1,27	3,70	1,47	1,97	13,22

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2022

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

<b>Fundo</b> <b>Variação da Estratégia</b>	<b>No Mês</b>	<b>No Ano</b>	<b>3 meses</b>	<b>6 meses</b>	<b>12 meses</b>	<b>24 meses</b>	<b>36 meses</b>
Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,01	-0,02	-0,03	-0,03	-0,14	-0,36	-0,68
<b>FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO</b>	<b>-1,92</b>	<b>-3,80</b>	<b>-2,40</b>	<b>0,29</b>	<b>-27,69</b>	<b>10,89</b>	<b>8,25</b>
Var. IBOVESPA p.p.	-5,14	-10,02	-0,82	-8,97	-15,91	-16,51	-6,51
<b>BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI</b>	<b>2,22</b>	<b>2,97</b>	<b>1,31</b>	<b>9,39</b>	<b>-10,68</b>	<b>44,24</b>	<b>43,33</b>
Var. IBOVESPA p.p.	-1,00	-3,26	2,89	0,13	1,09	16,84	28,57
<b>BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI</b>	<b>2,12</b>	<b>-5,35</b>	<b>-1,91</b>	<b>2,36</b>	<b>-11,98</b>	<b>49,51</b>	<b>48,94</b>
Var. IBOVESPA p.p.	-1,10	-11,58	-0,33	-6,89	-0,20	22,11	34,18
<b>BB AÇÕES CONSUMO FIC</b>	<b>-3,13</b>	<b>-12,68</b>	<b>-12,35</b>	<b>-12,72</b>	<b>-37,89</b>	<b>-21,84</b>	<b>-15,59</b>
Var. IBOVESPA p.p.	-6,35	-18,91	-10,77	-21,98	-26,12	-49,24	-30,35
<b>FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I</b>	<b>-4,44</b>	<b>-28,42</b>	<b>-14,62</b>	<b>-27,20</b>	<b>-14,82</b>	<b>13,58</b>	<b>74,74</b>
Var. Global BDRX p.p.	-0,12	-0,24	-0,09	-0,25	-1,78	-3,06	-4,50
<b>CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP</b>	<b>0,97</b>	<b>-10,62</b>	<b>-3,59</b>	<b>-5,65</b>	<b>4,99</b>	<b>42,87</b>	<b>57,03</b>
Var. S&P 500 p.p.	4,83	15,92	9,69	18,22	16,16	24,59	-23,15
<b>BTG PACTUAL S&amp;P 500 BRL FI MULTIMERCADO</b>	<b>1,03</b>	<b>-10,49</b>	<b>-3,53</b>	<b>-5,59</b>	<b>5,46</b>	<b>45,44</b>	
Var. S&P 500 p.p.	4,89	16,04	9,75	18,28	16,62	27,15	
<b>CONSOLIDADO</b>	<b>1,01</b>	<b>2,92</b>	<b>2,90</b>	<b>4,41</b>	<b>4,43</b>	<b>8,73</b>	
Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,20	-3,56	-1,30	-3,23	-11,77	-21,84	
CDI	1,03	4,34	2,81	5,14	7,89	10,24	15,63
IBOVESPA	3,22	6,23	-1,58	9,26	-11,78	27,40	14,76
INPC + 6,00%	0,96	7,49	4,75	8,85	18,61	36,88	48,04
IPCA + 6,00%	0,98	7,31	4,69	8,67	18,43	35,62	46,43

**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	0,95	4,02	2,61	4,93	6,43	8,67	15,54	23,85	33,97
IRF-M 1+	0,39	0,65	0,67	2,95	-0,89	-1,17	12,32	30,13	44,56
IRF-M TOTAL	0,58	1,82	1,31	3,74	1,60	2,33	13,90	29,08	42,46
IMA-B 5	0,78	6,25	5,02	7,09	9,55	17,65	28,78	45,80	60,12
IMA-B 5+	1,16	3,17	4,84	2,82	-0,25	10,41	15,02	52,46	63,45
IMA-B TOTAL	0,96	4,73	4,93	4,96	4,59	14,18	21,81	50,71	63,86
IMA-GERAL TOTAL	0,92	4,04	3,06	4,94	5,26	9,68	18,01	34,24	46,62
IDKA 2	0,85	6,35	4,97	7,23	9,24	18,49	29,19	44,76	60,19
IDKA 20	1,21	0,35	3,98	-1,94	-10,01	4,21	1,84	54,09	61,61
CDI	1,03	4,34	2,81	5,14	7,89	10,24	15,63	22,99	32,44

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,22	6,23	-1,58	9,26	-11,78	27,40	14,76	45,08	77,56
IBRX 100	3,23	6,61	-1,68	9,95	-12,43	29,27	17,73	50,94	83,12
IBRX 50	3,30	6,74	-2,55	10,76	-11,91	31,55	16,59	45,38	78,31
SMALL CAP	-1,82	-4,02	-2,10	-0,37	-26,87	15,36	13,41	44,72	71,86
IFIX	0,26	0,56	2,89	9,39	0,14	6,12	10,49	27,39	37,13
Índice Consumo - ICON	-3,02		-12,01	-12,30	-36,86	-19,27	-13,06	7,05	10,44
Índice Dividendos - IDIV	4,26	14,16	8,74	15,99	2,41	41,18	33,41	82,88	105,54

## 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	0,47	4,78	3,18	5,55	11,73	20,73	23,00	28,73	32,40
INPC	0,45	4,96	3,23	5,73	11,90	21,85	24,35	30,30	32,59
IGPM	0,52	7,54	3,71	8,47	10,72	51,73	61,61	73,96	81,38
SELIC	1,03	4,34	2,81	5,14	7,89	10,24	15,63	23,00	32,46

### 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	-3,86	-26,53	-13,29	-23,87	-11,17	18,29	80,18	91,96	149,78
MSCI ACWI	-3,99	-26,71	-14,01	-24,39	-17,07	11,67	59,19	61,99	105,20

### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,81	6,48	4,20	7,64	16,20	30,56	38,31	50,52	60,94
IPCA + 5,00%	0,90	6,90	4,45	8,16	17,32	33,08	42,33	56,38	68,79
IPCA + 5,50%	0,94	7,10	4,57	8,41	17,88	34,35	44,37	59,37	72,83
IPCA + 5,89%	0,97	7,26	4,67	8,61	18,31	35,34	45,97	61,73	76,03
IPCA + 6,00%	0,98	7,31	4,69	8,67	18,43	35,62	46,43	62,40	76,94
INPC + 4,00%	0,79	6,66	4,25	7,82	16,37	31,77	39,83	52,36	61,17
INPC + 6,00%	0,96	7,49	4,75	8,85	18,61	36,88	48,04	64,38	77,19

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Movimentações**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1559	02/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.867.225,33	3.932.292,77539600	2,7635850000
1522	02/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.343,68	0,00	1.933,60435800	2,7635850000
1533	02/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	721.647,70	261.127,37621100	2,7635850000
1513	02/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	27.589.113,31	9.983.088,38403400	2,7635850000
1561	03/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.392.342,40	1.588.874,11722600	2,7644370000
1560	03/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	574.730,22	0,00	207.901,36291700	2,7644370000
1536	03/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	302.550,82	109.443,91867800	2,7644370000
1523	03/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.630,82	0,00	4.207,30152200	2,7644370000
1535	03/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.799.853,19	2.821.497,89703500	2,7644370000
1534	03/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.416.652,24	0,00	1.235.930,58550400	2,7644370000
1514	03/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	92.406,12	33.426,74045900	2,7644370000
1563	04/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.994,08	5.058,17165900	2,7666280000
1562	04/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.739,75	0,00	5.689,14577600	2,7666280000
1537	04/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	32.410,99	0,00	11.714,97939000	2,7666280000
1524	04/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.982,51	0,00	2.162,38323300	2,7666280000
1565	05/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	303.083,07	109.580,24484700	2,7658550000
1564	05/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	66.968,97	0,00	24.212,75518700	2,7658550000
1525	05/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.414,88	0,00	511,55248500	2,7658550000
1539	05/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	87.632.968,06	31.683.861,97238700	2,7658550000
1538	05/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.559.802,13	0,00	5.987.227,14314300	2,7658550000
1567	06/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.311.600,22	4.089.423,95981300	2,7660620000
1566	06/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.195.740,16	0,00	7.301.260,83941700	2,7660620000
1541	06/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	30.665.294,03	11.086.264,16470500	2,7660620000
1540	06/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	101.045.158,98	0,00	36.530.330,47704600	2,7660620000
1516	06/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	15.938.317,98	5.762.097,15371100	2,7660620000
1515	06/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	21.457.922,84	0,00	7.757.571,17519400	2,7660620000
1568	09/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.626.872,24	0,00	4.200.594,68675100	2,7679110000
1542	09/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.231.045,37	0,00	7.309.138,68617800	2,7679110000

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1569	10/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.323,47	0,00	1.200,04260700	2,7694600000
1543	10/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.409.808,18	0,00	509.055,25987000	2,7694600000
1526	10/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.651,66	0,00	1.318,54585300	2,7694600000
1571	11/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	36.983,42	13.350,60543100	2,7701680000
1570	11/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	36.983,42	0,00	13.350,60545000	2,7701680000
1544	11/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	71.826,06	25.928,41170800	2,7701680000
1527	11/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	116.086,30	0,00	41.905,86996800	2,7701680000
1528	12/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	42.612,71	0,00	15.379,20262000	2,7708010000
1545	12/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.103,70	3.646,48988600	2,7708010000
1573	13/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	217,94	78,62795200	2,7717710000
1572	13/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.924,66	0,00	1.055,15931800	2,7717710000
1547	13/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	18.854,34	6.802,27187900	2,7717710000
1546	13/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	519.213,11	0,00	187.321,79173500	2,7717710000
1517	13/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.799.753,12	0,00	7.504.138,37218100	2,7717710000
1558	16/05/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	6.684.840,15	0,00	1.992.295,80014600	3,3553452000
1575	16/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	570.787,19	205.785,77790900	2,7736960000
1574	16/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	37.755.090,48	0,00	13.611.834,34666236	2,7736960000
1548	16/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	570.787,19	205.785,77796600	2,7736960000
1518	16/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	570.787,19	205.785,77818200	2,7736960000
1529	17/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.089,43	0,00	2.194,11561600	2,7753460000
1530	18/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.225,50	0,00	441,30865000	2,7769680000
1577	19/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	41.299,39	14.862,36985300	2,7787890000
1576	19/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	41.299,39	0,00	14.862,36990200	2,7787890000
1531	23/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.930,22	0,00	10.400,59045200	2,7815940000
1549	23/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.583,57	2.366,83311500	2,7815940000
1550	24/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	406,60	146,17732900	2,7815290000
1551	25/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.484,80	533,56330300	2,7828000000
1553	27/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.073.530,58	4.692.070,66785200	2,7863030000
1552	27/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.708.515,69	0,00	613.183,73845100	2,7863030000
1532	27/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.595,23	0,00	1.649,22120800	2,7863030000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2022

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1519	27/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.303.787,48	0,00	826.825,89797300	2,7863030000
1578	30/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.930,34	0,00	5.716,12594800	2,7869120000
1555	30/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.035.441,54	3.600.917,98322700	2,7869120000
1554	30/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	56.645,75	0,00	20.325,63281500	2,7869120000
1520	30/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	103.105,84	36.996,44606700	2,7869120000
1579	31/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	712.168,99	0,00	255.391,89767800	2,7885340000
1580	31/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	29.279.659,05	10.500.018,66583700	2,7885340000
1556	31/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.886.021,94	0,00	676.348,91308400	2,7885340000
1557	31/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	72.993.639,44	26.176.349,09239048	2,7885340000
1521	31/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	30.795.300,21	11.043.544,81737800	2,7885340000
<b>Total</b>			<b>269.386.913,00</b>	<b>355.811.194,36</b>		



Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2022

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 14.055.725,18

Value-At-Risk: 1,12%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		1,12	1,12			1.257.304.244,87	100,00

#### Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,44%

#### Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,634200%)		0,27	0,00	0,27			29.594.215,86	2,35
NTN-B 150535 (5,909200%)		0,26	0,00	0,27			80.258.237,84	6,38
NTN-B 150545 (5,900200%)		0,26	0,00	0,27			120.956.269,17	9,62
NTN-B 150832 (5,763300%)		0,40	-0,00	0,42			41.064.460,21	3,27
NTN-B 150860 (5,599600%)		0,39	-0,00	0,41			85.753.481,92	6,82
NTN-B 150860 (5,788000%)		0,39	-0,00	0,41			70.879.454,05	5,64
NTN-B 150860 (5,959200%)		0,40	-0,00	0,42			81.331.753,20	6,47
<b>Sub-total</b>	0,44	0,27	-0,00		0,96	1,46	509.837.872,25	40,55

#### Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,31	0,03	0,01			253.069.173,97	20,13
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,08	0,01	0,02			21.537.528,68	1,71
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,35	0,01	0,33			21.514.653,93	1,71
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,54	0,00	0,04			2.394.243,97	0,19
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,46	0,13	1,10			203.321.377,06	16,17
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		2,62	0,04	0,76			29.783.914,39	2,37
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		1,55	0,01	1,53			12.316.885,24	0,98
<b>Sub-total</b>	1,42	0,90	0,23		-0,06	0,94	543.937.777,24	43,26

#### Artigo 7º III, Alínea a

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,04	0,00	0,03			50.669.078,73	4,03
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI		0,03	0,00	0,02			8.507.124,59	0,68
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		0,47	0,00	0,50			29.168.392,48	2,32
<b>Sub-total</b>	0,82	0,16	0,00		0,14	1,14	88.344.595,80	7,03

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 13,32%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO		13,41	0,27	8,26			27.933.625,08	2,22
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		13,22	0,23	8,23			24.223.495,35	1,93
<b>Sub-total</b>	30,59	13,32	0,49		-0,00	1,00	52.157.120,43	4,15

Renda Variável

Value-At-Risk: 10,15%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		11,58	0,09	7,11			13.637.598,68	1,08
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI		10,72	0,07	3,41			10.641.751,52	0,85
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		12,89	0,06	7,69			7.542.948,41	0,60
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI		10,00	0,07	5,44			11.482.051,80	0,91
<b>Sub-total</b>	22,80	10,15	0,29		-0,06	-0,27	43.304.350,41	3,44

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 10,80%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		10,80	0,11	1,87			19.722.528,74	1,57
<b>Sub-total</b>	24,56	10,80	0,11		-0,22	-4,44	19.722.528,74	1,57