



RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

CONSOLIDADO

Período: setembro de 2022

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

91,63%

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	0,11	3,72	30.042.192,62	2,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	4,04	0,12	1,26	30.487.680,50	2,37
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	2,93	0,13	5,86	81.545.408,42	6,35
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	4,09	0,09	0,09	12.213.620,36	0,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	2,92	0,13	5,52	122.892.518,52	9,57
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	2,94	0,12	5,44	40.526.998,66	3,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	2,82	0,11	4,86	84.689.412,50	6,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	2,90	0,12	3,79	69.988.094,48	5,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	2,96	0,13	1,32	68.345.098,54	5,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	2,97	0,13	5,88	80.296.023,32	6,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	4,19	0,09	0,09	27.991.535,61	2,18
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,74	0,12	5,81	649.018.583,53	50,55

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,72	1,09	8,39	180.187.732,08	14,03	5.416.816.231,94	3,33
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,68	0,43	7,04	21.716.497,61	1,69	8.885.835.879,64	0,24

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

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 IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,92	0,16	6,15	0,00	0,00	8.482.726.221,67	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,72	1,37	6,84	2.512.898,08	0,20	930.421.879,82	0,27
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,20	0,49	6,18	197.719.192,45	15,40	2.902.138.561,58	6,81
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	6,58	1,18	5,64	29.267.020,49	2,28	221.335.375,02	13,22
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	3,01	0,49	5,79	11.995.287,16	0,93	2.223.594.947,35	0,54
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,86	0,84	7,27	443.398.627,87	34,53		

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
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,14	1,12	1,65	52.922.455,74	4,12	7.044.059.635,23	0,75
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,13	1,07	6,92	887.903,78	0,07	10.751.461.015,63	0,01
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,68	1,28	8,63	30.218.278,23	2,35	801.217.889,04	3,77
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,89	1,18	8,18	84.028.637,75	6,54		

Renda Fixa			1,54	0,53	7,31	1.176.445.849,15	91,63		
-------------------	--	--	-------------	-------------	-------------	-------------------------	--------------	--	--

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL3,16%

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	26,22	-1,21	-14,40	13.370.030,49	1,04	149.643.232,53	8,93
BB	BB	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	22,28	-1,22	-1,48	10.182.131,72	0,79	104.565.698,79	9,74
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	27,88	-1,94	-8,24	7.194.270,74	0,56	643.251.684,47	1,12
BB	BB	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	20,56	-5,00	-18,57	9.878.124,39	0,77	193.304.214,88	5,11
Sub-total Artigo 8º I			21,36	-2,29	-11,54	40.624.557,34	3,16		
Renda Variável			20,09	-2,29	-11,54	40.624.557,34	3,16		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR1,48%

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	22,78	-7,72	-30,97	19.021.029,89	1,48	2.057.509.929,37	0,92
Sub-total Artigo 9º III			22,78	-7,72	-30,97	19.021.029,89	1,48		
Investimentos no Exterior			22,78	-7,72	-30,97	19.021.029,89	1,48		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

3,73%

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	21,80	-5,01	-12,96	26.111.589,85	2,03	391.146.244,88	6,68
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	21,98	-8,62	-19,76	21.746.985,61	1,69	1.721.873.439,88	1,26
Sub-total Artigo 10º I			23,55	-6,69	-18,01	47.858.575,46	3,73		
Investimentos Estruturados			23,55	-6,69	-18,01	47.858.575,46	3,73		
Total			2,56	0,09	4,45	1.283.950.011,84	100,00		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	649.018.583,53	50,55	0,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	443.398.627,87	34,53	0,00	29,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	84.028.637,75	6,54	0,00	10,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	1.176.445.849,15	91,63					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	40.624.557,34	3,16	0,00	5,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	40.624.557,34	3,16					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	19.021.029,89	1,48	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	19.021.029,89	1,48					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	47.858.575,46	3,73	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	47.858.575,46	3,73					15,00
Total		1.283.950.011,84	100,00					

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

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	0,12 11,63	5,81 85,13	0,57 17,36	4,89 77,45		792.351,29	26.935.616,96
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,84 78,01	7,27 81,79	1,86 56,17	4,38 69,38	9,09 83,43	5.114.507,05	48.163.459,38
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,18 109,67	8,18 91,99	3,42 103,18	6,28 99,53		1.145.366,42	8.446.364,59
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-2,29 -2,76	-11,54 -16,51	9,57 -2,09	-15,58 -7,28		-950.634,84	-5.147.209,07
Artigo 9º III % do CDI	-7,72 -720,14	-30,97 -348,32	-4,35 -131,36	-14,12 -223,69	-22,81 -209,38	-1.591.229,34	-8.532.672,04
Artigo 10º I % do CDI	-6,69 -623,63	-18,01 -202,62	-0,48 -14,39	-15,41 -244,04		-3.428.637,22	-11.589.376,83
CONSOLIDADO (Total)						1.081.723,36	58.276.182,99

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%)	30.009.583,19	0,00	0,00	0,00	30.042.192,62	32.609,43	1.090.447,01
NTN-B 150535 (5,784900%)	30.450.989,66	0,00	0,00	0,00	30.487.680,50	36.690,84	380.736,24
NTN-B 150535 (5,909200%)	81.439.302,18	0,00	0,00	0,00	81.545.408,42	106.106,24	4.592.683,18
NTN-B 150535 (5,927000%)	0,00	12.202.674,82	0,00	0,00	12.213.620,36	10.945,54	10.945,54
NTN-B 150545 (5,900200%)	122.733.459,93	0,00	0,00	0,00	122.892.518,52	159.058,59	6.535.973,85
NTN-B 150832 (5,763300%)	40.478.915,63	0,00	0,00	0,00	40.526.998,66	48.083,03	2.150.730,58
NTN-B 150860 (5,599600%)	84.599.822,16	0,00	0,00	0,00	84.689.412,50	89.590,34	4.029.755,12
NTN-B 150860 (5,788000%)	69.903.693,61	0,00	0,00	0,00	69.988.094,48	84.400,87	2.623.748,49
NTN-B 150860 (5,949840%)	68.253.956,08	0,00	0,00	0,00	68.345.098,54	91.142,46	908.685,72
NTN-B 150860 (5,959200%)	80.188.334,04	0,00	0,00	0,00	80.296.023,32	107.689,28	4.585.876,56
NTN-B 150860 (5,986700%)	0,00	27.965.500,94	0,00	0,00	27.991.535,61	26.034,67	26.034,67
					649.018.583,53	0,00	0,00

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	11.937.355,34	0,00	0,00	0,00	11.995.287,16	57.931,82	677.799,68
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	196.759.153,44	0,00	0,00	0,00	197.719.192,45	960.039,01	11.900.228,49
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.926.477,92	0,00	0,00	0,00	29.267.020,49	340.542,57	1.602.301,25
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.476.475,51	0,00	-21.509.903,62	0,00	0,00	33.428,11	2.832.829,08
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.624.132,79	0,00	0,00	0,00	21.716.497,61	92.364,82	1.762.431,29
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	201.676.094,27	273.709.384,44	-298.794.100,31	0,00	180.187.732,08	3.596.353,68	26.797.102,27
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.479.051,04	0,00	0,00	0,00	2.512.898,08	33.847,04	160.942,51
					443.398.627,87	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\$)
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	52.338.855,10	0,00	0,00	0,00	52.922.455,74	583.600,64	856.671,26
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	19.366.911,94	21.509.903,62	-40.168.175,75	0,00	887.903,78	179.263,97	1.366.698,51
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	29.835.776,42	0,00	0,00	0,00	30.218.278,23	382.501,81	2.401.124,28
					84.028.637,75	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	13.533.133,24	0,00	0,00	0,00	13.370.030,49	-163.102,75	-2.248.504,94
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	10.397.957,37	0,00	0,00	0,00	9.878.124,39	-519.832,98	-2.282.292,01
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	10.307.789,46	0,00	0,00	0,00	10.182.131,72	-125.657,74	29.924,87
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	7.336.312,11	0,00	0,00	0,00	7.194.270,74	-142.041,37	-646.336,99
					40.624.557,34	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	20.612.259,23	0,00	0,00	0,00	19.021.029,89	-1.591.229,34	-8.532.672,04
					19.021.029,89	0,00	0,00

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

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	27.487.580,29	0,00	0,00	0,00	26.111.589,85	-1.375.990,44	-3.888.410,15
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	23.799.632,39	0,00	0,00	0,00	21.746.985,61	-2.052.646,78	-7.236.965,64
					47.858.575,46	0,00	0,00

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

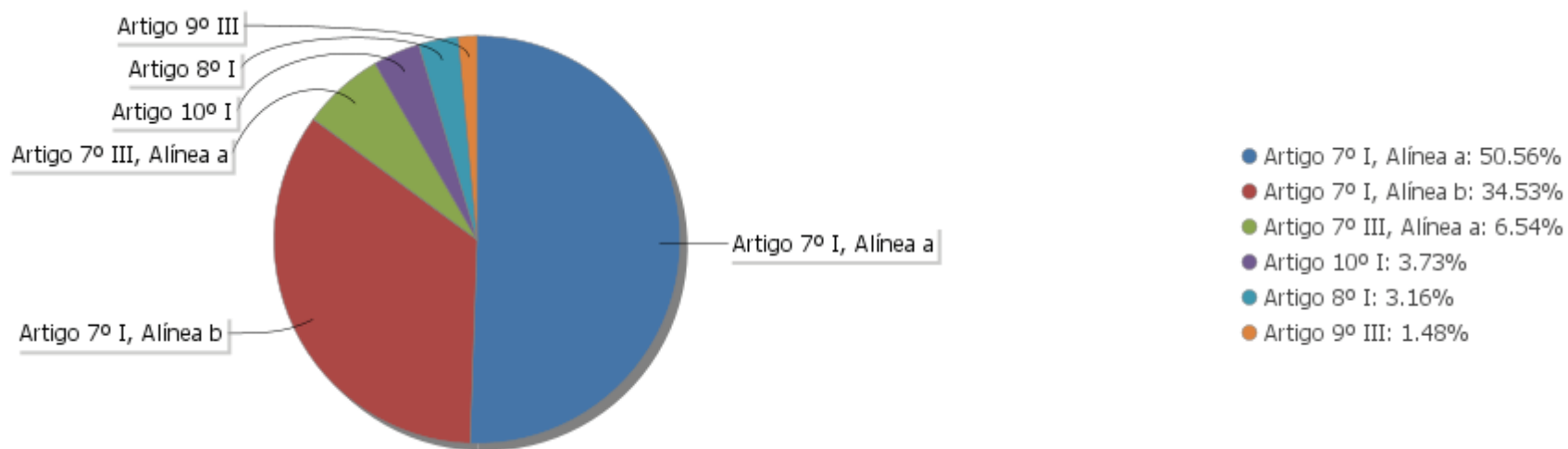
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	395.949.928,21	30,84	395.949.928,21	30,84
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	395.949.928,21	30,84
acima de 365 dias	888.000.083,63	69,16	1.283.950.011,84	100,00

Carteira: CONSOLIDADO

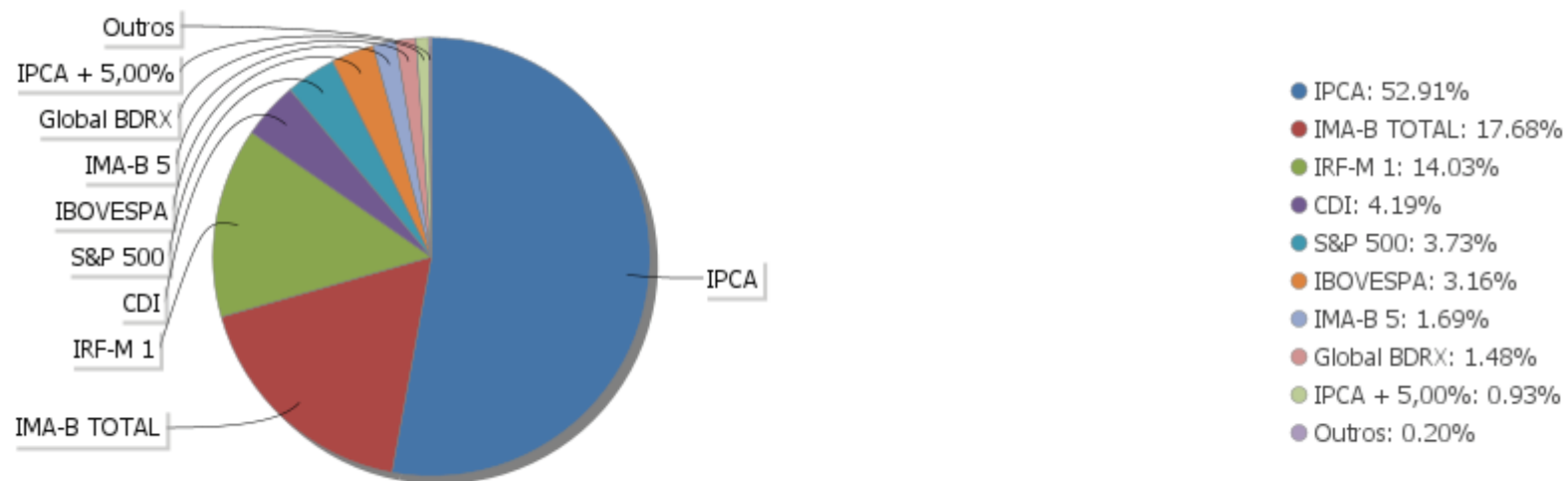
Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia

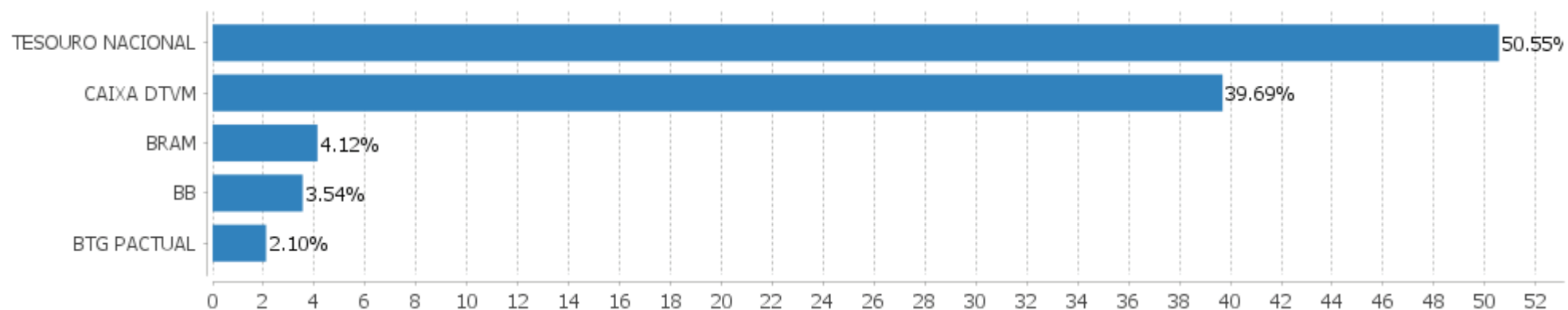


Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

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	0,09				4,45
IPCA + 4,00%	0,87	1,31	1,97	1,36	0,81	1,00	-0,35	-0,00	0,04				7,20
p.p. indexador	-1,18	-0,98	-0,33	-1,13	0,20	-1,01	1,40	0,37	0,05				-2,74
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

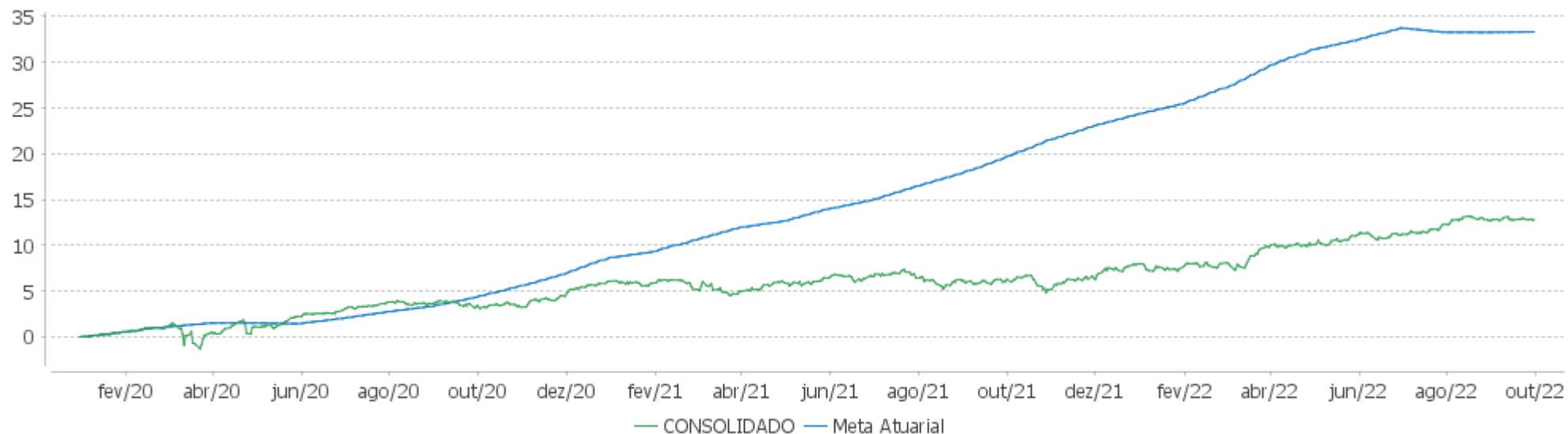
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

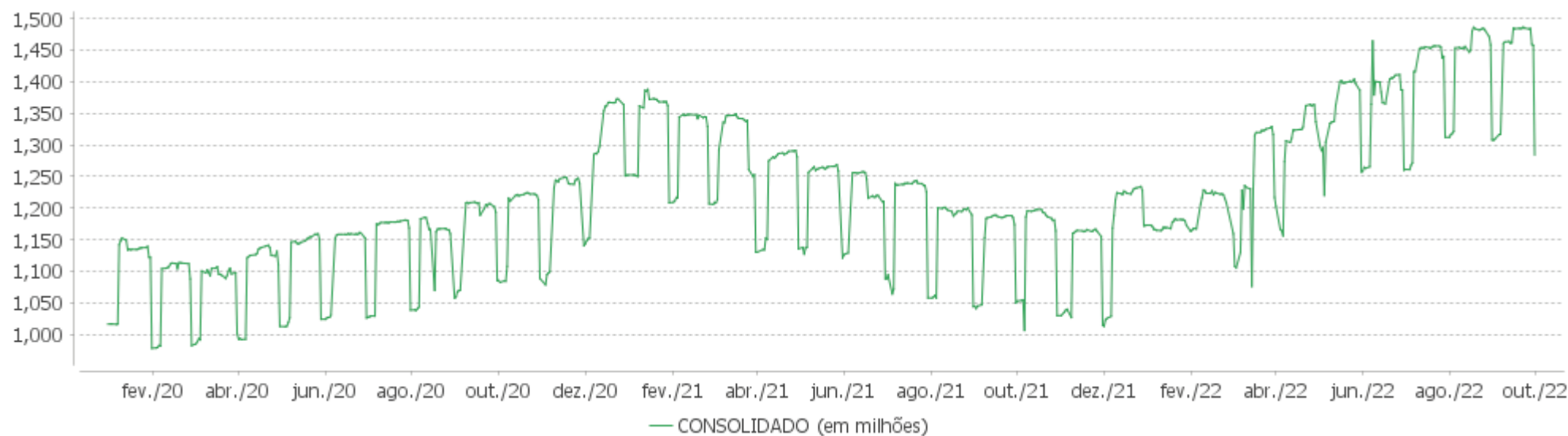
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	11	33,33	03 meses	1,51	-0,32	1,83	1,73
Meses abaixo - Meta Atuarial	22	66,67	06 meses	2,75	2,87	-0,13	2,03
			12 meses	6,40	10,92	-4,51	2,56
			24 meses	9,14	25,25	-16,11	2,51
Maior rentabilidade da Carteira	1,64	2022-03	Desde 31/12/2019	12,80	30,47	-17,66	2,85
Menor rentabilidade da Carteira	-0,80	2021-10					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Patrimônio Líquido

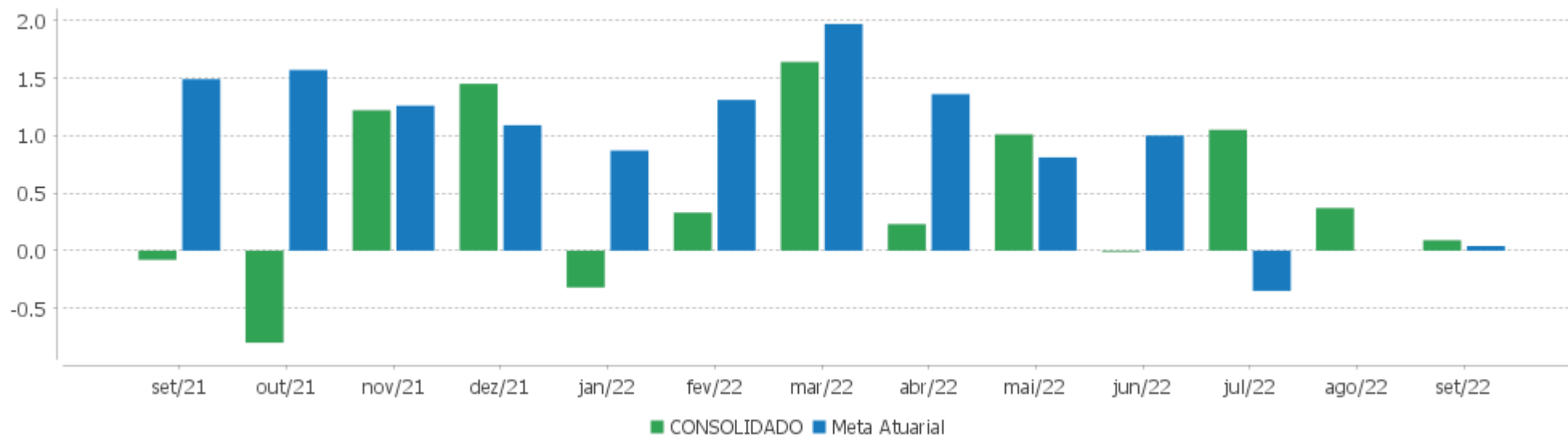


Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

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.	0,12 0,41	6,08 1,99	0,56 1,89	1,92 1,06	7,76 0,59	18,53 0,38	21,62 -0,23
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	0,11 0,40	9,03 4,94	0,53 1,85	4,80 3,94	10,77 3,60	21,75 3,61	24,86 3,01
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	0,13 0,42	9,24 5,15	0,59 1,92	4,94 4,08	10,98 3,81	22,13 3,98	25,38 3,53
NTN-B 150860 (5,986700%) Var. IPCA p.p.	0,14 0,43	3,15 -0,94	-2,26 -0,94	1,97 1,11	7,87 0,70	18,76 0,61	21,97 0,11
NTN-B 150860 (5,949840%) Var. IPCA p.p.	0,13 0,42	6,17 2,08	0,60 1,93	4,96 4,09	11,02 3,85	22,22 4,07	25,52 3,67
NTN-B 150860 (5,599600%) Var. IPCA p.p.	0,11 0,40	6,06 1,97	0,52 1,84	4,79 3,93	10,82 3,65	21,95 3,80	25,20 3,34
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	0,12 0,41	6,06 1,97	0,56 1,88	4,84 3,98	10,85 3,68	21,89 3,74	25,04 3,19
NTN-B 150545 (5,900200%) Var. IPCA p.p.	0,13 0,42	9,24 5,15	0,59 1,92	4,93 4,07	10,98 3,81	22,15 4,00	25,43 3,57
NTN-B 150860 (5,788000%) Var. IPCA p.p.	0,12 0,41	6,12 2,03	0,56 1,89	4,87 4,01	10,93 3,76	22,10 3,95	25,37 3,52
NTN-B 150535 (5,927000%) Var. IPCA p.p.	0,13 0,42	6,15 2,06	0,60 1,92	1,95 1,09	7,83 0,66	18,67 0,52	21,84 -0,01
NTN-B 150860 (5,959200%) Var. IPCA p.p.	0,13 0,42	6,17 2,08	0,61 1,93	4,97 4,11	11,03 3,86	22,23 4,08	25,53 3,68
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,43 0,00	7,04 -0,03	0,50 0,06	3,16 0,02	9,15 -0,10	15,36 -0,39	23,34 -0,79
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,49 -0,99	6,18 0,06	0,00 -1,70	2,38 -0,78	8,34 1,09	13,62 1,32	22,33 7,67
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,18 -0,30	5,64 -0,48	1,05 -0,65	2,98 -0,17	7,91 0,67	11,11 -1,19	14,18 -0,48
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,51 -0,11	6,53 -0,41	0,11 0,02	2,60 -0,34	8,47 -0,45	14,89 -0,79	23,34 -1,60
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	1,09 -0,02	8,39 -0,20	3,37 -0,07	6,04 -0,13	9,57 -0,25	12,03 -0,52	16,89 -0,78
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,49	5,73	-0,02	2,35			

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,37	-1,46	0,06	-1,02			
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,37	6,84	4,60	5,39	7,88	6,53	13,25
Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,03	-0,12	-0,07	-0,14	-0,13	-0,38	-0,68
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	1,12	9,35	3,44	6,62	11,58	15,22	18,56
% do CDI	104,02	105,17	103,94	104,79	106,31	107,12	101,56
BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	1,07	8,83	3,28	6,21	10,84	13,78	17,09
% do CDI	99,40	99,34	99,19	98,31	99,51	96,98	93,51
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,28	8,63	3,51	5,91	10,29	11,11	
Var. IPCA p.p.	1,57	4,54	4,84	5,05	3,12	-7,04	
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-1,94	-8,24	13,94	-14,26	-18,90	-7,59	-11,45
Var. IBOVESPA p.p.	-2,41	-13,22	2,27	-5,95	-18,05	-23,90	-16,50
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	-5,00	-18,57	0,52	-18,86	-21,43	11,90	20,19
Var. IBOVESPA p.p.	-5,47	-23,55	-11,14	-10,56	-20,58	-4,41	15,14
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	-1,22	-1,48	9,84	-9,14	-5,32	22,72	23,02
Var. IBOVESPA p.p.	-1,69	-6,45	-1,82	-0,83	-4,47	6,41	17,97
BB AÇÕES CONSUMO FIC	-1,21	-14,40	14,63	-18,52	-28,67	-31,13	-31,76
Var. IBOVESPA p.p.	-1,67	-19,37	2,96	-10,22	-27,82	-47,44	-36,81
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-7,72	-30,97	-4,35	-14,12	-22,81	-8,72	47,15
Var. Global BDRX p.p.	0,66	-0,19	0,03	0,08	-0,54	-2,81	-3,67
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-8,62	-19,76	-2,65	-17,23	-9,27	18,60	28,89
Var. S&P 500 p.p.	-3,27	7,36	-0,42	-7,55	8,00	16,41	-27,50
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	-5,01	-16,33	1,41	-13,84	-5,35	24,97	
Var. S&P 500 p.p.	0,35	10,78	3,64	-4,16	11,91	22,78	
CONSOLIDADO	0,09	4,45	1,51	2,75	6,40	9,14	
Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,05	-2,74	1,83	-0,13	-5,05	-18,63	
CDI	1,07	8,89	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28
IBOVESPA	0,47	4,97	11,66	-8,30	-0,85	16,31	5,05
INPC + 6,00%	0,17	8,98	0,27	3,88	13,62	33,40	46,90
IPCA + 6,00%	0,20	8,74	0,17	3,87	13,60	32,72	45,10

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES CONSUMO FIC	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI			D+0	D+0		
BRADESCO FI 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
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		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

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	1,11	8,59	3,43	6,17	9,81	12,55	17,67	26,42	34,96
IRF-M 1+	1,58	6,25	5,47	5,41	7,24	3,87	11,78	35,04	42,24
IRF-M TOTAL	1,40	6,96	4,66	5,53	8,01	6,91	13,92	33,10	40,74
IMA-B 5	0,42	7,07	0,43	3,14	9,25	15,75	24,13	43,24	52,60
IMA-B 5+	2,39	5,10	3,01	3,14	5,19	8,56	6,75	54,62	53,36
IMA-B TOTAL	1,48	6,12	1,70	3,16	7,25	12,30	14,67	50,64	54,48
IMA-GERAL TOTAL	1,26	7,80	3,17	5,13	9,24	11,95	16,81	36,41	43,76
IDKA 2	0,62	6,94	0,09	2,94	8,91	15,68	24,94	40,99	52,99
IDKA 20	5,00	3,97	6,75	3,59	0,98	3,03	-6,12	61,55	50,87
CDI	1,07	8,89	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28	25,70	34,07

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,47	4,97	11,66	-8,30	-0,85	16,31	5,05	38,69	48,11
IBRX 100	-0,05	4,43	10,77	-9,10	-1,33	16,26	6,28	43,30	51,68
IBRX 50	0,48	5,31	11,70	-8,80	0,58	19,15	7,21	38,32	48,42
SMALL CAP	-1,84	-8,06	14,47	-13,82	-18,43	-5,58	-7,27	45,86	34,71
IFIX	0,49	6,63	6,98	7,58	10,13	7,01	11,42	40,10	34,66
Índice Consumo - ICON	-1,18		15,08	-17,92	-27,77	-28,97	-29,71	8,70	-9,15
Índice Dividendos - IDIV	-1,80	9,21	4,42	-5,43	7,21	28,20	15,63	76,72	67,29

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

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	-0,29	4,09	-1,32	0,86	7,17	18,15	21,85	25,38	31,05
INPC	-0,32	4,32	-1,23	0,87	7,19	18,75	23,37	26,97	32,02
IGPM	-0,95	6,61	-1,43	1,07	8,25	35,16	59,40	64,77	81,31
SELIC	1,07	8,89	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28	25,70	34,08

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-5,36	-27,11	-2,23	-9,68	-17,26	2,19	56,39	66,16	142,89
MSCI ACWI	-5,78	-28,97	-4,29	-11,25	-22,48	-6,15	37,99	42,53	93,97

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,04	7,20	-0,32	2,87	11,46	27,77	37,05	46,63	59,32
IPCA + 5,00%	0,12	7,97	-0,07	3,37	12,53	30,23	41,03	52,34	67,10
IPCA + 5,50%	0,16	8,35	0,05	3,62	13,06	31,48	43,06	55,26	71,10
IPCA + 5,89%	0,19	8,65	0,14	3,81	13,48	32,45	44,65	57,56	74,27
IPCA + 6,00%	0,20	8,74	0,17	3,87	13,60	32,72	45,10	58,22	75,18
INPC + 4,00%	0,01	7,43	-0,22	2,89	11,48	28,42	38,75	48,49	60,50
INPC + 6,00%	0,17	8,98	0,27	3,88	13,62	33,40	46,90	60,23	76,47

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1803	01/09/2022	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	19.328.827,95	0,00	5.548.802,35058400	3,4834234000
1789	01/09/2022	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	21.509.903,62	8.076.550,30875200	2,6632538400
1768	01/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	21.737,38	7.549,60984200	2,8792712000
1767	01/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.475,17	0,00	9.195,09423000	2,8792712000
1804	02/09/2022	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	2.181.075,67	0,00	625.796,90074600	3,4852772000
1790	05/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.265.398,67	0,00	439.004,67523100	2,8824264100
1769	05/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.432.361,39	0,00	1.884.648,77061600	2,8824264100
1757	05/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	405,00	0,00	140,50662200	2,8824264100
1749	05/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4,04	0,00	1,40159600	2,8824264100
1791	06/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.846,03	0,00	3.415,50862700	2,8827419500
1770	06/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.083.874,57	0,00	722.879,33021500	2,8827419500
1792	08/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	35.045.878,38	0,00	12.150.776,68404300	2,8842500600
1793	08/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.165.322,27	2.831.003,58777600	2,8842500600
1771	08/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	148.438.833,73	0,00	51.465.313,56230600	2,8842500600
1758	08/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.198,29	0,00	762,17039200	2,8842500600
1772	08/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	44.685.082,09	15.492.790,55402100	2,8842500600
1750	08/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.292.113,94	0,00	8.075.622,24337700	2,8842500600
1751	08/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.157.400,41	4.215.099,30035700	2,8842500600
1794	09/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.218,32	0,00	4.926,36748300	2,8861671500
1774	09/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.421,07	1.878,29347200	2,8861671500
1773	09/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	45.972,90	0,00	15.928,70322800	2,8861671500
1759	12/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.852,20	0,00	5.490,39623200	2,8872597400
1775	13/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.137.203,53	0,00	393.742,66937000	2,8881897200
1805	14/09/2022	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	971.122,69	277.656,22393700	3,4975722000
1811	14/09/2022	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	2.188.769,84	625.796,89991800	3,4975722000
1810	14/09/2022	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	19.407.336,84	5.548.802,34924000	3,4975722000
1809	14/09/2022	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	6.943.664,50	1.985.281,24737400	3,4975722000
1808	14/09/2022	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	350.962,46	100.344,59331500	3,4975722000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1807	14/09/2022	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	9.962.397,12	2.848.374,97278800	3,4975722000
1806	14/09/2022	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	343.922,30	98.331,72278700	3,4975722000
1795	14/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.660,22	2.650,82442200	2,8897498200
1812	14/09/2022	NTN-B 150535 (5,927000%)	12.202.674,82	0,00	3.000,00000000	4.067,5582730000
1813	14/09/2022	NTN-B 150860 (5,986700%)	27.965.500,94	0,00	7.000,00000000	3.995,0715630000
1796	15/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.364,02	0,00	1.509,64813600	2,8907530800
1760	15/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.203,56	0,00	2.491,93196300	2,8907530800
1776	15/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	97.641,68	0,00	33.777,24672300	2,8907530800
1752	15/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.968.814,70	0,00	8.291.546,88646000	2,8907530800
1797	16/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	656.094,60	226.860,14924400	2,8920663300
1777	16/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	238.417,81	0,00	82.438,56910400	2,8920663300
1761	16/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	60.909,66	0,00	21.060,94848700	2,8920663300
1754	16/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	664.398,82	229.731,52815200	2,8920663300
1753	16/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.609,26	0,00	1.247,98659000	2,8920663300
1798	19/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	106.620,44	0,00	36.845,49791300	2,8937169000
1779	19/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	664.618,68	229.676,46890700	2,8937169000
1778	19/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	109.719,90	0,00	37.916,59785300	2,8937169000
1799	20/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	80,91	27,94499200	2,8952811500
1762	20/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.777,31	0,00	9.248,60440500	2,8952811500
1780	20/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	14.424,45	4.982,05501500	2,8952811500
1763	21/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	99.919,85	0,00	34.485,06847400	2,8974815600
1781	21/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	90.119,34	31.102,64444900	2,8974815600
1782	22/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.092,07	721,43204300	2,8998827200
1764	22/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.259,53	0,00	2.503,38744700	2,8998827200
1783	23/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.038,20	357,83449900	2,9013369700
1765	26/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	454,80824700	2,9023220400
1800	28/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	236,29	81,32312000	2,9055612900
1784	28/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.743.465,83	0,00	600.044,41689100	2,9055612900
1785	28/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	27.007.186,04	9.294.997,88318009	2,9055612900
1766	29/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.773,84	0,00	5.769,94073300	2,9071078500

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1786	29/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	46.357,20	0,00	15.946,15762100	2,9071078500
1802	30/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	36.104.811,58	12.412.868,30823800	2,9086598426
1801	30/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.445.832,22	0,00	1.184.680,36748900	2,9086598500
1788	30/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	118.958.298,01	40.897.975,06229544	2,9086598500
1787	30/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.949.662,21	0,00	7.202.513,62839800	2,9086598500
1756	30/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	49.588.077,88	17.048.427,94669900	2,9086598500
1755	30/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.964.079,26	0,00	2.050.456,07515700	2,9086598500
Total			335.387.463,82	360.472.179,68		

Carteira: CONSOLIDADO	Data Extrato: 30/09/2022
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS	

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%				Value-At-Risk (R\$): 13.068.457,30		Value-At-Risk: 1,02%	
	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		1,02	1,02			1.283.950.011,84	100,00
Renda Fixa						Value-At-Risk: 0,41%	

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,634200%)		0,19	0,00	0,17			30.042.192,62	2,34
NTN-B 150535 (5,784900%)		0,29	-0,00	0,33			30.487.680,50	2,37
NTN-B 150535 (5,909200%)		0,19	0,00	0,17			81.545.408,42	6,35
NTN-B 150535 (5,927000%)		0,29	-0,00	0,34			12.213.620,36	0,95
NTN-B 150545 (5,900200%)		0,19	0,00	0,17			122.892.518,52	9,57
NTN-B 150832 (5,763300%)		0,19	0,00	0,17			40.526.998,66	3,16
NTN-B 150860 (5,599600%)		0,19	0,00	0,17			84.689.412,50	6,60
NTN-B 150860 (5,788000%)		0,19	0,00	0,17			69.988.094,48	5,45
NTN-B 150860 (5,949840%)		0,19	0,00	0,17			68.345.098,54	5,32
NTN-B 150860 (5,959200%)		0,19	0,00	0,17			80.296.023,32	6,25
NTN-B 150860 (5,986700%)		0,29	-0,00	0,32			27.991.535,61	2,18
Sub-total	0,30	0,17	0,00		-3,16	0,12	649.018.583,53	50,55

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		0,17	0,01	0,01			180.187.732,08	14,03
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,14	0,01	0,04			21.716.497,61	1,69
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,68	0,00	0,02			2.512.898,08	0,20
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,60	0,13	1,52			197.719.192,45	15,40

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		2,92	0,03	0,83			29.267.020,49	2,28
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		1,60	0,01	1,60			11.995.287,16	0,93
Sub-total	1,55	1,01	0,19		-0,15	0,84	443.398.627,87	34,53

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,01	-0,00	0,01			52.922.455,74	4,12
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI		0,01	-0,00	0,01			887.903,78	0,07
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		1,46	0,01	1,48			30.218.278,23	2,35
Sub-total	0,69	0,52	0,01		0,15	1,18	84.028.637,75	6,54

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 13,40%

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		13,61	0,24	8,44			26.111.589,85	2,03
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		13,40	0,20	7,87			21.746.985,61	1,69
Sub-total	22,27	13,40	0,44		-0,35	-6,69	47.858.575,46	3,73

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		11,41	0,09	7,82			13.370.030,49	1,04
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI		12,33	0,07	3,79			10.182.131,72	0,79
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		12,23	0,06	7,17			7.194.270,74	0,56
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI		10,38	0,06	4,37			9.878.124,39	0,77
Sub-total	23,74	10,58	0,28		-0,14	-2,29	40.624.557,34	3,16

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 11,01%

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2022

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		11,01	0,09	2,09			19.021.029,89	1,48
Sub-total	20,19	11,01	0,09		-0,44	-7,72	19.021.029,89	1,48