



RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

CONSOLIDADO

Período: outubro de 2022

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/10/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

92,98%

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	0,53	4,27	30.202.433,63	2,27
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	4,04	0,54	1,82	30.653.750,94	2,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	2,92	0,55	6,44	81.997.294,36	6,17
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	4,11	0,56	0,65	12.281.468,64	0,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	2,91	0,55	6,10	123.572.683,89	9,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	2,93	0,54	6,02	40.747.128,04	3,07
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	2,82	0,53	5,42	85.138.891,34	6,41
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	2,89	0,55	4,35	70.369.557,99	5,29
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	2,96	0,56	1,88	68.725.909,50	5,17
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	2,96	0,56	6,47	80.744.008,64	6,07
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	4,19	0,56	0,65	28.148.277,13	2,12
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,71	0,55	6,39	652.581.404,10	49,10

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	0,51	0,99	9,45	230.652.495,32	17,35	5.646.338.902,14	4,08
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,43	1,43	8,57	0,00	0,00	8.449.071.998,91	0,00

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/10/2022

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 IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,24	0,63	7,52	0,00	0,00	989.148.437,52	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,92	1,89	8,19	201.464.576,05	15,16	3.200.270.776,09	6,30
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	6,31	1,06	6,77	29.578.630,54	2,23	223.691.964,46	13,22
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2,92	1,89	7,79	12.222.356,40	0,92	2.426.875.574,48	0,50
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,65	1,31	8,68	473.918.058,31	35,65		

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	0,12	1,07	2,74	106.015.035,53	7,98	7.181.883.753,28	1,48
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,12	1,02	8,01	3.413.503,47	0,26	10.893.075.392,79	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,69	0,74	9,44	0,00	0,00	839.190.192,11	0,00
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,86	0,98	9,24	109.428.539,00	8,23		
Renda Fixa			1,21	0,91	8,29	1.235.928.001,41	92,98		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/10/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL1,65%

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	26,82	5,91	-9,33	14.160.735,68	1,07	157.170.946,00	9,01
BB	BB	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	22,04	6,50	4,93	0,00	0,00	90.894.867,63	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	27,33	7,11	-1,72	7.705.866,75	0,58	685.388.293,76	1,12
BB	BB	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	20,91	6,67	-13,14	0,00	0,00	193.461.245,42	0,00
Sub-total Artigo 8º I			22,32	8,48	-4,04	21.866.602,43	1,65		
Renda Variável			21,35	8,48	-4,04	21.866.602,43	1,65		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/10/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR1,46%

Artigo 9º III (Fundos de 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	24,16	1,70	-29,79	19.344.959,03	1,46	2.030.078.847,62	0,95
Sub-total Artigo 9º III			24,16	1,70	-29,79	19.344.959,03	1,46		
Investimentos no Exterior			24,16	1,70	-29,79	19.344.959,03	1,46		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/10/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 3,92%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	22,87	8,84	-5,26	28.420.773,91	2,14	403.547.884,46	7,04
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	23,03	8,77	-12,72	23.654.737,96	1,78	1.767.351.817,15	1,34
Sub-total Artigo 10º I			24,03	8,81	-10,79	52.075.511,87	3,92		
Investimentos Estruturados			24,03	8,81	-10,79	52.075.511,87	3,92		
Total			2,40	1,36	5,87	1.329.215.074,74	100,00		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/10/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

Ativo	Valor (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	21.380.752,60
Sub-total Disponibilidades Financeiras	21.380.752,60
Total	1.350.595.827,34

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/10/2022

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	652.581.404,10	49,10	0,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	473.918.058,31	35,65	0,00	29,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	109.428.539,00	8,23	0,00	10,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	1.235.928.001,41	92,98					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	21.866.602,43	1,65	0,00	5,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	21.866.602,43	1,65					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	19.344.959,03	1,46	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	19.344.959,03	1,46					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	52.075.511,87	3,92	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	52.075.511,87	3,92					15,00
Total		1.329.215.074,74	100,00					

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/10/2022

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	0,55 53,78	6,39 80,74	0,64 19,54	3,63 55,71		3.562.820,57	30.498.437,53
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,31 128,53	8,68 86,78	2,94 89,06	4,73 72,70	11,60 100,92	7.883.328,04	56.046.787,42
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,98 95,80	9,24 92,34	3,53 106,97	6,43 98,73		844.606,40	9.290.970,99
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	8,48 3,02	-4,04 -14,74	12,15 -0,33	1,49 -6,08		2.622.797,69	-2.524.411,38
Artigo 9º III % do CDI	1,70 166,85	-29,79 -297,86	-9,82 -298,04	-6,27 -96,27	-29,23 -254,37	323.929,14	-8.208.742,90
Artigo 10º I % do CDI	8,81 863,27	-10,79 -107,88	-1,70 -51,44	0,84 12,97		4.216.936,41	-7.372.440,42
CONSOLIDADO (Total)						19.454.418,25	77.730.601,24

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%)	30.042.192,62	0,00	0,00	0,00	30.202.433,63	160.241,01	1.250.688,02
NTN-B 150535 (5,784900%)	30.487.680,50	0,00	0,00	0,00	30.653.750,94	166.070,44	546.806,68
NTN-B 150535 (5,909200%)	81.545.408,42	0,00	0,00	0,00	81.997.294,36	451.885,94	5.044.569,12
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.213.620,36	0,00	0,00	0,00	12.281.468,64	67.848,28	78.793,82
NTN-B 150545 (5,900200%)	122.892.518,52	0,00	0,00	0,00	123.572.683,89	680.165,37	7.216.139,22
NTN-B 150832 (5,763300%)	40.526.998,66	0,00	0,00	0,00	40.747.128,04	220.129,38	2.370.859,96
NTN-B 150860 (5,599600%)	84.689.412,50	0,00	0,00	0,00	85.138.891,34	449.478,84	4.479.233,96
NTN-B 150860 (5,788000%)	69.988.094,48	0,00	0,00	0,00	70.369.557,99	381.463,51	3.005.212,00
NTN-B 150860 (5,949840%)	68.345.098,54	0,00	0,00	0,00	68.725.909,50	380.810,96	1.289.496,68
NTN-B 150860 (5,959200%)	80.296.023,32	0,00	0,00	0,00	80.744.008,64	447.985,32	5.033.861,88
NTN-B 150860 (5,986700%)	27.991.535,61	0,00	0,00	0,00	28.148.277,13	156.741,52	182.776,19
					652.581.404,10	0,00	0,00

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/10/2022

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	11.995.287,16	0,00	0,00	0,00	12.222.356,40	227.069,24	904.868,92
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	197.719.192,45	0,00	0,00	0,00	201.464.576,05	3.745.383,60	15.645.612,09
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.267.020,49	0,00	0,00	0,00	29.578.630,54	311.610,05	1.913.911,30
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.716.497,61	0,00	-22.026.572,14	0,00	0,00	310.074,53	2.072.505,82
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	180.187.732,08	223.723.583,02	-176.532.185,77	0,00	230.652.495,32	3.273.365,99	30.070.468,26
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.512.898,08	0,00	-2.528.722,71	0,00	0,00	15.824,63	176.767,14
					473.918.058,31	0,00	0,00

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	52.922.455,74	52.482.379,49	0,00	0,00	106.015.035,53	610.200,30	1.466.871,56
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	887.903,78	2.515.265,86	0,00	0,00	3.413.503,47	10.333,83	1.377.032,34
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	30.218.278,23	0,00	-30.442.350,50	0,00	0,00	224.072,27	2.625.196,55
					109.428.539,00	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	13.370.030,49	0,00	0,00	0,00	14.160.735,68	790.705,19	-1.457.799,75
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	9.878.124,39	0,00	-10.536.899,44	0,00	0,00	658.775,05	-1.623.516,96
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	10.182.131,72	0,00	-10.843.853,16	0,00	0,00	661.721,44	691.646,31
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	7.194.270,74	0,00	0,00	0,00	7.705.866,75	511.596,01	-134.740,98
					21.866.602,43	0,00	0,00

Artigo 9º III (Fundos de 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	19.021.029,89	0,00	0,00	0,00	19.344.959,03	323.929,14	-8.208.742,90
					19.344.959,03	0,00	0,00

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/10/2022

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	26.111.589,85	0,00	0,00	0,00	28.420.773,91	2.309.184,06	-1.579.226,09
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	21.746.985,61	0,00	0,00	0,00	23.654.737,96	1.907.752,35	-5.329.213,29
					52.075.511,87	0,00	0,00

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/10/2022

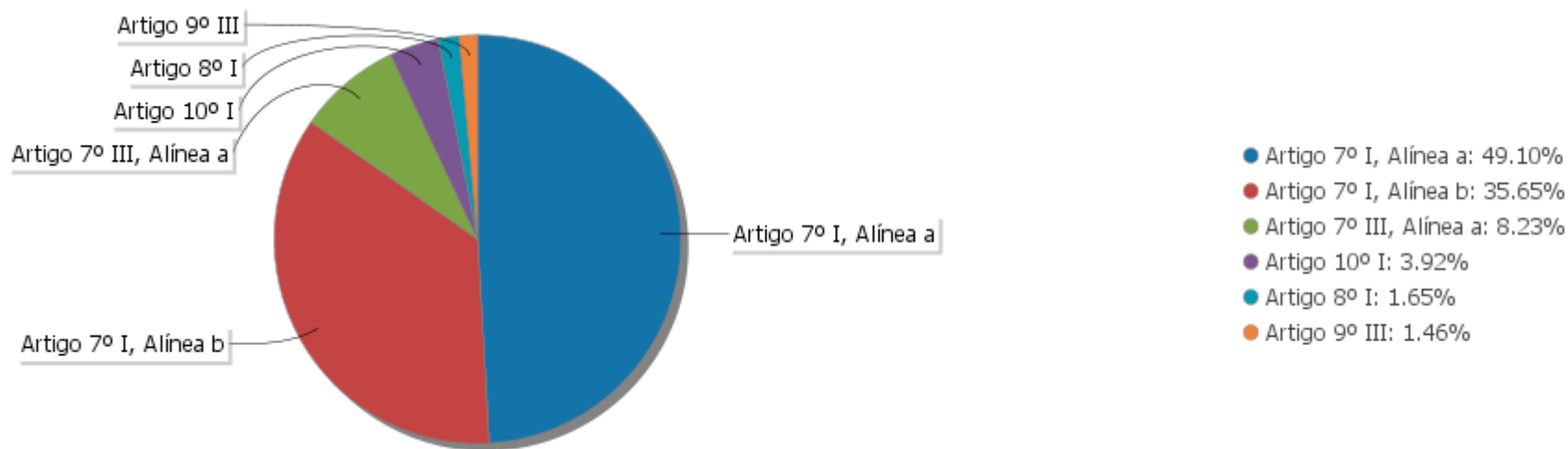
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

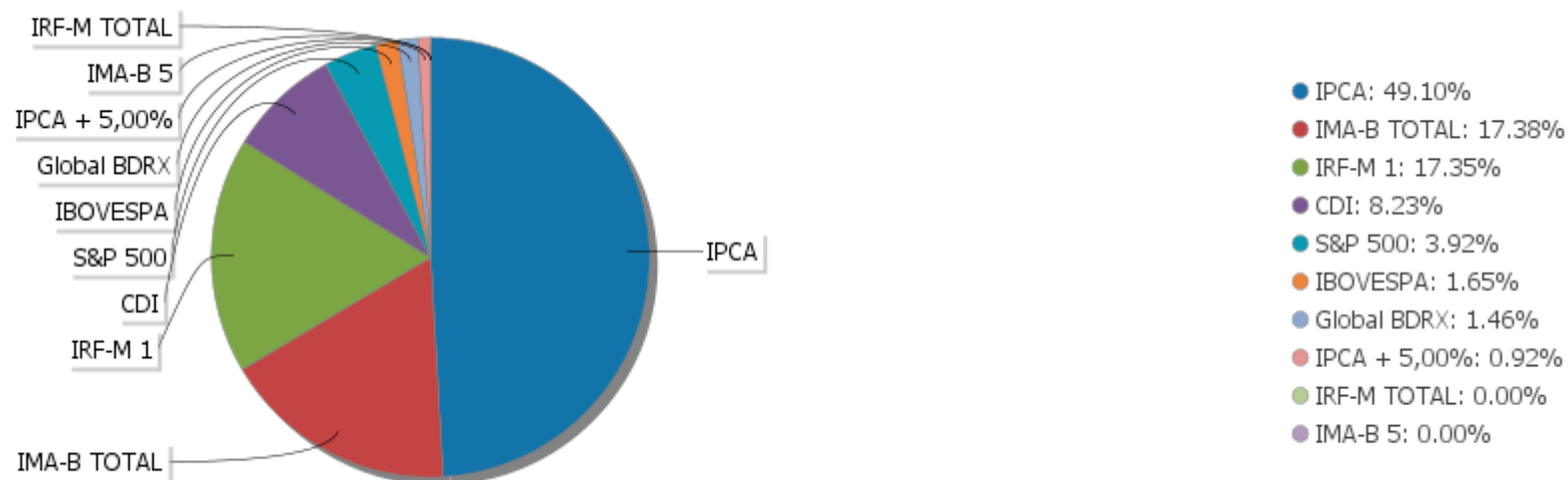
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	433.368.107,65	32,60	433.368.107,65	32,60
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	433.368.107,65	32,60
acima de 365 dias	895.846.967,09	67,40	1.329.215.074,74	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia

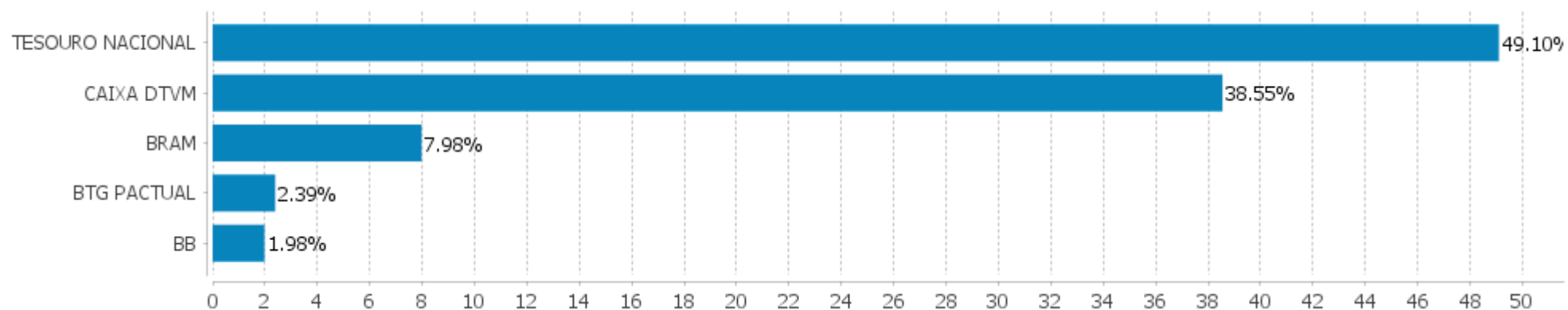


Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/10/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/10/2022

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	1,36			5,87
IPCA + 4,00%	0,87	1,31	1,97	1,36	0,81	1,00	-0,35	-0,00	0,04	0,90			8,17
p.p. indexador	-1,18	-0,98	-0,33	-1,13	0,20	-1,01	1,40	0,37	0,05	0,45			-2,29
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

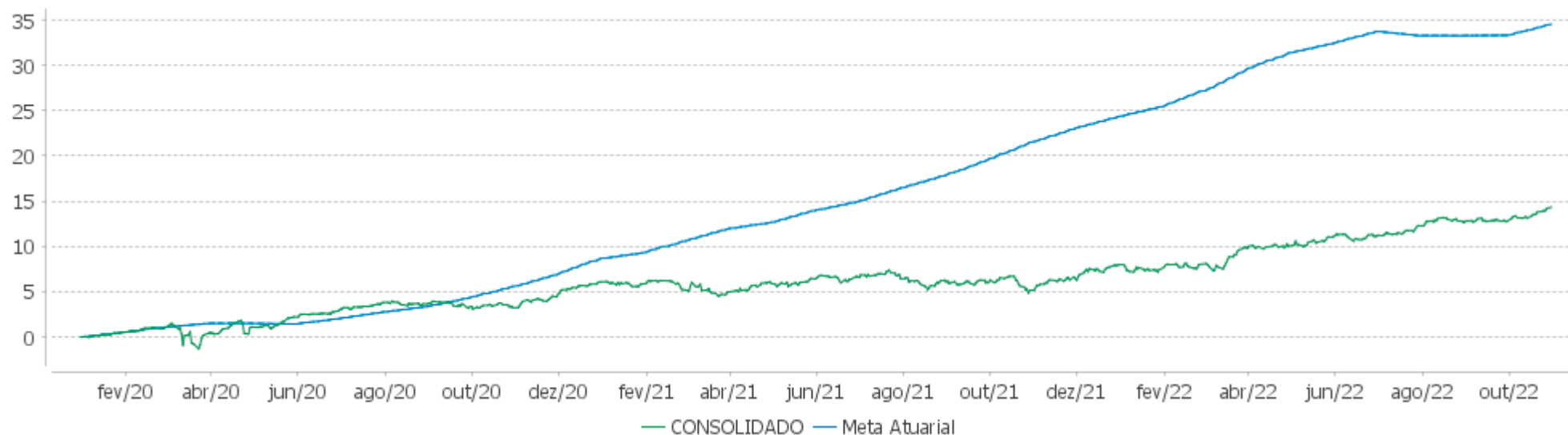
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

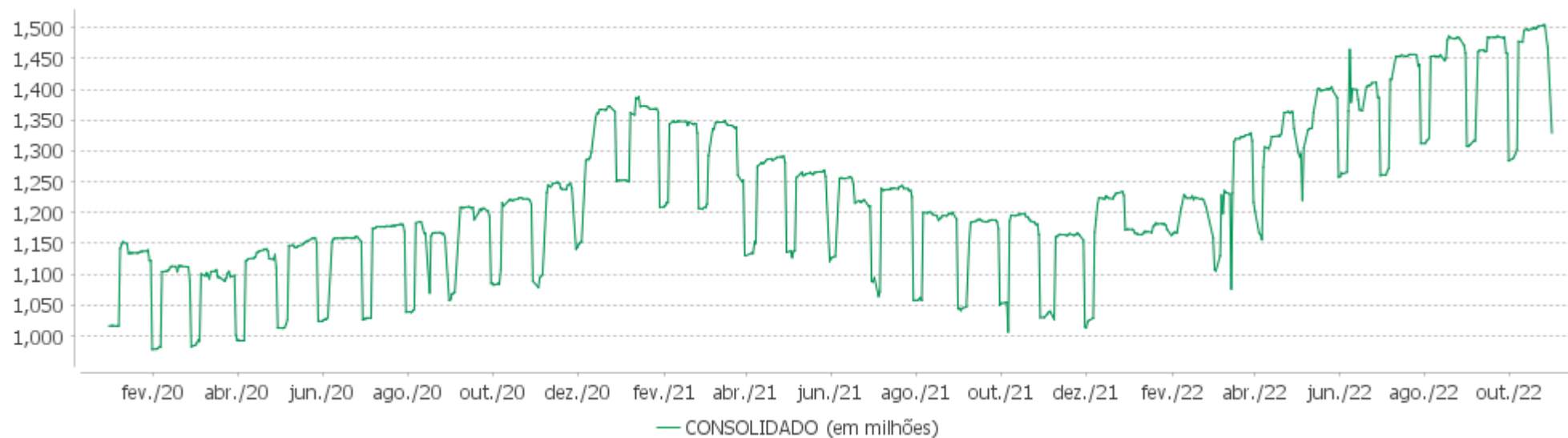
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	12	35,29	03 meses	1,82	0,94	0,88	1,78
Meses abaixo - Meta Atuarial	22	64,71	06 meses	3,91	2,41	1,50	1,94
			12 meses	8,72	10,36	-1,65	2,40
			24 meses	10,73	24,92	-14,19	2,51
			Desde 31/12/2019	14,33	31,64	-17,31	2,83
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	1,64	2022-03					
Menor rentabilidade da Carteira	-0,80	2021-10					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Patrimônio Líquido

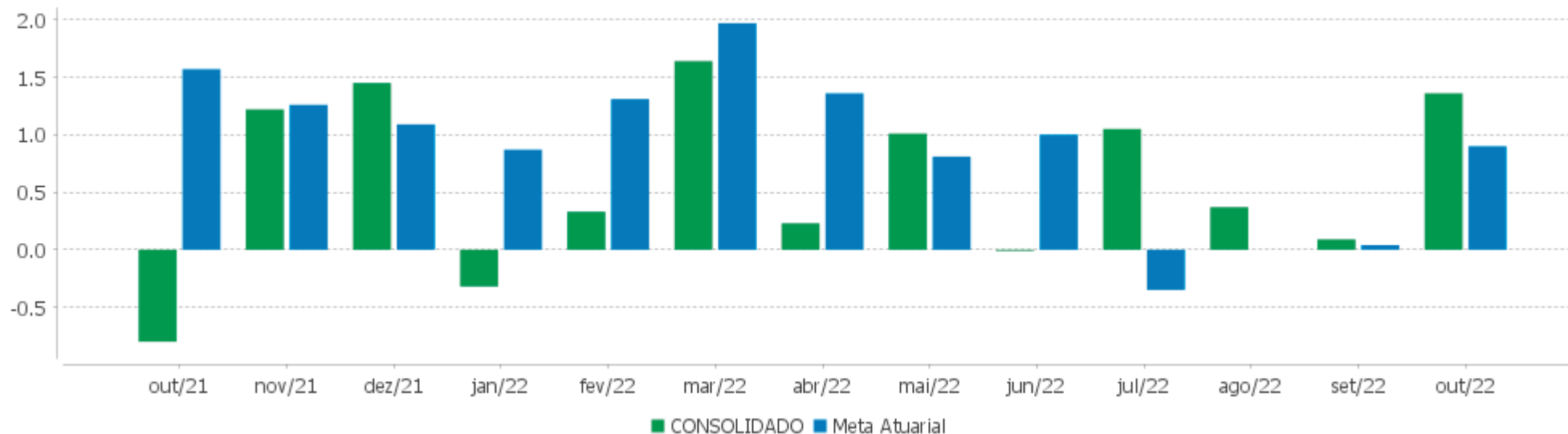


Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/10/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/10/2022

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.	0,54 -0,05	6,65 1,95	0,63 0,69	0,69 0,29	6,76 0,29	17,66 -0,17	21,68 -0,78
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	0,53 -0,06	9,61 4,91	0,60 0,66	3,53 3,14	9,74 3,27	20,87 3,04	24,92 2,47
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	0,55 -0,04	9,85 5,15	0,66 0,72	3,67 3,27	9,95 3,48	21,24 3,41	25,43 2,98
NTN-B 150860 (5,986700%) Var. IPCA p.p.	0,56 -0,03	3,72 -0,98	-2,20 -2,13	0,74 0,35	6,87 0,40	17,89 0,06	22,02 -0,43
NTN-B 150860 (5,949840%) Var. IPCA p.p.	0,56 -0,03	6,76 2,06	0,67 0,73	3,69 3,29	10,00 3,53	21,33 3,50	25,57 3,12
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	0,54 -0,05	6,63 1,93	0,63 0,69	3,59 3,20	9,83 3,36	21,00 3,17	25,09 2,64
NTN-B 150860 (5,599600%) Var. IPCA p.p.	0,53 -0,06	6,62 1,92	0,59 0,65	3,51 3,12	9,79 3,32	21,06 3,23	25,25 2,80
NTN-B 150545 (5,900200%) Var. IPCA p.p.	0,55 -0,04	9,84 5,14	0,66 0,72	3,66 3,27	9,96 3,49	21,27 3,43	25,48 3,03
NTN-B 150860 (5,788000%) Var. IPCA p.p.	0,55 -0,04	6,70 1,99	0,63 0,70	3,60 3,21	9,90 3,43	21,21 3,38	25,43 2,98
NTN-B 150535 (5,927000%) Var. IPCA p.p.	0,56 -0,03	6,73 2,03	0,67 0,73	0,72 0,33	6,83 0,36	17,81 -0,03	21,89 -0,56
NTN-B 150860 (5,959200%) Var. IPCA p.p.	0,56 -0,03	6,76 2,06	0,67 0,74	3,69 3,30	10,00 3,53	21,34 3,51	25,58 3,13
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,88 -0,04	9,05 -0,08	2,36 0,01	3,51 0,00	12,60 -0,14	17,31 -0,41	23,62 -0,83
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,89 0,66	8,19 0,76	2,23 -1,64	3,03 -0,54	12,06 0,66	15,99 2,54	21,74 9,44
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,06 -0,17	6,77 -0,66	3,31 -0,55	3,21 -0,36	11,74 0,34	12,12 -1,32	11,66 -0,65
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	1,89 0,91	7,73 -0,51	2,21 1,03	3,00 0,09			
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,99 -0,02	9,45 -0,23	3,32 -0,07	6,31 -0,13	11,24 -0,27	12,97 -0,52	17,33 -0,78
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,94	7,84	4,40	6,56	11,84	7,91	12,40

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/10/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,01	-0,11	-0,03	-0,08	-0,11	-0,34	-0,66
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,07 105,22	10,52 105,23	3,44 104,29	6,84 105,03	12,13 105,57	16,28 107,15	19,29 102,00
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	1,02 100,04	9,94 99,42	3,28 99,60	6,49 99,69	11,41 99,29	15,03 98,91	17,74 93,81
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,96 0,37	9,68 4,97	3,86 3,93	5,92 5,53	11,28 4,81	12,31 -5,53	
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	7,11 1,66	-1,72 -12,42	16,25 3,77	0,20 -7,37	-0,87 -12,98	1,42 -22,09	-7,06 -15,29
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	8,24 2,79	6,65 -4,05	12,80 0,33	5,86 -1,70	14,52 2,41	31,28 7,77	31,28 23,05
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	7,16 1,70	-12,75 -23,44	3,96 -8,52	-5,86 -13,42	-10,59 -22,70	18,96 -4,55	30,09 21,87
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. IBOVESPA p.p.	5,91 0,46	-9,33 -20,03	11,38 -1,10	0,59 -6,97	-16,24 -28,36	-24,83 -48,34	-26,33 -34,55
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	1,70 0,37	-29,79 0,07	-9,82 0,16	-6,27 0,29	-29,23 -0,10	-5,49 -2,53	51,74 -3,28
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	8,77 3,77	-12,72 10,75	-3,83 1,19	-1,40 -1,54	-8,31 13,36	32,33 24,48	37,32 -30,03
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	8,84 3,85	-8,93 14,54	0,15 5,17	2,79 2,64	-4,35 17,33	39,24 31,39	
CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,00% p.p.	1,36 0,45	5,87 -2,29	1,82 0,88	3,91 1,50	8,72 -2,01	10,73 -16,68	
CDI	1,02	10,00	3,30	6,51	11,49	15,20	18,91
IBOVESPA	5,45	10,70	12,48	7,57	12,11	23,51	8,22
INPC + 6,00%	0,94	10,00	1,33	3,32	12,85	32,81	47,43
IPCA + 6,00%	1,06	9,89	1,43	3,41	12,86	32,34	45,71

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/10/2022

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 TESOUREO 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 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: 31/10/2022

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	1,00	9,68	3,38	6,44	11,52	13,50	18,11	26,53	35,47
IRF-M 1+	0,92	7,22	5,18	6,95	12,08	5,46	10,35	30,15	43,64
IRF-M TOTAL	0,93	7,95	4,44	6,64	11,95	8,26	13,06	29,67	41,90
IMA-B 5	1,91	9,12	2,35	3,50	12,73	17,73	24,45	41,60	54,77
IMA-B 5+	0,65	5,79	5,62	3,73	10,15	9,03	2,65	40,63	55,93
IMA-B TOTAL	1,23	7,43	3,86	3,57	11,40	13,44	12,30	42,33	56,98
IMA-GERAL TOTAL	1,01	8,88	3,72	5,61	11,80	12,98	15,99	33,17	45,02
IDKA 2	1,78	8,84	2,04	3,22	12,50	17,69	25,62	40,76	54,48
IDKA 20	-0,33	3,63	10,36	4,51	7,43	2,00	-11,54	37,24	53,99
CDI	1,02	10,00	3,30	6,51	11,49	15,20	18,91	26,30	34,57

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	5,45	10,70	12,48	7,57	12,11	23,51	8,22	32,73	56,16
IBRX 100	5,57	10,25	12,01	6,76	11,78	23,41	9,78	37,01	60,34
IBRX 50	5,32	10,92	12,53	7,34	13,01	26,17	10,50	32,80	56,33
SMALL CAP	7,30	-1,35	16,81	0,91	0,06	3,68	-2,72	39,01	46,73
IFIX	0,02	6,66	6,30	6,34	11,80	8,12	7,14	33,40	34,37
Índice Consumo - ICON	6,28		12,02	1,65	-14,96	-22,29	-23,79	10,51	-0,91
Índice Dividendos - IDIV	4,03	13,61	6,51	3,76	16,46	32,51	18,49	64,97	73,53

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/10/2022

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	0,59	4,70	-0,06	0,39	6,47	17,83	22,45	25,55	31,28
INPC	0,47	4,81	-0,16	0,30	6,46	18,26	23,90	27,06	32,15
IGPM	-0,97	5,58	-2,59	-1,31	6,52	29,66	56,80	61,74	79,20
SELIC	1,02	10,00	3,30	6,51	11,49	15,20	18,91	26,30	34,58

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	5,00	-23,47	-5,01	0,15	-21,68	7,85	67,36	101,91	141,21
MSCI ACWI	3,03	-26,82	-6,84	-4,13	-26,70	-3,07	44,06	71,11	89,42

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,90	8,17	0,94	2,41	10,73	27,41	37,65	46,79	59,57
IPCA + 5,00%	0,98	9,03	1,18	2,91	11,79	29,86	41,64	52,49	67,35
IPCA + 5,50%	1,02	9,46	1,31	3,16	12,33	31,10	43,66	55,41	71,35
IPCA + 5,89%	1,05	9,79	1,40	3,35	12,74	32,06	45,25	57,71	74,53
IPCA + 6,00%	1,06	9,89	1,43	3,41	12,86	32,34	45,71	58,36	75,43
INPC + 4,00%	0,78	8,27	0,84	2,32	10,72	27,87	39,28	48,55	60,63
INPC + 6,00%	0,94	10,00	1,33	3,32	12,85	32,81	47,43	60,26	76,60

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/10/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1888	03/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.110,76	0,00	3.130,52041000	2,9103020600
1887	03/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	110.098,82	0,00	37.830,71919300	2,9103020600
1912	04/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.199.599,30	0,00	411.987,07947869	2,9117401000
1889	04/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	73.375,78	0,00	25.199,97578081	2,9117401000
1942	04/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	216.478,28	0,00	74.346,70422680	2,9117401000
1913	05/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.433.262,02	0,00	1.521.823,50956700	2,9131249400
1890	05/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.030,64	0,00	2.413,43579300	2,9131249400
1943	05/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	442.788,01	0,00	151.997,60364552	2,9131249400
1914	06/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	534.851,64	0,00	183.512,94117700	2,9145172900
1891	06/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.791,87	0,00	5.075,23837678	2,9145172900
1959	06/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.436.090,54	0,00	1.522.066,98351700	2,9145172900
1944	06/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.218,32	0,00	4.878,44764100	2,9145172900
1916	07/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	495.975,98	170.101,79570100	2,9157598100
1915	07/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	112.552.604,68	0,00	38.601.466,51791500	2,9157598100
1961	07/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.756,70	4.375,08549400	2,9157598100
1960	07/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	36.770.082,26	0,00	12.610.806,32701300	2,9157598100
1946	07/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.211.655,72	1.444.445,35718200	2,9157598100
1945	07/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	33.401.157,71	0,00	11.455.387,23575400	2,9157598100
1892	10/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.938,77	0,00	664,55972600	2,9173751000
1918	10/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.003.327,26	343.914,38385828	2,9173751000
1917	10/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	176.977,66	0,00	60.663,32025600	2,9173751000
1962	10/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.673,77	0,00	2.630,36796331	2,9173751000
1948	10/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	72.716,37	24.925,27260800	2,9173751000
1947	10/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	173.845,70	0,00	59.589,76615657	2,9173751000
1920	11/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.938,65	2.034,69749300	2,9186881600
1919	11/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.487.570,08	0,00	6.676.825,00209200	2,9186881600
1963	11/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.045,93	2.414,07427370	2,9186881600
1950	11/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	177.909,23	60.955,20296200	2,9186881600

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/10/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1949	11/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.328,70	0,00	6.279,77330747	2,9186881600
1964	13/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.045,93	0,00	2.412,80946700	2,9202181500
1921	14/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	699,58	0,00	239,46589400	2,9214181100
1965	14/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.072,31	0,00	367,05119200	2,9214181100
1951	14/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.599,99	0,00	1.916,87385600	2,9214181100
1923	17/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.417.483,07	1.853.414,59116800	2,9229742200
1922	17/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.393.932,79	0,00	1.845.357,63370500	2,9229742200
1966	17/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	751.079,15	256.957,15840700	2,9229742200
1893	18/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.256,40	0,00	5.558,67372214	2,9245105600
1926	18/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.357,76	3.199,76960521	2,9245105600
1925	18/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	21.140,00	0,00	7.228,55998167	2,9245105600
1967	18/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.700,15	581,34501700	2,9245105600
1924	19/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.848,32	0,00	973,49004500	2,9258850800
1927	19/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	664.812,33	227.217,51254700	2,9258850800
1968	19/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	664.426,05	227.085,49034800	2,9258850800
1953	19/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	737.244,74	251.973,23881224	2,9258850800
1952	19/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	62.957,91	0,00	21.517,56076400	2,9258850800
1894	20/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	60.298,92	0,00	20.598,75701400	2,9273086700
1969	20/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	66.817,61	0,00	22.825,61134901	2,9273086700
1929	21/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.234,12	421,37292000	2,9288030300
1928	21/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.607,80	0,00	9.767,74460600	2,9288030300
1895	21/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	157.365,15	0,00	53.730,19229600	2,9288030300
1954	21/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.599,99	1.912,04015100	2,9288030300
1896	24/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	166.194,84	0,00	56.716,46788700	2,9302748600
1897	25/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	1.002,77817500	2,9315755700
1931	27/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	18.841.069,22	6.420.958,22685100	2,9343080200
1930	27/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.164,82	0,00	737,76167500	2,9343080200
1898	27/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.989,82	0,00	2.722,89750958	2,9343080200
1938	27/10/2022	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	22.040.028,99	0,00	1.548.539,60857340	14,2327835000
1941	27/10/2022	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	22.026.572,14	6.023.703,41476889	3,6566495100

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/10/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1957	27/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	2.528.722,71	1.020.940,78224396	2,4768554200
1932	28/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	48.641,71	0,00	16.569,30424900	2,9356519300
1899	28/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.350,44	0,00	1.141,29334100	2,9356519300
1936	28/10/2022	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	0,00	10.536.899,44	913.507,12517000	11,5345563770
1937	28/10/2022	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	0,00	10.843.853,16	8.901.331,30157900	1,2182282394
1939	28/10/2022	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	30.442.350,50	0,00	2.137.532,60196463	14,2418181000
1940	28/10/2022	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	2.515.265,86	0,00	707.917,52312584	3,5530493000
1971	28/10/2022	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,00	30.442.350,50	26.646,35601031	1.142,4582966700
1934	31/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	71.965.438,65	24.500.455,19025132	2,9373102700
1933	31/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.922.756,76	0,00	995.045,29359700	2,9373102700
1900	31/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.873,19	0,00	637,72289100	2,9373102700
1970	31/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	37.379.757,08	12.725.845,63679400	2,9373102700
1956	31/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	34.105.657,62	11.611.186,59078532	2,9373102700
1955	31/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	661.153,70	0,00	225.088,13820300	2,9373102700
Total			278.721.228,37	252.910.583,72		

Carteira: CONSOLIDADO	Data Extrato: 31/10/2022
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS	

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%				Value-At-Risk (R\$): 11.658.408,46		Value-At-Risk: 0,88%	
	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		0,88	0,88			1.329.215.074,74	100,00
Renda Fixa						Value-At-Risk: 0,35%	

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,634200%)		0,18	0,00	0,19			30.202.433,63	2,27
NTN-B 150535 (5,784900%)		0,18	0,00	0,19			30.653.750,94	2,31
NTN-B 150535 (5,909200%)		0,18	0,00	0,19			81.997.294,36	6,17
NTN-B 150535 (5,927000%)		0,18	0,00	0,21			12.281.468,64	0,92
NTN-B 150545 (5,900200%)		0,18	0,00	0,19			123.572.683,89	9,30
NTN-B 150832 (5,763300%)		0,18	0,00	0,19			40.747.128,04	3,07
NTN-B 150860 (5,599600%)		0,18	0,00	0,19			85.138.891,34	6,41
NTN-B 150860 (5,788000%)		0,18	0,00	0,19			70.369.557,99	5,29
NTN-B 150860 (5,949840%)		0,18	0,00	0,19			68.725.909,50	5,17
NTN-B 150860 (5,959200%)		0,18	0,00	0,19			80.744.008,64	6,07
NTN-B 150860 (5,986700%)		0,31	-0,00	0,34			28.148.277,13	2,12
Sub-total	0,33	0,17	0,00		-1,44	0,55	652.581.404,10	49,10

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	0,00			230.652.495,32	17,35
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,52	0,11	1,62			201.464.576,05	15,16
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		2,92	0,03	0,82			29.578.630,54	2,23

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/10/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		1,52	0,01	1,51			12.222.356,40	0,92
Sub-total	0,82	0,88	0,16		0,36	1,31	473.918.058,31	35,65

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRAPREVID FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,01	0,00	0,01			106.015.035,53	7,98
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI		0,01	-0,00	0,01			3.413.503,47	0,26
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
Sub-total	0,43	0,01	0,00		-0,10	0,98	109.428.539,00	8,23

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 12,59%

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		12,78	0,24	8,10			28.420.773,91	2,14
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		12,58	0,20	7,60			23.654.737,96	1,78
Sub-total	27,72	12,59	0,44		0,28	8,81	52.075.511,87	3,92

Renda Variável

Value-At-Risk: 12,71%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		12,62	0,10	8,17			14.160.735,68	1,07
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		13,41	0,06	7,67			7.705.866,75	0,58
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
Sub-total	29,75	12,71	0,15		0,25	8,48	21.866.602,43	1,65

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 13,73%

Artigo 9º III

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/10/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		13,73	0,12	2,44			19.344.959,03	1,46
Sub-total	35,00	13,73	0,12		0,02	1,70	19.344.959,03	1,46