



RELATÓRIO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

CONSOLIDADO

Período: 4º trimestre de 2022

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENTA FIXA

94,34%

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Trim.		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,634200%)	0,62	0,04	0,84	2,47	29.927.637,19	1,87
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	2,89	0,04	0,86	2,50	30.371.148,83	1,90
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,886400%)	2,94	0,05	0,87	1,69	7.121.704,70	0,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	0,62	0,04	0,87	2,53	81.232.927,12	5,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	4,80	0,04	0,87	2,46	12.166.800,50	0,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,216000%)	4,23	0,04	0,89	1,17	2.573.407,68	0,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	0,62	0,04	0,87	2,53	122.435.719,41	7,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	2,93	0,04	0,86	2,50	41.539.685,72	2,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	2,81	0,04	0,84	2,46	86.772.499,68	5,43
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	2,89	0,04	0,86	2,50	71.741.042,83	4,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,926400%)	4,15	0,05	0,87	1,70	17.166.826,82	1,07
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	2,95	0,04	0,87	2,54	70.083.240,45	4,39
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	2,96	0,04	0,87	2,55	82.339.931,12	5,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	4,18	0,04	0,87	2,55	28.705.871,39	1,80
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,225100%)	4,32	0,04	0,89	1,17	5.947.804,24	0,37

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Trim.		

Sub-total Artigo 7º I, Alínea a0,660,040,862,52690.126.247,6843,21

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,48	0,05	1,15	3,09	463.005.020,51	28,99	6.557.713.378,25	7,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,91	0,04	1,32	2,71	203.073.305,13	12,72	3.307.767.205,35	6,14
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	6,54	0,04	-0,08	0,14	29.308.342,53	1,84	221.647.877,89	13,22
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2,92	0,04	1,32	2,71	12.319.971,67	0,77	2.756.777.028,75	0,45

Sub-total Artigo 7º I, Alínea b1,590,051,132,78707.706.639,8444,31

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,09	0,05	1,17	3,34	108.387.669,93	6,79	7.627.582.136,16	1,42
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,08	0,05	1,10	3,16	514.867,79	0,03	11.421.565.249,40	0,00

Sub-total Artigo 7º III, Alínea a0,780,051,173,23108.902.537,726,82

		Renda Fixa	1,00	0,05	1,01	2,70	1.506.735.425,24	94,34		
--	--	------------	------	------	------	------	------------------	-------	--	--

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL1,13%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	28,30	-0,02	-5,27	-14,33	11.454.679,63	0,72	124.636.942,42	9,19
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	28,11	-0,01	-2,99	-7,72	6.638.771,66	0,42	569.834.602,44	1,17
Sub-total Artigo 8º I			24,69	-0,02	-4,45	-10,24	18.093.451,29	1,13		
Renda Variável			24,69	-0,02	-4,45	-10,24	18.093.451,29	1,13		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,23%

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	26,84	-0,00	-4,79	3,52	19.690.199,16	1,23	1.938.590.167,99	1,02
Sub-total Artigo 9º III			26,84	-0,00	-4,79	3,52	19.690.199,16	1,23		
Investimentos no Exterior			26,84	-0,00	-4,79	3,52	19.690.199,16	1,23		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

3,29%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	24,01	0,05	-4,87	9,97	28.714.099,15	1,80	435.575.393,61	6,59
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	24,18	0,05	-4,90	9,70	23.855.932,72	1,49	1.723.160.287,50	1,38
Sub-total Artigo 10º I			23,99	0,05	-4,88	9,84	52.570.031,87	3,29		
Investimentos Estruturados			23,99	0,05	-4,88	9,84	52.570.031,87	3,29		
Total			2,18	0,04	0,63	2,81	1.597.089.107,56	100,00		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

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	690.126.247,68	43,21	0,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	707.706.639,84	44,31	0,00	29,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	108.902.537,72	6,82	0,00	10,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	1.506.735.425,24	94,34					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	18.093.451,29	1,13	0,00	5,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	18.093.451,29	1,13					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	19.690.199,16	1,23	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	19.690.199,16	1,23					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	52.570.031,87	3,29	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	52.570.031,87	3,29					15,00
Total		1.597.089.107,56	100,00					

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre (R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,86 76,76	2,52 78,73	2,52 78,73	3,11 46,98		5.900.132,14	16.733.726,76
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,13 100,38	2,78 87,00	2,78 87,00	4,69 70,96	10,26 82,90	7.637.711,68	17.640.271,49
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,17 103,76	3,23 101,08	3,23 101,08	6,76 102,18	11,68 94,36	1.254.701,80	3.311.789,93
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-4,45 -2,00	-10,24 -9,97	-10,24 -9,97	-1,65 -13,01	-20,60 -25,28	-842.081,78	-1.150.353,45
Artigo 9º III % do CDI	-4,79 -426,73	3,52 110,00	3,52 110,00	-0,98 -14,87	-28,54 -230,65	-991.374,75	669.169,27
Artigo 10º I % do CDI	-4,88 -434,43	9,84 307,82	9,84 307,82	9,32 140,93	-9,94 -80,36	-2.697.012,68	4.711.456,41
CONSOLIDADO (Total)						10.262.076,41	41.916.060,41

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
NTN-B 150535 (5,634200%)	29.676.995,01	0,00	0,00	0,00	29.927.637,19	250.642,18	730.195,30
NTN-B 150535 (5,784900%)	30.113.063,05	0,00	0,00	0,00	30.371.148,83	258.085,78	751.684,36
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.060.590,96	0,00	0,00	0,00	7.121.704,70	61.113,74	119.197,14
NTN-B 150535 (5,909200%)	80.534.339,78	0,00	0,00	0,00	81.232.927,12	698.587,34	2.034.048,50
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.061.994,46	0,00	0,00	0,00	12.166.800,50	104.806,04	305.159,61
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.550.634,43	0,00	0,00	0,00	2.573.407,68	22.773,25	29.746,63
NTN-B 150545 (5,900200%)	121.383.687,63	0,00	0,00	0,00	122.435.719,41	1.052.031,78	3.062.995,59
NTN-B 150832 (5,763300%)	41.187.409,77	0,00	0,00	0,00	41.539.685,72	352.275,95	1.012.687,06
NTN-B 150860 (5,599600%)	86.048.298,44	0,00	0,00	0,00	86.772.499,68	724.201,24	2.083.087,18
NTN-B 150860 (5,788000%)	71.131.208,70	0,00	0,00	0,00	71.741.042,83	609.834,13	1.752.948,35
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.018.961,29	0,00	0,00	0,00	17.166.826,82	147.865,53	286.780,16

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
NTN-B 150860 (5,949840%)	69.478.186,96	0,00	0,00	0,00	70.083.240,45	605.053,49	1.738.141,91
NTN-B 150860 (5,959200%)	81.628.425,30	0,00	0,00	0,00	82.339.931,12	711.505,82	2.043.907,80
NTN-B 150860 (5,986700%)	28.457.197,88	0,00	0,00	0,00	28.705.871,39	248.673,51	714.335,78
NTN-B 150860 (6,225100%)	5.895.121,88	0,00	0,00	0,00	5.947.804,24	52.682,36	68.811,39
					690.126.247,68	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 Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	12.159.561,83	0,00	0,00	0,00	12.319.971,67	160.409,84	324.684,51
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	200.430.321,80	0,00	0,00	0,00	203.073.305,13	2.642.983,33	5.354.112,68
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.332.709,13	0,00	0,00	0,00	29.308.342,53	-24.366,60	41.322,04
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	237.035.827,11	696.413.255,78	-475.302.747,49	0,00	463.005.020,51	4.858.685,11	11.594.253,10
					707.706.639,84	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	107.138.583,12	0,00	0,00	0,00	108.387.669,93	1.249.086,81	2.982.834,70
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	509.252,80	0,00	0,00	0,00	514.867,79	5.614,99	104.882,96
					108.902.537,72	0,00	0,00

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB AÇÕES CONSUMO FIC	12.091.869,49	0,00	0,00	0,00	11.454.679,63	-637.189,86	-1.915.350,86
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	6.843.663,58	0,00	0,00	0,00	6.638.771,66	-204.891,92	-555.499,08
					18.093.451,29	0,00	0,00

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	20.681.573,91	0,00	0,00	0,00	19.690.199,16	-991.374,75	669.169,27
					19.690.199,16	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	30.182.640,94	0,00	0,00	0,00	28.714.099,15	-1.468.541,79	2.602.509,30
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	25.084.403,61	0,00	0,00	0,00	23.855.932,72	-1.228.470,89	2.108.947,11
					52.570.031,87	0,00	0,00

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

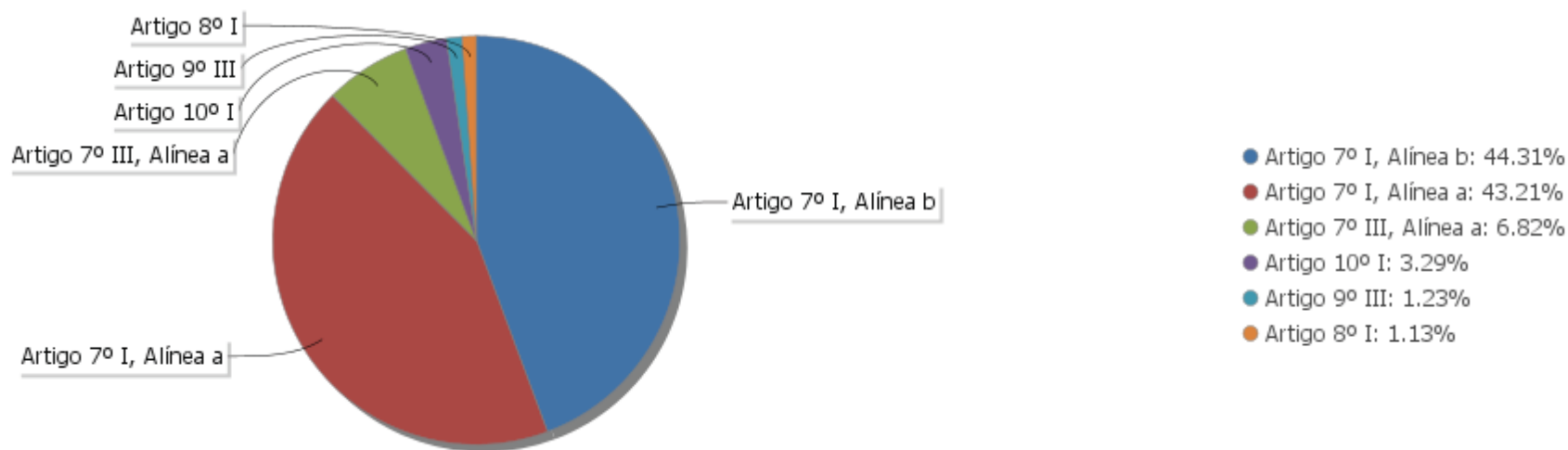
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

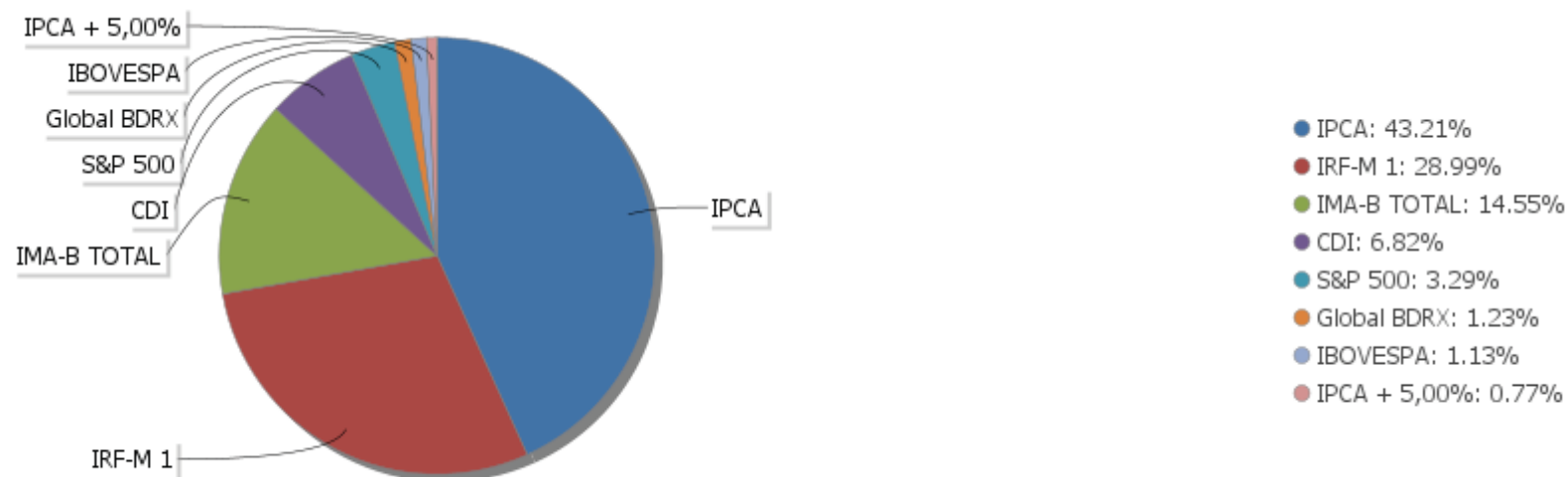
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	662.261.240,55	41,47	662.261.240,55	41,47
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	662.261.240,55	41,47
acima de 365 dias	934.827.867,01	58,53	1.597.089.107,56	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia

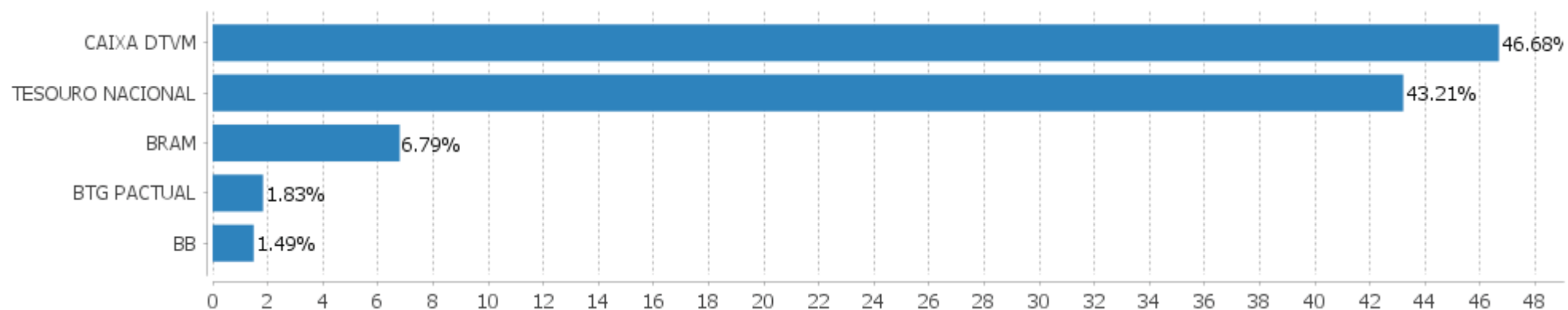


Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

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	0,80	0,63	7,39
IPCA + 4,00%	0,87	1,31	1,97	1,36	0,81	1,00	-0,35	-0,00	0,04	0,90	0,72	0,97	10,00
p.p. indexador	-1,18	-0,98	-0,33	-1,13	0,20	-1,01	1,40	0,37	0,05	0,45	0,08	-0,34	-2,61
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

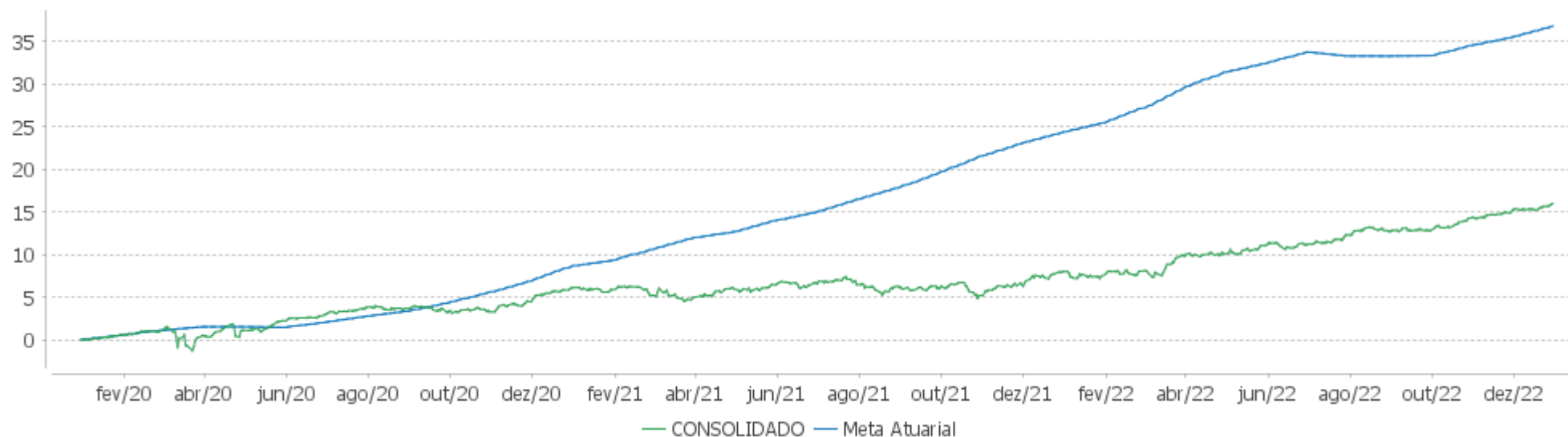
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

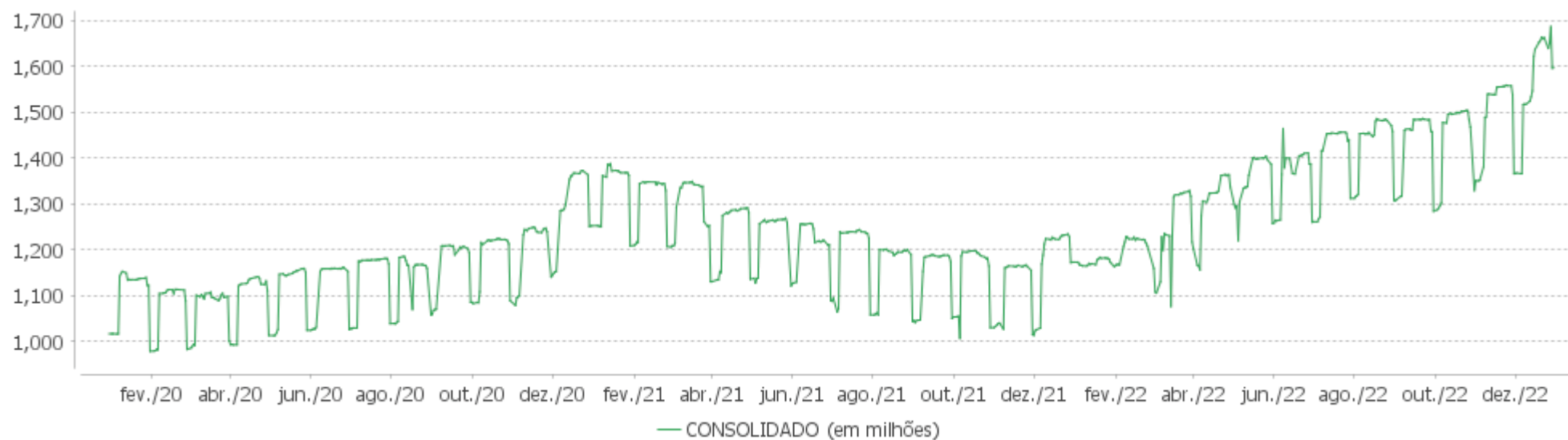
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	13	36,11	03 meses	2,81	2,61	0,19	1,45
Meses abaixo - Meta Atuarial	23	63,89	06 meses	4,36	2,28	2,07	1,60
			12 meses	7,39	10,00	-2,61	2,18
			24 meses	9,31	23,48	-14,17	2,48
			36 meses	15,97	33,88	-17,91	2,77
			Desde 31/12/2019	15,97	33,88	-17,91	2,77
	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

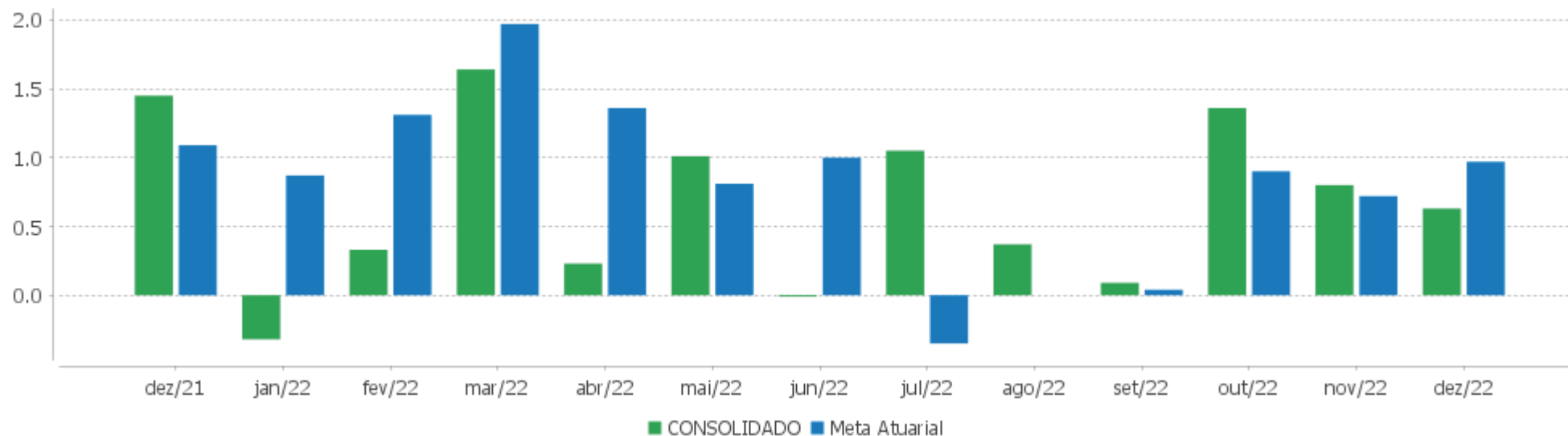


Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150535 (5,784900%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,24	2,50 0,87	2,50 0,87	3,08 2,80	8,73 2,95	19,91 3,48	25,09 3,41
NTN-B 150535 (6,216000%) Var. IPCA p.p.	0,89 0,27	-0,39 -2,02	-0,39 -2,02	0,28 -0,00	5,87 0,09		
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,23	2,50 0,87	2,50 0,87	3,07 2,79	8,71 2,92	19,85 3,42	25,00 3,31
NTN-B 150535 (5,886400%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,25	2,53 0,90	2,53 0,90	3,13 2,85	8,81 3,03		
NTN-B 150860 (6,225100%) Var. IPCA p.p.	0,89 0,27	2,61 0,98	2,61 0,98	0,24 -0,04	5,80 0,02		
NTN-B 150860 (5,959200%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,25	2,55 0,92	2,55 0,92	3,17 2,88	8,88 3,09	20,18 3,75	25,49 3,80
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	0,84 0,22	2,47 0,84	2,47 0,84	3,01 2,72	11,72 5,94	23,13 6,70	28,37 6,68
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,25	2,53 0,90	2,53 0,90	3,14 2,86	12,01 6,23	23,60 7,17	29,00 7,31
NTN-B 150860 (5,986700%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,25	2,55 0,92	2,55 0,92	0,23 -0,05	5,78 -0,01	16,77 0,34	21,93 0,24
NTN-B 150860 (5,949840%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,25	2,54 0,91	2,54 0,91	3,16 2,88	8,87 3,09	20,18 3,75	25,48 3,79
NTN-B 150860 (5,599600%) Var. IPCA p.p.	0,84 0,22	2,46 0,83	2,46 0,83	2,99 2,71	8,67 2,88	19,91 3,48	25,16 3,47
NTN-B 150545 (5,900200%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,25	2,53 0,90	2,53 0,90	3,14 2,85	12,00 6,22	23,61 7,18	29,04 7,35
NTN-B 150535 (5,927000%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,25	2,46 0,83	2,46 0,83	3,07 2,79	8,76 2,97	20,01 3,59	25,27 3,58
NTN-B 150860 (5,788000%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,24	2,50 0,88	2,50 0,88	3,08 2,80	8,78 2,99	20,05 3,63	25,33 3,65
NTN-B 150860 (5,926400%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,25	2,54 0,91	2,54 0,91	0,23 -0,05	5,78 -0,01		
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,32 1,51	2,71 2,47	2,71 2,47	2,71 0,77	9,05 2,68	12,28 7,25	22,12 10,36
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	-0,08	0,14	0,14	1,19	5,79	2,79	12,38

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,11	-0,09	-0,09	-0,75	-0,58	-2,23	0,63
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,32	2,71	2,71	2,69			
Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,27	-0,15	-0,15	-0,09			
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,15	3,09	3,09	6,56	11,74	14,76	18,92
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	-0,06	-0,06	-0,13	-0,28	-0,54	-0,80
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	1,17	3,34	3,34	6,89	13,00	18,58	21,11
% do CDI	103,79	104,31	104,31	104,19	105,05	107,34	102,67
BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	1,10	3,16	3,16	6,54	12,27	17,09	19,36
% do CDI	98,16	98,71	98,71	98,94	99,15	98,70	94,18
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-2,99	-7,72	-7,72	5,14	-15,33	-29,83	-32,10
Var. IBOVESPA p.p.	-0,55	-7,45	-7,45	-6,22	-20,01	-22,03	-26,99
BB AÇÕES CONSUMO FIC	-5,27	-14,33	-14,33	-1,79	-26,66	-46,66	-46,19
Var. IBOVESPA p.p.	-2,82	-14,05	-14,05	-13,15	-31,35	-38,86	-41,08
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-4,79	3,52	3,52	-0,98	-28,54	-6,74	44,34
Var. Global BDRX p.p.	-0,58	-0,42	-0,42	-0,37	-0,49	-2,90	-3,76
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-4,90	9,70	9,70	6,79	-11,97	16,92	30,01
Var. S&P 500 p.p.	2,36	6,36	6,36	5,75	12,71	14,29	-23,83
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	-4,87	9,97	9,97	11,52	-7,99	23,07	
Var. S&P 500 p.p.	2,39	6,63	6,63	10,48	16,69	20,43	
CONSOLIDADO	0,63	2,81	2,81	4,36	7,39	9,31	15,97
Var. IPCA + 4,00% p.p.	-0,34	0,19	0,19	2,07	-2,61	-16,58	-20,85
CDI	1,12	3,20	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56
IBOVESPA	-2,45	-0,27	-0,27	11,36	4,69	-7,80	-5,11
INPC + 6,00%	1,20	3,01	3,01	3,29	12,26	31,06	46,46
IPCA + 6,00%	1,13	3,10	3,10	3,27	12,11	30,76	44,83

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

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 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 IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	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

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	1,18	3,16	3,16	6,70	12,02	15,30	19,73	27,82	36,73
IRF-M 1+	1,62	1,10	1,10	6,63	7,41	2,06	10,68	26,44	41,95
IRF-M TOTAL	1,48	1,74	1,74	6,49	8,82	6,66	13,80	27,49	41,17
IMA-B 5	0,94	2,53	2,53	2,98	9,78	14,79	24,02	40,34	54,18
IMA-B 5+	-1,19	-1,72	-1,72	1,24	3,30	-3,47	1,84	32,76	53,22
IMA-B TOTAL	-0,19	0,23	0,23	1,94	6,37	5,02	11,75	37,40	55,34
IMA-GERAL TOTAL	0,77	1,73	1,73	4,95	9,66	10,71	16,62	31,57	44,78
IDKA 2	1,24	2,25	2,25	2,34	9,34	14,78	24,67	39,41	53,01
IDKA 20	-3,32	-5,66	-5,66	0,71	-1,92	-16,13	-14,29	23,65	48,88
CDI	1,12	3,20	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56	27,75	35,96

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-2,45	-0,27	-0,27	11,36	4,69	-7,80	-5,11	24,86	43,63
IBRX 100	-2,63	-0,39	-0,39	10,33	4,02	-7,61	-4,37	27,56	47,23
IBRX 50	-2,55	0,38	0,38	12,12	5,72	-5,43	-2,00	26,57	44,96
SMALL CAP	-3,01	-7,61	-7,61	5,76	-15,06	-28,82	-29,28	11,87	20,97
Índice Consumo - ICON									
Índice Dividendos - IDIV	-1,61	3,15	3,15	7,71	12,65	5,43	4,37	51,51	75,68

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-7,26	3,34	3,34	1,04	-24,68	2,63	53,84	106,24	126,51

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-0,00	-4,14	-4,14	2,56	2,22	-0,11	-10,33	21,92	28,78

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-5,43	5,58	5,58	1,05	-25,01	-5,95	38,64	78,90	86,12

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,62	1,63	1,63	0,28	5,79	16,43	21,69	26,93	31,68
INPC	0,69	1,55	1,55	0,30	5,93	16,70	23,05	28,57	32,98
IGPM	0,45	-1,09	-1,09	-2,51	5,45	24,20	52,94	64,11	76,48
SELIC	1,12	3,20	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56	27,75	35,97

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,97	2,61	2,61	2,28	10,00	25,89	36,82	48,44	60,11
IPCA + 5,00%	1,05	2,86	2,86	2,78	11,05	28,31	40,79	54,22	67,93
IPCA + 5,50%	1,09	2,98	2,98	3,03	11,58	29,53	42,80	57,17	71,96
IPCA + 5,89%	1,12	3,07	3,07	3,22	11,99	30,49	44,38	59,51	75,15
IPCA + 6,00%	1,13	3,10	3,10	3,27	12,11	30,76	44,83	60,17	76,06
INPC + 4,00%	1,04	2,53	2,53	2,31	10,15	26,18	38,35	50,36	61,69
INPC + 6,00%	1,20	3,01	3,01	3,29	12,26	31,06	46,46	62,24	77,79

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

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: 30/12/2022

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	BRADESCO 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: 30/12/2022

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
2045	01/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.144,67	0,00	4.813,40434200	2,9386000000
2018	01/11/2022	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	21.380.752,60	0,00	6.011.512,45650910	3,5566345000
2026	03/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.207.298,62	0,00	410.665,20491955	2,9398610000
2000	03/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	216.557,97	0,00	73.662,65615959	2,9398610000
2027	04/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.291,14	0,00	438,94752400	2,9414450000
2046	04/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.809,73	0,00	6.394,72436100	2,9414450000
2055	04/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	19.853,38	6.749,53237700	2,9414450000
2029	07/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.867.364,14	0,00	10.149.753,21383400	2,9426690000
2028	07/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	18.653.776,74	6.339.067,26686200	2,9426690000
2002	07/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.582.350,04	0,00	1.557.208,79242600	2,9426690000
2001	07/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.530.159,96	2.898.783,36952200	2,9426690000
2057	07/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	34.120.984,13	0,00	11.595.250,47839200	2,9426690000
2056	07/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.375.546,32	4.205.551,59964000	2,9426690000
2065	08/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	76.260.589,50	0,00	25.903.609,66354100	2,9440140000
2030	08/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	415,37	141,08843100	2,9440140000
2067	08/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.096.250,31	0,00	5.807.122,62577556	2,9440140000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2058	08/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.967,50	3.725,35556600	2,9440140000
2066	08/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.901.476,97	0,00	4.382.274,32682046	2,9440140000
2031	09/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.903.498,64	0,00	985.707,36885774	2,9455990000
2047	09/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.105,55	0,00	3.091,23882700	2,9455990000
2022	09/11/2022	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	21.434.315,78	6.011.512,45731157	3,5655446000
2021	09/11/2022	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	2.524.111,50	707.917,52261352	3,5655446000
2020	09/11/2022	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	628,90	176,38259244	3,5655446000
2019	09/11/2022	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	128.819,39	36.128,95208210	3,5655446000
2003	09/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	433.110,66	0,00	147.036,53144912	2,9455990000
2068	09/11/2022	NTN-B 150535 (5,886400%)	7.207.828,92	0,00	1.750,00000000	4.118,7593800000
2070	09/11/2022	NTN-B 150860 (5,926400%)	16.880.046,66	0,00	4.150,00000000	4.067,4811230000
2059	09/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.045,93	0,00	2.392,01941608	2,9455990000
2048	10/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	71.208,51	0,00	24.177,39127246	2,9452520000
2033	10/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	33.577.740,60	0,00	11.400.634,17323800	2,9452520000
2032	10/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	55.362,03	18.797,04226900	2,9452520000
2005	10/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.477.974,61	0,00	4.236.640,73906070	2,9452520000
2004	10/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	18.826,46	6.392,13894091	2,9452520000
2034	11/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	22.540,00	0,00	7.651,47822200	2,9458360000
2049	14/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.014,37	0,00	3.057,51273000	2,9482690000
2036	14/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.573,10	0,00	1.211,93147500	2,9482690000
2035	14/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	845.494,66	286.776,63401813	2,9482690000
2006	14/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	843.977,18	286.261,93200146	2,9482690000
2060	14/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	851.023,11	288.651,78516614	2,9482690000
2038	16/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	65.966,64	0,00	22.370,19488500	2,9488630000
2037	16/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.026,52	1.026,33325400	2,9488630000
2023	16/11/2022	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	8.136.592,06	0,00	2.277.543,82868183	3,5725293000
2061	16/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.045,93	0,00	2.389,37176800	2,9488630000
2040	17/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.481.467,02	0,00	4.909.249,78464883	2,9498330000
2039	17/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.914,67	2.344,08750600	2,9498330000
2007	17/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.777.385,05	0,00	602.537,51653000	2,9498330000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2041	18/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.590,34	0,00	877,91083200	2,9505730000
2050	21/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	25.309,74	0,00	8.572,09336600	2,9525740000
2051	22/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.663,57	0,00	5.302,91319500	2,9537670000
2025	23/11/2022	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	8.156.974,94	2.277.543,82910210	3,5814788000
2024	23/11/2022	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	265.678,96	74.181,35771179	3,5814788000
2069	23/11/2022	NTN-B 150535 (6,216000%)	2.543.661,05	0,00	650,00000000	3.913,3246900000
2071	23/11/2022	NTN-B 150860 (6,225100%)	5.878.992,85	0,00	1.500,00000000	3.919,3285693000
2042	29/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	21.423.616,07	7.231.146,35422700	2,9626860000
2052	29/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.156,30	0,00	2.415,47703600	2,9626860000
2009	30/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	663.530,94	0,00	223.834,49231577	2,9643820000
2008	30/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	32.267.693,34	10.885.133,33900200	2,9643820000
2062	30/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	38.462.076,16	12.974.736,77818850	2,9643820000
2053	30/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.533,47	0,00	5.914,71342000	2,9643820000
2044	30/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.914.861,61	0,00	983.294,86887900	2,9643820000
2043	30/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	108.490.580,54	36.598.043,21381200	2,9643820000
2146	01/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.045,93	2.375,80637000	2,9657000000
2096	01/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	312.075,55	0,00	105.228,29348889	2,9657000000
2084	01/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	54.896,17	0,00	18.510,35843100	2,9657000000
2127	01/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.665,06	3.258,94673700	2,9657000000
2126	01/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.080,55	0,00	4.747,79984400	2,9657000000
2097	05/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.792,07	2.624,89869700	2,9685220000
2128	06/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	659.886,42	0,00	222.182,93247103	2,9700140000
2147	07/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	46.926.696,07	0,00	15.789.511,32177200	2,9720170000
2148	07/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.451.815,76	4.189.685,24055100	2,9720170000
2098	07/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	132.113.200,38	0,00	44.452.370,35319784	2,9720170000
2085	07/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.335,91	0,00	4.823,62987800	2,9720170000
2099	07/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	44.139.251,62	14.851.614,78356400	2,9720170000
2130	07/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.510.922,01	2.863.685,50660700	2,9720170000
2129	07/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	35.998.887,76	0,00	12.112.611,65733574	2,9720170000
2101	08/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.606,33	3.566,60973000	2,9737840000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2100	08/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	188.331,96	0,00	63.330,74628151	2,9737840000
2131	08/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	164.244,90	0,00	55.230,94481600	2,9737840000
2102	12/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.442.218,87	0,00	2.164.369,89981814	2,9764870000
2086	13/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.190,13	0,00	2.414,44571300	2,9779630000
2104	13/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	31.226,83	10.485,96972800	2,9779630000
2103	13/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.702.895,58	0,00	2.922.432,40765584	2,9779630000
2087	14/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.216,94	0,00	1.079,75971600	2,9793110000
2105	14/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.578.717,70	0,00	5.228.966,59663900	2,9793110000
2106	14/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.343.446,91	1.457.869,59012900	2,9793110000
2132	14/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.059.877,34	0,00	691.393,86254000	2,9793110000
2150	15/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	27.315.860,13	9.162.125,48245130	2,9813890000
2149	15/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	45.462.657,98	0,00	15.248.817,91004100	2,9813890000
2108	15/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	45.913.783,47	15.400.131,77317500	2,9813890000
2107	15/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	101.772.434,59	0,00	34.135.912,68700500	2,9813890000
2088	15/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	96.061,06	0,00	32.220,23694325	2,9813890000
2134	15/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	22.134.451,33	7.424.207,75278800	2,9813890000
2133	15/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	24.105.809,81	0,00	8.085.429,24455600	2,9813890000
2151	16/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	830.884,23	278.555,86299700	2,9828280000
2109	16/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.901.282,71	0,00	6.001.446,51652700	2,9828280000
2089	16/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	138.229,01	0,00	46.341,59596100	2,9828280000
2110	16/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	976.042,49	327.220,50619800	2,9828280000
2136	16/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	830.883,63	278.555,66237400	2,9828280000
2135	16/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	775.776,00	0,00	260.080,70193789	2,9828280000
2090	19/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	85.715,54	0,00	28.722,50578367	2,9842640000
2112	19/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.063,45	1.026,53441100	2,9842640000
2111	19/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.858.701,40	0,00	2.968.471,08700800	2,9842640000
2137	19/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.674.683,46	0,00	1.901.535,34003600	2,9842640000
2114	20/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.472.391,54	1.162.882,88044700	2,9860200000
2091	20/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	65.812,64	0,00	22.040,25425148	2,9860200000
2113	20/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.695.523,70	0,00	567.820,61071259	2,9860200000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2139	20/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	70.985,12	23.772,48636000	2,9860200000
2138	20/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.672.353,75	0,00	1.229.849,01306700	2,9860200000
2115	21/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.769.592,37	0,00	1.596.441,46215700	2,9876400000
2092	21/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	160.536,12	0,00	53.733,42169700	2,9876400000
2140	21/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	868.342,43	0,00	290.644,93379300	2,9876400000
2116	22/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.070,84	0,00	1.361,79602200	2,9893170000
2093	22/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	87.360,92	0,00	29.224,37466400	2,9893170000
2141	22/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.945.519,04	985.348,50496700	2,9893170000
2152	23/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	400,00	133,73815200	2,9909140000
2118	23/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	29.634,74	9.908,25546300	2,9909140000
2117	23/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.430,40	0,00	10.174,28117291	2,9909140000
2120	26/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	25.201.638,62	8.422.129,31672900	2,9923120000
2119	26/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.953.367,30	0,00	652.795,33016611	2,9923120000
2094	26/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.057,04	0,00	1.021,63143400	2,9923120000
2122	27/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	20.298,97	6.780,21376300	2,9938540000
2121	27/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.399.424,29	0,00	3.139.573,36930926	2,9938540000
2142	27/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.034.256,25	0,00	679.477,43944700	2,9938540000
2123	28/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.501.728,77	0,00	10.182.411,32206600	2,9955310000
2143	28/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.757.936,77	0,00	1.254.514,39828100	2,9955310000
2154	29/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	49.773.164,43	16.607.174,84104571	2,9970880000
2153	29/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	46.864.302,23	0,00	15.636.612,01472800	2,9970880000
2095	29/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.147,56	0,00	1.050,20606600	2,9970880000
2125	29/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	185.202.283,33	61.794.075,89300014	2,9970880000
2124	29/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	108.604.635,65	0,00	36.236.718,99190147	2,9970880000
2145	29/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	41.069.690,45	13.703.198,05677800	2,9970880000
2144	29/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	27.825.272,96	0,00	9.284.102,75574100	2,9970880000
Total			1.282.942.798,09	1.003.583.170,69		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 9.604.821,17

Value-At-Risk: 0,60%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		0,60	0,60			1.597.089.107,56	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,27%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,634200%)		0,17	0,00	0,14			29.927.637,19	1,87
NTN-B 150535 (5,784900%)		0,17	0,00	0,14			30.371.148,83	1,90
NTN-B 150535 (5,886400%)		0,17	0,00	0,17			7.121.704,70	0,45
NTN-B 150535 (5,909200%)		0,17	0,00	0,14			81.232.927,12	5,09
NTN-B 150535 (5,927000%)		0,20	-0,00	0,23			12.166.800,50	0,76
NTN-B 150535 (6,216000%)		0,25	0,00	0,28			2.573.407,68	0,16
NTN-B 150545 (5,900200%)		0,17	0,00	0,14			122.435.719,41	7,67
NTN-B 150832 (5,763300%)		0,17	0,00	0,14			41.539.685,72	2,60
NTN-B 150860 (5,599600%)		0,17	0,00	0,14			86.772.499,68	5,43
NTN-B 150860 (5,788000%)		0,17	0,00	0,14			71.741.042,83	4,49
NTN-B 150860 (5,926400%)		0,25	-0,00	0,26			17.166.826,82	1,07
NTN-B 150860 (5,949840%)		0,17	0,00	0,14			70.083.240,45	4,39
NTN-B 150860 (5,959200%)		0,17	0,00	0,14			82.339.931,12	5,16
NTN-B 150860 (5,986700%)		0,25	-0,00	0,26			28.705.871,39	1,80
NTN-B 150860 (6,225100%)		0,25	-0,00	0,26			5.947.804,24	0,37
Sub-total	0,38	0,16	0,01		-0,69	0,86	690.126.247,68	43,21

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		0,11	0,01	0,01			463.005.020,51	28,99

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,31	0,06	2,13			203.073.305,13	12,72
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		3,42	0,02	0,77			29.308.342,53	1,84
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		1,31	0,00	1,29			12.319.971,67	0,77
Sub-total	1,01	0,57	0,10		0,00	1,13	707.706.639,84	44,31

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			108.387.669,93	6,79
BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI		0,01	-0,00	0,01			514.867,79	0,03
Sub-total	0,04	0,01	0,00		1,02	1,17	108.902.537,72	6,82

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 11,35%

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		11,41	0,17	8,02			28.714.099,15	1,80
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		11,49	0,14	7,74			23.855.932,72	1,49
Sub-total	17,63	11,35	0,32		-0,34	-4,88	52.570.031,87	3,29

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 13,54%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		13,54	0,09	1,33			19.690.199,16	1,23
Sub-total	22,36	13,54	0,09		-0,26	-4,79	19.690.199,16	1,23

Renda Variável

Value-At-Risk: 15,10%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		16,17	0,06	9,00			11.454.679,63	0,72

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo		Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO			13,55	0,03	6,43			6.638.771,66	0,42
	Sub-total	31,23	15,10	0,09		-0,18	-4,45	18.093.451,29	1,13