

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

CONSOLIDADO

Período: dezembro de 2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

94,34%

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,634200%)	0,62	0,04	0,84	6,28	29.927.637,19	1,87
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	2,89	0,04	0,86	3,80	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	8,54	81.232.927,12	5,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	4,80	0,04	0,87	2,55	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	8,19	122.435.719,41	7,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	2,93	0,04	0,86	8,08	41.539.685,72	2,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	2,81	0,04	0,84	7,44	86.772.499,68	5,43
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	2,89	0,04	0,86	6,39	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	3,89	70.083.240,45	4,39
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	2,96	0,04	0,87	8,58	82.339.931,12	5,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	4,18	0,04	0,87	2,65	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	Ano		
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea a	0,66	0,04	0,86	8,47	690.126.247,68	43,21

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	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,48	0,05	1,15	11,74	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	9,05	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	5,79	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	8,65	12.319.971,67	0,77	2.756.777.028,75	0,45
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	1,59	0,05	1,13	10,26	707.706.639,84	44,31		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,09	0,05	1,17	5,04	108.387.669,93	6,79	7.627.582.136,16	1,42
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,08	0,05	1,10	10,29	514.867,79	0,03	11.421.565.249,40	0,00
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	0,78	0,05	1,17	11,68	108.902.537,72	6,82		
		Renda Fixa	1,00	0,05	1,01	10,21	1.506.735.425,24	94,34		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

1,13%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	28,30	-0,02	-5,27	-26,66	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	-15,33	6.638.771,66	0,42	569.834.602,44	1,17
Sub-total Artigo 8º I			24,69	-0,02	-4,45	-20,60	18.093.451,29	1,13		
Renda Variável			24,69	-0,02	-4,45	-20,60	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	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	26,84	-0,00	-4,79	-28,54	19.690.199,16	1,23	1.938.590.167,99	1,02
Sub-total Artigo 9º III			26,84	-0,00	-4,79	-28,54	19.690.199,16	1,23		
Investimentos no Exterior			26,84	-0,00	-4,79	-28,54	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	Ano				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	24,01	0,05	-4,87	-4,29	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	-11,97	23.855.932,72	1,49	1.723.160.287,50	1,38
Sub-total Artigo 10º I			23,99	0,05	-4,88	-9,94	52.570.031,87	3,29		
Investimentos Estruturados			23,99	0,05	-4,88	-9,94	52.570.031,87	3,29		
Total			2,18	0,04	0,63	7,39	1.597.089.107,56	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	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					

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	0,86 76,76	8,47 82,75	2,52 78,73	3,11 46,98		5.900.132,14	43.669.343,72
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,13 100,38	10,26 82,90	2,78 87,00	4,69 70,96	10,26 82,90	7.637.711,68	65.803.730,87
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,17 103,76	11,68 94,36	3,23 101,08	6,76 102,18	11,68 94,36	1.254.701,80	11.758.154,52
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-4,45 -2,00	-20,60 -25,28	-10,24 -9,97	-1,65 -13,01	-20,60 -25,28	-842.081,78	-6.297.562,52
Artigo 9º III % do CDI	-4,79 -426,73	-28,54 -230,65	3,52 110,00	-0,98 -14,87	-28,54 -230,65	-991.374,75	-7.863.502,77
Artigo 10º I % do CDI	-4,88 -434,43	-9,94 -80,36	9,84 307,82	9,32 140,93	-9,94 -80,36	-2.697.012,68	-6.877.920,42
CONSOLIDADO (Total)						10.262.076,41	100.192.243,40

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150535 (5,634200%)	29.676.995,01	0,00	0,00	0,00	29.927.637,19	250.642,18	1.820.642,31
NTN-B 150535 (5,784900%)	30.113.063,05	0,00	0,00	0,00	30.371.148,83	258.085,78	1.132.420,60
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	6.626.731,68
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.061.994,46	0,00	0,00	0,00	12.166.800,50	104.806,04	316.105,15
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	9.598.969,44
NTN-B 150832 (5,763300%)	41.187.409,77	0,00	0,00	0,00	41.539.685,72	352.275,95	3.163.417,64
NTN-B 150860 (5,599600%)	86.048.298,44	0,00	0,00	0,00	86.772.499,68	724.201,24	6.112.842,30
NTN-B 150860 (5,788000%)	71.131.208,70	0,00	0,00	0,00	71.741.042,83	609.834,13	4.376.696,84
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
NTN-B 150860 (5,949840%)	69.478.186,96	0,00	0,00	0,00	70.083.240,45	605.053,49	2.646.827,63

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150860 (5,959200%)	81.628.425,30	0,00	0,00	0,00	82.339.931,12	711.505,82	6.629.784,36
NTN-B 150860 (5,986700%)	28.457.197,88	0,00	0,00	0,00	28.705.871,39	248.673,51	740.370,45
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 Financ. Ano (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	1.002.484,19
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	17.254.341,17
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	1.643.623,29
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	38.391.355,37
					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 Financ. Ano (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	3.839.505,96
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	509.252,80	0,00	0,00	0,00	514.867,79	5.614,99	1.471.581,47
					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 Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES CONSUMO FIC	12.091.869,49	0,00	0,00	0,00	11.454.679,63	-637.189,86	-4.163.855,80
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	6.843.663,58	0,00	0,00	0,00	6.638.771,66	-204.891,92	-1.201.836,07
					18.093.451,29	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	20.681.573,91	0,00	0,00	0,00	19.690.199,16	-991.374,75	-7.863.502,77

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					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 Financ. Ano (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	-1.285.900,85
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	25.084.403,61	0,00	0,00	0,00	23.855.932,72	-1.228.470,89	-5.128.018,53
					52.570.031,87	0,00	0,00

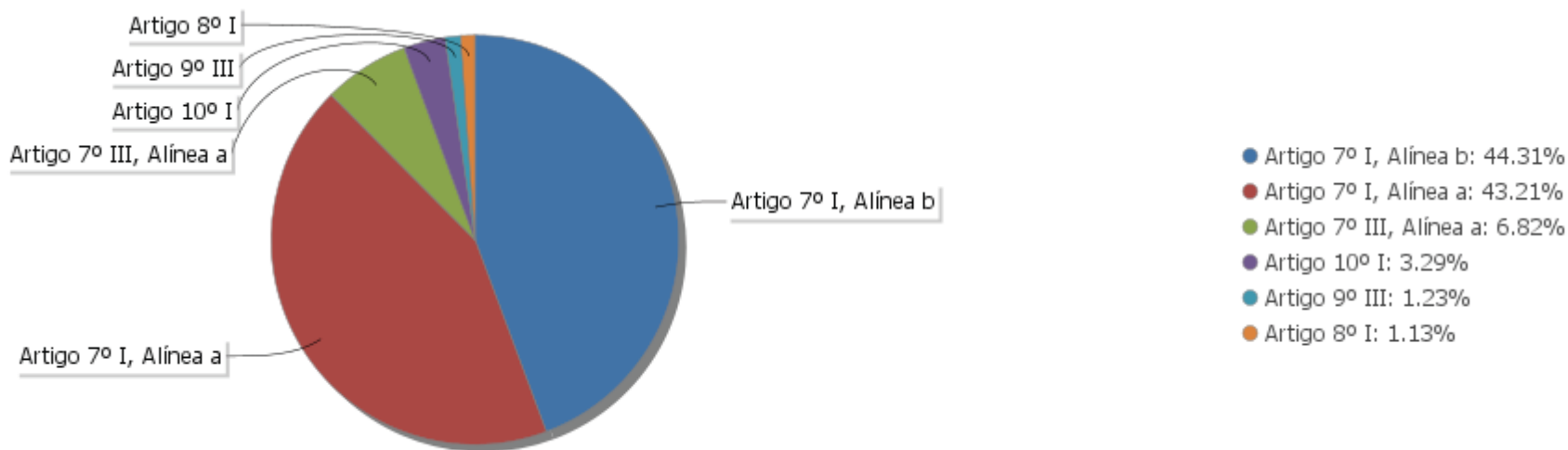
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

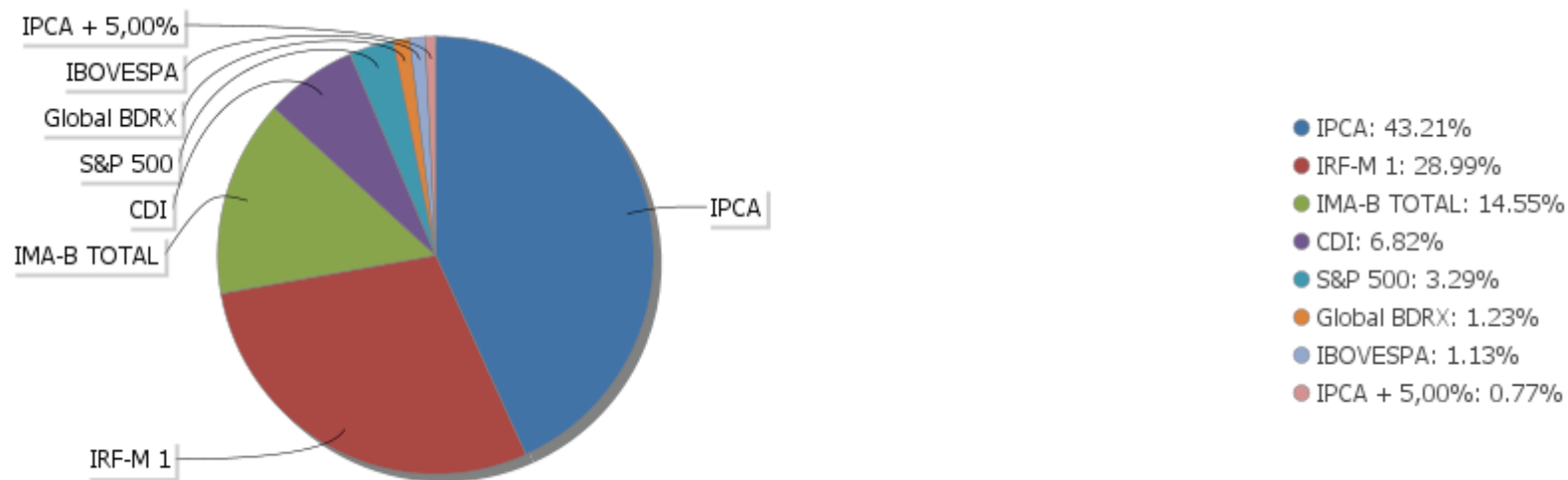
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	662.261.240,55	41,47	662.261.240,55	41,47
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	662.261.240,55	41,47
acima de 365 dias	934.827.867,01	58,53	1.597.089.107,56	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

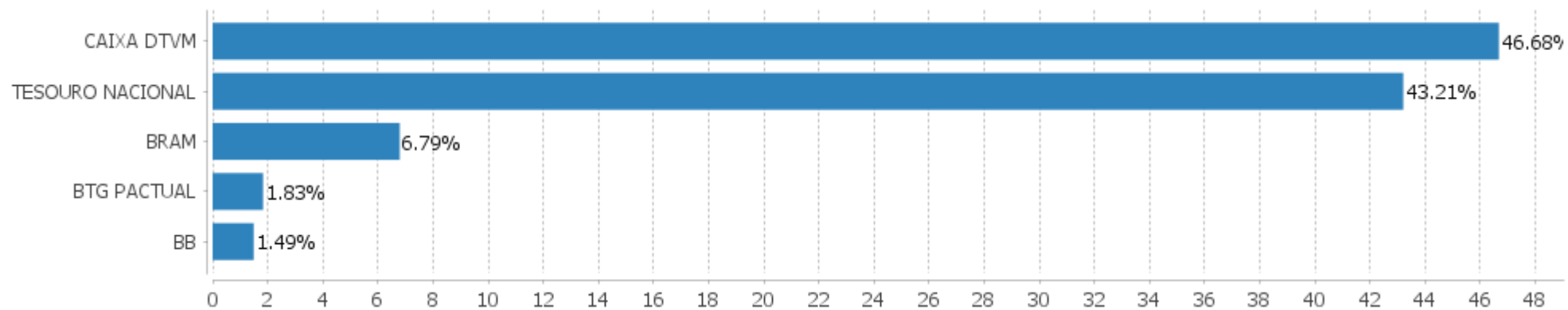


Alocação Por Estratégia



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

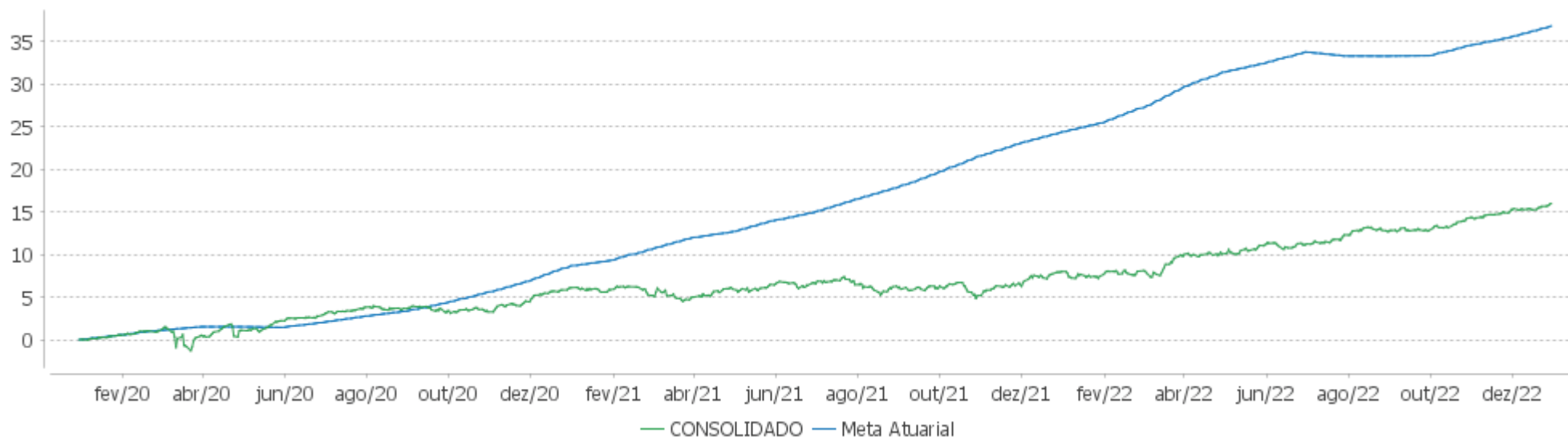
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

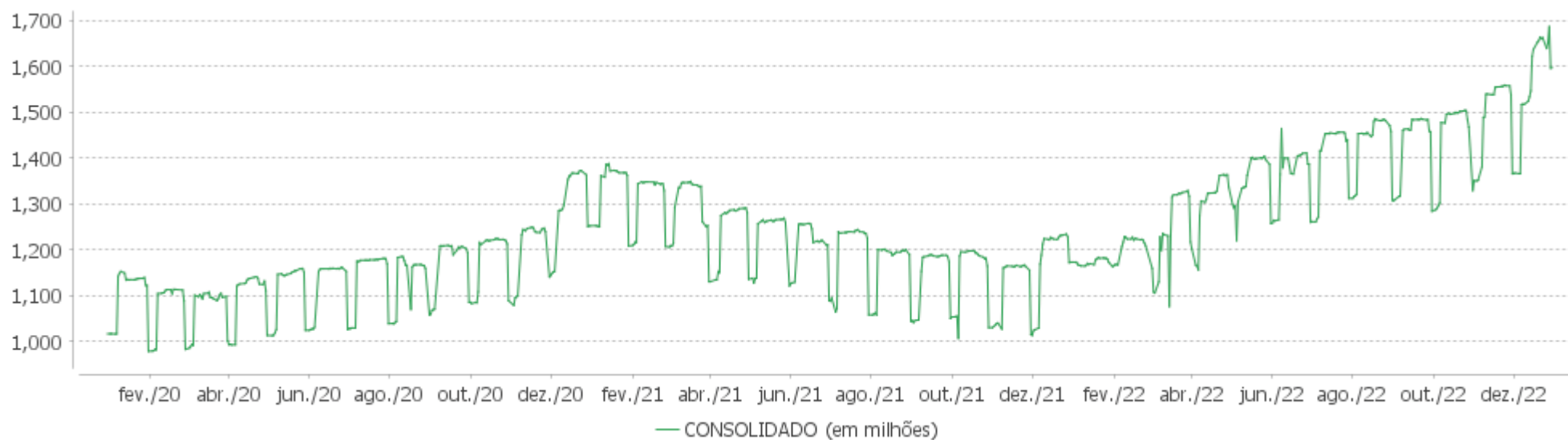
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	13	36,11	03 meses	2,81	2,61	0,19	1,45
Meses abaixo - Meta Atuarial	23	63,89	06 meses	4,36	2,28	2,07	1,60
			12 meses	7,39	10,00	-2,61	2,18
			24 meses	9,31	23,48	-14,17	2,48
			36 meses	15,97	33,88	-17,91	2,77
Maior rentabilidade da Carteira	1,64	2022-03	Desde 31/12/2019	15,97	33,88	-17,91	2,77
Menor rentabilidade da Carteira	-0,80	2021-10					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

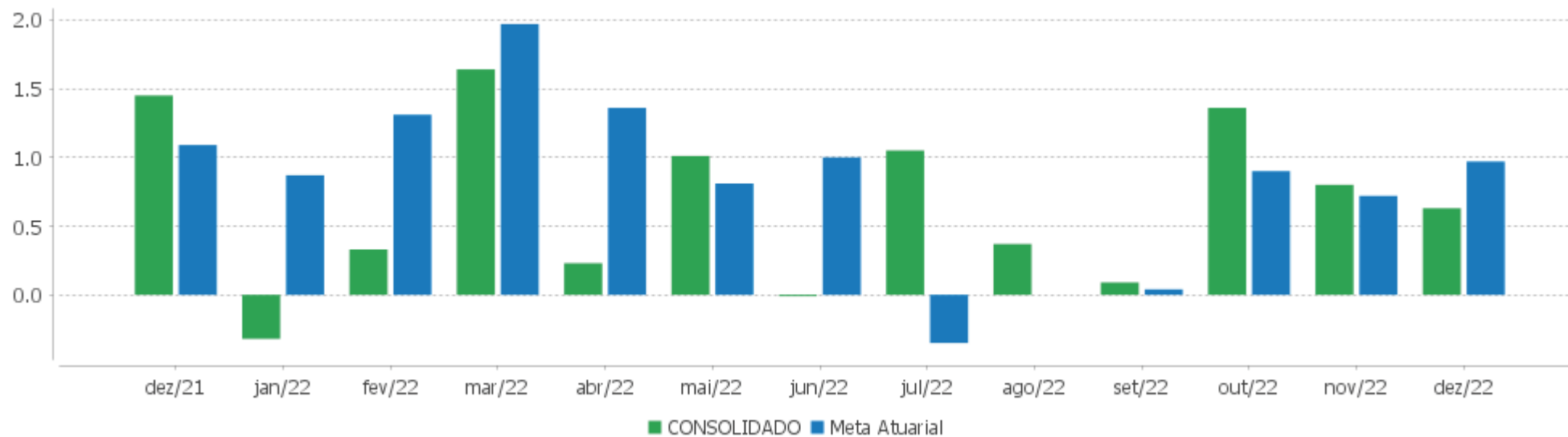


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150535 (5,784900%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,24	8,73 2,95	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	5,87 0,09	-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	8,71 2,92	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	8,81 3,03	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	5,80 0,02	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	8,88 3,09	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	11,72 5,94	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	12,01 6,23	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	5,78 -0,01	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	8,87 3,09	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	8,67 2,88	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	12,00 6,22	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	8,76 2,97	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	8,78 2,99	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	5,78 -0,01	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	9,05 2,68	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	5,79	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 Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,11	-0,58	-0,09	-0,75	-0,58	-2,23	0,63
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,32	8,60	2,71	2,69			
Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,27	-1,66	-0,15	-0,09			
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,15	11,74	3,09	6,56	11,74	14,76	18,92
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	-0,28	-0,06	-0,13	-0,28	-0,54	-0,80
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	1,17	13,00	3,34	6,89	13,00	18,58	21,11
% do CDI	103,79	105,05	104,31	104,19	105,05	107,34	102,67
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	1,10	12,27	3,16	6,54	12,27	17,09	19,36
% do CDI	98,16	99,15	98,71	98,94	99,15	98,70	94,18
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-2,99	-15,33	-7,72	5,14	-15,33	-29,83	-32,10
Var. IBOVESPA p.p.	-0,55	-20,01	-7,45	-6,22	-20,01	-22,03	-26,99
BB AÇÕES CONSUMO FIC	-5,27	-26,66	-14,33	-1,79	-26,66	-46,66	-46,19
Var. IBOVESPA p.p.	-2,82	-31,35	-14,05	-13,15	-31,35	-38,86	-41,08
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-4,79	-28,54	3,52	-0,98	-28,54	-6,74	44,34
Var. Global BDRX p.p.	-0,58	-0,49	-0,42	-0,37	-0,49	-2,90	-3,76
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-4,90	-11,97	9,70	6,79	-11,97	16,92	30,01
Var. S&P 500 p.p.	2,36	12,71	6,36	5,75	12,71	14,29	-23,83
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	-4,87	-7,99	9,97	11,52	-7,99	23,07	
Var. S&P 500 p.p.	2,39	16,69	6,63	10,48	16,69	20,43	
CONSOLIDADO	0,63	7,39	2,81	4,36	7,39	9,31	15,97
Var. IPCA + 4,00% p.p.	-0,34	-2,61	0,19	2,07	-2,61	-16,58	-20,85
CDI	1,12	12,37	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56
IBOVESPA	-2,45	4,69	-0,27	11,36	4,69	-7,80	-5,11
INPC + 6,00%	1,20	12,26	3,01	3,29	12,26	31,06	46,46
IPCA + 6,00%	1,13	12,11	3,10	3,27	12,11	30,76	44,83

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		
BRANCO 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

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	1,18	12,02	3,16	6,70	12,02	15,30	19,73	27,82	36,73
IRF-M 1+	1,62	7,41	1,10	6,63	7,41	2,06	10,68	26,44	41,95
IRF-M TOTAL	1,48	8,82	1,74	6,49	8,82	6,66	13,80	27,49	41,17
IMA-B 5	0,94	9,78	2,53	2,98	9,78	14,79	24,02	40,34	54,18
IMA-B 5+	-1,19	3,30	-1,72	1,24	3,30	-3,47	1,84	32,76	53,22
IMA-B TOTAL	-0,19	6,37	0,23	1,94	6,37	5,02	11,75	37,40	55,34
IMA-GERAL TOTAL	0,77	9,66	1,73	4,95	9,66	10,71	16,62	31,57	44,78
IDKA 2	1,24	9,34	2,25	2,34	9,34	14,78	24,67	39,41	53,01
IDKA 20	-3,32	-1,92	-5,66	0,71	-1,92	-16,13	-14,29	23,65	48,88
CDI	1,12	12,37	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56	27,75	35,96

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-2,45	4,69	-0,27	11,36	4,69	-7,80	-5,11	24,86	43,63
IBRX 100	-2,63	4,02	-0,39	10,33	4,02	-7,61	-4,37	27,56	47,23
IBRX 50	-2,55	5,72	0,38	12,12	5,72	-5,43	-2,00	26,57	44,96
SMALL CAP	-3,01	-15,06	-7,61	5,76	-15,06	-28,82	-29,28	11,87	20,97
Índice Consumo - ICON									
Índice Dividendos - IDIV	-1,61	12,65	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 Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-7,26	-24,68	3,34	1,04	-24,68	2,63	53,84	106,24	126,51

Investimentos Imobiliários

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

Investimentos no Exterior

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

Indicadores Econômicos

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

Meta Atuarial

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
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
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

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
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
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

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
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			696.413.255,78	475.302.747,49		

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