

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



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

# RELATÓRIO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS **CONSOLIDADO**

Período: 1º trimestre de 2023

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Posição de Ativos e Enquadramento**

**RENDA FIXA**

**93,73%**

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%)	0,60	0,06	1,46	3,62	31.009.726,81	2,06
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	2,88	0,06	1,48	3,65	31.480.482,02	2,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,886400%)	2,93	0,06	1,48	3,68	7.383.594,82	0,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	0,60	0,06	1,49	3,68	84.224.758,44	5,58
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	4,78	0,06	1,49	3,69	12.615.432,28	0,84
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,216000%)	4,21	0,06	1,51	3,76	2.670.119,09	0,18
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	0,60	0,06	1,49	3,68	126.942.397,83	8,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	0,60	0,06	1,47	3,65	41.840.054,98	2,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	0,60	0,06	1,46	3,61	87.473.547,34	5,80
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	0,60	0,06	1,48	3,65	72.296.920,34	4,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,926400%)	2,99	0,06	1,49	3,69	17.295.597,27	1,15
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	0,60	0,06	1,49	3,69	70.605.955,02	4,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	0,60	0,06	1,49	3,70	82.952.605,90	5,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	3,01	0,06	1,49	3,70	28.918.041,61	1,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,225100%)	3,11	0,06	1,51	3,76	5.989.155,57	0,40

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2023

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Trim.		
	<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>	<b>0,60</b>	<b>0,06</b>	<b>1,48</b>	<b>3,67</b>	<b>703.698.389,32</b>	<b>46,66</b>

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	0,42	0,03	1,21	3,33	337.994.759,54	22,41	7.183.936.024,67	4,70
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,70	-0,12	1,27	4,05	205.198.969,53	13,61	3.501.227.547,95	5,86
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	6,47	-0,07	2,78	4,40	29.717.703,25	1,97	224.743.717,51	13,22
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2,70	-0,12	1,27	4,06	12.460.991,96	0,83	3.204.967.185,63	0,39
		<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>	<b>1,45</b>	<b>-0,01</b>	<b>1,28</b>	<b>3,53</b>	<b>585.372.424,28</b>	<b>38,82</b>		

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.				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,05	0,05	1,15	3,20	12.222.058,00	0,81	12.273.058.316,83	0,10
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,04	0,05	1,08	1,37	358.380,65	0,02	3.847.917.325,94	0,01
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,05	0,05	1,17	3,21	111.862.341,44	7,42	7.612.606.824,57	1,47
		<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>	<b>0,57</b>	<b>0,05</b>	<b>1,16</b>	<b>3,20</b>	<b>124.442.780,09</b>	<b>8,25</b>		
		<b>Renda Fixa</b>	<b>0,73</b>	<b>0,02</b>	<b>1,36</b>	<b>3,58</b>	<b>1.413.513.593,69</b>	<b>93,73</b>		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2023

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### RENTA VARIÁVEL

1,06%

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	28,11	-3,18	-6,39	-13,02	9.963.776,08	0,66	103.513.265,51	9,63
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	26,87	-1,56	-1,83	-9,25	6.024.635,89	0,40	506.329.839,46	1,19
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>25,62</b>	<b>-2,58</b>	<b>-4,72</b>	<b>-11,63</b>	<b>15.988.411,97</b>	<b>1,06</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>25,62</b>	<b>-2,58</b>	<b>-4,72</b>	<b>-11,63</b>	<b>15.988.411,97</b>	<b>1,06</b>		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2023

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,42%

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	25,51	0,87	3,19	8,45	21.354.673,03	1,42	2.012.391.655,50	1,06
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>25,51</b>	<b>0,87</b>	<b>3,19</b>	<b>8,45</b>	<b>21.354.673,03</b>	<b>1,42</b>		
Investimentos no Exterior			25,51	0,87	3,19	8,45	21.354.673,03	1,42		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2023

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

3,79%

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	23,21	1,47	4,14	8,86	31.257.150,74	2,07	496.229.337,01	6,30
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	23,44	1,47	3,98	8,82	25.960.734,18	1,72	1.679.532.532,23	1,55
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>23,23</b>	<b>1,47</b>	<b>4,06</b>	<b>8,84</b>	<b>57.217.884,92</b>	<b>3,79</b>		
Investimentos Estruturados			23,23	1,47	4,06	8,84	57.217.884,92	3,79		
Total			1,69	0,06	1,41	3,65	1.508.074.563,61	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
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	703.698.389,32	46,66	0,00	57,40	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	585.372.424,28	38,82	0,00	20,33	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	124.442.780,09	8,25	0,00	22,27	60,00	0,00	60,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>1.413.513.593,69</b>	<b>93,73</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	15.988.411,97	1,06	0,00	0,00	30,00	0,00	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>15.988.411,97</b>	<b>1,06</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	21.354.673,03	1,42	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>21.354.673,03</b>	<b>1,42</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	57.217.884,92	3,79	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>57.217.884,92</b>	<b>3,79</b>					15,00
<b>Total</b>		<b>1.508.074.563,61</b>	<b>100,00</b>					

**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	1,48 126,05	3,67 112,84	3,67 112,84	6,28 95,81	11,47 86,41	10.267.667,80	25.089.540,76
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,28 108,94	3,53 108,50	3,53 108,50	6,41 97,78	11,07 83,35	9.099.217,16	25.589.862,06
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,16 99,08	3,20 98,60	3,20 98,60	6,54 99,83	13,24 99,67	1.431.627,51	3.669.289,78
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-4,72 -1,82	-11,63 -4,48	-11,63 -4,48	-20,68 -13,27	-33,04 -17,95	-792.694,12	-2.105.039,32
Artigo 9º III % do CDI	3,19 271,66	8,45 260,06	8,45 260,06	12,27 187,23	-3,59 -27,00	660.373,21	1.664.473,87
Artigo 10º I % do CDI	4,06 346,04	8,84 271,99	8,84 271,99	19,56 298,45	1,14 8,56	2.234.996,08	4.647.853,05
<b>CONSOLIDADO (Total)</b>						<b>22.901.187,64</b>	<b>58.555.980,20</b>

**RESULTADO POR ATIVO**

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
NTN-B 150535 (5,634200%)	30.562.882,21	0,00	0,00	0,00	31.009.726,81	446.844,60	1.082.089,62
NTN-B 150535 (5,784900%)	31.022.828,70	0,00	0,00	0,00	31.480.482,02	457.653,32	1.109.333,19
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.275.619,07	0,00	0,00	0,00	7.383.594,82	107.975,75	261.890,12
NTN-B 150535 (5,909200%)	82.991.448,20	0,00	0,00	0,00	84.224.758,44	1.233.310,24	2.991.831,32
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.430.511,78	0,00	0,00	0,00	12.615.432,28	184.920,50	448.631,78
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.630.323,01	0,00	0,00	0,00	2.670.119,09	39.796,08	96.711,41
NTN-B 150545 (5,900200%)	125.084.519,58	0,00	0,00	0,00	126.942.397,83	1.857.878,25	4.506.678,42
NTN-B 150832 (5,763300%)	41.232.567,86	0,00	0,00	0,00	41.840.054,98	607.487,12	1.492.029,80
NTN-B 150860 (5,599600%)	86.215.708,46	0,00	0,00	0,00	87.473.547,34	1.257.838,88	3.084.368,74
NTN-B 150860 (5,788000%)	71.245.704,62	0,00	0,00	0,00	72.296.920,34	1.051.215,72	2.581.700,43
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.042.087,13	0,00	0,00	0,00	17.295.597,27	253.510,14	623.309,57



Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2023

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
NTN-B 150860 (5,949840%)	69.569.578,48	0,00	0,00	0,00	70.605.955,02	1.036.376,54	2.548.537,49
NTN-B 150860 (5,959200%)	81.734.411,22	0,00	0,00	0,00	82.952.605,90	1.218.194,68	2.995.995,86
NTN-B 150860 (5,986700%)	28.492.680,73	0,00	0,00	0,00	28.918.041,61	425.360,88	1.046.332,60
NTN-B 150860 (6,225100%)	5.899.850,47	0,00	0,00	0,00	5.989.155,57	89.305,10	220.100,41
					703.698.389,32	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	12.304.282,61	0,00	0,00	0,00	12.460.991,96	156.709,35	494.573,78
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	202.617.640,23	0,00	0,00	0,00	205.198.969,53	2.581.329,30	8.151.173,79
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.915.027,91	0,00	0,00	0,00	29.717.703,25	802.675,34	1.267.528,84
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	337.139.880,96	252.790.672,01	-257.494.296,60	0,00	337.994.759,54	5.558.503,17	15.676.585,65
					585.372.424,28	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\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	354.560,85	0,00	0,00	0,00	358.380,65	3.819,80	4.827,16
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	110.572.979,06	0,00	0,00	0,00	111.862.341,44	1.289.362,38	3.474.671,51
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	12.083.612,67	0,00	0,00	0,00	12.222.058,00	138.445,33	189.791,11
					124.442.780,09	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	10.644.190,00	0,00	0,00	0,00	9.963.776,08	-680.413,92	-1.490.903,55
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	6.136.916,09	0,00	0,00	0,00	6.024.635,89	-112.280,20	-614.135,77
					15.988.411,97	0,00	0,00

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2023

### 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	20.694.299,82	0,00	0,00	0,00	21.354.673,03	660.373,21	1.664.473,87
					21.354.673,03	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	30.015.002,58	0,00	0,00	0,00	31.257.150,74	1.242.148,16	2.543.051,59
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	24.967.886,26	0,00	0,00	0,00	25.960.734,18	992.847,92	2.104.801,46
					57.217.884,92	0,00	0,00

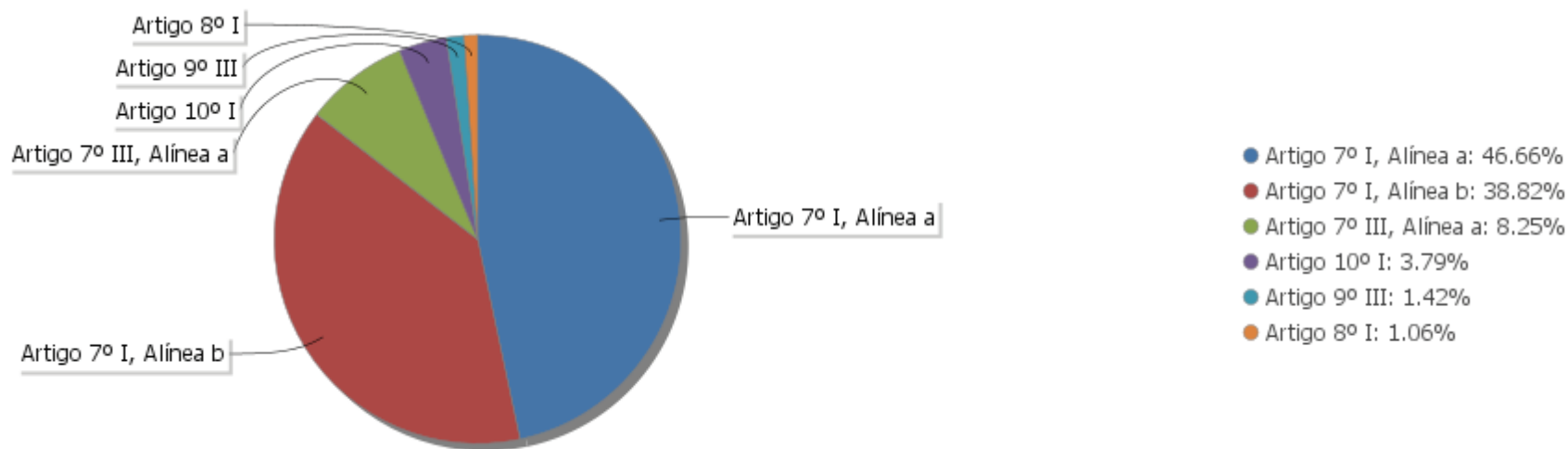
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Liquidez

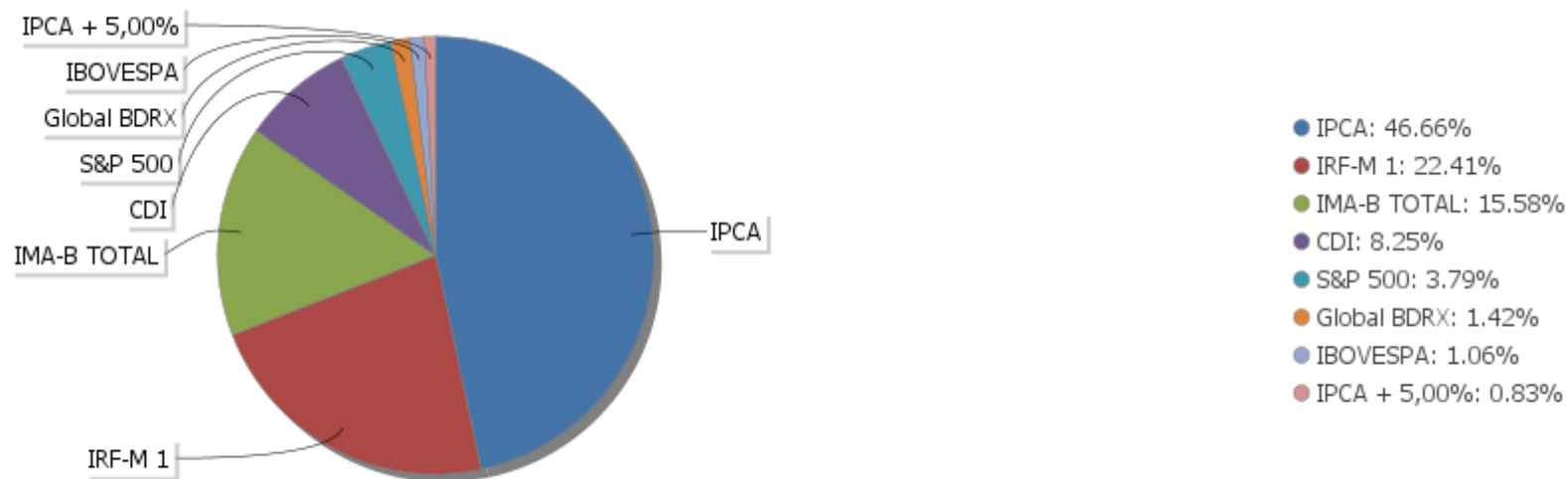
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	556.998.509,55	36,93	556.998.509,55	36,93	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	556.998.509,55	36,93	
acima de 365 dias	951.076.054,06	63,07	1.508.074.563,61	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

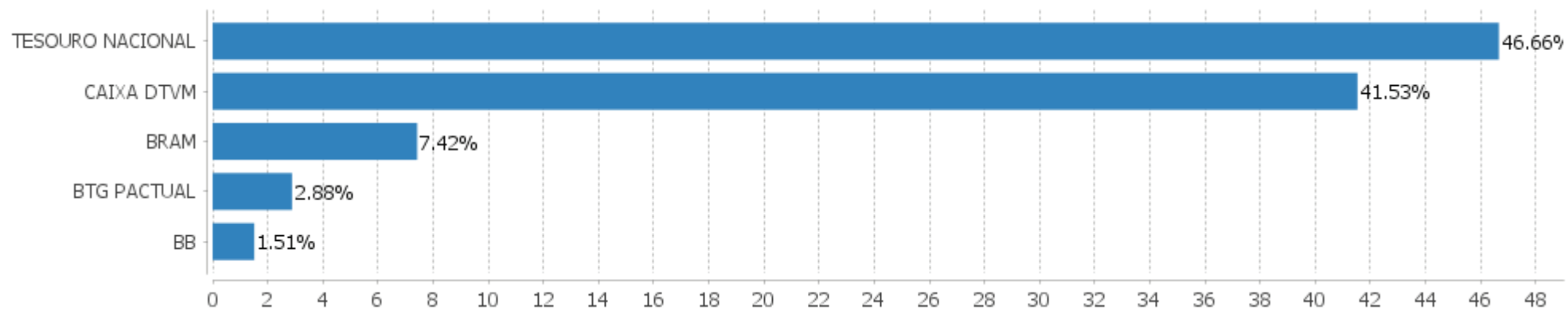


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



**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
2023	1,40	0,80	1,41										3,65
IPCA + 4,00%	0,87	1,12	1,07										3,10
p.p. indexador	0,53	-0,33	0,34										0,55
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	0,26	0,90	0,46	0,19	-0,17	-0,33	-0,08	-0,80	1,22	1,45	2,32
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	-0,86	0,44	-0,53	-0,50	-1,30	-1,38	-1,41	-2,21	0,11	0,54	-9,93
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

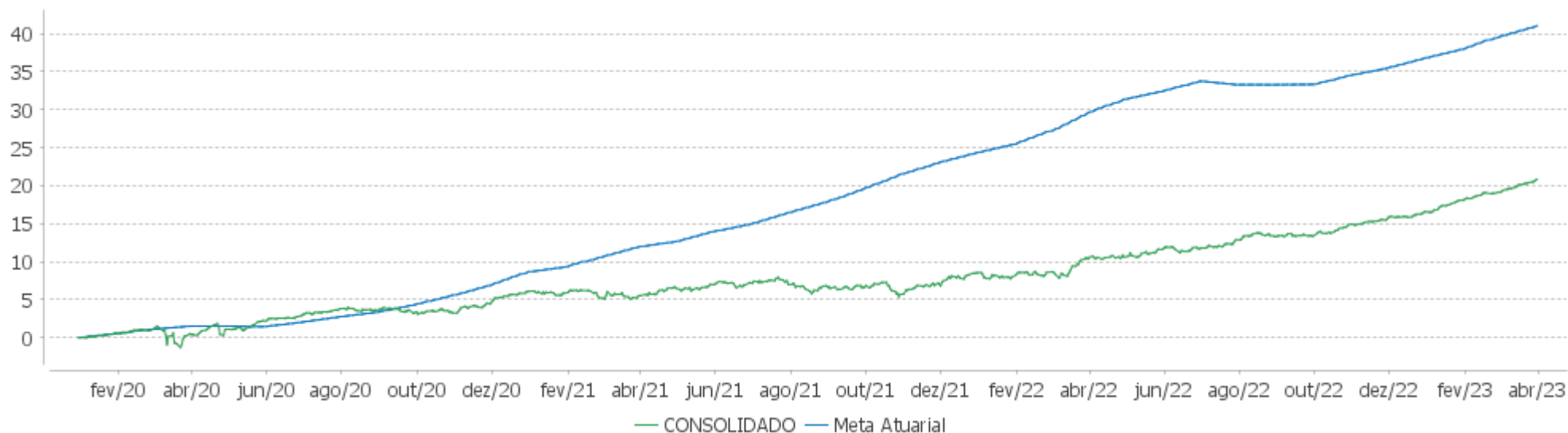
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

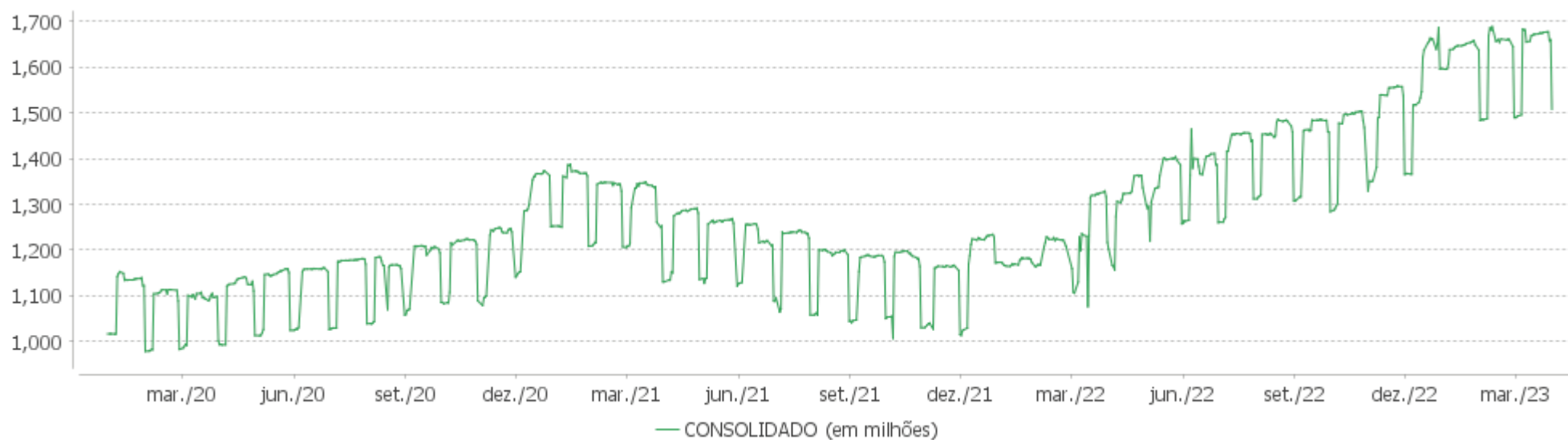
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	15	38,46	03 meses	3,65	3,10	0,55	0,97
Meses abaixo - Meta Atuarial	24	61,54	06 meses	6,56	5,80	0,77	1,23
			12 meses	9,49	8,84	0,66	1,69
			24 meses	14,50	24,15	-9,65	2,29
			36 meses	20,23	36,06	-15,83	2,34
Maior rentabilidade da Carteira	1,64	2022-03	Desde 31/12/2019	20,83	38,03	-17,19	2,65
Menor rentabilidade da Carteira	-0,80	2021-10					

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Evolução

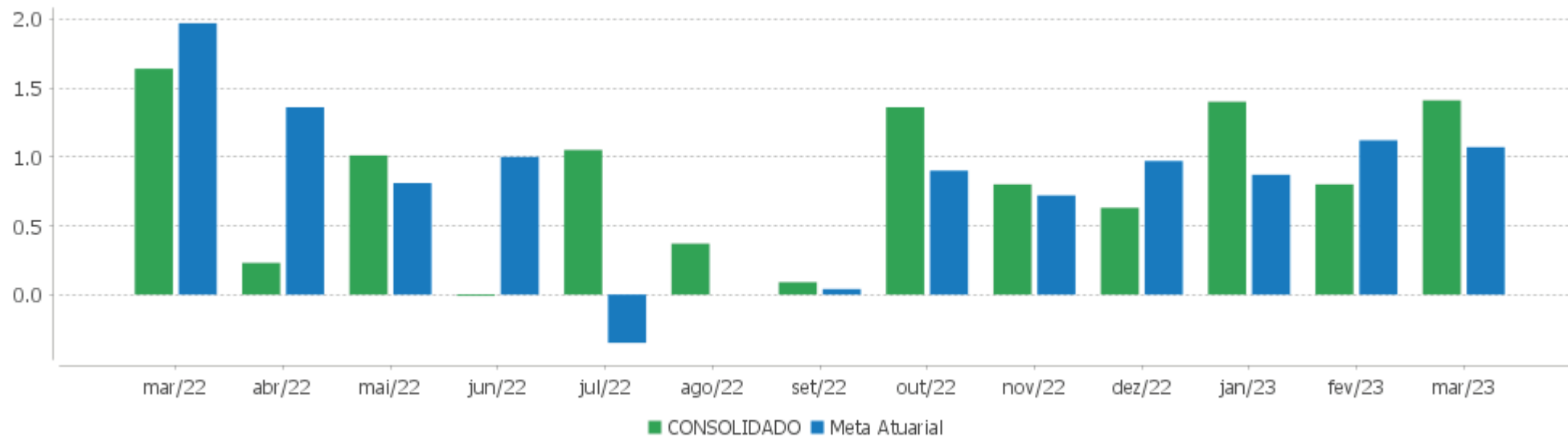


### Patrimônio Líquido



### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

#### Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses





EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150535 (5,784900%) Var. IPCA p.p.	1,48 0,77	3,65 1,56	3,65 1,56	6,25 2,49	8,29 3,64	19,73 3,25	26,43 2,85
NTN-B 150535 (6,216000%) Var. IPCA p.p.	1,51 0,80	3,76 1,66	3,76 1,66	3,36 -0,40	5,44 0,79		
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	1,47 0,76	3,65 1,55	3,65 1,55	6,24 2,48	11,38 6,72	23,13 6,66	29,99 6,41
NTN-B 150535 (5,886400%) Var. IPCA p.p.	1,48 0,77	3,68 1,58	3,68 1,58	6,30 2,54	8,37 3,72		
NTN-B 150860 (6,225100%) Var. IPCA p.p.	1,51 0,80	3,76 1,67	3,76 1,67	6,47 2,71	8,58 3,93		
NTN-B 150860 (5,959200%) Var. IPCA p.p.	1,49 0,78	3,70 1,60	3,70 1,60	6,33 2,58	11,62 6,97	23,51 7,04	30,55 6,97
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	1,49 0,78	3,68 1,59	3,68 1,59	6,31 2,55	11,56 6,91	23,41 6,93	30,38 6,80
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	1,46 0,75	3,62 1,52	3,62 1,52	6,17 2,42	11,27 6,62	22,94 6,46	29,75 6,17
NTN-B 150860 (5,986700%) Var. IPCA p.p.	1,49 0,78	3,70 1,61	3,70 1,61	6,35 2,59	8,45 3,80	20,02 3,54	26,86 3,28
NTN-B 150860 (5,949840%) Var. IPCA p.p.	1,49 0,78	3,69 1,60	3,69 1,60	6,33 2,57	11,60 6,95	23,50 7,03	30,54 6,96
NTN-B 150860 (5,599600%) Var. IPCA p.p.	1,46 0,75	3,61 1,51	3,61 1,51	6,16 2,40	11,24 6,59	23,05 6,57	30,01 6,43
NTN-B 150545 (5,900200%) Var. IPCA p.p.	1,49 0,78	3,68 1,59	3,68 1,59	6,31 2,55	11,54 6,89	23,42 6,94	30,42 6,84
NTN-B 150860 (5,788000%) Var. IPCA p.p.	1,48 0,77	3,65 1,56	3,65 1,56	6,25 2,49	11,43 6,78	23,29 6,82	30,29 6,71
NTN-B 150535 (5,927000%) Var. IPCA p.p.	1,49 0,78	3,69 1,59	3,69 1,59	6,24 2,48	8,31 3,66	19,83 3,35	26,61 3,04
NTN-B 150860 (5,926400%) Var. IPCA p.p.	1,49 0,78	3,69 1,59	3,69 1,59	6,32 2,57	8,42 3,77		
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,27 -1,39	4,05 0,08	4,05 0,08	6,87 2,65	9,41 1,90	18,64 6,28	28,64 4,62
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,78	4,40	4,40	4,54	7,66	12,97	23,69

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2023

**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	0,42	0,42	0,32	0,15	0,61	-0,34
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,27	4,06	4,06	6,87	9,39		
Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,11	0,71	0,71	0,58	-0,50		
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,21	3,33	3,33	6,53	12,96	18,52	21,21
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	-0,02	-0,02	-0,08	-0,23	-0,49	-0,77
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	1,17	3,21	3,21	6,65	13,70	21,72	24,21
% do CDI	99,27	98,62	98,62	101,47	103,20	105,72	104,24
BB PREV RF FLUXO FIC	1,08	2,99	2,99	6,03	12,15	18,06	19,38
% do CDI	91,71	92,03	92,03	91,98	91,46	87,91	83,42
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	1,15	3,20	3,20	6,46	13,07	20,33	22,04
% do CDI	97,54	98,44	98,44	98,55	98,39	98,97	94,88
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-1,83	-9,25	-9,25	-16,26	-28,20	-35,73	3,29
Var. IBOVESPA p.p.	1,08	-2,09	-2,09	-8,85	-13,10	-23,08	-36,23
BB AÇÕES CONSUMO FIC	-6,39	-13,02	-13,02	-25,48	-39,28	-51,27	-27,58
Var. IBOVESPA p.p.	-3,49	-5,86	-5,86	-18,07	-24,18	-38,62	-67,10
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	3,19	8,45	8,45	12,27	-3,59	-10,72	46,58
Var. Global BDRX p.p.	0,20	-0,27	-0,27	-0,74	-0,55	-2,69	-5,49
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3,98	8,82	8,82	19,38	-1,19	19,14	80,09
Var. S&P 500 p.p.	3,00	4,61	4,61	11,69	1,54	26,91	24,71
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	4,14	8,86	8,86	19,71	3,14	25,17	
Var. S&P 500 p.p.	3,17	4,65	4,65	12,02	5,87	32,94	
CONSOLIDADO	1,41	3,65	3,65	6,56	9,49	14,50	20,23
Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,34	0,55	0,55	0,77	0,66	-11,48	-18,74
CDI	1,17	3,25	3,25	6,55	13,28	20,54	23,23
IBOVESPA	-2,91	-7,16	-7,16	-7,41	-15,10	-12,65	39,53
INPC + 6,00%	1,18	3,38	3,38	6,49	10,62	31,02	48,44
IPCA + 6,00%	1,25	3,59	3,59	6,80	10,93	30,87	47,12

**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 PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		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		0,20
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 Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	1,23	3,35	3,35	6,61	13,19	19,00	21,98	30,11	38,81
IRF-M 1+	2,67	4,23	4,23	5,37	11,08	11,70	13,73	28,47	41,59
IRF-M TOTAL	2,15	3,89	3,89	5,70	11,55	13,99	16,56	29,49	41,33
IMA-B 5	1,52	4,38	4,38	7,03	10,38	20,01	30,21	42,37	55,45
IMA-B 5+	3,73	3,61	3,61	1,83	5,03	5,39	18,05	27,77	49,85
IMA-B TOTAL	2,66	3,98	3,98	4,22	7,51	12,36	24,02	35,36	53,92
IMA-GERAL TOTAL	1,86	3,63	3,63	5,42	10,83	16,27	22,06	32,40	45,00
IDKA 2	1,58	4,71	4,71	7,06	10,21	20,24	30,55	42,44	55,53
IDKA 20	6,29	2,22	2,22	-3,57	-0,11	-7,62	6,42	12,74	41,71
CDI	1,17	3,25	3,25	6,55	13,28	20,54	23,23	29,94	38,18

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-2,91	-7,16	-7,16	-7,41	-15,10	-12,65	39,53	6,78	19,35
IBRX 100	-3,07	-7,27	-7,27	-7,64	-16,05	-13,70	39,95	8,87	22,66
IBRX 50	-3,50	-7,76	-7,76	-7,41	-15,56	-12,07	44,85	7,72	19,11
SMALL CAP	-1,74	-9,51	-9,51	-16,40	-27,95	-35,01	6,96	-5,85	5,23
Índice Consumo - ICON	-5,95			-24,62	-38,13	-49,63	-23,97	-29,27	-29,77
Índice Dividendos - IDIV	-2,02	-4,08	-4,08	-1,06	-6,43	4,48	45,59	34,27	52,68

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2023

## 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	0,97	4,21	4,21	7,69	-2,74	-7,77	55,37	89,02	137,84

### Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,69	-3,70	-3,70	-7,68	-0,68	-3,01	10,70	11,20	17,11

### Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	0,30	4,02	4,02	9,83	-2,53	-14,34	42,88	65,81	95,59

### Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,71	2,09	2,09	3,76	4,65	16,48	23,58	27,66	33,50
INPC	0,64	1,88	1,88	3,46	4,36	16,60	24,69	28,82	34,84
IGPM	0,05	0,20	0,20	-0,89	0,17	14,96	50,71	60,97	74,28
SELIC	1,17	3,25	3,25	6,55	13,28	20,54	23,23	29,94	38,19

### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,07	3,10	3,10	5,80	8,84	25,98	38,97	49,35	62,38
IPCA + 5,00%	1,16	3,35	3,35	6,30	9,88	28,41	43,00	55,17	70,32
IPCA + 5,50%	1,20	3,47	3,47	6,55	10,41	29,64	45,05	58,15	74,41
IPCA + 5,89%	1,24	3,56	3,56	6,74	10,81	30,60	46,66	60,50	77,65
IPCA + 6,00%	1,25	3,59	3,59	6,80	10,93	30,87	47,12	61,17	78,57
INPC + 4,00%	1,00	2,89	2,89	5,49	8,54	26,12	40,22	50,70	64,00
INPC + 6,00%	1,18	3,38	3,38	6,49	10,62	31,02	48,44	62,64	80,36

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Movimentações**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2176	03/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.348,65	0,00	449,63947800	2,9994030000
2156	05/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	274.135,74	0,00	91.306,44790615	3,0023700000
2163	05/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.574.227,36	0,00	3.188.889,89698100	3,0023700000
2157	06/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.939.185,23	0,00	1.976.216,01540196	3,0053320000
2164	06/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.198.604,79	0,00	7.719.148,76293200	3,0053320000
2165	09/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.672,77	0,00	556,22261900	3,0073750000
2166	10/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	102.842,10	0,00	34.182,59594900	3,0086100000
2177	10/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	40.120,27	0,00	13.335,15144868	3,0086100000
2178	11/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.987,35	0,00	660,06430700	3,0108430000
2179	13/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.390,56	0,00	461,15810100	3,0153650000
2180	16/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.125,10	0,00	1.699,69482300	3,0153060000
2181	17/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	437,41560200	3,0177250000
2158	19/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.564,02	0,00	2.173,00352500	3,0207130000
2167	19/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.188.220,98	0,00	393.357,78672121	3,0207130000
2159	20/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.000,00	0,00	3.309,03180300	3,0220320000
2168	20/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.800,00	0,00	926,52890500	3,0220320000
2182	23/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.104,66	0,00	5.327,83853579	3,0227380000
2183	25/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	257.522,78	0,00	85.078,73464258	3,0268760000
2184	25/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	185.082,89	0,00	61.146,50550600	3,0268760000
2185	26/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	100.013,61	0,00	33.028,31759800	3,0281170000
2171	27/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.654.038,24	3.187.270,45912400	3,0289360000
2170	27/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.654.038,24	3.187.270,45748700	3,0289360000
2186	27/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.834,41	0,00	605,62851100	3,0289360000
2169	27/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.654.038,24	0,00	3.187.270,46065000	3,0289360000
2160	30/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	24.111,90	0,00	7.956,75903282	3,0303670000
2173	30/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.654.651,94	3.845.953,95079000	3,0303670000
2172	30/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	75.545,04	0,00	24.929,33694170	3,0303670000
2161	31/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	120.118,25	0,00	39.613,84512800	3,0322290000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2162	31/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	29.164.265,28	9.618.094,57199800	3,0322290000
2175	31/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	97.699.936,79	32.220.500,75646900	3,0322290000
2174	31/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.349.249,45	0,00	774.759,90434759	3,0322290000
2155	31/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	31.507.680,52	10.390.930,40796061	3,0322290000
2198	01/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	969,28044500	3,0328890000
2205	02/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	361.521,03	0,00	119.165,72037300	3,0337670000
2206	06/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.042.644,95	0,00	673.154,50938675	3,0344370000
2188	06/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.000,00	3.295,50424016	3,0344370000
2187	06/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	253.696,23	0,00	83.605,70016700	3,0344370000
2230	07/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	43.192.863,38	0,00	14.217.780,42210700	3,0379470000
2189	07/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	27.585.391,29	0,00	9.080.274,04362222	3,0379470000
2208	07/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	26.173,22	8.615,43010000	3,0379470000
2199	07/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.246,16	0,00	1.397,70706900	3,0379470000
2207	07/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	108.024.982,53	0,00	35.558.547,44338858	3,0379470000
2190	08/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.326.158,55	0,00	1.422.626,41213300	3,0409660000
2209	08/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.454.848,69	0,00	4.095.688,24182800	3,0409660000
2191	09/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	205.221,70	0,00	67.414,68689800	3,0441690000
2211	09/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.374.999,97	2.094.167,56123000	3,0441690000
2210	09/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	448.703,09	0,00	147.397,56235600	3,0441690000
2200	09/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.945,07	0,00	2.609,93065700	3,0441690000
2192	10/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.833.516,62	0,00	602.037,68948337	3,0455180000
2213	10/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.748.013,89	4.514.179,16179300	3,0455180000
2212	10/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.745.993,78	0,00	6.155.272,69252718	3,0455180000
2232	13/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	17.742.045,05	5.824.658,92278400	3,0460230000
2231	13/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.385.460,56	0,00	1.768.030,16917400	3,0460230000
2193	13/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.915.291,35	1.613.675,06071700	3,0460230000
2201	13/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.091,03	0,00	686,47872900	3,0460230000
2215	13/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	27.988.483,19	9.188.533,10900900	3,0460230000
2214	13/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.027.000,88	0,00	3.948.427,46755300	3,0460230000
2194	14/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.724,60	0,00	4.830,09891000	3,0485090000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2216	14/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.211,83	0,00	4.333,86616200	3,0485090000
2228	15/02/2023	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,00	353.553,49	317.640,72101700	1,1130609730
2229	15/02/2023	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	11.517.399,10	0,00	3.120.720,83579204	3,6906214000
2217	15/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.278,75	0,00	9.919,78663000	3,0523590000
2227	16/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	353.553,49	0,00	143.247,77017400	2,4681256090
2219	16/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.002,44	0,00	1.965,23665400	3,0543090000
2218	16/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	59.316,97	0,00	19.420,74950500	3,0543090000
2195	17/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.883.677,60	0,00	2.252.710,59527100	3,0557310000
2220	17/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	362.118,39	0,00	118.504,66876800	3,0557310000
2202	22/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.629,61	0,00	533,31286800	3,0556360000
2203	23/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.044,03	0,00	341,53428200	3,0568820000
2221	23/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.400,00	0,00	457,98300300	3,0568820000
2222	24/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	14.391,13	4.707,02924000	3,0573700000
2204	24/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.044,38	0,00	6.229,00728400	3,0573700000
2224	27/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	17.359.728,81	5.672.337,28532900	3,0604190000
2223	27/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.339,64	0,00	4.032,00999600	3,0604190000
2233	28/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	31.676.921,44	10.346.754,96909100	3,0615320000
2197	28/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	29.147.134,74	9.520.440,98860300	3,0615320000
2196	28/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	723.203,02	0,00	236.222,59052004	3,0615320000
2226	28/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	98.645.782,32	32.221.052,17851600	3,0615320000
2225	28/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.833.971,42	0,00	925.671,01046143	3,0615320000
2234	01/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	650.614,08	0,00	212.357,69714714	3,0637650000
2252	01/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.213.414,90	1.375.240,88825351	3,0637650000
2251	01/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.593.276,83	0,00	1.172.830,43249074	3,0637650000
2235	02/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.691,10	0,00	9.360,98170000	3,0649670000
2253	02/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	705.752,95	0,00	230.264,45309199	3,0649670000
2254	03/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	74.289,73	24.228,51989916	3,0662100000
2279	03/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	398.956,25	0,00	130.113,80499053	3,0662100000
2280	03/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	398.956,25	130.113,80499053	3,0662100000
2236	06/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	125.503,38	0,00	40.895,40605400	3,0688870000



Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2023

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2256	06/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	528,30	172,14707200	3,0688870000
2255	06/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	832.313,04	0,00	271.210,06410467	3,0688870000
2237	07/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	36.200.487,04	0,00	11.786.510,43564200	3,0713490000
2238	07/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.546.779,10	503.615,54547800	3,0713490000
2239	07/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.546.779,10	503.615,54518800	3,0713490000
2257	07/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	144.567.513,26	0,00	47.069.712,12323965	3,0713490000
2258	07/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.807.600,89	9.379.461,88791961	3,0713490000
2282	07/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.478.661,08	3.411.745,48293300	3,0713490000
2281	07/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	49.221.176,61	0,00	16.025.914,54439075	3,0713490000
2241	08/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.314.343,43	2.053.947,31647600	3,0742480000
2240	08/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.434.142,96	0,00	791.784,83973967	3,0742480000
2259	08/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	192.810,70	0,00	62.718,00453300	3,0742480000
2261	09/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	29.874,16	9.710,05825800	3,0766200000
2260	09/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.644,81	0,00	6.710,22420700	3,0766200000
2242	10/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.364.728,15	1.418.775,07308600	3,0764060000
2263	10/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.848.090,67	4.501.385,92395000	3,0764060000
2262	10/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.686,94	0,00	5.749,22165670	3,0764060000
2274	10/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.091,03	0,00	679,69897300	3,0764060000
2283	10/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.741.904,35	2.516.541,81860262	3,0764060000
2243	13/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.459,72	4.370,38892600	3,0797530000
2244	14/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	288.783,62	0,00	93.741,89328400	3,0806250000
2264	14/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.514.385,02	0,00	3.088.459,32886900	3,0806250000
2246	15/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.329,52	431,21111500	3,0832200000
2245	15/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.525,90	0,00	494,90467700	3,0832200000
2265	15/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.705,92	0,00	3.472,31790100	3,0832200000
2275	21/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.424,66	0,00	5.641,68315400	3,0885570000
2288	22/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	54.483,45	0,00	17.632,44124914	3,0899550000
2276	23/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.384,49	0,00	448,13304000	3,0894620000
2266	24/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.506,93	0,00	1.457,54868000	3,0921300000
2284	24/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	19.754,07	6.388,49880200	3,0921300000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2023

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2267	27/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.051,05	0,00	339,70741900	3,0939860000
2285	27/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.643,27	0,00	1.823,94813600	3,0939860000
2268	28/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.355,60	0,00	1.730,76289100	3,0943580000
2286	28/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.643,27	1.823,72883500	3,0943580000
2247	29/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.258,86	1.699,11666000	3,0950540000
2270	29/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	21.198.131,37	6.849.034,41662800	3,0950540000
2269	29/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.474,81	0,00	1.445,79383700	3,0950540000
2248	30/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.417,16	0,00	5.300,30519100	3,0973990000
2277	30/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.800,16	0,00	1.872,59051800	3,0973990000
2271	30/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	140.041,92	0,00	45.212,74785715	3,0973990000
2250	31/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	29.010.679,59	9.362.925,93757400	3,0984630000
2249	31/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	840.578,58	0,00	271.288,88742500	3,0984630000
2278	31/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.929,04	0,00	3.527,24560500	3,0984630000
2273	31/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	97.768.869,12	31.553.989,54901188	3,0984630000
2272	31/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.875.519,45	0,00	928.047,05107000	3,0984630000
2287	31/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	30.105.220,97	9.716.178,94743297	3,0984630000
<b>Total</b>			<b>565.661.978,69</b>	<b>694.831.426,21</b>		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2023

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 7.375.281,55

Value-At-Risk: 0,49%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		0,49	0,49			1.508.074.563,61	100,00

#### Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,31%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,634200%)		0,07	0,00	0,10			31.009.726,81	2,06
NTN-B 150535 (5,784900%)		0,07	0,00	0,10			31.480.482,02	2,09
NTN-B 150535 (5,886400%)		0,14	0,00	0,16			7.383.594,82	0,49
NTN-B 150535 (5,909200%)		0,07	0,00	0,10			84.224.758,44	5,58
NTN-B 150535 (5,927000%)		0,16	-0,00	0,17			12.615.432,28	0,84
NTN-B 150535 (6,216000%)		0,22	0,00	0,23			2.670.119,09	0,18
NTN-B 150545 (5,900200%)		0,07	0,00	0,10			126.942.397,83	8,42
NTN-B 150832 (5,763300%)		0,07	0,00	0,10			41.840.054,98	2,77
NTN-B 150860 (5,599600%)		0,07	0,00	0,10			87.473.547,34	5,80
NTN-B 150860 (5,788000%)		0,07	0,00	0,10			72.296.920,34	4,79
NTN-B 150860 (5,926400%)		0,07	0,00	0,10			17.295.597,27	1,15
NTN-B 150860 (5,949840%)		0,07	0,00	0,10			70.605.955,02	4,68
NTN-B 150860 (5,959200%)		0,07	0,00	0,10			82.952.605,90	5,50
NTN-B 150860 (5,986700%)		0,07	0,00	0,10			28.918.041,61	1,92
NTN-B 150860 (6,225100%)		0,07	0,00	0,10			5.989.155,57	0,40
<b>Sub-total</b>	0,22	0,07	0,01		1,39	1,48	703.698.389,32	46,66

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,25	0,02	0,03			337.994.759,54	22,41

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2023

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,34	0,09	1,99			205.198.969,53	13,61
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		3,31	0,03	0,76			29.717.703,25	1,97
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		1,34	0,01	1,33			12.460.991,96	0,83
<b>Sub-total</b>	1,01	0,74	0,15		0,10	1,28	585.372.424,28	38,82

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI		0,01	-0,00	0,01			12.222.058,00	0,81
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	-0,00	0,01			358.380,65	0,02
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,03	-0,00	0,03			111.862.341,44	7,42
<b>Sub-total</b>	0,05	0,03	-0,00		-0,20	1,16	124.442.780,09	8,25

#### Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 7,79%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO		7,80	0,11	6,52			31.257.150,74	2,07
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		7,77	0,09	6,52			25.960.734,18	1,72
<b>Sub-total</b>	18,33	7,79	0,21		0,16	4,06	57.217.884,92	3,79

#### Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 10,09%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		10,09	0,05	1,04			21.354.673,03	1,42
<b>Sub-total</b>	17,03	10,09	0,05		0,12	3,19	21.354.673,03	1,42

#### Renda Variável

Value-At-Risk: 13,76%

Artigo 8º I

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2023

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		14,68	0,05	7,55			9.963.776,08	0,66
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		12,77	0,03	6,05			6.024.635,89	0,40
<b>Sub-total</b>	27,55	13,76	0,07		-0,21	-4,72	15.988.411,97	1,06