

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

CONSOLIDADO

Período: abril 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	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,634200%)	0,49	0,05	0,93	4,58	31.299.400,32	2,05
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	2,87	0,05	0,94	4,63	31.777.794,08	2,08
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,886400%)	2,91	0,06	0,95	4,66	7.453.840,93	0,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	0,49	0,05	0,95	4,67	85.027.368,56	5,57
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	4,78	0,05	0,95	4,68	12.735.798,99	0,83
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,216000%)	4,20	0,05	0,97	4,77	2.696.118,68	0,18
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	0,49	0,05	0,95	4,67	128.151.303,60	8,40
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	0,49	0,05	0,94	4,62	42.234.596,43	2,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	0,49	0,05	0,93	4,57	88.288.687,12	5,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	0,49	0,05	0,94	4,63	72.979.879,56	4,78
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,926400%)	2,97	0,06	0,95	4,68	17.460.616,70	1,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	0,49	0,05	0,96	4,68	71.280.693,76	4,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	0,49	0,05	0,96	4,69	83.745.887,12	5,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	3,00	0,05	0,96	4,70	29.195.124,75	1,91
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,225100%)	3,10	0,05	0,97	4,77	6.047.508,62	0,40

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/04/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea a	0,50	0,05	0,95	4,65	710.374.619,22	46,56

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	0,40	0,02	0,84	4,20	345.109.255,05	22,62	7.326.400.964,83	4,71
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,62	-0,14	0,51	4,59	206.250.562,85	13,52	3.560.884.208,43	5,79
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	6,38	-0,18	1,88	6,35	30.275.210,76	1,98	228.959.935,66	13,22
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2,62	-0,14	0,51	4,59	12.524.893,26	0,82	3.440.772.568,93	0,36
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	1,40	-0,04	0,78	4,34	594.159.921,92	38,94		

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				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,03	0,05	0,88	4,11	12.329.822,90	0,81	12.982.425.301,13	0,09
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,03	0,05	0,83	2,21	361.363,22	0,02	4.036.788.225,11	0,01
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,05	0,05	0,90	4,13	112.865.135,93	7,40	7.884.712.793,21	1,43
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	0,57	0,05	0,89	4,13	125.556.322,05	8,23		
		Renda Fixa	0,69	0,01	0,87	4,48	1.430.090.863,19	93,73		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/04/2023

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	Ano				
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	28,65	2,17	0,30	-12,75	9.993.850,04	0,65	100.819.430,00	9,91
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	27,16	2,65	1,87	-7,55	6.137.597,18	0,40	514.833.864,90	1,19
Sub-total Artigo 8º I			26,22	2,35	0,89	-10,84	16.131.447,22	1,06		
Renda Variável			26,22	2,35	0,89	-10,84	16.131.447,22	1,06		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/04/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,39%

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	25,10	0,03	-0,66	7,74	21.214.618,38	1,39	1.992.900.655,39	1,06
Sub-total Artigo 9º III			25,10	0,03	-0,66	7,74	21.214.618,38	1,39		
Investimentos no Exterior			25,10	0,03	-0,66	7,74	21.214.618,38	1,39		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/04/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

3,82%

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	22,17	0,86	2,03	11,06	31.890.360,45	2,09	509.872.626,73	6,25
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	22,47	0,86	1,96	10,96	26.470.773,28	1,73	1.620.180.004,79	1,63
Sub-total Artigo 10º I			22,22	0,86	2,00	11,02	58.361.133,73	3,82		
Investimentos Estruturados			22,22	0,86	2,00	11,02	58.361.133,73	3,82		
Total			1,57	0,06	0,89	4,57	1.525.798.062,52	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	710.374.619,22	46,56	0,00	57,40	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	594.159.921,92	38,94	0,00	20,33	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	125.556.322,05	8,23	0,00	22,27	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	1.430.090.863,19	93,73					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	16.131.447,22	1,06	0,00	0,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	16.131.447,22	1,06					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	21.214.618,38	1,39	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	21.214.618,38	1,39					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	58.361.133,73	3,82	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	58.361.133,73	3,82					15,00
Total		1.525.798.062,52	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	0,95 103,33	4,65 110,79	3,43 112,63	6,70 103,98	10,57 79,04	6.676.229,90	31.765.770,66
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,78 85,49	4,34 103,35	3,15 103,49	5,85 90,83	10,86 81,23	5.444.154,04	31.034.016,10
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,89 97,46	4,13 98,33	2,97 97,58	6,45 100,14	13,30 99,42	1.113.541,96	4.782.831,74
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	0,89 -1,61	-10,84 -6,01	-13,62 -5,69	-26,23 -16,23	-25,13 -21,94	143.035,25	-1.962.004,07
Artigo 9º III % do CDI	-0,66 -71,43	7,74 184,40	3,28 107,95	9,66 149,97	2,79 20,88	-140.054,65	1.524.419,22
Artigo 10º I % do CDI	2,00 217,62	11,02 262,38	4,29 141,16	12,07 187,30	13,02 97,33	1.143.248,81	5.791.101,86
CONSOLIDADO (Total)						14.380.155,31	72.936.135,51

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%)	31.009.726,81	0,00	0,00	0,00	31.299.400,32	289.673,51	1.371.763,13
NTN-B 150535 (5,784900%)	31.480.482,02	0,00	0,00	0,00	31.777.794,08	297.312,06	1.406.645,25
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.383.594,82	0,00	0,00	0,00	7.453.840,93	70.246,11	332.136,23
NTN-B 150535 (5,909200%)	84.224.758,44	0,00	0,00	0,00	85.027.368,56	802.610,12	3.794.441,44
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.615.432,28	0,00	0,00	0,00	12.735.798,99	120.366,71	568.998,49
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.670.119,09	0,00	0,00	0,00	2.696.118,68	25.999,59	122.711,00
NTN-B 150545 (5,900200%)	126.942.397,83	0,00	0,00	0,00	128.151.303,60	1.208.905,77	5.715.584,19
NTN-B 150832 (5,763300%)	41.840.054,98	0,00	0,00	0,00	42.234.596,43	394.541,45	1.886.571,25
NTN-B 150860 (5,599600%)	87.473.547,34	0,00	0,00	0,00	88.288.687,12	815.139,78	3.899.508,52
NTN-B 150860 (5,788000%)	72.296.920,34	0,00	0,00	0,00	72.979.879,56	682.959,22	3.264.659,65
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.295.597,27	0,00	0,00	0,00	17.460.616,70	165.019,43	788.329,00
NTN-B 150860 (5,949840%)	70.605.955,02	0,00	0,00	0,00	71.280.693,76	674.738,74	3.223.276,23

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/04/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150860 (5,959200%)	82.952.605,90	0,00	0,00	0,00	83.745.887,12	793.281,22	3.789.277,08
NTN-B 150860 (5,986700%)	28.918.041,61	0,00	0,00	0,00	29.195.124,75	277.083,14	1.323.415,74
NTN-B 150860 (6,225100%)	5.989.155,57	0,00	0,00	0,00	6.047.508,62	58.353,05	278.453,46
					710.374.619,22	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	12.460.991,96	0,00	0,00	0,00	12.524.893,26	63.901,30	558.475,08
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	205.198.969,53	0,00	0,00	0,00	206.250.562,85	1.051.593,32	9.202.767,11
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.717.703,25	0,00	0,00	0,00	30.275.210,76	557.507,51	1.825.036,35
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	337.994.759,54	258.795.435,47	-255.452.091,87	0,00	345.109.255,05	3.771.151,91	19.447.737,56
					594.159.921,92	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\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	358.380,65	0,00	0,00	0,00	361.363,22	2.982,57	7.809,73
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	111.862.341,44	0,00	0,00	0,00	112.865.135,93	1.002.794,49	4.477.466,00
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	12.222.058,00	0,00	0,00	0,00	12.329.822,90	107.764,90	297.556,01
					125.556.322,05	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	9.963.776,08	0,00	0,00	0,00	9.993.850,04	30.073,96	-1.460.829,59
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	6.024.635,89	0,00	0,00	0,00	6.137.597,18	112.961,29	-501.174,48
					16.131.447,22	0,00	0,00

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

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/04/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	21.354.673,03	0,00	0,00	0,00	21.214.618,38	-140.054,65	1.524.419,22
					21.214.618,38	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	31.257.150,74	0,00	0,00	0,00	31.890.360,45	633.209,71	3.176.261,30
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	25.960.734,18	0,00	0,00	0,00	26.470.773,28	510.039,10	2.614.840,56
					58.361.133,73	0,00	0,00

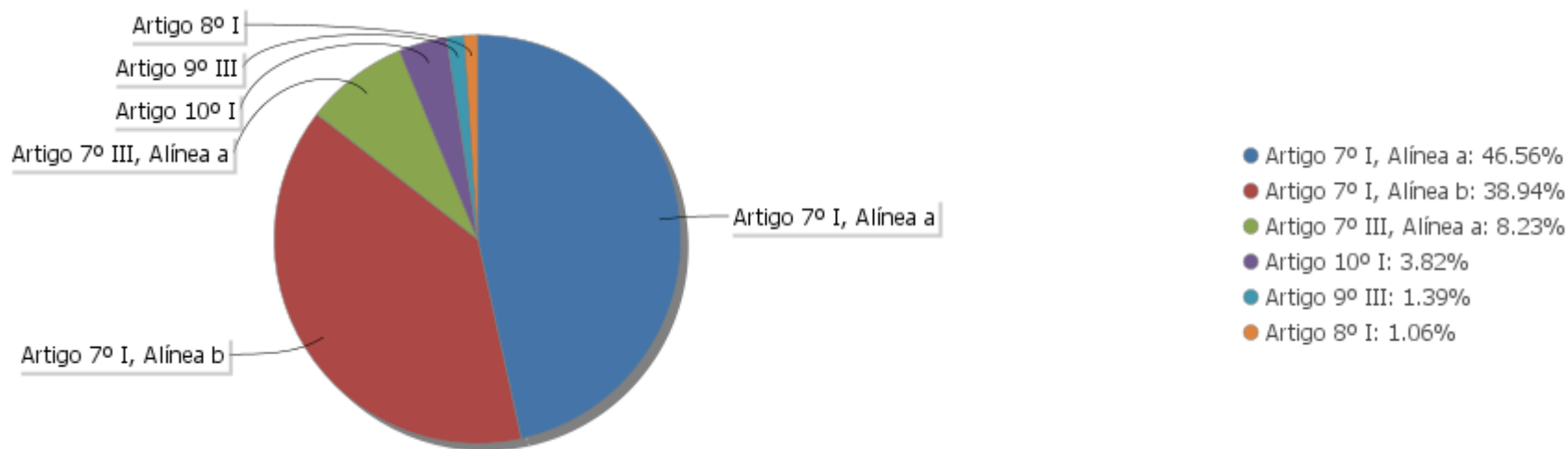
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

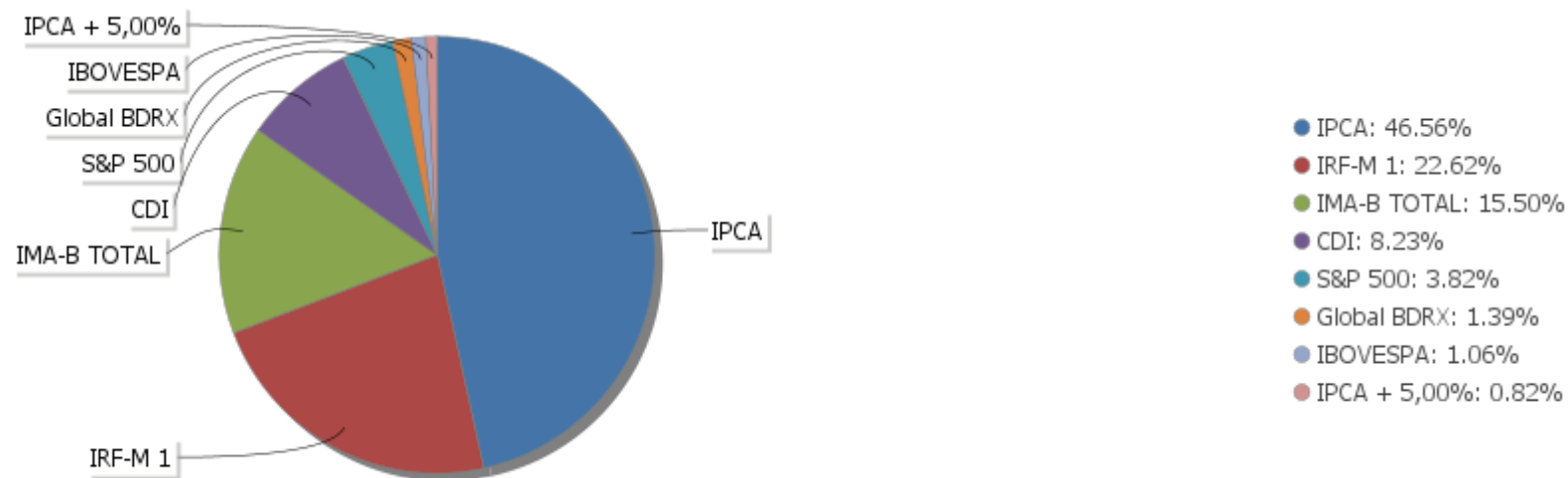
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	566.372.776,43	37,12	566.372.776,43	37,12	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	566.372.776,43	37,12	
acima de 365 dias	959.425.286,09	62,88	1.525.798.062,52	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

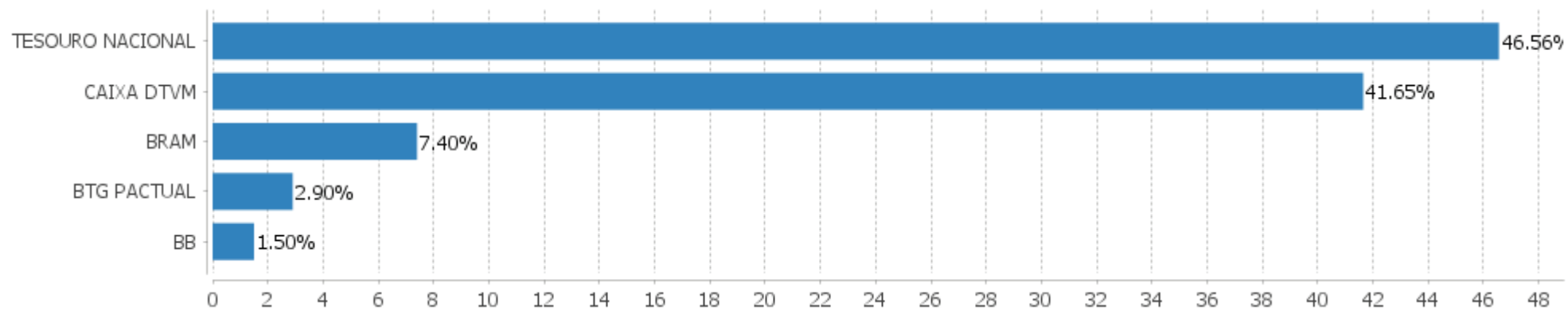


Alocação Por Estratégia



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	0,89									4,57
IPCA + 4,00%	0,87	1,12	1,07	0,89									4,02
p.p. indexador	0,53	-0,33	0,34	-0,01									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

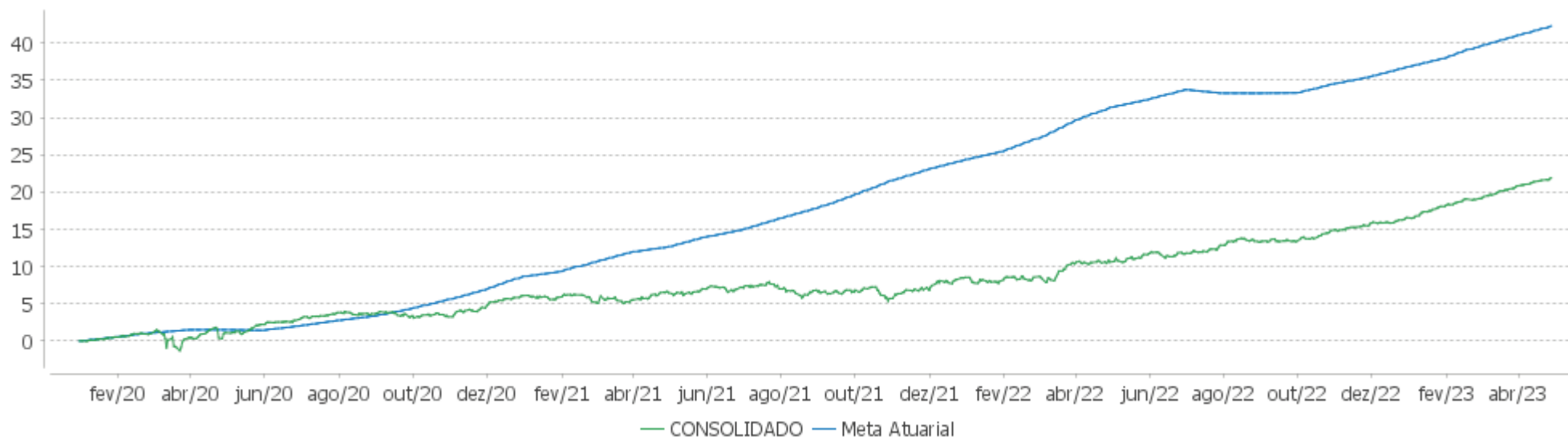
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

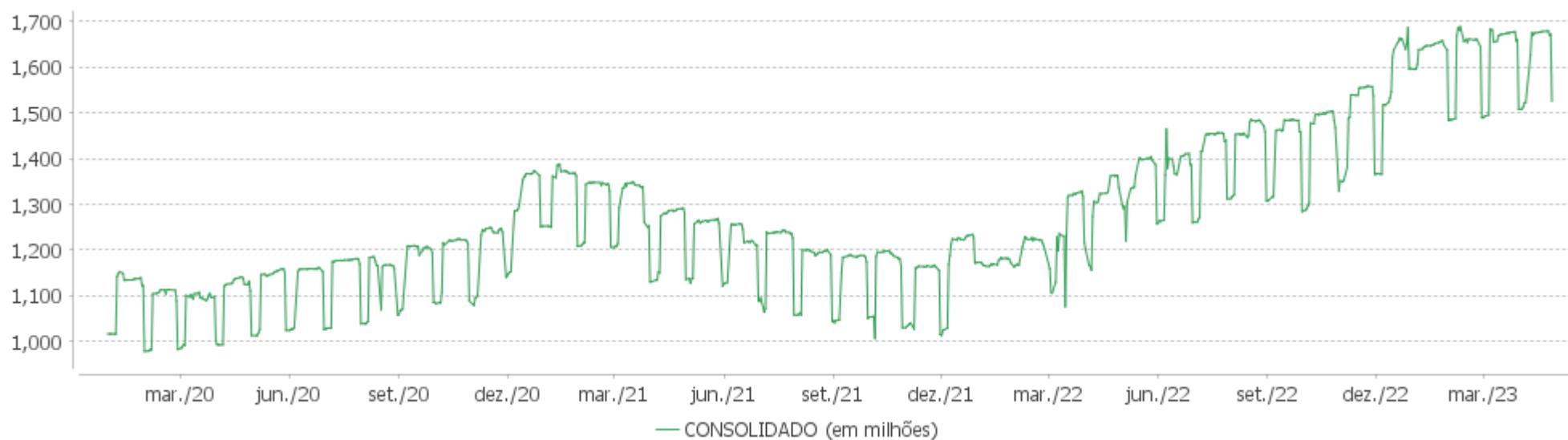
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	15	37,50	03 meses	3,13	3,12	0,01	0,87
Meses abaixo - Meta Atuarial	25	62,50	06 meses	6,07	5,78	0,29	1,04
			12 meses	10,22	8,34	1,88	1,57
			24 meses	14,48	24,67	-10,19	2,26
Maior rentabilidade da Carteira	1,64	2022-03	36 meses	20,58	37,30	-16,72	2,20
Menor rentabilidade da Carteira	-0,80	2021-10	Desde 31/12/2019	21,90	39,26	-17,35	2,63

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

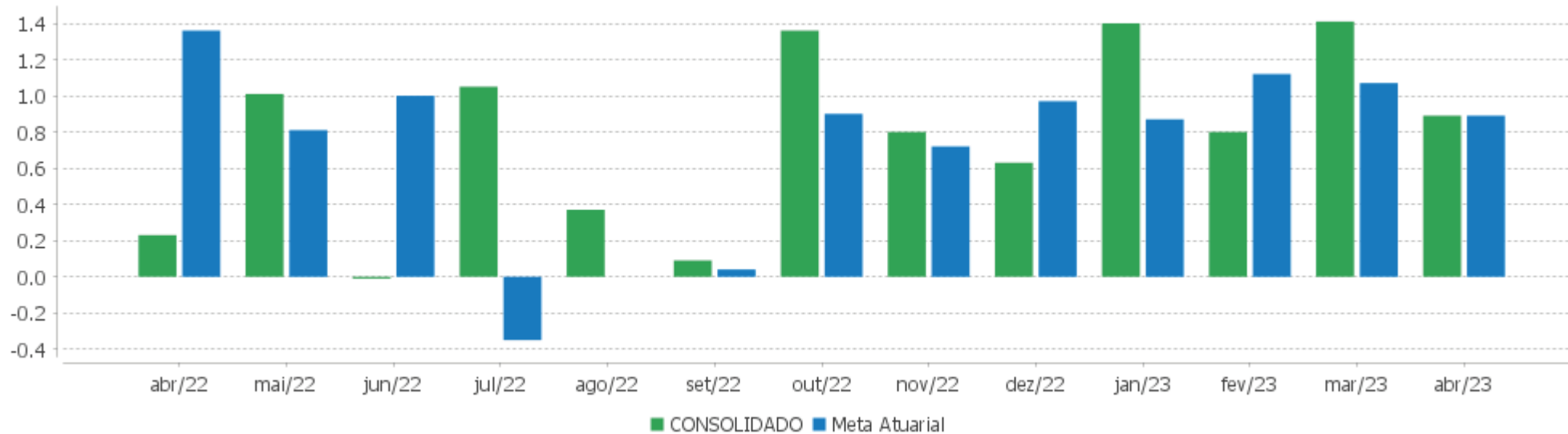


Patrimônio Líquido



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.	0,94 0,33	4,63 1,91	3,41 1,24	6,67 2,89	7,40 3,22	19,72 2,90	27,18 2,46
NTN-B 150535 (6,216000%) Var. IPCA p.p.	0,97 0,36	4,77 2,05	3,51 1,33	3,76 -0,01	4,58 0,40		
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	0,94 0,33	4,62 1,91	3,41 1,23	6,66 2,88	10,49 6,31	23,13 6,30	30,76 6,04
NTN-B 150535 (5,886400%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,34	4,66 1,95	3,43 1,26	6,72 2,95	7,48 3,30		
NTN-B 150860 (6,225100%) Var. IPCA p.p.	0,97 0,36	4,77 2,05	3,51 1,34	6,89 3,11	7,69 3,51		
NTN-B 150860 (5,959200%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,35	4,69 1,97	3,45 1,28	6,76 2,98	10,70 6,51	23,51 6,68	31,31 6,59
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,34	4,67 1,95	3,44 1,26	6,73 2,95	10,64 6,46	23,40 6,57	31,15 6,43
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	0,93 0,32	4,58 1,87	3,38 1,20	6,60 2,82	10,36 6,17	22,93 6,11	30,51 5,79
NTN-B 150860 (5,986700%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,35	4,70 1,98	3,46 1,28	6,77 2,99	7,56 3,37	20,01 3,19	27,60 2,88
NTN-B 150860 (5,949840%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,35	4,68 1,97	3,45 1,27	6,75 2,97	10,69 6,50	23,49 6,67	31,30 6,58
NTN-B 150860 (5,599600%) Var. IPCA p.p.	0,93 0,32	4,57 1,86	3,37 1,19	6,58 2,80	10,32 6,14	23,04 6,22	30,77 6,05
NTN-B 150545 (5,900200%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,34	4,67 1,95	3,44 1,26	6,73 2,95	10,63 6,45	23,41 6,59	31,18 6,46
NTN-B 150535 (5,927000%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,34	4,68 1,96	3,44 1,27	6,66 2,88	7,43 3,24	19,82 3,00	27,36 2,64
NTN-B 150860 (5,788000%) Var. IPCA p.p.	0,94 0,33	4,63 1,92	3,41 1,24	6,67 2,89	10,52 6,33	23,29 6,46	31,06 6,34
NTN-B 150860 (5,926400%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,34	4,68 1,96	3,44 1,27	6,74 2,97	7,53 3,34		
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,51 -1,51	4,59 -1,49	3,16 -2,92	5,42 0,39	8,62 -0,16	17,50 3,61	28,41 3,52
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,88	6,35	6,06	5,38	8,77	14,42	24,15

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/04/2023

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.	-0,14	0,28	-0,02	0,35	-0,01	0,54	-0,73
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,51 -0,45	4,59 0,25	3,16 -0,19	5,43 -0,85	8,59 -0,78		
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,84 -0,02	4,20 -0,03	3,04 -0,06	6,37 -0,08	13,08 -0,23	19,17 -0,52	21,70 -0,78
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,90 97,64	4,13 98,39	2,97 97,66	6,46 100,26	13,74 102,74	22,51 105,21	25,39 105,78
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,83 90,64	3,85 91,67	2,79 91,60	5,90 91,60	12,26 91,69	18,91 88,39	20,13 83,86
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,88 96,03	4,11 97,89	2,97 97,53	6,31 97,93	13,21 98,78	21,23 99,20	22,80 94,98
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	1,87 -0,63	-7,55 -2,72	-10,51 -2,57	-20,35 -10,35	-20,19 -17,00	-37,26 -25,10	-5,48 -35,20
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. IBOVESPA p.p.	0,30 -2,20	-12,75 -7,92	-15,43 -7,49	-29,43 -19,42	-29,01 -25,82	-51,58 -39,42	-38,29 -68,00
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	-0,66 -0,17	7,74 -0,46	3,28 -0,38	9,66 -1,32	2,79 -0,92	-11,85 -2,49	25,57 -4,53
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	1,96 2,09	10,96 6,88	4,16 3,86	11,90 9,47	10,34 7,76	15,28 23,00	64,28 32,37
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	2,03 2,15	11,06 6,98	4,40 4,10	12,21 9,77	15,34 12,76	21,05 28,76	74,88 42,97
CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,89 -0,01	4,57 0,55	3,13 0,01	6,07 0,29	10,22 1,88	14,48 -11,84	20,58 -19,62
CDI	0,92	4,20	3,04	6,44	13,37	21,40	24,00
IBOVESPA	2,50	-4,83	-7,93	-10,00	-3,19	-12,16	29,72
INPC + 6,00%	0,95	4,36	3,35	6,51	10,04	31,15	49,50
IPCA + 6,00%	1,03	4,66	3,58	6,77	10,41	31,20	48,41

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 Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,86	4,23	3,10	6,45	13,31	19,69	22,48	30,57	39,29
IRF-M 1+	1,25	5,54	4,78	5,72	13,07	11,85	13,45	29,25	42,72
IRF-M TOTAL	1,10	5,03	4,16	5,88	12,91	14,29	16,50	30,13	42,22
IMA-B 5	0,90	5,33	3,87	5,96	9,67	20,04	30,74	42,08	56,20
IMA-B 5+	3,03	6,75	8,11	4,24	8,12	8,09	19,22	29,32	55,37
IMA-B TOTAL	2,02	6,08	6,08	5,03	8,78	13,88	24,89	36,05	57,25
IMA-GERAL TOTAL	1,25	4,92	4,19	5,67	11,60	17,13	22,53	32,91	46,34
IDKA 2	0,71	5,45	3,96	5,94	9,35	19,48	30,73	42,00	55,36
IDKA 20	5,47	7,81	12,99	2,04	6,65	-2,92	10,29	16,48	51,43
CDI	0,92	4,20	3,04	6,44	13,37	21,40	24,00	30,46	38,73

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	2,50	-4,83	-7,93	-10,00	-3,19	-12,16	29,72	8,38	21,27
IBRX 100	1,93	-5,48	-8,69	-10,82	-4,80	-14,46	29,37	9,81	24,02
IBRX 50	1,64	-6,25	-9,32	-10,64	-4,09	-13,15	33,26	8,75	20,30
SMALL CAP	1,91	-7,78	-10,40	-20,60	-19,88	-36,55	-1,08	-5,63	4,75
Índice Consumo - ICON	0,89		-14,39	-28,45	-27,26	-49,56	-34,81	-34,15	-28,37
Índice Dividendos - IDIV	3,89	-0,36	-5,90	-1,19	2,52	6,38	45,77	35,30	60,90

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/04/2023

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	-0,13	4,08	0,30	2,43	2,58	-7,71	31,92	79,40	126,19

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	3,52	-0,31	1,31	-4,45	1,61	-0,10	9,78	13,94	22,29

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,32	3,70	-0,93	6,26	1,87	-13,63	23,38	58,18	84,61

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,61	2,72	2,18	3,78	4,18	16,82	24,72	27,71	34,02
INPC	0,53	2,42	1,95	3,52	3,83	16,78	25,64	28,73	35,27
IGPM	-0,95	-0,75	-0,96	-0,87	-2,17	12,18	48,09	57,99	71,65
SELIC	0,92	4,20	3,04	6,44	13,37	21,40	24,00	30,46	38,74

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,89	4,02	3,12	5,78	8,34	26,32	40,21	49,34	62,93
IPCA + 5,00%	0,96	4,34	3,35	6,28	9,37	28,75	44,27	55,14	70,88
IPCA + 5,50%	1,00	4,50	3,46	6,53	9,89	29,97	46,33	58,11	74,98
IPCA + 5,89%	1,02	4,62	3,55	6,72	10,30	30,93	47,95	60,46	78,22
IPCA + 6,00%	1,03	4,66	3,58	6,77	10,41	31,20	48,41	61,12	79,14
INPC + 4,00%	0,81	3,72	2,89	5,52	7,97	26,27	41,24	50,53	64,44
INPC + 6,00%	0,95	4,36	3,35	6,51	10,04	31,15	49,50	62,41	80,81

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2306	03/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	31.298,80	0,00	10.096,84308300	3,0998600000
2294	03/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	22.845,02	0,00	7.369,69411500	3,0998600000
2330	03/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	34.090,60	10.997,46294700	3,0998600000
2320	04/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	679.817,31	0,00	219.234,73288900	3,1008650000
2308	04/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	489.315,64	157.799,72379400	3,1008650000
2296	04/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.316.588,85	0,00	1.392.059,58659900	3,1008650000
2322	05/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.942.893,50	0,00	626.220,88340300	3,1025690000
2295	05/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.176.973,64	0,00	1.990.922,24540300	3,1025690000
2299	06/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.134,84	0,00	7.454,08704900	3,1036450000
2323	10/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	15.898.164,50	5.119.401,94082000	3,1054730000
2319	10/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.961.946,13	0,00	6.750.001,08840100	3,1054730000
2314	10/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	42.797.372,39	13.781.273,38687800	3,1054729987
2298	10/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	110.262.872,89	0,00	35.505.983,43311900	3,1054730000
2333	10/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	18.180.715,91	5.854.411,19954100	3,1054730000
2329	10/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	48.457.992,20	0,00	15.604.061,66790000	3,1054730000
2324	11/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.542.733,60	817.985,33817100	3,1085320000
2318	11/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.896.673,30	0,00	4.470.493,88585900	3,1085320000
2293	11/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.017,82	0,00	2.257,59940700	3,1085320000
2307	11/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	35.299.611,38	0,00	11.355.717,54770400	3,1085320000
2311	12/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.542.733,56	817.625,76593700	3,1098990000
2297	12/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	43.722,32	0,00	14.059,08037500	3,1098990000
2331	12/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.542.733,56	817.625,76837300	3,1098990000
2321	13/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	164.461,12	0,00	52.862,91254400	3,1110870000
2300	13/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.623.393,13	0,00	843.240,04118100	3,1110870000
2313	14/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	307.413,76	98.780,89422200	3,1120771119
2305	14/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	328.731,56	0,00	105.630,92108500	3,1120770000
2289	18/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.936,90	0,00	621,92732900	3,1143510000
2304	18/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.493,10	0,00	2.405,99084600	3,1143510000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/04/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2303	19/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	306.858,26	0,00	98.494,82390400	3,1154760000
2325	24/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.427.824,94	1.098.821,73194600	3,1195460000
2317	24/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.427.824,94	0,00	1.098.821,73239300	3,1195460000
2291	24/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.104,66	0,00	5.162,50121000	3,1195460000
2312	24/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	15.876,80	5.089,45734800	3,1195460000
2328	25/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	75.669,18	24.241,60618700	3,1214590000
2316	25/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	219.490,63	0,00	70.316,67883500	3,1214590000
2326	26/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.258,86	1.684,20841400	3,1224520000
2310	26/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.682.982,64	3.101.082,94206600	3,1224520000
2301	27/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.247,55	0,00	8.402,39412100	3,1238180000
2290	27/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	422,55982900	3,1238180000
2315	28/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.830.915,84	0,00	906.063,55371800	3,1244120000
2327	28/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	29.061.046,56	9.301.285,02735300	3,1244120000
2309	28/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	97.732.115,16	31.280.162,52388100	3,1244120000
2292	28/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	940,88743700	3,1244120000
2302	28/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.714.330,06	0,00	2.148.989,97315300	3,1244120000
2332	28/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	30.116.044,21	9.638.947,80942000	3,1244120000
Total			258.795.435,47	255.452.091,87		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 6.889.802,96

Value-At-Risk: 0,45%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		0,45	0,45			1.525.798.062,52	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,23%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,634200%)		0,07	0,00	0,09			31.299.400,32	2,05
NTN-B 150535 (5,784900%)		0,07	0,00	0,09			31.777.794,08	2,08
NTN-B 150535 (5,886400%)		0,16	0,00	0,17			7.453.840,93	0,49
NTN-B 150535 (5,909200%)		0,07	0,00	0,09			85.027.368,56	5,57
NTN-B 150535 (5,927000%)		0,16	0,00	0,17			12.735.798,99	0,83
NTN-B 150535 (6,216000%)		0,16	0,00	0,17			2.696.118,68	0,18
NTN-B 150545 (5,900200%)		0,07	0,00	0,09			128.151.303,60	8,40
NTN-B 150832 (5,763300%)		0,07	0,00	0,09			42.234.596,43	2,77
NTN-B 150860 (5,599600%)		0,07	0,00	0,09			88.288.687,12	5,79
NTN-B 150860 (5,788000%)		0,07	0,00	0,09			72.979.879,56	4,78
NTN-B 150860 (5,926400%)		0,08	0,00	0,10			17.460.616,70	1,14
NTN-B 150860 (5,949840%)		0,07	0,00	0,09			71.280.693,76	4,67
NTN-B 150860 (5,959200%)		0,07	0,00	0,09			83.745.887,12	5,49
NTN-B 150860 (5,986700%)		0,07	0,00	0,09			29.195.124,75	1,91
NTN-B 150860 (6,225100%)		0,07	0,00	0,09			6.047.508,62	0,40
Sub-total	0,15	0,07	0,00		0,20	0,95	710.374.619,22	46,56

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		0,24	0,02	0,02			345.109.255,05	22,62

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/04/2023

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		0,91	0,06	1,87			206.250.562,85	13,52
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		2,77	0,02	0,72			30.275.210,76	1,98
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		0,91	0,00	0,91			12.524.893,26	0,82
Sub-total	0,66	0,55	0,10		-0,20	0,78	594.159.921,92	38,94

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI		0,01	-0,00	0,01			12.329.822,90	0,81
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	-0,00	0,01			361.363,22	0,02
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,03	0,00	0,03			112.865.135,93	7,40
Sub-total	0,04	0,03	0,00		-0,57	0,89	125.556.322,05	8,23

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 7,48%

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		7,43	0,12	6,59			31.890.360,45	2,09
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		7,53	0,10	6,63			26.470.773,28	1,73
Sub-total	12,09	7,48	0,23		0,09	2,00	58.361.133,73	3,82

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 8,98%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		8,98	0,06	0,79			21.214.618,38	1,39
Sub-total	16,47	8,98	0,06		-0,10	-0,66	21.214.618,38	1,39

Renda Variável

Value-At-Risk: 12,41%

Artigo 8º I

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/04/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		12,82	0,04	6,35			9.993.850,04	0,65
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		12,35	0,02	5,87			6.137.597,18	0,40
Sub-total	28,42	12,41	0,06		-0,00	0,89	16.131.447,22	1,06