

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

CONSOLIDADO

Período: janeiro de 2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

93,59%

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%)	0,63	0,05	1,17	1,17	30.277.211,52	2,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	2,89	0,05	1,18	1,18	30.729.710,82	2,07
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,886400%)	2,94	0,05	1,19	1,19	7.206.386,76	0,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	0,63	0,05	1,19	1,19	82.200.363,56	5,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	4,79	0,05	1,19	1,19	12.311.888,20	0,83
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,216000%)	4,22	0,05	1,22	1,22	2.604.714,15	0,18
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	0,63	0,05	1,19	1,19	123.892.941,48	8,35
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	2,92	0,05	1,18	1,18	42.029.366,78	2,83
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	2,81	0,05	1,17	1,17	87.783.515,30	5,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	2,88	0,05	1,18	1,18	72.588.238,48	4,89
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,926400%)	4,14	0,05	1,19	1,19	17.371.535,94	1,17
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	2,95	0,05	1,19	1,19	70.920.309,39	4,78
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	2,95	0,05	1,20	1,20	83.323.958,06	5,62
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	4,18	0,05	1,20	1,20	29.049.618,56	1,96
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,225100%)	4,32	0,05	1,22	1,22	6.020.203,24	0,41

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/01/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea a	0,65	0,05	1,19	1,19	698.309.962,24	47,06

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				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,07	0,05	1,11	1,11	520.587,74	0,04	11.583.286.989,04	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,44	0,06	1,12	1,12	332.342.782,83	22,40	6.631.421.970,83	5,01
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,85	0,01	1,39	1,39	205.890.373,04	13,88	3.389.466.663,61	6,07
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	6,60	0,09	0,28	0,28	29.389.652,40	1,98	222.262.793,93	13,22
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2,85	0,01	1,39	1,39	12.490.907,84	0,84	2.846.054.203,16	0,44
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	1,54	0,05	1,16	1,16	580.634.303,85	39,13		

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	BRANCO	BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,07	0,05	1,13	1,13	109.609.808,39	7,39	8.262.735.410,47	1,33
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	0,07	0,05	1,13	1,13	109.609.808,39	7,39		
		Renda Fixa	0,90	0,05	1,17	1,17	1.388.554.074,48	93,59		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/01/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDÁ VARIÁVEL

1,26%

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	28,15	1,79	3,16	3,16	11.816.641,73	0,80	126.266.240,85	9,36
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	27,55	1,70	3,30	3,30	6.858.112,12	0,46	583.745.036,37	1,17
Sub-total Artigo 8º I			25,04	1,76	3,21	3,21	18.674.753,85	1,26		
Renda Variável			25,04	1,76	3,21	3,21	18.674.753,85	1,26		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/01/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,38%

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	26,58	0,23	4,32	4,32	20.540.304,66	1,38	1.979.769.025,50	1,04
Sub-total Artigo 9º III			26,58	0,23	4,32	4,32	20.540.304,66	1,38		
Investimentos no Exterior			26,58	0,23	4,32	4,32	20.540.304,66	1,38		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/01/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

3,77%

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	23,86	1,40	6,38	6,38	30.546.227,93	2,06	494.455.251,27	6,18
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	24,04	1,39	6,53	6,53	25.412.744,25	1,71	1.758.911.660,14	1,44
Sub-total Artigo 10º I			23,85	1,40	6,45	6,45	55.958.972,18	3,77		
Investimentos Estruturados			23,85	1,40	6,45	6,45	55.958.972,18	3,77		
Total			2,05	0,11	1,40	1,40	1.483.728.105,17	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	698.309.962,24	47,06	0,00	57,40	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	580.634.303,85	39,13	0,00	20,33	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	109.609.808,39	7,39	0,00	22,27	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	1.388.554.074,48	93,59					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	18.674.753,85	1,26	0,00	0,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	18.674.753,85	1,26					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	20.540.304,66	1,38	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	20.540.304,66	1,38					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	55.958.972,18	3,77	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	55.958.972,18	3,77					15,00
Total		1.483.728.105,17	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	1,19 105,57	1,19 105,57	3,17 95,89	3,83 57,13		8.183.714,56	8.183.714,56
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,16 102,88	1,16 102,88	2,62 79,44	5,64 84,02	11,27 87,96	8.613.983,35	8.613.983,35
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,13 100,35	1,13 100,35	3,39 102,50	7,03 104,81	12,46 97,26	1.222.396,19	1.222.396,19
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	3,21 -0,16	3,21 -0,16	-14,60 -12,35	-4,22 -14,18	-19,54 -20,69	581.302,56	581.302,56
Artigo 9º III % do CDI	4,32 384,34	4,32 384,34	6,18 187,08	-4,25 -63,37	-17,40 -135,87	850.105,50	850.105,50
Artigo 10º I % do CDI	6,45 573,88	6,45 573,88	7,46 225,78	5,64 84,02	1,24 9,66	3.388.940,31	3.388.940,31
CONSOLIDADO (Total)						22.840.442,47	22.840.442,47

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%)	29.927.637,19	0,00	0,00	0,00	30.277.211,52	349.574,33	349.574,33
NTN-B 150535 (5,784900%)	30.371.148,83	0,00	0,00	0,00	30.729.710,82	358.561,99	358.561,99
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.121.704,70	0,00	0,00	0,00	7.206.386,76	84.682,06	84.682,06
NTN-B 150535 (5,909200%)	81.232.927,12	0,00	0,00	0,00	82.200.363,56	967.436,44	967.436,44
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.166.800,50	0,00	0,00	0,00	12.311.888,20	145.087,70	145.087,70
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.573.407,68	0,00	0,00	0,00	2.604.714,15	31.306,47	31.306,47
NTN-B 150545 (5,900200%)	122.435.719,41	0,00	0,00	0,00	123.892.941,48	1.457.222,07	1.457.222,07
NTN-B 150832 (5,763300%)	41.539.685,72	0,00	0,00	0,00	42.029.366,78	489.681,06	489.681,06
NTN-B 150860 (5,599600%)	86.772.499,68	0,00	0,00	0,00	87.783.515,30	1.011.015,62	1.011.015,62
NTN-B 150860 (5,788000%)	71.741.042,83	0,00	0,00	0,00	72.588.238,48	847.195,65	847.195,65
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.166.826,82	0,00	0,00	0,00	17.371.535,94	204.709,12	204.709,12
NTN-B 150860 (5,949840%)	70.083.240,45	0,00	0,00	0,00	70.920.309,39	837.068,94	837.068,94

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/01/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150860 (5,959200%)	82.339.931,12	0,00	0,00	0,00	83.323.958,06	984.026,94	984.026,94
NTN-B 150860 (5,986700%)	28.705.871,39	0,00	0,00	0,00	29.049.618,56	343.747,17	343.747,17
NTN-B 150860 (6,225100%)	5.947.804,24	0,00	0,00	0,00	6.020.203,24	72.399,00	72.399,00
					698.309.962,24	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	12.319.971,67	0,00	0,00	0,00	12.490.907,84	170.936,17	170.936,17
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	0,00	0,00	0,00	520.587,74	5.719,95	5.719,95
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	203.073.305,13	0,00	0,00	0,00	205.890.373,04	2.817.067,91	2.817.067,91
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.308.342,53	0,00	0,00	0,00	29.389.652,40	81.309,87	81.309,87
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	463.005.020,51	53.133.166,15	-189.334.611,01	0,00	332.342.782,83	5.539.207,18	5.539.207,18
					580.634.303,85	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\$)
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	514.867,79	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	108.387.669,93	0,00	0,00	0,00	109.609.808,39	1.222.138,46	1.222.138,46
					109.609.808,39	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	11.454.679,63	0,00	0,00	0,00	11.816.641,73	361.962,10	361.962,10
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	6.638.771,66	0,00	0,00	0,00	6.858.112,12	219.340,46	219.340,46
					18.674.753,85	0,00	0,00

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

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/01/2023

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	19.690.199,16	0,00	0,00	0,00	20.540.304,66	850.105,50	850.105,50
					20.540.304,66	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	28.714.099,15	0,00	0,00	0,00	30.546.227,93	1.832.128,78	1.832.128,78
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	23.855.932,72	0,00	0,00	0,00	25.412.744,25	1.556.811,53	1.556.811,53
					55.958.972,18	0,00	0,00

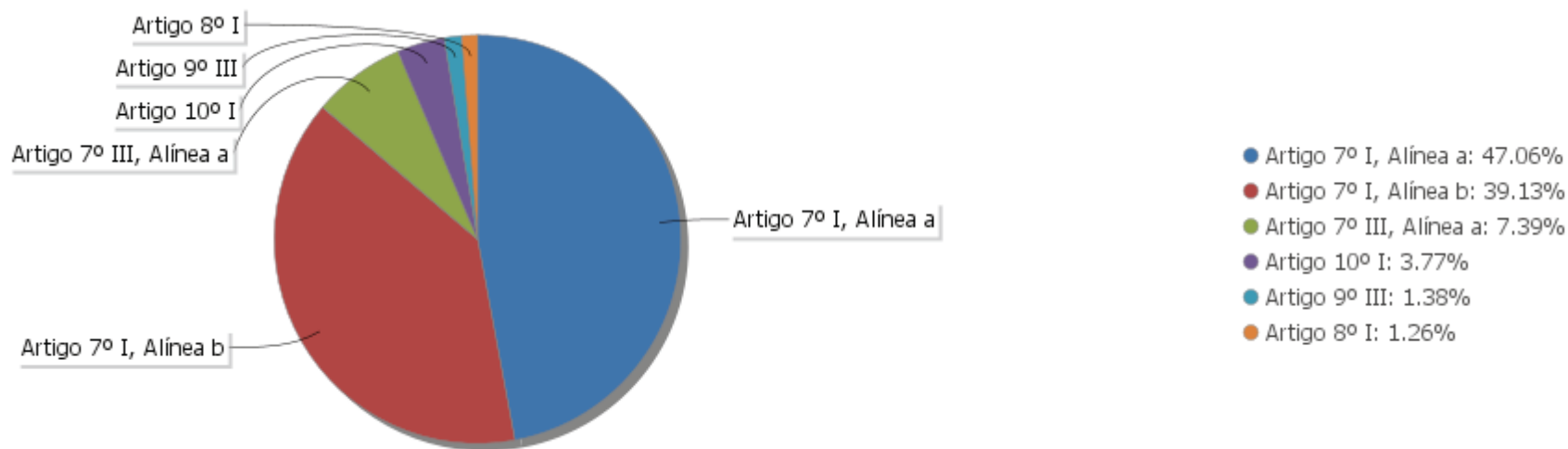
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

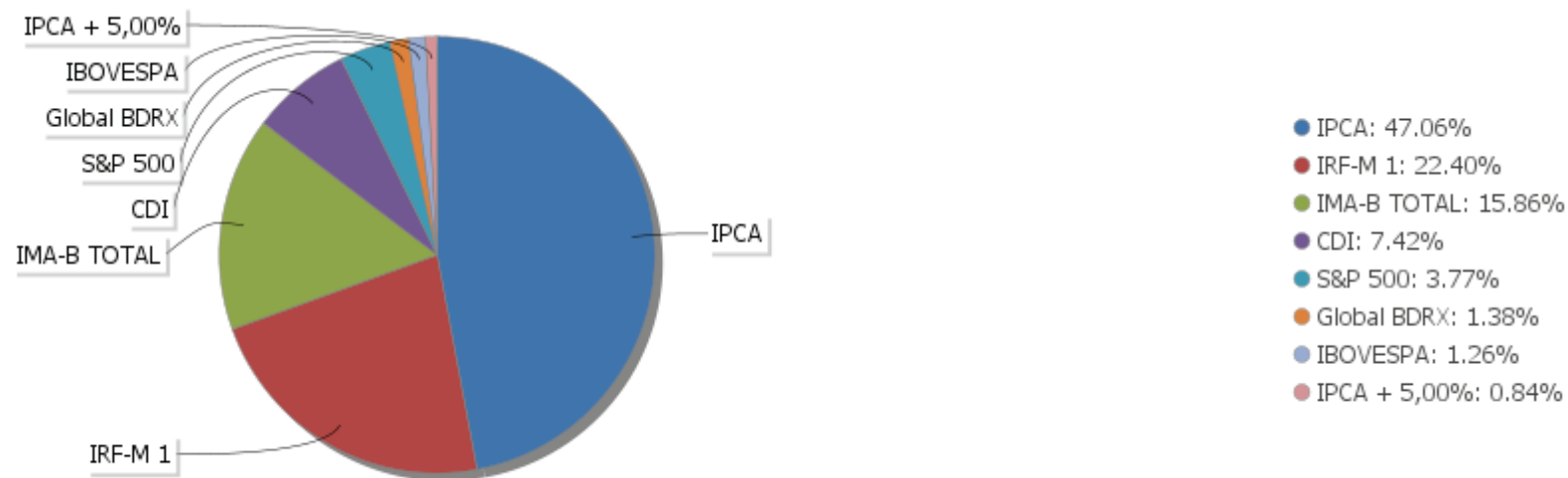
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	537.647.209,65	36,24	537.647.209,65	36,24
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	537.647.209,65	36,24
acima de 365 dias	946.080.895,52	63,76	1.483.728.105,17	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

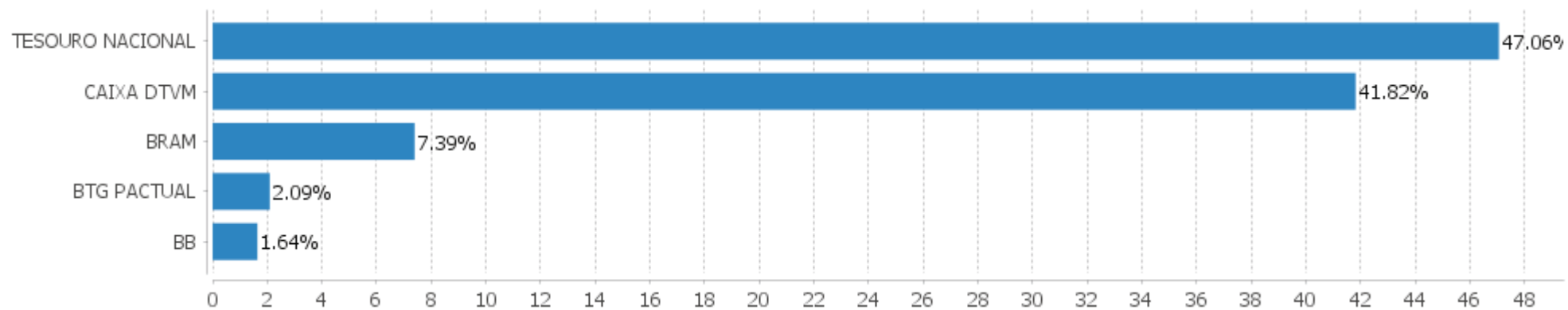


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/01/2023

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												1,40
IPCA + 4,00%	0,87												0,87
p.p. indexador	0,53												0,53
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

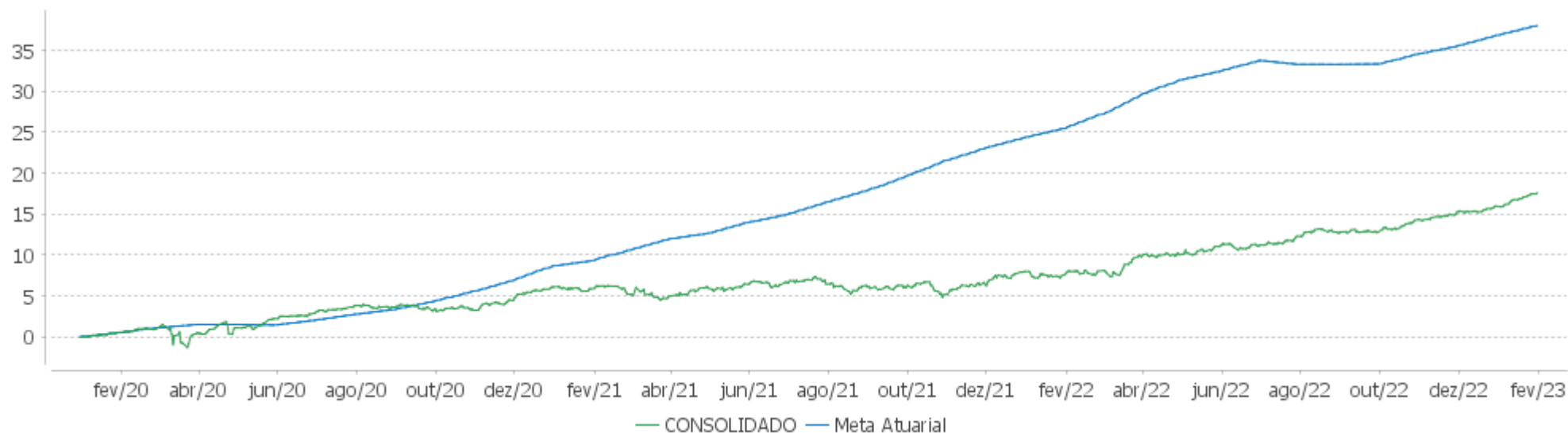
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

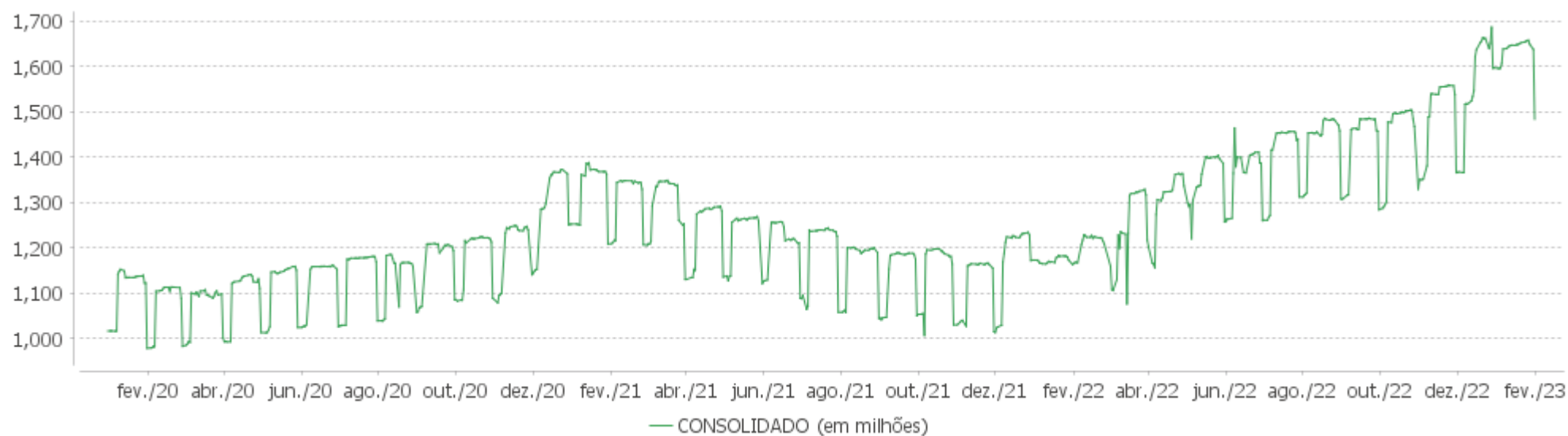
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	14	37,84	03 meses	2,85	2,58	0,27	1,18
Meses abaixo - Meta Atuarial	23	62,16	06 meses	4,72	3,55	1,18	1,51
			12 meses	9,24	10,01	-0,77	2,05
			24 meses	11,09	24,05	-12,96	2,45
Maior rentabilidade da Carteira	1,64	2022-03	36 meses	16,98	34,33	-17,35	2,77
Menor rentabilidade da Carteira	-0,80	2021-10	Desde 31/12/2019	17,59	35,05	-17,45	2,74

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

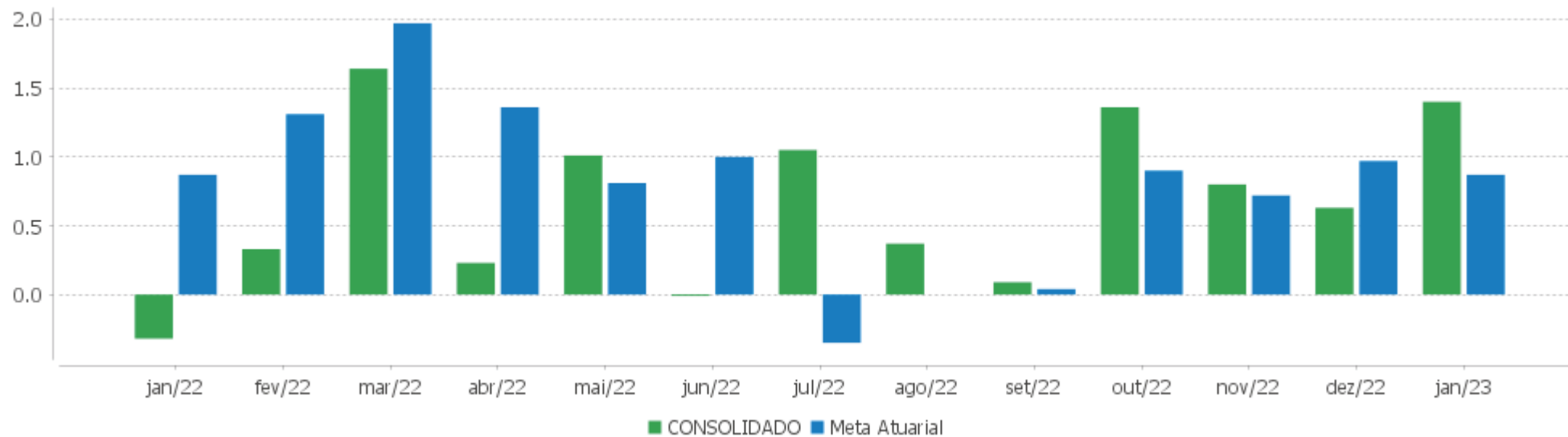


Patrimônio Líquido



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.	1,18 0,65	1,18 0,65	3,15 1,58	3,80 2,30	8,77 3,00	19,76 3,01	24,96 2,89
NTN-B 150535 (6,216000%) Var. IPCA p.p.	1,22 0,69	1,22 0,69	0,25 -1,32	0,98 -0,52	5,92 0,14		
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	1,18 0,65	1,18 0,65	3,15 1,58	3,79 2,29	8,75 2,97	19,70 2,95	24,87 2,79
NTN-B 150535 (5,886400%) Var. IPCA p.p.	1,19 0,66	1,19 0,66	3,18 1,61	3,86 2,35	8,85 3,08		
NTN-B 150860 (6,225100%) Var. IPCA p.p.	1,22 0,69	1,22 0,69	3,26 1,69	0,95 -0,56	5,85 0,07		
NTN-B 150860 (5,959200%) Var. IPCA p.p.	1,20 0,67	1,20 0,67	3,20 1,63	3,89 2,39	8,92 3,14	20,03 3,28	25,36 3,28
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	1,17 0,64	1,17 0,64	3,11 1,55	3,73 2,22	11,77 5,99	22,97 6,22	28,24 6,16
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	1,19 0,66	1,19 0,66	3,18 1,61	3,87 2,36	12,06 6,28	23,44 6,69	28,87 6,79
NTN-B 150860 (5,986700%) Var. IPCA p.p.	1,20 0,67	1,20 0,67	3,20 1,63	0,93 -0,57	5,82 0,05	16,62 -0,13	21,80 -0,28
NTN-B 150860 (5,949840%) Var. IPCA p.p.	1,19 0,66	1,19 0,66	3,19 1,62	3,89 2,38	8,91 3,14	20,03 3,27	25,35 3,27
NTN-B 150860 (5,599600%) Var. IPCA p.p.	1,17 0,64	1,17 0,64	3,11 1,54	3,71 2,21	8,71 2,94	19,76 3,00	25,03 2,95
NTN-B 150545 (5,900200%) Var. IPCA p.p.	1,19 0,66	1,19 0,66	3,18 1,61	3,86 2,36	12,05 6,27	23,45 6,70	28,90 6,82
NTN-B 150535 (5,927000%) Var. IPCA p.p.	1,19 0,66	1,19 0,66	3,11 1,54	3,80 2,29	8,80 3,03	19,86 3,11	25,14 3,06
NTN-B 150860 (5,788000%) Var. IPCA p.p.	1,18 0,65	1,18 0,65	3,15 1,58	3,81 2,30	8,82 3,05	19,90 3,15	25,20 3,13
NTN-B 150860 (5,926400%) Var. IPCA p.p.	1,19 0,66	1,19 0,66	3,19 1,62	0,93 -0,57	5,82 0,04		
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,39 1,39	1,39 1,39	2,20 3,18	4,47 1,63	10,60 3,44	14,02 8,10	22,83 11,37
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,28	0,28	-0,64	2,65	7,07	4,57	11,41

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/01/2023

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.	0,28	0,28	0,35	-0,19	-0,08	-1,35	-0,05
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	1,11 98,90	1,11 98,90	3,25 98,36	6,64 98,96	12,67 98,91	18,19 98,60	20,26 94,43
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	1,12 0,02	1,12 0,02	3,23 -0,02	6,66 -0,09	12,31 -0,23	16,01 -0,50	19,75 -0,76
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	1,39 0,43	1,39 0,43	2,20 -0,64	4,46 0,40	10,57 -0,49		
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,13 100,38	1,13 100,38	3,39 102,66	6,94 103,53	13,39 104,56	19,73 106,95	22,02 102,64
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	3,30 -0,06	3,30 -0,06	-11,00 -8,76	3,46 -6,49	-15,88 -17,03	-24,90 -23,48	-30,21 -29,92
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. IBOVESPA p.p.	3,16 -0,21	3,16 -0,21	-16,55 -14,31	-7,06 -17,01	-26,04 -27,19	-44,18 -42,76	-46,48 -46,19
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	4,32 -0,06	4,32 -0,06	6,18 -0,88	-4,25 -0,62	-17,40 -0,69	-8,03 -2,61	41,35 -3,83
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	6,53 2,76	6,53 2,76	7,43 5,31	3,32 6,31	-0,98 13,09	24,62 22,41	38,03 -12,92
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	6,38 2,61	6,38 2,61	7,48 5,35	7,64 10,64	3,25 17,32	31,03 28,82	
CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,00% p.p.	1,40 0,53	1,40 0,53	2,85 0,27	4,72 1,18	9,24 -0,77	11,09 -15,19	16,98 -20,28
CDI	1,12	1,12	3,30	6,71	12,81	18,45	21,46
IBOVESPA	3,37	3,37	-2,25	9,95	1,15	-1,42	-0,29
INPC + 6,00%	0,97	0,97	3,05	4,42	12,05	31,37	46,85
IPCA + 6,00%	1,04	1,04	3,08	4,55	12,12	31,18	45,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES CONSUMO FIC	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI			D+0	D+0		
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+0	D+2 du		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	1,10	1,10	3,25	6,75	12,54	16,51	20,51	28,48	37,42
IRF-M 1+	0,72	0,72	0,90	6,13	8,73	4,24	10,25	25,21	40,80
IRF-M TOTAL	0,84	0,84	1,65	6,17	9,82	8,42	13,75	26,79	40,53
IMA-B 5	1,40	1,40	2,01	4,40	11,19	16,27	25,06	40,14	54,28
IMA-B 5+	-1,26	-1,26	-3,59	1,84	3,66	-3,05	0,52	22,96	44,15
IMA-B TOTAL	-0,00	-0,00	-0,99	2,84	7,15	5,93	11,46	31,65	50,23
IMA-GERAL TOTAL	0,70	0,70	1,42	5,19	10,20	11,76	16,79	30,01	43,27
IDKA 2	1,44	1,44	1,90	3,99	10,86	16,26	25,79	39,66	54,03
IDKA 20	-4,58	-4,58	-9,69	-0,34	-3,60	-17,66	-17,08	6,23	30,85
CDI	1,12	1,12	3,30	6,71	12,81	18,45	21,46	28,49	36,69

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,37	3,37	-2,25	9,95	1,15	-1,42	-0,29	16,47	33,58
IBRX 100	3,51	3,51	-2,34	9,39	0,75	-1,38	0,24	19,26	37,61
IBRX 50	3,38	3,38	-1,47	10,88	1,52	0,57	3,26	18,48	34,15
SMALL CAP	2,92	2,92	-11,39	3,51	-15,47	-24,13	-27,55	5,24	19,33
Índice Consumo - ICON			-16,42	-6,37	-24,84	-42,47	-44,77	-20,86	-20,70
Índice Dividendos - IDIV	5,89	5,89	5,00	11,84	10,99	17,61	12,30	42,62	69,29

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/01/2023

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	3,77	3,77	2,13	-2,99	-14,07	2,21	50,95	110,51	132,79

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,60	-1,60	-5,69	0,25	1,59	-2,03	-8,32	17,07	23,45

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	4,67	4,67	7,25	-0,08	-13,97	-6,09	38,62	84,31	93,01

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,53	0,53	1,57	1,50	5,77	16,75	22,08	27,19	32,00
INPC	0,46	0,46	1,54	1,37	5,71	16,92	23,38	28,69	33,29
IGPM	0,21	0,21	0,09	-2,50	3,79	21,34	52,54	64,45	75,53
SELIC	1,12	1,12	3,30	6,71	12,81	18,45	21,46	28,49	36,70

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,87	0,87	2,58	3,55	10,01	26,28	37,25	48,75	60,49
IPCA + 5,00%	0,96	0,96	2,83	4,05	11,06	28,72	41,24	54,54	68,33
IPCA + 5,50%	1,00	1,00	2,96	4,30	11,59	29,95	43,26	57,50	72,37
IPCA + 5,89%	1,03	1,03	3,06	4,50	12,00	30,91	44,84	59,84	75,57
IPCA + 6,00%	1,04	1,04	3,08	4,55	12,12	31,18	45,29	60,50	76,48
INPC + 4,00%	0,80	0,80	2,55	3,41	9,94	26,46	38,73	50,51	62,06
INPC + 6,00%	0,97	0,97	3,05	4,42	12,05	31,37	46,85	62,40	78,20

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: 31/01/2023

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
Total			53.133.166,15	189.334.611,01		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 9.313.682,43

Value-At-Risk: 0,63%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		0,63	0,63			1.483.728.105,17	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,30%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,634200%)		0,14	0,00	0,16			30.277.211,52	2,04
NTN-B 150535 (5,784900%)		0,14	0,00	0,16			30.729.710,82	2,07
NTN-B 150535 (5,886400%)		0,14	0,00	0,18			7.206.386,76	0,49
NTN-B 150535 (5,909200%)		0,14	0,00	0,16			82.200.363,56	5,54
NTN-B 150535 (5,927000%)		0,24	-0,00	0,28			12.311.888,20	0,83
NTN-B 150535 (6,216000%)		0,24	0,00	0,28			2.604.714,15	0,18
NTN-B 150545 (5,900200%)		0,14	0,00	0,16			123.892.941,48	8,35
NTN-B 150832 (5,763300%)		0,14	0,00	0,16			42.029.366,78	2,83
NTN-B 150860 (5,599600%)		0,14	0,00	0,16			87.783.515,30	5,92
NTN-B 150860 (5,788000%)		0,14	0,00	0,16			72.588.238,48	4,89
NTN-B 150860 (5,926400%)		0,14	0,00	0,16			17.371.535,94	1,17
NTN-B 150860 (5,949840%)		0,14	0,00	0,16			70.920.309,39	4,78
NTN-B 150860 (5,959200%)		0,14	0,00	0,16			83.323.958,06	5,62
NTN-B 150860 (5,986700%)		0,14	0,00	0,16			29.049.618,56	1,96
NTN-B 150860 (6,225100%)		0,14	0,00	0,16			6.020.203,24	0,41
Sub-total	0,51	0,14	0,02		0,12	1,19	698.309.962,24	47,06

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI		0,01	-0,00	0,01			520.587,74	0,04

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/01/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,15	0,01	0,02			332.342.782,83	22,40
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,36	0,07	2,08			205.890.373,04	13,88
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		3,24	0,03	0,59			29.389.652,40	1,98
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		1,36	0,00	1,35			12.490.907,84	0,84
Sub-total	1,01	0,70	0,11		0,03	1,16	580.634.303,85	39,13

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRAPRESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,01	0,00	0,01			109.609.808,39	7,39
Sub-total	0,05	0,01	0,00		0,08	1,13	109.609.808,39	7,39

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 10,61%

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		10,60	0,18	8,38			30.546.227,93	2,06
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		10,83	0,15	8,11			25.412.744,25	1,71
Sub-total	15,78	10,61	0,33		0,34	6,45	55.958.972,18	3,77

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 12,23%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		12,23	0,07	0,94			20.540.304,66	1,38
Sub-total	18,50	12,23	0,07		0,17	4,32	20.540.304,66	1,38

Renda Variável

Value-At-Risk: 15,38%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		15,63	0,06	7,93			11.816.641,73	0,80

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/01/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		15,26	0,04	7,19			6.858.112,12	0,46
Sub-total	27,18	15,38	0,10		0,08	3,21	18.674.753,85	1,26