

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

CONSOLIDADO

Período: maio de 2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

95,50%

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%)	0,47	0,04	1,04	5,68	30.745.592,85	2,05
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	0,47	0,04	1,06	5,74	31.208.451,57	2,08
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,886400%)	0,59	0,04	1,07	5,78	7.319.165,86	0,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	0,47	0,04	1,07	5,79	83.488.154,44	5,57
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	3,83	0,04	1,07	5,80	12.504.925,42	0,83
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,216000%)	3,02	0,04	1,09	5,91	2.646.056,84	0,18
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	0,47	0,04	1,07	5,78	125.848.140,27	8,39
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	0,47	0,04	1,06	5,73	42.680.217,03	2,85
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	0,47	0,04	1,04	5,66	89.208.160,56	5,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	0,47	0,04	1,06	5,74	73.751.437,98	4,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,926400%)	2,97	0,04	1,07	5,80	17.647.212,15	1,18
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	0,47	0,04	1,07	5,80	72.043.895,86	4,80
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	0,47	0,04	1,07	5,81	84.643.215,20	5,64
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	2,99	0,04	1,07	5,82	29.508.595,82	1,97
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,225100%)	3,09	0,04	1,09	5,92	6.113.644,96	0,41

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea a	0,47	0,04	1,06	5,76	709.356.866,81	47,31

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	0,38	0,04	1,12	5,37	337.237.858,63	22,49	7.491.213.170,65	4,50
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,52	0,01	-0,01	4,58	206.231.362,75	13,75	3.601.308.774,10	5,73
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	6,24	-0,04	2,84	9,38	31.135.593,01	2,08	235.466.680,27	13,22
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2,52	0,01	-0,01	4,58	12.523.767,25	0,84	3.478.619.664,42	0,36
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	1,35	0,03	0,86	5,24	587.128.581,64	39,16		

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	1,13	5,29	21.043.869,21	1,40	13.081.140.366,94	0,16
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,05	1,04	3,28	365.136,64	0,02	3.860.323.166,27	0,01
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,05	0,06	1,16	5,34	114.175.402,44	7,61	8.436.127.357,01	1,35
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	0,52	0,06	1,16	5,33	135.584.408,29	9,04		
		Renda Fixa	0,65	0,04	0,98	5,50	1.432.069.856,74	95,50		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDÁ VARIÁVEL

1,21%

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	28,44	0,16	12,47	-1,87	11.239.979,42	0,75	113.419.160,24	9,91
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	26,88	0,65	13,18	4,64	6.946.744,41	0,46	618.934.183,67	1,12
Sub-total Artigo 8º I			26,23	0,35	12,74	0,52	18.186.723,83	1,21		
Renda Variável			26,23	0,35	12,74	0,52	18.186.723,83	1,21		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,50%

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	24,59	0,03	5,80	14,00	22.446.112,56	1,50	2.053.133.646,70	1,09
Sub-total Artigo 9º III			24,59	0,03	5,80	14,00	22.446.112,56	1,50		
Investimentos no Exterior			24,59	0,03	5,80	14,00	22.446.112,56	1,50		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

1,79%

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	20,66	-0,48	1,23	12,43	0,00	0,00	457.117.581,91	0,00
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	20,97	-0,46	1,21	12,31	26.791.502,30	1,79	1.555.010.010,21	1,72
Sub-total Artigo 10º I			20,71	-0,47	1,22	12,37	26.791.502,30	1,79		
Investimentos Estruturados			20,71	-0,47	1,22	12,37	26.791.502,30	1,79		
Total			1,42	0,02	1,16	5,78	1.499.494.195,43	100,00		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

Ativo	Valor (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	32.282.088,55
Sub-total Disponibilidades Financeiras	32.282.088,55
Total	1.531.776.283,98

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	709.356.866,81	47,31	0,00	57,40	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	587.128.581,64	39,16	0,00	20,33	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	135.584.408,29	9,04	0,00	22,27	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	1.432.069.856,74	95,50					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	18.186.723,83	1,21	0,00	0,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	18.186.723,83	1,21					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	22.446.112,56	1,50	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	22.446.112,56	1,50					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	26.791.502,30	1,79	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	26.791.502,30	1,79					15,00
Total		1.499.494.195,43	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	1,06 94,55	5,76 107,34	3,53 108,65	6,68 101,87	10,14 75,22	7.505.343,08	39.271.113,74
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,86 76,95	5,24 97,62	2,96 90,97	6,43 98,10	10,77 79,95	6.029.241,48	37.063.257,58
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,16 102,82	5,33 99,29	3,25 99,92	6,56 100,09	13,31 98,75	1.504.990,79	6.287.822,53
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	12,74 9,00	0,52 1,79	8,38 5,13	-3,95 -0,26	-15,36 -12,65	2.055.276,61	93.272,54
Artigo 9º III % do CDI	5,80 516,77	14,00 260,69	8,47 260,42	8,53 130,21	13,81 102,47	1.231.494,18	2.755.913,40
Artigo 10º I % do CDI	1,22 108,68	12,37 230,42	7,44 228,88	6,89 105,11	13,26 98,40	712.457,12	6.503.558,98
CONSOLIDADO (Total)						19.038.803,26	91.974.938,77

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%)	31.299.400,32	0,00	0,00	876.661,25	30.745.592,85	322.853,78	1.694.616,91
NTN-B 150535 (5,784900%)	31.777.794,08	0,00	0,00	901.012,95	31.208.451,57	331.670,44	1.738.315,69
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.453.840,93	0,00	0,00	213.077,39	7.319.165,86	78.402,32	410.538,55
NTN-B 150535 (5,909200%)	85.027.368,56	0,00	0,00	2.435.170,14	83.488.154,44	895.956,02	4.690.397,46
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.735.798,99	0,00	0,00	365.275,52	12.504.925,42	134.401,95	703.400,44
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.696.118,68	0,00	0,00	79.143,03	2.646.056,84	29.081,19	151.792,19
NTN-B 150545 (5,900200%)	128.151.303,60	0,00	0,00	3.652.755,21	125.848.140,27	1.349.591,88	7.065.176,07
NTN-B 150832 (5,763300%)	42.234.596,43	0,00	0,00	0,00	42.680.217,03	445.620,60	2.332.191,85
NTN-B 150860 (5,599600%)	88.288.687,12	0,00	0,00	0,00	89.208.160,56	919.473,44	4.818.981,96
NTN-B 150860 (5,788000%)	72.979.879,56	0,00	0,00	0,00	73.751.437,98	771.558,42	4.036.218,07
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.460.616,70	0,00	0,00	0,00	17.647.212,15	186.595,45	974.924,45
NTN-B 150860 (5,949840%)	71.280.693,76	0,00	0,00	0,00	72.043.895,86	763.202,10	3.986.478,33

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150860 (5,959200%)	83.745.887,12	0,00	0,00	0,00	84.643.215,20	897.328,08	4.686.605,16
NTN-B 150860 (5,986700%)	29.195.124,75	0,00	0,00	0,00	29.508.595,82	313.471,07	1.636.886,81
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.047.508,62	0,00	0,00	0,00	6.113.644,96	66.136,34	344.589,80
					709.356.866,81	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	12.524.893,26	0,00	0,00	0,00	12.523.767,25	-1.126,01	557.349,07
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	206.250.562,85	0,00	0,00	0,00	206.231.362,75	-19.200,10	9.183.567,01
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.275.210,76	0,00	0,00	0,00	31.135.593,01	860.382,25	2.685.418,60
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	345.109.255,05	239.840.902,10	-252.901.483,86	0,00	337.237.858,63	5.189.185,34	24.636.922,90
					587.128.581,64	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	361.363,22	0,00	0,00	0,00	365.136,64	3.773,42	11.583,15
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	112.865.135,93	0,00	0,00	0,00	114.175.402,44	1.310.266,51	5.787.732,51
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	12.329.822,90	8.523.095,45	0,00	0,00	21.043.869,21	190.950,86	488.506,87
					135.584.408,29	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	9.993.850,04	0,00	0,00	0,00	11.239.979,42	1.246.129,38	-214.700,21
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	6.137.597,18	0,00	0,00	0,00	6.946.744,41	809.147,23	307.972,75
					18.186.723,83	0,00	

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

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2023

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	21.214.618,38	0,00	0,00	0,00	22.446.112,56	1.231.494,18	2.755.913,40
					22.446.112,56	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	31.890.360,45	0,00	-32.282.088,55	0,00	0,00	391.728,10	3.567.989,40
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	26.470.773,28	0,00	0,00	0,00	26.791.502,30	320.729,02	2.935.569,58
					26.791.502,30	0,00	

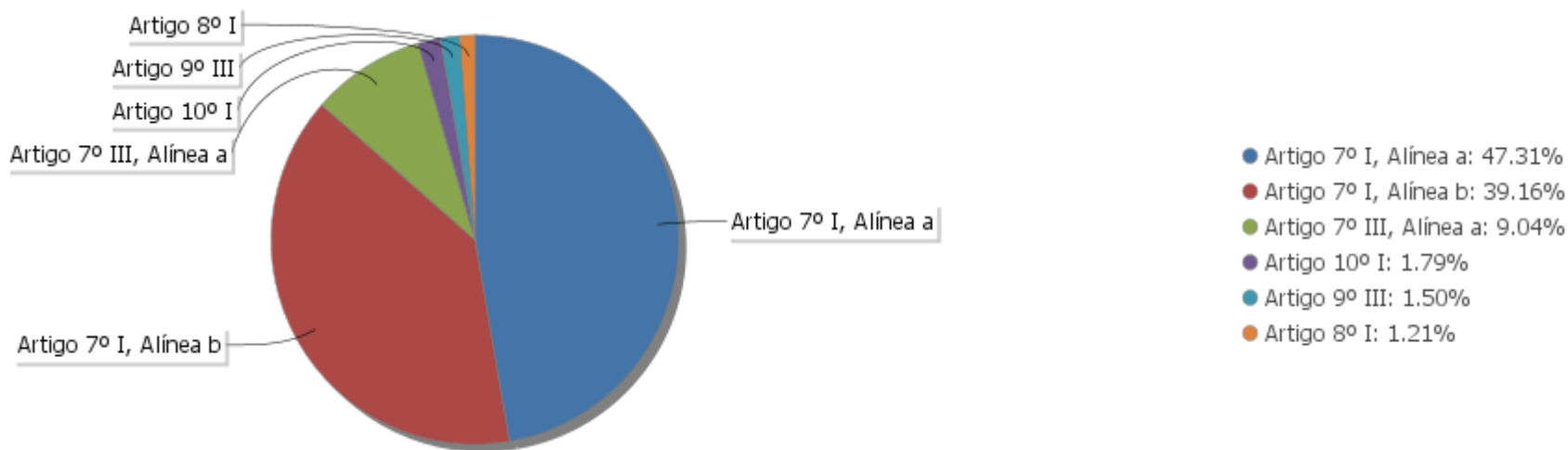
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

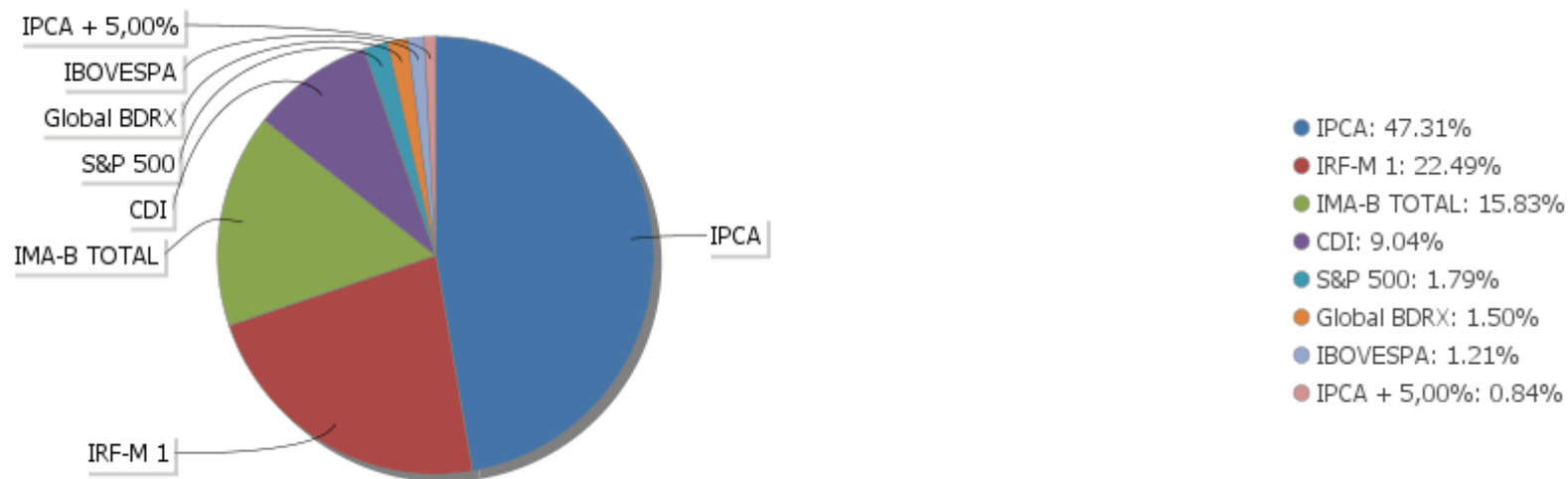
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	540.246.605,61	36,03	540.246.605,61	36,03	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	540.246.605,61	36,03	
acima de 365 dias	959.247.589,82	63,97	1.499.494.195,43	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

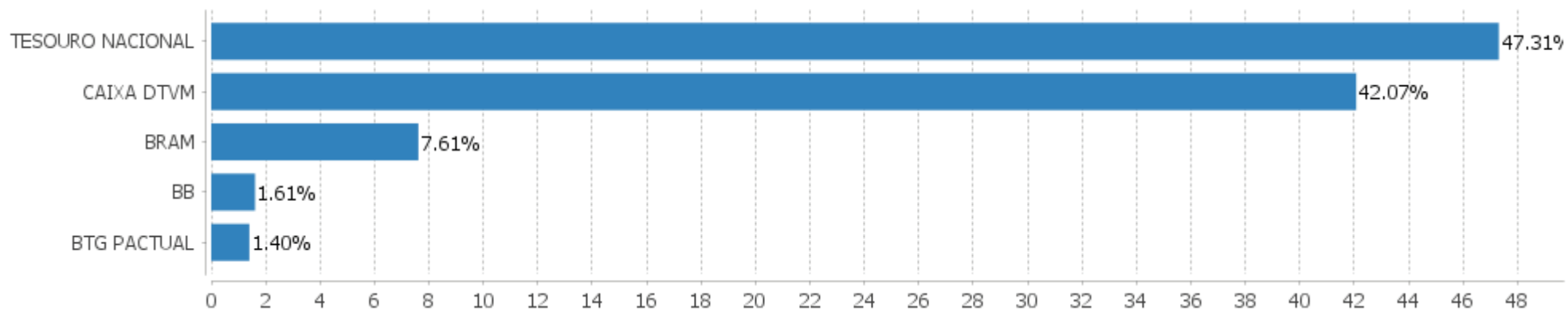


Alocação Por Estratégia



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	1,16								5,78
IPCA + 4,00%	0,87	1,12	1,07	0,89	0,57								4,62
p.p. indexador	0,53	-0,33	0,34	-0,01	0,58								1,16
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

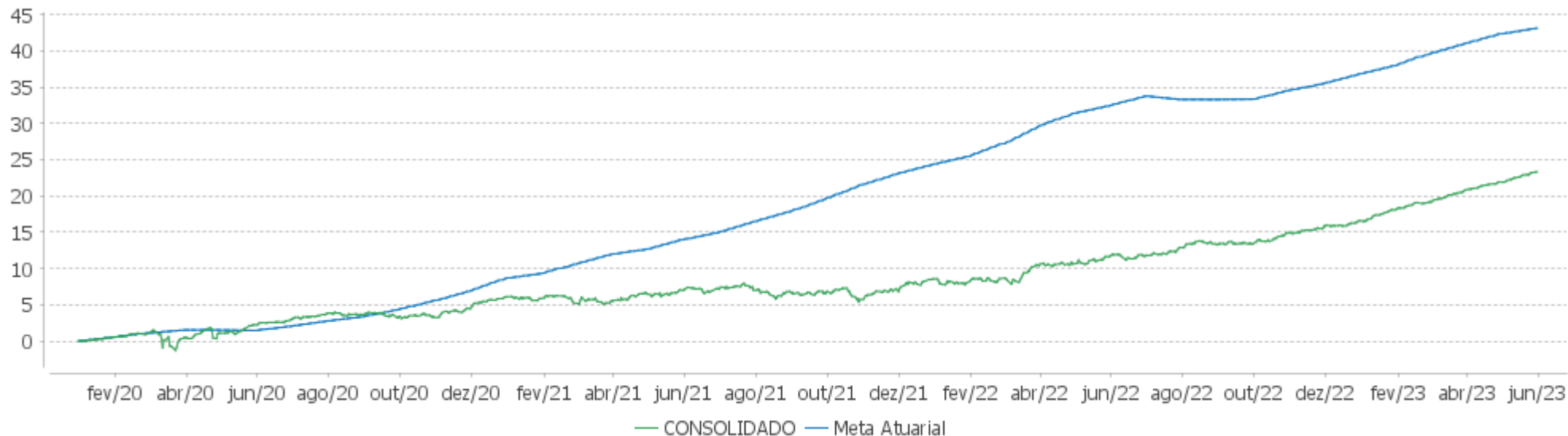
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

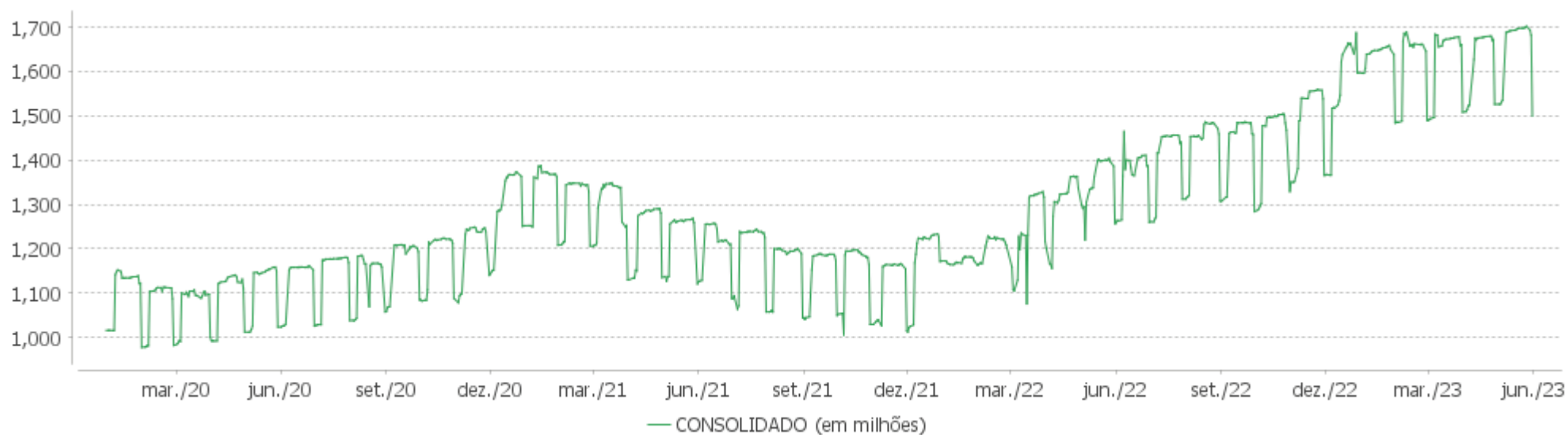
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	16	39,02	03 meses	3,49	2,56	0,94	0,75
Meses abaixo - Meta Atuarial	25	60,98	06 meses	6,44	5,63	0,82	0,91
			12 meses	10,38	8,08	2,30	1,42
			24 meses	15,27	24,15	-8,88	2,20
Maior rentabilidade da Carteira	1,64	2022-03	36 meses	20,63	38,21	-17,58	2,17
Menor rentabilidade da Carteira	-0,80	2021-10	Desde 31/12/2019	23,31	40,06	-16,74	2,60

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

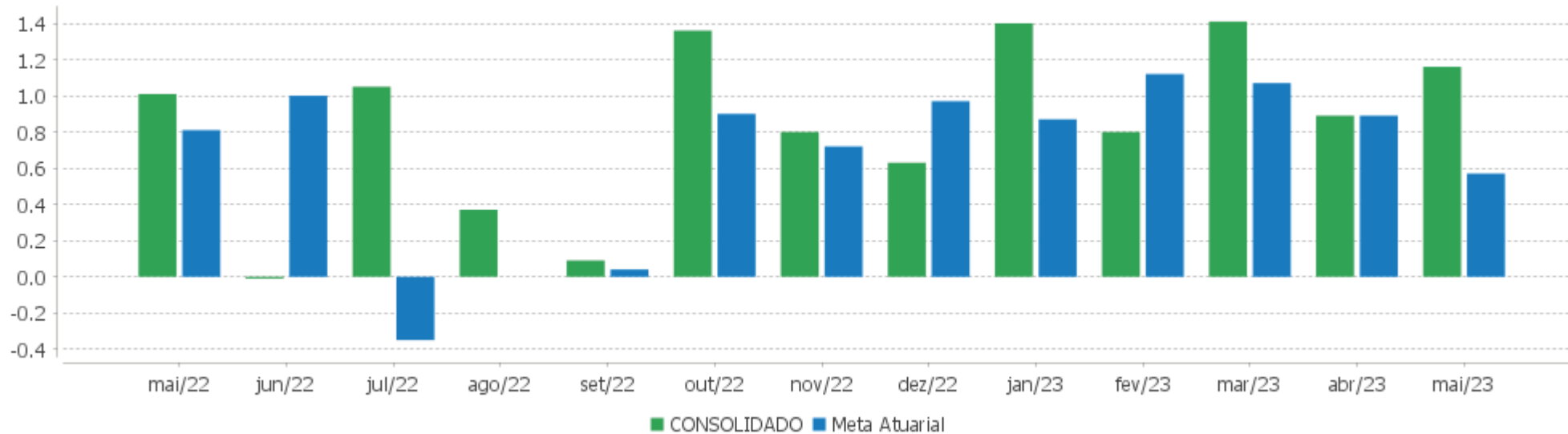


Patrimônio Líquido



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.	1,06 0,83	5,74 2,78	3,52 1,96	6,64 3,05	10,08 6,14	23,25 7,13	32,22 6,73
NTN-B 150535 (6,216000%) Var. IPCA p.p.	1,09 0,86	5,91 2,96	3,62 2,06	6,86 3,27	7,30 3,37		
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,83	5,73 2,78	3,51 1,95	6,63 3,04	10,06 6,12	23,20 7,07	32,12 6,63
NTN-B 150535 (5,886400%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,84	5,78 2,83	3,54 1,98	6,69 3,10	10,19 6,25		
NTN-B 150860 (6,225100%) Var. IPCA p.p.	1,09 0,86	5,92 2,96	3,62 2,07	6,86 3,27	7,27 3,33		
NTN-B 150860 (5,959200%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,84	5,81 2,86	3,56 2,00	6,73 3,14	10,26 6,32	23,58 7,45	32,68 7,20
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,84	5,79 2,84	3,55 1,99	6,71 3,11	10,21 6,27	27,08 10,95	36,39 10,91
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,81	5,68 2,72	3,48 1,92	6,57 2,98	9,92 5,99	26,51 10,38	35,63 10,14
NTN-B 150860 (5,986700%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,84	5,82 2,87	3,57 2,01	6,74 3,15	7,14 3,20	20,08 3,95	28,93 3,45
NTN-B 150860 (5,949840%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,84	5,80 2,85	3,56 2,00	6,73 3,13	10,25 6,31	23,57 7,44	32,67 7,19
NTN-B 150860 (5,599600%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,81	5,66 2,71	3,47 1,91	6,55 2,96	9,89 5,95	23,11 6,98	32,13 6,65
NTN-B 150545 (5,900200%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,84	5,78 2,83	3,54 1,99	6,70 3,11	10,20 6,26	27,08 10,95	36,41 10,93
NTN-B 150535 (5,927000%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,84	5,80 2,84	3,55 1,99	6,71 3,12	10,14 6,21	23,41 7,28	32,46 6,97
NTN-B 150860 (5,788000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,83	5,74 2,79	3,52 1,96	6,65 3,05	10,08 6,15	23,36 7,23	32,42 6,94
NTN-B 150860 (5,926400%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,84	5,80 2,84	3,55 1,99	6,71 3,12	7,11 3,17		
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01 -2,54	4,58 -4,19	1,78 -5,61	5,96 -2,60	7,65 -2,82	16,87 1,32	24,47 -1,67
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,84	9,38	7,68	9,29	10,62	16,76	25,47

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2023

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.	0,31	0,61	0,29	0,73	0,15	1,22	-0,67
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	1,12 -0,02	5,37 -0,06	3,20 -0,06	6,58 -0,08	13,30 -0,22	20,31 -0,52	22,58 -0,79
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	-0,01 -0,67	4,58 -0,44	1,78 -1,02	5,96 -0,17	7,63 -1,48		
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,16 103,35	5,34 99,46	3,26 100,23	6,57 100,23	13,81 102,50	23,57 105,06	26,44 105,36
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	1,04 92,96	4,93 91,88	2,98 91,76	6,02 91,84	12,36 91,75	19,92 88,82	21,20 84,44
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	1,13 100,78	5,29 98,50	3,19 98,22	6,45 98,42	13,32 98,82	22,25 99,20	23,91 95,27
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	13,18 9,45	4,64 5,91	13,20 9,95	1,51 5,20	-7,90 -5,20	-33,40 -19,24	2,12 -21,83
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. IBOVESPA p.p.	12,47 8,73	-1,87 -0,60	5,60 2,35	-7,05 -3,35	-17,58 -14,87	-48,81 -34,65	-35,58 -59,53
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	5,80 -0,10	14,00 -0,59	8,47 -0,07	8,53 -1,22	13,81 -0,98	-3,05 -2,88	29,26 -4,63
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	1,21 -0,95	12,31 5,98	7,30 4,28	6,81 8,20	10,60 1,60	16,12 19,29	58,02 29,08
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	1,23 -0,93	12,43 6,10	7,55 4,53	6,96 8,35	15,57 6,56	21,88 25,04	68,08 39,14
CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,00% p.p.	1,16 0,58	5,78 1,16	3,49 0,94	6,44 0,82	10,38 2,30	15,27 -10,32	20,63 -20,47
CDI	1,12	5,37	3,25	6,55	13,48	22,43	25,10
IBOVESPA	3,74	-1,28	3,24	-3,69	-2,71	-14,17	23,95
INPC + 6,00%	0,87	5,27	3,03	6,53	9,94	30,40	50,49
IPCA + 6,00%	0,74	5,43	3,05	6,63	10,15	30,45	49,38

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	1,14	5,42	3,26	6,67	13,53	20,82	23,37	31,17	40,60
IRF-M 1+	2,85	8,54	6,92	10,30	15,84	14,80	14,48	30,11	50,74
IRF-M TOTAL	2,20	7,34	5,54	8,93	14,73	16,57	17,40	30,67	48,09
IMA-B 5	0,57	5,93	3,02	6,92	9,45	19,90	28,76	40,94	59,58
IMA-B 5+	4,13	11,16	11,29	9,84	11,30	11,03	22,89	28,01	69,69
IMA-B TOTAL	2,53	8,76	7,39	8,55	10,47	15,54	26,13	34,56	66,49
IMA-GERAL TOTAL	1,77	6,78	4,95	7,60	12,55	18,47	23,45	32,82	51,09
IDKA 2	0,29	5,76	2,60	7,07	8,74	18,79	28,85	40,48	57,41
IDKA 20	7,14	15,51	20,12	11,68	12,90	1,60	17,65	14,97	73,96
CDI	1,12	5,37	3,25	6,55	13,48	22,43	25,10	31,21	39,57

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,74	-1,28	3,24	-3,69	-2,71	-14,17	23,95	11,65	41,15
IBRX 100	3,59	-2,09	2,36	-4,66	-4,47	-16,34	23,50	12,48	44,21
IBRX 50	2,92	-3,51	0,95	-5,97	-4,44	-15,81	25,71	11,41	38,93
SMALL CAP	13,54	4,71	13,69	1,56	-7,34	-32,24	6,89	5,09	34,10
Índice Consumo - ICON	12,26		6,51	-6,28	-15,80	-46,84	-32,02	-26,79	-9,87
Índice Dividendos - IDIV	0,84	0,48	2,64	-1,14	-0,85	1,55	39,98	32,28	81,33

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	2,16	6,32	3,02	-1,39	9,00	-3,17	28,94	96,40	109,24

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	5,43	5,10	7,30	5,10	6,84	6,99	13,39	18,05	36,10

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	0,56	4,28	0,55	-1,39	6,70	-11,51	19,15	69,85	72,84

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,23	2,95	1,56	3,59	3,94	16,13	25,48	27,84	33,80
INPC	0,36	2,79	1,54	3,50	3,74	16,08	26,41	29,00	35,17
IGPM	-1,84	-2,58	-2,73	-2,14	-4,47	5,78	44,96	54,39	66,19
SELIC	1,12	5,37	3,25	6,55	13,48	22,43	25,10	31,21	39,57

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,57	4,62	2,56	5,63	8,08	25,59	41,11	49,48	62,68
IPCA + 5,00%	0,66	5,03	2,80	6,13	9,11	28,01	45,21	55,30	70,63
IPCA + 5,50%	0,70	5,23	2,93	6,38	9,63	29,23	47,29	58,27	74,72
IPCA + 5,89%	0,73	5,39	3,02	6,57	10,03	30,18	48,92	60,62	77,96
IPCA + 6,00%	0,74	5,43	3,05	6,63	10,15	30,45	49,38	61,28	78,88
INPC + 4,00%	0,70	4,45	2,54	5,53	7,87	25,54	42,15	50,84	64,35
INPC + 6,00%	0,87	5,27	3,03	6,53	9,94	30,40	50,49	62,75	80,72

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150535 (5,634200%)	30.745.592,85	5,634200	30.954.053,46	5,552700	208.460,61
NTN-B 150535 (5,784900%)	31.208.451,57	5,784900	31.813.888,28	5,552700	605.436,71
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.319.165,86	5,886400	7.523.554,66	5,552700	204.388,80
NTN-B 150535 (5,909200%)	83.488.154,44	5,909200	85.983.481,84	5,552700	2.495.327,40
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.504.925,42	5,927000	12.897.522,28	5,552700	392.596,86
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.646.056,84	6,216000	2.794.463,16	5,552700	148.406,32
NTN-B 150545 (5,900200%)	125.848.140,27	5,900200	128.425.547,55	5,730200	2.577.407,28
NTN-B 150832 (5,763300%)	42.680.217,03	5,763300	43.424.878,38	5,507000	744.661,35
NTN-B 150860 (5,599600%)	89.208.160,56	5,599600	87.569.038,98	5,725100	-1.639.121,58
NTN-B 150860 (5,788000%)	73.751.437,98	5,788000	74.433.683,13	5,725100	682.245,15
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.647.212,15	5,926400	18.170.575,59	5,725100	523.363,44
NTN-B 150860 (5,949840%)	72.043.895,86	5,949840	74.433.683,13	5,725100	2.389.787,27
NTN-B 150860 (5,959200%)	84.643.215,20	5,959200	87.569.038,98	5,725100	2.925.823,78
NTN-B 150860 (5,986700%)	29.508.595,82	5,986700	30.649.163,64	5,725100	1.140.567,82
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.113.644,96	6,225100	6.567.677,92	5,725100	454.032,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2434	02/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	504.803,13	0,00	161.460,74046300	3,1264760000
2393	03/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	635.683,40	203.208,26170800	3,1282360000
2435	03/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	188.606,99	0,00	60.291,80343100	3,1282360000
2395	04/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	635.683,40	203.080,11203200	3,1302100000
2394	04/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.326.319,21	0,00	423.715,72833772	3,1302100000
2436	04/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	152.430,72	0,00	48.696,64335600	3,1302100000
2448	04/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	635.683,39	203.080,10957400	3,1302100000
2447	04/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.607.488,09	0,00	1.471.942,16681900	3,1302100000
2338	04/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	635.683,39	203.080,10879600	3,1302100000
2337	04/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	635.593,39	203.051,35629200	3,1302100000
2336	04/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	635.683,39	0,00	203.080,10964100	3,1302100000
2396	05/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.269,05	0,00	3.598,13979300	3,1319100000
2449	05/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.105.026,96	0,00	672.122,43008260	3,1319100000
2398	08/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.328.680,63	3.934.673,16777400	3,1333430000
2397	08/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	36.539.245,69	0,00	11.661.425,41368700	3,1333430000
2451	08/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	43.296.588,34	13.818.017,48047700	3,1333430000
2450	08/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	140.334.626,82	0,00	44.787.508,68321700	3,1333430000
2340	08/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	18.341.947,99	5.853.795,12782300	3,1333430000
2339	08/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	48.392.407,01	0,00	15.444.337,56853300	3,1333430000
2437	09/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.611,49	0,00	3.066,46758400	3,1343850000
2452	09/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	189.194,83	0,00	60.361,06923600	3,1343850000
2438	10/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.469,67	0,00	1.425,44196700	3,1356380000
2399	11/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.385,58	0,00	2.035,31273500	3,1373950000
2453	11/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	235.948,89	0,00	75.205,35029800	3,1373950000
2439	11/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.653,73	0,00	3.714,46056300	3,1373950000
2454	12/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	700,00	0,00	223,04401500	3,1383940000
2440	12/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.577,79	0,00	821,37233200	3,1383940000
2406	15/05/2023	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	8.523.095,45	0,00	2.243.468,20612364	3,7990712000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2455	15/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.272,09	0,00	723,63932800	3,1398100000
2441	15/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.897,79	0,00	1.241,40951204	3,1398100000
2456	16/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	39.976,83	12.726,02739700	3,1413440000
2442	17/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.815,90	0,00	2.168,88464000	3,1425830000
2457	17/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.972,31	2.218,65575400	3,1425830000
2400	18/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	901,10	286,57931800	3,1443240000
2459	18/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.352,64	2.338,38497100	3,1443240000
2458	18/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.874,73	0,00	3.458,52717400	3,1443240000
2460	19/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.204,90	0,00	4.197,34571800	3,1460120000
2461	22/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.405,02	0,00	764,12790800	3,1474050000
2443	22/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.104,66	0,00	5.116,80574900	3,1474050000
2462	23/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	18.601,63	5.906,81696700	3,1491800000
2444	23/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	32.221,71	0,00	10.231,77779600	3,1491800000
2463	24/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.520,00	0,00	799,73824440	3,1510310000
2445	24/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	58.384,42	0,00	18.528,67204417	3,1510310000
2465	25/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.545,01	4.295,01683800	3,1536570000
2464	25/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.846,57	0,00	2.488,08605300	3,1536570000
2466	26/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	157.361,78	0,00	49.870,69134900	3,1553960000
2402	29/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.278,11	1.672,15231200	3,1564760000
2401	29/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	48.893,04	0,00	15.489,75503000	3,1564760000
2468	29/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.578.247,70	3.034.475,06266600	3,1564760000
2467	29/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	220.555,37	0,00	69.873,92585909	3,1564760000
2446	30/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	116.542,50	0,00	36.901,49942700	3,1582050000
2470	30/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.340.548,18	3.907.456,34672500	3,1582050000
2469	30/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.571,82	0,00	4.930,59190268	3,1582050000
2407	31/05/2023	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	0,00	32.282.088,55	16.111.017,36638340	2,0037275000
2404	31/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	29.073.740,91	9.201.969,07297000	3,1595130000
2403	31/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	895.881,71	0,00	283.550,56934400	3,1595130000
2471	31/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.971.099,05	0,00	940.366,14187000	3,1595130000
2472	31/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	94.497.858,39	29.908.994,95903324	3,1595130000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2341	31/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	30.172.917,12	9.549.863,26046800	3,1595130000
Total			248.363.997,55	285.183.572,41		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 4.994.645,73

Value-At-Risk: 0,33%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		0,33	0,33			1.499.494.195,43	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,21%

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	0,10			30.745.592,85	2,05
NTN-B 150535 (5,784900%)		0,07	0,00	0,10			31.208.451,57	2,08
NTN-B 150535 (5,886400%)		0,07	0,00	0,10			7.319.165,86	0,49
NTN-B 150535 (5,909200%)		0,07	0,00	0,10			83.488.154,44	5,57
NTN-B 150535 (5,927000%)		0,07	0,00	0,10			12.504.925,42	0,83
NTN-B 150535 (6,216000%)		0,07	0,00	0,10			2.646.056,84	0,18
NTN-B 150545 (5,900200%)		0,07	0,00	0,10			125.848.140,27	8,39
NTN-B 150832 (5,763300%)		0,07	0,00	0,10			42.680.217,03	2,85
NTN-B 150860 (5,599600%)		0,07	0,00	0,10			89.208.160,56	5,95
NTN-B 150860 (5,788000%)		0,07	0,00	0,10			73.751.437,98	4,92
NTN-B 150860 (5,926400%)		0,07	0,00	0,10			17.647.212,15	1,18
NTN-B 150860 (5,949840%)		0,07	0,00	0,10			72.043.895,86	4,80
NTN-B 150860 (5,959200%)		0,07	0,00	0,10			84.643.215,20	5,64
NTN-B 150860 (5,986700%)		0,07	0,00	0,10			29.508.595,82	1,97
NTN-B 150860 (6,225100%)		0,07	0,00	0,10			6.113.644,96	0,41
Sub-total	0,30	0,07	0,00		-0,20	1,06	709.356.866,81	47,31

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		0,22	0,03	0,01			337.237.858,63	22,49

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2023

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		0,87	0,06	1,68			206.231.362,75	13,75
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		2,28	0,02	0,65			31.135.593,01	2,08
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		0,87	0,00	0,86			12.523.767,25	0,84
Sub-total	0,41	0,49	0,12		-0,64	0,86	587.128.581,64	39,16

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		0,02	0,00	0,02			21.043.869,21	1,40
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	-0,00	0,01			365.136,64	0,02
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,03	0,00	0,03			114.175.402,44	7,61
Sub-total	0,04	0,02	0,00		0,72	1,16	135.584.408,29	9,04

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 7,50%

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		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		7,50	0,08	6,11			26.791.502,30	1,79
Sub-total	12,72	7,50	0,08		0,01	1,22	26.791.502,30	1,79

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 7,57%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		7,57	0,05	0,61			22.446.112,56	1,50
Sub-total	17,30	7,57	0,05		0,27	5,80	22.446.112,56	1,50

Renda Variável

Value-At-Risk: 10,98%

Artigo 8º I

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		11,02	0,05	5,64			11.239.979,42	0,75
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		11,63	0,03	5,94			6.946.744,41	0,46
Sub-total	20,46	10,98	0,09		0,57	12,74	18.186.723,83	1,21