

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

CONSOLIDADO

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

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

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

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

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

1,06%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|------------------------------|--------|----------------------------|------------------------|-------------------|--------------|---------------|----------------------|-------------|----------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Ano | | | | |
| BB | BB | BB AÇÕES CONSUMO FIC | 28,11 | -3,18 | -6,39 | -13,02 | 9.963.776,08 | 0,66 | 103.513.265,51 | 9,63 |
| CAIXA DTVM | CEF | FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | 26,87 | -1,56 | -1,83 | -9,25 | 6.024.635,89 | 0,40 | 506.329.839,46 | 1,19 |
| Sub-total Artigo 8º I | | | 25,62 | -2,58 | -4,72 | -11,63 | 15.988.411,97 | 1,06 | | |
| Renda Variável | | | 25,62 | -2,58 | -4,72 | -11,63 | 15.988.411,97 | 1,06 | | |

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,42%

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

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--------------------------------|--------|-------------------------------------|------------------------|-------------------|-------------|-------------|----------------------|-------------|------------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Ano | | | | |
| CAIXA DTVM | CEF | FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | 25,51 | 0,87 | 3,19 | 8,45 | 21.354.673,03 | 1,42 | 2.012.391.655,50 | 1,06 |
| Sub-total Artigo 9º III | | | 25,51 | 0,87 | 3,19 | 8,45 | 21.354.673,03 | 1,42 | | |
| Investimentos no Exterior | | | 25,51 | 0,87 | 3,19 | 8,45 | 21.354.673,03 | 1,42 | | |

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

3,79%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|-------------------------------|-------------|--|------------------------|-------------------|-------------|-------------|----------------------|-------------|------------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Ano | | | | |
| BTG PACTUAL | BTG PACTUAL | BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO | 23,21 | 1,47 | 4,14 | 8,86 | 31.257.150,74 | 2,07 | 496.229.337,01 | 6,30 |
| CAIXA DTVM | CEF | CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 23,44 | 1,47 | 3,98 | 8,82 | 25.960.734,18 | 1,72 | 1.679.532.532,23 | 1,55 |
| Sub-total Artigo 10º I | | | 23,23 | 1,47 | 4,06 | 8,84 | 57.217.884,92 | 3,79 | | |
| Investimentos Estruturados | | | 23,23 | 1,47 | 4,06 | 8,84 | 57.217.884,92 | 3,79 | | |
| Total | | | 1,69 | 0,06 | 1,41 | 3,65 | 1.508.074.563,61 | 100,00 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

| Artigo | Tipo de Ativo | Valor(R\$) | % Carteira | Política de Investimentos | | | | |
|-----------------------------------|---|-------------------------|---------------|---------------------------|----------|--------|------|--------------|
| | | | | Mínimo | Objetivo | Máximo | ALM | Limite Legal |
| Renda Fixa | | | | | | | | |
| Artigo 7º I, Alínea a | Títulos do Tesouro Nacional | 703.698.389,32 | 46,66 | 0,00 | 57,40 | 100,00 | 0,00 | 100,00 |
| Artigo 7º I, Alínea b | Fundos 100% Títulos Públicos | 585.372.424,28 | 38,82 | 0,00 | 20,33 | 100,00 | 0,00 | 100,00 |
| Artigo 7º III, Alínea a | Fundos Renda Fixa | 124.442.780,09 | 8,25 | 0,00 | 22,27 | 60,00 | 0,00 | 60,00 |
| | Total Renda Fixa | 1.413.513.593,69 | 93,73 | | | | | 100,00 |
| Renda Variável | | | | | | | | |
| Artigo 8º I | Fundos de Ações | 15.988.411,97 | 1,06 | 0,00 | 0,00 | 30,00 | 0,00 | 30,00 |
| | Total Renda Variável | 15.988.411,97 | 1,06 | | | | | 30,00 |
| Investimentos no Exterior | | | | | | | | |
| Artigo 9º III | Fundos de Ações - BDR Nível I | 21.354.673,03 | 1,42 | 0,00 | 0,00 | 10,00 | 0,00 | 10,00 |
| | Total Investimentos no Exterior | 21.354.673,03 | 1,42 | | | | | 10,00 |
| Investimentos Estruturados | | | | | | | | |
| Artigo 10º I | Fundos Multimercados | 57.217.884,92 | 3,79 | 0,00 | 0,00 | 10,00 | 0,00 | 10,00 |
| | Total Investimentos Estruturados | 57.217.884,92 | 3,79 | | | | | 15,00 |
| Total | | 1.508.074.563,61 | 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 | 1,48 126,05 | 3,67 112,84 | 3,67 112,84 | 6,28 95,81 | 11,47 86,41 | 10.267.667,80 | 25.089.540,76 |
| Artigo 7º I, Alínea b % do CDI | 1,28 108,94 | 3,53 108,50 | 3,53 108,50 | 6,41 97,78 | 11,07 83,35 | 9.099.217,16 | 25.589.862,06 |
| Artigo 7º III, Alínea a % do CDI | 1,16 99,08 | 3,20 98,60 | 3,20 98,60 | 6,54 99,83 | 13,24 99,67 | 1.431.627,51 | 3.669.289,78 |
| Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p. | -4,72 -1,82 | -11,63 -4,48 | -11,63 -4,48 | -20,68 -13,27 | -33,04 -17,95 | -792.694,12 | -2.105.039,32 |
| Artigo 9º III % do CDI | 3,19 271,66 | 8,45 260,06 | 8,45 260,06 | 12,27 187,23 | -3,59 -27,00 | 660.373,21 | 1.664.473,87 |
| Artigo 10º I % do CDI | 4,06 346,04 | 8,84 271,99 | 8,84 271,99 | 19,56 298,45 | 1,14 8,56 | 2.234.996,08 | 4.647.853,05 |
| CONSOLIDADO (Total) | | | | | | 22.901.187,64 | 58.555.980,20 |

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%) | 30.562.882,21 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 31.009.726,81 | 446.844,60 | 1.082.089,62 |
| NTN-B 150535 (5,784900%) | 31.022.828,70 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 31.480.482,02 | 457.653,32 | 1.109.333,19 |
| NTN-B 150535 (5,886400%) | 7.275.619,07 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 7.383.594,82 | 107.975,75 | 261.890,12 |
| NTN-B 150535 (5,909200%) | 82.991.448,20 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 84.224.758,44 | 1.233.310,24 | 2.991.831,32 |
| NTN-B 150535 (5,927000%) | 12.430.511,78 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 12.615.432,28 | 184.920,50 | 448.631,78 |
| NTN-B 150535 (6,216000%) | 2.630.323,01 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2.670.119,09 | 39.796,08 | 96.711,41 |
| NTN-B 150545 (5,900200%) | 125.084.519,58 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 126.942.397,83 | 1.857.878,25 | 4.506.678,42 |
| NTN-B 150832 (5,763300%) | 41.232.567,86 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 41.840.054,98 | 607.487,12 | 1.492.029,80 |
| NTN-B 150860 (5,599600%) | 86.215.708,46 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 87.473.547,34 | 1.257.838,88 | 3.084.368,74 |
| NTN-B 150860 (5,788000%) | 71.245.704,62 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 72.296.920,34 | 1.051.215,72 | 2.581.700,43 |
| NTN-B 150860 (5,926400%) | 17.042.087,13 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 17.295.597,27 | 253.510,14 | 623.309,57 |
| NTN-B 150860 (5,949840%) | 69.569.578,48 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 70.605.955,02 | 1.036.376,54 | 2.548.537,49 |

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|--------------------------|----------------|------------|----------|-------------|----------------|-----------------------------|-----------------------------|
| NTN-B 150860 (5,959200%) | 81.734.411,22 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 82.952.605,90 | 1.218.194,68 | 2.995.995,86 |
| NTN-B 150860 (5,986700%) | 28.492.680,73 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 28.918.041,61 | 425.360,88 | 1.046.332,60 |
| NTN-B 150860 (6,225100%) | 5.899.850,47 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5.989.155,57 | 89.305,10 | 220.100,41 |
| | | | | | 703.698.389,32 | 0,00 | 0,00 |

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|--|----------------|----------------|-----------------|-------------|----------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI | 12.304.282,61 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 12.460.991,96 | 156.709,35 | 494.573,78 |
| FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF | 202.617.640,23 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 205.198.969,53 | 2.581.329,30 | 8.151.173,79 |
| FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF | 28.915.027,91 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 29.717.703,25 | 802.675,34 | 1.267.528,84 |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 337.139.880,96 | 252.790.672,01 | -257.494.296,60 | 0,00 | 337.994.759,54 | 5.558.503,17 | 15.676.585,65 |
| | | | | | 585.372.424,28 | 0,00 | 0,00 |

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

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|---|----------------|------------|----------|-------------|----------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BB PREV RF FLUXO FIC | 354.560,85 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 358.380,65 | 3.819,80 | 4.827,16 |
| BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM | 110.572.979,06 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 111.862.341,44 | 1.289.362,38 | 3.474.671,51 |
| BGT PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI | 12.083.612,67 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 12.222.058,00 | 138.445,33 | 189.791,11 |
| | | | | | 124.442.780,09 | 0,00 | 0,00 |

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|----------------------------|----------------|------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BB AÇÕES CONSUMO FIC | 10.644.190,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 9.963.776,08 | -680.413,92 | -1.490.903,55 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | 6.136.916,09 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 6.024.635,89 | -112.280,20 | -614.135,77 |
| | | | | | 15.988.411,97 | 0,00 | 0,00 |

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

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2023

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 | 20.694.299,82 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 21.354.673,03 | 660.373,21 | 1.664.473,87 |
| | | | | | 21.354.673,03 | 0,00 | 0,00 |

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|--|----------------|------------|----------|-------------|---------------|--------------------------------|--------------------------------|
| BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO | 30.015.002,58 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 31.257.150,74 | 1.242.148,16 | 2.543.051,59 |
| CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 24.967.886,26 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 25.960.734,18 | 992.847,92 | 2.104.801,46 |
| | | | | | 57.217.884,92 | 0,00 | 0,00 |

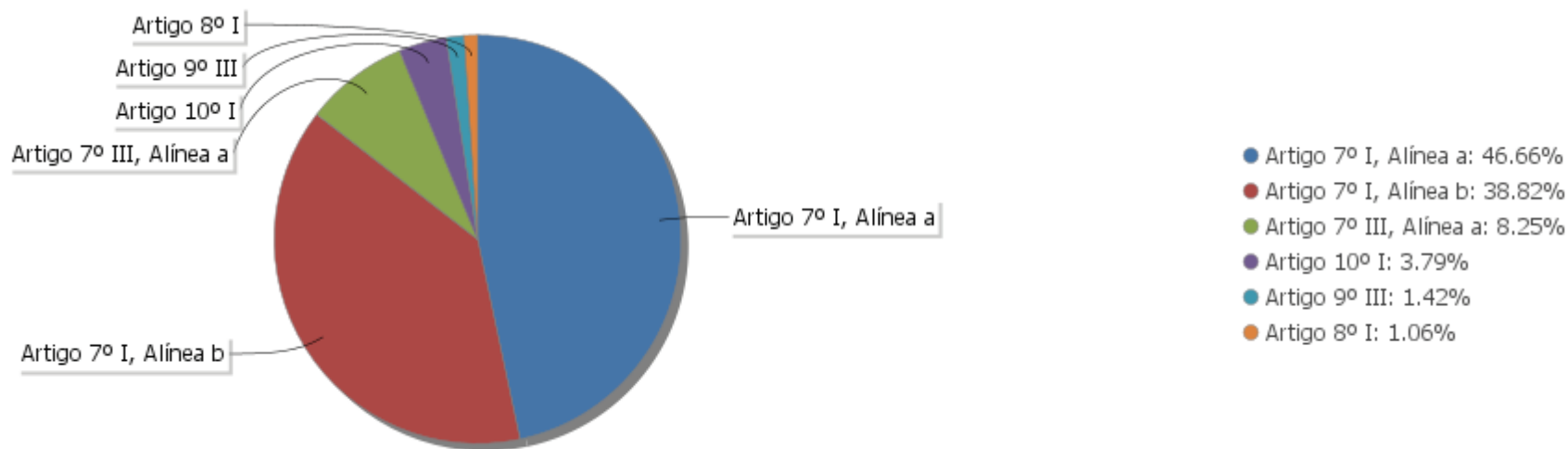
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

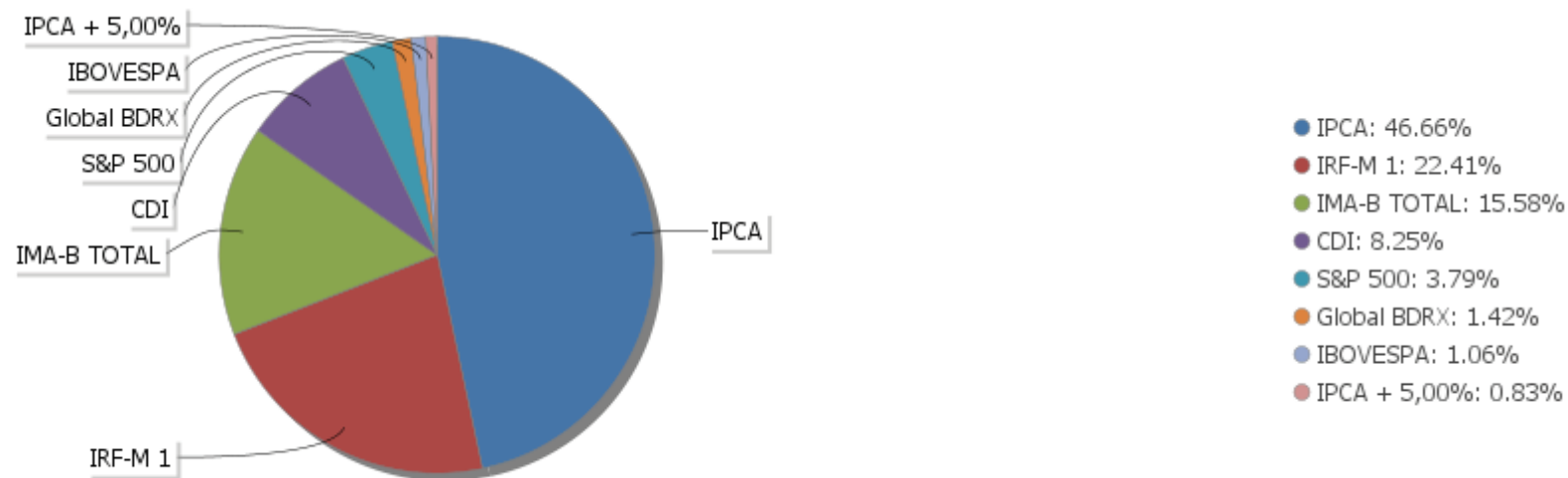
| Período | Valor (R\$) | (%) | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. | (%) Limite Mínimo |
|-----------------------|----------------|-------|-----------------------|-----------|-------------------|
| de 0 a 30 dias | 556.998.509,55 | 36,93 | 556.998.509,55 | 36,93 | |
| de 31 dias a 365 dias | 0,00 | 0,00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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

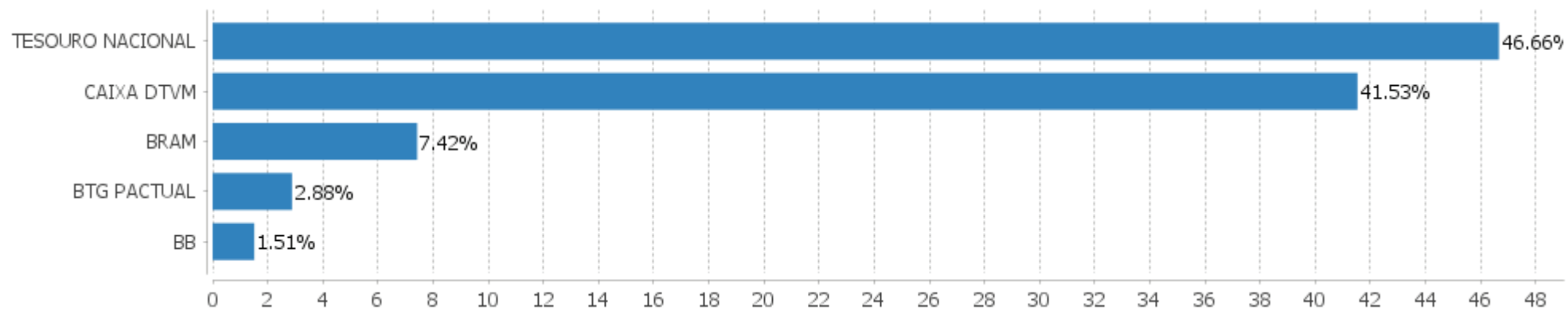


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2023

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 | 0,80 | 1,41 | | | | | | | | | | 3,65 |
| IPCA + 4,00% | 0,87 | 1,12 | 1,07 | | | | | | | | | | 3,10 |
| p.p. indexador | 0,53 | -0,33 | 0,34 | | | | | | | | | | 0,55 |
| 2022 | -0,32 | 0,33 | 1,64 | 0,23 | 1,01 | -0,01 | 1,05 | 0,37 | 0,09 | 1,36 | 0,80 | 0,63 | 7,39 |
| IPCA + 4,00% | 0,87 | 1,31 | 1,97 | 1,36 | 0,81 | 1,00 | -0,35 | -0,00 | 0,04 | 0,90 | 0,72 | 0,97 | 10,00 |
| p.p. indexador | -1,18 | -0,98 | -0,33 | -1,13 | 0,20 | -1,01 | 1,40 | 0,37 | 0,05 | 0,45 | 0,08 | -0,34 | -2,61 |
| 2021 | -0,23 | -0,56 | 0,26 | 0,90 | 0,46 | 0,19 | -0,17 | -0,33 | -0,08 | -0,80 | 1,22 | 1,45 | 2,32 |
| IPCA + 2,00% | 0,41 | 1,00 | 1,11 | 0,47 | 1,00 | 0,70 | 1,13 | 1,04 | 1,33 | 1,41 | 1,11 | 0,91 | 12,25 |
| p.p. indexador | -0,64 | -1,56 | -0,86 | 0,44 | -0,53 | -0,50 | -1,30 | -1,38 | -1,41 | -2,21 | 0,11 | 0,54 | -9,93 |
| 2020 | 0,52 | 0,46 | -0,47 | 0,59 | 1,11 | 0,70 | 0,84 | -0,16 | -0,27 | -0,10 | 1,14 | 1,59 | 6,09 |
| IPCA + 3,75% | 0,53 | 0,51 | 0,39 | -0,02 | -0,09 | 0,57 | 0,70 | 0,55 | 0,95 | 1,17 | 1,19 | 1,68 | 8,42 |
| p.p. indexador | -0,01 | -0,06 | -0,87 | 0,61 | 1,20 | 0,13 | 0,14 | -0,71 | -1,22 | -1,27 | -0,04 | -0,09 | -2,33 |

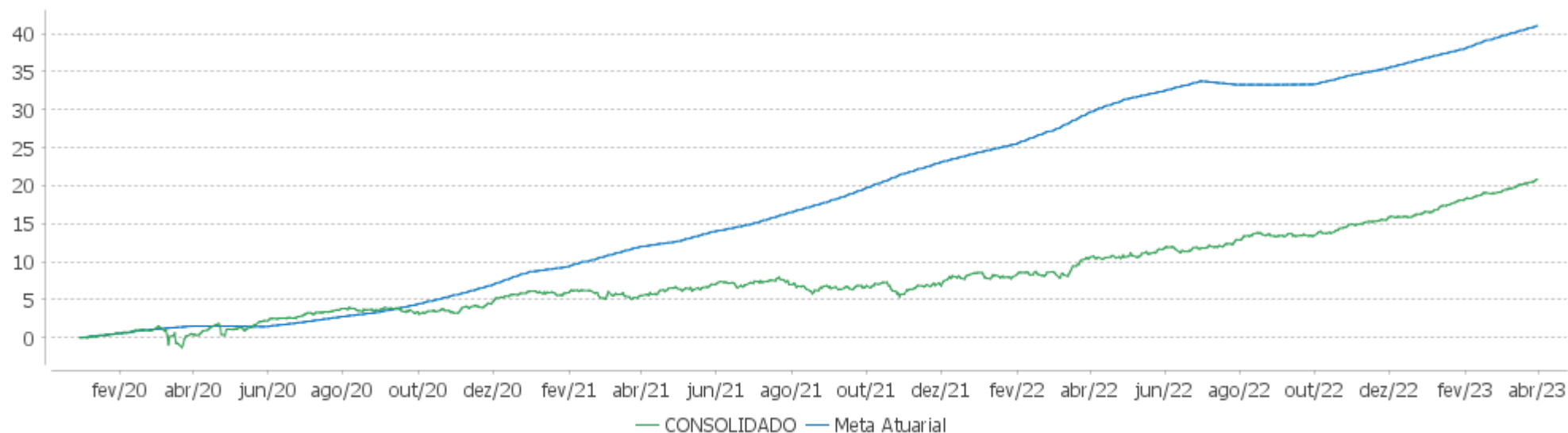
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

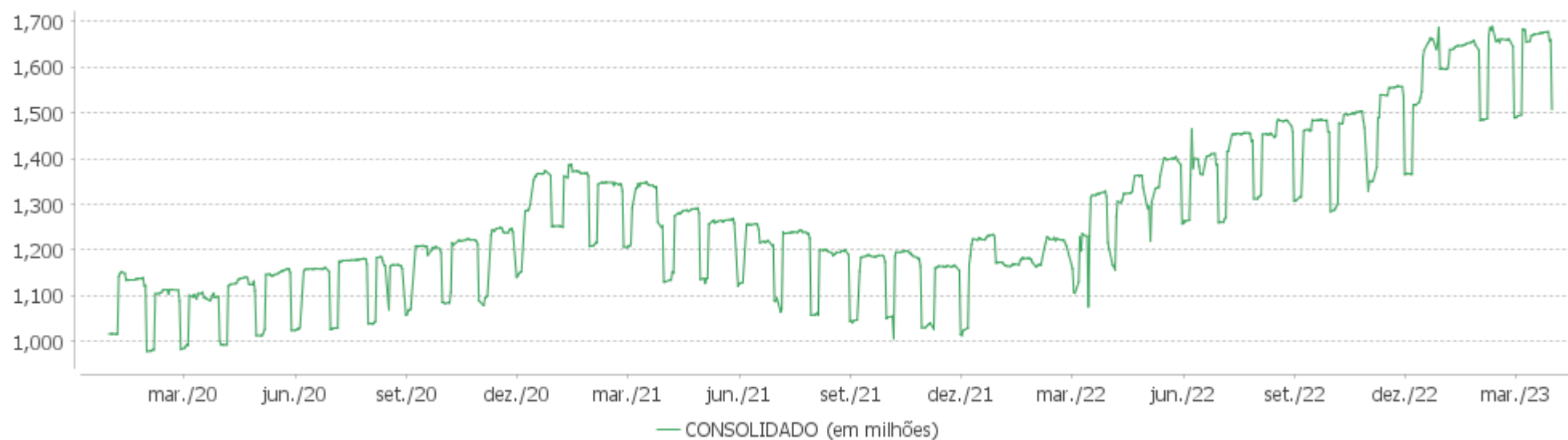
| | Quantidade | Perc. (%) | Período | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima - Meta Atuarial | 15 | 38,46 | 03 meses | 3,65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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

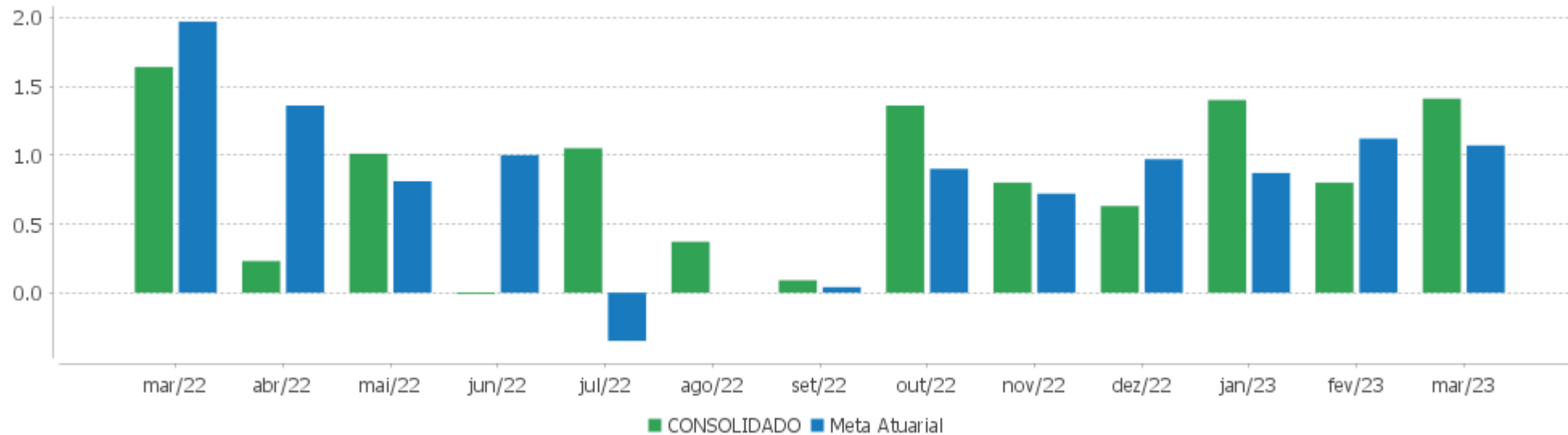


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

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

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo Variação da Estratégia | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|--|----------------|-----------------|-----------------|------------------|------------------|------------------|------------------|
| Var. IMA-B TOTAL p.p. | 0,11 | 0,42 | 0,42 | 0,32 | 0,15 | 0,61 | -0,34 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p. | 1,27 0,11 | 4,06 0,71 | 4,06 0,71 | 6,87 0,58 | 9,39 -0,50 | | |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p. | 1,21 -0,02 | 3,33 -0,02 | 3,33 -0,02 | 6,53 -0,08 | 12,96 -0,23 | 18,52 -0,49 | 21,21 -0,77 |
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI | 1,17 99,27 | 3,21 98,62 | 3,21 98,62 | 6,65 101,47 | 13,70 103,20 | 21,72 105,72 | 24,21 104,24 |
| BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI | 1,08 91,71 | 2,99 92,03 | 2,99 92,03 | 6,03 91,98 | 12,15 91,46 | 18,06 87,91 | 19,38 83,42 |
| BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI % do CDI | 1,15 97,54 | 3,20 98,44 | 3,20 98,44 | 6,46 98,55 | 13,07 98,39 | 20,33 98,97 | 22,04 94,88 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p. | -1,83 1,08 | -9,25 -2,09 | -9,25 -2,09 | -16,26 -8,85 | -28,20 -13,10 | -35,73 -23,08 | 3,29 -36,23 |
| BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. IBOVESPA p.p. | -6,39 -3,49 | -13,02 -5,86 | -13,02 -5,86 | -25,48 -18,07 | -39,28 -24,18 | -51,27 -38,62 | -27,58 -67,10 |
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p. | 3,19 0,20 | 8,45 -0,27 | 8,45 -0,27 | 12,27 -0,74 | -3,59 -0,55 | -10,72 -2,69 | 46,58 -5,49 |
| CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p. | 3,98 3,00 | 8,82 4,61 | 8,82 4,61 | 19,38 11,69 | -1,19 1,54 | 19,14 26,91 | 80,09 24,71 |
| BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p. | 4,14 3,17 | 8,86 4,65 | 8,86 4,65 | 19,71 12,02 | 3,14 5,87 | 25,17 32,94 | |
| CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,00% p.p. | 1,41 0,34 | 3,65 0,55 | 3,65 0,55 | 6,56 0,77 | 9,49 0,66 | 14,50 -11,48 | 20,23 -18,74 |
| CDI | 1,17 | 3,25 | 3,25 | 6,55 | 13,28 | 20,54 | 23,23 |
| IBOVESPA | -2,91 | -7,16 | -7,16 | -7,41 | -15,10 | -12,65 | 39,53 |
| INPC + 6,00% | 1,18 | 3,38 | 3,38 | 6,49 | 10,62 | 31,02 | 48,44 |
| IPCA + 6,00% | 1,25 | 3,59 | 3,59 | 6,80 | 10,93 | 30,87 | 47,12 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

| Fundo | Aplicação | | Resgate | | Taxas | |
|---|-----------|------------|-----------|------------|-------------|---------------|
| | Cotização | Liquidação | Cotização | Liquidação | Performance | Administração |
| BB AÇÕES CONSUMO FIC | D+1 du | D+0 | D+1 du | D+3 du | | 1,00 |
| BB PREV RF FLUXO FIC | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 1,00 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI | | | D+0 | D+0 | | |
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO | D+0 | D+0 | D+0 | D+2 du | | 0,20 |
| BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | D+0 | D+0 | D+0 | D+1 du | | 1,20 |
| FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | D+1 du | D+0 | D+1 du | D+3 du | | 0,70 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | D+1 du | D+0 | D+1 du | D+3 du | | 1,50 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IRF-M 1 | 1,23 | 3,35 | 3,35 | 6,61 | 13,19 | 19,00 | 21,98 | 30,11 | 38,81 |
| IRF-M 1+ | 2,67 | 4,23 | 4,23 | 5,37 | 11,08 | 11,70 | 13,73 | 28,47 | 41,59 |
| IRF-M TOTAL | 2,15 | 3,89 | 3,89 | 5,70 | 11,55 | 13,99 | 16,56 | 29,49 | 41,33 |
| IMA-B 5 | 1,52 | 4,38 | 4,38 | 7,03 | 10,38 | 20,01 | 30,21 | 42,37 | 55,45 |
| IMA-B 5+ | 3,73 | 3,61 | 3,61 | 1,83 | 5,03 | 5,39 | 18,05 | 27,77 | 49,85 |
| IMA-B TOTAL | 2,66 | 3,98 | 3,98 | 4,22 | 7,51 | 12,36 | 24,02 | 35,36 | 53,92 |
| IMA-GERAL TOTAL | 1,86 | 3,63 | 3,63 | 5,42 | 10,83 | 16,27 | 22,06 | 32,40 | 45,00 |
| IDKA 2 | 1,58 | 4,71 | 4,71 | 7,06 | 10,21 | 20,24 | 30,55 | 42,44 | 55,53 |
| IDKA 20 | 6,29 | 2,22 | 2,22 | -3,57 | -0,11 | -7,62 | 6,42 | 12,74 | 41,71 |
| CDI | 1,17 | 3,25 | 3,25 | 6,55 | 13,28 | 20,54 | 23,23 | 29,94 | 38,18 |

Renda Variável

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

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| S&P 500 | 0,97 | 4,21 | 4,21 | 7,69 | -2,74 | -7,77 | 55,37 | 89,02 | 137,84 |

Investimentos Imobiliários

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

Investimentos no Exterior

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

Indicadores Econômicos

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

Meta Atuarial

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

| APR | Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|------|------------|---|----------------|---------------|---------------------|--------------|
| 2234 | 01/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 650.614,08 | 0,00 | 212.357,69714714 | 3,0637650000 |
| 2252 | 01/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 4.213.414,90 | 1.375.240,88825351 | 3,0637650000 |
| 2251 | 01/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 3.593.276,83 | 0,00 | 1.172.830,43249074 | 3,0637650000 |
| 2235 | 02/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 28.691,10 | 0,00 | 9.360,98170000 | 3,0649670000 |
| 2253 | 02/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 705.752,95 | 0,00 | 230.264,45309199 | 3,0649670000 |
| 2254 | 03/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 74.289,73 | 24.228,51989916 | 3,0662100000 |
| 2279 | 03/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 398.956,25 | 0,00 | 130.113,80499053 | 3,0662100000 |
| 2280 | 03/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 398.956,25 | 130.113,80499053 | 3,0662100000 |
| 2236 | 06/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 125.503,38 | 0,00 | 40.895,40605400 | 3,0688870000 |
| 2256 | 06/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 528,30 | 172,14707200 | 3,0688870000 |
| 2255 | 06/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 832.313,04 | 0,00 | 271.210,06410467 | 3,0688870000 |
| 2237 | 07/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 36.200.487,04 | 0,00 | 11.786.510,43564200 | 3,0713490000 |
| 2238 | 07/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 1.546.779,10 | 503.615,54547800 | 3,0713490000 |
| 2239 | 07/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 1.546.779,10 | 503.615,54518800 | 3,0713490000 |
| 2257 | 07/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 144.567.513,26 | 0,00 | 47.069.712,12323965 | 3,0713490000 |
| 2258 | 07/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 28.807.600,89 | 9.379.461,88791961 | 3,0713490000 |
| 2282 | 07/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 10.478.661,08 | 3.411.745,48293300 | 3,0713490000 |
| 2281 | 07/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 49.221.176,61 | 0,00 | 16.025.914,54439075 | 3,0713490000 |
| 2241 | 08/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 6.314.343,43 | 2.053.947,31647600 | 3,0742480000 |
| 2240 | 08/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 2.434.142,96 | 0,00 | 791.784,83973967 | 3,0742480000 |
| 2259 | 08/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 192.810,70 | 0,00 | 62.718,00453300 | 3,0742480000 |
| 2261 | 09/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 29.874,16 | 9.710,05825800 | 3,0766200000 |
| 2260 | 09/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 20.644,81 | 0,00 | 6.710,22420700 | 3,0766200000 |
| 2242 | 10/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 4.364.728,15 | 1.418.775,07308600 | 3,0764060000 |
| 2263 | 10/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 13.848.090,67 | 4.501.385,92395000 | 3,0764060000 |
| 2262 | 10/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 17.686,94 | 0,00 | 5.749,22165670 | 3,0764060000 |
| 2274 | 10/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 2.091,03 | 0,00 | 679,69897300 | 3,0764060000 |
| 2283 | 10/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 7.741.904,35 | 2.516.541,81860262 | 3,0764060000 |

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| APR | Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|--------------|------------|---|-----------------------|-----------------------|---------------------|--------------|
| 2243 | 13/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 13.459,72 | 4.370,38892600 | 3,0797530000 |
| 2244 | 14/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 288.783,62 | 0,00 | 93.741,89328400 | 3,0806250000 |
| 2264 | 14/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 9.514.385,02 | 0,00 | 3.088.459,32886900 | 3,0806250000 |
| 2246 | 15/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 1.329,52 | 431,21111500 | 3,0832200000 |
| 2245 | 15/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 1.525,90 | 0,00 | 494,90467700 | 3,0832200000 |
| 2265 | 15/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 10.705,92 | 0,00 | 3.472,31790100 | 3,0832200000 |
| 2275 | 21/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 17.424,66 | 0,00 | 5.641,68315400 | 3,0885570000 |
| 2288 | 22/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 54.483,45 | 0,00 | 17.632,44124914 | 3,0899550000 |
| 2276 | 23/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 1.384,49 | 0,00 | 448,13304000 | 3,0894620000 |
| 2266 | 24/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 4.506,93 | 0,00 | 1.457,54868000 | 3,0921300000 |
| 2284 | 24/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 19.754,07 | 6.388,49880200 | 3,0921300000 |
| 2267 | 27/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 1.051,05 | 0,00 | 339,70741900 | 3,0939860000 |
| 2285 | 27/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 5.643,27 | 0,00 | 1.823,94813600 | 3,0939860000 |
| 2268 | 28/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 5.355,60 | 0,00 | 1.730,76289100 | 3,0943580000 |
| 2286 | 28/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 5.643,27 | 1.823,72883500 | 3,0943580000 |
| 2247 | 29/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 5.258,86 | 1.699,11666000 | 3,0950540000 |
| 2270 | 29/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 21.198.131,37 | 6.849.034,41662800 | 3,0950540000 |
| 2269 | 29/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 4.474,81 | 0,00 | 1.445,79383700 | 3,0950540000 |
| 2248 | 30/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 16.417,16 | 0,00 | 5.300,30519100 | 3,0973990000 |
| 2277 | 30/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 5.800,16 | 0,00 | 1.872,59051800 | 3,0973990000 |
| 2271 | 30/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 140.041,92 | 0,00 | 45.212,74785715 | 3,0973990000 |
| 2250 | 31/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 29.010.679,59 | 9.362.925,93757400 | 3,0984630000 |
| 2249 | 31/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 840.578,58 | 0,00 | 271.288,88742500 | 3,0984630000 |
| 2278 | 31/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 10.929,04 | 0,00 | 3.527,24560500 | 3,0984630000 |
| 2273 | 31/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 97.768.869,12 | 31.553.989,54901188 | 3,0984630000 |
| 2272 | 31/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 2.875.519,45 | 0,00 | 928.047,05107000 | 3,0984630000 |
| 2287 | 31/03/2023 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 30.105.220,97 | 9.716.178,94743297 | 3,0984630000 |
| Total | | | 252.790.672,01 | 257.494.296,60 | | |

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

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

Value-At-Risk: 0,49%

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

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,31%

Artigo 7º I, Alínea a

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

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 | | 0,25 | 0,02 | 0,03 | | | 337.994.759,54 | 22,41 |

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2023

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 | | 1,34 | 0,09 | 1,99 | | | 205.198.969,53 | 13,61 |
| FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF | | 3,31 | 0,03 | 0,76 | | | 29.717.703,25 | 1,97 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI | | 1,34 | 0,01 | 1,33 | | | 12.460.991,96 | 0,83 |
| Sub-total | 1,01 | 0,74 | 0,15 | | 0,10 | 1,28 | 585.372.424,28 | 38,82 |

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 | | | 12.222.058,00 | 0,81 |
| BB PREV RF FLUXO FIC | | 0,01 | -0,00 | 0,01 | | | 358.380,65 | 0,02 |
| BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM | | 0,03 | -0,00 | 0,03 | | | 111.862.341,44 | 7,42 |
| Sub-total | 0,05 | 0,03 | -0,00 | | -0,20 | 1,16 | 124.442.780,09 | 8,25 |

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 7,79%

Artigo 10º I

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

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 10,09%

Artigo 9º III

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

Renda Variável

Value-At-Risk: 13,76%

Artigo 8º I

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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