



LDB
CONSULTORIA

RELATÓRIO MACROECONÔMICO

MAIO/2023

Handwritten signature and initials

Prezados(as) Senhores(as),

Este documento tem por objetivo apresentar as principais informações macroeconômicas para o mês de maio de 2023, na intenção de ajudá-los na tomada de decisão e acompanhamento da carteira de investimentos.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o último dia útil do mês de referência, sendo disponibilizado em 12.05.2023.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.



**“A verdadeira riqueza não consiste em ter grandes posses, mas em ter poucas necessidades”
-Epicuro-**

1. COMENTÁRIO DO MÊS:

MERCADOS INTERNACIONAIS

O mês de abril foi relativamente calmo no cenário global, depois do mês de março dominado pelos receios de uma crise bancária sistêmica. Ainda há uma leitura cautelosa, especialmente pela perspectiva mais desfavorável para as economias desenvolvidas, onde a inflação elevada e os juros restritivos sugerem crescimento fraco e alto grau de incerteza.

O estresse financeiro nos EUA persistiu, com o First Republic Bank se tornando insolvente. Apesar de uma resolução relativamente rápida deste caso, permanecem as preocupações sobre a intensidade de aperto das condições de crédito à frente.

Nos EUA e na Zona do Euro, a inflação continua pressionada e a esperada queda deverá ocorrer de forma gradual, com convergência para as metas ocorrendo provavelmente só a partir do final de 2024. Em paralelo, o mercado de trabalho apertado e desacelerando apenas modestamente segue como um risco para a inflação. Isso sugere que o desafio dos bancos centrais permanece, o que deve exigir juros restritivos por um período relativamente longo.

A economia Chinesa ainda continua demonstrando sinais de recuperação robusta e deve encerrar o ano com crescimento forte do PIB, oferecendo suporte para a economia internacional como um todo. Adicionalmente, os dados econômicos mostram certa acomodação do setor de manufaturas, o que sugere menor pressão nos preços das commodities. Diante disso, as previsões de crescimento global vêm mostrando certa recuperação nos últimos meses.

Olhando para o mercado acionário americano, os principais índices apresentaram retornos positivos. Assim, no mês de abril de 2023, o MSCI ACWI e S&P 500, respectivamente, renderam +1,27% e +1,46%, todos em “moeda original”, ou seja, considerando apenas a performance dos índices estrangeiros. Observando no acumulado nos últimos 12 meses, esses índices apresentam retornos positivos de +0,20% e +0,91%, respectivamente.

Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, caíram -0,32% e -0,13%, devido à desvalorização do Dólar frente ao Real. Entretanto, acumulam retornos positivos de +1,87% e +2,58% nos últimos 12 meses.

BRASIL

Localmente, a melhora na percepção sobre os riscos fiscais domésticos contribuiu para uma redução das taxas de juros em vértices mais longos da curva, com a valorização do Real amplificando esse sentimento. Apesar disso, o Banco Central enfrenta um ambiente inflacionário bastante desafiador.

A inflação continua seguindo um estágio de desaceleração mais lento, com medidas de núcleo pressionadas. É preciso que os núcleos apresentem uma tendência mais firme de queda para que o Banco Central tenha conforto em iniciar um ciclo de afrouxamento monetário.

Adicionalmente, a meta de inflação poderá ser revista pelo Conselho Monetário Nacional. Essa definição e os próximos passos no campo fiscal terão efeito importante sobre as expectativas de inflação, que atualmente estão pressionadas e acima das metas, o que tem levado o Copom a manter um tom cauteloso, sinalizando a manutenção da taxa Selic no atual patamar por um prazo relativamente longo.

A proposta oficial para o arcabouço fiscal seguiu, em linhas gerais, as indicações anteriores dadas pelo governo. Após a apresentação do projeto, temos o trâmite no Congresso, com chance relevante de eventuais mudanças. Adicionalmente, espera-se que sejam aprovadas medidas buscando aumento nas receitas, fator essencial para o sucesso do novo arcabouço.

Aqui, somente a título de exemplo da “Estrutura a Termo das Taxas de Juros - ETTJ” para o IPCA, estimada e divulgada pela ANBIMA para o fechamento de 05.05.2023, e apresentada no item 3 deste relatório como “Taxa de Juros Real”, a taxa de juros real com vencimento para 9 anos apresentava taxa de retorno estimada em 5,77% a.a., continuando acima da taxa máxima pré-fixada de 4,90% limitada pela SPREV para o ano de 2023.

O Ibovespa fechou o mês com performance positiva, seguindo o movimento dos índices internacionais e sendo favorecido pela queda dos juros locais. Apresentando um retorno positivo de 2,50% no mês. Sendo assim, o Ibovespa possui um comportamento negativo anual de -4,83% e de -3,19% nos últimos 12 meses.

Mediante a todo esse cenário exposto acima e em linha com o último relatório disponibilizado, tentando elucidar muitos questionamentos recebidos acerca dos prêmios trazidos pelas NTN-Bs atualmente, a estratégia de compra direta de NTN-Bs, respaldada por um estudo de ALM, pode auxiliar na “ancoragem de rentabilidade” ainda acima da meta atuarial dos RPPS. Tal estratégia, em especial para carregamento até o vencimento, pode contribuir proporcionalmente para a redução da volatilidade global da carteira de investimentos do RPPS, devido ao benefício da “marcação na curva” do preço desse ativo.

Handwritten notes and signatures:
A
PO
to g
e sb r
bar
3

2. EXPECTATIVAS DE MERCADO

2.1. BOLETIM FOCUS

Mediana - Agregado	2023							2024						
	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***
IPCA (variação %)	5,98	6,05	6,02	▼ (1)	147	6,01	113	4,14	4,18	4,16	▼ (1)	141	4,20	109
PIB Total (variação % sobre ano anterior)	0,91	1,00	1,00	= (1)	107	1,02	63	1,44	1,41	1,40	▼ (1)	97	1,37	57
Câmbio (R\$/US\$)	5,25	5,20	5,20	= (2)	120	5,20	78	5,27	5,25	5,25	= (2)	115	5,25	77
Selic (% a.a.)	12,75	12,50	12,50	= (3)	132	12,50	95	10,00	10,00	10,00	= (12)	127	10,00	93
IGP-M (variação %)	3,70	2,18	2,14	▼ (4)	82	1,96	55	4,25	4,18	4,14	▼ (1)	68	4,26	48
IPCA Administrados (variação %)	9,79	10,73	10,70	▼ (1)	103	10,80	78	4,50	4,50	4,50	= (4)	89	4,50	69
Conta corrente (US\$ bilhões)	-50,84	-48,00	-47,70	▲ (4)	33	-45,00	15	-52,50	-52,75	-52,25	▲ (1)	32	-51,11	14
Balança comercial (US\$ bilhões)	55,00	60,00	60,00	= (1)	32	60,00	14	52,44	54,60	55,00	▲ (2)	29	57,50	12
Investimento direto no país (US\$ bilhões)	80,00	80,00	80,00	= (19)	30	80,00	12	80,00	80,00	80,00	= (14)	29	80,00	11
Dívida líquida do setor público (% do PIB)	61,15	60,55	60,70	▲ (1)	29	61,00	10	64,50	64,00	64,10	▲ (1)	26	63,30	8
Resultado primário (% do PIB)	-1,01	-1,00	-1,00	= (3)	39	-1,00	16	-0,80	-0,80	-0,80	= (7)	35	-0,73	14
Resultado nominal (% do PIB)	-7,80	-7,80	-7,80	= (1)	27	-7,80	10	-7,10	-7,00	-7,00	= (2)	24	-7,00	9

Relatório Focus de 05.05.2023. Fonte: <https://www.bcb.gov.br/publicacoes/focus>

2.2. DINÂMICA DAS EXPECTATIVAS DE MERCADO

Como destaques para o final de 2023, o último Boletim Focus apresentou expectativas reduzidas para a inflação, mas estáveis para o PIB, taxa Selic e Câmbio.

Inflação (IPCA): Para o final de 2023 tivemos a redução da expectativa para 6,02%. Para 2024, em relação ao último relatório, foi reduzida para 4,16%.

SELIC: Em relação ao último relatório e para o final de 2023, a expectativa foi mantida em 12,50%. Para 2024 a previsão foi mantida em 10%.

PIB: Para o final de 2023 tivemos estabilidade da expectativa em 1,00%. Para 2024, em relação ao último relatório, a expectativa foi reduzida para 1,40%.

Câmbio (Dólar/ Real): Para 2023 e 2024, em relação ao último relatório, as expectativas foram mantidas, respectivamente, em R\$ 5,20 e R\$ 5,25.

Handwritten signatures and initials in blue ink, including a large 'A' at the top right, 'PO' in the middle, and 'J' and 'P.' below it, along with other scribbles.

3. CURVA DE JUROS E INFLAÇÃO

Taxa de Juros Real: A curva de juros real calculada pela ANBIMA, projetada em 05.05.2023, estima uma taxa real de juros de 5,77% a.a. para 9 anos.

Curva de Juros Real		
Ano	Taxa*	
	Abr/23	Mai/23
1	6.76%	7.34%
2	5.76%	5.77%
3	5.64%	5.40%
4	5.72%	5.42%
5	5.83%	5.51%
6	5.98%	5.67%
7	5.98%	5.67%
8	6.03%	5.72%
9	6.07%	5.77%



* FONTE: ANBIMA; Referência abr/23 divulgada em 03.04.2023 e referência mai/23 divulgada em 05.05.2023.

Taxa de Inflação Implícita: A curva de inflação implícita calculada pela ANBIMA, projetada em 05.05.2023, estima uma taxa de inflação máxima de 6,10% a.a. para 9 anos.

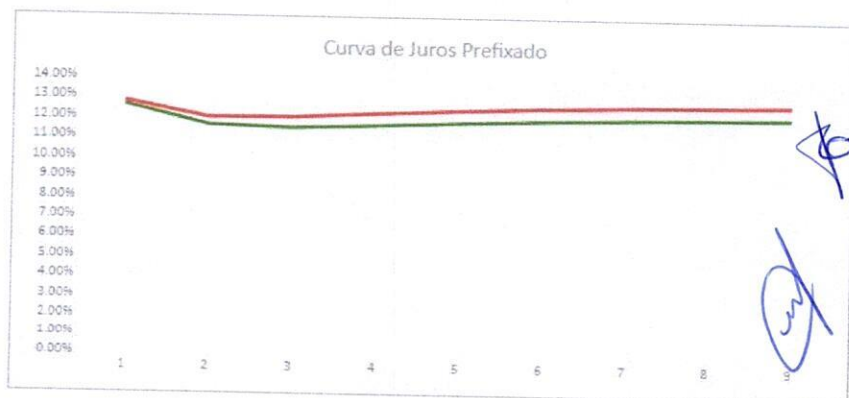
Curva de Inflação Implícita		
Ano	Taxa*	
	Abr/23	Mai/23
1	5.63%	4.88%
2	5.87%	5.50%
3	6.03%	5.77%
4	6.16%	5.90%
5	6.24%	5.97%
6	6.30%	6.02%
7	6.34%	6.05%
8	6.37%	6.08%
9	6.39%	6.10%



* FONTE: ANBIMA; Referência abr/23 divulgada em 03.04.2023 e referência mai/23 divulgada em 05.05.2023.

Taxa de Juros Prefixados: A curva de juros prefixada calculada pela ANBIMA, projetada em 05.05.2023, estima uma taxa prefixada de juros de 12,21% a.a. para 9 anos.

Curva de Juros Pré		
Ano	Taxa*	
	Abr/23	Mai/23
1	12.76%	12.58%
2	11.97%	11.59%
3	12.01%	11.48%
4	12.23%	11.63%
5	12.43%	11.81%
6	12.58%	11.95%
7	12.69%	12.06%
8	12.78%	12.15%
9	12.85%	12.21%

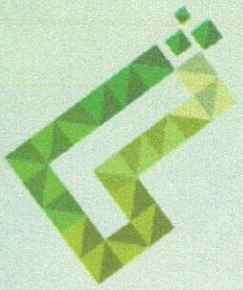


* FONTE: ANBIMA; Referência abr/23 divulgada em 03.04.2023 e referência mai/23 divulgada em 05.05.2023.

Handwritten signatures and initials:
A
70
J
S
P
5

4. INDICADORES

Indicadores	Índices Financeiros													
	2022								2023				No ano (2023)	Acumulado 12 meses
	maio	junho	julho	agosto	setembro	outubro	novembro	dezembro	janeiro	fevereiro	março	abril		
Renda Fixa														
IMA-S	1.11%	1.07%	1.04%	1.19%	1.11%	1.08%	1.01%	1.11%	1.15%	0.96%	1.15%	0.86%	4.18%	13.61%
CDI	1.03%	1.01%	1.03%	1.17%	1.07%	1.02%	1.02%	1.12%	1.12%	0.92%	1.17%	0.92%	4.20%	13.37%
IRF-M 1	0.95%	0.93%	1.05%	1.23%	1.11%	1.00%	0.94%	1.18%	1.10%	0.98%	1.23%	0.86%	4.23%	13.31%
IRF-M 1+	0.39%	0.09%	1.20%	2.60%	1.58%	0.92%	-1.42%	1.62%	0.72%	0.79%	2.67%	1.25%	5.54%	13.07%
IRF-M	0.58%	0.37%	1.15%	2.05%	1.40%	0.93%	-0.66%	1.48%	0.84%	0.86%	2.15%	1.10%	5.03%	12.91%
IMA-GERAL	0.92%	0.43%	0.47%	1.40%	1.26%	1.01%	-0.06%	0.77%	0.70%	1.03%	1.86%	1.25%	4.92%	11.60%
IMA-B5	0.78%	0.33%	0.01%	0.00%	0.42%	1.91%	-0.33%	0.94%	1.40%	1.41%	1.52%	0.90%	5.33%	9.67%
IDkA IPCA 2A	0.85%	0.47%	-0.17%	-0.36%	0.62%	1.78%	-0.77%	1.24%	1.44%	1.62%	1.58%	0.71%	5.45%	9.35%
IMA-B	0.96%	-0.36%	-0.88%	1.10%	1.48%	1.23%	-0.79%	-0.19%	0.00%	1.28%	2.66%	2.02%	6.08%	8.78%
IMA-B5+	1.16%	-1.10%	-1.84%	2.49%	2.39%	0.65%	-1.18%	-1.19%	-1.26%	1.17%	3.73%	3.03%	6.75%	8.12%
IDkA IPCA 20A	1.21%	-2.95%	-3.59%	5.45%	5.00%	-0.33%	-2.10%	-3.32%	-4.58%	0.79%	6.29%	5.47%	7.81%	6.65%
Renda Variável														
IDIV	4.26%	-8.38%	1.98%	4.27%	-1.80%	4.03%	0.78%	-1.61%	5.89%	-7.55%	-2.02%	3.89%	-0.36%	2.52%
IFIX	0.26%	-0.88%	0.66%	5.76%	0.49%	0.02%	-4.15%	0.00%	-1.60%	-0.45%	-1.69%	3.52%	-0.31%	1.61%
Ibovespa	3.22%	-11.50%	4.69%	6.16%	0.47%	5.45%	-3.06%	-2.45%	3.37%	-7.49%	-2.91%	2.50%	-4.83%	-3.19%
IBRX - 50	3.30%	-11.67%	4.54%	6.33%	0.48%	5.32%	-2.19%	-2.55%	3.38%	-7.54%	-3.50%	1.64%	-6.25%	-4.09%
IBrX - 100	3.23%	-11.56%	4.40%	6.15%	-0.05%	5.57%	-3.11%	-2.63%	3.51%	-7.59%	-3.07%	1.93%	-5.48%	-4.80%
IVBX-2	0.88%	-12.83%	5.79%	4.04%	-2.48%	8.89%	-7.47%	-3.14%	3.27%	-8.11%	-3.52%	1.49%	-7.07%	-14.41%
ISE	2.01%	-12.35%	4.40%	5.97%	-2.54%	7.65%	-10.48%	-4.37%	2.25%	-8.16%	-1.21%	3.23%	-4.23%	-14.91%
SMLL	-1.82%	-16.33%	5.16%	10.90%	-1.84%	7.30%	-11.23%	-3.01%	2.92%	-10.52%	-1.74%	1.91%	-7.78%	-19.88%
Investimentos no Exterior														
Global BDRX	-4.32%	0.79%	7.65%	-3.05%	-8.38%	1.33%	7.09%	-4.22%	4.37%	1.15%	2.99%	-0.49%	8.20%	3.71%
S&P 500	-3.86%	1.47%	8.08%	-4.42%	-5.36%	5.00%	6.12%	-7.26%	3.77%	-0.54%	0.97%	-0.13%	4.08%	2.58%
MSCI ACWI	-3.99%	1.26%	5.85%	-4.03%	-5.78%	3.03%	8.36%	-5.43%	4.67%	-0.92%	0.30%	-0.32%	3.70%	1.87%
S&P 500 (M. Orig.)	0.01%	-8.39%	9.11%	-4.24%	-9.34%	7.99%	5.38%	-5.90%	6.18%	-2.61%	3.51%	1.46%	8.59%	0.91%
MSCI ACWI (M.Orig.)	-0.13%	-8.58%	6.86%	-3.86%	-9.74%	5.96%	7.60%	-4.05%	7.10%	-2.98%	2.82%	1.27%	8.20%	0.20%
Índices Econômicos														
SELIC	1.03%	1.01%	1.03%	1.17%	1.07%	1.02%	1.02%	1.12%	1.12%	0.92%	1.17%	0.92%	4.20%	13.37%
IPCA	0.47%	0.67%	-0.68%	-0.36%	-0.29%	0.59%	0.41%	0.62%	0.53%	0.84%	0.71%	0.61%	2.72%	4.18%
INPC	0.45%	0.62%	-0.60%	-0.31%	-0.32%	0.47%	0.38%	0.69%	0.46%	0.77%	0.64%	0.53%	2.42%	3.83%
DÓLAR	-3.87%	10.77%	-0.95%	-0.18%	4.39%	-2.77%	0.71%	-1.44%	-2.27%	2.13%	-2.45%	-1.57%	-4.16%	1.66%
IGPM	0.52%	0.59%	0.21%	-0.70%	-0.95%	-0.97%	-0.56%	0.45%	0.21%	-0.06%	0.05%	-0.95%	-0.75%	-2.17%
Meta Atuarial														
IPCA + 6% a.a.	0.98%	1.16%	-0.20%	0.17%	0.20%	1.06%	0.88%	1.13%	1.04%	1.26%	1.25%	1.03%	4.66%	10.41%
INPC + 6% a.a.	0.96%	1.11%	-0.12%	0.22%	0.17%	0.94%	0.85%	1.20%	0.97%	1.19%	1.18%	0.95%	4.36%	10.04%
IPCA + 5% a.a.	0.90%	1.08%	-0.28%	0.08%	0.12%	0.98%	0.80%	1.05%	0.96%	1.19%	1.16%	0.96%	4.34%	9.37%
INPC + 5% a.a.	0.88%	1.03%	-0.20%	0.13%	0.09%	0.86%	0.77%	1.12%	0.89%	1.12%	1.09%	0.88%	4.04%	9.00%
IPCA + 4% a.a.	0.81%	1.00%	-0.35%	0.00%	0.04%	0.90%	0.72%	0.97%	0.87%	1.12%	1.07%	0.89%	4.02%	8.34%
INPC + 4% a.a.	0.79%	0.95%	-0.27%	0.05%	0.01%	0.78%	0.69%	1.04%	0.80%	1.05%	1.00%	0.81%	3.72%	7.97%



LDDB
E M P R E S A S

CAMPO ALEGRE - CONSOLIDADO
ABRIL 2023



A
70
p

[Handwritten signature]

[Handwritten signature]

[Handwritten signature]

Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 28.04.2023.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,
Equipe LDB Empresas.

Handwritten signatures and initials in blue ink at the bottom of the page. There are several distinct marks, including what appears to be a large stylized 'A' or '7' on the right, and various scribbles and initials on the left and center.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

89,27%

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)			Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
		Dia	Mês	Ano	Dia	Mês	Ano				
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,020000%)	4,11	0,05	0,96	4,71	14.450,264,52	24,86				
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,830000%)	5,09	0,06	1,02	6,35	2.508,893,82	4,32				
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,77	0,05	0,97	5,18	16.959.158,34	29,18				

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	Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	0,03	0,04	0,73	3,33	3.711,057,87	6,39	123.597,131,757,08	0,00		
BB	BB	BB PREV RF IPCA	1,61	0,06	0,95	4,63	505,761,32	0,87	4.174,630,090,89	0,01		
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,03	0,05	0,88	4,09	3.114,606,73	5,36	10.108,009,094,45	0,03		
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,47	0,04	0,81	3,73	7.331.425,92	12,61				

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	Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB RENDA FIXA REFERENCIADO DI PLUS ÁGIL FIC FI	0,03	0,05	0,83	3,85	3.688,854,50	6,35	28.762,147,676,53	0,01		
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,05	0,92	3,98	10.852,221,08	18,67	15.640,448,903,65	0,07		
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,05	0,89	4,09	6.525,731,59	11,23	14.478,047,383,36	0,05		
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,03	0,05	0,83	1,48	2.013,974,81	3,47	4.036,788,225,11	0,05		
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,07	0,04	0,88	3,99	3.500,796,73	6,02	5.975,742,251,15	0,06		
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,14	0,05	0,89	4,02	26.581.578,71	45,73				

Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
PETRA	FINAXIS	FIDC PREMIUM	89,31	-0,40	-0,40	-0,94	122.126,66	0,21	81.898.860,94	0,15
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			89,31	-0,40	-0,40	-0,94	122.126,66	0,21		
Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)										
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO	2,28	-0,10	0,89	5,22	891.488,40	1,53	233.547.964,79	0,38
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			2,28	-0,10	0,89	5,22	891.488,40	1,53		
Renda Fixa			0,31	0,05	0,90	4,36	51.885.778,03	89,27		

Handwritten signatures and initials at the bottom of the page, including a large signature on the left and several initials on the right.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

10,19%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatili.d. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC DE FI	21,39	1,44	2,43	-4,96	2.616.510,68	4,50	220.357.338,69	1,19
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	21,21	1,44	2,44	-4,86	2.892.371,67	4,98	400.943.160,24	0,72
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	21,01	1,11	1,25	-6,34	411.008,83	0,71	804.593.754,06	0,05
Sub-total Artigo 8º I			19,83	1,42	2,35	-5,01	5.919.891,18	10,19		
Renda Variável			19,21	1,42	2,35	-2,06	5.919.891,18	10,19		

Handwritten signatures and initials in blue ink, including a large 'A' and several illegible signatures.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

0,54%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

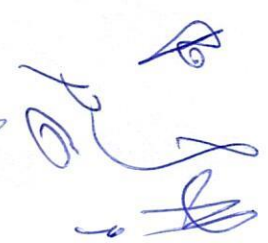
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilitd. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	19,20	1,01	1,92	3,89	315.700,00	0,54	129.487.908,68	0,24
Sub-total Artigo 11º			19,20	1,01	1,92	3,89	315.700,00	0,54		
Fundos Imobiliários			24,06	1,01	1,92	3,87	315.700,00	0,54		
Total			2,20	0,19	1,05	3,32	58.121.369,21	100,00		

Handwritten signatures and initials in blue ink, including a large '4' and several illegible signatures.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Política de Investimentos			ALM	Pró-Gestão Nivel 1 Limite Legal
					Objetivo	Máximo			
Renda Fixa									
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	16.959.158,34	29,18	0,00	30,00	100,00	0,00	100,00	
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	7.331.425,92	12,61	10,00	30,00	100,00	0,00	100,00	
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	26.581.578,71	45,73	10,00	20,00	65,00	0,00	65,00	
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	122.126,66	0,21	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00	
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	891.488,40	1,53	1,00	1,50	5,00	0,00	5,00	
	Total Renda Fixa	51.885.778,03	89,27					100,00	
Renda Variável									
Artigo 8º I	Fundos de Ações	5.919.891,18	10,19	0,00	12,00	30,00	0,00	35,00	
	Total Renda Variável	5.919.891,18	10,19					35,00	
Fundos Imobiliários									
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	315.700,00	0,54	0,00	1,00	1,00	0,00	5,00	
	Total Fundos Imobiliários	315.700,00	0,54					5,00	
Total		58.121.369,21	100,00						


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,97 105,49	5,18 123,48	3,94 129,46			162.676,21	801.616,26
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,81 88,22	3,73 88,91	2,68 88,15			57.655,34	268.773,21
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,89 96,65	4,02 95,83	2,87 94,52			234.391,64	1.042.270,48
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-0,40 -43,20	-0,94 -22,40	-0,60 -19,77			-486,32	-1.159,37
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,89 97,02	5,22 124,45	3,82 125,56			7.870,80	44.266,40
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	2,35 -0,15	-5,01 -0,18	-8,06 -0,13			136.048,39	-312.268,77
Artigo 11º % do CDI	1,92 209,46	3,89 92,60	2,32 76,35			5.950,00	11.900,00
CAMPO ALEGRE - CONSOLIDADO (Total)						604.106,06	1.855.398,21

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mes (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150527 (6,020000%)	14.312.807,18	0,00	0,00	0,00	14.450.264,52	137.457,34	649.494,31
NTN-B 150824 (6,830000%)	2.483.674,95	0,00	0,00	0,00	2.508.893,82	25.218,87	152.121,95
Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)					16.959.158,34	0,00	

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IPCA	500.998,04	0,00	0,00	0,00	505.761,32	4.763,28	22.370,17
BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	2.743.389,60	1.013.270,82	-71.417,68	0,00	3.711.057,87	25.815,13	128.638,19
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	3.087.529,80	0,00	0,00	0,00	3.114.606,73	27.076,93	91.530,39
					7.331.425,92	0,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	1.997.352,13	0,00	0,00	0,00	2.013.974,81	16.622,68	29.462,96
BB PREV RF REF DI LP PERFL FIC FI	6.303.429,56	165.339,66	0,00	0,00	6.525.731,59	56.962,37	247.725,53
BB RENDA FIXA REFERENCIADO DI PLUS ÁGIL FIC FI	4.657.425,32	0,00	-1.000.000,00	0,00	3.688.854,50	31.429,18	166.761,89
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	3.467.353,42	2.800,00	0,00	0,00	3.500.796,73	30.643,31	132.965,11
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.756.070,07	0,00	-2.583,09	0,00	10.852.221,08	98.734,10	423.487,77
					26.581.578,71	0,00	

Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIDC PREMIUM	122.612,98	0,00	0,00	0,00	122.126,66	-486,32	-1.159,37

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO	883.617,60	0,00	0,00	0,00	891.488,40	7.870,80	44.266,40
					891.488,40	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 BOLSA BRASILEIRA FIC DE FI	2.554.477,79	0,00	0,00	0,00	2.616.510,68	62.032,89	-136.694,71
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	405.915,07	0,00	0,00	0,00	411.008,83	5.093,76	-27.833,98
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	2.823.449,93	0,00	0,00	0,00	2.892.371,67	68.921,74	-147.740,08
					5.919.891,18	0,00	

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	312.550,00	0,00	0,00	0,00	2.800,00	315.700,00	5.950,00	11.900,00


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
						315.700,00	0,00	

7



2



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	40.751.202,04	70,11	40.751.202,04	70,11	
de 31 dias a 365 dias	411.008,83	0,71	41.162.210,87	70,82	
acima de 365 dias	16.959.158,34	29,18	58.121.369,21	100,00	

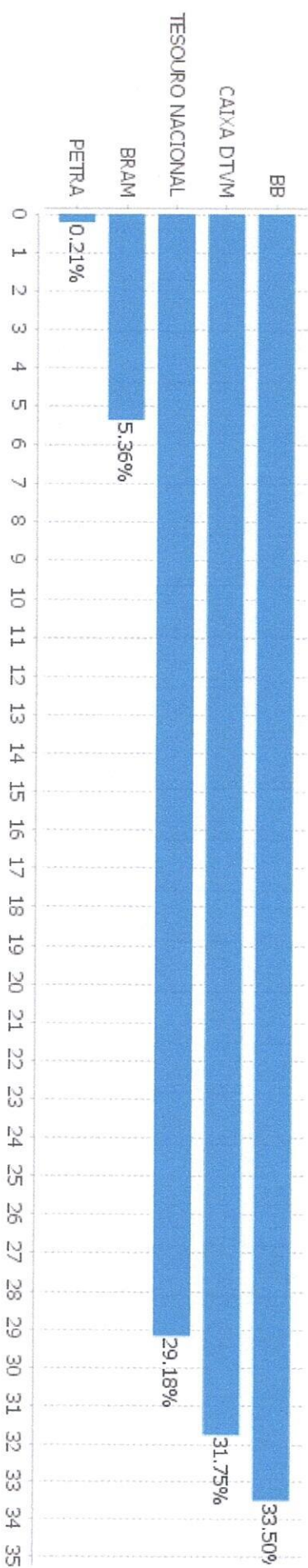
4



Handwritten notes and signatures in blue ink, including a large 'V' and several illegible signatures.

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	1,38	0,04	0,82	1,05									3,32
IPCA + 5,03%	0,96	1,19	1,16	0,96									4,35
p.p. Indexador	0,42	-1,16	-0,35	0,09									-1,03

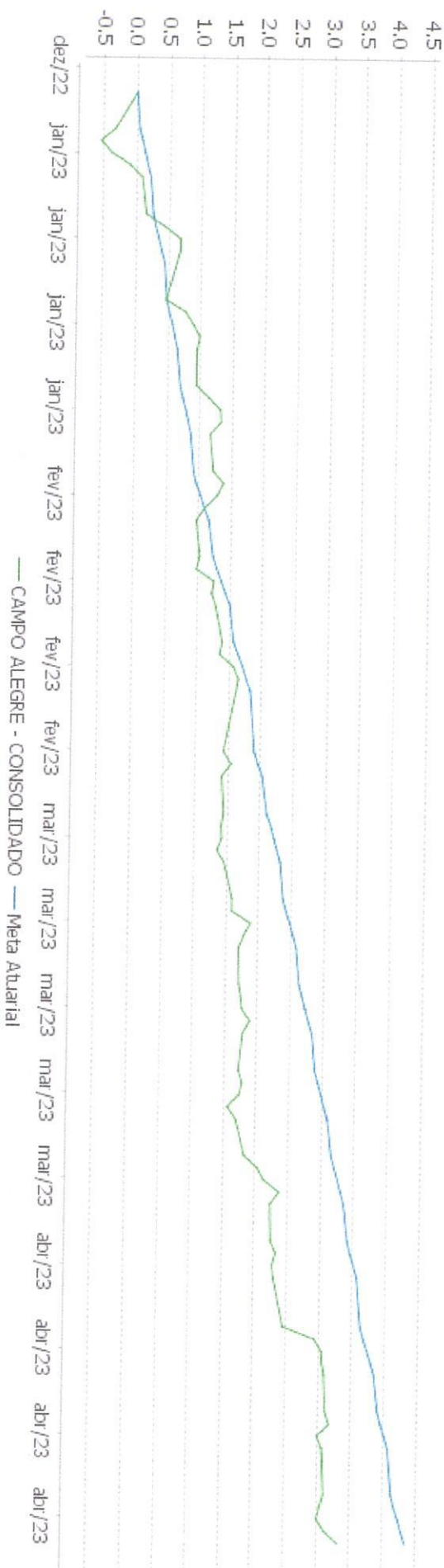
Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)	Relatório	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	2	50,00		03 meses	1,91	3,36	-1,44	1,99
Meses abaixo - Meta Atuarial	2	50,00		06 meses				
				12 meses				
				24 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	1,38	2023-01	Desde 30/12/2022		3,32	4,35	-1,03	2,20
Menor rentabilidade da Carteira	0,04	2023-02						

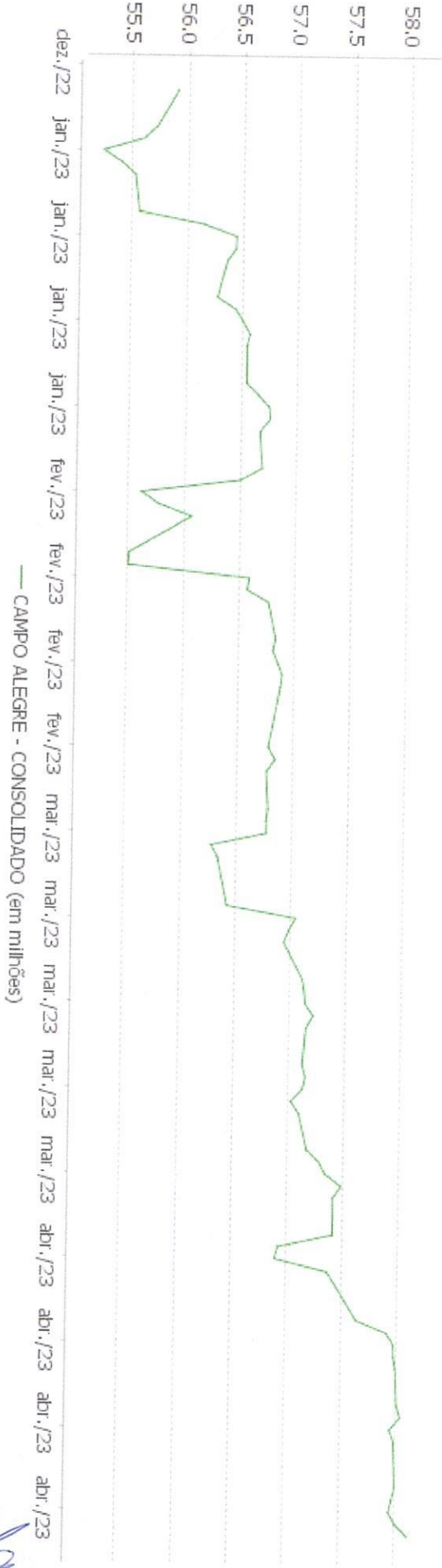


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

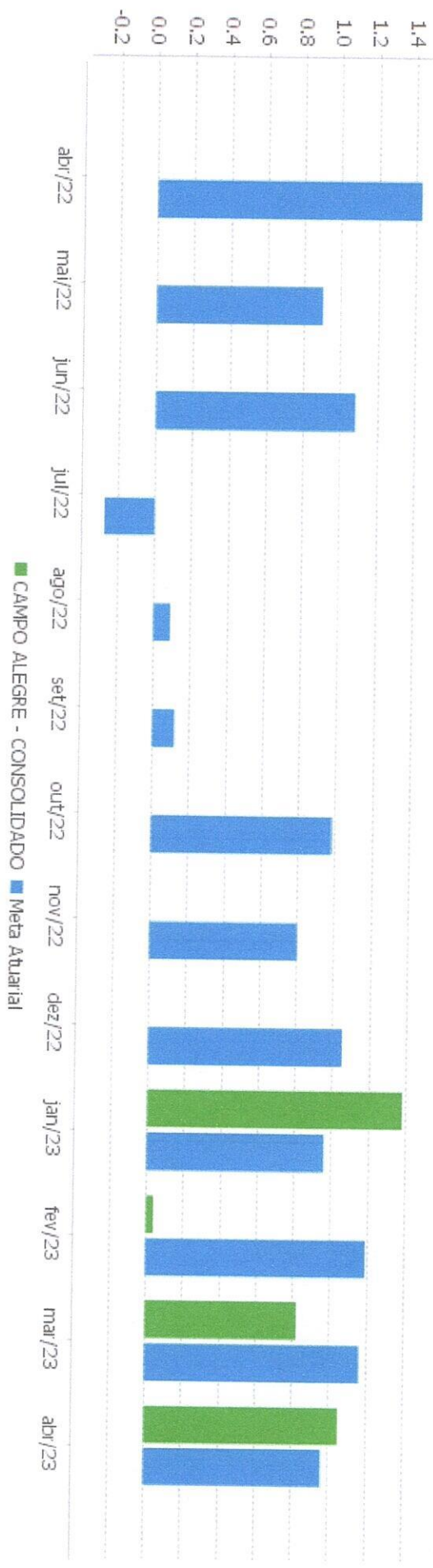


Patrimônio Líquido



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
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO		0,89	5,22	3,82	5,86	10,11	18,07	28,59
Var. IPCA + 6,00% p.p.		-0,14	0,57	0,24	-0,91	-0,30	-13,13	-19,82
NTN-B 150527 (6,020000%)		0,96	4,71	3,46	3,72	4,49		
Var. IPCA p.p.		0,35	1,99	1,29	-0,06	0,30		
NTN-B 150824 (6,830000%)		1,02	4,96	3,65	7,18	8,35		
Var. IPCA p.p.		0,41	2,25	1,47	3,41	4,17		
BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI		0,73	3,33	2,41	5,10	10,44		
% do CDI		79,65	79,23	79,37	79,07	78,08		
BB PREV RF IPCA		0,95	4,63	3,08	6,40	9,72	20,80	31,82
Var. IPCA + 6,00% p.p.		-0,08	-0,03	-0,50	-0,37	-0,69	-10,41	-16,58
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA		0,88	4,09	2,96	6,29	13,10	20,96	23,04
% do CDI		95,52	97,44	97,30	97,57	97,97	97,96	96,00
FIDC PREMIUM		-0,40	-0,94	-0,60	10,70	-55,39	-57,89	-59,74
% do CDI		-43,20	-22,40	-19,77	165,99	-414,17	-270,55	-248,87
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,89	4,09	2,93	6,33	13,37	21,75	24,49
% do CDI		96,61	97,37	96,39	98,26	99,98	101,66	102,03
BB PREV RF FLUXO FIC		0,83	3,85	2,79	5,90	12,26	18,91	20,13
% do CDI		90,64	91,67	91,60	91,60	91,69	88,39	83,86
BB RENDA FIXA REFERENCIADO DI PLUS ÁGIL FIC FI		0,83	3,85	2,79	5,91	12,33	19,23	20,57
% do CDI		90,86	91,74	91,70	91,75	92,18	89,87	85,69
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI		0,88	3,99	2,86	6,23	13,32	21,89	24,84
% do CDI		96,22	95,13	94,14	96,75	99,61	102,32	103,46
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,92	4,02	2,90	6,31	13,37	21,85	24,56
% do CDI		100,00	95,78	95,21	97,91	100,01	102,12	102,32
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA		2,44	-4,86	-7,89	-9,84	-2,96	-12,08	29,15
Var. IBOVESPA p.p.		-0,06	-0,03	0,04	0,16	0,23	0,08	-0,57
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC DE FI		2,43	-4,96	-8,04	-10,11	-3,78	-13,54	26,04
Var. IBOVESPA p.p.		-0,07	-0,13	-0,11	-0,11	-0,59	-1,37	-3,68
BB AÇÕES VALOR FIC FIA		1,25	-6,34	-9,37	-11,40	-9,28	-13,61	28,61
Var. IBOVESPA p.p.		-1,25	-1,51	-1,43	-1,40	-6,09	-1,45	-1,11
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII		1,92	3,89	2,32	-3,96	7,79	-20,99	-35,41
Var. IPCA p.p.		1,31	1,17	0,15	-7,74	3,60	-37,82	-60,13
CAMPO ALEGRE - CONSOLIDADO		1,05	3,32	1,91				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Variação da Estratégia							
Var. IPCA + 5,03% p.p.	0,09	-1,03	-1,44				
CDI	0,92	4,20	3,04	6,44	13,37	21,40	24,00
IBOVESPA	2,50	-4,83	-7,93	-10,00	-3,19	-12,16	29,72
INPC + 6,00%	0,95	4,36	3,35	6,51	10,04	31,15	49,50
IPCA + 6,00%	1,03	4,66	3,58	6,77	10,41	31,20	48,41

7









EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC DE FI	D+0	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32		2,00
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREV RF IPCA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB RENDA FIXA REFERENCIADO DI PLUS ÁGIL FIC FI			D+0	D+0		1,00
BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	Não se aplica	Não se aplica				
FI CAIXA BRASIL IPCA XVII RF CRÉDITO PRIVADO	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,50
FIDC PREMIUM	Não se aplica	Não se aplica				



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

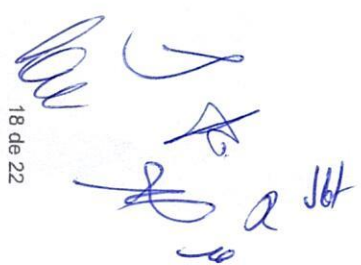
Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,86	4,23	3,10	6,45	13,31	19,69	22,48	30,57	39,29
IRF-M 1+	1,25	5,54	4,78	5,72	13,07	11,85	13,45	29,25	42,72
IRF-M TOTAL	1,10	5,03	4,16	5,88	12,91	14,29	16,50	30,13	42,22
IMA-B 5	0,90	5,33	3,87	5,96	9,67	20,04	30,74	42,08	56,20
IMA-B 5+	3,03	6,75	8,11	4,24	8,12	8,09	19,22	29,32	55,37
IMA-B TOTAL	2,02	6,08	6,08	5,03	8,78	13,88	24,89	36,05	57,25
IMA-GERAL TOTAL	1,25	4,92	4,19	5,67	11,60	17,13	22,53	32,91	46,34
IDKA 2	0,71	5,45	3,96	5,94	9,35	19,48	30,73	42,00	55,36
IDKA 20	5,47	7,81	12,99	2,04	6,65	-2,92	10,29	16,48	51,43
CDI	0,92	4,20	3,04	6,44	13,37	21,40	24,00	30,46	38,73

Renda Variável

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



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados										
Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses	
S&P 500	-0,13	4,08	0,30	2,43	2,58	-7,71	31,92	79,40	126,19	
Investimentos Imobiliários										
Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses	
IFIX	3,52	-0,31	1,31	-4,45	1,61	-0,10	9,78	13,94	22,29	
Investimentos no Exterior										
Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses	
MSCI ACWI	-0,32	3,70	-0,93	6,26	1,87	-13,63	23,38	58,18	84,61	
Indicadores Econômicos										
Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses	
IPCA	0,61	2,72	2,18	3,78	4,18	16,82	24,72	27,71	34,02	
INPC	0,53	2,42	1,95	3,52	3,83	16,78	25,64	28,73	35,27	
IGPM	-0,95	-0,75	-0,96	-0,87	-2,17	12,18	48,09	57,99	71,65	
SELIC	0,92	4,20	3,04	6,44	13,37	21,40	24,00	30,46	38,74	
Meta Atuarial										
Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses	
IPCA + 4,00%	0,89	4,02	3,12	5,78	8,34	26,32	40,21	49,34	62,93	
IPCA + 5,00%	0,96	4,34	3,35	6,28	9,37	28,75	44,27	55,14	70,88	
IPCA + 5,50%	1,00	4,50	3,46	6,53	9,89	29,97	46,33	58,11	74,98	
IPCA + 5,89%	1,02	4,62	3,55	6,72	10,30	30,93	47,95	60,46	78,22	
IPCA + 6,00%	1,03	4,66	3,58	6,77	10,41	31,20	48,41	61,12	79,14	
INPC + 4,00%	0,81	3,72	2,89	5,52	7,97	26,27	41,24	50,53	64,44	
INPC + 6,00%	0,95	4,36	3,35	6,51	10,04	31,15	49,50	62,41	80,81	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
89	03/04/2023	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIG FI	0,00	110,00	96,57521471	1,1390085990
94	04/04/2023	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIG FI	0,00	17.415,49	15.283,96199032	1,1394617450
81	04/04/2023	BB RENDA FIXA REFERENCIADO DI PLUS ÁGIL FIG FI	0,00	1.000,000,00	169,452,32360517	5,9013649310
82	04/04/2023	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIG FI	487.734,83	0,00	428,039,67060781	1,1394617450
88	05/04/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	2.583,09	567,77373192	4,5495060000
83	06/04/2023	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIG FI	456,977,31	0,00	400,720,82856514	1,1403882140
92	10/04/2023	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIG FI	20,669,14	0,00	18,117,23275900	1,1408552440
70	10/04/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIG FI	165,328,16	0,00	58,954,55239718	2,8043323760
72	10/04/2023	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIG FI	47,192,69	0,00	41,366,06309012	1,1408552440
86	10/04/2023	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIG FI	0,00	47,183,69	41,358,16550623	1,1408552440
75	11/04/2023	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIG FI	0,00	2.332,53	2,043,72149490	1,1413150010
84	11/04/2023	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIG FI	604,85	0,00	529,95886278	1,1413150010
76	12/04/2023	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIG FI	0,00	554,90	485,99447392	1,1417825300
93	17/04/2023	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIG FI	11,50	0,00	10,05974000	1,1431706050
87	17/04/2023	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	2.800,00	0,00	1.578,73133150	1,7735760000
77	17/04/2023	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIG FI	0,00	103,50	90,53766739	1,1431706050
85	17/04/2023	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIG FI	80,50	0,00	70,41818574	1,1431706050
78	19/04/2023	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIG FI	0,00	168,99	147,70672384	1,1440914510
71	25/04/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIG FI	11,50	0,00	4,08106073	2,8178948440
79	27/04/2023	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIG FI	0,00	3.390,15	2,957,18990492	1,1464092970
80	28/04/2023	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIG FI	0,00	158,43	138,14083951	1,1468730070
Total			1.181.410,48	1.074.000,77		



20 de 22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 553.788,99

Value-At-Risk: 0,95%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VAR ⁽²⁾	CVAR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAMPO ALEGRE - CONSOLIDADO		0,95	0,95			58.121.369,21	100,00
Renda Fixa							
Value-At-Risk: 0,03%							

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VAR ⁽²⁾	CVAR ⁽³⁾	BVAR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150527 (6,020000%)		0,07	0,00	0,09			14.450.264,52	24,86
NTN-B 150824 (6,830000%)		0,08	-0,00	0,10			2.508.893,82	4,32
Sub-total	0,15	0,06	-0,00		0,33	0,97	16.959.158,34	29,18

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VAR ⁽²⁾	CVAR ⁽³⁾	BVAR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FIC FI		0,00	0,00	0,00			3.711.057,87	6,39
BB PREV RF IPCA		0,50	0,00	0,50			505.761,32	0,87
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA		0,01	-0,00	0,01			3.114.606,73	5,36
Sub-total	0,03	0,03	0,00		-4,11	0,81	7.331.425,92	12,61

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VAR ⁽²⁾	CVAR ⁽³⁾	BVAR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB RENDA FIXA REFERENCIADO DI PLUS AGIL FIC FI		0,01	-0,00	0,01			3.688.854,50	6,35
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,04	0,00	0,04			10.852.221,08	18,67
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	0,00	0,02			6.525.731,59	11,23
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	-0,00	0,01			2.013.974,81	3,47
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI		0,04	0,00	0,04			3.500.796,73	6,02
Sub-total	0,02	0,02	0,00		-1,24	0,89	26.581.578,71	45,73

Artigo 7º V, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	Var ⁽²⁾	CVar ⁽³⁾	BVar ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC PREMIUM		0,49	0,00	0,49			122.126,66	0,21
Sub-total	1,49	0,49	0,00		-0,88	-0,40	122.126,66	0,21

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	Var ⁽²⁾	CVar ⁽³⁾	BVar ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO		0,93	0,01	0,93			891.488,40	1,53
Sub-total	1,25	0,93	0,01		-0,02	0,89	891.488,40	1,53

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,14%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	Var ⁽²⁾	CVar ⁽³⁾	BVar ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES BOLSA BRASILEIRA FIC DE FI		9,24	0,41	0,07			2.616.510,68	4,50
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA		9,09	0,45	0,21			2.892.371,67	4,98
BB AÇÕES VALOR FIC FIA		8,94	0,06	1,27			411.008,83	0,71
Sub-total	20,35	9,14	0,93		0,07	2,35	5.919.891,18	10,19

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 12,30%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	Var ⁽²⁾	CVar ⁽³⁾	BVar ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII		12,30	0,02	12,30			315.700,00	0,54
Sub-total	32,79	12,30	0,02		0,03	1,92	315.700,00	0,54