

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

CONSOLIDADO

Período: 3º trimestre de 2021

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

86,94%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,38	0,38	0,89	201.076.168,18	19,15	6.805.654.314,46	2,95
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,48	0,98	1,00	21.209.998,59	2,02	11.150.255.278,19	0,19
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,29	1,03	1,30	21.500.400,83	2,05	9.425.482.510,34	0,23
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,45	1,08	1,21	21.497.209,82	2,05	11.068.272.487,58	0,19
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,91	-0,37	-1,46	2.329.328,46	0,22	1.386.775.998,41	0,17
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,49	0,98	1,08	30.322.555,30	2,89	6.090.651.961,96	0,50
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,66	0,96	0,76	192.926.789,59	18,38	1.402.948.935,17	13,75
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	6,57	-0,49	-1,93	28.647.707,25	2,73	217.127.860,87	13,19
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,68	-0,01	-0,70	54.900.735,89	5,23	8.672.013.980,14	0,63
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,43	0,35	-1,87	211.006.192,56	20,10	14.407.320.968,51	1,46
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,82	0,48	-0,01	785.417.086,47	74,82		

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF IDKA PRE 2	3,31	-0,57	-1,80	50.017.253,42	4,76	332.263.801,49	15,05
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	2,21	0,49	-1,52	77.306.932,16	7,36	1.036.012.764,97	7,46
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			5,00	0,07	-1,64	127.324.185,58	12,13		
Renda Fixa			2,01	0,43	-0,23	912.741.272,05	86,94		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

10,71%

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	21,62	-6,18	-15,08	18.743.438,07	1,79	251.032.322,68	7,47
BB	BB	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	22,82	-2,67	-8,93	13.686.782,01	1,30	163.946.719,52	8,35
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	22,04	-6,52	-15,87	8.870.783,50	0,84	1.047.084.854,27	0,85
BB	BB	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	20,48	-1,47	-4,64	16.229.582,55	1,55	358.347.201,68	4,53
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			19,74	-4,12	-11,03	57.530.586,13	5,48		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	13,89	-4,70	0,92	9.635.768,34	0,92	258.269.045,58	3,73
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13,92	-4,64	1,14	45.253.422,31	4,31	3.166.279.756,52	1,43
Sub-total Artigo 8º III			11,31	-4,65	1,10	54.889.190,65	5,23		
Renda Variável			17,54	-4,38	-5,50	112.419.776,78	10,71		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,35%

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	18,24	-0,25	7,72	24.643.058,06	2,35	3.337.438.389,61	0,74
Sub-total Artigo 9º III			18,24	-0,25	7,72	24.643.058,06	2,35		
Investimentos no Exterior			15,41	-0,25	7,72	24.643.058,06	2,35		
Total			2,46	-0,08	-0,58	1.049.804.106,89	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 b	Fundos 100% Títulos Públicos	785.417.086,47	74,82	50,00	52,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	127.324.185,58	12,13	0,00	27,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	912.741.272,05	86,94					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	57.530.586,13	5,48	0,00	5,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	54.889.190,65	5,23	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável	112.419.776,78	10,71					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	24.643.058,06	2,35	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	24.643.058,06	2,35					10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,48 109,18	-0,01 -1,22	-0,01 -1,22	1,01 50,31	2,60 87,10	4.614.948,69	373.083,51
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,07 16,78	-1,64 -133,97	-1,64 -133,97	-0,83 -41,39	-4,89 -163,58	93.538,44	-2.154.837,64
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-4,12 2,45	-11,03 1,45	-11,03 1,45	-2,20 2,65	17,53 0,22	-2.469.538,59	-7.133.751,38
Artigo 8º III % do CDI	-4,65 -1.060,96	1,10 89,78	1,10 89,78	9,91 492,13		-2.676.415,17	596.084,48
Artigo 9º III % do CDI	-0,25 -57,07	7,72 631,10	7,72 631,10	3,03 150,20		-61.785,75	1.765.614,29
CONSOLIDADO (Total)						-499.252,38	-6.553.806,74

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	54.903.652,42	0,00	0,00	0,00	54.900.735,89	-2.916,53	-388.510,57
BB PREV RF IDKA2	21.280.478,48	0,00	0,00	0,00	21.500.400,83	219.922,35	275.547,66
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	30.028.996,29	0,00	0,00	0,00	30.322.555,30	293.559,01	322.555,30
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	191.087.677,06	0,00	0,00	0,00	192.926.789,59	1.839.112,53	1.404.870,39
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.787.381,62	0,00	0,00	0,00	28.647.707,25	-139.674,37	-585.407,30
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.267.875,33	0,00	0,00	0,00	21.497.209,82	229.334,49	256.789,72
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.003.936,31	0,00	0,00	0,00	21.209.998,59	206.062,28	209.998,59
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	193.539.362,52	179.762.356,79	-173.457.404,84	0,00	201.076.168,18	1.231.853,71	2.925.996,18
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.337.958,48	0,00	0,00	0,00	2.329.328,46	-8.630,02	-34.615,00
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	210.259.867,32	0,00	0,00	0,00	211.006.192,56	746.325,24	-4.014.141,46
					785.417.086,47	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	50.302.890,42	0,00	0,00	0,00	50.017.253,42	-285.637,00	-963.419,01
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	76.927.756,72	0,00	0,00	0,00	77.306.932,16	379.175,44	-1.191.418,63
					127.324.185,58	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB AÇÕES CONSUMO FIC	19.977.049,50	0,00	0,00	0,00	18.743.438,07	-1.233.611,43	-3.327.394,99
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	16.470.933,60	0,00	0,00	0,00	16.229.582,55	-241.351,05	-790.109,69
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	14.062.158,06	0,00	0,00	0,00	13.686.782,01	-375.376,05	-1.342.357,00
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	9.489.983,56	0,00	0,00	0,00	8.870.783,50	-619.200,06	-1.673.889,70
					57.530.586,13	0,00	0,00

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	10.111.098,48	0,00	0,00	0,00	9.635.768,34	-475.330,14	87.908,23
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	47.454.507,34	0,00	0,00	0,00	45.253.422,31	-2.201.085,03	508.176,25
					54.889.190,65	0,00	0,00

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	24.704.843,81	0,00	0,00	0,00	24.643.058,06	-61.785,75	1.765.614,29
					24.643.058,06	0,00	0,00

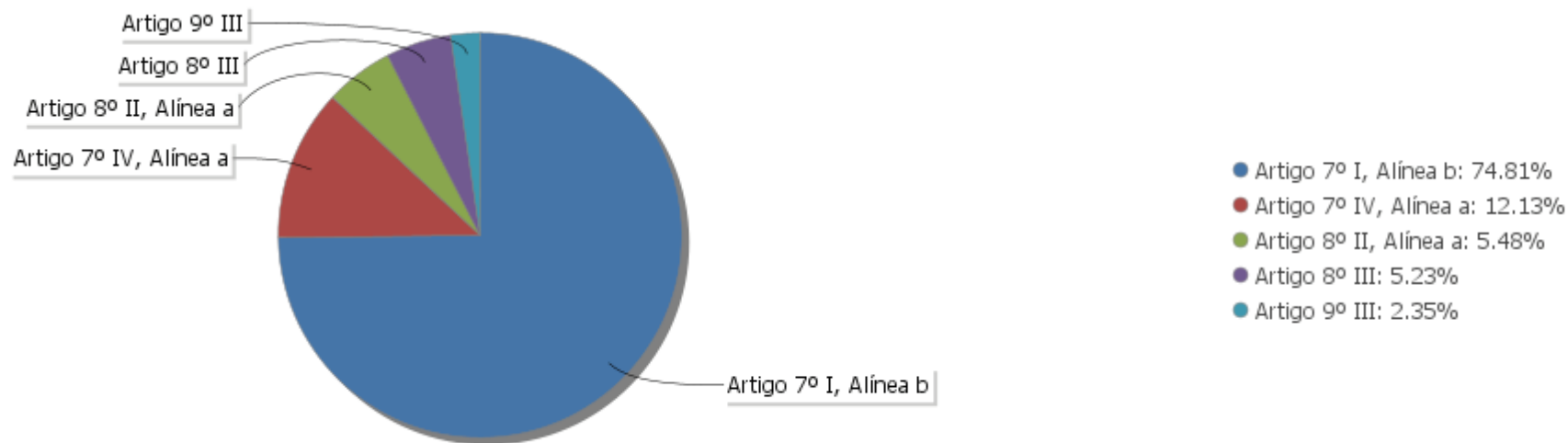
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

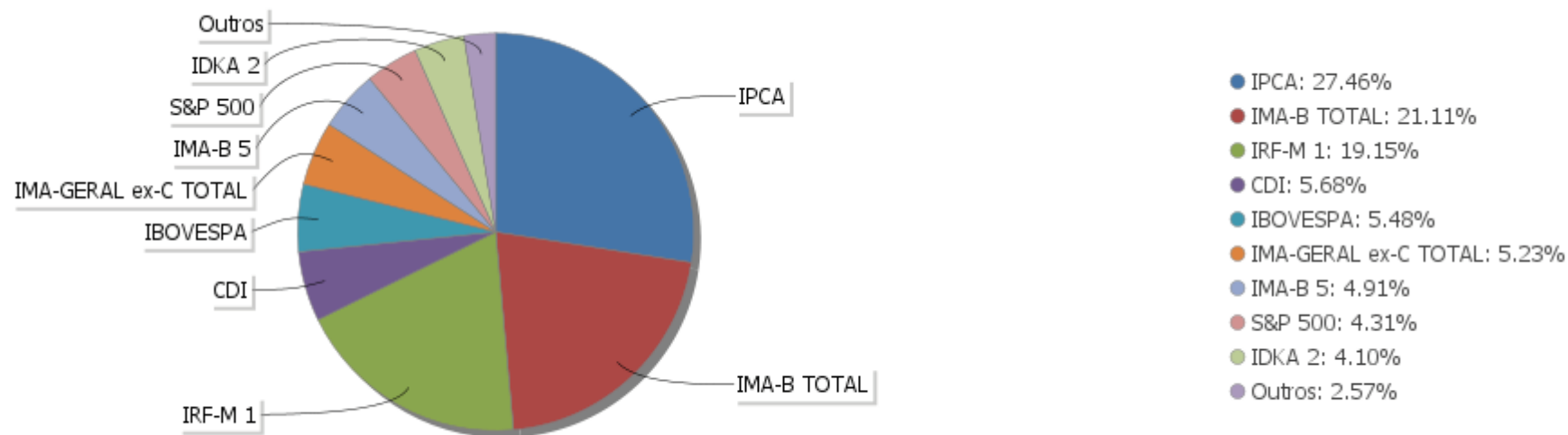
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	828.229.610,05	78,89	828.229.610,05	78,89
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	828.229.610,05	78,89
acima de 365 dias	221.574.496,84	21,11	1.049.804.106,89	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

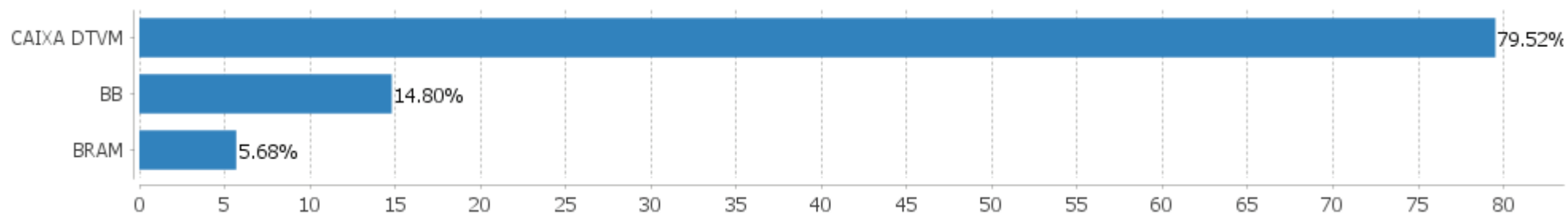


Alocação Por Estratégia



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
2021	-0,23	-0,56	-0,27	0,90	0,46	0,19	-0,17	-0,33	-0,08				-0,08
IPCA + 2,00%	0,41	1,00	1,11	0,47	1,00	0,70	1,13	1,04	1,33				8,49
p.p. indexador	-0,64	-1,56	-1,38	0,44	-0,53	-0,50	-1,30	-1,38	-1,41				-8,57
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

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	5	23,81
Meses abaixo - Meta Atuarial	16	76,19

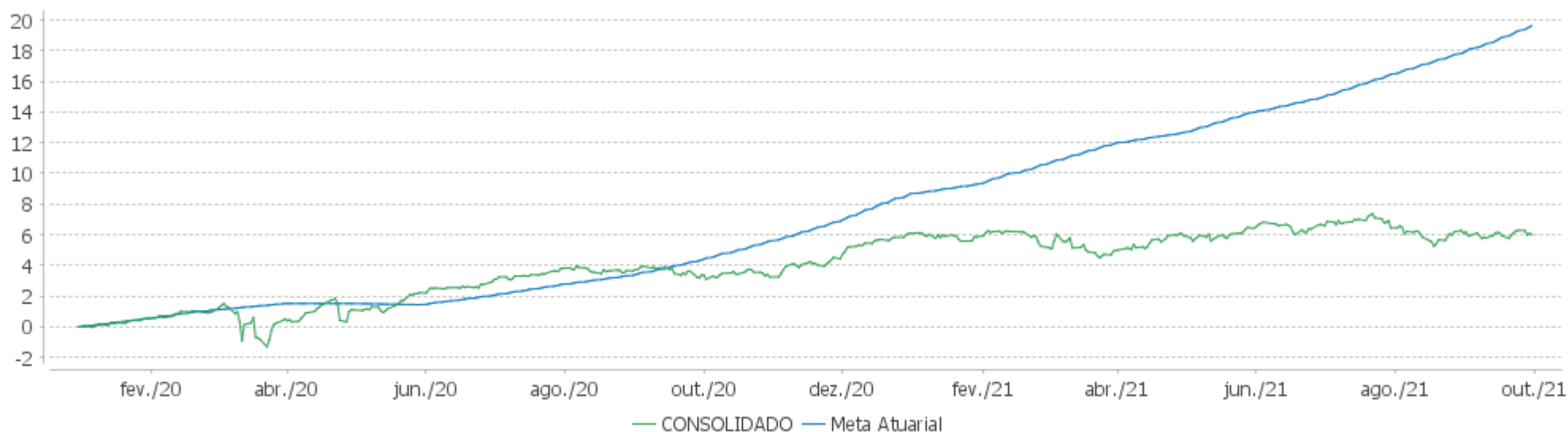
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,59	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-0,56	2021-02

Relatório

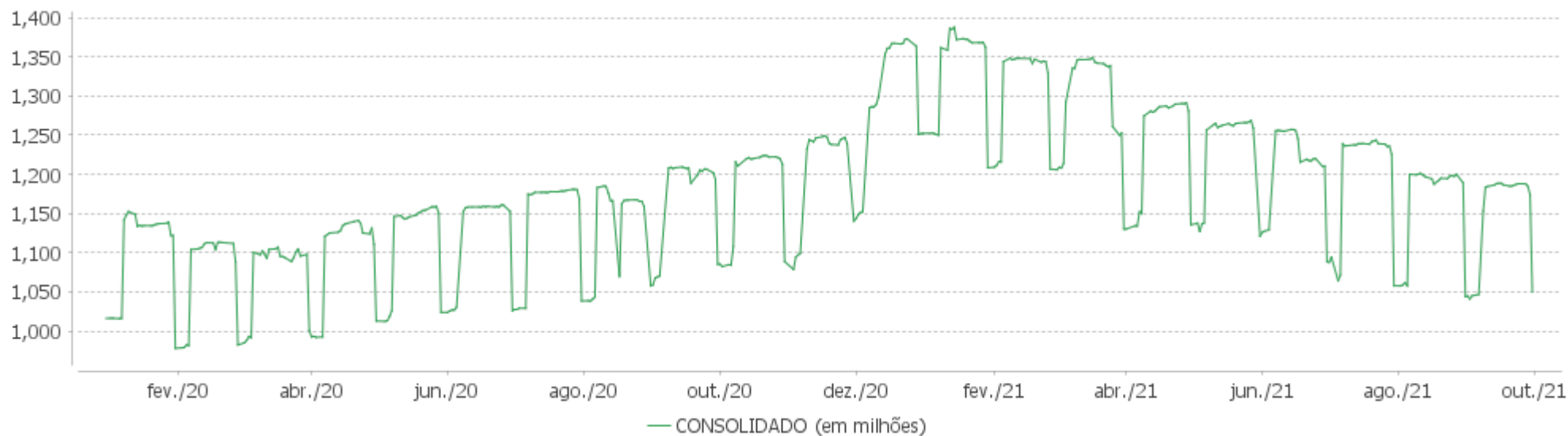
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	-0,58	3,55	-4,12	2,61
06 meses	0,98	5,80	-4,82	2,49
12 meses	2,57	12,92	-10,35	2,46
24 meses				
Desde 31/12/2019	6,01	17,63	-11,61	3,01

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

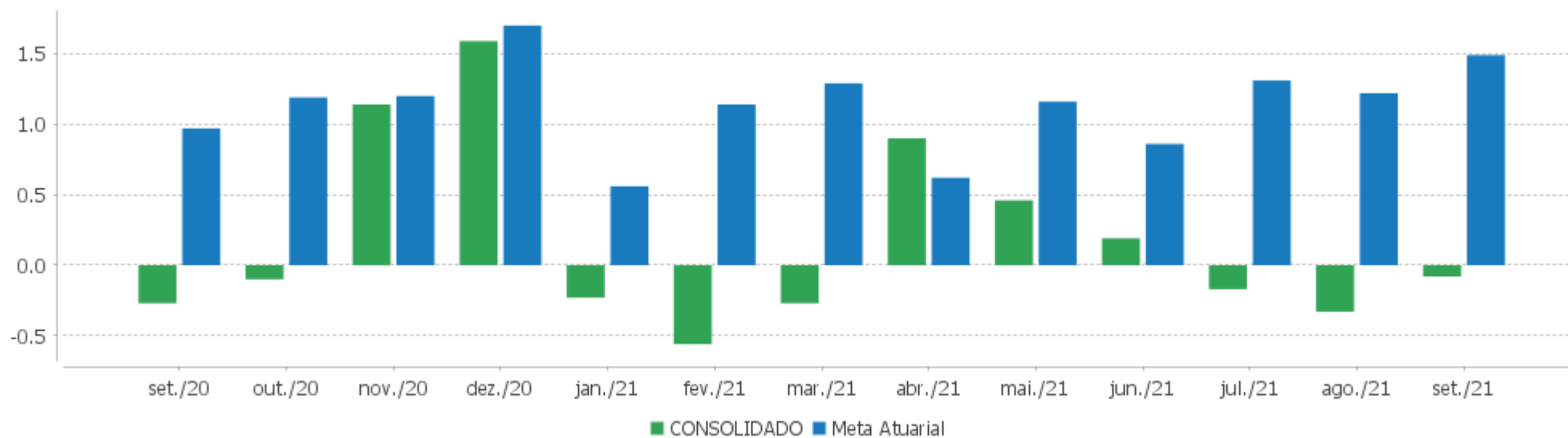


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BRDESCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	-0,57 -129,58	-1,80 -147,02	-1,80 -147,02	-1,01 -49,90	-2,31 -77,30	5,81 87,26	22,93 171,81
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,49 -0,67	-1,52 -4,54	-1,52 -4,54	-0,70 -5,45	0,74 -9,50		
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,98 -0,02	1,13 -0,05	1,13 -0,05	2,53 -0,11	5,69 -0,26	13,00 -0,62	30,19 -0,93
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,03 -0,06	1,30 0,11	1,30 0,11	2,74 -0,38	6,05 -0,17	13,77 -0,94	27,54 -1,91
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,01 -0,03	-0,70 -0,28	-0,70 -0,28	0,51 -0,38	1,75 -0,30	5,52 -0,51	23,63 0,04
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,96 1,10	0,76 2,35	0,76 2,35	2,46 1,94	4,88 0,17	12,92 6,00	39,51 -0,95
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,35 -0,81	-1,87 -4,89	-1,87 -4,89	-0,98 -5,73	0,85 -9,39	7,32 -6,38	26,96 9,96
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,49 -0,35	-1,93 -0,34	-1,93 -0,34	0,13 -0,39	2,96 -1,75	5,81 -1,11	36,59 -3,87
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,08 -0,02	1,21 0,03	1,21 0,03	2,82 -0,30	5,92 -0,29	13,71 -1,00	27,67 -1,78
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,98 -0,02	1,11 -0,08	1,11 -0,08	2,49 -0,15	5,70 -0,25	13,04 -0,58	30,18 -0,94
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,38 -0,02	0,89 -0,07	0,89 -0,07	1,54 -0,11	2,25 -0,25	6,68 -0,47	14,44 -0,68
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,37 -0,04	-1,46 -0,07	-1,46 -0,07	-0,35 -0,20	-1,25 -0,24	4,97 -0,50	22,56 -0,66
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	-6,52 0,04	-15,87 -3,40	-15,87 -3,40	-5,36 -0,51	13,95 -3,36	9,19 3,24	65,50 25,63
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	-2,67 3,90	-8,93 3,55	-8,93 3,55	0,84 5,69	29,62 12,31	29,94 23,98	68,91 29,03
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-1,47 5,10	-4,64 7,84	-4,64 7,84	5,18 10,03	42,42 25,11	52,97 47,02	61,14 21,27
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. IBOVESPA p.p.	-6,18 0,39	-15,08 -2,60	-15,08 -2,60	-8,33 -3,48	-3,45 -20,76	-4,33 -10,28	45,72 5,84
BRDESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	-4,70	0,92	0,92	9,55	30,02	42,82	49,43

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Varição da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	-1.072,77	75,29	75,29	473,80	1.003,60	643,58	370,33
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	-4,64 -5,36	1,14 -7,86	1,14 -7,86	9,99 6,48	30,71 7,20	42,05 -46,96	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	-0,25 -0,08	7,72 -0,42	7,72 -0,42	3,03 -1,68	18,25 -2,79	90,64 -3,38	101,42 -4,69
CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,00% p.p.	-0,08 -1,41	-0,58 -4,12	-0,58 -4,12	0,98 -4,82	2,57 -9,87		
CDI	0,44	1,22	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35
IBOVESPA	-6,57	-12,48	-12,48	-4,85	17,31	5,95	39,87
INPC + 6,00%	1,69	4,69	4,69	8,28	17,40	29,29	41,02
IPCA + 6,00%	1,65	4,58	4,58	7,87	16,83	27,73	39,28

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 AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	D+0	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	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 IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	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
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	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
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	D+0	D+0		D +1		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,40	0,96	0,96	1,65	2,49	7,15	15,12	22,90	38,45
IRF-M 1+	-0,73	-2,65	-2,65	-1,15	-3,14	4,23	25,92	32,64	58,13
IRF-M TOTAL	-0,33	-1,39	-1,39	-0,15	-1,02	5,48	23,23	30,30	53,03
IMA-B 5	1,00	1,18	1,18	2,64	5,95	13,62	31,12	39,68	58,47
IMA-B 5+	-1,26	-4,19	-4,19	-1,61	3,20	1,48	46,98	45,78	70,99
IMA-B TOTAL	-0,13	-1,59	-1,59	0,52	4,71	6,92	40,46	44,04	66,75
IMA-GERAL TOTAL	-0,01	-0,52	-0,52	0,96	2,48	6,93	24,87	31,60	51,09
IDKA 2	1,10	1,18	1,18	3,12	6,21	14,71	29,45	40,48	59,67
IDKA 20	-3,03	-8,65	-8,65	-5,13	2,03	-7,04	59,98	49,40	80,44
CDI	0,44	1,22	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35	20,90	34,86

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-6,57	-12,48	-12,48	-4,85	17,31	5,95	39,87	49,38	90,14
IBRX 100	-6,99	-13,61	-13,61	-5,31	17,82	7,71	45,23	53,72	95,90
IBRX 50	-7,47	-14,15	-14,15	-5,58	18,46	6,59	37,53	47,56	87,32
SMALL CAP	-6,43	-15,22	-15,22	-4,70	15,75	13,69	78,82	65,15	133,65
IFIX	-1,24	-1,42	-1,42	-4,61	-2,83	1,17	27,21	22,27	49,54
Índice Consumo - ICON	-5,95	-14,34	-14,34	-7,48	-1,67	-2,69	50,48	25,77	51,19
Índice Dividendos - IDIV	-4,48	-6,59	-6,59	-1,51	19,58	7,85	64,83	56,04	121,60

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	1,16	3,02	3,02	4,75	10,25	13,70	16,99	22,29	25,39
INPC	1,20	3,13	3,13	5,14	10,78	15,09	18,46	23,16	25,17
IGPM	-0,64	0,80	0,80	7,15	24,86	47,25	52,21	67,49	65,07
SELIC	0,44	1,22	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35	20,91	34,89

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	0,73	8,99	8,99	3,52	23,52	89,01	100,82	193,57	232,88
MSCI ACWI	1,23	7,16	7,16	0,61	21,06	78,00	83,86	150,21	184,12

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,49	4,07	4,07	6,84	14,64	22,96	31,56	42,95	52,39
IPCA + 5,00%	1,57	4,32	4,32	7,36	15,74	25,33	35,38	48,50	59,82
IPCA + 5,50%	1,61	4,45	4,45	7,61	16,29	26,53	37,32	51,33	63,64
IPCA + 5,89%	1,64	4,55	4,55	7,81	16,71	27,46	38,84	53,57	66,67
IPCA + 6,00%	1,65	4,58	4,58	7,87	16,83	27,73	39,28	54,21	67,53
INPC + 4,00%	1,53	4,18	4,18	7,24	15,20	24,46	33,20	43,97	52,12
INPC + 6,00%	1,69	4,69	4,69	8,28	17,40	29,29	41,02	55,31	67,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
928	01/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.489,53	0,00	566,07624147	2,6313240000
965	02/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	502.987,68	0,00	191.087,24467000	2,6322410000
941	02/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.162.883,17	0,00	1.201.593,30775563	2,6322410000
929	02/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	1.116,81263228	2,6322410000
961	05/07/2021	BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	0,00	14.030.244,59	8.485.672,85343890	1,6534039000
962	05/07/2021	BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	0,00	15.969.755,41	9.658.714,00811381	1,6534039000
942	05/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	19.393,48	7.368,58983127	2,6319120000
975	05/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.654,14	1.008,44523500	2,6319120000
982	06/07/2021	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	21.000.000,00	12.750.664,40069145	1,6469730000
960	06/07/2021	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	30.000.000,00	0,00	1.435.905,88946000	20,8927341410
966	06/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	65.176,80	0,00	24.765,57423700	2,6317500000
943	06/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	114.266,63	0,00	43.418,49719768	2,6317500000
964	07/07/2021	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.000.000,00	0,00	6.421.386,02865406	3,2703220000
967	07/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	25.031.106,82	0,00	9.508.398,70907200	2,6325260000
968	07/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.699.057,49	2.924.589,34370000	2,6325260000
944	07/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	117.483.388,59	0,00	44.627.627,07376870	2,6325260000
945	07/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	18.400.896,17	6.989.825,04636232	2,6325260000
976	07/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	38.621.011,42	0,00	14.670.704,64641100	2,6325260000
977	07/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.006.461,74	4.180.950,82176200	2,6325260000
930	08/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	50.584,33	0,00	19.216,91140995	2,6322820000
931	08/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	48.992,73	18.612,26494730	2,6322820000
946	08/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	911.396,54	0,00	346.238,18420671	2,6322820000
947	08/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.266.738,01	861.130,38420656	2,6322820000
978	08/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	553.405,28	0,00	210.237,83925800	2,6322820000
948	09/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	44.543,22	0,00	16.918,74046158	2,6327740000
932	12/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.704,40	0,00	1.026,98630179	2,6333360000
949	13/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.867,68	4.126,87201383	2,6333940000
969	16/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	101.659,35	0,00	38.569,44973400	2,6357480000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
933	16/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.327,98	0,00	1.262,63208774	2,6357480000
950	16/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	101.623,65	38.555,90519276	2,6357480000
979	16/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	202,30	0,00	76,75240500	2,6357480000
951	19/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	720,00	273,05700975	2,6368120000
934	19/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.704,40	1.025,63246830	2,6368120000
952	20/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	720,00	0,00	272,94738825	2,6378710000
935	20/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.594,82	0,00	11.219,20670116	2,6378710000
936	21/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.121,79	0,00	3.836,65778554	2,6381790000
937	22/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	35.208,15	0,00	13.346,22790990	2,6380600000
953	22/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	59.757,38	22.652,01701250	2,6380600000
970	23/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.745,36	0,00	662,12995700	2,6359780000
971	23/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	451.033,94	171.106,86479600	2,6359780000
954	23/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	451.033,94	171.106,86811498	2,6359780000
980	23/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	451.033,94	171.106,86802900	2,6359780000
938	27/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.929,57	0,00	9.080,78285117	2,6351880000
955	28/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	193.818,94	0,00	73.546,16885810	2,6353370000
939	28/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.889,75	0,00	1.475,99718746	2,6353370000
972	29/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.526,74	0,00	2.475,51505400	2,6365180000
956	29/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.599.597,27	0,00	606.708,26825381	2,6365180000
957	29/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.347.378,45	5.062.502,30417543	2,6365180000
940	29/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.787,90	0,00	1.436,70553359	2,6365180000
973	30/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	847.434,41	0,00	321.537,55412900	2,6355690000
974	30/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	32.031.379,79	12.153.496,94468100	2,6355690000
958	30/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.259.989,02	0,00	478.070,96683866	2,6355690000
959	30/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	104.723.627,91	39.734.732,01043115	2,6355690000
981	30/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	27.693.315,25	10.507.528,06996000	2,6355690000
983	02/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	1.115,15530396	2,6361530000
984	03/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.603,60	0,00	2.125,57329901	2,6362770000
985	04/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.695,89	0,00	643,13655592	2,6369050000
1001	04/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.171.210,26	0,00	1.202.625,90423200	2,6369050000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1019	04/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	516.611,55	0,00	195.915,87486000	2,6369050000
1002	05/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	110.122,56	41.780,28682400	2,6357540000
1027	06/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	37.166.034,74	0,00	14.098.031,69417853	2,6362570000
1028	06/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.000.000,00	3.413.931,19107887	2,6362570000
1003	06/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	117.492.074,09	0,00	44.567.761,82671100	2,6362570000
986	06/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.010,87	0,00	5.314,68290079	2,6362570000
1004	06/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	21.014.949,30	7.971.510,09654600	2,6362570000
1020	06/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	24.062.788,53	0,00	9.127.633,81187700	2,6362570000
1021	06/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.801.250,96	2.959.214,88420500	2,6362570000
1005	09/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	103.223,20	0,00	39.155,25590400	2,6362540000
1006	10/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.539,94	0,00	4.754,24348500	2,6376310000
987	10/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	82.968,40	0,00	31.455,65092312	2,6376310000
988	11/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	158.677,86	0,00	60.150,22596441	2,6380260000
1007	11/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	697.715,16	0,00	264.483,80721000	2,6380260000
1008	11/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	473,27	179,40307800	2,6380260000
989	12/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.719,83	0,00	2.926,43271369	2,6379660000
990	13/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.564,84	0,00	2.488,56803964	2,6379990000
992	18/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.460,01	1.311,05034154	2,6391130000
1010	18/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	60.333,41	22.861,24545700	2,6391130000
991	18/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.880,25	0,00	1.849,20084892	2,6391130000
1009	18/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	62.033,73	0,00	23.505,52249900	2,6391130000
1022	18/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.084.462,22	0,00	2.305.495,14931700	2,6391130000
993	20/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.232,12	0,00	3.117,66514825	2,6404760000
1011	20/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.357,00	0,00	3.543,67924500	2,6404760000
994	23/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	34.640,67	0,00	13.116,81540181	2,6409360000
995	24/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	24.152,31	0,00	9.141,82208801	2,6419580000
1013	25/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.173.472,60	444.128,43689400	2,6421920000
996	25/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.018,40	0,00	3.791,70022466	2,6421920000
997	25/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.625,84	3.264,65298510	2,6421920000
1012	25/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	76.650,40	0,00	29.010,15520400	2,6421920000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1014	26/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.422,74	0,00	538,40273600	2,6425200000
998	26/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.399,89	0,00	4.692,44887456	2,6425200000
999	27/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	93.767,15	0,00	35.474,87343934	2,6431990000
1023	27/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	92,88	35,13922800	2,6431990000
1015	30/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.619.135,46	0,00	612.348,61240300	2,6441400000
1000	30/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	58.091,45	0,00	21.969,88434803	2,6441400000
1016	30/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.479.962,22	5.098.051,62007800	2,6441400000
1024	30/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.526,06	0,00	2.468,12196000	2,6441400000
1029	31/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	27.972.896,95	10.577.244,05682459	2,6446300000
1018	31/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	89.107.979,95	33.693.930,70112900	2,6446300000
1017	31/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.257.589,83	0,00	475.525,81268400	2,6446300000
1025	31/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	859.011,34	0,00	324.813,42947700	2,6446300000
1026	31/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.154.026,79	10.645.733,72949600	2,6446300000
1044	01/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	69.032,20	0,00	26.101,88371400	2,6447210000
1045	02/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	473.125,29	178.893,53903000	2,6447310000
1074	02/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	473.125,29	178.893,53931600	2,6447310000
1061	02/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	473.125,29	178.893,53920800	2,6447310000
1046	03/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.163.305,39	0,00	1.195.724,75735300	2,6455130000
1030	03/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.181,26	0,00	4.982,49677800	2,6455130000
1062	03/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	514.759,96	0,00	194.578,50329900	2,6455130000
1031	06/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.790,42	0,00	1.810,31866700	2,6461750000
1032	06/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.116,35	0,00	2.689,29681500	2,6461750000
1047	06/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	307.099,09	0,00	116.053,96090500	2,6461750000
1075	08/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.292.611,83	0,00	10.692.621,30979800	2,6459940000
1063	08/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.075.854,24	0,00	6.453.474,28603300	2,6459940000
1064	08/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.810.559,65	3.707.702,90922400	2,6459940000
1049	08/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	20.624.217,13	7.794.506,38848900	2,6459940000
1048	08/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	94.592.698,07	0,00	35.749.400,06288700	2,6459940000
1065	09/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.946.948,48	0,00	3.006.912,68242700	2,6428930000
1050	09/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	22.069.944,74	0,00	8.350.676,60325200	2,6428930000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1033	09/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.742,06	0,00	10.118,48001400	2,6428930000
1066	10/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.920,32	0,00	2.238,69303600	2,6445430000
1051	10/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.308.327,97	0,00	494.727,43305700	2,6445430000
1034	10/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.819,42	0,00	6.360,04784100	2,6445430000
1052	10/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	48.485,84	18.334,29832700	2,6445430000
1035	13/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	34.771,27	0,00	13.145,81415400	2,6450450000
1036	14/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.663,99	0,00	628,44176800	2,6478030000
1053	15/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.434,23	1.296,84901200	2,6481340000
1054	16/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.749,53	0,00	1.038,09751700	2,6486240000
1037	16/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	536.409,03	0,00	202.523,66134200	2,6486240000
1038	17/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.357,30	0,00	8.817,07660400	2,6490980000
1076	21/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	908.472,07	342.707,78399500	2,6508650000
1067	21/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.557,00	0,00	3.982,47364500	2,6508650000
1068	21/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	117.006,59	44.139,02243100	2,6508650000
1039	21/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	223.961,03	0,00	84.486,01871400	2,6508650000
1055	21/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	907.896,04	342.490,48408800	2,6508650000
1069	22/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	908.472,07	342.626,22670800	2,6514960000
1040	23/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	497,71559800	2,6521170000
1070	24/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.904,54	718,02587600	2,6524670000
1056	24/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.691,69	0,00	1.768,80240100	2,6524670000
1041	28/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.425,74	0,00	11.467,74090800	2,6531590000
1071	29/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.182,94	0,00	2.329,62190200	2,6540530000
1057	29/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.644.568,65	0,00	619.644,23845300	2,6540530000
1042	29/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.038,18	0,00	4.535,77226900	2,6540530000
1058	29/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.673.794,12	5.152.042,59748500	2,6540530000
1077	30/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	27.828.749,28	10.483.091,17130900	2,6546320000
1073	30/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	21.034.334,24	7.923.634,70336500	2,6546320000
1072	30/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	523.110,71	0,00	197.055,82920700	2,6546320000
1043	30/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.501,95	0,00	1.319,18473000	2,6546320000
1059	30/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.287.895,98	0,00	485.150,47660000	2,6546320000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1060	30/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	76.170.703,17	28.693.507,48724200	2,6546320000
Total			615.156.543,77	641.113.721,67		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 14.921.675,99

Value-At-Risk: 1,42%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		1,42	1,42			1.049.804.106,89	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,10%

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		0,18	0,02	0,00			201.076.168,18	19,15
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,23	0,02	0,01			21.209.998,59	2,02
BB PREV RF IDKA2		1,07	0,02	0,61			21.500.400,83	2,05
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,04	0,02	0,60			21.497.209,82	2,05
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,49	0,00	0,03			2.329.328,46	0,22
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,25	0,03	0,04			30.322.555,30	2,89
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,63	0,24	1,80			192.926.789,59	18,38
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		3,36	0,07	0,84			28.647.707,25	2,73
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,11	0,05	0,19			54.900.735,89	5,23
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,46	0,24	1,46			211.006.192,56	20,10
Sub-total	1,20	1,09	0,70		0,03	0,48	785.417.086,47	74,82

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2		1,57	0,06	1,57			50.017.253,42	4,76
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		1,20	0,06	1,20			77.306.932,16	7,36
Sub-total	1,60	1,25	0,12		-0,23	0,07	127.324.185,58	12,13

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,11%

Artigo 8º II, Alínea a

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		10,08	0,13	5,62			18.743.438,07	1,79
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI		10,57	0,11	3,90			13.686.782,01	1,30
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		11,60	0,07	5,06			8.870.783,50	0,84
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI		10,90	0,12	5,74			16.229.582,55	1,55
Sub-total	25,35	9,84	0,43		-0,18	-4,12	57.530.586,13	5,48

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS		6,26	0,03	6,26			9.635.768,34	0,92
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		6,26	0,16	6,33			45.253.422,31	4,31
Sub-total	12,98	6,26	0,19		-0,39	-4,65	54.889.190,65	5,23

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,65%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		6,65	-0,02	1,22			24.643.058,06	2,35
Sub-total	14,25	6,65	-0,02		-0,05	-0,25	24.643.058,06	2,35