



RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

CONSOLIDADO

Período: fevereiro de 2022

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 25/02/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

87,07%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,70	0,72	1,34	353.720.586,51	29,27	5.808.584.551,28	6,09
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,75	1,05	1,14	42.433.287,53	3,51	11.612.568.005,11	0,37
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,63	1,16	1,17	39.587.630,71	3,28	9.012.864.987,26	0,44
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,75	1,15	1,17	104.885.201,72	8,68	10.680.932.817,60	0,98
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,55	0,59	0,52	2.364.169,09	0,20	962.262.156,33	0,25
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,77	1,05	1,13	41.521.223,73	3,44	6.375.804.434,87	0,65
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,68	1,06	1,02	193.894.137,19	16,04	1.676.536.603,63	11,57
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	6,82	-0,09	-1,01	28.184.112,66	2,33	213.145.718,59	13,22
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,74	0,62	0,65	28.449.076,85	2,35	6.887.287.977,51	0,41
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,24	0,81	1,48	61.913.339,99	5,12	10.665.837.627,38	0,58
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2,80	1,06	0,68	11.746.105,63	0,97	895.249.518,55	1,31
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,06	0,88	1,12	908.698.871,61	75,18		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,22	0,82	1,61	77.152.210,75	6,38	10.660.917.138,14	0,72
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,16			0,00	0,00	3.177.445.522,66	0,00
BRAM	BRADERCO	BRADERCO FI RF IDKA PRE 2	4,19	0,46	-0,01	38.231.637,79	3,16	320.655.489,40	11,92
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,95	0,92	1,74	28.301.899,45	2,34	970.244.667,08	2,92
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,17	0,74	1,17	143.685.747,99	11,89		
Renda Fixa			2,20	0,86	1,13	1.052.384.619,60	87,07		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 25/02/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL4,28%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	23,61	-2,62	-0,38	15.559.914,10	1,29	190.088.804,57	8,19
BB	BB	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	21,79	-1,41	1,64	13.368.441,08	1,11	135.094.071,46	9,90
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	25,28	-5,20	-1,43	7.728.424,81	0,64	855.448.008,07	0,90
BB	BB	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	18,86	-2,83	-3,51	15.111.276,69	1,25	283.661.302,54	5,33
Sub-total Artigo 8º I			19,63	-2,77	-0,96	51.768.056,68	4,28		
Renda Variável			15,82	-2,77	-0,96	51.768.056,68	4,28		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 25/02/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR1,91%

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	18,56	-7,12	-16,17	23.098.474,38	1,91	2.975.370.153,41	0,78
Sub-total Artigo 9º III			18,56	-7,12	-16,17	23.098.474,38	1,91		
Investimentos no Exterior			18,20	-7,12	-16,17	23.098.474,38	1,91		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 25/02/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS6,74%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	14,33	-2,26	-7,48	10.049.564,46	0,83	246.662.911,63	4,07
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	14,34	-2,09	-7,29	71.374.713,68	5,91	3.122.842.560,56	2,29
Sub-total Artigo 10º I			19,80	-2,11	-7,31	81.424.278,14	6,74		
Investimentos Estruturados			19,80	-2,11	-7,31	81.424.278,14	6,74		
Total			2,79	0,33	0,02	1.208.675.428,80	100,00		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 25/02/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	908.698.871,61	75,18	0,00	29,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	143.685.747,99	11,89	0,00	10,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	1.052.384.619,60	87,07					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	51.768.056,68	4,28	0,00	5,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	51.768.056,68	4,28					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	23.098.474,38	1,91	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	23.098.474,38	1,91					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	81.424.278,14	6,74	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	81.424.278,14	6,74					15,00

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 25/02/2022

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 b % do CDI	0,88 118,04	1,12 75,59	1,98 87,39	3,33 87,43	3,92 69,39	7.806.280,59	9.848.108,96
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,74 99,08	1,17 78,60				1.059.700,24	1.717.422,04
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-2,77 -3,66	-0,96 -8,90				-1.473.869,77	-503.709,73
Artigo 9º III % do CDI	-7,12 -949,45	-16,17 -1.087,12	-14,74 -651,65	-6,50 -170,69		-1.769.833,61	-4.455.227,55
Artigo 10º I % do CDI	-2,11 -282,09	-7,31 -491,51				-1.758.869,39	-6.421.919,00
CONSOLIDADO (Total)						3.863.408,06	184.674,72

RESULTADO POR ATIVO

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 PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	28.274.899,97	0,00	0,00	0,00	28.449.076,85	174.176,88	184.913,85
BB PREV RF IDKA2	39.134.963,25	0,00	0,00	0,00	39.587.630,71	452.667,46	456.436,40
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	41.088.007,67	0,00	0,00	0,00	41.521.223,73	433.216,06	464.752,70
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	11.959.393,48	0,00	-338.860,90	0,00	11.746.105,63	125.573,05	81.188,11
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	196.792.761,83	0,00	0,00	4.963.307,73	193.894.137,19	2.064.683,09	2.003.029,09
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.993.876,65	0,00	0,00	786.764,30	28.184.112,66	-22.999,69	-292.494,45
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	103.696.579,12	0,00	0,00	0,00	104.885.201,72	1.188.622,60	1.208.127,18
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	41.991.983,49	0,00	0,00	0,00	42.433.287,53	441.304,04	479.221,21
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	303.462.970,88	234.985.389,40	-187.168.033,07	0,00	353.720.586,51	2.440.259,30	4.348.531,18
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.350.266,94	0,00	0,00	0,00	2.364.169,09	13.902,15	12.213,52
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	61.418.464,34	0,00	0,00	0,00	61.913.339,99	494.875,65	902.190,17
					908.698.871,61	0,00	0,00

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

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 25/02/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	338.860,90	-339.231,29	0,00	0,00	370,39	4.148,81
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	38.058.249,85	0,00	0,00	0,00	38.231.637,79	173.387,94	4.225,64
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	76.525.412,81	0,00	0,00	0,00	77.152.210,75	626.797,94	1.224.302,09
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	28.042.755,48	0,00	0,00	0,00	28.301.899,45	259.143,97	484.745,50
					143.685.747,99	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	15.977.797,85	0,00	0,00	0,00	15.559.914,10	-417.883,75	-58.621,33
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	15.551.766,45	0,00	0,00	0,00	15.111.276,69	-440.489,76	-549.139,71
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	13.559.763,34	0,00	0,00	0,00	13.368.441,08	-191.322,26	216.234,23
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	8.152.598,81	0,00	0,00	0,00	7.728.424,81	-424.174,00	-112.182,92
					51.768.056,68	0,00	0,00

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	24.868.307,99	0,00	0,00	0,00	23.098.474,38	-1.769.833,61	-4.455.227,55
					23.098.474,38	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	10.281.548,69	0,00	0,00	0,00	10.049.564,46	-231.984,23	-812.681,43
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	72.901.598,84	0,00	0,00	0,00	71.374.713,68	-1.526.885,16	-5.609.237,57
					81.424.278,14	0,00	0,00

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 25/02/2022

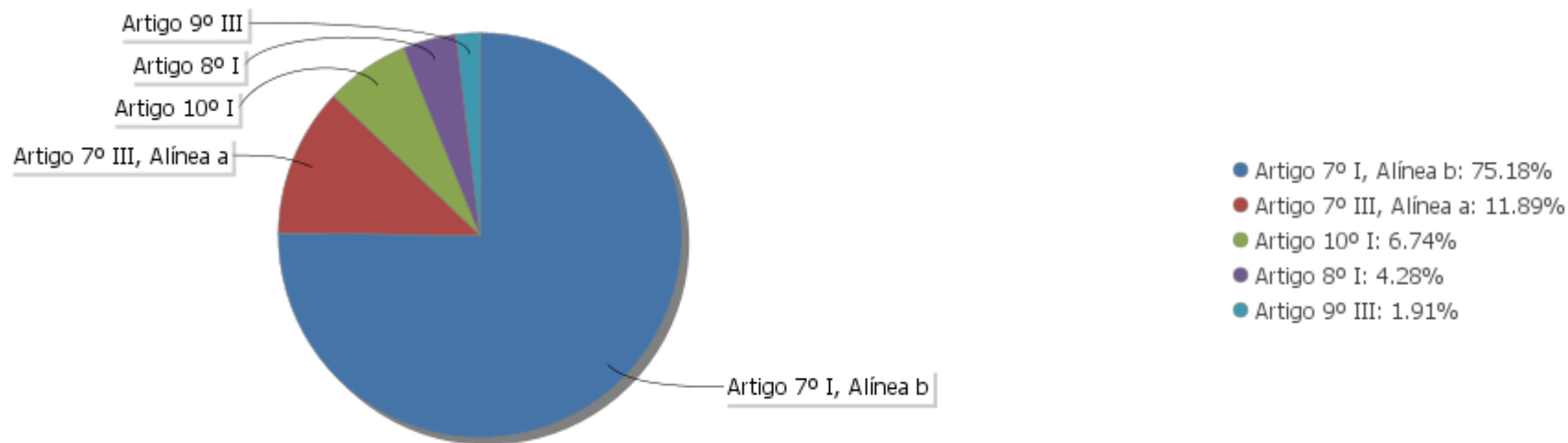
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

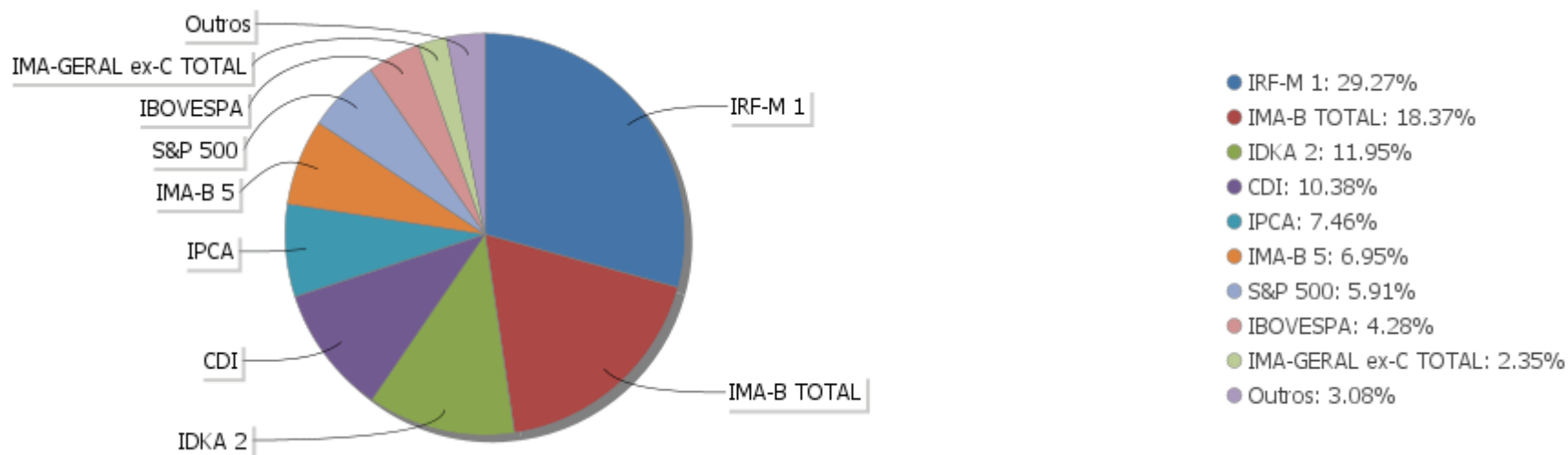
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	974.851.073,32	80,65	974.851.073,32	80,65
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	974.851.073,32	80,65
acima de 365 dias	233.824.355,48	19,35	1.208.675.428,80	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia

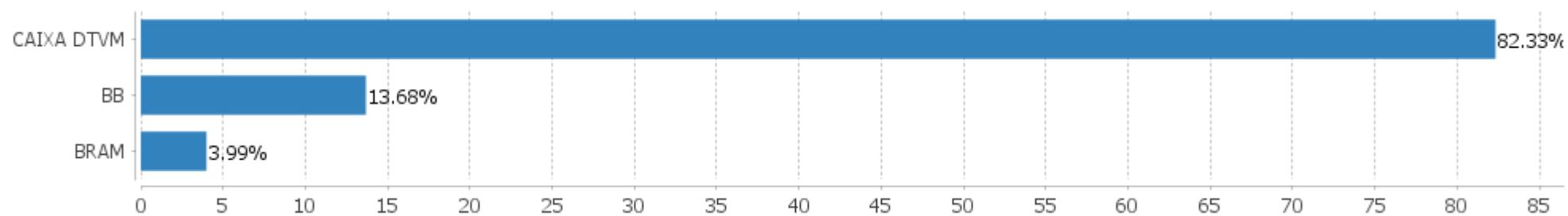


Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 25/02/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 25/02/2022

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
2022	-0,32	0,33											0,02
IPCA + 4,00%	0,87	1,31											2,19
p.p. indexador	-1,18	-0,98											-2,17
2021	-0,23	-0,56	-0,27	0,90	0,46	0,19	-0,17	-0,33	-0,08	-0,80	1,22	1,45	1,79
IPCA + 2,00%	0,41	1,00	1,11	0,47	1,00	0,70	1,13	1,04	1,33	1,41	1,11	0,91	12,25
p.p. indexador	-0,64	-1,56	-1,38	0,44	-0,53	-0,50	-1,30	-1,38	-1,41	-2,21	0,11	0,54	-10,47
2020	0,52	0,46	-0,47	0,59	1,11	0,70	0,84	-0,16	-0,27	-0,10	1,14	1,59	6,09
IPCA + 3,75%	0,53	0,51	0,39	-0,02	-0,09	0,57	0,70	0,55	0,95	1,17	1,19	1,68	8,42
p.p. indexador	-0,01	-0,06	-0,87	0,61	1,20	0,13	0,14	-0,71	-1,22	-1,27	-0,04	-0,09	-2,33

Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

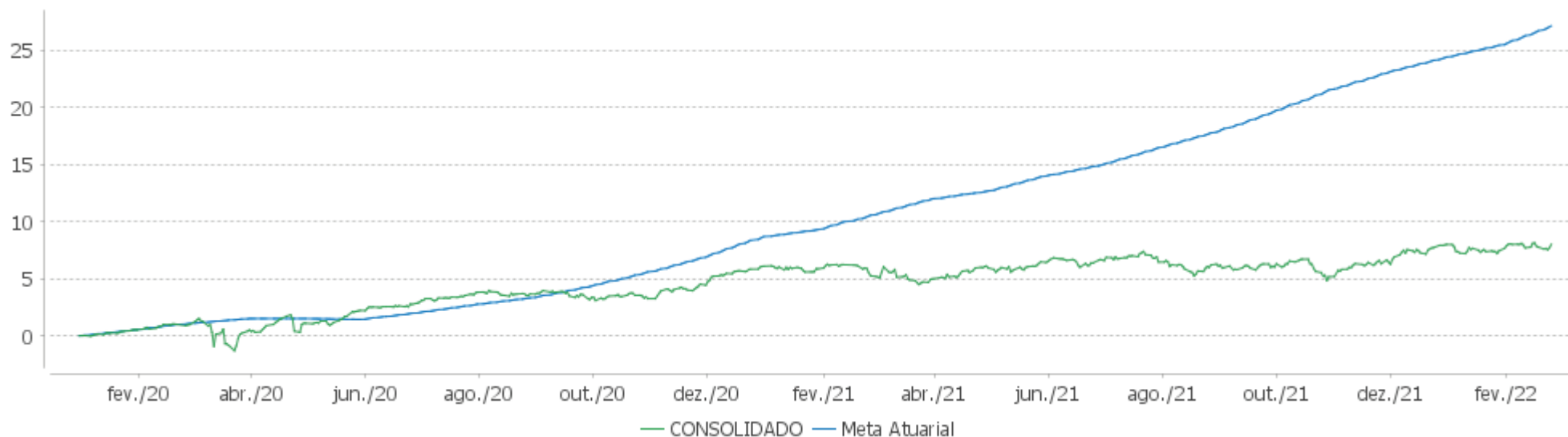
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	7	26,92	03 meses	1,47	3,12	-1,65	2,64
Meses abaixo - Meta Atuarial	19	73,08	06 meses	1,80	7,14	-5,34	2,81
			12 meses	2,61	13,11	-10,50	2,79
			24 meses	6,96	23,08	-16,12	3,09
Maior rentabilidade da Carteira	1,59	2020-12	Desde 31/12/2019	8,01	24,37	-16,36	2,99
Menor rentabilidade da Carteira	-0,80	2021-10					

Carteira: CONSOLIDADO

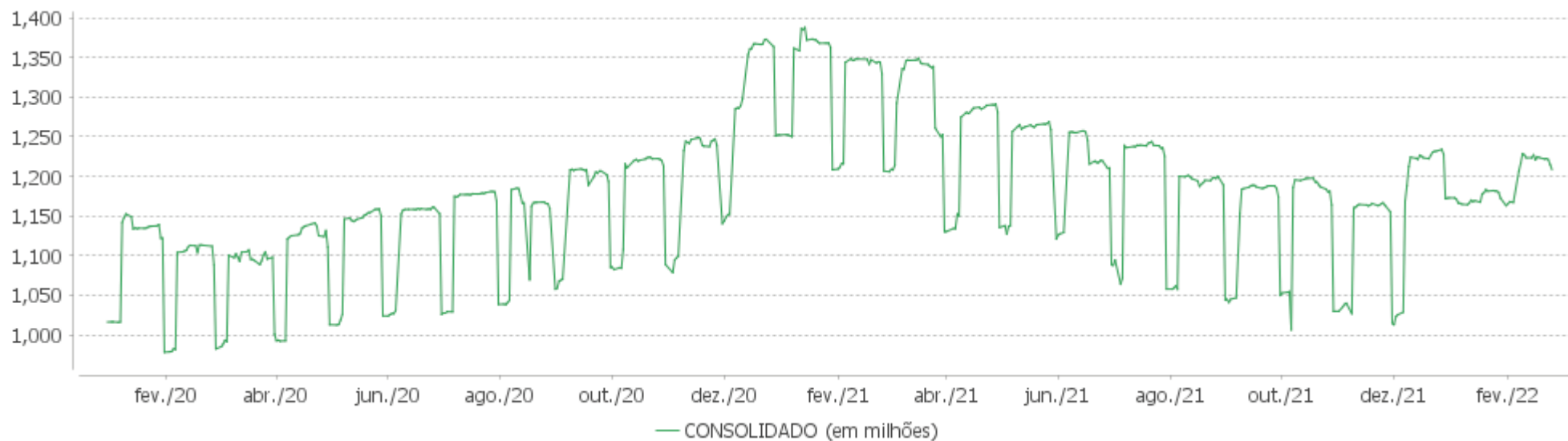
Data Extrato: 25/02/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Patrimônio Líquido

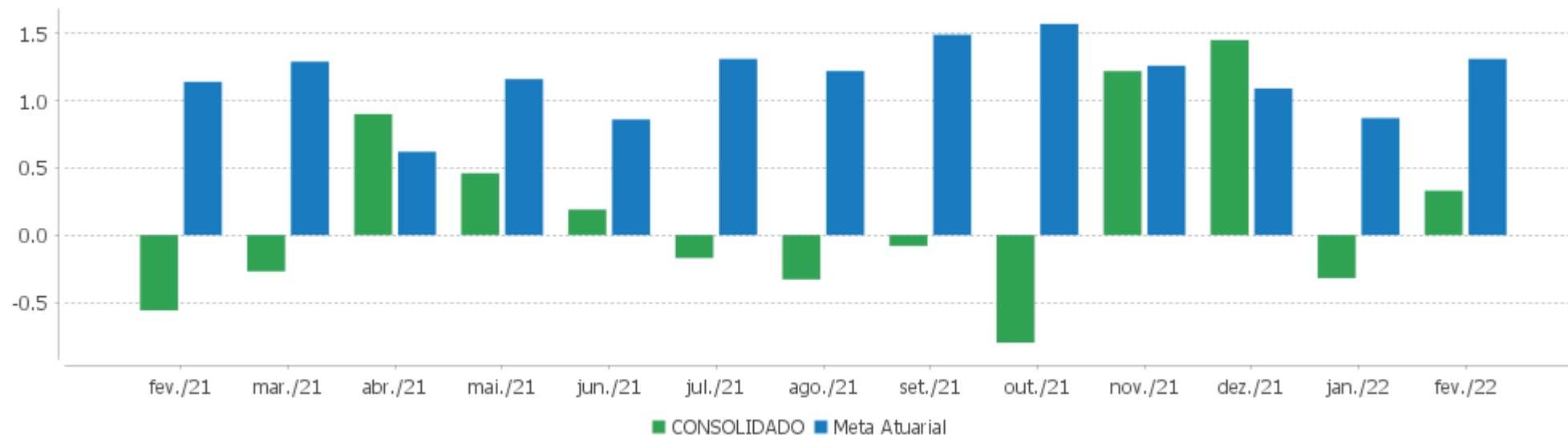


Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 25/02/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 25/02/2022

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
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	0,46 60,78	-0,01 -0,82	2,15 95,20	-0,16 -4,26	-1,50 -26,50	2,34 28,67	14,76 104,04
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,68 90,41	1,33 89,71	2,01 88,96	3,29 86,49	4,51 79,90	5,83 71,53	10,54 74,29
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,82 109,27	1,61 108,41	2,38 105,17	4,08 107,18	6,03 106,73	8,15 99,97	13,91 98,05
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,92 -0,09	1,74 0,19	2,50 0,20	3,80 -1,97	2,90 -7,64		
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,05 -0,01	1,14 -0,03	1,92 -0,05	4,15 -0,12	6,07 -0,24	12,36 -0,59	25,70 -0,99
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,16 -0,10	1,17 -0,14	1,88 -0,27	4,11 -0,20	6,26 -0,44	13,10 -1,02	24,76 -2,13
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,62	0,65	1,57	1,65	1,74	4,37	16,33
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,81 -0,20	1,48 -0,08	2,32 0,02	2,92 -2,85	1,86 -8,68	6,59 -9,70	21,76 0,81
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,06 0,51	1,02 1,22	1,88 1,85	4,07 3,34	5,70 4,77	11,45 7,33	29,32 6,46
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,15 -0,11	1,17 -0,14	1,89 -0,26	4,12 -0,19	6,30 -0,40	13,18 -0,93	24,90 -1,99
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,05 -0,01	1,13 -0,04	1,90 -0,07	4,10 -0,17	6,00 -0,32	12,29 -0,65	25,72 -0,96
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,09 -0,64	-1,01 -0,82	-0,34 -0,37	0,62 -0,11	-0,05 -0,97	3,30 -0,82	19,94 -2,92
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	1,06 -0,32	0,63 -0,98					
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,72 -0,02	1,34 -0,04	2,20 -0,07	2,83 -0,10	4,03 -0,23	7,01 -0,46	13,76 -0,71
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,59 0,01	0,52 0,02	2,40 0,00	1,12 -0,04	0,24 -0,24	3,13 -0,38	15,00 -0,79
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	-5,20 -6,09	-1,43 -9,37	2,75 -8,26	-18,56 -13,81	-13,65 -16,47	-13,95 -22,56	13,95 -4,42
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	-1,41	1,64	7,98	-4,93	5,34	16,61	39,29

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 25/02/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-2,30	-6,29	-3,04	-0,19	2,52	8,00	20,92
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	-2,83	-3,51	4,36	-8,25	5,64	32,67	57,31
Var. IBOVESPA p.p.	-3,72	-11,44	-6,66	-3,51	2,82	24,06	38,94
BB AÇÕES CONSUMO FIC	-2,62	-0,38	-0,41	-22,11	-22,34	-21,82	4,47
Var. IBOVESPA p.p.	-3,51	-8,31	-11,43	-17,36	-25,17	-30,43	-13,89
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-7,12	-16,17	-14,74	-6,50	-0,12	68,54	113,78
Var. Global BDRX p.p.	-0,30	-0,19	-0,20	-0,69	-1,95	-3,73	-6,06
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	-2,26	-7,48	-2,49	-0,61	18,91	47,89	61,46
% do CDI	-301,01	-503,03	-110,17	-15,98	334,76	587,34	433,08
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-2,09	-7,29	-2,13	-0,03	19,98	47,75	62,22
Var. S&P 500 p.p.	4,76	7,99	10,07	3,10	13,06	-21,81	-54,26
CONSOLIDADO	0,33	0,02	1,47	1,80	2,61	6,96	
Var. IPCA + 4,00% p.p.	-0,98	-2,17	-1,84	-6,03	-12,37	-18,78	
CDI	0,75	1,49	2,26	3,81	5,65	8,15	14,19
IBOVESPA	0,89	7,94	11,02	-4,75	2,82	8,61	18,37
INPC + 6,00%	1,44	2,62	3,92	8,81	17,47	32,17	45,56
IPCA + 6,00%	1,45	2,50	3,80	8,85	17,20	30,60	43,95

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 25/02/2022

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 FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
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
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI			D+0	D+0		
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
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI 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		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 25/02/2022

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	0,74	1,38	2,27	2,93	4,26	7,47	14,48	22,35	34,40
IRF-M 1+	0,48	-0,02	2,26	0,18	-1,69	1,08	15,45	28,42	46,68
IRF-M TOTAL	0,58	0,50	2,40	1,16	0,48	3,51	15,79	27,30	43,94
IMA-B 5	1,06	1,18	1,97	4,26	6,32	12,94	26,68	39,47	55,81
IMA-B 5+	0,01	-1,60	-1,93	-2,75	-4,23	-3,33	17,98	38,31	53,22
IMA-B TOTAL	0,54	-0,19	0,03	0,73	0,92	4,12	22,86	40,19	55,41
IMA-GERAL TOTAL	0,74	0,95	1,83	2,30	2,88	6,29	18,28	30,05	44,43
IDKA 2	1,26	1,31	2,15	4,31	6,70	14,12	26,89	39,82	57,21
IDKA 20	-0,58	-3,49	-5,69	-9,10	-12,75	-14,41	8,86	34,44	45,63
CDI	0,75	1,49	2,26	3,81	5,65	8,15	14,19	21,51	32,41

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,89	7,94	11,02	-4,75	2,82	8,61	18,37	32,56	69,72
IBRX 100	1,46	8,43	11,83	-4,71	2,87	9,99	22,25	38,00	76,75
IBRX 50	1,74	9,53	13,65	-3,21	4,78	13,29	20,78	33,87	72,89
SMALL CAP	-5,19	-1,95	1,77	-18,60	-13,32	-11,41	20,21	34,33	77,03
IFIX	-1,29	-2,27	6,31	-0,32	-5,04	-7,51	12,59	18,59	35,11
Índice Consumo - ICON	-2,51		-0,33	-21,72	-21,21	-20,40	7,27	6,67	33,15
Índice Dividendos - IDIV	-2,32	4,98	6,66	-1,56	9,19	5,34	28,12	49,91	76,56

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 25/02/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	1,01	1,56	2,30	5,77	10,54	16,29	20,94	25,65	29,22
INPC	1,00	1,68	2,42	5,73	10,80	17,68	22,30	27,12	29,42
IGPM	1,83	3,68	4,59	4,61	16,12	49,73	59,94	72,10	71,38
SELIC	0,75	1,49	2,26	3,81	5,65	8,15	14,19	21,52	32,43

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-6,85	-15,28	-12,20	-3,13	6,92	69,56	116,47	155,90	207,13
MSCI ACWI	-6,59	-14,77	-12,07	-5,84	-1,21	55,63	90,73	113,55	160,11

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,31	2,19	3,30	7,83	14,98	25,74	35,98	46,92	57,07
IPCA + 5,00%	1,38	2,35	3,55	8,34	16,09	28,16	39,93	52,64	64,73
IPCA + 5,50%	1,42	2,42	3,68	8,60	16,65	29,37	41,93	55,56	68,67
IPCA + 5,89%	1,45	2,48	3,77	8,79	17,08	30,33	43,50	57,86	71,80
IPCA + 6,00%	1,45	2,50	3,80	8,85	17,20	30,60	43,95	58,52	72,69
INPC + 4,00%	1,30	2,31	3,43	7,79	15,25	27,25	37,51	48,64	57,31
INPC + 6,00%	1,44	2,62	3,92	8,81	17,47	32,17	45,56	60,37	72,96

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 25/02/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1296	01/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.753,86	0,00	1.019,12492100	2,7021810000
1303	01/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.499,26	0,00	2.405,19047300	2,7021810000
1335	01/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	119.480,61	44.216,36054100	2,7021810000
1295	02/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	172.009,74	0,00	63.621,98695700	2,7036210000
1334	02/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.047.988,51	0,00	387.624,04567700	2,7036210000
1302	02/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	81.583,55	30.175,66064100	2,7036210000
1294	03/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.942,73	0,00	3.302,71315900	2,7076920000
1332	03/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.012.712,63	1.481.967,90168500	2,7076920000
1333	03/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.261.536,97	0,00	1.204.545,04057300	2,7076920000
1331	04/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	36.123,49	0,00	13.339,61475400	2,7079860000
1293	07/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.880.593,48	0,00	6.599.298,04696000	2,7094690000
1292	07/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.541.199,54	4.997.731,85791500	2,7094690000
1304	07/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	36.201,49	0,00	13.361,10138100	2,7094690000
1329	07/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	101.555.881,30	37.481.839,17340700	2,7094690000
1330	07/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	101.899.124,89	0,00	37.608.522,14585200	2,7094690000
1301	07/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	57.272.411,88	0,00	21.137.873,09616700	2,7094690000
1300	07/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	22.592.197,28	8.338.237,96424800	2,7094690000
1291	08/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.730.553,10	0,00	2.854.073,88975000	2,7086030000
1290	08/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	16.148.983,35	5.962.107,89752800	2,7086030021
1328	08/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.465.164,53	0,00	6.817.228,11722500	2,7086030000
1327	08/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	380,00	140,29292500	2,7086030000
1288	09/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.948.471,87	2.196.533,48489400	2,7081180000
1289	09/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.244.028,51	0,00	1.567.150,51190500	2,7081180000
1326	09/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.305.632,85	0,00	4.543.979,56440500	2,7081180000
1325	09/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	170.017,14	62.780,55072100	2,7081180000
1299	09/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	602.286,40	0,00	222.400,35330800	2,7081180000
1323	11/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	831.891,20	307.209,88817700	2,7078920000
1324	11/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	87.837,13	0,00	32.437,45688500	2,7078920000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 25/02/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1287	14/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	684.378,56	252.642,71999100	2,7088790000
1322	14/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	97.406,40	35.958,19447600	2,7088790000
1298	14/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.413,57	0,00	1.629,29758000	2,7088790000
1277	15/02/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	338.860,90	0,00	153.610,46190800	2,2059753990
1279	15/02/2022	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,00	338.860,90	337.759,57242900	1,0032606850
1321	15/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	914,79	337,41466900	2,7111740000
1285	16/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	15.000,00	5.530,08410500	2,7124360000
1286	16/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.367,46	0,00	6.402,90130300	2,7124360000
1320	16/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	259.036,41	0,00	95.499,54727000	2,7124360000
1305	16/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.642,14	0,00	1.342,75610500	2,7124360000
1319	16/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	775.111,56	285.762,15548200	2,7124360000
1297	16/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	481.506,32	177.518,03759400	2,7124360000
1284	17/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.758.899,21	0,00	2.122.467,37188300	2,7133040000
1318	17/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.012.756,70	0,00	373.255,89023500	2,7133040000
1306	17/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	70.923,86	0,00	26.139,29732900	2,7133040000
1317	17/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.586,52	584,71819700	2,7133040000
1278	18/02/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	339.231,29	153.610,46190800	2,2083866160
1283	18/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	415.646,41	0,00	153.103,25838500	2,7148110000
1315	18/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	59.467,79	21.904,94632700	2,7148110000
1316	18/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	138.020,14	0,00	50.839,68644500	2,7148110000
1307	21/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.121,79	0,00	3.726,75973500	2,7159760000
1314	21/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.237,82	0,00	5.610,43985600	2,7159760000
1282	23/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.421,59	4.937,32137300	2,7183950000
1308	23/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.794,90	0,00	6.546,10533000	2,7183950000
1309	23/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.275,24	1.204,84303200	2,7183950000
1281	24/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	26.383,71	9.704,66362600	2,7186630000
1313	24/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.047.619,94	2.960.138,84072100	2,7186630000
1280	25/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	576.790,18	0,00	212.094,12314900	2,7195010000
1312	25/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.625.049,99	0,00	597.554,47414800	2,7195010000
1310	25/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.752.063,66	1.011.973,76291900	2,7195010000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 25/02/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1311	25/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.207.098,52	3.385.583,79557200	2,7195010000
Total			235.324.250,30	187.846.125,26		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 25/02/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 16.366.867,94

Value-At-Risk: 1,35%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		1,35	1,35			1.208.675.428,80	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,99%

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		0,57	0,10	0,02			353.720.586,51	29,27
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,17	0,03	0,01			42.433.287,53	3,51
BB PREV RF IDKA2		1,35	0,03	0,37			39.587.630,71	3,28
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,60	0,09	0,25			104.885.201,72	8,68
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,77	0,00	0,02			2.364.169,09	0,20
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,16	0,03	0,03			41.521.223,73	3,44
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,54	0,17	1,07			193.894.137,19	16,04
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		2,82	0,04	0,93			28.184.112,66	2,33
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,12	0,02	2,02			28.449.076,85	2,35
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,75	0,02	0,78			61.913.339,99	5,12
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		1,34	0,01	1,31			11.746.105,63	0,97
Sub-total	1,72	1,04	0,55		0,08	0,88	908.698.871,61	75,18

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,07	0,00	0,06			77.152.210,75	6,38
BB PREV RF FLUXO FIC		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2		2,52	0,05	2,51			38.231.637,79	3,16
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		0,22	0,00	0,26			28.301.899,45	2,34
Sub-total	0,95	0,72	0,06		-0,01	0,74	143.685.747,99	11,89

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 25/02/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 8,68%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS		8,69	0,05	8,70			10.049.564,46	0,83
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		8,68	0,33	6,14			71.374.713,68	5,91
Sub-total	21,99	8,68	0,37		-0,13	-2,11	81.424.278,14	6,74

Renda Variável

Value-At-Risk: 11,37%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		14,93	0,12	9,31			15.559.914,10	1,29
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI		11,67	0,08	4,09			13.368.441,08	1,11
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		15,86	0,07	9,11			7.728.424,81	0,64
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI		8,30	0,06	5,25			15.111.276,69	1,25
Sub-total	15,46	11,37	0,33		-0,23	-2,77	51.768.056,68	4,28

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 9,66%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		9,66	0,04	0,82			23.098.474,38	1,91
Sub-total	27,41	9,66	0,04		-0,29	-7,12	23.098.474,38	1,91