

**CEARAPREV**  
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA  
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



**CEARÁ**  
GOVERNO DO ESTADO  
SECRETARIA DO  
PLANEJAMENTO E GESTÃO

# RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

# **CONSOLIDADO**

Período: janeiro de 2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

86,13%

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	0,67	0,61	0,61	303.462.970,88	26,09	6.296.869.255,71	4,82
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,77	0,09	0,09	41.991.983,49	3,61	12.040.160.059,77	0,35
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,62	0,01	0,01	39.134.963,25	3,36	9.258.989.052,65	0,42
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,77	0,02	0,02	103.696.579,12	8,92	10.879.369.499,05	0,95
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,54	-0,07	-0,07	2.350.266,94	0,20	1.205.162.298,95	0,20
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,79	0,08	0,08	41.088.007,67	3,53	6.406.714.372,41	0,64
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,77	-0,03	-0,03	196.792.761,83	16,92	1.456.289.627,12	13,51
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	6,86	-0,92	-0,92	28.993.876,65	2,49	219.269.757,54	13,22
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,77	0,04	0,04	28.274.899,97	2,43	7.461.201.984,89	0,38
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,30	0,67	0,67	61.418.464,34	5,28	11.686.800.915,89	0,53
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2,24	-0,37	-0,37	11.959.393,48	1,03	911.505.616,42	1,31
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>2,05</b>	<b>0,24</b>	<b>0,24</b>	<b>859.164.167,62</b>	<b>73,87</b>		

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	0,21	0,79	0,79	76.525.412,81	6,58	9.998.166.423,55	0,77
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,15			0,00	0,00	3.101.943.229,29	0,00
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	4,17	-0,47	-0,47	38.058.249,85	3,27	298.261.875,82	12,76
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	2,02	0,81	0,81	28.042.755,48	2,41	977.612.086,50	2,87
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>1,35</b>	<b>0,42</b>	<b>0,42</b>	<b>142.626.418,14</b>	<b>12,26</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>2,20</b>	<b>0,26</b>	<b>0,26</b>	<b>1.001.790.585,76</b>	<b>86,13</b>		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/01/2022

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### RENDÁ VARIÁVEL

**4,58%**

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	23,51	2,30	2,30	15.977.797,85	1,37	200.601.796,72	7,96
BB	BB	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	22,70	3,10	3,10	13.559.763,34	1,17	141.307.419,15	9,60
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	25,50	3,98	3,98	8.152.598,81	0,70	911.466.501,10	0,89
BB	BB	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	19,54	-0,69	-0,69	15.551.766,45	1,34	303.332.414,25	5,13
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>23,00</b>	<b>1,86</b>	<b>1,86</b>	<b>53.241.926,45</b>	<b>4,58</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>16,33</b>	<b>1,86</b>	<b>1,86</b>	<b>53.241.926,45</b>	<b>4,58</b>		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/01/2022

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,14%

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	17,35	-9,75	-9,75	24.868.307,99	2,14	3.479.303.240,79	0,71
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>17,35</b>	<b>-9,75</b>	<b>-9,75</b>	<b>24.868.307,99</b>	<b>2,14</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>17,19</b>	<b>-9,75</b>	<b>-9,75</b>	<b>24.868.307,99</b>	<b>2,14</b>		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/01/2022

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

7,15%

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	13,57	-5,35	-5,35	10.281.548,69	0,88	265.081.661,91	3,88
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13,60	-5,30	-5,30	72.901.598,84	6,27	3.506.862.313,47	2,08
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>18,08</b>	<b>-5,31</b>	<b>-5,31</b>	<b>83.183.147,53</b>	<b>7,15</b>		
<b>Investimentos Estruturados</b>			<b>18,08</b>	<b>-5,31</b>	<b>-5,31</b>	<b>83.183.147,53</b>	<b>7,15</b>		
<b>Total</b>			<b>2,78</b>	<b>-0,32</b>	<b>-0,32</b>	<b>1.163.083.967,73</b>	<b>100,00</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	859.164.167,62	73,87	0,00	29,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	142.626.418,14	12,26	0,00	10,00	60,00	0,00	60,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>1.001.790.585,76</b>	<b>86,13</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	53.241.926,45	4,58	0,00	5,00	30,00	0,00	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>53.241.926,45</b>	<b>4,58</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	24.868.307,99	2,14	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>24.868.307,99</b>	<b>2,14</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	83.183.147,53	7,15	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>83.183.147,53</b>	<b>7,15</b>					15,00

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/01/2022

## 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	0,24 32,41	0,24 32,41	2,93 139,68	2,11 60,79	2,51 50,27	2.041.828,37	2.041.828,37
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,42 57,79	0,42 57,79				657.721,80	657.721,80
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	1,86 -5,13	1,86 -5,13				970.160,04	970.160,04
Artigo 9º III % do CDI	-9,75 -1.330,92	-9,75 -1.330,92	-9,03 -430,53	3,11 89,61		-2.685.393,94	-2.685.393,94
Artigo 10º I % do CDI	-5,31 -724,89	-5,31 -724,89				-4.663.049,61	-4.663.049,61
<b>CONSOLIDADO (Total)</b>						<b>-3.678.733,34</b>	<b>-3.678.733,34</b>

### 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	28.264.163,00	0,00	0,00	0,00	28.274.899,97	10.736,97	10.736,97
BB PREV RF IDKA2	39.131.194,31	0,00	0,00	0,00	39.134.963,25	3.768,94	3.768,94
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	41.056.471,03	0,00	0,00	0,00	41.088.007,67	31.536,64	31.536,64
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,00	12.003.778,42	0,00	0,00	11.959.393,48	-44.384,94	-44.384,94
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	196.854.415,83	0,00	0,00	0,00	196.792.761,83	-61.654,00	-61.654,00
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.263.371,41	0,00	0,00	0,00	28.993.876,65	-269.494,76	-269.494,76
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	103.677.074,54	0,00	0,00	0,00	103.696.579,12	19.504,58	19.504,58
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	41.954.066,32	0,00	0,00	0,00	41.991.983,49	37.917,17	37.917,17
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	307.663.539,74	18.360.749,99	-24.469.590,73	0,00	303.462.970,88	1.908.271,88	1.908.271,88
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.351.955,57	0,00	0,00	0,00	2.350.266,94	-1.688,63	-1.688,63
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	61.011.149,82	0,00	0,00	0,00	61.418.464,34	407.314,52	407.314,52
					859.164.167,62	0,00	0,00

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

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/01/2022

**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	12.000.000,00	-12.003.778,42	0,00	0,00	3.778,42	3.778,42
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	50.227.412,15	0,00	-12.000.000,00	0,00	38.058.249,85	-169.162,30	-169.162,30
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	75.927.908,66	0,00	0,00	0,00	76.525.412,81	597.504,15	597.504,15
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	27.817.153,95	0,00	0,00	0,00	28.042.755,48	225.601,53	225.601,53
					142.626.418,14	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	15.618.535,43	0,00	0,00	0,00	15.977.797,85	359.262,42	359.262,42
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	15.660.416,40	0,00	0,00	0,00	15.551.766,45	-108.649,95	-108.649,95
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	13.152.206,85	0,00	0,00	0,00	13.559.763,34	407.556,49	407.556,49
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	7.840.607,73	0,00	0,00	0,00	8.152.598,81	311.991,08	311.991,08
					53.241.926,45	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	27.553.701,93	0,00	0,00	0,00	24.868.307,99	-2.685.393,94	-2.685.393,94
					24.868.307,99	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	10.862.245,89	0,00	0,00	0,00	10.281.548,69	-580.697,20	-580.697,20
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	76.983.951,25	0,00	0,00	0,00	72.901.598,84	-4.082.352,41	-4.082.352,41
					83.183.147,53	0,00	0,00



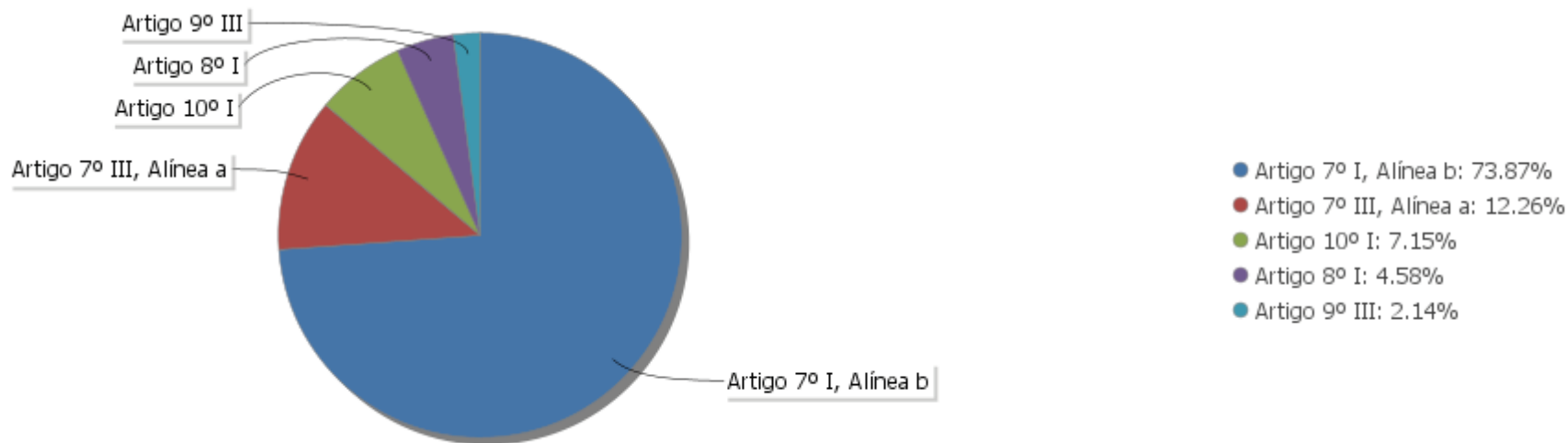
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Liquidez

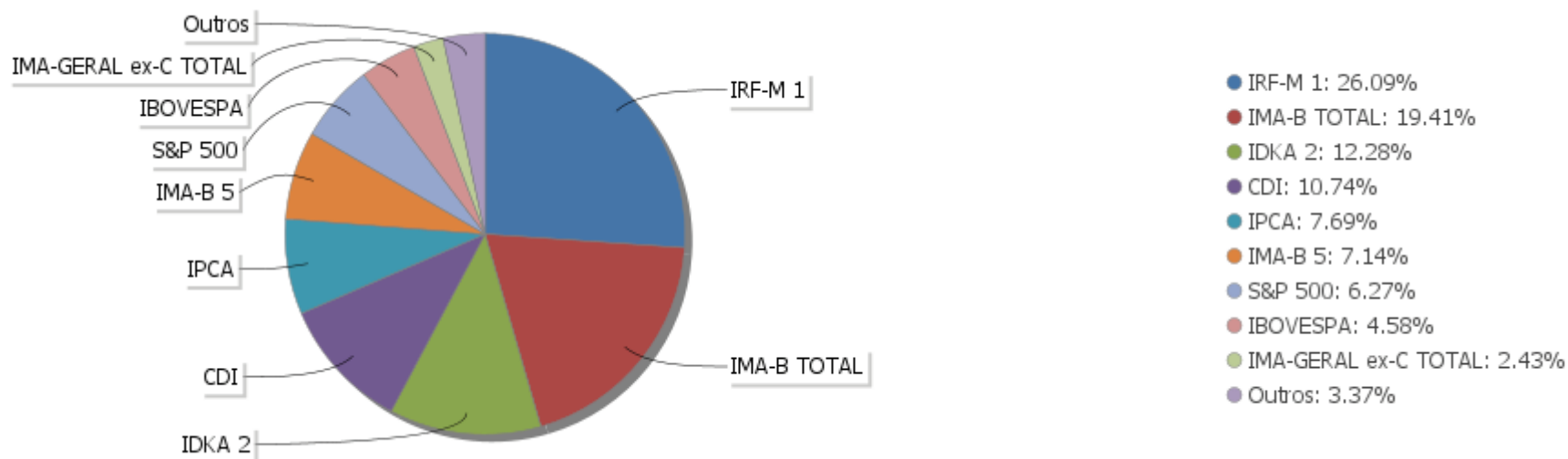
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	925.337.935,77	79,56	925.337.935,77	79,56
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	925.337.935,77	79,56
acima de 365 dias	237.746.031,96	20,44	1.163.083.967,73	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

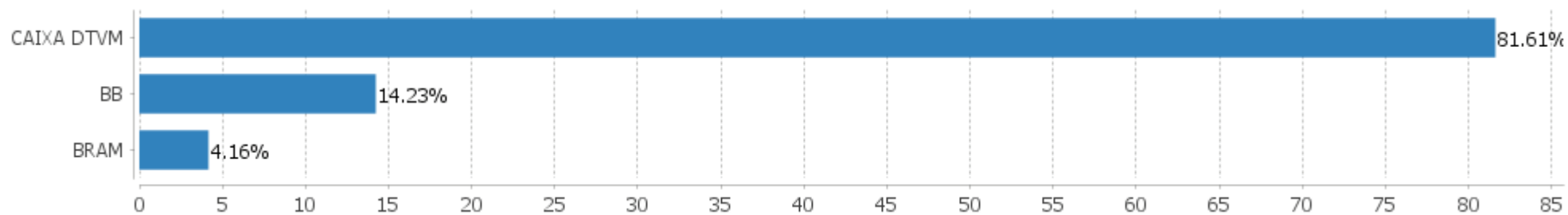


Alocação Por Estratégia



## 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
2022	-0,32												-0,32
IPCA + 4,00%	0,87												0,87
p.p. indexador	-1,18												-1,18
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

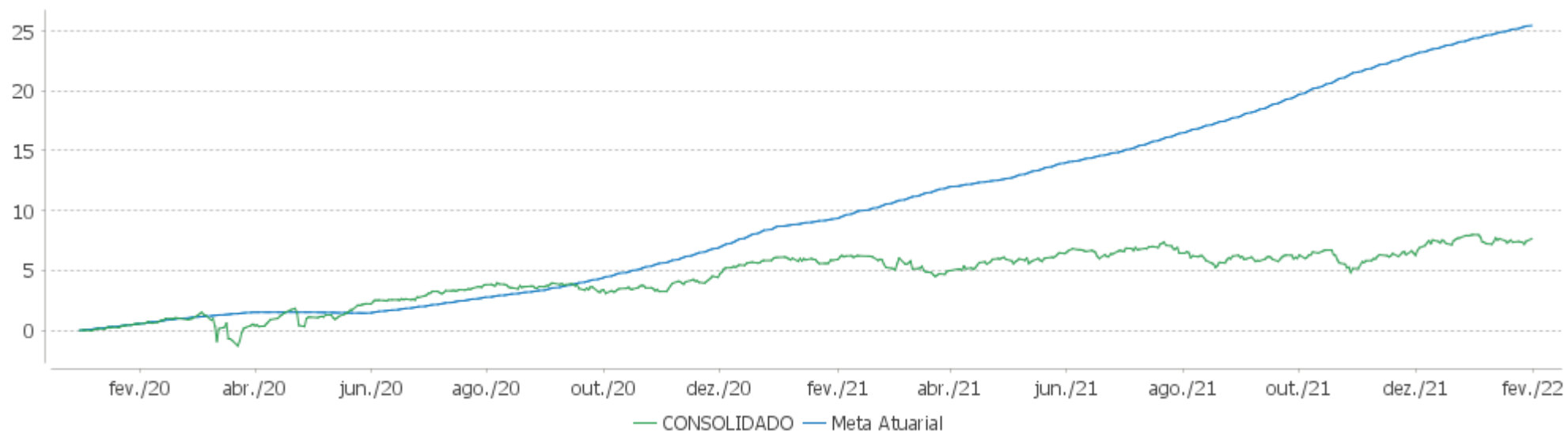
**Performance Sobre a Meta Atuarial**

**Relatório**

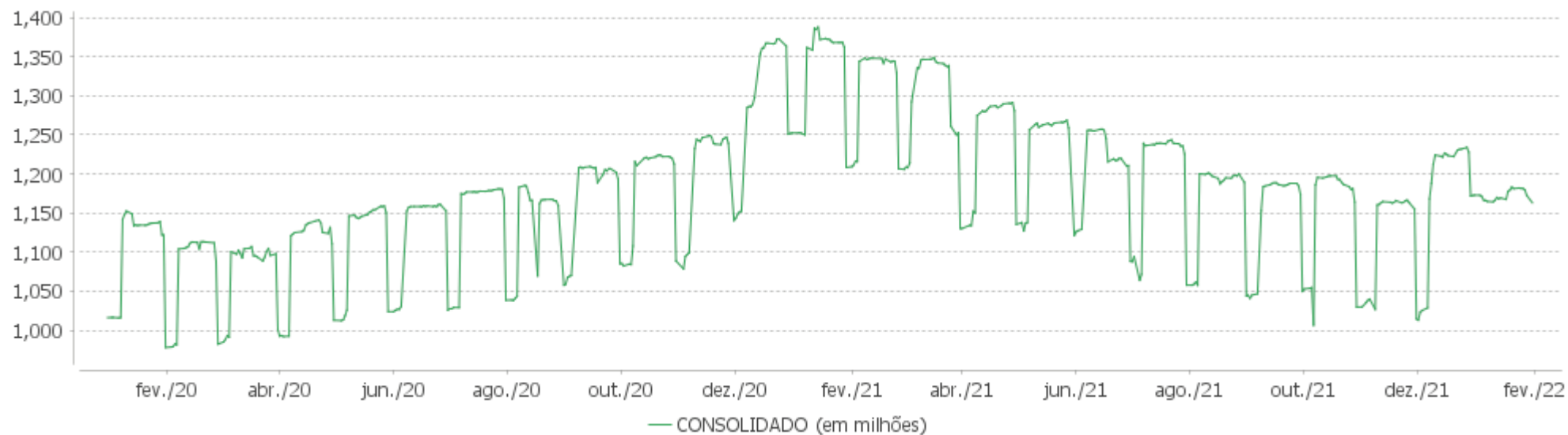
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	7	28,00	03 meses	2,36	2,92	-0,55	2,76
Meses abaixo - Meta Atuarial	18	72,00	06 meses	1,13	6,86	-5,73	2,86
			12 meses	1,70	12,77	-11,07	2,78
			24 meses	7,09	22,11	-15,03	3,07
Maior rentabilidade da Carteira	1,59	2020-12	Desde 31/12/2019	7,65	22,76	-15,11	3,01
Menor rentabilidade da Carteira	-0,80	2021-10					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

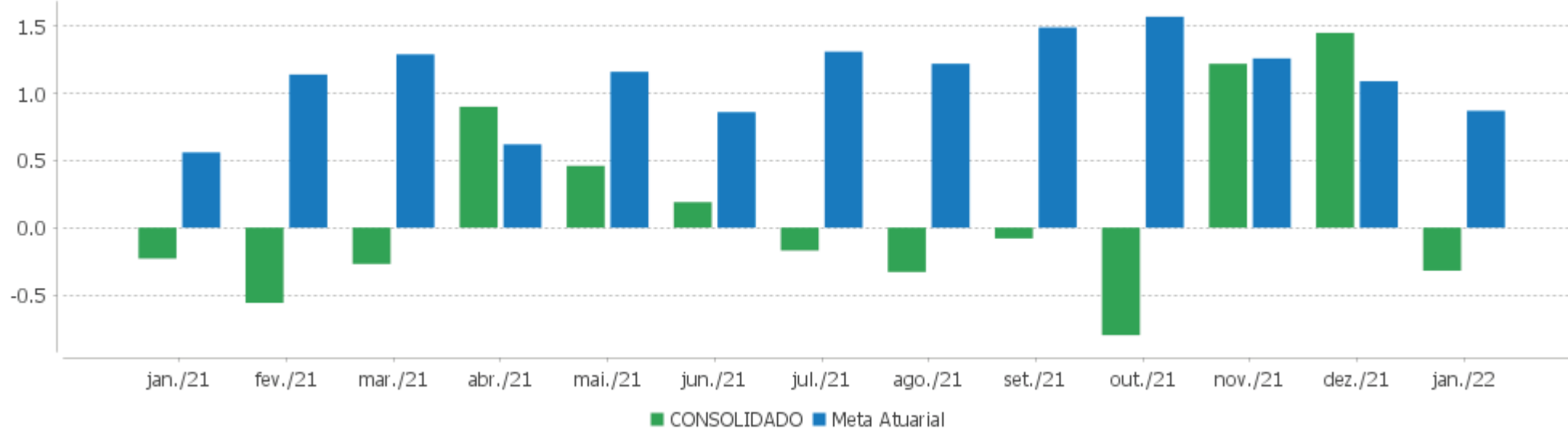


Patrimônio Líquido



### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

#### Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Performance dos Fundos**

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	-0,47 -63,58	-0,47 -63,58	3,56 169,61	-1,21 -34,77	-3,16 -63,15	2,96 38,61	14,53 104,51
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,65 89,07	0,65 89,07	1,84 87,65	2,91 83,63	3,86 77,14	5,35 69,76	10,25 73,70
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,79 107,46	0,79 107,46	2,18 103,93	3,74 107,77	5,25 104,90	7,57 98,71	13,53 97,36
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,81 0,27	0,81 0,27	2,29 0,05	1,41 -4,22	1,43 -8,95		
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,09 -0,02	0,09 -0,02	3,35 -0,08	3,20 -0,12	4,32 -0,25	11,89 -0,59	25,04 -1,00
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,01 -0,04	0,01 -0,04	3,16 -0,25	3,11 -0,18	4,47 -0,40	12,51 -0,97	24,08 -1,89
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,04	0,04	2,70	0,57	0,19	4,20	16,07
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03 0,70	-0,03 0,70	3,55 0,61	2,96 3,87	3,09 4,24	11,06 7,04	28,42 5,56
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,67 0,13	0,67 0,13	2,42 0,18	0,62 -5,00	0,53 -9,85	6,39 -9,02	21,39 1,14
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,02 -0,03	0,02 -0,03	3,17 -0,24	3,14 -0,15	4,54 -0,33	12,57 -0,90	24,17 -1,81
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,92 -0,19	-0,92 -0,19	3,70 0,76	-0,16 0,74	-2,34 -1,19	4,05 0,03	17,88 -4,98
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,08 -0,04	0,08 -0,04	3,33 -0,09	3,12 -0,20	4,25 -0,32	11,85 -0,63	25,06 -0,97
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	-0,42 -0,65	-0,42 -0,65					
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,61 -0,02	0,61 -0,02	2,25 -0,06	2,44 -0,10	3,30 -0,23	6,63 -0,45	13,45 -0,71
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,07 0,01	-0,07 0,01	3,64 0,01	-0,11 -0,08	-1,50 -0,22	3,17 -0,41	14,64 -0,82
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	3,98 -3,01	3,98 -3,01	4,88 -3,47	-18,40 -10,47	-10,73 -8,18	-17,03 -15,61	17,20 2,06
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	3,10	3,10	10,71	-8,95	6,33	7,90	39,53

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/01/2022

**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.	-3,89	-3,89	2,36	-1,02	8,87	9,32	24,38
<b>BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI</b>	<b>-0,69</b>	<b>-0,69</b>	<b>1,76</b>	<b>-6,21</b>	<b>12,53</b>	<b>23,26</b>	<b>64,72</b>
Var. IBOVESPA p.p.	-7,68	-7,68	-6,59	1,72	15,07	24,68	49,58
<b>BB AÇÕES CONSUMO FIC</b>	<b>2,30</b>	<b>2,30</b>	<b>-5,50</b>	<b>-23,29</b>	<b>-24,52</b>	<b>-27,64</b>	<b>2,71</b>
Var. IBOVESPA p.p.	-4,68	-4,68	-13,85	-15,36	-21,98	-26,22	-12,43
<b>FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I</b>	<b>-9,75</b>	<b>-9,75</b>	<b>-9,03</b>	<b>3,11</b>	<b>11,35</b>	<b>71,14</b>	<b>143,50</b>
Var. Global BDRX p.p.	0,09	0,09	-0,12	-0,27	-2,22	-3,19	-6,48
<b>BRADESCO FI MULTIMERCADO S&amp;P 500 MAIS</b>	<b>-5,35</b>	<b>-5,35</b>	<b>-0,81</b>	<b>5,04</b>	<b>24,86</b>	<b>39,94</b>	<b>70,31</b>
% do CDI	-730,05	-730,05	-38,65	144,95	496,97	521,12	505,78
<b>CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP</b>	<b>-5,30</b>	<b>-5,30</b>	<b>-0,53</b>	<b>5,52</b>	<b>25,85</b>	<b>39,39</b>	<b>71,27</b>
Var. S&P 500 p.p.	3,74	3,74	6,39	-1,95	6,91	-36,27	-73,70
<b>CONSOLIDADO</b>	<b>-0,32</b>	<b>-0,32</b>	<b>2,36</b>	<b>1,13</b>	<b>1,70</b>	<b>7,09</b>	
Var. IPCA + 4,00% p.p.	-1,18	-1,18	-0,90	-6,61	-13,09	-17,68	
CDI	0,73	0,73	2,10	3,47	5,00	7,66	13,90
IBOVESPA	6,98	6,98	8,35	-7,93	-2,54	-1,42	15,14
INPC + 6,00%	1,16	1,16	3,78	8,75	17,24	31,05	44,93
IPCA + 6,00%	1,03	1,03	3,76	8,77	17,00	29,59	43,15



**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		

**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	0,63	0,63	2,31	2,54	3,53	7,08	14,16	22,11	34,75
IRF-M 1+	-0,50	-0,50	4,01	-1,41	-4,13	1,40	15,16	29,50	49,44
IRF-M TOTAL	-0,08	-0,08	3,63	-0,03	-1,28	3,58	15,45	27,96	45,98
IMA-B 5	0,11	0,11	3,42	3,32	4,57	12,47	26,04	38,75	56,48
IMA-B 5+	-1,61	-1,61	2,45	-4,92	-6,47	-3,03	18,62	39,06	60,95
IMA-B TOTAL	-0,73	-0,73	2,94	-0,91	-1,15	4,02	22,86	40,20	60,52
IMA-GERAL TOTAL	0,21	0,21	2,90	1,13	1,42	5,98	17,98	30,01	46,61
IDKA 2	0,05	0,05	3,41	3,29	4,87	13,47	25,98	38,94	57,36
IDKA 20	-2,92	-2,92	0,64	-12,61	-14,59	-13,99	10,19	35,73	59,77
CDI	0,73	0,73	2,10	3,47	5,00	7,66	13,90	21,17	32,56

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,98	6,98	8,35	-7,93	-2,54	-1,42	15,14	32,07	73,41
IBRX 100	6,87	6,87	8,36	-9,14	-2,11	-0,51	18,37	36,58	79,96
IBRX 50	7,65	7,65	9,69	-8,20	-0,93	1,71	16,71	32,14	74,76
SMALL CAP	3,42	3,42	4,89	-17,43	-10,25	-14,29	24,49	41,16	97,42
IFIX	-0,99	-0,99	3,78	-1,67	-3,56	-9,76	15,24	21,52	43,53
Índice Consumo - ICON			-5,43	-22,83	-23,46	-26,51	5,30	5,50	37,84
Índice Dividendos - IDIV	7,47	7,47	10,17	0,27	5,96	1,18	28,50	52,53	93,40

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/01/2022

## 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	0,54	0,54	2,24	5,63	10,38	15,41	20,25	24,79	28,35
INPC	0,67	0,67	2,26	5,61	10,60	16,72	21,74	26,09	28,45
IGPM	1,82	1,82	2,72	3,40	16,91	46,97	58,45	69,12	68,43
SELIC	0,73	0,73	2,10	3,47	5,00	7,66	13,90	21,18	32,59

### 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	-9,05	-9,05	-6,91	7,47	18,94	75,67	144,98	170,90	239,48
MSCI ACWI	-8,76	-8,76	-8,61	3,62	9,17	61,14	114,25	124,36	183,76

### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,87	0,87	3,26	7,73	14,79	24,77	35,22	45,90	55,99
IPCA + 5,00%	0,95	0,95	3,51	8,26	15,90	27,17	39,15	51,57	63,59
IPCA + 5,50%	0,99	0,99	3,64	8,51	16,45	28,37	41,14	54,46	67,50
IPCA + 5,89%	1,02	1,02	3,73	8,72	16,88	29,32	42,71	56,75	70,61
IPCA + 6,00%	1,03	1,03	3,76	8,77	17,00	29,59	43,15	57,40	71,49
INPC + 4,00%	1,00	1,00	3,28	7,71	15,02	26,18	36,90	47,41	56,11
INPC + 6,00%	1,16	1,16	3,78	8,75	17,24	31,05	44,93	59,03	71,61

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Movimentações**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1260	04/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.033,58	0,00	1.130,99596600	2,6822200000
1268	04/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	35.172,68	0,00	13.113,27184100	2,6822200000
1267	12/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.395,07	0,00	3.119,52647500	2,6911360000
1259	13/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.575,63	0,00	2.814,73976100	2,6914140000
1272	18/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	564.460,58	0,00	209.643,52540600	2,6924780000
1266	18/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.817.876,98	0,00	4.389.219,51451400	2,6924780000
1258	19/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	41.515,66	0,00	15.408,38530900	2,6943550000
1273	20/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	534.095,28	0,00	198.029,13845900	2,6970540000
1257	20/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.647,98	0,00	1.723,35444500	2,6970540000
1265	20/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.227.768,18	0,00	826.000,58434100	2,6970540000
1256	21/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.121,79	0,00	3.751,24525200	2,6982480000
1269	25/01/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	12.000.000,00	0,00	5.467.348,62564500	2,1948481470
1271	25/01/2022	BRANCO FI RF IDKA PRE 2	0,00	12.000.000,00	7.342.587,31850730	1,6343013000
1270	26/01/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	12.003.778,42	5.467.348,62564500	2,1955392360
1276	26/01/2022	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	12.003.778,42	0,00	12.010.081,93552400	0,9994751480
1274	28/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.925,52	0,00	4.047,86216300	2,6990840000
1263	28/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.667.402,31	3.581.734,51205600	2,6990840000
1264	28/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	40.660,85	0,00	15.064,68490700	2,6990840000
1255	28/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.822,84	0,00	675,35504600	2,6990840000
1275	31/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	611.983,27	0,00	226.666,17900000	2,6999320000
1261	31/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.926.369,27	4.787.664,75089800	2,6999320000
1262	31/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.440.694,10	0,00	903.983,54477000	2,6999320000
1254	31/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.875.819,15	694.765,33038900	2,6999320000
<b>Total</b>			<b>42.364.528,41</b>	<b>48.473.369,15</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 16.902.087,62

Value-At-Risk: 1,45%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		1,45	1,45			1.163.083.967,73	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,01%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,63	0,10	0,02			303.462.970,88	26,09
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,06	0,03	0,01			41.991.983,49	3,61
BB PREV RF IDKA2		1,36	0,03	0,38			39.134.963,25	3,36
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,60	0,10	0,26			103.696.579,12	8,92
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,79	0,00	0,02			2.350.266,94	0,20
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,10	0,03	0,04			41.088.007,67	3,53
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,56	0,19	1,12			196.792.761,83	16,92
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		2,94	0,05	1,01			28.993.876,65	2,49
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,11	0,02	1,75			28.274.899,97	2,43
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,74	0,02	0,76			61.418.464,34	5,28
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		0,87	0,01	0,87			11.959.393,48	1,03
<b>Sub-total</b>	1,64	1,06	0,56		-0,30	0,24	859.164.167,62	73,87

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,07	0,00	0,07			76.525.412,81	6,58
BB PREV RF FLUXO FIC		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BRANCO FI RF IDKA PRE 2		2,50	0,05	2,50			38.058.249,85	3,27
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		0,21	0,00	0,25			28.042.755,48	2,41
<b>Sub-total</b>	1,35	0,72	0,06		-0,23	0,42	142.626.418,14	12,26

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/01/2022

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 8,29%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS		8,02	0,05	8,02			10.281.548,69	0,88
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		8,33	0,34	5,87			72.901.598,84	6,27
<b>Sub-total</b>	18,08	8,29	0,39		-0,33	-5,31	83.183.147,53	7,15

### Renda Variável

Value-At-Risk: 12,36%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		14,75	0,13	8,46			15.977.797,85	1,37
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI		12,45	0,10	4,04			13.559.763,34	1,17
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		16,19	0,08	8,45			8.152.598,81	0,70
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI		11,08	0,09	5,50			15.551.766,45	1,34
<b>Sub-total</b>	23,00	12,36	0,41		0,05	1,86	53.241.926,45	4,58

### Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 9,01%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		9,01	0,04	0,89			24.868.307,99	2,14
<b>Sub-total</b>	22,05	9,01	0,04		-0,48	-9,75	24.868.307,99	2,14