

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

CONSOLIDADO

Período: novembro de 2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

84,20%

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	0,62	0,78	1,84	162.958.054,55	16,06	6.377.941.010,36	2,56
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,76	2,47	2,20	41.634.548,14	4,10	11.929.906.744,63	0,35
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,57	2,43	3,55	38.856.786,90	3,83	9.400.574.561,59	0,41
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,73	2,42	3,59	102.936.230,90	10,14	10.904.431.852,46	0,94
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,46	1,81	-3,98	2.308.753,45	0,23	1.248.645.776,60	0,18
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,78	2,47	2,25	40.745.898,90	4,02	6.334.560.730,61	0,64
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,86	2,71	2,09	195.194.061,98	19,24	1.424.510.796,65	13,70
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	7,03	3,95	-3,49	29.065.999,09	2,86	219.815.074,89	13,22
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,88	1,73	-1,30	28.008.140,47	2,76	7.834.893.808,79	0,36
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,36	0,91	-0,93	60.511.514,97	5,96	13.063.702.370,09	0,46
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,03	1,83	1,29	702.219.989,35	69,21		

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de 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	0,48	0,48	75.359.329,47	7,43	8.064.205.057,36	0,93
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF IDKA PRE 2	3,99	1,84	-5,57	49.162.516,84	4,85	297.726.962,54	16,51
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	2,09	0,71	-0,04	27.611.768,23	2,72	981.257.837,77	2,81
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			5,16	1,10	-7,49	152.133.614,54	14,99		
Renda Fixa			2,20	1,72	0,15	854.353.603,89	84,20		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/11/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

13,13%

Artigo 8º II, Alínea a (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	23,01	-7,58	-27,24	15.624.715,16	1,54	203.002.154,39	7,70
BB	BB	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	23,06	1,09	-6,64	12.381.043,74	1,22	136.871.001,98	9,05
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	23,99	-3,24	-20,50	7.521.358,32	0,74	864.957.103,62	0,87
BB	BB	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	20,13	-5,25	3,81	14.480.336,59	1,43	293.772.568,51	4,93
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			20,34	-4,22	-14,00	50.007.453,81	4,93		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	12,73	-0,57	18,41	10.306.442,29	1,02	275.723.676,42	3,74
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	12,73	-0,49	18,96	72.928.049,71	7,19	3.554.282.113,36	2,05
Sub-total Artigo 8º III			11,90	-0,50	18,86	83.234.492,00	8,20		
Renda Variável			16,27	-1,78	1,42	133.241.945,81	13,13		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/11/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,67%

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	17,25	-0,89	15,56	27.092.402,30	2,67	3.764.762.598,77	0,72
Sub-total Artigo 9º III			17,25	-0,89	15,56	27.092.402,30	2,67		
Investimentos no Exterior			16,16	-0,89	15,56	27.092.402,30	2,67		
Total			2,66	1,22	0,33	1.014.687.952,00	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	702.219.989,35	69,21	50,00	52,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	152.133.614,54	14,99	0,00	27,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	854.353.603,89	84,20					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	50.007.453,81	4,93	0,00	5,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	83.234.492,00	8,20	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável	133.241.945,81	13,13					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	27.092.402,30	2,67	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	27.092.402,30	2,67					10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,83 311,34	1,29 35,81	1,33 87,73	0,91 34,64	2,63 69,66	14.941.428,31	8.565.085,40
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	1,10 188,16	-7,49 -207,75	-1,15 -75,94	-2,78 -106,18	-6,11 -161,79	1.440.949,53	-10.583.872,88
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-4,22 -2,69	-14,00 0,37	-16,65 -2,46	-22,34 -3,09	-7,97 -1,56	-2.204.303,52	-8.137.644,28
Artigo 8º III % do CDI	-0,50 -85,31	18,86 582,01	2,11 139,64	11,19 427,39		-842.971,66	7.234.492,00
Artigo 9º III % do CDI	-0,89 -152,03	15,56 481,20	9,66 638,81	17,02 650,01		-243.856,86	3.092.402,30
CONSOLIDADO (Total)						13.091.245,80	170.462,54

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	27.530.764,35	0,00	0,00	0,00	28.008.140,47	477.376,12	-660.259,61
BB PREV RF IDKA2	37.935.270,46	0,00	0,00	0,00	38.856.786,90	921.516,44	856.627,62
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	39.762.489,09	0,00	0,00	0,00	40.745.898,90	983.409,81	745.898,90
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	190.047.914,48	0,00	0,00	0,00	195.194.061,98	5.146.147,50	3.966.301,67
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	27.960.597,10	0,00	0,00	0,00	29.065.999,09	1.105.401,99	-1.774.210,79
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	50.722.790,94	50.000.000,00	0,00	0,00	102.936.230,90	2.213.439,96	1.936.230,90
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	40.631.835,78	0,00	0,00	0,00	41.634.548,14	1.002.712,36	634.548,14
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	189.082.395,72	199.082.764,13	-227.357.034,06	0,00	162.958.054,55	2.149.928,76	5.933.074,27
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.267.816,79	0,00	0,00	0,00	2.308.753,45	40.936,66	-95.725,44
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	209.610.956,26	0,00	-150.000.000,00	0,00	60.511.514,97	900.558,71	-2.977.400,26
					702.219.989,35	0,00	0,00

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

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/11/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	48.276.476,83	0,00	0,00	0,00	49.162.516,84	886.040,01	-3.616.902,06
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	75.000.000,00	0,00	0,00	75.359.329,47	359.329,47	359.329,47
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	27.416.188,18	0,00	0,00	0,00	27.611.768,23	195.580,05	-326.459,57
					152.133.614,54	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES CONSUMO FIC	16.907.041,82	0,00	0,00	0,00	15.624.715,16	-1.282.326,66	-5.849.319,65
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	15.283.275,98	0,00	0,00	0,00	14.480.336,59	-802.939,39	532.054,47
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	12.247.893,45	0,00	0,00	0,00	12.381.043,74	133.150,29	-880.509,85
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	7.773.546,08	0,00	0,00	0,00	7.521.358,32	-252.187,76	-1.939.869,25
					50.007.453,81	0,00	0,00

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	10.365.556,95	0,00	0,00	0,00	10.306.442,29	-59.114,66	1.306.442,29
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	48.711.906,71	25.000.000,00	0,00	0,00	72.928.049,71	-783.857,00	5.928.049,71
					83.234.492,00	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	27.336.259,16	0,00	0,00	0,00	27.092.402,30	-243.856,86	3.092.402,30
					27.092.402,30	0,00	0,00

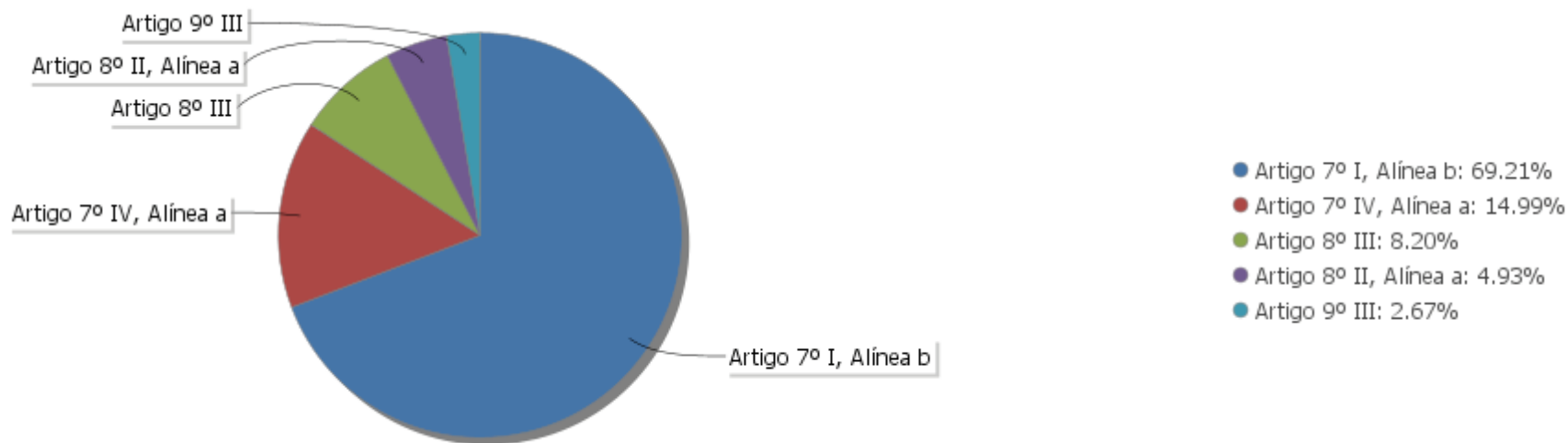
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

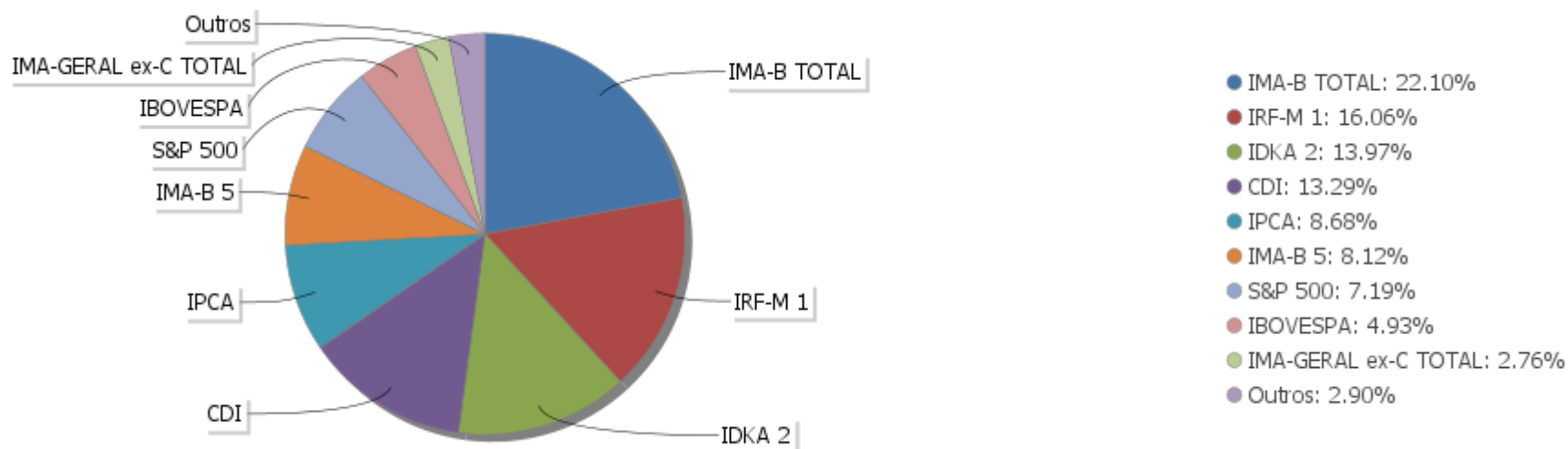
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	790.427.890,93	77,90	790.427.890,93	77,90
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	790.427.890,93	77,90
acima de 365 dias	224.260.061,07	22,10	1.014.687.952,00	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

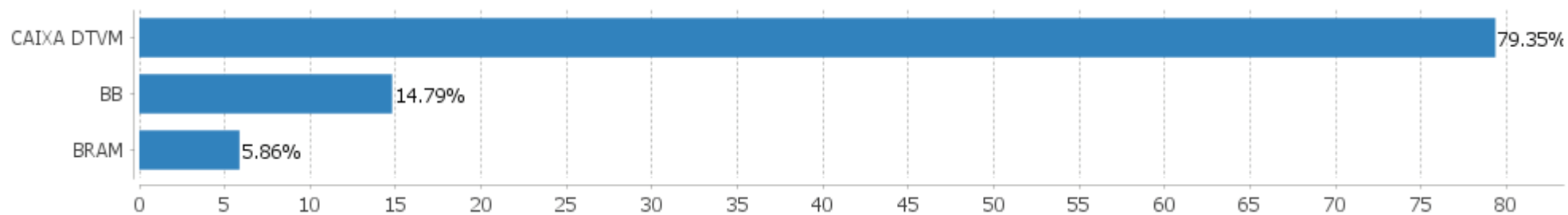


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/11/2021

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	-0,80	1,22		0,33
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		11,24
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		-10,91
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

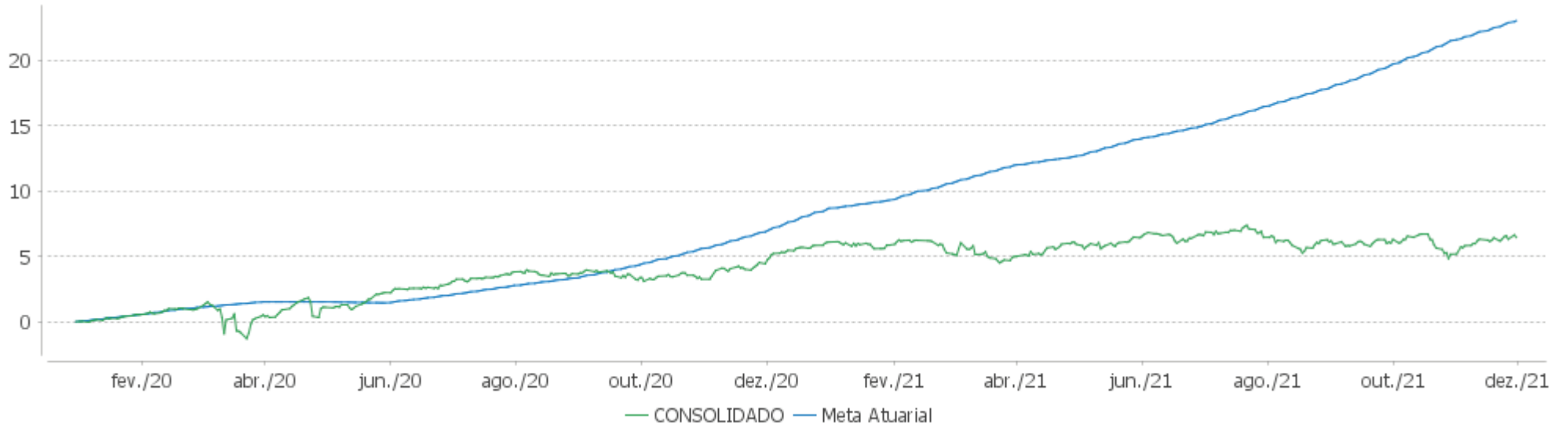
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	6	26,09
Meses abaixo - Meta Atuarial	17	73,91
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,59	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-0,80	2021-10

Relatório

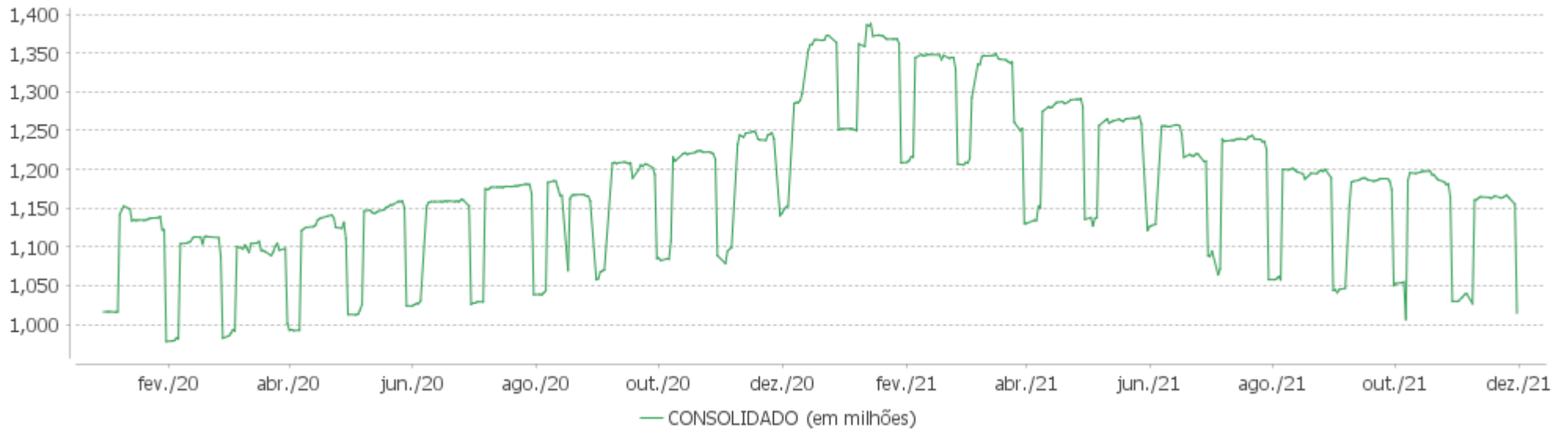
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	0,33	3,89	-3,57	2,98
06 meses	0,02	6,91	-6,89	2,77
12 meses	1,93	13,10	-11,18	2,66
24 meses				
Desde 31/12/2019	6,44	20,61	-14,16	3,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

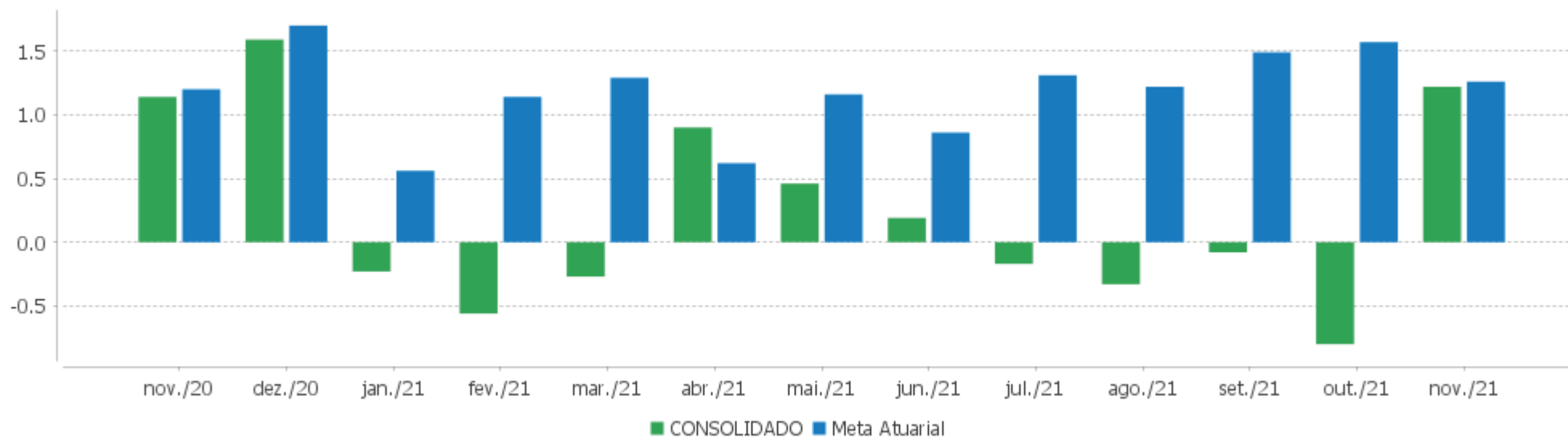


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	2,47 -0,03	3,52 -0,23	2,19 -0,06	2,18 -0,12	5,40 -0,25	12,88 -0,59	27,61 -0,95
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	2,43 -0,08	3,91 -0,20	2,19 0,08	2,36 0,48	5,50 -0,42	13,43 -1,01	26,22 -1,81
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	1,73	-1,30	0,07	-0,51	1,05	4,72	18,65
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,71 -0,76	2,09 3,58	2,15 1,45	1,61 1,96	4,68 1,38	12,69 5,76	32,82 1,81
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,91 -0,04	-0,93 -10,19	0,59 -2,80	-1,64 -7,49	0,38 -10,36	6,30 -9,21	24,67 5,38
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,95 0,49	-3,49 -2,00	0,97 0,27	0,23 0,58	1,84 -1,45	6,68 -0,25	25,86 -5,15
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	2,47 -0,03	3,48 -0,27	2,16 -0,09	2,09 -0,20	5,35 -0,30	12,86 -0,61	27,60 -0,96
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	2,42 -0,09	3,91 -0,19	2,18 0,07	2,03 0,15	5,63 -0,28	13,49 -0,95	26,27 -1,77
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,78 -0,01	1,84 -0,20	0,62 -0,03	1,32 -0,10	2,13 -0,22	5,96 -0,44	13,06 -0,69
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,81 0,02	-3,98 -0,17	-1,25 -0,04	-2,16 -0,10	-2,10 -0,17	2,82 -0,45	15,82 -0,93
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	1,84 312,80	-5,57 -154,64	-2,27 -149,85	-3,46 -132,04	-3,72 -98,67	2,76 40,13	15,96 119,26
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,62 106,07	3,81 105,76	1,66 109,99	2,94 112,24	4,19 110,97	6,69 97,39	12,94 96,67
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,71 -0,24	-0,04 -9,31	1,27 -2,13	-0,65 -6,51	0,96 -9,78		
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS % do CDI	-0,57 -97,20	24,85 689,38	1,93 127,70	10,77 411,56	28,61 758,09	44,32 644,85	68,56 512,29
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	-0,49 0,75	25,83 -5,66	2,15 -8,19	11,27 -5,41	29,78 -3,14	43,53 -49,92	69,64 -71,05
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	-3,24 -1,71	-20,50 -6,13	-20,74 -6,55	-27,90 -8,64	-14,46 -8,05	-13,42 -7,58	20,66 6,79
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	1,09	-6,64	-11,95	-18,35	2,12	11,37	36,69

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/11/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Varição da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	2,62	7,73	2,24	0,91	8,53	17,20	22,82
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	-5,25	3,81	-12,09	-14,01	11,83	26,81	53,39
Var. IBOVESPA p.p.	-3,72	18,18	2,11	5,25	18,24	32,64	39,53
BB AÇÕES CONSUMO FIC	-7,58	-27,24	-21,79	-28,84	-23,67	-20,96	12,19
Var. IBOVESPA p.p.	-6,05	-12,87	-7,59	-9,59	-17,26	-15,12	-1,68
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-0,89	28,32	9,66	17,02	29,21	95,10	146,17
Var. Global BDRX p.p.	-0,22	-3,08	-0,55	-2,04	-3,41	-4,19	-7,16
CONSOLIDADO	1,22	0,33	0,33	0,02	1,93		
Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,11	-10,91	-3,57	-6,89	-11,01		
CDI	0,59	3,60	1,51	2,62	3,77	6,87	13,38
IBOVESPA	-1,53	-14,37	-14,20	-19,25	-6,41	-5,84	13,87
INPC + 6,00%	1,31	15,28	4,70	8,96	17,56	31,03	43,57
IPCA + 6,00%	1,42	15,18	4,87	8,99	17,33	29,67	41,95

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
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	0,79	2,03	0,65	1,42	2,35	6,40	13,74	21,69	36,07
IRF-M 1+	2,19	-7,11	-2,04	-3,73	-4,28	1,46	17,30	31,09	53,93
IRF-M TOTAL	1,79	-3,81	-1,21	-2,06	-1,93	3,27	16,74	28,91	49,37
IMA-B 5	2,50	3,75	2,25	2,30	5,65	13,47	28,56	40,58	59,06
IMA-B 5+	4,47	-6,23	-0,84	-2,98	0,81	1,50	31,39	50,00	74,04
IMA-B TOTAL	3,47	-1,49	0,70	-0,35	3,30	6,93	31,01	46,92	69,13
IMA-GERAL TOTAL	1,80	0,09	0,46	0,31	2,12	6,38	20,34	32,04	50,44
IDKA 2	2,51	4,11	2,12	1,88	5,91	14,44	28,04	40,40	59,70
IDKA 20	6,09	-12,50	-3,62	-8,23	-2,56	-7,04	31,71	56,52	86,71
CDI	0,59	3,60	1,51	2,62	3,77	6,87	13,38	20,72	33,50

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-1,53	-14,37	-14,20	-19,25	-6,41	-5,84	13,87	41,61	64,63
IBRX 100	-1,69	-13,88	-14,79	-20,36	-6,00	-4,38	17,37	45,94	70,57
IBRX 50	-1,81	-13,79	-14,84	-20,46	-5,66	-4,80	12,95	40,34	62,89
SMALL CAP	-2,29	-19,26	-20,02	-26,60	-13,19	-9,64	29,55	46,85	103,82
IFIX	-3,64	-10,16	-6,23	-8,45	-8,19	-10,79	12,08	16,51	40,35
Índice Consumo - ICON	-7,50	-26,09	-21,46	-28,01	-22,40	-19,51	15,50	11,72	36,98
Índice Dividendos - IDIV	0,89	-7,89	-7,71	-11,70	0,34	0,29	33,23	61,08	90,61

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	0,95	9,26	3,40	5,86	10,74	15,51	19,30	24,12	27,60
INPC	0,84	9,36	3,23	5,84	10,96	16,73	20,66	24,95	27,38
IGPM	0,02	16,77	0,02	2,08	17,89	46,79	52,62	67,39	65,94
SELIC	0,59	3,60	1,51	2,62	3,77	6,87	13,38	20,73	33,53

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	-1,24	31,49	10,34	16,68	32,92	93,45	140,69	197,22	243,65
MSCI ACWI	-2,91	21,57	7,09	9,69	23,86	76,81	115,31	147,67	190,75

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,26	13,21	4,38	7,95	15,13	24,86	34,11	45,07	55,08
IPCA + 5,00%	1,34	14,19	4,63	8,47	16,23	27,25	37,99	50,70	62,64
IPCA + 5,50%	1,38	14,69	4,75	8,73	16,78	28,46	39,96	53,57	66,52
IPCA + 5,89%	1,41	15,07	4,84	8,93	17,21	29,40	41,51	55,84	69,61
IPCA + 6,00%	1,42	15,18	4,87	8,99	17,33	29,67	41,95	56,48	70,48
INPC + 4,00%	1,15	13,31	4,22	7,93	15,36	26,17	35,64	46,04	54,81
INPC + 6,00%	1,31	15,28	4,70	8,96	17,56	31,03	43,57	57,53	70,19

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1150	01/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.105,36	0,00	1.933,69247100	2,6402130000
1149	03/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.508,29	0,00	3.975,93543300	2,6429730000
1166	03/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.744,40	2.173,46097000	2,6429730000
1183	04/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	515.307,12	0,00	194.905,34380400	2,6438840000
1165	04/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.171.610,07	0,00	1.199.602,58089900	2,6438840000
1170	05/11/2021	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	25.000.000,00	0,00	14.588.351,72632700	1,7136960000
1167	05/11/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	50.000.000,00	0,00	20.468.851,32081400	2,4427360000
1168	05/11/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	75.000.000,00	0,00	19.412.721,18207400	3,8634460000
1169	05/11/2021	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	150.000.000,00	100.643.514,64184100	1,4904089999
1148	05/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.664,25	0,00	10.835,27754700	2,6454560000
1182	08/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.920,32	0,00	2.238,45349300	2,6448260000
1181	08/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	14.634.666,75	5.533.319,29502300	2,6448260022
1164	08/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.285.909,22	0,00	486.198,04100500	2,6448260000
1178	09/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.440.031,56	1.299.941,60110100	2,6462970000
1179	09/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.397.661,81	1.661.817,17665800	2,6462970000
1180	09/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.273.680,31	0,00	9.928.469,97521400	2,6462970000
1163	09/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	120.780.804,43	0,00	45.641.439,50206600	2,6462970000
1146	09/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.951.688,77	1.115.403,44206100	2,6462969888
1147	09/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.841.964,75	0,00	1.073.940,20776900	2,6462970000
1162	09/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	34.247.653,38	12.941.727,01872000	2,6462970000
1134	09/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	38.223.569,37	0,00	14.444.172,12807100	2,6462970000
1133	09/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.045.809,22	4.174.062,55522200	2,6462970000
1161	10/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	106.745,04	0,00	40.332,20926800	2,6466450000
1145	10/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	120.139,72	0,00	45.393,21291600	2,6466450000
1132	10/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	559.009,92	0,00	211.214,54520700	2,6466450000
1131	11/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.717,58	0,00	648,24344500	2,6495910000
1177	12/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	112.659,93	42.505,56209800	2,6504750000
1130	12/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	180,41	68,06671600	2,6504750000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/11/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1144	16/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	35.919,89	0,00	13.550,65118300	2,6507870000
1128	16/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.717,57	647,94661900	2,6507870000
1129	16/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.717,57	0,00	647,94719400	2,6507870000
1127	17/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.717,58	647,77745100	2,6514950000
1160	18/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.138,51	4.200,84770200	2,6514910000
1143	18/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.197,71	0,00	6.108,90627100	2,6514910000
1176	19/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.147.332,13	0,00	432.463,49153600	2,6530150000
1142	19/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	50.822,06	0,00	19.156,34099300	2,6530150000
1158	19/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.147.332,13	432.463,49223800	2,6530150000
1159	19/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.138,00	0,00	1.182,80522300	2,6530150000
1141	22/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	27.348,85	0,00	10.313,12102800	2,6518500000
1175	23/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	244.223,20	0,00	92.051,11253600	2,6531260000
1174	23/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	457.097,39	172.286,34819400	2,6531260000
1156	23/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	701.320,59	264.337,46086300	2,6531260000
1157	23/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	166.584,19	0,00	62.787,89247000	2,6531260000
1140	23/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	25.985,29	0,00	9.794,21633100	2,6531260000
1126	23/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	457.097,39	172.286,34698300	2,6531260000
1139	24/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.663,99	0,00	626,73964600	2,6549940000
1138	25/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.930,79	0,00	4.867,82937800	2,6563770000
1155	25/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.289,12	0,00	1.238,19774000	2,6563770000
1137	26/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.802,04	0,00	1.429,60975600	2,6594950000
1173	29/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.182,94	0,00	2.323,98717800	2,6604880000
1153	29/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.590.323,44	5.108.207,00703000	2,6604880000
1136	29/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.871,95	0,00	1.831,22419600	2,6604880000
1154	29/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.616.458,53	0,00	607.579,71094000	2,6604880000
1171	30/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	31.878.070,85	11.979.692,98298600	2,6610090000
1172	30/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	476.933,76	0,00	179.230,41973900	2,6610090000
1135	30/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	125.449,54	0,00	47.143,59853700	2,6610090000
1151	30/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	80.464.590,82	30.238.376,05060900	2,6610090000
1152	30/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.181.256,83	0,00	443.913,12844100	2,6610090000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/11/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1125	30/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	27.810.531,56	10.451.122,69826400	2,6610090000
Total			349.082.764,13	377.357.034,06		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/11/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 16.282.951,06

Value-At-Risk: 1,60%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		1,60	1,60			1.014.687.952,00	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,26%

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		0,59	0,05	0,02			162.958.054,55	16,06
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,51	0,05	0,03			41.634.548,14	4,10
BB PREV RF IDKA2		1,34	0,04	0,61			38.856.786,90	3,83
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,64	0,12	0,60			102.936.230,90	10,14
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,83	0,00	0,03			2.308.753,45	0,23
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,55	0,05	0,05			40.745.898,90	4,02
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,76	0,26	1,36			195.194.061,98	19,24
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		3,36	0,07	0,90			29.065.999,09	2,86
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,38	0,03	1,97			28.008.140,47	2,76
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,46	0,06	1,46			60.511.514,97	5,96
Sub-total	1,95	1,36	0,71		0,64	1,83	702.219.989,35	69,21

Artigo 7º IV, 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	0,07			75.359.329,47	7,43
BRANCO FI RF IDKA PRE 2		2,24	0,08	2,24			49.162.516,84	4,85
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		1,22	0,02	1,21			27.611.768,23	2,72
Sub-total	2,21	0,88	0,09		0,23	1,10	152.133.614,54	14,99

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,59%

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/11/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		14,02	0,15	7,98			15.624.715,16	1,54
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI		13,64	0,12	4,60			12.381.043,74	1,22
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		15,10	0,08	6,60			7.521.358,32	0,74
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI		10,58	0,10	5,56			14.480.336,59	1,43
Sub-total	25,06	12,22	0,45		-0,19	-4,22	50.007.453,81	4,93

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS		7,23	0,04	7,23			10.306.442,29	1,02
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		7,20	0,30	7,16			72.928.049,71	7,19
Sub-total	14,98	7,20	0,35		-0,07	-0,50	83.234.492,00	8,20

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 8,14%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		8,14	0,00	0,76			27.092.402,30	2,67
Sub-total	19,70	8,14	0,00		-0,08	-0,89	27.092.402,30	2,67

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

-Referente ao mês de novembro de 2021, vale observar que:

- O Instituto está com 16,51% do Patrimônio Líquido do fundo BRADESCO FI RF IDKA PRE 2, percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;