

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

CONSOLIDADO

Período: outubro de 2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

86,54%

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	0,58	-0,54	1,05	189.082.395,72	18,36	6.589.712.896,46	2,87
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,69	-1,24	-0,26	40.631.835,78	3,95	10.998.044.937,35	0,37
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,50	-1,25	1,09	37.935.270,46	3,68	9.253.803.912,06	0,41
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,65	-1,29	1,14	50.722.790,94	4,93	11.036.712.361,17	0,46
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,35	-2,64	-5,68	2.267.816,79	0,22	1.295.006.190,43	0,18
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,70	-1,27	-0,21	39.762.489,09	3,86	6.081.334.244,20	0,65
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,84	-1,49	-0,60	190.047.914,48	18,45	1.382.014.263,51	13,75
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	6,76	-2,40	-7,16	27.960.597,10	2,71	211.455.343,90	13,22
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,84	-1,63	-2,98	27.530.764,35	2,67	7.937.028.591,03	0,35
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,40	-0,66	-1,82	209.610.956,26	20,35	13.374.488.418,39	1,57
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,97	-0,96	-0,53	815.552.830,97	79,19		

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
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	3,84	-3,48	-7,28	48.276.476,83	4,69	311.318.354,44	15,51
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	2,10	0,06	-0,75	27.416.188,18	2,66	947.189.238,70	2,89
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			5,14	-2,30	-8,50	75.692.665,01	7,35		
Renda Fixa			2,15	-1,06	-1,55	891.245.495,98	86,54		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/10/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

10,81%

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	22,15	-9,80	-21,27	16.907.041,82	1,64	222.234.037,22	7,61
BB	BB	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	23,25	-10,51	-7,64	12.247.893,45	1,19	142.509.532,51	8,59
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	23,33	-12,37	-17,84	7.773.546,08	0,75	900.555.238,47	0,86
BB	BB	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	20,13	-5,83	9,57	15.283.275,98	1,48	329.440.416,23	4,64
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			20,06	-9,25	-10,20	52.211.757,33	5,07		

Artigo 8º III (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	13,17	7,57	19,09	10.365.556,95	1,01	281.131.662,80	3,69
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13,18	7,64	19,54	48.711.906,71	4,73	3.490.527.601,78	1,40
Sub-total Artigo 8º III			11,50	7,63	19,46	59.077.463,66	5,74		
Renda Variável			16,74	-1,01	3,26	111.289.220,99	10,81		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/10/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,65%

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	17,17	10,93	16,60	27.336.259,16	2,65	3.720.209.176,93	0,73
Sub-total Artigo 9º III			17,17	10,93	16,60	27.336.259,16	2,65		
Investimentos no Exterior			15,72	10,93	16,60	27.336.259,16	2,65		
Total			2,60	-0,80	-0,88	1.029.870.976,13	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	815.552.830,97	79,19	50,00	52,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	75.692.665,01	7,35	0,00	27,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	891.245.495,98	86,54					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	52.211.757,33	5,07	0,00	5,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	59.077.463,66	5,74	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável	111.289.220,99	10,81					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	27.336.259,16	2,65	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	27.336.259,16	2,65					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	-0,96 -200,75	-0,53 -17,56	-0,79 -58,87	-0,58 -25,11	1,59 47,97	-9.880.277,52	-6.376.342,91
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-2,30 -478,82	-8,50 -283,28	-3,29 -243,90	-3,76 -164,20	-6,62 -199,13	-1.631.520,57	-12.024.822,41
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-9,25 -2,51	-10,20 2,83	-16,19 -1,16	-15,17 -2,22	7,92 -2,24	-5.318.828,80	-5.933.340,76
Artigo 8º III % do CDI	7,63 1.588,37	19,46 737,51	6,04 448,17	12,26 534,72		4.188.273,01	8.077.463,66
Artigo 9º III % do CDI	10,93 2.274,98	16,60 630,87	13,35 989,52	13,59 592,90		2.693.201,10	3.336.259,16
CONSOLIDADO (Total)						-9.949.152,78	-12.920.783,26

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	54.900.735,89	0,00	-27.000.000,00	0,00	27.530.764,35	-369.971,54	-1.137.635,73
BB PREV RF IDKA2	21.500.400,83	17.000.000,00	0,00	0,00	37.935.270,46	-565.130,37	-64.888,82
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	30.322.555,30	10.000.000,00	0,00	0,00	39.762.489,09	-560.066,21	-237.510,91
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	192.926.789,59	0,00	0,00	0,00	190.047.914,48	-2.878.875,11	-1.179.845,83
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.647.707,25	0,00	0,00	0,00	27.960.597,10	-687.110,15	-2.879.612,78
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.497.209,82	30.000.000,00	0,00	0,00	50.722.790,94	-774.418,88	-277.209,06
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.209.998,59	20.000.000,00	0,00	0,00	40.631.835,78	-578.162,81	-368.164,22
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	201.076.168,18	184.657.180,81	-194.641.158,79	0,00	189.082.395,72	-2.009.794,48	3.783.145,51
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.329.328,46	0,00	0,00	0,00	2.267.816,79	-61.511,67	-136.662,10
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	211.006.192,56	0,00	0,00	0,00	209.610.956,26	-1.395.236,30	-3.877.958,97
					815.552.830,97	0,00	0,00

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

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/10/2021

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	50.017.253,42	0,00	0,00	0,00	48.276.476,83	-1.740.776,59	-4.502.942,07
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	77.306.932,16	0,00	-50.000.000,00	0,00	27.416.188,18	109.256,02	-522.039,62
					75.692.665,01	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	18.743.438,07	0,00	0,00	0,00	16.907.041,82	-1.836.396,25	-4.566.992,99
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	16.229.582,55	0,00	0,00	0,00	15.283.275,98	-946.306,57	1.334.993,86
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	13.686.782,01	0,00	0,00	0,00	12.247.893,45	-1.438.888,56	-1.013.660,14
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	8.870.783,50	0,00	0,00	0,00	7.773.546,08	-1.097.237,42	-1.687.681,49
					52.211.757,33	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	9.635.768,34	0,00	0,00	0,00	10.365.556,95	729.788,61	1.365.556,95
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	45.253.422,31	0,00	0,00	0,00	48.711.906,71	3.458.484,40	6.711.906,71
					59.077.463,66	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	24.643.058,06	0,00	0,00	0,00	27.336.259,16	2.693.201,10	3.336.259,16
					27.336.259,16	0,00	0,00

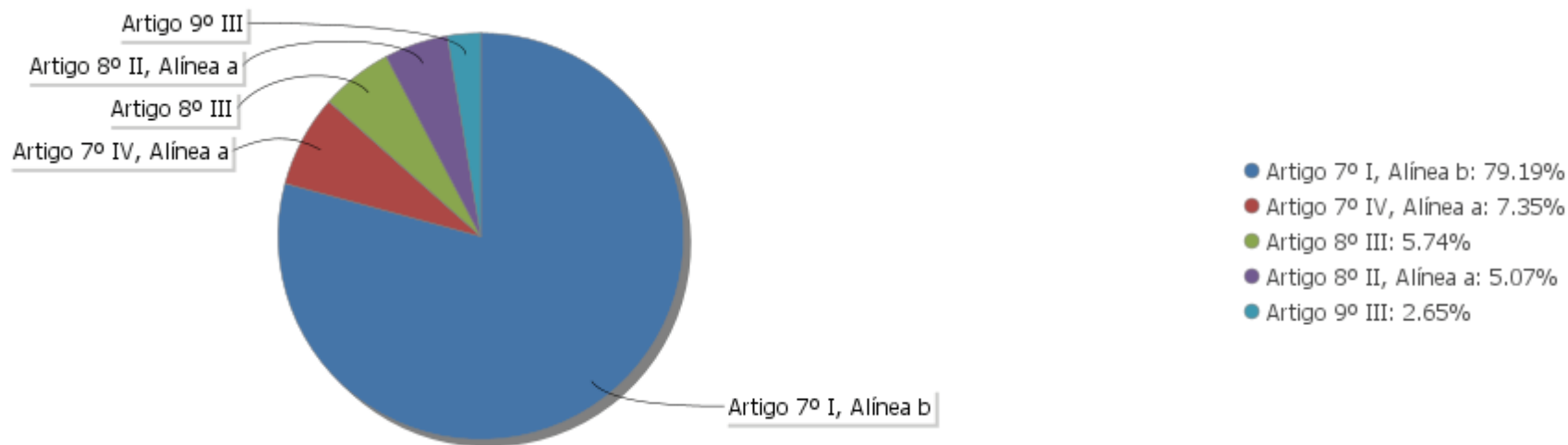
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

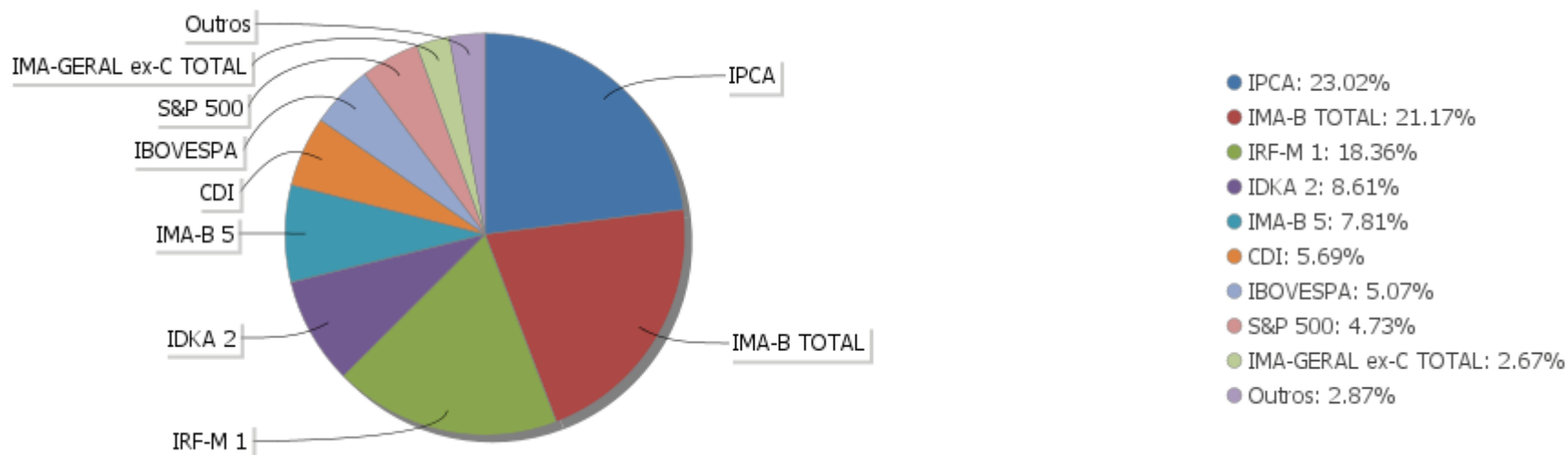
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	811.862.464,55	78,83	811.862.464,55	78,83
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	811.862.464,55	78,83
acima de 365 dias	218.008.511,58	21,17	1.029.870.976,13	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

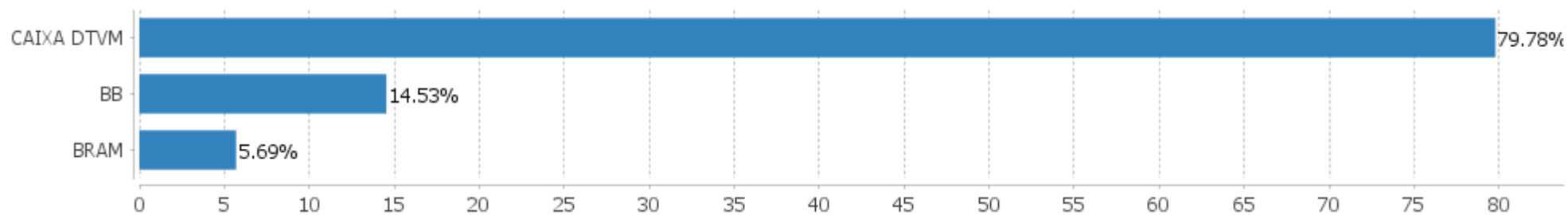


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/10/2021

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			-0,88
IPCA + 2,00%	0,41	1,00	1,11	0,47	1,00	0,70	1,13	1,04	1,33	1,41			10,02
p.p. indexador	-0,64	-1,56	-1,38	0,44	-0,53	-0,50	-1,30	-1,38	-1,41	-2,21			-10,89
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

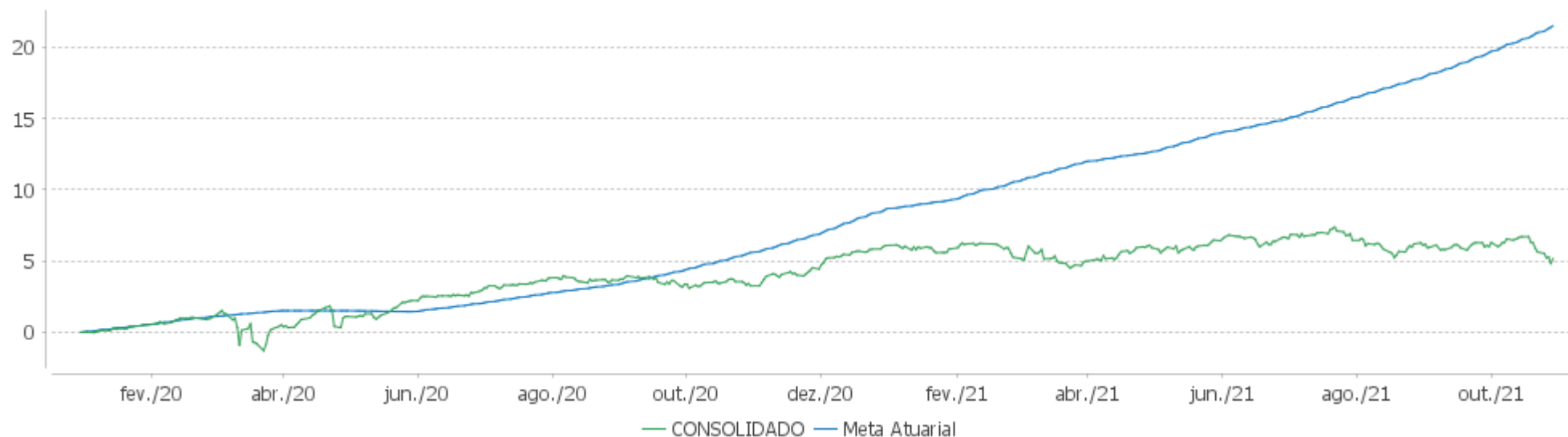
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	5	22,73
Meses abaixo - Meta Atuarial	17	77,27
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,59	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-0,80	2021-10

Relatório

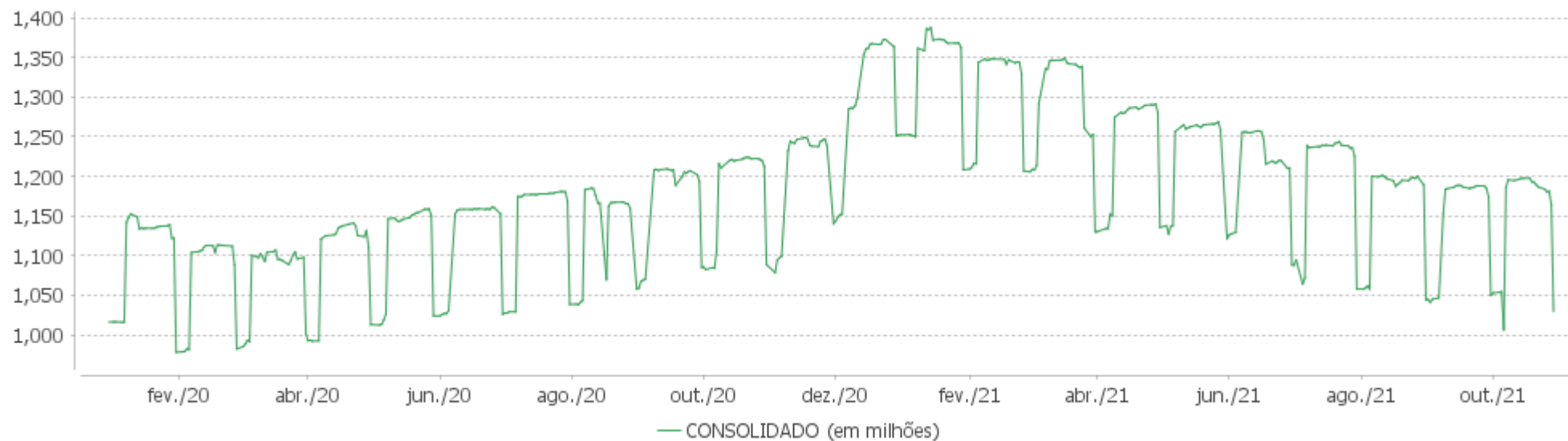
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	-1,21	3,83	-5,04	2,90
06 meses	-0,72	6,79	-7,52	2,70
12 meses	1,85	13,19	-11,34	2,60
24 meses				
Desde 31/12/2019	5,16	19,28	-14,12	3,04

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

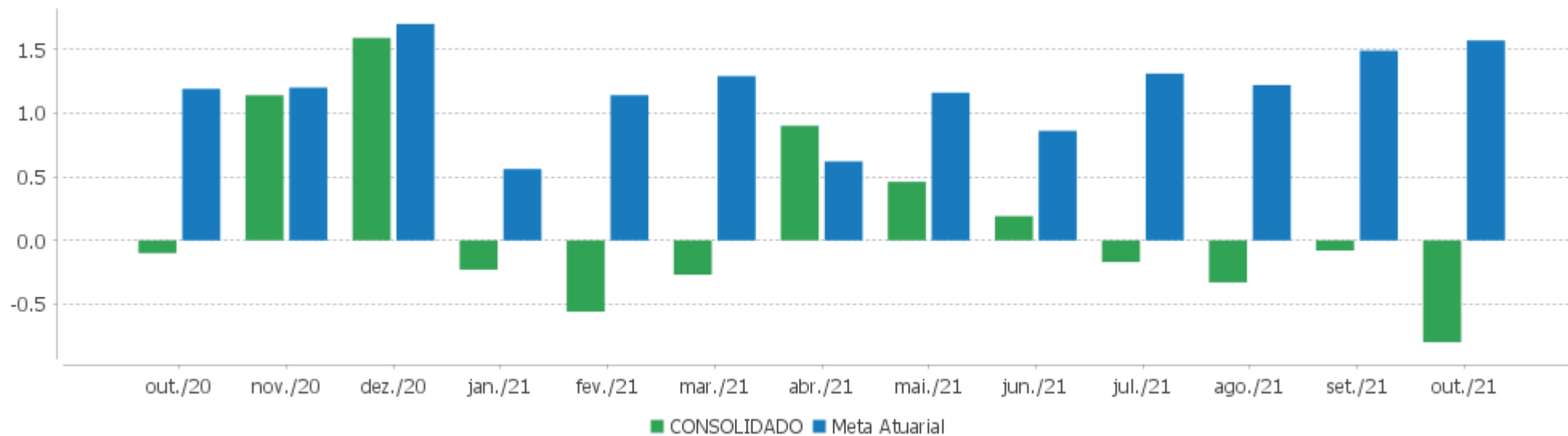


Patrimônio Líquido



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.	-1,24 -0,01	1,03 -0,19	-0,14 -0,05	0,39 -0,10	4,19 -0,24	9,79 -0,60	24,71 -0,90
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	-1,25 0,21	1,45 -0,11	-0,05 0,07	0,61 0,35	4,38 -0,24	10,97 -0,69	23,36 -1,76
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-1,63 -0,27	-2,98 -0,88	-2,07 -0,40	-1,74 -0,78	0,17 -0,50	1,97 -0,88	17,51 -0,37
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,66 -1,91	-1,82 -10,05	-1,75 -5,07	-2,29 -8,02	0,30 -10,38	4,82 -10,19	24,02 6,09
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,49 1,05	-0,60 4,19	-0,56 3,17	-0,54 2,13	3,50 1,67	8,64 7,83	29,47 1,70
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,40 0,15	-7,16 -2,37	-3,72 0,01	-2,83 -0,16	0,34 -1,49	-0,08 -0,89	22,19 -5,58
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	-1,29 0,17	1,46 -0,10	-0,03 0,09	0,46 0,21	4,40 -0,22	10,83 -0,83	23,45 -1,67
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	-1,27 -0,04	0,98 -0,24	-0,21 -0,11	0,31 -0,18	4,16 -0,27	9,80 -0,59	24,69 -0,92
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	-0,54 0,00	1,05 -0,18	0,18 -0,04	0,71 -0,12	1,55 -0,22	5,47 -0,44	12,78 -0,69
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-2,64 -0,01	-5,68 -0,19	-3,61 -0,09	-3,73 -0,14	-3,52 -0,21	0,50 -0,49	14,90 -0,93
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	-3,48 -724,48	-7,28 -242,53	-4,60 -341,13	-5,23 -228,03	-5,01 -150,65	0,50 7,56	14,93 112,43
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,06 -1,19	-0,75 -8,99	-0,86 -4,17	-1,16 -6,89	0,92 -9,75		
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	-12,37 -5,63	-17,84 -4,80	-22,19 -7,17	-20,54 -7,60	2,31 -7,85	-6,25 -2,78	29,49 11,10
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-5,83 0,91	9,57 22,61	-7,83 7,19	-7,38 5,57	33,05 22,89	45,51 48,98	61,20 42,81
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	-10,51 -3,77	-7,64 5,39	-17,76 -2,73	-16,25 -3,30	14,63 4,47	14,63 18,10	40,69 22,30
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. IBOVESPA p.p.	-9,80 -3,06	-21,27 -8,23	-18,83 -3,81	-18,09 -5,15	-10,26 -20,42	-12,04 -8,57	25,86 7,47
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	7,57	25,56	5,89	11,78	43,17	50,43	72,53

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/10/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Varição da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	1.576,57	852,14	436,98	514,05	1.299,05	757,90	546,24
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	7,64 -3,27	26,45 -6,69	6,08 -9,37	12,36 -2,67	44,33 6,63	49,77 -63,90	73,56 -84,22
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	10,93 -0,22	29,48 -2,81	13,35 -0,14	13,59 -1,66	33,54 -3,39	114,42 -4,34	160,27 -6,94
CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,00% p.p.	-0,80 -2,21	-0,88 -10,89	-1,21 -5,04	-0,72 -7,52	1,85 -11,02		
CDI	0,48	3,00	1,35	2,29	3,32	6,65	13,28
IBOVESPA	-6,74	-13,04	-15,02	-12,95	10,16	-3,47	18,39
INPC + 6,00%	1,63	13,79	4,79	9,12	17,69	30,64	42,02
IPCA + 6,00%	1,72	13,57	4,83	8,88	17,26	29,10	40,32

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 Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	-0,54	1,23	0,23	0,83	1,78	5,91	13,47	21,48	36,42
IRF-M 1+	-3,44	-9,10	-5,21	-5,61	-5,90	-1,54	16,13	28,17	50,67
IRF-M TOTAL	-2,63	-5,50	-3,53	-3,59	-3,30	0,99	15,83	26,75	47,22
IMA-B 5	-1,24	1,22	-0,10	0,49	4,43	10,39	25,61	37,29	55,80
IMA-B 5+	-3,87	-10,25	-7,19	-5,85	-1,01	-6,80	27,68	41,57	63,18
IMA-B TOTAL	-2,54	-4,79	-3,73	-2,67	1,83	0,81	27,76	40,92	61,47
IMA-GERAL TOTAL	-1,31	-1,68	-1,71	-0,86	1,05	3,75	19,11	29,71	47,78
IDKA 2	-1,47	1,56	-0,12	0,25	4,62	11,66	25,12	37,32	56,68
IDKA 20	-6,31	-17,52	-13,17	-11,45	-5,06	-17,66	27,75	43,34	67,23
CDI	0,48	3,00	1,35	2,29	3,32	6,65	13,28	20,70	34,10

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-6,74	-13,04	-15,02	-12,95	10,16	-3,47	18,39	39,29	59,42
IBRX 100	-6,81	-12,40	-16,15	-14,19	10,40	-1,79	22,56	43,44	64,83
IBRX 50	-6,27	-12,20	-16,31	-13,99	11,64	-2,23	17,51	38,33	58,04
SMALL CAP	-12,53	-17,37	-21,28	-20,14	3,62	-2,77	38,93	46,64	90,99
IFIX	-1,47	-6,78	-5,26	-6,48	-3,29	-4,17	19,32	20,19	41,88
Índice Consumo - ICON	-9,73	-20,10	-18,41	-17,11	-8,62	-10,39	29,95	16,52	35,92
Índice Dividendos - IDIV	-4,23	-8,71	-8,99	-7,55	13,78	1,74	41,65	49,00	84,75

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	1,25	8,24	3,32	5,73	10,67	15,01	17,92	23,30	26,63
INPC	1,16	8,45	3,27	5,96	11,08	16,38	19,35	24,13	26,41
IGPM	0,64	16,74	0,66	6,24	21,73	47,21	51,84	68,23	65,87
SELIC	0,48	3,00	1,35	2,29	3,32	6,65	13,28	20,71	34,13

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	10,92	33,14	15,45	15,03	37,70	113,67	157,78	207,96	284,24
MSCI ACWI	8,97	25,22	13,38	10,89	32,23	96,53	133,44	158,41	221,64

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,57	11,80	4,33	7,84	15,06	24,32	32,57	44,11	53,90
IPCA + 5,00%	1,64	12,68	4,58	8,36	16,16	26,70	36,41	49,70	61,40
IPCA + 5,50%	1,68	13,13	4,71	8,62	16,71	27,90	38,35	52,55	65,25
IPCA + 5,89%	1,71	13,47	4,80	8,82	17,14	28,84	39,89	54,81	68,31
IPCA + 6,00%	1,72	13,57	4,83	8,88	17,26	29,10	40,32	55,45	69,18
INPC + 4,00%	1,48	12,02	4,29	8,08	15,49	25,80	34,17	45,08	53,62
INPC + 6,00%	1,63	13,79	4,79	9,12	17,69	30,64	42,02	56,50	68,89

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1095	01/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	308.451,78	0,00	116.145,97896900	2,6557250000
1109	04/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.161.692,86	0,00	1.190.605,75033300	2,6555330000
1094	04/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.477,06	0,00	556,21978700	2,6555330000
1121	04/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	515.173,17	0,00	193.999,91263500	2,6555330000
1093	05/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.902,53	0,00	7.493,73561900	2,6558890000
1092	06/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.076,47	0,00	781,11587000	2,6583380000
1110	06/10/2021	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,00	50.000.000,00	48.563,94109100	1.029,5704770000
1078	07/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.033.634,98	0,00	10.547.854,81893100	2,6577570000
1107	07/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	34.822.729,29	13.102.299,90383800	2,6577570000
1108	07/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	117.457.791,13	0,00	44.194.330,45609500	2,6577570000
1111	07/10/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	30.000.000,00	0,00	12.130.166,38949200	2,4731730000
1112	07/10/2021	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	20.000.000,00	0,00	6.034.977,52272600	3,3140140000
1120	07/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	22.599.854,77	0,00	8.503.356,31511800	2,6577570000
1119	07/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.845.968,51	1.447.073,04262100	2,6577570000
1106	08/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.603.363,92	0,00	1.730.439,61645300	2,6602280000
1118	08/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.135.256,38	0,00	802.659,16304900	2,6602280000
1105	11/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	101.355,93	0,00	38.096,51479500	2,6605040000
1122	11/10/2021	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	0,00	27.000.000,00	17.862.438,12494400	1,5115517720
1123	11/10/2021	BB PREV RF IDKA2	17.000.000,00	0,00	5.695.010,53095700	2,9850691070
1124	11/10/2021	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	10.000.000,00	0,00	471.334,99459300	21,2163325760
1117	11/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	69.640,35	0,00	26.175,62311500	2,6605040000
1104	14/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	21.544,46	8.096,99192800	2,6607980000
1090	14/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.880,57	0,00	2.210,07757800	2,6607980000
1091	14/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.701,91	0,00	6.652,85752600	2,6607980000
1089	15/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.454,26	0,00	3.177,60515000	2,6605760000
1103	18/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	227.325,22	85.441,17582600	2,6606050000
1088	18/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	27.349,79	0,00	10.279,53792400	2,6606050000
1116	18/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	227.325,22	0,00	85.441,17597300	2,6606050000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/10/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1087	19/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.225,33	0,00	7.614,91844500	2,6560140000
1086	20/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	92.300,91	0,00	34.740,97900800	2,6568310000
1085	21/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	713.669,85	0,00	269.164,73940000	2,6514240000
1101	21/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	52.263,64	19.711,53612900	2,6514240000
1084	21/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	702.228,06	264.849,40043200	2,6514240000
1102	21/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	755.067,73	0,00	284.778,19088900	2,6514240000
1100	22/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	166.796,00	0,00	62.990,92463300	2,6479370000
1083	22/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.820,58	0,00	5.974,68142100	2,6479370000
1115	25/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.629.945,18	616.163,21503100	2,6453140000
1082	26/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.658,65	0,00	2.520,11104300	2,6422050000
1081	27/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	133.518,35	0,00	50.509,48937100	2,6434310000
1099	28/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.596.689,44	0,00	605.326,86615800	2,6377310000
1098	28/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.521.727,63	5.126.272,39989200	2,6377310000
1079	29/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	27.383.612,05	10.370.961,82367900	2,6404120000
1096	29/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	80.898.685,64	30.638.660,03893700	2,6404120000
1097	29/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.302.502,22	0,00	493.295,06910200	2,6404120000
1080	29/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.108,93	0,00	3.449,81389200	2,6404120000
1113	29/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	31.535.129,11	11.943.260,78921300	2,6404120000
1114	29/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	548.439,74	0,00	207.709,91042300	2,6404120000
Total			261.657.180,81	271.641.158,79		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/10/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 15.917.905,83

Value-At-Risk: 1,55%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		1,55	1,55			1.029.870.976,13	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,28%

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		0,56	0,07	0,02			189.082.395,72	18,36
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,44	0,05	0,01			40.631.835,78	3,95
BB PREV RF IDKA2		1,51	0,04	0,56			37.935.270,46	3,68
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,56	0,06	0,55			50.722.790,94	4,93
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,74	0,00	0,03			2.267.816,79	0,22
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,44	0,05	0,04			39.762.489,09	3,86
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,71	0,26	1,45			190.047.914,48	18,45
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		3,26	0,07	0,87			27.960.597,10	2,71
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,64	0,04	0,30			27.530.764,35	2,67
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,42	0,22	1,42			209.610.956,26	20,35
Sub-total	2,97	1,26	0,86		-0,49	-0,96	815.552.830,97	79,19

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		2,15	0,08	2,15			48.276.476,83	4,69
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		1,18	0,02	1,18			27.416.188,18	2,66
Sub-total	5,14	1,65	0,10		-0,54	-2,30	75.692.665,01	7,35

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,38%

Artigo 8º II, Alínea a

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/10/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		12,34	0,14	6,31			16.907.041,82	1,64
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI		11,83	0,10	4,26			12.247.893,45	1,19
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		14,94	0,08	7,06			7.773.546,08	0,75
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI		10,68	0,10	5,08			15.283.275,98	1,48
Sub-total	26,20	11,32	0,43		-0,37	-9,25	52.211.757,33	5,07

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS		6,51	0,03	6,51			10.365.556,95	1,01
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		6,50	0,15	7,07			48.711.906,71	4,73
Sub-total	12,26	6,50	0,18		0,58	7,63	59.077.463,66	5,74

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,69%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		6,69	-0,02	1,19			27.336.259,16	2,65
Sub-total	16,60	6,69	-0,02		0,63	10,93	27.336.259,16	2,65

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

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

- O Instituto está com 20,35% do Patrimônio Líquido alocado no fundo FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF, percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;
- O Instituto está com 15,51% 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;