

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

CONSOLIDADO

Período: 4º trimestre de 2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

85,70%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,64	0,04	0,85	1,09	307.663.539,74	26,23	6.465.382.741,43	4,76
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,78	0,05	0,77	1,97	41.954.066,32	3,58	12.444.051.491,75	0,34
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,61	0,05	0,71	1,86	39.131.194,31	3,34	9.277.694.744,55	0,42
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,76	0,05	0,72	1,82	103.677.074,54	8,84	10.998.710.156,34	0,94
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,52	0,04	1,87	0,97	2.351.955,57	0,20	1.233.687.856,77	0,19
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,80	0,04	0,76	1,94	41.056.471,03	3,50	6.458.635.592,00	0,64
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,83	0,05	0,85	2,04	196.854.415,83	16,78	1.446.702.120,00	13,61
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	6,96	0,05	0,68	2,15	29.263.371,41	2,50	221.307.831,59	13,22
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,84	0,04	0,91	0,99	28.264.163,00	2,41	7.701.081.218,58	0,37
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,33	0,04	0,83	1,07	61.011.149,82	5,20	12.561.638.596,69	0,49
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,04	0,04	0,84	1,70	851.227.401,57	72,58		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,20	0,04	0,75	1,24	75.927.908,66	6,47	8.765.736.063,59	0,87
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF IDKA PRE 2	4,12	0,04	2,17	0,42	50.227.412,15	4,28	300.397.636,27	16,72
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	2,07	0,03	0,74	1,52	27.817.153,95	2,37	981.226.315,84	2,83
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			2,90	0,04	1,21	-0,03	153.972.474,76	13,13		
Renda Fixa			2,11	0,04	0,90	1,55	1.005.199.876,33	85,70		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/12/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

11,95%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	23,51	-0,01	-0,04	-16,67	15.618.535,43	1,33	199.779.357,69	7,82
BB	BB	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	23,20	-0,01	6,23	-3,91	13.152.206,85	1,12	143.273.332,67	9,18
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	24,78	-0,01	4,24	-11,61	7.840.607,73	0,67	889.447.105,88	0,88
BB	BB	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	20,36	-0,01	8,15	-3,51	15.660.416,40	1,34	315.599.761,94	4,96
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			20,77	-0,01	4,53	-9,14	52.271.766,41	4,46		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BRAM	BRDESCO	BRDESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	13,35	0,03	5,39	12,73	10.862.245,89	0,93	288.809.264,54	3,76
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13,38	0,03	5,56	13,07	76.983.951,25	6,56	3.768.911.648,33	2,04
Sub-total Artigo 8º III			12,50	0,03	5,54	13,03	87.846.197,14	7,49		
Renda Variável			16,49	0,02	5,16	2,25	140.117.963,55	11,95		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/12/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,35%

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17,57	-0,00	1,70	11,81	27.553.701,93	2,35	3.890.658.229,39	0,71
Sub-total Artigo 9º III			17,57	-0,00	1,70	11,81	27.553.701,93	2,35		
Investimentos no Exterior			16,44	-0,00	1,70	11,81	27.553.701,93	2,35		
Total			2,67	0,04	1,45	1,87	1.172.871.541,81	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	851.227.401,57	72,58	50,00	52,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	153.972.474,76	13,13	0,00	27,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	1.005.199.876,33	85,70					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	52.271.766,41	4,46	0,00	5,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	87.846.197,14	7,49	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável	140.117.963,55	11,95					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	27.553.701,93	2,35	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	27.553.701,93	2,35					10,00
Total		1.172.871.541,81	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,84 110,43	1,70 92,04	1,70 92,04	1,68 54,41	2,14 48,79	6.823.446,54	11.884.597,33
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	1,21 158,30	-0,03 -1,50	-0,03 -1,50	-1,67 -53,95	-2,42 -55,03	1.838.860,22	1.648.289,18
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	4,53 1,68	-9,14 -3,59	-9,14 -3,59	-19,16 -1,83	-10,10 1,83	2.264.312,60	-5.258.819,72
Artigo 8º III % do CDI	5,54 725,63	13,03 707,24	13,03 707,24	14,27 462,12		4.611.705,14	7.957.006,49
Artigo 9º III % do CDI	1,70 222,99	11,81 641,32	11,81 641,32	20,44 662,12		461.299,63	2.910.643,87
CONSOLIDADO (Total)						15.999.624,13	19.141.717,15

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	28.008.140,47	0,00	0,00	0,00	28.264.163,00	256.022,53	363.427,11
BB PREV RF IDKA2	38.856.786,90	0,00	0,00	0,00	39.131.194,31	274.407,41	630.793,48
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	40.745.898,90	0,00	0,00	0,00	41.056.471,03	310.572,13	733.915,73
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	195.194.061,98	0,00	0,00	0,00	196.854.415,83	1.660.353,85	3.927.626,24
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.065.999,09	0,00	0,00	0,00	29.263.371,41	197.372,32	615.664,16
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	102.936.230,90	0,00	0,00	0,00	103.677.074,54	740.843,64	2.179.864,72
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	41.634.548,14	0,00	0,00	0,00	41.954.066,32	319.518,18	744.067,73
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	162.958.054,55	582.974.136,49	-440.790.170,81	0,00	307.663.539,74	2.521.519,51	2.661.653,79
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.308.753,45	0,00	0,00	0,00	2.351.955,57	43.202,12	22.627,11
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	60.511.514,97	0,00	0,00	0,00	61.011.149,82	499.634,85	4.957,26
					851.227.401,57	0,00	0,00

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

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/12/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	49.162.516,84	0,00	0,00	0,00	50.227.412,15	1.064.895,31	210.158,73
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	75.359.329,47	0,00	0,00	0,00	75.927.908,66	568.579,19	927.908,66
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	27.611.768,23	0,00	0,00	0,00	27.817.153,95	205.385,72	510.221,79
					153.972.474,76	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB AÇÕES CONSUMO FIC	15.624.715,16	0,00	0,00	0,00	15.618.535,43	-6.179,73	-3.124.902,64
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	14.480.336,59	0,00	0,00	0,00	15.660.416,40	1.180.079,81	-569.166,15
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	12.381.043,74	0,00	0,00	0,00	13.152.206,85	771.163,11	-534.575,16
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	7.521.358,32	0,00	0,00	0,00	7.840.607,73	319.249,41	-1.030.175,77
					52.271.766,41	0,00	0,00

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	10.306.442,29	0,00	0,00	0,00	10.862.245,89	555.803,60	1.226.477,55
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	72.928.049,71	0,00	0,00	0,00	76.983.951,25	4.055.901,54	6.730.528,94
					87.846.197,14	0,00	0,00

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	27.092.402,30	0,00	0,00	0,00	27.553.701,93	461.299,63	2.910.643,87
					27.553.701,93	0,00	0,00

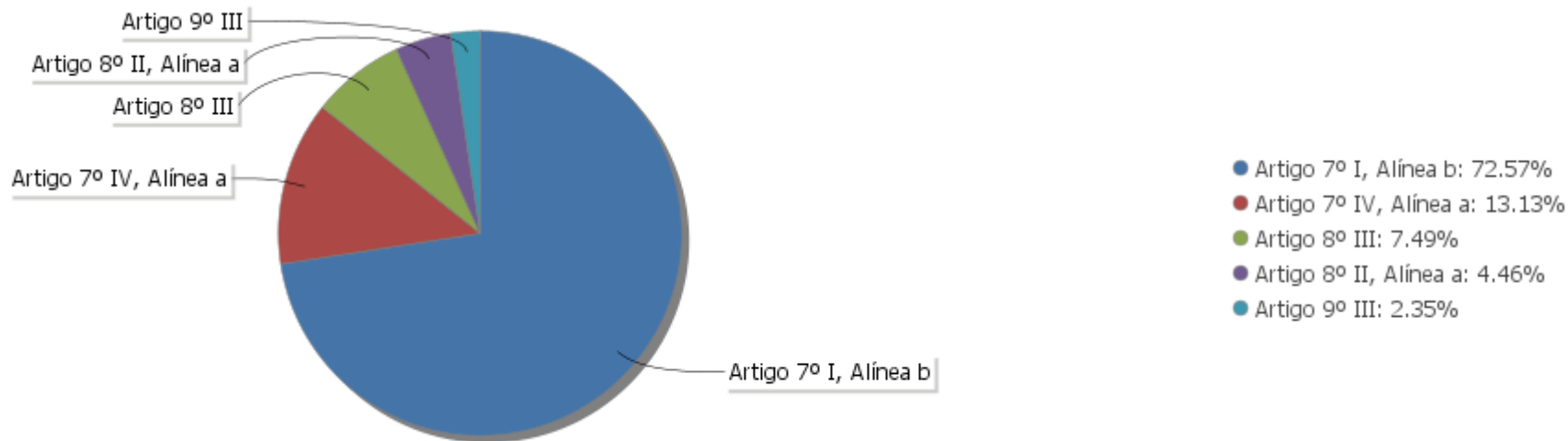
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

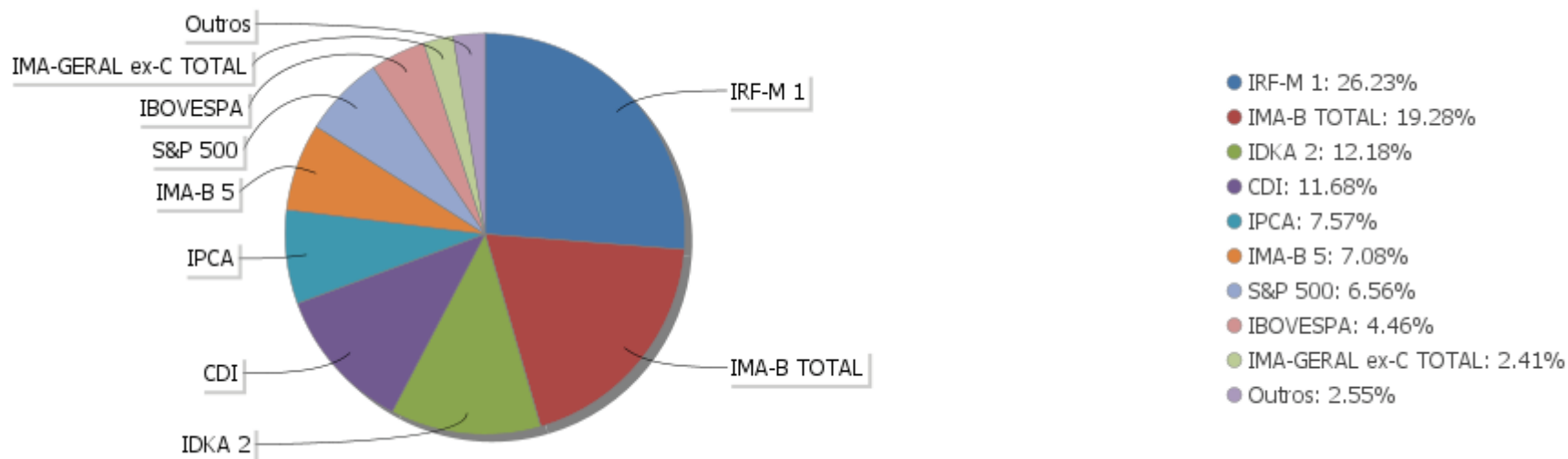
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	946.753.754,57	80,72	946.753.754,57	80,72	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	946.753.754,57	80,72	
acima de 365 dias	226.117.787,24	19,28	1.172.871.541,81	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

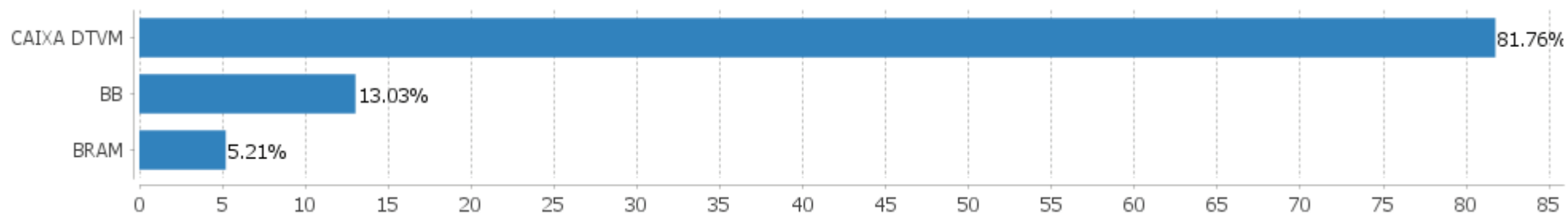


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2021	-0,23	-0,56	0,26	0,90	0,46	0,19	-0,17	-0,33	-0,08	-0,80	1,22	1,45	2,32
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	-0,86	0,44	-0,53	-0,50	-1,30	-1,38	-1,41	-2,21	0,11	0,54	-9,93
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	7	29,17
Meses abaixo - Meta Atuarial	17	70,83

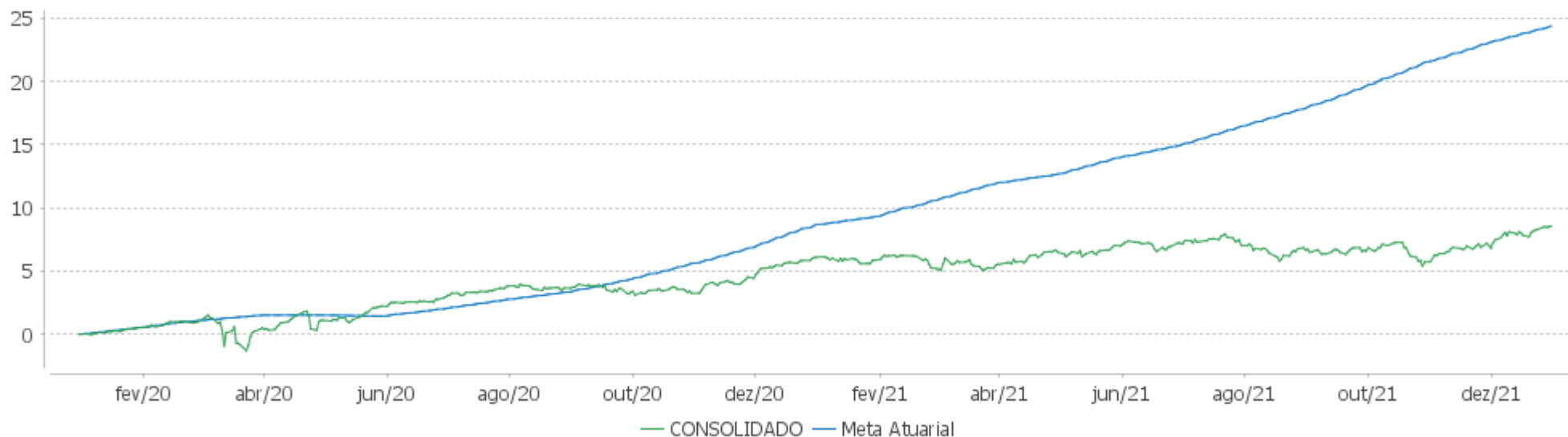
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,59	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-0,80	2021-10

Relatório

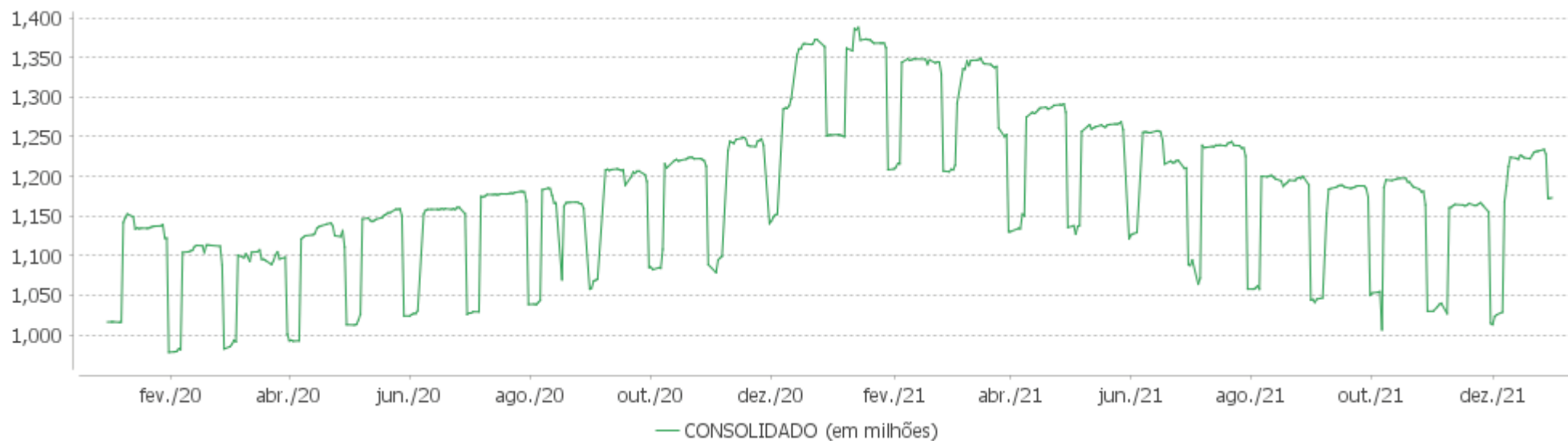
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,87	3,47	-1,60	3,09
06 meses	1,28	7,14	-5,86	2,86
12 meses	2,32	12,25	-9,93	2,67
24 meses	8,55	21,71	-13,15	2,99
Desde 31/12/2019	8,55	21,71	-13,15	2,99

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

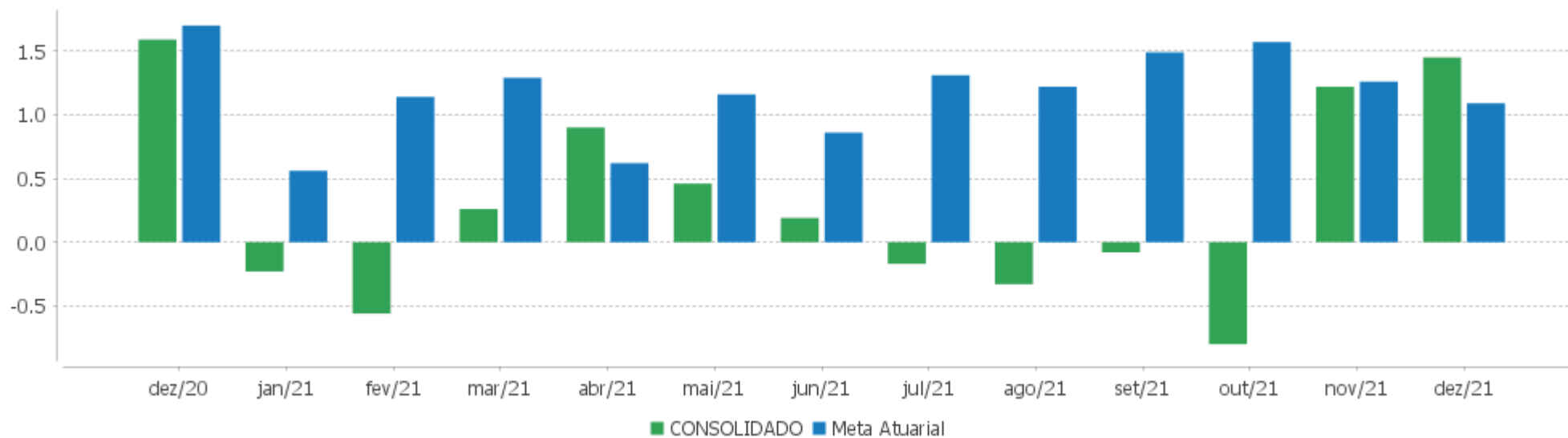


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,77 -0,02	1,97 -0,06	1,97 -0,06	3,12 -0,12	4,31 -0,25	12,39 -0,58	26,84 -0,99
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,71 -0,12	1,86 0,02	1,86 0,02	3,18 0,13	4,65 -0,33	12,93 -1,09	25,58 -1,92
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,91	0,99	0,99	0,28	-0,40	4,67	18,35
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,83 0,10	1,07 -1,89	1,07 -1,89	-0,82 -6,89	-0,11 -10,17	6,55 -8,48	24,06 4,07
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,85 0,63	2,04 0,98	2,04 0,98	2,81 3,35	2,96 4,22	11,98 6,92	31,57 2,40
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,76 -0,02	1,94 -0,09	1,94 -0,09	3,06 -0,17	4,27 -0,30	12,38 -0,59	26,87 -0,97
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,68 0,45	2,15 1,09	2,15 1,09	0,18 0,73	-2,83 -1,57	6,23 1,17	24,93 -4,24
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,72 -0,11	1,82 -0,02	1,82 -0,02	3,05 0,00	4,66 -0,31	13,07 -0,95	25,72 -1,78
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,85 -0,03	1,09 -0,04	1,09 -0,04	1,99 -0,11	2,70 -0,23	6,43 -0,45	13,40 -0,70
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,87 -0,01	0,97 -0,01	0,97 -0,01	-0,51 -0,08	-2,18 -0,19	4,11 -0,46	16,27 -0,88
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	2,17 283,68	0,42 22,81	0,42 22,81	-1,39 -44,87	-3,53 -80,27	4,42 60,73	16,54 120,86
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,75 98,81	1,89 102,69	1,89 102,69	3,40 110,10	4,60 104,55	7,12 97,76	13,24 96,76
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,74 0,01	1,52 -1,44	1,52 -1,44	-0,02 -6,09	0,70 -9,36		
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS % do CDI	5,39 706,27	12,73 691,12	12,73 691,12	13,77 445,93	31,58 718,48	48,27 662,63	93,66 684,30
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	5,56 1,93	13,07 -0,45	13,07 -0,45	14,36 -9,37	32,83 -3,44	47,69 -56,56	94,62 -79,20
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	4,24 1,39	-11,61 -6,07	-11,61 -6,07	-25,64 -8,31	-17,13 -5,20	-19,81 -10,45	24,10 4,83
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	8,15	-3,51	-3,51	-7,99	12,27	24,93	72,47

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/12/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	5,30	2,04	2,04	9,35	24,20	34,29	53,20
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	6,23	-3,91	-3,91	-12,49	-0,82	4,47	46,98
Var. IBOVESPA p.p.	3,38	1,64	1,64	4,84	11,10	13,83	27,71
BB AÇÕES CONSUMO FIC	-0,04	-16,67	-16,67	-29,23	-27,27	-26,63	12,45
Var. IBOVESPA p.p.	-2,89	-11,12	-11,12	-11,90	-15,34	-17,27	-6,81
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	1,70	11,81	11,81	20,44	30,51	101,98	171,58
Var. Global BDRX p.p.	-0,01	-0,48	-0,48	-0,99	-3,14	-3,86	-7,67
CONSOLIDADO	1,45	1,87	1,87	1,28	2,32	8,55	
Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,54	-1,60	-1,60	-5,86	-9,93	-11,11	
CDI	0,76	1,84	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69
IBOVESPA	2,85	-5,55	-5,55	-17,33	-11,93	-9,36	19,27
INPC + 6,00%	1,27	4,26	4,26	9,16	16,74	30,46	44,52
IPCA + 6,00%	1,27	4,47	4,47	9,25	16,64	29,19	42,87

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 Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,88	1,13	1,13	2,10	2,93	6,88	14,10	22,06	35,63
IRF-M 1+	2,29	0,93	0,93	-1,74	-4,99	3,04	17,72	32,16	54,19
IRF-M TOTAL	1,89	0,98	0,98	-0,42	-1,99	4,57	17,15	29,72	49,44
IMA-B 5	0,79	2,03	2,03	3,24	4,57	12,97	27,83	40,44	58,11
IMA-B 5+	-0,34	0,09	0,09	-4,11	-6,55	-1,41	28,53	48,33	67,24
IMA-B TOTAL	0,22	1,06	1,06	-0,55	-1,26	5,06	29,17	46,04	64,72
IMA-GERAL TOTAL	0,87	1,34	1,34	0,82	0,96	6,35	19,98	32,02	48,95
IDKA 2	0,83	1,84	1,84	3,05	4,97	14,02	27,50	39,94	58,99
IDKA 20	-2,28	-2,87	-2,87	-11,27	-14,50	-12,61	26,07	51,79	70,27
CDI	0,76	1,84	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69	20,99	33,03

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	2,85	-5,55	-5,55	-17,33	-11,93	-9,36	19,27	37,20	74,05
IBRX 100	3,14	-5,51	-5,51	-18,37	-11,17	-8,07	22,63	41,54	80,53
IBRX 50	3,76	-4,49	-4,49	-18,01	-10,54	-7,30	19,73	37,12	73,89
SMALL CAP	3,80	-11,28	-11,28	-24,79	-16,20	-16,75	31,71	42,41	112,70
Índice Consumo - ICON									
Índice Dividendos - IDIV	1,60	-1,83	-1,83	-8,30	-6,41	-7,35	34,49	55,95	95,40

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	3,63	13,52	13,52	23,73	36,26	104,25	173,82	200,73	264,52

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	8,78	3,28	3,28	1,81	-2,28	-12,28	19,27	25,98	50,42

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	3,17	9,15	9,15	16,96	25,42	84,89	138,58	148,21	206,39

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,73	2,96	2,96	6,07	10,06	15,03	19,99	24,48	28,15
INPC	0,73	2,75	2,75	5,97	10,16	16,16	21,37	25,53	28,13
IGPM	0,87	1,54	1,54	2,35	17,78	45,04	55,63	67,36	66,49
SELIC	0,76	1,84	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69	21,00	33,06

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,09	3,97	3,97	8,20	14,45	24,38	34,95	45,56	55,77
IPCA + 5,00%	1,18	4,22	4,22	8,73	15,54	26,77	38,87	51,22	63,36
IPCA + 5,50%	1,22	4,35	4,35	8,99	16,09	27,98	40,86	54,11	67,27
IPCA + 5,89%	1,26	4,44	4,44	9,20	16,52	28,92	42,43	56,40	70,37
IPCA + 6,00%	1,27	4,47	4,47	9,25	16,64	29,19	42,87	57,04	71,26
INPC + 4,00%	1,09	3,77	3,77	8,10	14,55	25,60	36,50	46,79	55,74
INPC + 6,00%	1,27	4,26	4,26	9,16	16,74	30,46	44,52	58,37	71,23

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: 31/12/2021

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
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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
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
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

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/12/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
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
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
1214	01/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	33.545,88	0,00	12.599,24485300	2,6625310000
1213	02/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	91.710,51	0,00	34.419,83331000	2,6644670000
1253	02/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.073.872,02	0,00	2.279.582,37801400	2,6644670000
1212	03/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	145.057,14	0,00	54.395,38038800	2,6667180000
1238	03/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	84.707,20	0,00	31.764,58853100	2,6667180000
1211	06/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	282.761,04	0,00	106.030,48609000	2,6667900000
1237	06/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.308.802,29	0,00	490.778,16026000	2,6667900000
1252	06/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.095,26	0,00	3.035,58210400	2,6667900000
1193	07/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	35.929.089,15	0,00	13.469.376,03679800	2,6674650000
1192	07/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.412.772,80	2.778.957,84997600	2,6674650000
1209	07/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.731.464,23	1.023.992,52987100	2,6674650000
1235	07/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	33.589.607,07	12.592.332,82251200	2,6674650000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1210	07/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.029.842,91	0,00	1.135.851,04584300	2,6674650000
1236	07/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	127.554.365,59	0,00	47.818.571,41143300	2,6674650000
1251	07/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	22.114.455,65	0,00	8.290.438,91859800	2,6674650000
1250	07/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.540.756,57	2.826.937,39763500	2,6674650000
1208	08/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	62.006,75	0,00	23.229,96624100	2,6692570000
1234	08/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	27.352.625,88	0,00	10.247.280,75265800	2,6692570000
1207	08/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	51.287,45	19.214,12982100	2,6692570000
1233	08/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.551.840,58	4.327.736,35906500	2,6692570000
1249	08/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.075.032,87	0,00	777.382,19661800	2,6692570000
1190	09/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	23.900.269,98	8.955.510,71532400	2,6687780000
1191	09/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	38.475.287,89	0,00	14.416.818,44274700	2,6687780000
1231	09/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	74.272.865,89	27.830.290,07459400	2,6687780000
1206	09/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	100.927,05	0,00	37.817,70158400	2,6687780000
1232	09/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	85.688.627,16	0,00	32.107.813,82340500	2,6687780000
1248	09/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.559.663,38	0,00	7.703.774,30419400	2,6687780000
1247	09/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	19.721.000,00	7.389.524,34357600	2,6687780000
1230	10/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.390.151,84	0,00	2.392.464,94036300	2,6709490000
1205	10/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.816,56	0,00	4.424,10543900	2,6709490000
1229	10/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	112,91	42,27189700	2,6709490000
1246	10/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.889.498,40	0,00	707.425,86249300	2,6709490000
1204	13/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	27.970,39	0,00	10.468,39520600	2,6718890000
1228	14/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	14.249,09	5.331,26981800	2,6727380000
1203	14/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.283,70	0,00	854,44214800	2,6727380000
1227	15/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.171.162,66	0,00	812.196,11701300	2,6732000000
1202	15/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.095,59	0,00	7.143,34505400	2,6732000000
1245	15/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	343.391,84	0,00	128.457,21981100	2,6732000000
1189	16/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	48.375,19	18.093,23304600	2,6736620000
1201	16/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	40.267,16	0,00	15.060,67707800	2,6736620000
1226	16/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.129,83	1.544,63345600	2,6736620000
1200	17/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.494,44	0,00	1.306,72350600	2,6742000000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/12/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1199	20/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	50.061,71	0,00	18.706,95137900	2,6761020000
1225	20/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.305,33	0,00	1.982,48422500	2,6761020000
1188	21/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.269,71	0,00	1.968,11111000	2,6775470000
1198	21/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.042,16	0,00	4.870,93597200	2,6775470000
1224	21/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	350.683,87	0,00	130.972,06883700	2,6775470000
1187	22/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	316.282,79	118.078,88266100	2,6785720000
1197	22/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.291,85	0,00	5.708,95611500	2,6785720000
1222	22/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	316.282,79	118.078,88238600	2,6785720000
1223	22/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.166.698,09	0,00	1.182.233,70139000	2,6785720000
1243	22/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	316.282,79	118.078,88285600	2,6785720000
1244	22/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	515.424,84	0,00	192.425,23254900	2,6785720000
1186	23/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.269,71	1.967,23432100	2,6787400000
1221	23/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	22.500,30	0,00	8.399,58338600	2,6787400000
1196	24/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.992,45	0,00	4.102,11198600	2,6797050000
1219	28/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	30.503.386,53	11.377.055,11105300	2,6811320000
1195	28/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.506.280,93	1.680.738,18533500	2,6811320000
1220	28/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.302.228,94	0,00	9.810.120,85193800	2,6811320000
1242	28/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.242.524,19	0,00	836.409,46809000	2,6811320000
1185	29/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.197.213,92	0,00	7.531.940,17472000	2,6815420000
1184	29/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	49.424.458,59	18.431.357,25223400	2,6815420000
1194	29/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.439,44	0,00	1.282,63514000	2,6815420000
1217	29/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	135.852.741,57	50.662.171,83154500	2,6815420000
1218	29/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	121.324.080,56	0,00	45.244.147,04673600	2,6815420000
1240	29/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	38.627.450,61	14.404.939,62855200	2,6815419992
1241	29/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.770.562,83	0,00	9.983.271,87491300	2,6815420000
1215	30/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	83.002,91	30.941,03285500	2,6826160000
1216	30/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.554,44	0,00	1.324,99023300	2,6826160000
1239	30/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	105.653,66	0,00	39.384,56342600	2,6826160000
Total			1.193.714.081,43	1.089.788.363,66		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/12/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 16.825.694,57

Value-At-Risk: 1,43%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		1,43	1,43			1.172.871.541,81	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,08%

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		0,62	0,10	0,02			307.663.539,74	26,23
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,20	0,03	0,02			41.954.066,32	3,58
BB PREV RF IDKA2		1,37	0,03	0,38			39.131.194,31	3,34
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,62	0,10	0,26			103.677.074,54	8,84
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,78	0,00	0,02			2.351.955,57	0,20
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,20	0,03	0,04			41.056.471,03	3,50
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,72	0,22	1,65			196.854.415,83	16,78
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		3,24	0,06	0,75			29.263.371,41	2,50
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,19	0,02	1,85			28.264.163,00	2,41
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,06	0,03	1,07			61.011.149,82	5,20
Sub-total	1,61	1,14	0,64		0,05	0,84	851.227.401,57	72,58

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		0,06	0,00	0,06			75.927.908,66	6,47
BRANCO FI RF IDKA PRE 2		2,23	0,07	2,22			50.227.412,15	4,28
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		0,54	0,01	0,54			27.817.153,95	2,37
Sub-total	1,42	0,80	0,07		0,31	1,21	153.972.474,76	13,13

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,35%

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/12/2021

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		14,32	0,13	8,27			15.618.535,43	1,33
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI		14,07	0,11	5,45			13.152.206,85	1,12
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		15,53	0,08	7,85			7.840.607,73	0,67
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI		10,91	0,09	4,94			15.660.416,40	1,34
Sub-total	19,46	12,51	0,42		0,19	4,53	52.271.766,41	4,46

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS		6,48	0,04	6,48			10.862.245,89	0,93
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		6,48	0,26	5,81			76.983.951,25	6,56
Sub-total	16,67	6,48	0,30		0,29	5,54	87.846.197,14	7,49

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 8,18%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		8,18	0,01	0,67			27.553.701,93	2,35
Sub-total	18,91	8,18	0,01		0,05	1,70	27.553.701,93	2,35

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

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

- O Instituto está com 26,23% do Patrimônio Líquido alocado no fundo FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF, percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;
- O Instituto está com 16,72% 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;