

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

em dezembro, 4º trimestre e ano de 2021

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2021)

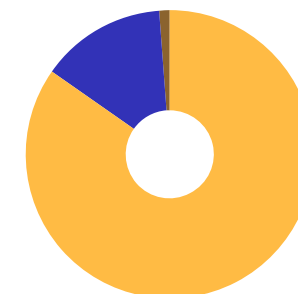
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	27.130.292,75	2,05%	553	0,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	89.489.256,14	6,77%	1.035	0,96%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	18.582.618,49	1,40%	788	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	22.075.023,69	1,67%	636	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	6.192.267,41	0,47%	1.127	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	1.673.801,93	0,13%	51	0,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	430.196,51	0,03%	165	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	16/08/2024	15.477.880,00	1,17%	17	7,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2030	13.117.976,00	0,99%	34	5,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	213.634.949,08	16,15%	945	1,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	201.533.273,82	15,24%	1.060	1,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	129.139.657,80	9,76%	1.023	1,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	54.800.883,36	4,14%	840	1,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	36.598.556,28	2,77%	1.241	0,57%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	109.997.897,52	8,32%	590	2,44%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.901.372,80	0,37%	803	0,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	47.630.864,75	3,60%	854	0,66%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	13.085.917,08	0,99%	141	1,33%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	7.074.252,19	0,53%	305	0,81%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	69.169.555,56	5,23%	865	0,79%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	39.333.634,78	2,97%	531	0,29%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	34.908.642,29	2,64%	2.203	3,51%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	58.886.885,83	4,45%	111	5,35%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	11.332.724,11	0,86%	838	2,59%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	8.928.556,47	0,68%	27.197	0,63%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	9.961.143,48	0,75%	199	3,23%	Artigo 8º, Inciso III
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	10.054.183,65	0,76%	49.393	0,43%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	15.302.098,10	1,16%	13.421	0,45%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	6.513.454,08	0,49%	131	0,60%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	10.280.525,75	0,78%	19.787	0,27%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	19.943.034,60	1,51%	12.762	1,40%	Artigo 8º, Inciso III
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4 du	Não há	5.588.308,57	0,42%	143	0,23%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	9.962.896,00	0,75%	529	0,26%	Artigo 9º, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			1.322.732.580,87				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (REDA FIXA) - base (Dezembro / 2021)

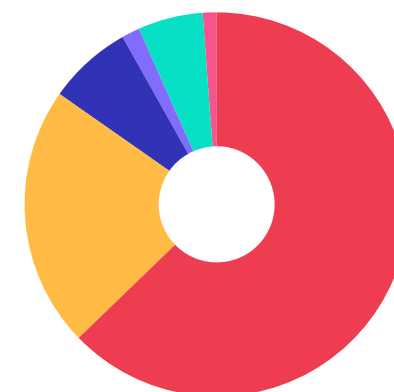
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	829.876.633,26	62,74%	11,50%	55,52%	82,00%	254.764.083,05
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	66.136.629,04
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40,00%	291.193.494,68	22,01%	4,07%	20,36%	40,00%	237.899.537,67
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'a'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	6,00%	79.363.954,85
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	66.136.629,04
Total Renda Fixa	100,00%	1.121.070.127,94	84,75%	15,57%	75,88%	138,00%	



Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENTA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Dezembro / 2021)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	30,00%	93.795.528,12	7,09%	0,00%	0,00%	10,00%	38.477.729,97
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	66.136.629,04
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	20.261.280,58	1,53%	3,65%	18,24%	20,00%	244.285.235,59
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	72.054.439,66	5,45%	3,09%	5,09%	10,00%	60.218.818,43
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,09%	0,09%	1.190.459,32
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	1,00%	13.227.325,81
Total Renda Variável	30,00%	186.111.248,36	14,07%	6,74%	23,42%	46,09%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,35%	5,00%	66.136.629,04
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	15.551.204,57	1,18%	0,00%	0,35%	5,00%	50.585.424,47
Total Exterior	10,00%	15.551.204,57	1,18%	0,00%	0,70%	10,00%	



7º I b 7º IV a 8º I a 8º II a
8º III 9º III

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (Dezembro / 2021)

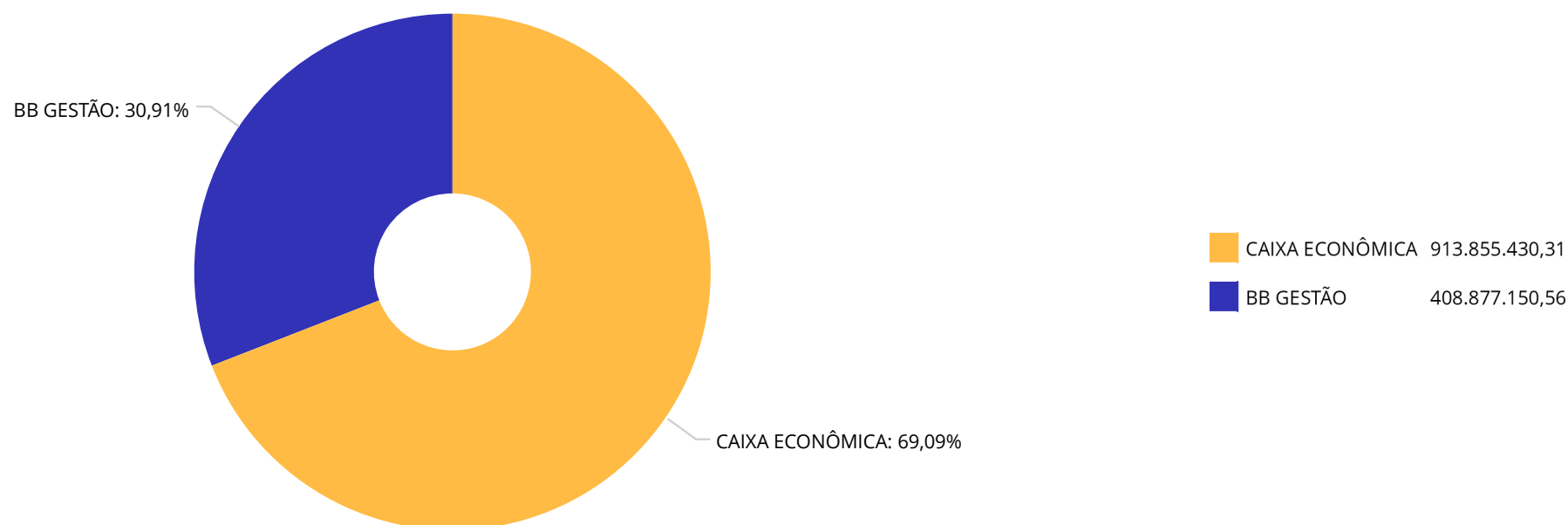
Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	913.855.430,31	69,09	2,89
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	408.877.150,56	30,91	0,02

Artigo 14º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

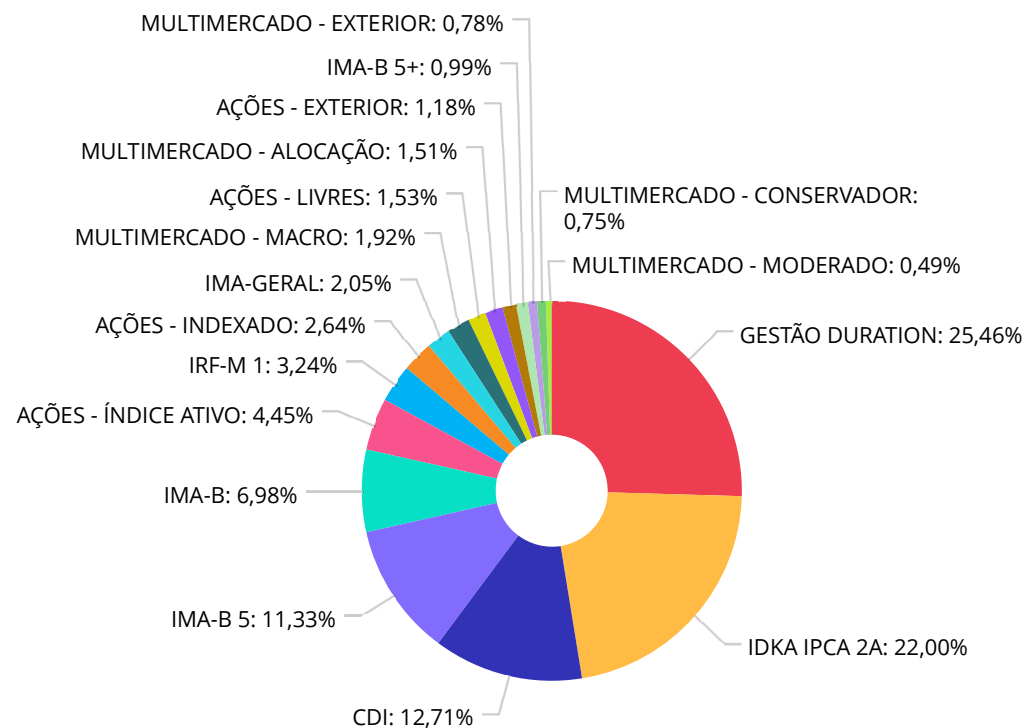
Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	829.876.633,26	62,74	11,50	82,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	291.193.494,68	22,01	4,07	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	6,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	93.795.528,12	7,09	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20.261.280,58	1,53	18,24	20,00
Artigo 8º, Inciso III	72.054.439,66	5,45	3,09	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	0,09
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	15.551.204,57	1,18	0,00	5,00

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Dezembro / 2021)



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Dezembro / 2021)

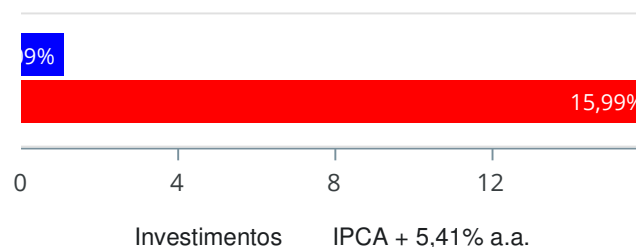


GESTÃO DURATION	336.718.763,68
IDKA IPCA 2A	291.022.529,96
CDI	168.109.680,08
IMA-B 5	149.826.274,73
IMA-B	92.353.787,05
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	58.886.885,83
IRF-M 1	42.790.823,69
AÇÕES - INDEXADO	34.908.642,29
IMA-GERAL	27.130.292,75
MULTIMERCADO - MACRO	25.356.281,75
AÇÕES - LIVRES	20.261.280,58
MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	19.943.034,60
AÇÕES - EXTERIOR	15.551.204,57
IMA-B 5+	13.117.976,00
MULTIMERCADO - EXTERIOR	10.280.525,75
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	9.961.143,48
MULTIMERCADO - MODERADO	6.513.454,08

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

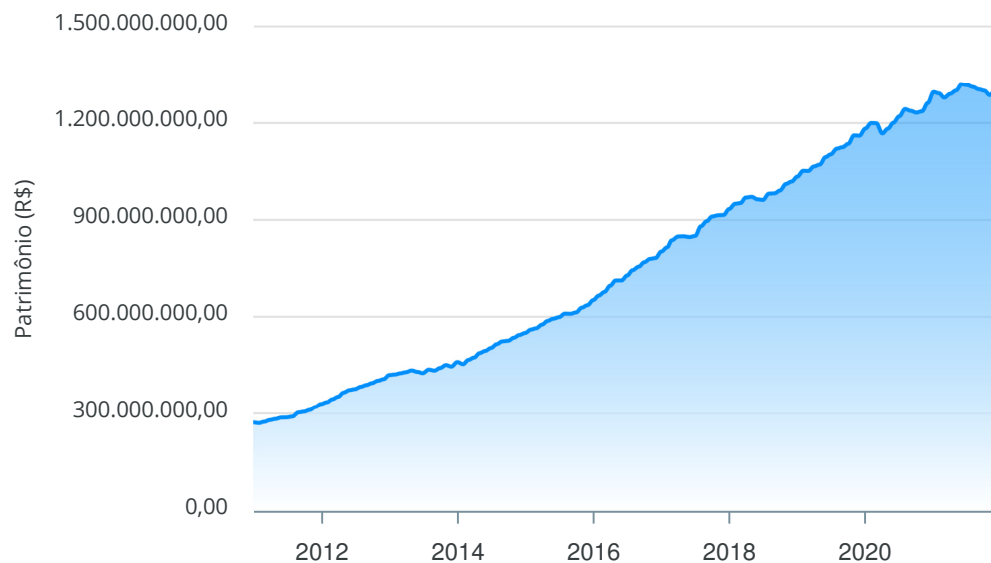
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	1.296.665.118,77	32.872.846,45	33.492.585,20	1.292.485.370,53	-3.560.009,49	-3.560.009,49	-0,27%	-0,27%	0,67%	0,67%	-40,97%	1,87%
Fevereiro	1.292.485.370,53	35.338.356,83	37.615.334,32	1.279.020.480,39	-11.187.912,65	-14.747.922,14	-0,87%	-1,14%	1,24%	1,92%	-59,30%	2,14%
Março	1.279.020.480,39	31.276.208,44	27.496.414,92	1.290.926.341,10	8.126.067,19	-6.621.854,95	0,63%	-0,51%	1,42%	3,36%	-15,21%	2,39%
Abril	1.290.926.341,10	32.739.622,16	35.000.310,03	1.300.930.769,71	12.265.116,48	5.643.261,53	0,95%	0,43%	0,73%	4,12%	10,53%	1,70%
Mai	1.300.930.769,71	37.307.191,61	31.506.683,11	1.320.669.474,33	13.938.196,12	19.581.457,65	1,07%	1,50%	1,27%	5,44%	27,65%	1,66%
Junho	1.320.669.474,33	43.865.464,07	46.583.436,29	1.318.356.123,49	404.621,38	19.986.079,03	0,03%	1,54%	0,97%	6,47%	23,75%	1,61%
Julho	1.318.356.123,49	72.844.969,51	71.445.418,78	1.312.489.366,66	-7.266.307,56	12.719.771,47	-0,55%	0,98%	1,43%	7,99%	12,23%	1,92%
Agosto	1.312.489.366,66	31.830.371,72	30.795.711,87	1.304.952.982,50	-8.571.044,01	4.148.727,46	-0,65%	0,32%	1,34%	9,43%	3,37%	2,12%
Setembro	1.304.952.982,50	61.952.296,73	63.817.740,53	1.300.797.645,20	-2.289.893,50	1.858.833,96	-0,18%	0,14%	1,61%	11,18%	1,27%	1,91%
Outubro	1.300.797.645,20	39.132.297,09	34.874.950,55	1.286.879.917,51	-18.175.074,23	-16.316.240,27	-1,39%	-1,25%	1,67%	13,05%	-9,60%	2,50%
Novembro	1.286.879.917,51	87.658.899,07	86.725.059,81	1.304.607.949,89	16.794.193,12	477.952,85	1,30%	0,04%	1,37%	14,60%	0,24%	1,96%
Dezembro	1.304.607.949,89	23.664.871,27	19.295.899,32	1.322.732.580,87	13.755.659,03	14.233.611,88	1,05%	1,09%	1,22%	15,99%	6,79%	1,67%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

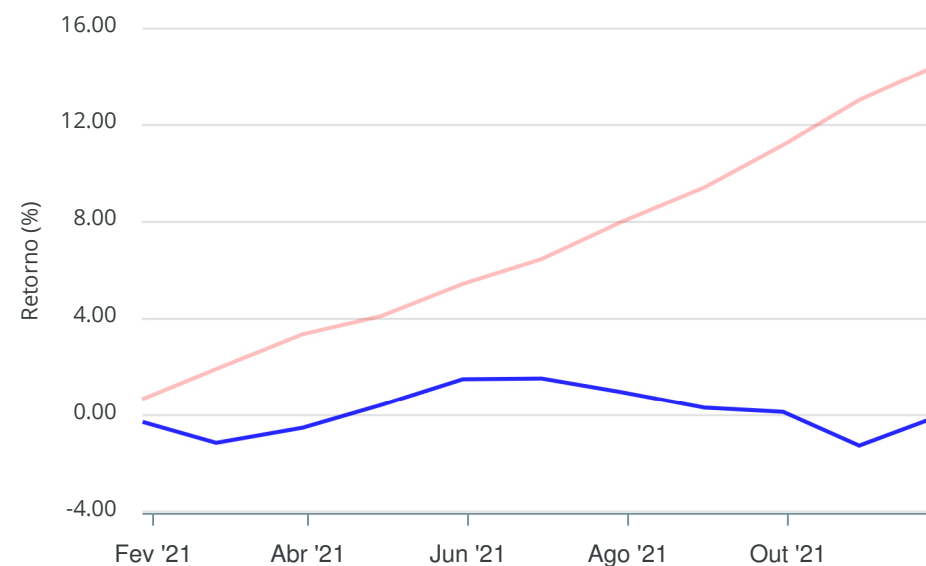
Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO

36M



Investimentos

Meta de Rentabilidade

☐ CDI ☐ IMA-B

☐ IMA-B 5 ☐ IMA-B 5+ ☐ IMA Geral ☐ IRF-M ☐ IRF-M 1

☐ IRF-M 1+ ☐ Ibovespa ☐ IBX ☐ SMLL ☐ IDIV

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Dezembro/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.947.896,00	0,00	0,00	13.117.976,00	170.080,00	1,31%	1,31%	0,18%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	26.884.541,06	0,00	0,00	27.130.292,75	245.751,69	0,91%	0,91%	1,00%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	15.347.640,00	0,00	0,00	15.477.880,00	130.240,00	0,85%	0,85%	1,23%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	6.140.417,96	0,00	0,00	6.192.267,41	51.849,45	0,84%	0,84%	0,20%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	211.885.441,58	0,00	0,00	213.634.949,08	1.749.507,50	0,83%	0,83%	0,23%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	34.302.965,27	2.000.000,00	0,00	36.598.556,28	295.591,01	0,81%	0,85%	0,20%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	47.253.368,76	0,00	0,00	47.630.864,75	377.495,99	0,80%	0,80%	0,03%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	128.156.142,42	0,00	0,00	129.139.657,80	983.515,38	0,77%	0,77%	1,02%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	18.442.050,07	0,00	0,00	18.582.618,49	140.568,42	0,76%	0,76%	1,04%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	109.166.990,82	0,00	0,00	109.997.897,52	830.906,70	0,76%	0,76%	0,79%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	37.713.721,22	2.000.000,00	677.000,00	39.333.634,78	296.913,56	0,75%	0,78%	0,04%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	12.989.298,26	0,00	0,00	13.085.917,08	96.618,82	0,74%	0,74%	0,06%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	66.687.627,78	2.500.000,00	526.000,00	69.169.555,56	507.927,78	0,73%	0,75%	0,04%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	200.093.180,70	0,00	0,00	201.533.273,82	1.440.093,12	0,72%	0,72%	1,10%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	88.861.712,94	0,00	0,00	89.489.256,14	627.543,20	0,71%	0,71%	1,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	427.704,36	0,00	0,00	430.196,51	2.492,15	0,58%	0,58%	0,45%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	1.664.580,85	0,00	0,00	1.673.801,93	9.221,08	0,55%	0,55%	1,02%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	6.319.310,18	1.261.665,57	2.719.827,61	4.901.372,80	40.224,66	0,53%	0,67%	0,02%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	9.196.414,00	13.203.205,70	15.373.071,71	7.074.252,19	47.704,20	0,21%	0,63%	0,02%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	54.686.400,93	0,00	0,00	54.800.883,36	114.482,43	0,21%	0,21%	2,16%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Dezembro/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	22.030.217,60	0,00	0,00	22.075.023,69	44.806,09	0,20%	0,20%	2,16%
Total Renda Fixa	1.111.197.622,76	20.964.871,27	19.295.899,32	1.121.070.127,94	8.203.533,23	0,74%		0,74%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Dezembro/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	9.738.895,98	0,00	0,00	10.280.525,75	541.629,77	5,56%	5,56%	7,98%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	55.569.390,93	1.200.000,00	0,00	58.886.885,83	2.117.494,90	3,73%	3,82%	9,21%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	8.621.360,20	0,00	0,00	8.928.556,47	307.196,27	3,56%	3,56%	9,21%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	33.748.090,34	0,00	0,00	34.908.642,29	1.160.551,95	3,44%	3,44%	9,23%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	10.992.288,20	0,00	0,00	11.332.724,11	340.435,91	3,10%	3,10%	9,14%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	15.085.740,94	0,00	0,00	15.302.098,10	216.357,16	1,43%	1,43%	1,69%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	6.421.704,74	0,00	0,00	6.513.454,08	91.749,34	1,43%	1,43%	2,21%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	19.692.360,47	0,00	0,00	19.943.034,60	250.674,13	1,27%	1,27%	2,65%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	9.845.932,80	0,00	0,00	9.961.143,48	115.210,68	1,17%	1,17%	0,65%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	9.939.636,39	0,00	0,00	10.054.183,65	114.547,26	1,15%	1,15%	1,23%
Total Renda Variável	179.655.400,99	1.200.000,00	0,00	186.111.248,36	5.255.847,37	2,91%		6,69%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Dezembro / 2021)

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5.425.988,47	0,00	0,00	5.588.308,57	162.320,10	2,99%	2,99%	8,37%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	8.328.937,67	1.500.000,00	0,00	9.962.896,00	133.958,33	1,36%	1,70%	8,95%
Total Exterior	13.754.926,14	1.500.000,00	0,00	15.551.204,57	296.278,43	1,94%		8,74%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	214.966.072,19	0,00	16.967.000,00	201.533.273,82	3.534.201,63	1,64%	1,82%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	136.721.777,10	0,00	10.000.000,00	129.139.657,80	2.417.880,70	1,77%	1,97%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	239.302.678,83	0,00	27.874.365,06	213.634.949,08	2.206.635,31	0,92%	1,07%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	88.452.499,73	0,00	600.000,00	89.489.256,14	1.636.756,41	1,85%	1,86%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	108.482.249,70	0,00	0,00	109.997.897,52	1.515.647,82	1,40%	1,40%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	34.333.664,46	34.264.500,00	526.000,00	69.169.555,56	1.097.391,10	1,60%	1,89%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	31.616.757,25	15.169.660,08	0,00	47.630.864,75	844.447,42	1,80%	1,93%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	18.414.968,44	21.000.000,00	677.000,00	39.333.634,78	595.666,34	1,51%	1,90%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.537.896,00	0,00	0,00	13.117.976,00	580.080,00	4,63%	4,63%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	64.338.133,86	0,00	10.000.000,00	54.800.883,36	462.749,50	0,72%	1,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	34.220.759,62	2.000.000,00	0,00	36.598.556,28	377.796,66	1,04%	1,09%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	18.229.328,08	0,00	0,00	18.582.618,49	353.290,41	1,94%	1,94%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	15.169.970,00	0,00	0,00	15.477.880,00	307.910,00	2,03%	2,03%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	21.862.031,63	0,00	0,00	22.075.023,69	212.992,06	0,97%	0,97%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	41.935.911,19	0,00	15.000.000,00	27.130.292,75	194.381,56	0,46%	0,99%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	7.902.037,61	5.000.000,00	0,00	13.085.917,08	183.879,47	1,43%	1,52%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.898.138,46	8.232.257,94	5.304.590,26	4.901.372,80	75.566,66	0,75%	1,58%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	6.780.217,93	49.089.649,41	48.869.911,36	7.074.252,19	74.296,21	0,13%	1,49%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	6.125.100,18	0,00	0,00	6.192.267,41	67.167,23	1,10%	1,10%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	1.694.711,42	0,00	46.268,08	1.673.801,93	25.358,59	1,50%	1,53%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	422.505,12	0,00	0,00	430.196,51	7.691,39	1,82%	1,82%
			Total Renda Fixa		16.771.786,47	1,35%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,00	10.000.000,00	0,00	10.280.525,75	280.525,75	2,81%	13,07%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	14.765.112,05	0,00	5.000.000,00	9.961.143,48	196.031,43	1,33%	1,92%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	9.925.347,66	0,00	0,00	10.054.183,65	128.835,99	1,30%	1,30%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	15.173.748,37	0,00	0,00	15.302.098,10	128.349,73	0,85%	0,85%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	6.454.857,92	0,00	0,00	6.513.454,08	58.596,16	0,91%	0,91%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	19.963.199,87	0,00	0,00	19.943.034,60	-20.165,27	-0,10%	-0,10%
CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA FIP MULTIESTRATÉGIA	63.907,40	0,00	30.774,92	0,00	-33.132,48	-51,84%	-
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	9.214.603,65	0,00	0,00	8.928.556,47	-286.047,18	-3,10%	-3,10%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	11.983.212,57	0,00	0,00	11.332.724,11	-650.488,46	-5,43%	-5,43%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	37.291.000,80	0,00	0,00	34.908.642,29	-2.382.358,51	-6,39%	-6,39%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	58.904.234,94	3.200.000,00	0,00	58.886.885,83	-3.217.349,11	-5,18%	-5,58%
				Total Renda Variável	-5.797.201,95	-3,02%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2021

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6.683.318,88	2.500.000,00	0,00	9.962.896,00	779.577,12	8,49%	11,81%
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4.967.692,29	0,00	0,00	5.588.308,57	620.616,28	12,49%	12,49%
			Total Exterior		1.400.193,40	9,89%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	215.813.421,85	8.433.000,00	32.211.746,35	201.533.273,82	9.498.598,32	4,24%	4,66%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	134.590.521,17	4.000.000,00	15.000.000,00	129.139.657,80	5.549.136,63	4,00%	4,31%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	128.054.668,09	0,00	43.044.292,60	89.489.256,14	4.478.880,65	3,50%	4,65%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	11.854.736,00	0,00	698.026,79	13.117.976,00	1.961.266,79	16,54%	10,66%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	9.026.971,43	62.749.800,00	4.326.000,00	69.169.555,56	1.718.784,13	2,39%	4,60%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	10.747.508,72	36.485.774,10	900.000,00	47.630.864,75	1.297.581,93	2,75%	4,62%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	30.234.736,20	35.670.000,00	27.838.148,07	39.333.634,78	1.267.046,65	1,92%	4,34%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	34.228.257,03	9.733.500,00	8.291.500,00	36.598.556,28	928.299,25	2,11%	2,70%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	27.674.541,09	0,00	9.899.025,51	18.582.618,49	807.102,91	2,92%	4,27%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	101.885.115,62	7.500.000,00	0,00	109.997.897,52	612.781,90	0,56%	0,53%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	15.822.630,00	0,00	783.593,72	15.477.880,00	438.843,72	2,77%	-2,18%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	16.818.784,88	216.409.802,65	226.294.329,62	7.074.252,19	139.994,28	0,06%	3,29%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	2.308.804,56	46.822.118,20	44.357.616,45	4.901.372,80	128.066,49	0,26%	3,27%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	4.605.209,57	6.900.000,00	5.430.915,51	6.192.267,41	117.973,35	1,03%	2,64%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,00	13.000.000,00	0,00	13.085.917,08	85.917,08	0,66%	0,70%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	1.690.847,41	0,00	90.132,13	1.673.801,93	73.086,65	4,32%	4,44%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	426.426,94	0,00	23.169,02	430.196,51	26.938,59	6,32%	6,57%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	20.423.248,65	2.000.000,00	0,00	22.075.023,69	-348.224,96	-1,55%	-1,51%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	67.678.667,54	0,00	40.000.000,00	27.130.292,75	-548.374,79	-0,81%	-0,40%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	247.219.054,13	7.272.400,00	40.176.959,25	213.634.949,08	-679.545,80	-0,27%	-0,11%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	63.946.021,78	2.000.000,00	10.000.000,00	54.800.883,36	-1.145.138,42	-1,74%	-1,53%
			Total Renda Fixa		26.409.015,35	1,65%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	15.534.753,41	0,00	6.000.000,00	9.961.143,48	426.390,07	2,74%	3,54%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,00	10.000.000,00	0,00	10.280.525,75	280.525,75	2,81%	32,83%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	6.136.039,61	3.700.000,00	0,00	10.054.183,65	218.144,04	2,22%	2,31%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	15.084.479,16	0,00	0,00	15.302.098,10	217.618,94	1,44%	1,44%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,00	6.480.000,00	0,00	6.513.454,08	33.454,08	0,52%	2,36%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	20.108.899,36	0,00	0,00	19.943.034,60	-165.864,76	-0,82%	-0,82%
CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA FIP MULTIESTRATÉGIA	1.128.992,65	0,00	784.089,71	0,00	-344.902,94	-30,55%	-
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	0,00	9.500.000,00	0,00	8.928.556,47	-571.443,53	-6,02%	-6,26%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	7.013.491,80	6.000.000,00	0,00	11.332.724,11	-1.680.767,69	-12,92%	-13,19%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	33.981.959,69	6.500.000,00	1.000.000,00	34.908.642,29	-4.573.317,40	-11,30%	-11,53%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	52.626.330,43	15.200.000,00	1.500.000,00	58.886.885,83	-7.439.444,60	-10,97%	-11,29%
Total Renda Variável					-13.599.608,04	-6,81%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2021

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	9.127.000,00	0,00	9.962.896,00	835.896,00	9,16%	30,51%
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	5.000.000,00	0,00	5.588.308,57	588.308,57	11,77%	33,49%
Total Exterior					1.424.204,57	10,08%	

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 3.922/2010, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.