

Relatório Analítico dos Investimentos

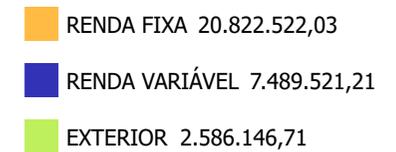
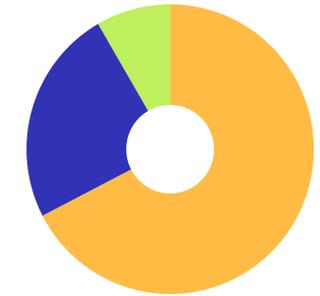
em dezembro, 4º trimestre e ano de 2021

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	250.283,14	0,81%	150	0,03%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	550.789,38	1,78%	9.819	0,22%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	159.783,11	0,52%	4.053	0,06%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕ...	D+24	Não há	260.761,40	0,84%	17	0,10%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	D+3	Não há	579.840,13	1,88%	23.076	0,06%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	257.351,96	0,83%	151.964	0,00%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	714.356,08	2,31%	131	0,07%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	132.499,62	0,43%	1.584	0,18%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.362.051,12	4,41%	1.259	0,06%	Artigo 8º, Inciso III
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4 du	Não há	626.532,24	2,03%	143	0,03%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	1.959.614,47	6,34%	529	0,05%	Artigo 9º, Inciso III
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		4.368,56	0,01%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			30.898.189,95				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			4.368,56				Artigo 6º
PL Total			30.902.558,51				

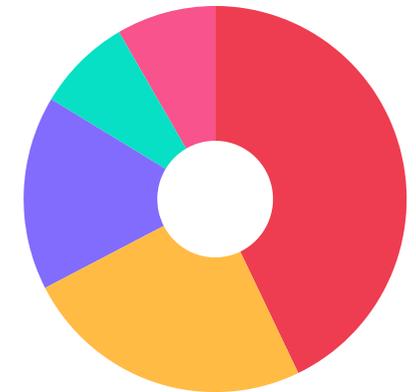
Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Dezembro / 2021)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	30.898.189,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	13.241.086,64	42,85%	0,00%	59,50%	100,00%	17.657.103,31
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	30.898.189,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	18.538.913,97
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	18.538.913,97
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	7.581.435,39	24,54%	0,00%	14,00%	40,00%	4.777.840,59
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	12.359.275,98
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	6.179.637,99
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	4.634.728,49
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.544.909,50
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.544.909,50
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.544.909,50
Total Renda Fixa	100,00%	20.822.522,03	67,39%	0,00%	73,50%	550,00%	

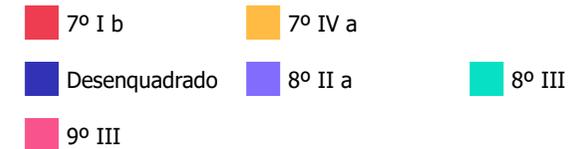


Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Dezembro / 2021)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	9.269.456,99
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	9.269.456,99
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	5.023.262,43	16,26%	0,00%	13,00%	20,00%	1.156.375,56
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	6.179.637,99
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.466.258,78	7,98%	0,00%	5,00%	10,00%	623.560,22
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.544.909,50
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.544.909,50
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.544.909,50
Total Renda Variável	30,00%	7.489.521,21	24,24%	0,00%	18,00%	125,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	3.089.819,00
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	3.089.819,00
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	2.586.146,71	8,37%	0,00%	6,50%	10,00%	503.672,29
Total Exterior	10,00%	2.586.146,71	8,37%	0,00%	8,50%	30,00%	



Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2021 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,83%	4,97%	1,84%	3,05%	4,97%	14,02%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	4,65%	1,86%	3,18%	4,65%	12,93%	1,05%	0,03%
IRF-M 1+ (Benchmark)	2,29%	-4,99%	0,93%	-1,74%	-4,99%	3,04%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,27%	-5,31%	0,86%	-1,95%	-5,31%	2,47%	2,07%	0,06%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-0,34%	-6,55%	0,09%	-4,11%	-6,55%	-1,41%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,34%	-7,00%	-0,14%	-4,47%	-7,00%	-2,14%	3,55%	0,07%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,88%	2,93%	1,13%	2,10%	2,93%	6,88%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,85%	2,70%	1,09%	1,99%	2,70%	6,43%	0,20%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,79%	4,57%	2,03%	3,24%	4,57%	12,97%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,77%	4,31%	1,97%	3,12%	4,31%	12,39%	1,02%	0,03%
IMA-B (Benchmark)	0,22%	-1,26%	1,06%	-0,55%	-1,26%	5,06%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,20%	-1,52%	0,97%	-0,70%	-1,52%	4,53%	2,16%	0,05%
CDI (Benchmark)	0,76%	4,40%	1,84%	3,09%	4,40%	7,28%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,80%	4,62%	1,93%	3,26%	4,62%	7,13%	0,03%	0,01%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2021 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,67%	3,27%	1,58%	2,49%	3,27%	4,96%	0,02%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	-0,01%	6,77%	1,82%	5,44%	6,77%	13,94%	0,90%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,46%	6,00%	2,19%	4,92%	6,00%	10,36%	0,21%	0,01%
IPCA (Benchmark)	0,73%	10,06%	2,96%	6,07%	10,06%	15,03%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,76%	0,54%	1,40%	0,93%	0,54%	-	0,79%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,83%	-0,11%	1,07%	-0,82%	-0,11%	6,55%	0,23%	0,02%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Benchmark)	4,36%	26,89%	10,65%	10,91%	26,89%	47,52%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	5,28%	30,30%	12,24%	12,99%	30,30%	-	7,90%	0,11%
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	5,55%	32,74%	13,02%	14,31%	32,74%	49,91%	7,93%	0,11%
Global BDRX (Benchmark)	1,71%	33,65%	12,29%	21,44%	33,65%	105,84%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,70%	30,51%	11,81%	20,44%	30,51%	101,98%	8,95%	0,14%
IDIV (Benchmark)	1,60%	-6,41%	-1,83%	-8,30%	-6,41%	-7,35%	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1,52%	-9,35%	-2,03%	-10,96%	-9,35%	-15,64%	7,98%	0,17%
Ibovespa (Benchmark)	2,85%	-11,93%	-5,55%	-17,33%	-11,93%	-9,36%	-	-
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	8,15%	12,28%	-3,51%	-7,99%	12,28%	24,93%	8,91%	0,17%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	3,56%	-6,27%	-3,10%	-11,41%	-6,27%	6,89%	9,21%	0,16%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1,50%	-13,05%	-10,15%	-23,04%	-13,05%	-16,06%	8,94%	0,18%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	6,28%	-32,03%	-4,27%	-26,36%	-32,03%	-49,11%	19,02%	0,26%
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	6,23%	-0,83%	-3,91%	-12,49%	-0,83%	4,47%	9,72%	0,19%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	3,41%	-6,84%	-6,92%	-14,76%	-6,84%	-7,42%	8,89%	0,17%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4,08%	-4,76%	-2,54%	-8,88%	-4,76%	0,93%	9,34%	0,16%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	5,78%	5,61%	-1,11%	-11,93%	5,61%	8,48%	8,04%	0,19%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	-0,02%	-26,98%	-16,69%	-28,90%	-26,98%	-27,40%	10,46%	0,16%

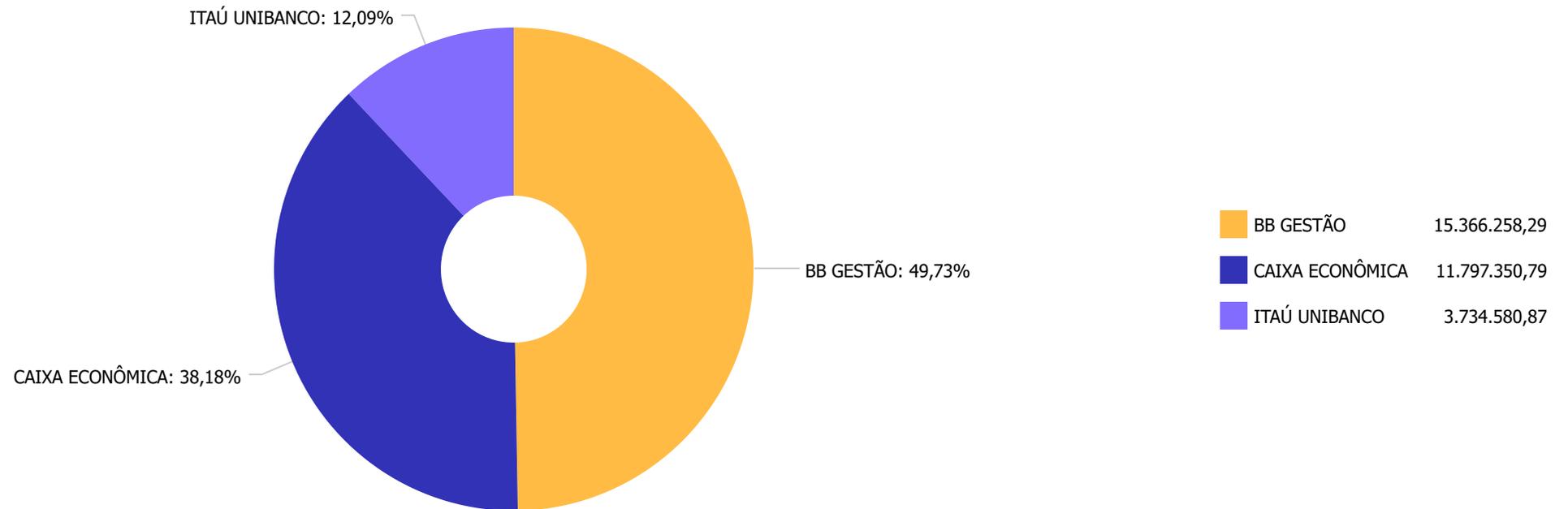
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	0,81%	-20,98%	-12,77%	-25,33%	-20,98%	-15,30%	7,14%	0,16%
SMLL (Benchmark)	3,80%	-16,20%	-11,28%	-24,79%	-16,20%	-16,75%	-	-
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	3,51%	-10,06%	-10,01%	-21,42%	-10,06%	-12,83%	11,67%	0,18%
CDI (Benchmark)	0,76%	4,40%	1,84%	3,09%	4,40%	7,28%	-	-
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,73%	4,37%	1,82%	3,06%	4,37%	8,69%	0,12%	0,01%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1,43%	2,36%	0,91%	-0,98%	2,36%	5,50%	2,21%	0,03%
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	-0,16%	14,47%	2,78%	8,51%	14,47%	-	2,57%	0,06%

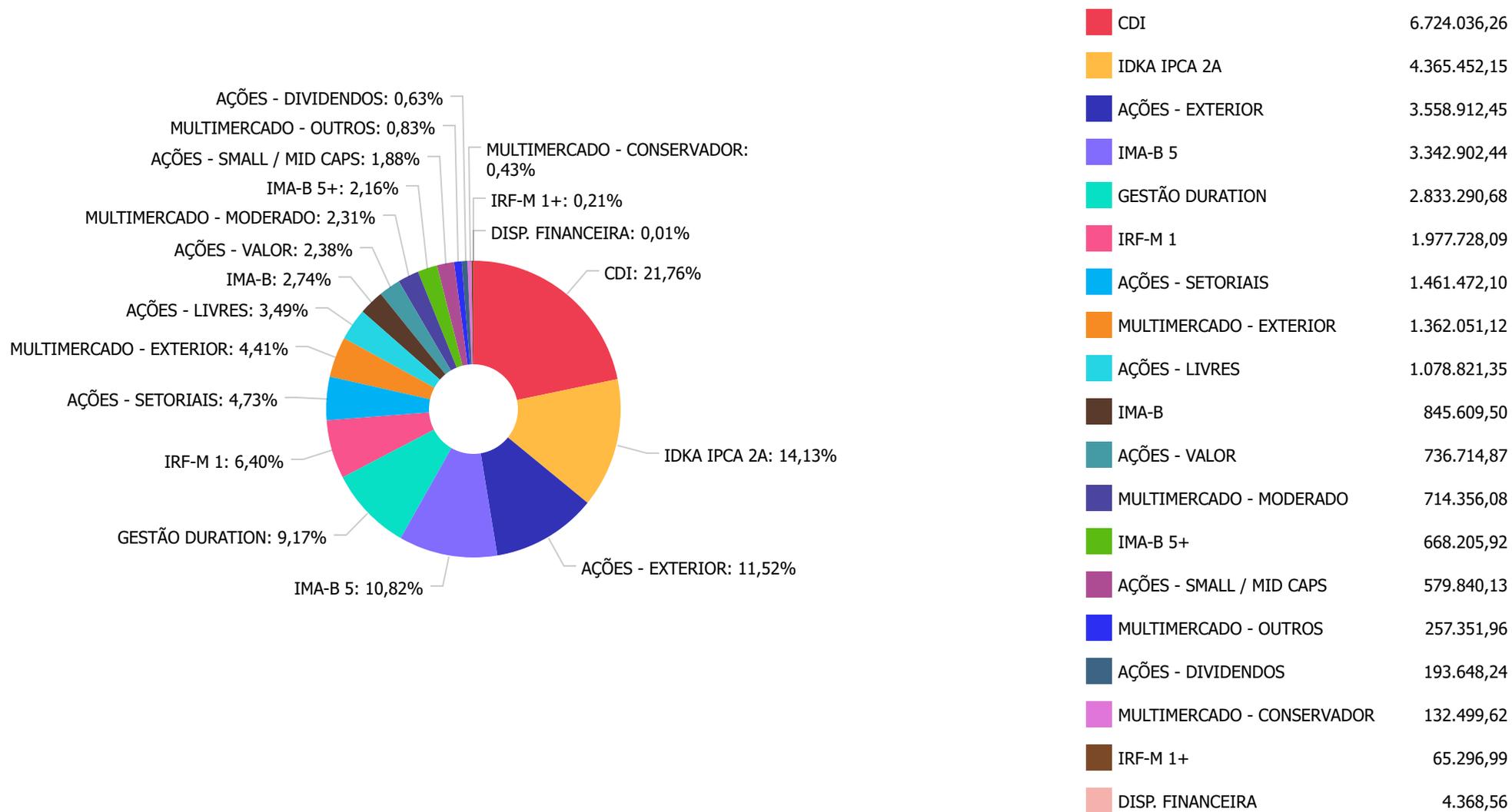
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	1,71%	33,65%	12,29%	21,44%	33,65%	105,84%	-	-
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,99%	33,49%	12,49%	23,02%	33,49%	99,34%	8,37%	0,13%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,70%	30,51%	11,81%	20,44%	30,51%	101,98%	8,95%	0,14%

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



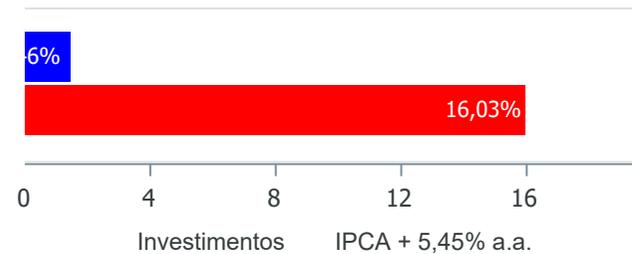
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Dezembro / 2021)



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	26.350.158,92	1.028.062,44	1.076.496,63	26.216.529,61	-85.195,12	-85.195,12	-0,32%	-0,32%	0,67%	0,67%	-48,03%	3,27%
Fevereiro	26.216.529,61	1.249.912,84	858.456,23	26.396.974,78	-211.011,44	-296.206,56	-0,79%	-1,11%	1,24%	1,92%	-57,87%	2,64%
Março	26.396.974,78	2.823.280,04	2.430.931,63	27.050.308,09	260.984,90	-35.221,66	0,97%	-0,15%	1,42%	3,37%	-4,46%	3,65%
Abril	27.050.308,09	2.223.471,40	1.831.109,46	27.700.496,46	257.826,43	222.604,77	0,94%	0,79%	0,73%	4,13%	19,07%	2,41%
Mai	27.700.496,46	3.959.431,19	3.564.486,87	28.310.677,68	215.236,90	437.841,67	0,77%	1,56%	1,28%	5,46%	28,57%	2,56%
Junho	28.310.677,68	2.809.817,61	2.408.771,85	28.695.889,39	-15.834,05	422.007,62	-0,06%	1,50%	0,98%	6,49%	23,18%	2,29%
Julho	28.695.889,39	11.045.016,73	10.653.445,65	28.966.613,69	-120.846,78	301.160,84	-0,42%	1,08%	1,43%	8,01%	13,51%	3,01%
Agosto	28.966.613,69	3.322.884,76	2.926.340,43	29.217.173,81	-145.984,21	155.176,63	-0,50%	0,58%	1,34%	9,46%	6,13%	2,96%
Setembro	29.217.173,81	3.007.672,18	2.608.221,09	29.386.834,45	-229.790,45	-74.613,82	-0,78%	-0,20%	1,61%	11,22%	-1,79%	3,31%
Outubro	29.386.834,45	2.830.672,08	2.462.767,60	29.602.674,83	-152.064,10	-226.677,92	-0,51%	-0,71%	1,68%	13,08%	-5,43%	3,85%
Novembro	29.602.674,83	1.472.815,91	1.163.978,72	30.115.750,80	204.238,78	-22.439,14	0,68%	-0,03%	1,38%	14,64%	-0,22%	3,59%
Dezembro	30.115.750,80	1.202.477,14	875.639,85	30.898.189,95	455.601,86	433.162,72	1,50%	1,46%	1,22%	16,03%	9,12%	3,24%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



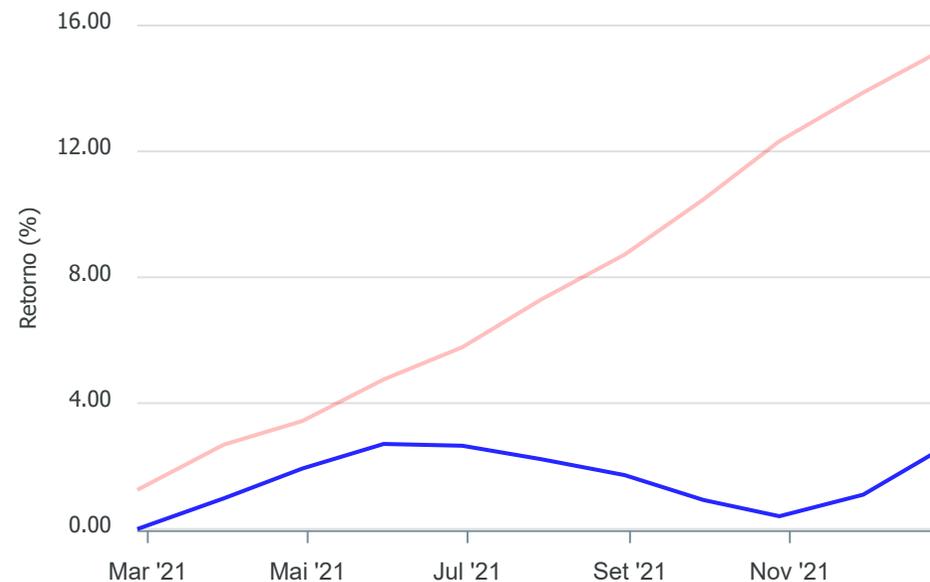
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
- 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 IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	63.849,21	0,00	0,00	65.296,99	1.447,78	2,27%	2,27%	2,07%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.961.087,28	0,00	0,00	1.977.728,09	16.640,81	0,85%	0,85%	0,20%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.959.710,51	0,00	0,00	1.975.891,55	16.181,04	0,83%	0,83%	0,23%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	4.903.077,39	0,00	0,00	4.942.246,91	39.169,52	0,80%	0,80%	0,03%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.317.443,22	0,00	0,00	3.342.902,44	25.459,22	0,77%	0,77%	1,02%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	850.922,47	0,00	0,00	857.399,13	6.476,66	0,76%	0,76%	0,79%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.334.839,43	0,00	0,00	4.365.452,15	30.612,72	0,71%	0,71%	1,05%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	0,00	300.184,54	0,00	301.381,01	1.196,47	0,40%	0,46%	0,21%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	101.399,13	622.292,60	475.455,31	249.861,13	1.624,71	0,22%	0,67%	0,02%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	843.893,14	0,00	0,00	845.609,50	1.716,36	0,20%	0,20%	2,16%
ITAÚ GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	220.000,00	80.000,00	300.184,54	0,00	184,54	0,06%	0,49%	0,23%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	1.230.616,25	0,00	0,00	1.230.547,21	-69,04	-0,01%	-0,01%	0,90%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	670.498,07	0,00	0,00	668.205,92	-2.292,15	-0,34%	-0,34%	3,55%
Total Renda Fixa	20.457.336,10	1.002.477,14	775.639,85	20.822.522,03	138.348,64	0,67%		0,73%

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
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	231.140,77	50.000,00	0,00	300.899,07	19.758,30	7,03%	8,15%	8,91%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	302.278,95	0,00	0,00	321.271,87	18.992,92	6,28%	6,28%	19,02%
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	1.290.494,23	0,00	0,00	1.362.051,12	71.556,89	5,54%	5,54%	7,93%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	924.017,77	0,00	0,00	972.765,74	48.747,97	5,28%	5,28%	7,90%
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	225.035,19	50.000,00	0,00	288.511,78	13.476,59	4,90%	6,23%	9,72%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	140.570,76	100.000,00	0,00	250.283,14	9.712,38	4,04%	5,78%	8,04%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	804.383,43	0,00	100.000,00	736.714,87	32.331,44	4,02%	4,08%	9,34%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	313.761,76	0,00	0,00	324.941,72	11.179,96	3,56%	3,56%	9,21%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	560.159,83	0,00	0,00	579.840,13	19.680,30	3,51%	3,51%	11,67%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	32.749,18	0,00	0,00	33.865,13	1.115,95	3,41%	3,41%	8,89%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	157.383,82	0,00	0,00	159.783,11	2.399,29	1,52%	1,52%	7,98%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	239.238,11	0,00	0,00	242.835,09	3.596,98	1,50%	1,50%	8,94%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	704.293,58	0,00	0,00	714.356,08	10.062,50	1,43%	1,43%	2,21%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	258.653,80	0,00	0,00	260.761,40	2.107,60	0,81%	0,81%	7,14%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	255.479,57	0,00	0,00	257.351,96	1.872,39	0,73%	0,73%	0,12%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	550.917,09	0,00	0,00	550.789,38	-127,71	-0,02%	-0,02%	10,46%
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	132.716,20	0,00	0,00	132.499,62	-216,58	-0,16%	-0,16%	2,57%
Total Renda Variável	7.123.274,04	200.000,00	100.000,00	7.489.521,21	266.247,17	3,69%		8,28%

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	608.333,75	0,00	0,00	626.532,24	18.198,49	2,99%	2,99%	8,37%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.926.806,91	0,00	0,00	1.959.614,47	32.807,56	1,70%	1,70%	8,95%
Total Exterior	2.535.140,66	0,00	0,00	2.586.146,71	51.006,05	2,01%		8,81%

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 PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	4.281.003,77	638.934,25	68.934,25	4.942.246,91	91.243,14	1,85%	1,93%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	3.972.722,55	313.907,87	0,00	4.365.452,15	78.821,73	1,84%	1,86%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.128.785,00	150.000,00	0,00	3.342.902,44	64.117,44	1,96%	1,97%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.036.195,89	0,00	80.000,00	1.977.728,09	21.532,20	1,06%	1,09%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.955.043,50	0,00	0,00	1.975.891,55	20.848,05	1,07%	1,07%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	611.607,12	600.000,00	0,00	1.230.547,21	18.940,09	1,56%	1,82%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	845.585,13	0,00	0,00	857.399,13	11.814,00	1,40%	1,40%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	837.450,59	0,00	0,00	845.609,50	8.158,91	0,97%	0,97%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	807.031,17	2.203.104,77	2.764.927,24	249.861,13	4.652,43	0,15%	1,58%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	0,00	300.184,54	0,00	301.381,01	1.196,47	0,40%	2,19%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	64.741,70	0,00	0,00	65.296,99	555,29	0,86%	0,86%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	102.009,51	0,00	102.392,61	0,00	383,10	0,38%	0,93%
ITAÚ GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,00	300.000,00	300.184,54	0,00	184,54	0,06%	2,07%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00	150.000,00	150.045,32	0,00	45,32	0,03%	1,26%
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	4.843,37	86.145,55	86.620,36	4.368,56	0,00	0,00%	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	669.159,57	0,00	0,00	668.205,92	-953,65	-0,14%	-0,14%
				Total Renda Fixa	321.539,06	1,57%	

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
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	1.078.821,93	135.947,53	0,00	1.362.051,12	147.281,66	12,12%	13,02%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	866.717,12	0,00	0,00	972.765,74	106.048,62	12,24%	12,24%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	707.929,62	0,00	0,00	714.356,08	6.426,46	0,91%	0,91%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	252.760,99	0,00	0,00	257.351,96	4.590,97	1,82%	1,82%
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	0,00	131.886,17	0,00	132.499,62	613,45	0,47%	2,78%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	150.370,04	100.000,00	0,00	250.283,14	-86,90	-0,03%	-1,11%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	36.382,78	0,00	0,00	33.865,13	-2.517,65	-6,92%	-6,92%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	163.098,41	0,00	0,00	159.783,11	-3.315,30	-2,03%	-2,03%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	809.558,82	0,00	805.902,21	0,00	-3.656,61	-0,45%	0,85%
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	259.062,92	50.000,00	0,00	300.899,07	-8.163,85	-2,64%	-3,51%
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	248.768,01	50.000,00	0,00	288.511,78	-10.256,23	-3,43%	-3,91%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	335.351,99	0,00	0,00	324.941,72	-10.410,27	-3,10%	-3,10%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	335.607,41	0,00	0,00	321.271,87	-14.335,54	-4,27%	-4,27%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	301.549,64	0,00	30.000,00	242.835,09	-28.714,55	-9,52%	-10,15%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	966.972,96	0,00	200.000,00	736.714,87	-30.258,09	-3,13%	-2,54%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	298.910,22	0,00	0,00	260.761,40	-38.148,82	-12,76%	-12,77%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	644.341,44	0,00	0,00	579.840,13	-64.501,31	-10,01%	-10,01%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	661.136,94	0,00	0,00	550.789,38	-110.347,56	-16,69%	-16,69%
			Total Renda Variável		-59.751,52	-0,70%	

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	1.752.609,98	0,00	0,00	1.959.614,47	207.004,49	11,81%	11,81%
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	205.547,73	382.000,00	0,00	626.532,24	38.984,51	6,64%	12,49%
				Total Exterior	245.989,00	10,51%	

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
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	933,05	5.655.626,26	853.756,96	4.942.246,91	139.444,56	2,47%	4,62%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.596.451,74	2.857.861,87	227.151,21	4.365.452,15	138.289,75	3,10%	4,65%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	953.646,60	2.290.068,91	0,00	3.342.902,44	99.186,93	3,06%	4,31%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.654.010,84	0,00	1.740.000,00	1.977.728,09	63.717,25	1,74%	2,70%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.492.659,14	837.470,30	2.368.954,00	0,00	38.824,56	1,67%	4,66%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	0,00	1.205.000,00	0,00	1.230.547,21	25.547,21	2,12%	6,77%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.429.048,81	537.470,30	1.990.068,91	0,00	23.549,80	1,20%	4,27%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	456.014,49	460.000,00	70.000,00	857.399,13	11.384,64	1,24%	0,53%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	617.645,13	298.309,53	925.933,46	0,00	9.978,80	1,09%	4,53%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	872.178,49	12.116.424,71	12.748.321,69	249.861,13	9.579,62	0,07%	3,27%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	348.920,61	374.000,00	732.062,76	0,00	9.142,15	1,26%	0,70%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	689.958,02	74.963,54	771.860,45	0,00	6.938,89	0,91%	4,10%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	153.559,67	300.184,54	154.074,42	301.381,01	1.711,22	0,38%	6,00%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	231.026,10	0,00	231.713,52	0,00	687,42	0,30%	2,64%
ITAÚ GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,00	300.000,00	300.184,54	0,00	184,54	0,06%	5,29%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00	150.000,00	150.045,32	0,00	45,32	0,03%	2,38%
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	7.759,03	131.733,35	135.123,82	4.368,56	0,00	0,00%	-
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	692.295,77	0,00	684.003,62	0,00	-8.292,15	-1,20%	0,35%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	124.145,85	855.626,06	121.907,42	845.609,50	-12.254,99	-1,25%	-1,51%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.062.307,92	0,00	1.042.626,06	0,00	-19.681,86	-1,85%	-1,53%

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
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.703.206,01	0,00	1.682.273,64	0,00	-20.932,37	-1,23%	-0,40%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	885.162,94	0,00	862.392,61	0,00	-22.770,33	-2,57%	-2,28%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	886.329,70	0,00	783.309,53	65.296,99	-37.723,18	-4,26%	-5,31%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.754.902,01	1.042.062,76	1.780.000,00	1.975.891,55	-41.073,22	-1,08%	-0,11%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	703.563,86	700.000,00	667.586,24	668.205,92	-67.771,70	-4,83%	-7,00%
				Total Renda Fixa	347.712,86	0,68%	

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
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	80.341,56	1.045.947,53	0,00	1.362.051,12	235.762,03	20,93%	32,74%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	0,00	866.000,00	0,00	972.765,74	106.765,74	12,33%	30,30%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,00	567.470,30	320.000,00	257.351,96	9.881,66	1,74%	4,37%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	804.796,08	0,00	805.902,21	0,00	1.106,13	0,14%	1,44%
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	0,00	131.886,17	0,00	132.499,62	613,45	0,47%	14,46%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,00	717.470,30	0,00	714.356,08	-3.114,22	-0,43%	2,36%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	0,00	40.000,00	0,00	33.865,13	-6.134,87	-15,34%	-6,84%
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	0,00	315.000,00	0,00	300.899,07	-14.100,93	-4,48%	12,27%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	0,00	270.000,00	0,00	250.283,14	-19.716,86	-7,30%	5,61%
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	0,00	312.500,00	0,00	288.511,78	-23.988,22	-7,68%	-0,82%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	114.806,90	100.000,00	30.000,00	159.783,11	-25.023,79	-11,65%	-9,35%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	0,00	362.500,00	0,00	324.941,72	-37.558,28	-10,36%	-6,26%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	648.176,06	342.500,00	200.000,00	736.714,87	-53.961,19	-5,45%	-4,76%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	35.408,19	300.000,00	30.000,00	242.835,09	-62.573,10	-18,66%	-13,05%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	329.957,27	0,00	0,00	260.761,40	-69.195,87	-20,97%	-20,97%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	557.139,94	100.000,00	0,00	579.840,13	-77.299,81	-11,76%	-10,06%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	412.242,53	56.153,80	0,00	321.271,87	-147.124,46	-31,41%	-32,03%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	569.561,77	187.500,00	0,00	550.789,38	-206.272,39	-27,25%	-26,98%
				Total Renda Variável	-391.934,98	-4,97%	

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	1.489.761,87	431.517,44	400.000,00	1.959.614,47	438.335,16	22,81%	30,51%
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	587.000,00	0,00	626.532,24	39.532,24	6,73%	33,49%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO ...	0,00	187.000,00	186.517,44	0,00	-482,56	-0,26%	11,65%
				Total Exterior	477.384,84	22,64%	

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 4.963/2021, 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 4.963 de 25 de novembro de 2021 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.