



LDB
EMPRESAS

LIMEIRA
JANEIRO 2022



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.01.2022.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

83,13%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IRF-M	3,54	-0,13	-0,13	20.461.634,00	3,34	4.743.847.539,71	0,43
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,71	-0,77	-0,77	22.379.308,18	3,66	6.778.952.570,88	0,33
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,68	-0,76	-0,76	43.174.028,31	7,06	4.513.989.587,78	0,96
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,67	0,61	0,61	22.661.075,36	3,70	6.296.869.255,71	0,36
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,77	0,09	0,09	50.476.565,61	8,25	12.040.160.059,77	0,42
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,62	0,01	0,01	57.260.232,19	9,36	9.258.989.052,65	0,62
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	5,68	-0,76	-0,76	38.316.813,57	6,26	992.957.009,73	3,86
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	5,10	-0,54	-0,54	15.984.878,46	2,61	1.104.395.418,47	1,45
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,77	0,02	0,02	137.638.889,13	22,50	10.879.369.499,05	1,27
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,54	-0,07	-0,07	12.066.769,90	1,97	1.205.162.298,95	1,00
BB	BB	BB PREV RF VII	1,68	0,56	0,56	436.365,24	0,07	249.437.254,95	0,17
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	2,42	0,29	0,29	624.936,94	0,10	435.239.728,20	0,14
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,77	0,04	0,04	17.642.456,51	2,88	7.461.201.984,89	0,24
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,30	0,67	0,67	31.521.303,45	5,15	11.686.800.915,89	0,27
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,77	-0,03	-0,03	16.994.552,23	2,78	1.456.289.627,12	1,17
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI IMA-B 5 TOP RENDA FIXA LP	2,99	0,13	0,13	5.134.329,91	0,84	797.400.240,01	0,64
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,20	-0,10	-0,10	492.774.138,99	80,56		

Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
GRAPHEN	RJI	LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	2,94	0,46	0,46	1.332.196,67	0,22	72.451.705,68	1,84
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			2,94	0,46	0,46	1.332.196,67	0,22		

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3,26	0,03	0,03	6.166.184,70	1,01	619.683.943,04	1,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO	3,23	0,27	0,27	8.263.424,07	1,35	216.695.980,82	3,81
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			2,08	0,17	0,17	14.429.608,77	2,36		
Renda Fixa			3,19	-0,10	-0,10	508.535.944,43	83,13		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

REND A VARIÁVEL

12,50%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST ACOES FIC FIA	18,27	7,72	7,72	1.890.409,16	0,31	418.468.400,92	0,45
XP	XP	XP INVESTOR FI DE ACOES	19,45	5,77	5,77	9.093.117,07	1,49	212.979.215,59	4,27
GUEPARDO	GUEPARDO	GUEPARDO AÇÕES INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES	25,24	5,96	5,96	7.754.244,00	1,27	762.410.255,86	1,02
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	20,24	6,70	6,70	16.874.023,04	2,76	1.044.534.082,64	1,62
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	24,24	5,00	5,00	2.636.194,62	0,43	1.987.878.244,61	0,13
NAVI	BEM	NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	20,59	6,53	6,53	2.673.382,24	0,44	874.833.331,54	0,31
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	20,20	9,48	9,48	13.163.810,73	2,15	731.059.746,80	1,80
PERFIN	PERFIN	PERFIN INSTITUCIONAL FC FIA	21,01	2,40	2,40	8.313.015,72	1,36	201.297.609,57	4,13
BB	BB	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	19,04	6,49	6,49	2.879.022,34	0,47	1.502.868.240,22	0,19
BB	BB	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	20,02	1,12	1,12	11.189.698,28	1,83	1.367.227.560,74	0,82
Sub-total Artigo 8º I			20,32	5,59	5,59	76.466.917,20	12,50		
Renda Variável			16,47	5,59	5,59	76.466.917,20	12,50		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,44%

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17,35	-9,75	-9,75	2.537.487,28	0,41	3.479.303.240,79	0,07
BB	BB	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	16,89	-10,62	-10,62	6.256.878,29	1,02	1.260.558.701,28	0,50
Sub-total Artigo 9º III			16,81	-10,37	-10,37	8.794.365,57	1,44		
Investimentos no Exterior			16,81	-10,37	-10,37	8.794.365,57	1,44		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

2,20%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	3,60	1,27	1,27	1.128.923,50	0,18	3.132.192.028,90	0,04
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13,60	-5,30	-5,30	2.156.028,38	0,35	3.506.862.313,47	0,06
Sub-total Artigo 10º I			12,20	-3,14	-3,14	3.284.951,88	0,54		

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRPP	BNY MELLON	GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	92,76	-0,32	-0,32	152.028,94	0,02	19.383.513,43	0,78
A5	PLANNER	W7 FIP MULTISTRATÉGIA	1,95	-0,12	-0,12	10.022.610,59	1,64	137.124.382,37	7,31
Sub-total Artigo 10º II			0,43	-0,12	-0,12	10.174.639,53	1,66		

Investimentos Estruturados			2,85	-0,88	-0,88	13.459.591,41	2,20		
-----------------------------------	--	--	-------------	--------------	--------------	----------------------	-------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

0,73%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
GRAPHEN	ELITE	BR HOTÉIS FII	2,16	-0,12	-0,12	1.524.354,76	0,25	147.391.667,73	1,03
GRAPHEN	RJI	HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	1,72	0,13	0,13	1.157.632,93	0,19	72.545.951,03	1,60
CADENCE	CADENCE	OSASCO PROPERTIES FII	4,22	-0,03	-0,03	1.783.238,85	0,29	191.963.093,58	0,93
Sub-total Artigo 11º			0,55	-0,02	-0,02	4.465.226,54	0,73		
Fundos Imobiliários			0,55	-0,02	-0,02	4.465.226,54	0,73		
Total			4,32	0,39	0,39	611.722.045,15	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	492.774.138,99	80,56					100,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	1.332.196,67	0,22					5,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	14.429.608,77	2,36					5,00
	Total Renda Fixa	508.535.944,43	83,13					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	76.466.917,20	12,50					30,00
	Total Renda Variável	76.466.917,20	12,50					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	8.794.365,57	1,44					10,00
	Total Investimentos no Exterior	8.794.365,57	1,44					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	3.284.951,88	0,54					10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	10.174.639,53	1,66					5,00
	Total Investimentos Estruturados	13.459.591,41	2,20					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	4.465.226,54	0,73					5,00
	Total Fundos Imobiliários	4.465.226,54	0,73					5,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,10 -14,33	-0,10 -14,33	3,08 146,94	1,52 43,65	1,71 34,09	-452.483,26	-452.483,26
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	0,46 63,45	0,46 63,45				6.160,91	6.160,91
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,17 22,96	0,17 22,96				24.217,91	24.217,91
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	5,59 -1,39	5,59 -1,39				4.050.010,23	4.050.010,23
Artigo 9º III % do CDI	-10,37 -1.415,80	-10,37 -1.415,80	-9,21 -439,11	3,71 106,76	12,16 243,17	-1.017.219,87	-1.017.219,87
Artigo 10º I % do CDI	-3,14 -428,94	-3,14 -428,94				-106.526,85	-106.526,85
Artigo 10º II % do CDI	-0,12 -16,97	-0,12 -16,97				-12.658,53	-12.658,53
Artigo 11º % do CDI	-0,02 -2,80	-0,02 -2,80				-909,71	-909,71
LIMEIRA (Total)						2.490.590,83	2.490.590,83

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	17.635.757,05	0,00	0,00	0,00	17.642.456,51	6.699,46	6.699,46
BB PREV RF IDKA2	57.254.717,68	0,00	0,00	0,00	57.260.232,19	5.514,51	5.514,51
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	22.552.485,87	0,00	0,00	0,00	22.379.308,18	-173.177,69	-173.177,69
BB PREV RF IRF-M	20.487.710,09	0,00	0,00	0,00	20.461.634,00	-26.076,09	-26.076,09
BB PREV RF VII	433.916,56	0,00	0,00	0,00	436.365,24	2.448,68	2.448,68
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	623.116,35	0,00	0,00	0,00	624.936,94	1.820,59	1.820,59
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.999.876,52	0,00	0,00	0,00	16.994.552,23	-5.324,29	-5.324,29
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	126.735.579,87	11.350.000,00	-500.000,00	0,00	137.638.889,13	53.309,26	53.309,26
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	50.430.987,18	0,00	0,00	0,00	50.476.565,61	45.578,43	45.578,43

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	43.503.408,78	0,00	0,00	0,00	43.174.028,31	-329.380,47	-329.380,47
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.123.474,75	0,00	-600.000,00	0,00	22.661.075,36	137.600,61	137.600,61
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	16.071.185,48	0,00	0,00	0,00	15.984.878,46	-86.307,02	-86.307,02
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12.075.439,71	0,00	0,00	0,00	12.066.769,90	-8.669,81	-8.669,81
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	31.312.260,70	0,00	0,00	0,00	31.521.303,45	209.042,75	209.042,75
SANTANDER FI IMA-B 5 TOP RENDA FIXA LP	5.127.697,11	0,00	0,00	0,00	5.134.329,91	6.632,80	6.632,80
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	38.609.008,55	0,00	0,00	0,00	38.316.813,57	-292.194,98	-292.194,98
					492.774.138,99	0,00	0,00

Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1.326.035,76	0,00	0,00	0,00	1.332.196,67	6.160,91	6.160,91
					1.332.196,67	0,00	0,00

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	6.164.577,75	0,00	0,00	0,00	6.166.184,70	1.606,95	1.606,95
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO	8.240.813,11	0,00	0,00	0,00	8.263.424,07	22.610,96	22.610,96
					14.429.608,77	0,00	0,00

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AZ QUEST ACOES FIC FIA	1.754.881,60	0,00	0,00	0,00	1.890.409,16	135.527,56	135.527,56
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	15.815.018,15	0,00	0,00	0,00	16.874.023,04	1.059.004,89	1.059.004,89
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	2.703.676,89	0,00	0,00	0,00	2.879.022,34	175.345,45	175.345,45
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	11.065.975,06	0,00	0,00	0,00	11.189.698,28	123.723,22	123.723,22
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	2.510.575,84	0,00	0,00	0,00	2.636.194,62	125.618,78	125.618,78
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	12.024.304,00	0,00	0,00	0,00	13.163.810,73	1.139.506,73	1.139.506,73
GUEPARDO AÇÕES INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES	7.317.803,46	0,00	0,00	0,00	7.754.244,00	436.440,54	436.440,54

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	2.509.611,01	0,00	0,00	0,00	2.673.382,24	163.771,23	163.771,23
PERFIN INSTITUCIONAL FC FIA	8.117.982,45	0,00	0,00	0,00	8.313.015,72	195.033,27	195.033,27
XP INVESTOR FI DE ACOES	8.597.078,51	0,00	0,00	0,00	9.093.117,07	496.038,56	496.038,56
					76.466.917,20	0,00	0,00

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	7.000.088,64	0,00	0,00	0,00	6.256.878,29	-743.210,35	-743.210,35
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	2.811.496,80	0,00	0,00	0,00	2.537.487,28	-274.009,52	-274.009,52
					8.794.365,57	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.276.761,91	0,00	0,00	0,00	2.156.028,38	-120.733,53	-120.733,53
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	1.114.716,82	0,00	0,00	0,00	1.128.923,50	14.206,68	14.206,68
					3.284.951,88	0,00	0,00

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	152.509,72	0,00	0,00	0,00	152.028,94	-480,78	-480,78
W7 FIP MULTISTRATÉGIA	10.034.788,34	0,00	0,00	0,00	10.022.610,59	-12.177,75	-12.177,75
					10.174.639,53	0,00	0,00

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BR HOTÉIS FII	1.526.186,87	0,00	0,00	0,00	0,00	1.524.354,76	-1.832,11	-1.832,11
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	1.160.599,98	0,00	0,00	0,00	4.449,89	1.157.632,93	1.482,84	1.482,84
OSASCO PROPERTIES FII	1.783.799,29	0,00	0,00	0,00	0,00	1.783.238,85	-560,44	-560,44

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
						4.465.226,54	0,00	0,00

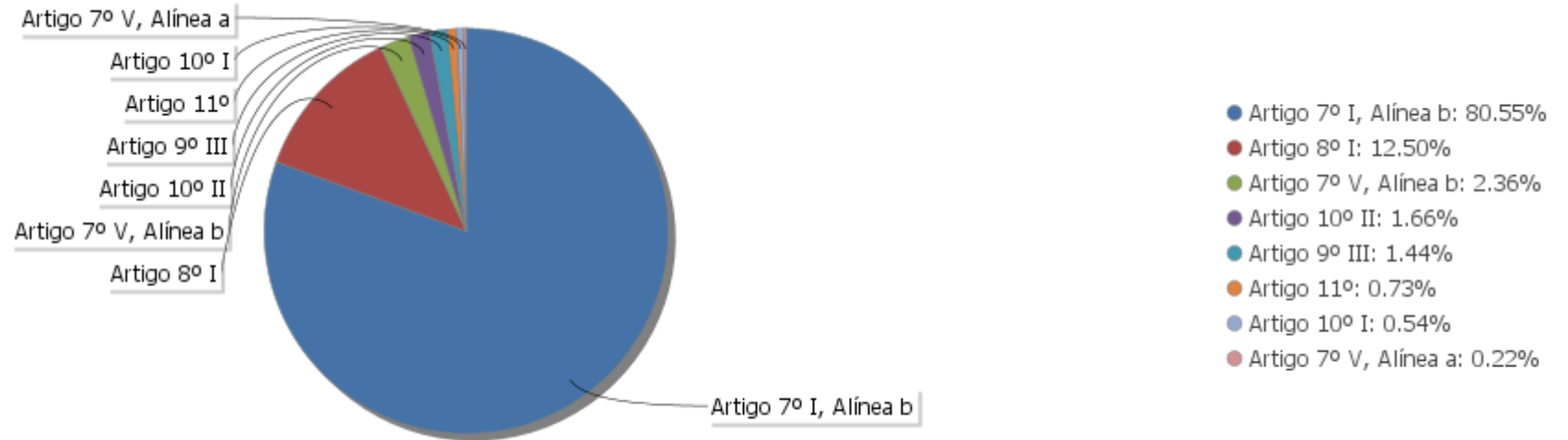
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

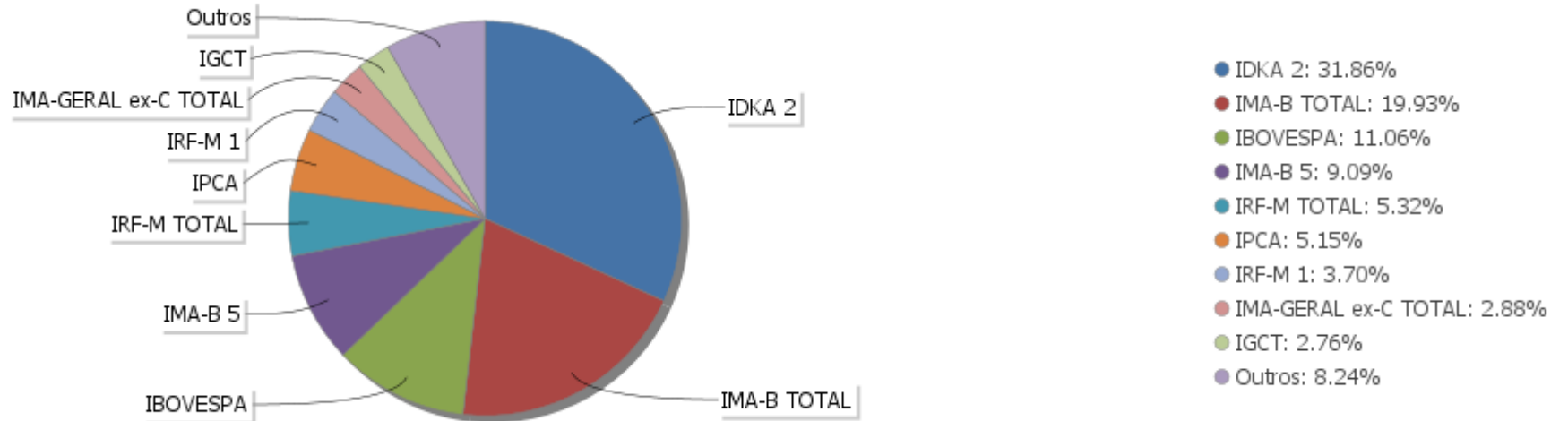
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	542.936.748,14	88,76	542.936.748,14	88,76
de 31 a 365 dias	44.999.623,14	7,36	587.936.371,28	96,11
acima de 365 dias	23.785.673,87	3,89	611.722.045,15	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

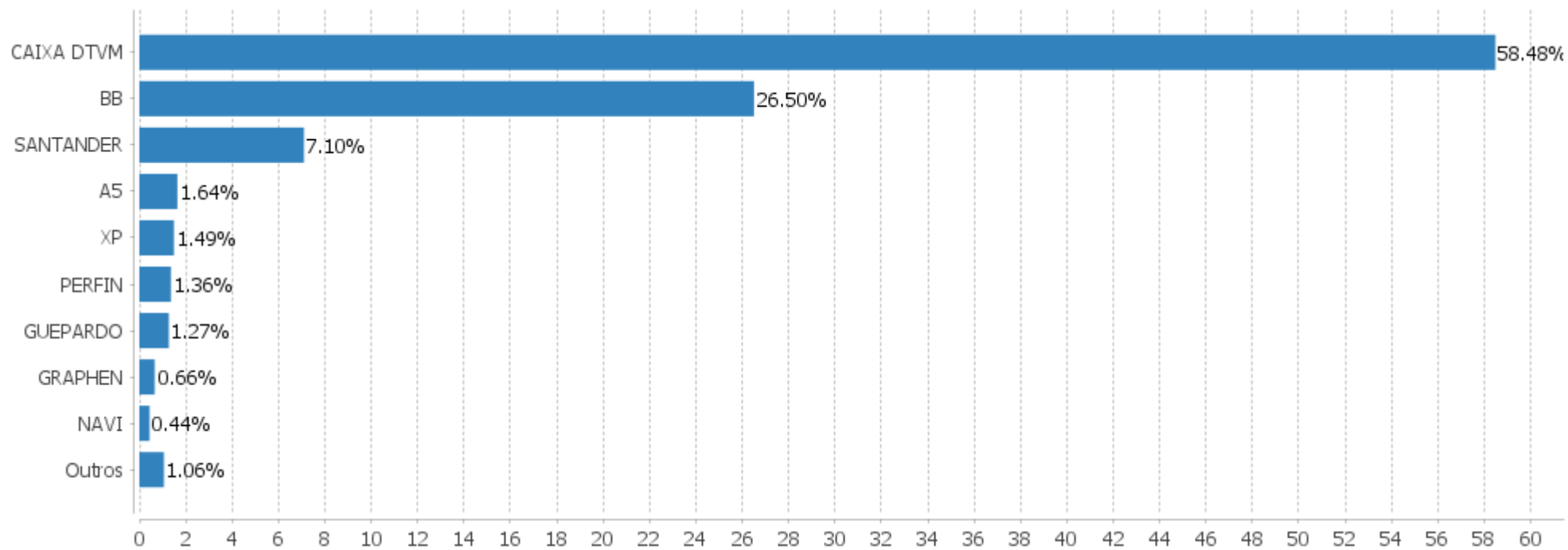


Alocação Por Estratégia



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
2022	0,39												0,39
IPCA + 5,89%	1,02												1,02
p.p. indexador	-0,63												-0,63
2021	-0,50	-1,09	0,52	1,07	1,22	0,17	-0,77	-0,76	-0,53	-2,26	1,91	0,86	-0,23
IPCA + 5,47%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,28	0,98	1,43	1,34	1,61	1,68	1,38	1,22	16,06
p.p. indexador	-1,18	-2,33	-0,90	0,33	-0,05	-0,81	-2,21	-2,10	-2,14	-3,94	0,54	-0,36	-16,29
2020	0,60	-0,35	-5,55	1,29	2,05	1,32	2,19	-0,04	-1,01	-0,16	2,24	2,91	5,34
IPCA + 5,89%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,89	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,65
p.p. indexador	-0,11	-1,01	-6,12	1,15	1,98	0,58	1,31	-0,76	-2,13	-1,50	0,89	1,05	-5,31
2019	2,23	0,30	0,51	1,03	1,71	2,00	1,10	-0,02	1,72	1,82	-0,40	1,66	14,50
IPCA + 6,00%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	1,40	-0,60	-0,69	-0,03	1,07	1,55	0,37	-0,65	1,27	1,19	-1,38	0,01	3,91
2018	1,94	0,39	0,93	0,56	-1,58	-0,01	1,40	-0,08	0,56	2,85	0,55	1,19	8,99
IPCA + 6,00%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
p.p. indexador	1,14	-0,35	0,35	-0,14	-2,47	-1,76	0,56	-0,52	-0,36	1,88	0,30	0,58	-0,93
2017	1,42	1,04	0,99	0,49	0,17	-0,90	1,32	0,75	1,09	0,41	-0,14	0,26	7,11
IPCA + 6,00%	0,89	0,75	0,78	0,56	0,82	0,26	0,73	0,72	0,62	0,91	0,74	0,91	9,05
p.p. indexador	0,52	0,29	0,20	-0,06	-0,65	-1,15	0,60	0,03	0,47	-0,50	-0,88	-0,64	-1,93

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	27	44,26
Meses abaixo - Meta Atuarial	34	55,74

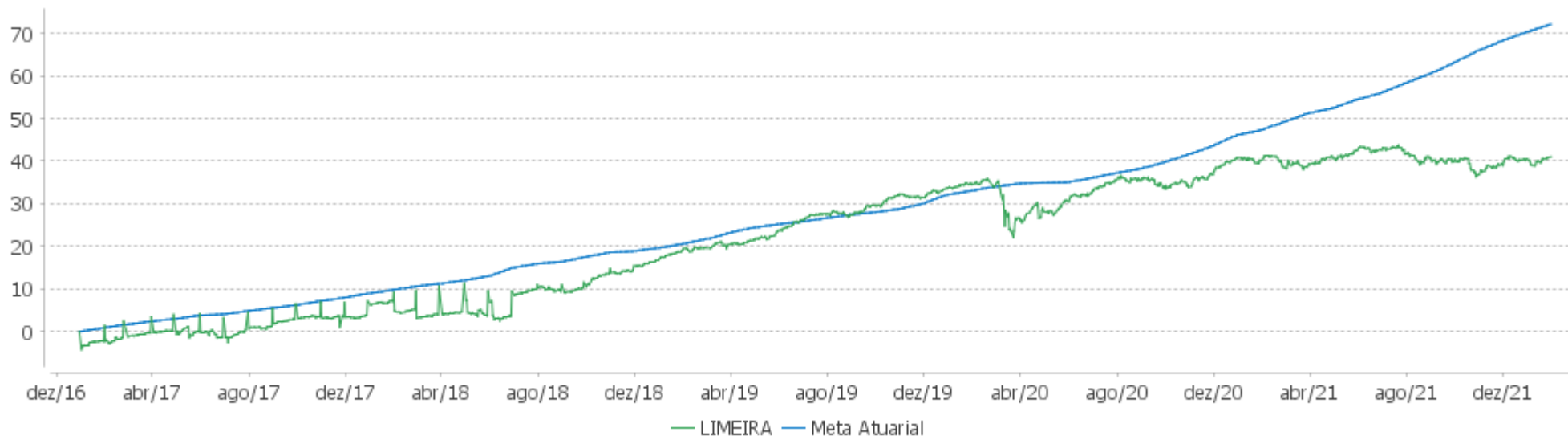
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,91	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-5,55	2020-03

Relatório

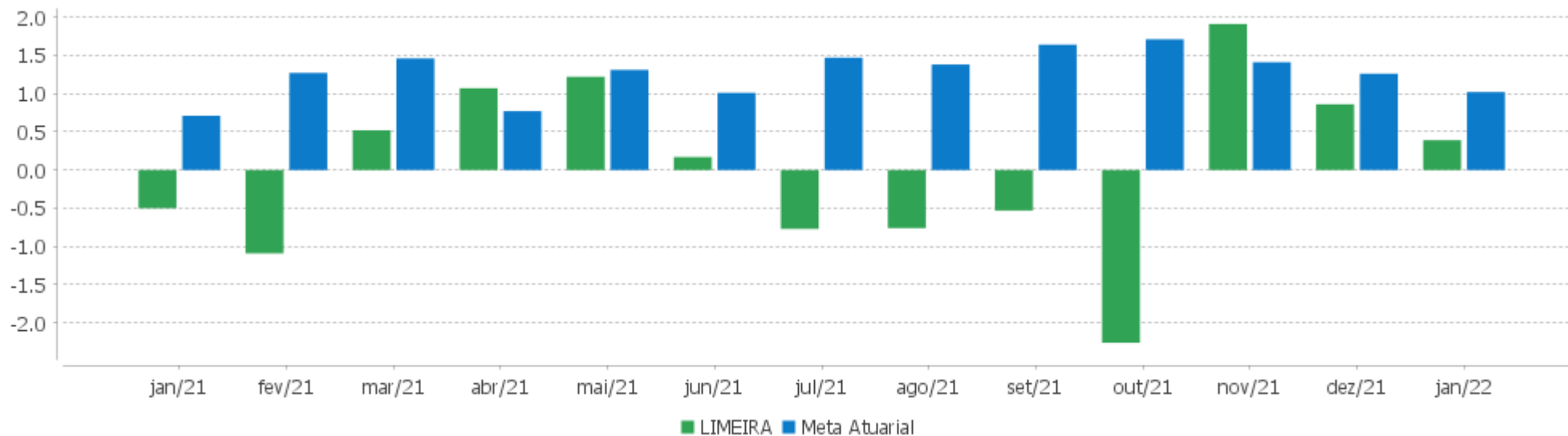
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	3,20	3,66	-0,47	3,94
06 meses	-0,43	8,54	-8,97	4,53
12 meses	0,66	16,46	-15,79	4,32
24 meses	4,88	28,81	-23,93	6,82
36 meses	18,17	42,28	-24,11	5,76
48 meses	29,16	56,44	-27,28	9,96
60 meses	39,06	70,44	-31,38	12,26
Desde 30/12/2016	41,03	71,96	-30,93	12,43

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC % do CDI	0,50 68,07	0,50 68,07	1,29 61,50	1,55 44,53	-0,35 -6,99	-4,92 -64,15	-5,03 -36,22
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,76 -0,02	-0,76 -0,02	2,87 -0,07	-1,06 -0,15	-1,42 -0,27	3,39 -0,62	21,71 -1,15
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,09 -0,02	0,09 -0,02	3,35 -0,08	3,20 -0,12	4,32 -0,25	11,89 -0,59	25,04 -1,00
SANTANDER FI IMA-B 5 TOP RENDA FIXA LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,13 0,02	0,13 0,02	3,34 -0,09	2,85 -0,48	3,60 -0,97	11,29 -1,18	24,50 -1,54
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,07 0,01	-0,07 0,01	3,64 0,01	-0,11 -0,08	-1,50 -0,22	3,17 -0,41	14,64 -0,82
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,29 1,03	0,29 1,03	3,20 0,26	3,63 4,54	5,12 6,26	12,47 8,45	26,37 3,51
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	-0,54 -0,04	-0,54 -0,04	3,95 -0,06	-1,62 -0,21	-4,49 -0,37	0,83 -0,57	14,18 -0,99
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,56 1,30	0,56 1,30	2,91 -0,03	4,19 5,10	6,86 8,01	12,96 8,94	23,37 0,51
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,01 -0,04	0,01 -0,04	3,16 -0,25	3,11 -0,18	4,47 -0,40	12,51 -0,97	24,08 -1,89
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,04	0,04	2,70	0,57	0,19	4,20	16,07
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,67 0,13	0,67 0,13	2,42 0,18	0,62 -5,00	0,53 -9,85	6,39 -9,02	21,39 1,14
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03 0,70	-0,03 0,70	3,55 0,61	2,96 3,87	3,09 4,24	11,06 7,04	28,42 5,56
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,02 -0,03	0,02 -0,03	3,17 -0,24	3,14 -0,15	4,54 -0,33	12,57 -0,90	24,17 -1,81
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,13 -0,05	-0,13 -0,05	3,58 -0,05	-0,22 -0,19	-1,62 -0,34	2,96 -0,62	14,51 -0,94
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,61 -0,02	0,61 -0,02	2,25 -0,06	2,44 -0,10	3,30 -0,23	6,63 -0,45	13,45 -0,71
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,77 -0,03	-0,77 -0,03	2,85 -0,08	-1,09 -0,18	-1,42 -0,27	3,46 -0,56	21,90 -0,96
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	-0,76	-0,76	2,87	-1,03	-1,41	3,20	21,54

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,02	-0,06	-0,12	-0,26	-0,82	-1,32
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,03 -1,00	0,03 -1,00	3,59 -0,17	3,50 -5,28	4,00 -13,00	11,46 -18,13	24,29 -18,86
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,27 -0,76	0,27 -0,76	3,14 -0,62	1,62 -7,15	2,65 -14,35	9,55 -20,04	26,24 -16,91
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,00 -1,98	5,00 -1,98	-2,71 -11,06	-28,15 -20,22	-27,93 -25,39	-24,27 -22,85	-0,04 -15,18
AZ QUEST ACOES FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	7,72 0,74	7,72 0,74	5,42 -2,93	-12,07 -4,15	-7,60 -5,06	-16,70 -15,28	3,53 -11,61
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	6,53 -0,46	6,53 -0,46	12,24 3,89	-4,25 3,67	6,03 8,57	7,42 8,84	31,99 16,85
PERFIN INSTITUCIONAL FC FIA Var. IBOVESPA p.p.	2,40 -4,58	2,40 -4,58	-1,33 -9,68	-22,16 -14,23	-17,81 -15,27	-28,46 -27,04	-5,14 -20,28
XP INVESTOR FI DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	5,77 -1,21	5,77 -1,21	8,29 -0,06	-13,39 -5,46	-4,99 -2,45	-15,99 -14,57	18,63 3,49
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p.	9,48 2,49	9,48 2,49	10,23 1,88	-8,18 -0,25	-4,17 -1,63	-6,79 -5,37	26,23 11,08
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	6,49 -0,50	6,49 -0,50	8,64 0,29	-2,97 4,96	5,03 7,57	11,07 12,49	
GUEPARDO AÇÕES INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	5,96 -1,02	5,96 -1,02	16,23 7,88	4,51 12,44	18,74 21,28	27,26 28,68	117,37 102,22
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	1,12 -5,87	1,12 -5,87	-0,70 -9,06	-18,56 -10,63	-9,19 -6,65	-16,03 -14,61	14,26 -0,88
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	6,70 -0,14	6,70 -0,14	8,41 -0,22	-9,80 -0,39	-2,87 -0,77	-2,40 -1,77	17,07 -3,15
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	-9,75 0,09	-9,75 0,09	-9,03 -0,12	3,11 -0,27	11,35 -2,22	71,14 -3,19	143,50 -6,48
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	-10,62 -17,60	-10,62 -17,60	-9,28 -17,63	3,95 11,88	12,50 15,04	68,78 70,20	122,31 107,17
FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP % do CDI	1,27 174,04	1,27 174,04	3,05 145,32	-0,01 -0,21	2,83 56,50	5,63 73,40	21,12 151,94
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	-5,30 3,74	-5,30 3,74	-0,53 6,39	5,52 -1,95	25,85 6,91	39,39 -36,27	71,27 -73,70
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,32 -1,34	-0,32 -1,34	-0,93 -4,69	-1,83 -10,60	143,17 126,17	-92,74 -122,33	-92,74 -135,89
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,12	-0,12	-0,37	-0,73	-1,47	1,27	-0,72

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	-16,57	-16,57	-17,68	-20,89	-29,47	16,63	-5,17
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO Var. IFIX p.p.	0,13 1,12	0,13 1,12	0,38 -3,40	0,52 2,20	1,76 5,32	3,78 13,54	5,10 -10,14
OSASCO PROPERTIES FII Var. IBOVESPA p.p.	-0,03 -7,02	-0,03 -7,02	-0,20 -8,55	0,03 7,96	3,35 5,89	-53,90 -52,47	-54,66 -69,81
BR HOTÉIS FII Var. IFIX p.p.	-0,12 0,87	-0,12 0,87	-2,33 -6,11	-2,70 -1,03	-3,53 0,03	-6,69 3,07	-7,03 -22,27
LIMEIRA Var. IPCA + 5,89% p.p.	0,39 -0,63	0,39 -0,63	3,20 -0,54	-0,43 -9,15	0,66 -16,22	4,88 -24,44	18,17 -24,54
CDI	0,73	0,73	2,10	3,47	5,00	7,66	13,90
IBOVESPA	6,98	6,98	8,35	-7,93	-2,54	-1,42	15,14
INPC + 6,00%	1,16	1,16	3,78	8,75	17,24	31,05	44,93
IPCA + 6,00%	1,03	1,03	3,76	8,77	17,00	29,59	43,15

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
AZ QUEST ACOES FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	Para informações adicionais, vide o Regulamento	2,00
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,60
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC 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 CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	D+0	D+0	D+30 ou D+0 a D+2880 (isento de taxa de resgate de acordo com a data de solicitação)	D+30 ou D+0 a D+2880 (isento de taxa de resgate de acordo com a data de solicitação)		0,20
BB PREV RF IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IRF-M	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF VII	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BR HOTÉIS FII	Não se aplica	Não se aplica				
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)	D+4 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)		3,00
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 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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO	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 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,50
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	D+1 du	D+0	D+21 du	D+23 du		1,72
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATEGIA	Não se aplica	Não se aplica				
GUEPARDO AÇÕES INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)	D+3 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)	O fundo cobrará 20.00 % do que exceder 100.00 % o índice IBOV_FEC. A taxa de performance será paga no(s) mês(es) de Janeiro e Julho	1,90
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	Não se aplica	Não se aplica				
LEME MULTISETORIAL IPCA FIDC	D+0	D+0				
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32	-	1,50
OSASCO PROPERTIES FII	Não se aplica	Não se aplica				
PERFIN INSTITUCIONAL FC FIA	D+0	D+0	D+30	D+32	-	1,85
SANTANDER FI IMA-B 5 TOP RENDA FIXA LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,30
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,20
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se aplica	Não se aplica				
XP INVESTOR FI DE ACOES	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	Para informações adicionais, vide o Regulamento	2,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,63	0,63	2,31	2,54	3,53	7,08	14,16	22,11	34,75
IRF-M 1+	-0,50	-0,50	4,01	-1,41	-4,13	1,40	15,16	29,50	49,44
IRF-M TOTAL	-0,08	-0,08	3,63	-0,03	-1,28	3,58	15,45	27,96	45,98
IMA-B 5	0,11	0,11	3,42	3,32	4,57	12,47	26,04	38,75	56,48
IMA-B 5+	-1,61	-1,61	2,45	-4,92	-6,47	-3,03	18,62	39,06	60,95
IMA-B TOTAL	-0,73	-0,73	2,94	-0,91	-1,15	4,02	22,86	40,20	60,52
IMA-GERAL TOTAL	0,21	0,21	2,90	1,13	1,42	5,98	17,98	30,01	46,61
IDKA 2	0,05	0,05	3,41	3,29	4,87	13,47	25,98	38,94	57,36
IDKA 20	-2,92	-2,92	0,64	-12,61	-14,59	-13,99	10,19	35,73	59,77
CDI	0,73	0,73	2,10	3,47	5,00	7,66	13,90	21,17	32,56

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,98	6,98	8,35	-7,93	-2,54	-1,42	15,14	32,07	73,41
IBRX 100	6,87	6,87	8,36	-9,14	-2,11	-0,51	18,37	36,58	79,96
IBRX 50	7,65	7,65	9,69	-8,20	-0,93	1,71	16,71	32,14	74,76
SMALL CAP	3,42	3,42	4,89	-17,43	-10,25	-14,29	24,49	41,16	97,42
IFIX	-0,99	-0,99	3,78	-1,67	-3,56	-9,76	15,24	21,52	43,53
Índice Consumo - ICON			-5,43	-22,83	-23,46	-26,51	5,30	5,50	37,84
Índice Dividendos - IDIV	7,47	7,47	10,17	0,27	5,96	1,18	28,50	52,53	93,40

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,54	0,54	2,24	5,63	10,38	15,41	20,25	24,79	28,35
INPC	0,67	0,67	2,26	5,61	10,60	16,72	21,74	26,09	28,45
IGPM	1,82	1,82	2,72	3,40	16,91	46,97	58,45	69,12	68,43
SELIC	0,73	0,73	2,10	3,47	5,00	7,66	13,90	21,18	32,59

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-9,05	-9,05	-6,91	7,47	18,94	75,67	144,98	170,90	239,48
MSCI ACWI	-8,76	-8,76	-8,61	3,62	9,17	61,14	114,25	124,36	183,76
MSCI World									

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,87	0,87	3,26	7,73	14,79	24,77	35,22	45,90	55,99
IPCA + 5,00%	0,95	0,95	3,51	8,26	15,90	27,17	39,15	51,57	63,59
IPCA + 5,50%	0,99	0,99	3,64	8,51	16,45	28,37	41,14	54,46	67,50
IPCA + 5,89%	1,02	1,02	3,73	8,72	16,88	29,32	42,71	56,75	70,61
IPCA + 6,00%	1,03	1,03	3,76	8,77	17,00	29,59	43,15	57,40	71,49
INPC + 4,00%	1,00	1,00	3,28	7,71	15,02	26,18	36,90	47,41	56,11
INPC + 6,00%	1,16	1,16	3,78	8,75	17,24	31,05	44,93	59,03	71,61

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
259	06/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	600.000,00	223.420,74991000	2,6855160000
261	06/01/2022	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	500.000,00	199.803,23368900	2,5024620000
260	11/01/2022	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.500.000,00	0,00	2.198.220,32082800	2,5020240000
262	11/01/2022	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.400.000,00	0,00	2.158.252,67863100	2,5020240000
263	26/01/2022	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	450.000,00	0,00	178.817,23130500	2,5165360000
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 12.901.753,76

Value-At-Risk: 2,11%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LIMEIRA		2,11	2,11			611.722.045,15	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,44%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF-M		1,78	0,04	0,02			20.461.634,00	3,34
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,14	0,06	0,03			22.379.308,18	3,66
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,15	0,11	0,01			43.174.028,31	7,06
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,63	0,01	0,02			22.661.075,36	3,70
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,06	0,06	0,01			50.476.565,61	8,25
BB PREV RF IDKA2		1,36	0,09	0,38			57.260.232,19	9,36
SANTANDER RF IMA-B PREMIUM FIC FI LONGO PR		2,15	0,10	0,00			38.316.813,57	6,26
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP		2,52	0,05	0,03			15.984.878,46	2,61
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,60	0,25	0,26			137.638.889,13	22,50
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,79	0,03	0,02			12.066.769,90	1,97
BB PREV RF VII		0,77	0,00	2,08			436.365,24	0,07
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI		1,02	0,00	1,55			624.936,94	0,10
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,11	0,02	1,75			17.642.456,51	2,88
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,74	0,02	0,76			31.521.303,45	5,15
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,56	0,03	1,12			16.994.552,23	2,78
SANTANDER FI IMA-B 5 TOP RENDA FIXA LP		1,24	0,01	0,20			5.134.329,91	0,84
Sub-total	2,48	1,45	0,89		-0,34	-0,10	492.774.138,99	80,56

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
-------	-----------------------------	--------------------	---------------------	---------------------	--------	-------	------------	------------

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC		0,08	-0,00	0,09			1.332.196,67	0,22
Sub-total	1,73	0,08	-0,00		-0,15	0,46	1.332.196,67	0,22

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI		1,18	0,01	1,19			6.166.184,70	1,01
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CRÉDITO PRIVADO		1,23	0,01	1,24			8.263.424,07	1,35
Sub-total	2,08	1,20	0,02		-0,27	0,17	14.429.608,77	2,36

Renda Variável

Value-At-Risk: 11,35%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AZ QUEST ACOES FIC FIA		8,76	0,02	3,16			1.890.409,16	0,31
XP INVESTOR FI DE ACOES		10,68	0,13	4,48			9.093.117,07	1,49
GUEPARDO AÇÕES INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES		13,88	0,13	6,94			7.754.244,00	1,27
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		11,27	0,25	0,10			16.874.023,04	2,76
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		16,66	0,06	9,38			2.636.194,62	0,43
NAVI INSTITUCIONAL FIC DE FIA		11,31	0,04	4,09			2.673.382,24	0,44
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS		10,91	0,19	2,12			13.163.810,73	2,15
PERFIN INSTITUCIONAL FC FIA		13,61	0,15	7,00			8.313.015,72	1,36
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI		10,69	0,04	2,50			2.879.022,34	0,47
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI		11,92	0,18	3,23			11.189.698,28	1,83
Sub-total	20,32	11,35	1,20		0,24	5,59	76.466.917,20	12,50

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 1,41%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP		1,76	0,00	1,76			1.128.923,50	0,18

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		8,33	0,01	5,87			2.156.028,38	0,35
Sub-total	12,20	5,77	0,01		-0,32	-3,14	3.284.951,88	0,54

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA		0,07	-0,00	0,11			152.028,94	0,02
W7 FIP MULTISTRATÉGIA		0,03	-0,00	0,05			10.022.610,59	1,64
Sub-total	0,43	0,03	-0,00		-1,99	-0,12	10.174.639,53	1,66

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 8,88%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		9,01	-0,01	0,89			2.537.487,28	0,41
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I		9,06	-0,01	14,69			6.256.878,29	1,02
Sub-total	21,11	8,88	-0,02		-0,53	-10,37	8.794.365,57	1,44

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 0,04%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BR HOTÉIS FII		0,12	-0,00	3,11			1.524.354,76	0,25
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO		0,02	-0,00	3,11			1.157.632,93	0,19
OSASCO PROPERTIES FII		0,02	0,00	10,77			1.783.238,85	0,29
Sub-total	0,55	0,04	-0,00		-1,36	-0,02	4.465.226,54	0,73