

Relatório Analítico dos Investimentos

em fevereiro de 2022



Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	66.630.377,82	13,83%	536	0,97%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.468.628,39	1,55%	1.027	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	41.367.736,52	8,59%	789	0,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	1.064.632,98	0,22%	251	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	43.436.235,27	9,02%	624	0,69%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	35.987.020,52	7,47%	1.120	0,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	15.966.532,51	3,32%	173	0,97%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	1.314.275,09	0,27%	140	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	6.984.570,49	1,45%	115	1,49%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.993.386,79	0,41%	165	0,81%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	1.228.188,88	0,26%	92	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	697.440,48	0,14%	45	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	2024-08-15	34.355.224,82	7,13%	114	3,84%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	463 dias	10.059.292,41	2,09%	105	0,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	507.670,20	0,11%	105	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	3.320.080,73	0,69%	38	1,51%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	24.855.357,52	5,16%	117	1,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	11.681.494,22	2,43%	931	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.849.558,20	1,01%	1.058	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.979.574,45	1,03%	1.018	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2022)

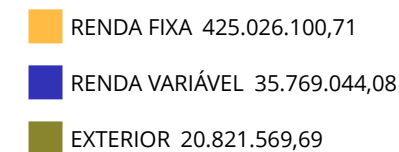
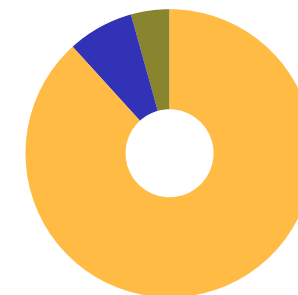
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	7.563.499,61	1,57%	292	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	14.776.030,84	3,07%	829	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	9.031.416,61	1,88%	1.226	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	26.965.028,31	5,60%	895	0,35%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	12.751.383,97	2,65%	138	1,31%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	20.368.716,31	4,23%	282	0,87%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.621.482,82	0,54%	82	0,48%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	1.977.048,17	0,41%	477	0,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO...	D+1	Não há	3.037.642,15	0,63%	289	0,91%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	6.214.213,63	1,29%	70	1,01%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	D+0	18/04/2018	972.360,00	0,20%	96	0,48%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	3.804.894,72	0,79%	816	0,81%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	4.870.111,13	1,01%	2.448	0,43%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	5.241.884,91	1,09%	48.094	0,41%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.325.030,19	0,48%	3.780	0,97%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.515.243,91	0,31%	9.615	0,18%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	9.615.297,43	2,00%	22.543	0,87%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	11.206.272,26	2,33%	530	0,38%	Artigo 9º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	3.141.574,61	0,65%	102	2,67%	Artigo 10º, Inciso I
BB DINÂMICO FIC MULTIMERCADO LP	D+4 du	Não há	6.881.521,79	1,43%	13.567	0,93%	Artigo 10º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	1.936.123,05	0,40%	200	0,61%	Artigo 10º, Inciso I
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	1.893.498,80	0,39%	49.402	0,08%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	2.194.778,82	0,46%	135	0,22%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.184.622,15	0,25%	11.401	0,10%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	779.760,00	0,16%		0,76%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			481.616.714,48				

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Fevereiro / 2022)

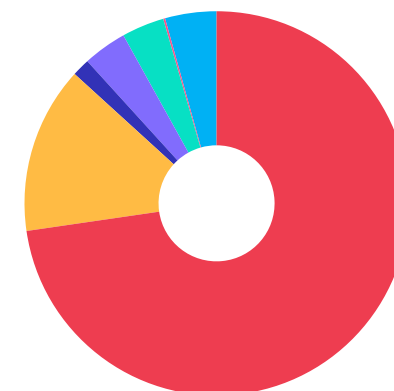
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	30,00%	144.485.014,34
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	350.118.225,35	72,70%	14,00%	56,00%	80,00%	35.175.146,23
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	67.721.301,73	14,06%	0,00%	12,00%	50,00%	173.087.055,51
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,00%	20,00%	96.323.342,90
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	7.186.573,63	1,49%	0,00%	2,00%	5,00%	16.894.262,09
Total Renda Fixa	100,00%	425.026.100,71	88,25%	14,00%	79,00%	185,00%	



Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Fevereiro / 2022)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	17.757.164,86	3,69%	0,00%	6,50%	30,00%	126.727.849,48
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	17.232.119,22	3,58%	0,00%	5,00%	10,00%	30.929.552,23
Artigo 11º	5,00%	779.760,00	0,16%	0,00%	0,50%	1,00%	4.036.407,14
Total Renda Variável	30,00%	35.769.044,08	7,43%	0,00%	12,00%	41,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,50%	5,00%	24.080.835,72
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	20.821.569,69	4,32%	0,00%	7,50%	10,00%	27.340.101,76
Total Exterior	10,00%	20.821.569,69	4,32%	0,00%	9,00%	15,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Fevereiro / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	329.058.398,94	68,32	0,02
CAIXA DTVM	144.922.142,40	30,09	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	4.598.530,99	0,95	0,00
SICREDI	3.037.642,15	0,63	0,01

Artigo 20º - 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) - (Resolução 4963)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2022		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	350.118.225,35	72,70	14,00	80,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	67.721.301,73	14,06	0,00	50,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	7.186.573,63	1,49	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	17.757.164,86	3,69	0,00	30,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	20.821.569,69	4,32	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	17.232.119,22	3,58	0,00	10,00
Artigo 11º	779.760,00	0,16	0,00	1,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2022 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,26%	1,31%	2,15%	4,31%	6,70%	14,12%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	1,17%	1,88%	4,11%	6,26%	13,10%	1,13%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,13%	1,70%	2,29%	4,89%	8,08%	15,78%	0,44%	0,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,15%	1,17%	1,89%	4,12%	6,30%	13,19%	1,15%	0,03%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	1,45%	2,50%	3,80%	8,85%	17,20%	30,60%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,05%	1,33%	2,03%	3,60%	4,39%	9,89%	1,07%	0,03%
IMA-B 5+ (Benchmark)	0,01%	-1,60%	-1,93%	-2,75%	-4,23%	-3,33%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,02%	-1,65%	-1,97%	-2,92%	-4,52%	-4,01%	2,67%	0,07%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,02%	-1,60%	-1,93%	-2,98%	-4,67%	-3,94%	2,65%	0,07%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,74%	1,38%	2,27%	2,93%	4,26%	7,47%	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	0,80%	1,54%	2,42%	3,28%	4,59%	7,66%	0,26%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,73%	1,34%	2,20%	2,83%	4,03%	7,01%	0,32%	0,01%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,74%	1,36%	2,21%	2,84%	4,00%	6,81%	0,32%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,06%	1,18%	1,97%	4,26%	6,32%	12,94%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,05%	1,13%	1,90%	4,10%	6,00%	12,30%	1,07%	0,03%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,05%	1,14%	1,92%	4,15%	6,07%	12,36%	1,06%	0,03%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2022 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,47%	-1,50%	-0,67%	1,47%	0,33%	0,88%	4,58%	0,05%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,70%	-1,73%	-0,90%	1,23%	0,09%	0,65%	4,96%	0,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,06%	-	-	-	-	-	1,33%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,38%	1,47%	2,03%	4,19%	6,58%	13,51%	0,75%	0,03%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,65%	-0,50%	0,80%	5,82%	10,92%	16,59%	4,76%	0,04%
IMA-B (Benchmark)	0,54%	-0,19%	0,03%	0,73%	0,92%	4,12%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,53%	-0,24%	-0,04%	0,58%	0,65%	3,56%	1,77%	0,05%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,53%	-0,23%	-0,03%	0,61%	0,65%	3,48%	1,78%	0,05%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	0,48%	-0,28%	-0,06%	0,55%	0,66%	3,48%	1,79%	0,05%
CDI (Benchmark)	0,75%	1,49%	2,26%	3,81%	5,65%	8,15%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,62%	0,65%	1,57%	1,65%	1,74%	4,37%	0,87%	0,03%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,82%	1,62%	2,45%	4,23%	6,40%	8,24%	0,03%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,80%	1,59%	2,40%	4,02%	6,01%	8,16%	0,02%	0,01%
IPCA (Benchmark)	1,01%	1,56%	2,30%	5,77%	10,54%	16,29%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11%	1,50%	2,17%	4,65%	7,36%	13,34%	0,58%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,13%	1,70%	2,29%	4,90%	8,10%	15,41%	0,44%	0,02%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,03%	1,05%	1,91%	4,35%	6,21%	12,25%	1,29%	0,03%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2022 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,13%	1,70%	2,29%	4,89%	8,08%	13,76%	0,44%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10%	1,39%	2,11%	4,52%	6,99%	13,03%	0,72%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,81%	1,48%	2,32%	2,93%	1,86%	6,59%	0,35%	0,03%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,92%	1,74%	2,50%	3,80%	2,90%	-	0,12%	0,02%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,72%	1,05%	1,83%	2,95%	4,40%	6,48%	0,41%	0,02%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-	-	-	-	-	-	-	-

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-6,82%	-15,98%	-14,54%	-5,81%	1,83%	72,27%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-5,82%	-15,82%	-13,38%	-4,95%	1,87%	66,41%	13,40%	0,19%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-7,12%	-16,17%	-14,74%	-6,50%	-0,12%	68,54%	13,05%	0,19%

IDIV (Benchmark)	-2,32%	4,98%	6,66%	-1,56%	9,19%	5,34%	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-2,38%	4,68%	6,28%	-2,14%	7,80%	-5,06%	5,17%	0,16%

Ibovespa (Benchmark)	0,89%	7,94%	11,02%	-4,75%	2,82%	8,61%	-	-
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-2,55%	-1,46%	0,02%	-18,29%	-10,29%	-11,18%	5,91%	0,18%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	0,56%	7,33%	10,66%	-5,65%	-0,38%	1,38%	5,92%	0,16%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-0,37%	3,30%	7,52%	-1,86%	9,72%	16,21%	6,03%	0,14%

SMLL (Benchmark)	-5,19%	-1,95%	1,77%	-18,60%	-13,32%	-11,41%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-5,20%	-1,43%	2,75%	-18,56%	-13,65%	-13,95%	9,12%	0,21%

CDI (Benchmark)	0,75%	1,49%	2,26%	3,81%	5,65%	8,15%	-	-
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,94%	2,27%	3,45%	3,11%	4,87%	8,71%	0,61%	0,02%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,73%	1,64%	2,83%	3,63%	5,65%	7,03%	0,35%	0,01%
BB DINÂMICO FIC MULTIMERCADO LP	0,90%	1,82%	2,67%	3,00%	4,08%	6,14%	0,26%	0,01%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1,00%	1,73%	3,10%	2,94%	3,80%	-	0,76%	0,02%

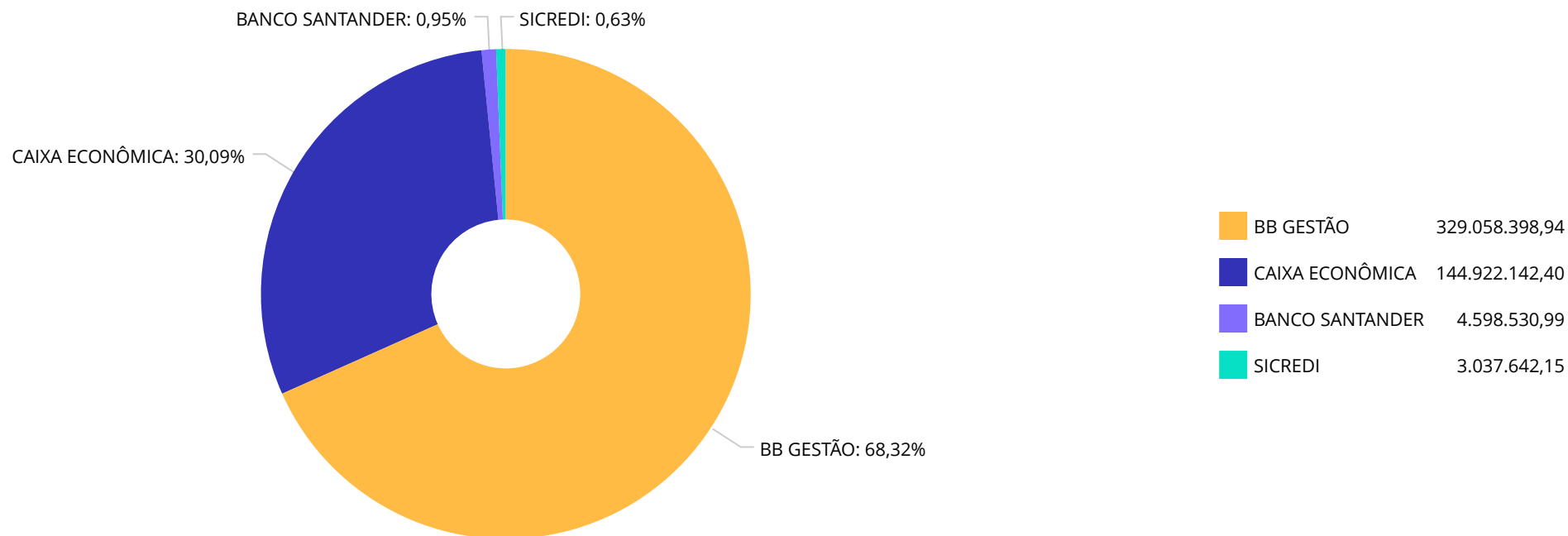
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,96%	3,66%	4,98%	1,92%	4,59%	8,27%	1,87%	0,05%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,93%	2,37%	3,83%	2,49%	4,97%	10,22%	1,56%	0,03%
IFIX (Benchmark)	-1,29%	-2,27%	6,31%	-0,32%	-5,04%	-7,51%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-5,14%	-4,78%	-4,44%	-11,59%	-33,69%	-55,92%	11,63%	0,13%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

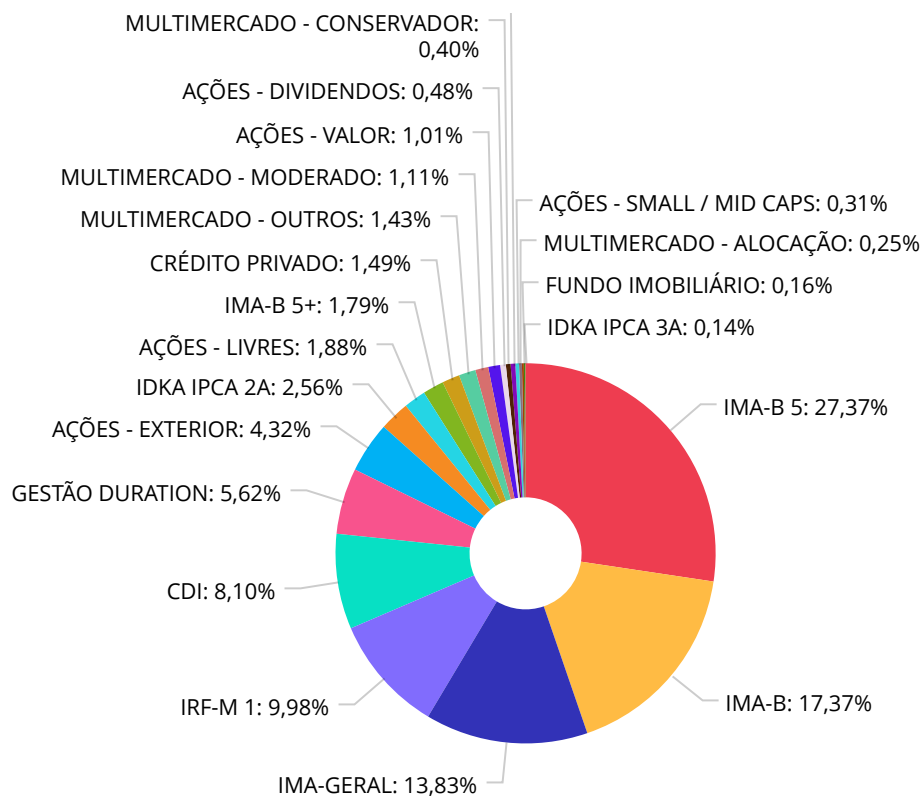
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-6,82%	-15,98%	-14,54%	-5,81%	1,83%	72,27%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-5,82%	-15,82%	-13,38%	-4,95%	1,87%	66,41%	13,40%	0,19%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-7,12%	-16,17%	-14,74%	-6,50%	-0,12%	68,54%	13,05%	0,19%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Fevereiro / 2022)





Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Fevereiro / 2022)

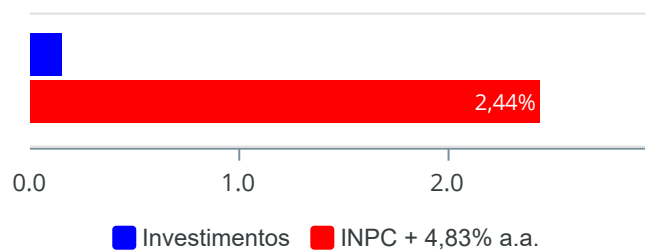


IMA-B 5	131.816.658,19
IMA-B	83.636.922,23
IMA-GERAL	66.630.377,82
IRF-M 1	48.056.079,28
CDI	39.001.368,89
GESTÃO DURATION	27.054.361,01
AÇÕES - EXTERIOR	20.821.569,69
IDKA IPCA 2A	12.318.186,59
AÇÕES - LIVRES	9.046.779,63
IMA-B 5+	8.628.132,59
CRÉDITO PRIVADO	7.186.573,63
MULTIMERCADO - OUTROS	6.881.521,79
MULTIMERCADO - MODERADO	5.336.353,43
AÇÕES - VALOR	4.870.111,13
AÇÕES - DIVIDENDOS	2.325.030,19
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	1.936.123,05
MULTIMERCADO - MACRO	1.893.498,80
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.515.243,91
MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	1.184.622,15

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2022

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	480.241.025,44	48.646.335,80	47.850.000,00	479.933.926,35	-1.103.434,89	-1.103.434,89	-0,23%	-0,23%	1,07%	1,07%	-21,44%	1,69%
Fevereiro	479.933.926,35	31.464.329,76	31.583.045,58	481.616.714,48	1.801.503,95	698.069,06	0,38%	0,15%	1,36%	2,44%	5,94%	1,94%

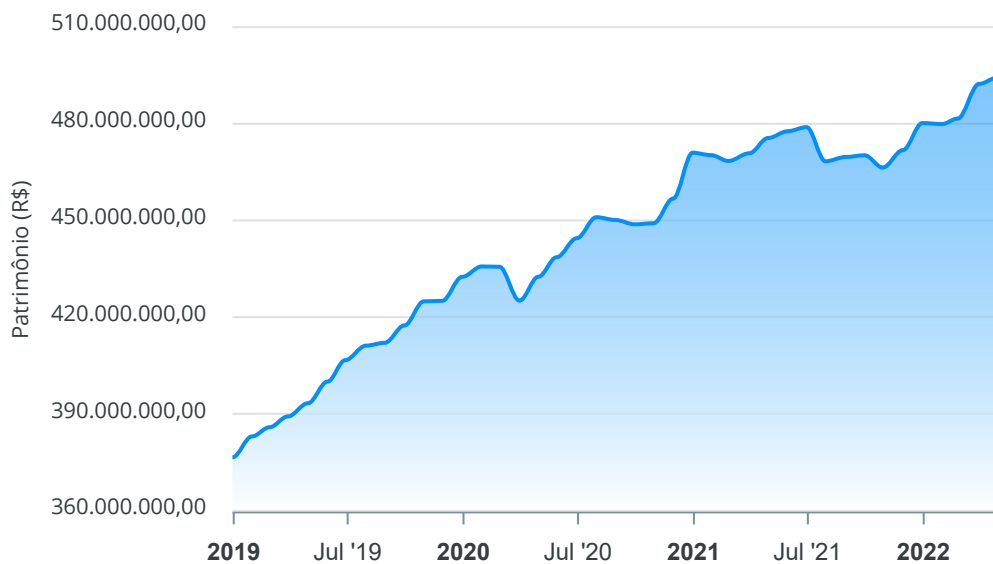
Investimentos x Meta de Rentabilidade



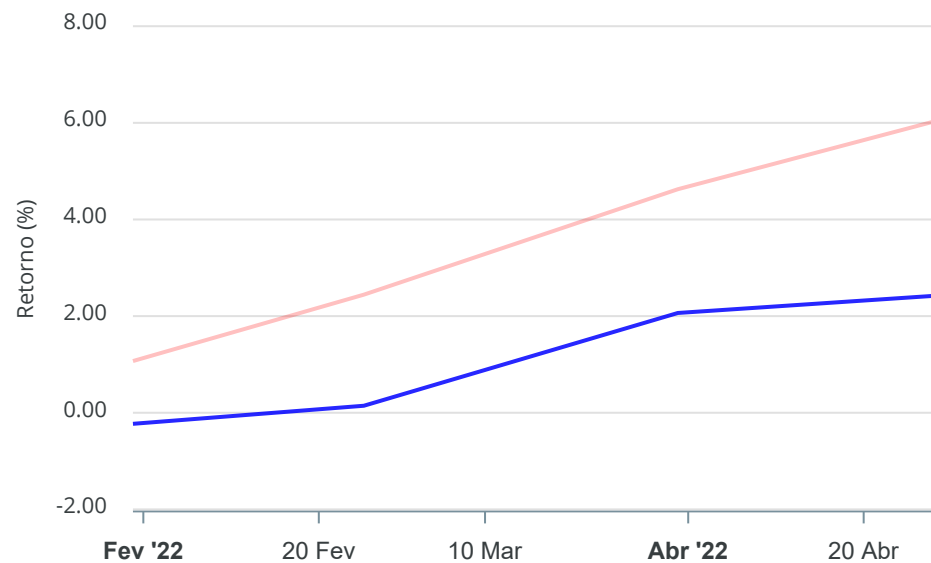
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- 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 Fevereiro/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	7.383.227,85	0,00	0,00	7.468.628,39	85.400,54	1,16%	1,16%	1,13%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.794.600,06	0,00	0,00	4.849.558,20	54.958,14	1,15%	1,15%	1,15%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.375.717,05	0,00	93.818,25	3.320.080,73	38.181,93	1,13%	-1,65%	4,76%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	7.103.104,66	0,00	197.486,20	6.984.570,49	78.952,03	1,11%	1,13%	0,44%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	709.241,45	0,00	19.674,20	697.440,48	7.873,23	1,11%	1,13%	0,44%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	2.028.759,45	0,00	57.890,98	1.993.386,79	22.518,32	1,11%	1,13%	0,44%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	1.336.697,77	0,00	37.027,50	1.314.275,09	14.604,82	1,09%	1,11%	0,58%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.249.229,82	0,00	34.571,06	1.228.188,88	13.530,12	1,08%	1,10%	0,72%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	40.936.121,88	0,00	0,00	41.367.736,52	431.614,64	1,05%	1,05%	1,07%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.927.787,13	0,00	0,00	4.979.574,45	51.787,32	1,05%	1,05%	1,06%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	516.469,20	0,00	14.222,66	507.670,20	5.423,66	1,05%	-1,70%	4,96%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	34.979.053,02	0,00	991.106,57	34.355.224,82	367.278,37	1,05%	1,06%	1,33%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	962.259,50	0,00	0,00	972.360,00	10.100,50	1,05%	1,05%	1,07%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	25.226.933,24	0,00	636.248,16	24.855.357,52	264.672,44	1,05%	-1,47%	4,58%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	6.151.165,03	0,00	0,00	6.214.213,63	63.048,60	1,02%	1,02%	1,29%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	12.634.626,98	0,00	0,00	12.751.383,97	116.756,99	0,92%	0,92%	0,12%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	1.960.949,24	0,00	0,00	1.977.048,17	16.098,93	0,82%	0,82%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	837.637,08	15.000.000,00	0,00	15.966.532,51	128.895,43	0,81%	1,38%	0,75%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	11.588.123,59	0,00	0,00	11.681.494,22	93.370,63	0,81%	0,81%	0,35%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	2.602.766,25	0,00	0,00	2.621.482,82	18.716,57	0,72%	0,72%	0,41%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Fevereiro/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	26.782.974,91	4.464.329,76	4.501.000,00	26.965.028,31	218.723,64	0,70%	0,80%	0,02%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	50.673.887,12	0,00	15.000.000,00	35.987.020,52	313.133,40	0,62%	0,74%	0,32%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	66.222.439,39	0,00	0,00	66.630.377,82	407.938,43	0,62%	0,62%	0,87%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO I...	1.019.174,56	2.000.000,00	0,00	3.037.642,15	18.467,59	0,61%	0,80%	0,26%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	10.000.000,00	0,00	10.059.292,41	59.292,41	0,59%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	18.924.962,87	0,00	10.000.000,00	9.031.416,61	106.453,74	0,56%	0,72%	0,32%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	43.205.701,55	0,00	0,00	43.436.235,27	230.533,72	0,53%	0,53%	1,77%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	14.698.563,62	0,00	0,00	14.776.030,84	77.467,22	0,53%	0,53%	1,78%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	20.270.829,58	0,00	0,00	20.368.716,31	97.886,73	0,48%	0,48%	1,79%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	7.561.900,58	0,00	0,00	7.563.499,61	1.599,03	0,02%	0,02%	2,65%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	1.064.855,32	0,00	0,00	1.064.632,98	-222,34	-0,02%	-0,02%	2,67%
Total Renda Fixa	421.729.759,75	31.464.329,76	31.583.045,58	425.026.100,71	3.415.056,78	0,81%		1,23%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Fevereiro/2022

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	3.110.581,27	0,00	0,00	3.141.574,61	30.993,34	1,00%	1,00%	0,76%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1.173.345,86	0,00	0,00	1.184.622,15	11.276,29	0,96%	0,96%	1,87%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.875.882,67	0,00	0,00	1.893.498,80	17.616,13	0,94%	0,94%	0,61%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2.174.568,54	0,00	0,00	2.194.778,82	20.210,28	0,93%	0,93%	1,56%
BB DINÂMICO FIC MULTIMERCADO LP	6.819.856,97	0,00	0,00	6.881.521,79	61.664,82	0,90%	0,90%	0,26%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.922.152,45	0,00	0,00	1.936.123,05	13.970,60	0,73%	0,73%	0,35%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	3.783.799,78	0,00	0,00	3.804.894,72	21.094,94	0,56%	0,56%	5,92%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4.888.021,38	0,00	0,00	4.870.111,13	-17.910,25	-0,37%	-0,37%	6,03%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.381.736,72	0,00	0,00	2.325.030,19	-56.706,53	-2,38%	-2,38%	5,17%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	5.379.004,30	0,00	0,00	5.241.884,91	-137.119,39	-2,55%	-2,55%	5,91%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	822.000,00	0,00	0,00	779.760,00	-42.240,00	-5,14%	-5,14%	11,63%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	1.598.407,96	0,00	0,00	1.515.243,91	-83.164,05	-5,20%	-5,20%	9,12%
Total Renda Variável	35.929.357,90	0,00	0,00	35.769.044,08	-160.313,82	-0,45%		3,62%



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Fevereiro / 2022)

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	10.209.898,03	0,00	0,00	9.615.297,43	-594.600,60	-5,82%	-5,82%	13,40%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	12.064.910,67	0,00	0,00	11.206.272,26	-858.638,41	-7,12%	-7,12%	13,05%
Total Exterior	22.274.808,70	0,00	0,00	20.821.569,69	-1.453.239,01	-6,52%		13,21%

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.