

Relatório Analítico dos Investimentos

em março e 1º trimestre de 2022



Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2022)

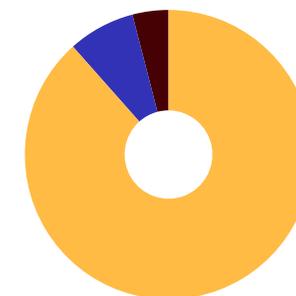
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	67.524.813,25	13,71%	515	1,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+1	Não há	7.664.318,60	1,56%	1.034	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	42.434.483,10	8,62%	793	0,66%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVID...	D+2	Não há	1.102.131,25	0,22%	242	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	44.743.589,85	9,09%	613	0,66%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVID...	D+0	Não há	36.299.095,98	7,37%	1.110	0,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	16.351.634,83	3,32%	181	0,92%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2024	1.345.856,16	0,27%	140	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2022	7.144.794,94	1,45%	115	1,49%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	2.039.085,61	0,41%	165	0,81%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	D+0	15/08/2024	1.258.404,33	0,26%	92	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	D+0	15/08/2022	713.425,04	0,14%	45	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	35.267.856,75	7,16%	126	3,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	463 dias	10.300.584,35	2,09%	142	0,41%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	521.166,00	0,11%	105	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	3.379.355,37	0,69%	38	1,51%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	25.516.163,78	5,18%	123	1,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	12.541.368,99	2,55%	921	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	4.976.930,22	1,01%	1.062	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	5.108.363,04	1,04%	1.024	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	1.959.083,19	0,40%	201	0,63%	Artigo 10º, Inciso I
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	1.917.565,77	0,39%	49.334	0,08%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	2.242.748,55	0,46%	133	0,23%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.216.267,73	0,25%	10.668	0,10%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	776.040,00	0,16%		0,76%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			492.395.159,40				

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

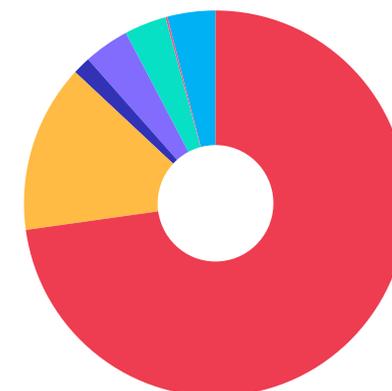
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	30,00%	147.718.547,82
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	358.402.170,38	72,79%	14,00%	56,00%	80,00%	35.513.957,14
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	69.562.428,28	14,13%	0,00%	12,00%	50,00%	176.635.151,42
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,00%	20,00%	98.479.031,88
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	7.378.066,05	1,50%	0,00%	2,00%	5,00%	17.241.691,92
Total Renda Fixa	100,00%	435.342.664,71	88,41%	14,00%	79,00%	185,00%	



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	18.848.582,60	3,83%	0,00%	6,50%	30,00%	128.869.965,22
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	17.483.178,35	3,55%	0,00%	5,00%	10,00%	31.756.337,59
Artigo 11º	5,00%	776.040,00	0,16%	0,00%	0,50%	1,00%	4.147.911,59
Total Renda Variável	30,00%	37.107.800,95	7,54%	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%	24.619.757,97
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	19.944.693,74	4,05%	0,00%	7,50%	10,00%	29.294.822,20
Total Exterior	10,00%	19.944.693,74	4,05%	0,00%	9,00%	15,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Março / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	336.153.505,06	68,27	0,02
CAIXA DTVM	148.535.626,26	30,17	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	4.641.018,85	0,94	0,00
SICREDI	3.065.009,23	0,62	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 '	358.402.170,38	72,79	14,00	80,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	69.562.428,28	14,13	0,00	50,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	7.378.066,05	1,50	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	18.848.582,60	3,83	0,00	30,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	19.944.693,74	4,05	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	17.483.178,35	3,55	0,00	10,00
Artigo 11º	776.040,00	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 Março/2022 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	2,54%	3,88%	3,88%	5,80%	9,10%	18,45%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,63%	3,82%	3,82%	5,71%	8,69%	17,87%	1,46%	0,04%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,62%	3,82%	3,82%	5,75%	8,64%	18,02%	1,43%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,29%	4,03%	4,03%	5,92%	10,12%	20,52%	0,80%	0,03%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	2,14%	4,69%	4,69%	9,37%	17,98%	32,62%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2,55%	3,91%	3,91%	5,39%	6,81%	16,07%	1,32%	0,04%
IMA-B 5+ (Benchmark)	3,56%	1,91%	1,91%	1,99%	0,35%	12,40%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,53%	1,88%	1,88%	1,73%	-0,11%	11,63%	4,23%	0,08%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,52%	1,82%	1,82%	1,82%	0,03%	11,52%	4,23%	0,08%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,89%	2,28%	2,28%	3,43%	5,14%	7,77%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,87%	2,24%	2,24%	3,36%	4,88%	7,10%	0,33%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,87%	2,22%	2,22%	3,33%	4,92%	7,31%	0,33%	0,01%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	0,90%	2,46%	2,46%	3,77%	5,57%	7,92%	0,25%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	2,61%	3,81%	3,81%	5,92%	8,72%	17,96%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,59%	3,76%	3,76%	5,80%	8,48%	17,37%	1,34%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,66%	-	-	-	-	-	1,63%	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2,58%	3,74%	3,74%	5,75%	8,38%	17,29%	1,35%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,41%	3,92%	3,92%	5,51%	8,74%	18,49%	1,03%	0,03%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,66%	1,12%	1,12%	3,17%	2,93%	6,43%	1,63%	0,06%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,79%	1,28%	1,28%	5,94%	10,99%	17,76%	0,23%	0,04%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,66%	0,88%	0,88%	2,93%	2,68%	6,18%	1,63%	0,06%
IMA-B (Benchmark)	3,07%	2,87%	2,87%	3,96%	4,50%	15,36%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,06%	2,82%	2,82%	3,85%	4,23%	14,81%	2,68%	0,06%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,01%	2,76%	2,76%	3,77%	4,18%	14,69%	2,67%	0,06%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3,07%	2,77%	2,77%	3,78%	4,26%	14,68%	2,73%	0,06%
CDI (Benchmark)	0,92%	2,42%	2,42%	4,31%	6,41%	8,78%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,96%	2,57%	2,57%	4,55%	6,77%	9,24%	0,04%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,34%	2,01%	2,01%	3,02%	3,54%	8,04%	1,24%	0,03%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,96%	2,60%	2,60%	4,70%	7,16%	9,36%	0,05%	0,01%
IPCA (Benchmark)	1,62%	3,20%	3,20%	6,25%	11,30%	18,09%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,82%	2,32%	2,32%	3,41%	2,39%	7,61%	0,34%	0,03%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,82%	2,57%	2,57%	4,13%	3,40%	-	0,07%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,40%	3,93%	3,93%	5,90%	9,62%	18,08%	0,86%	0,03%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,29%	4,03%	4,03%	5,93%	10,15%	20,04%	0,80%	0,03%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	2,68%	3,76%	3,76%	6,17%	8,83%	17,65%	1,62%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,29%	4,03%	4,03%	5,92%	10,13%	17,95%	0,80%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,46%	3,89%	3,89%	5,88%	9,35%	18,08%	0,98%	0,03%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,90%	1,95%	1,95%	3,56%	5,24%	7,34%	0,48%	0,02%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,40%	-	-	-	-	-	1,02%	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-3,98%	-19,32%	-19,32%	-9,41%	-5,15%	56,83%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-4,33%	-19,47%	-19,47%	-9,63%	-6,05%	47,37%	11,07%	0,19%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-4,11%	-19,62%	-19,62%	-10,12%	-7,40%	52,03%	12,22%	0,19%

IDIV (Benchmark)	10,00%	15,48%	15,48%	13,37%	11,66%	55,59%	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	9,76%	14,90%	14,90%	12,57%	10,05%	43,91%	9,24%	0,17%

Ibovespa (Benchmark)	6,06%	14,48%	14,48%	8,13%	2,89%	64,34%	-	-
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	5,51%	3,97%	3,97%	-6,58%	-11,61%	32,98%	9,45%	0,17%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	5,00%	12,71%	12,71%	6,59%	0,34%	55,80%	9,07%	0,16%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	5,25%	8,72%	8,72%	5,96%	6,30%	67,64%	9,70%	0,12%

SMLL (Benchmark)	8,81%	6,69%	6,69%	-5,35%	-9,80%	48,46%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	8,57%	7,01%	7,01%	-5,42%	-10,49%	43,86%	14,90%	0,22%

CDI (Benchmark)	0,92%	2,42%	2,42%	4,31%	6,41%	8,78%	-	-
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,27%	3,57%	3,57%	4,91%	5,93%	12,68%	1,00%	0,02%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,19%	2,84%	2,84%	4,82%	6,43%	9,50%	0,47%	0,01%
BB DINÂMICO FIC MULTIMERCADO LP	1,10%	2,93%	2,93%	4,36%	5,34%	9,01%	0,50%	0,02%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1,55%	3,31%	3,31%	5,29%	5,84%	8,54%	0,94%	0,02%

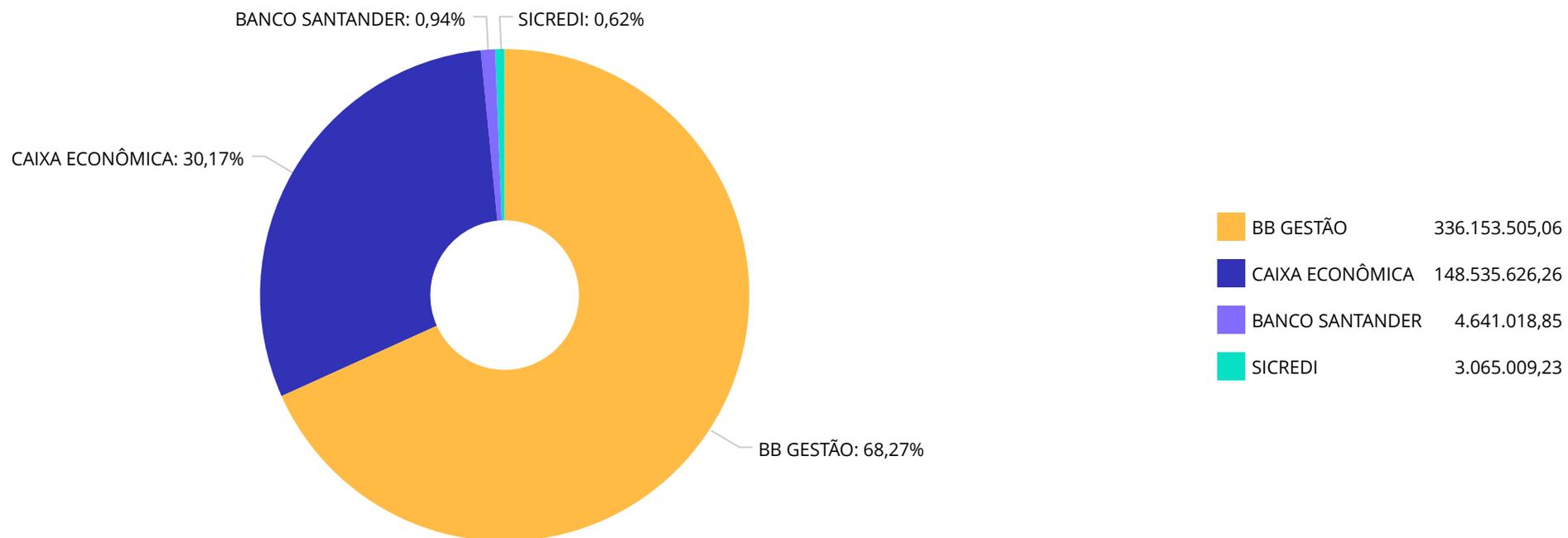
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2,67%	6,43%	6,43%	6,32%	5,71%	21,42%	2,89%	0,05%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2,19%	4,61%	4,61%	5,56%	5,60%	22,32%	1,85%	0,04%
IFIX (Benchmark)	1,42%	-0,88%	-0,88%	2,37%	-2,35%	11,46%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-0,48%	-5,23%	-5,23%	-10,21%	-35,00%	-44,31%	13,56%	0,13%

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

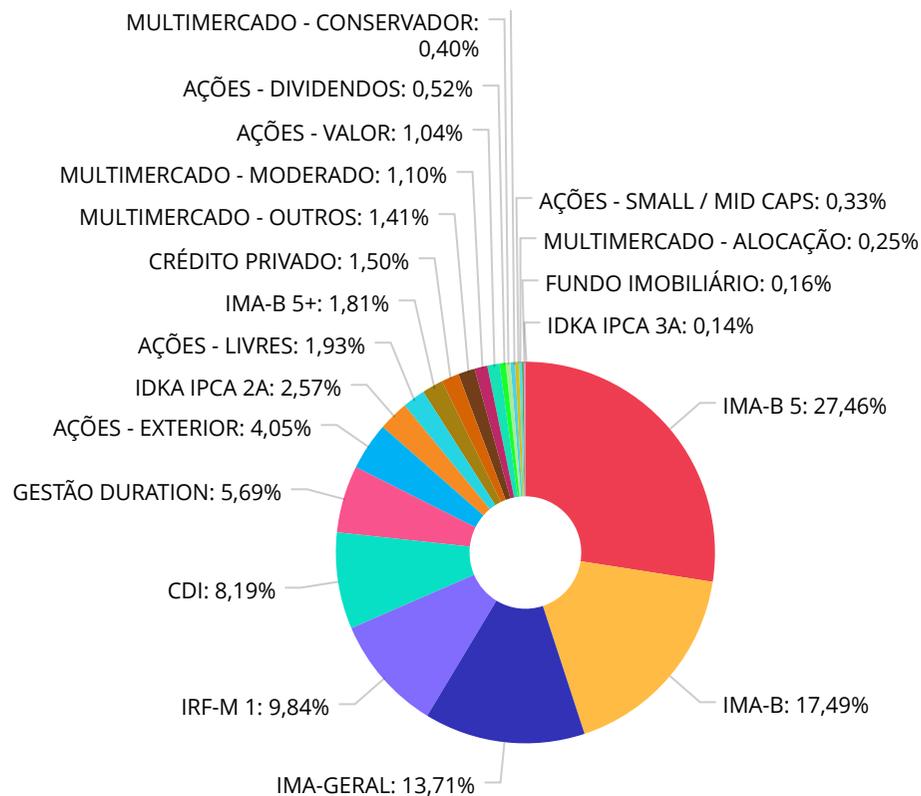
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-3,98%	-19,32%	-19,32%	-9,41%	-5,15%	56,83%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-4,33%	-19,47%	-19,47%	-9,63%	-6,05%	47,37%	11,07%	0,19%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-4,11%	-19,62%	-19,62%	-10,12%	-7,40%	52,03%	12,22%	0,19%

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





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

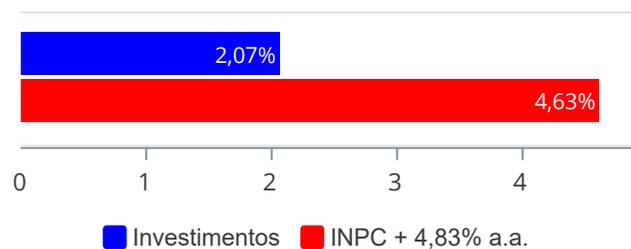


IMA-B 5	135.208.238,21
IMA-B	86.124.087,12
IMA-GERAL	67.524.813,25
IRF-M 1	48.473.714,37
CDI	40.304.783,25
GESTÃO DURATION	28.041.657,13
AÇÕES - EXTERIOR	19.944.693,74
IDKA IPCA 2A	12.641.248,82
AÇÕES - LIVRES	9.526.040,04
IMA-B 5+	8.932.631,47
CRÉDITO PRIVADO	7.378.066,05
MULTIMERCADO - OUTROS	6.957.133,11
MULTIMERCADO - MODERADO	5.433.128,55
AÇÕES - VALOR	5.125.545,40
AÇÕES - DIVIDENDOS	2.551.956,79
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	1.959.083,19
MULTIMERCADO - MACRO	1.917.565,77
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.645.040,37
MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	1.216.267,73

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%
Março	481.616.714,48	4.265.508,75	2.750.000,00	492.395.159,40	9.262.936,17	9.961.005,23	1,92%	2,07%	2,13%	4,63%	44,64%	2,12%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



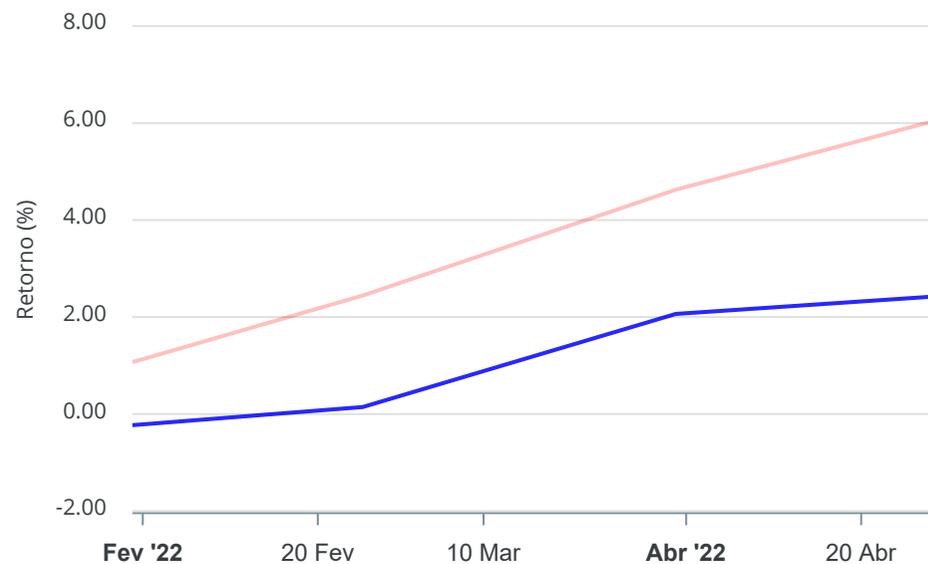
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Março/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	7.563.499,61	0,00	0,00	7.830.500,22	267.000,61	3,53%	3,53%	4,23%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	1.064.632,98	0,00	0,00	1.102.131,25	37.498,27	3,52%	3,52%	4,23%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	20.368.716,31	0,00	0,00	20.992.932,01	624.215,70	3,06%	3,06%	2,73%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	14.776.030,84	0,00	0,00	15.228.639,56	452.608,72	3,06%	3,06%	2,68%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	43.436.235,27	0,00	0,00	44.743.589,85	1.307.354,58	3,01%	3,01%	2,67%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	6.214.213,63	0,00	0,00	6.380.897,55	166.683,92	2,68%	2,68%	1,62%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	24.855.357,52	0,00	0,00	25.516.163,78	660.806,26	2,66%	2,66%	1,63%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	507.670,20	0,00	0,00	521.166,00	13.495,80	2,66%	2,66%	1,63%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	34.355.224,82	0,00	0,00	35.267.856,75	912.631,93	2,66%	2,66%	1,63%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.849.558,20	0,00	0,00	4.976.930,22	127.372,02	2,63%	2,63%	1,46%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	7.468.628,39	0,00	0,00	7.664.318,60	195.690,21	2,62%	2,62%	1,43%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.979.574,45	0,00	0,00	5.108.363,04	128.788,59	2,59%	2,59%	1,34%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	41.367.736,52	0,00	0,00	42.434.483,10	1.066.746,58	2,58%	2,58%	1,35%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	972.360,00	0,00	0,00	997.168,50	24.808,50	2,55%	2,55%	1,32%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.228.188,88	0,00	0,00	1.258.404,33	30.215,45	2,46%	2,46%	0,98%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	15.966.532,51	0,00	0,00	16.351.634,83	385.102,32	2,41%	2,41%	1,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	1.314.275,09	0,00	0,00	1.345.856,16	31.581,07	2,40%	2,40%	0,86%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.059.292,41	0,00	0,00	10.300.584,35	241.291,94	2,40%	2,40%	1,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	6.984.570,49	0,00	0,00	7.144.794,94	160.224,45	2,29%	2,29%	0,80%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.993.386,79	0,00	0,00	2.039.085,61	45.698,82	2,29%	2,29%	0,80%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	697.440,48	0,00	0,00	713.425,04	15.984,56	2,29%	2,29%	0,80%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.320.080,73	0,00	0,00	3.379.355,37	59.274,64	1,79%	1,79%	0,23%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	66.630.377,82	0,00	0,00	67.524.813,25	894.435,43	1,34%	1,34%	1,24%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	1.977.048,17	0,00	0,00	1.996.028,80	18.980,63	0,96%	0,96%	0,05%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	26.965.028,31	3.508.508,75	2.750.000,00	28.008.170,10	284.633,04	0,93%	0,96%	0,04%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO I...	3.037.642,15	0,00	0,00	3.065.009,23	27.367,08	0,90%	0,90%	0,25%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	2.621.482,82	0,00	0,00	2.644.990,05	23.507,23	0,90%	0,90%	0,48%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	35.987.020,52	0,00	0,00	36.299.095,98	312.075,46	0,87%	0,87%	0,33%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.031.416,61	0,00	0,00	9.109.609,16	78.192,55	0,87%	0,87%	0,33%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	11.681.494,22	757.000,00	0,00	12.541.368,99	102.874,77	0,83%	0,82%	0,34%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	12.751.383,97	0,00	0,00	12.855.298,09	103.914,12	0,81%	0,81%	0,07%
Total Renda Fixa	425.026.100,71	4.265.508,75	2.750.000,00	435.342.664,71	8.801.055,25	2,06%		1,37%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.325.030,19	0,00	0,00	2.551.956,79	226.926,60	9,76%	9,76%	9,24%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	1.515.243,91	0,00	0,00	1.645.040,37	129.796,46	8,57%	8,57%	14,90%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	5.241.884,91	0,00	0,00	5.530.738,90	288.853,99	5,51%	5,51%	9,45%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4.870.111,13	0,00	0,00	5.125.545,40	255.434,27	5,24%	5,24%	9,70%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	3.804.894,72	0,00	0,00	3.995.301,14	190.406,42	5,00%	5,00%	9,07%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1.184.622,15	0,00	0,00	1.216.267,73	31.645,58	2,67%	2,67%	2,89%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2.194.778,82	0,00	0,00	2.242.748,55	47.969,73	2,19%	2,19%	1,85%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	3.141.574,61	0,00	0,00	3.190.380,00	48.805,39	1,55%	1,55%	0,94%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.893.498,80	0,00	0,00	1.917.565,77	24.066,97	1,27%	1,27%	1,00%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.936.123,05	0,00	0,00	1.959.083,19	22.960,14	1,19%	1,19%	0,47%
BB DINÂMICO FIC MULTIMERCADO LP	6.881.521,79	0,00	0,00	6.957.133,11	75.611,32	1,10%	1,10%	0,50%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	779.760,00	0,00	0,00	776.040,00	-3.720,00	-0,48%	-0,48%	13,56%
Total Renda Variável	35.769.044,08	0,00	0,00	37.107.800,95	1.338.756,87	3,74%		5,76%



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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	11.206.272,26	0,00	0,00	10.745.493,53	-460.778,73	-4,11%	-4,11%	12,22%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	9.615.297,43	0,00	0,00	9.199.200,21	-416.097,22	-4,33%	-4,33%	11,07%
Total Exterior	20.821.569,69	0,00	0,00	19.944.693,74	-876.875,95	-4,21%		11,69%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	40.904.701,82	0,00	0,00	42.434.483,10	1.529.781,28	3,74%	3,74%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	66.197.292,41	0,00	0,00	67.524.813,25	1.327.520,84	2,01%	2,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	0,00	35.000.000,00	991.106,57	35.267.856,75	1.258.963,32	3,60%	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	43.540.040,02	0,00	0,00	44.743.589,85	1.203.549,83	2,76%	2,76%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	66.277.297,46	0,00	31.000.000,00	36.299.095,98	1.021.798,52	1,54%	2,23%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	15.191.302,17	10.000.000,00	636.248,16	25.516.163,78	961.109,77	3,82%	1,11%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	44.629.569,36	11.619.174,31	29.101.000,00	28.008.170,10	860.426,43	1,53%	2,57%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	20.426.771,49	0,00	0,00	20.992.932,01	566.160,52	2,77%	2,77%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	836.900,96	15.000.000,00	0,00	16.351.634,83	514.733,87	3,25%	3,92%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	14.810.700,94	0,00	0,00	15.228.639,56	417.938,62	2,82%	2,82%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	12.532.982,51	0,00	0,00	12.855.298,09	322.315,58	2,57%	2,57%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	10.000.000,00	0,00	10.300.584,35	300.584,35	3,01%	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	18.810.407,89	0,00	10.000.000,00	9.109.609,16	299.201,27	1,59%	2,22%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	21.501.294,88	757.000,00	10.000.000,00	12.541.368,99	283.074,11	1,27%	2,32%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	7.382.516,80	0,00	0,00	7.664.318,60	281.801,80	3,82%	3,82%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	7.063.191,44	0,00	197.486,20	7.144.794,94	279.089,70	3,95%	4,03%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	6.149.561,99	0,00	0,00	6.380.897,55	231.335,56	3,76%	3,76%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.923.337,53	0,00	0,00	5.108.363,04	185.025,51	3,76%	3,76%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.793.698,24	0,00	0,00	4.976.930,22	183.231,98	3,82%	3,82%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	7.686.299,02	0,00	0,00	7.830.500,22	144.201,20	1,88%	1,88%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.336.752,99	0,00	93.818,25	3.379.355,37	136.420,63	4,09%	1,28%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	2.017.375,02	0,00	57.890,98	2.039.085,61	79.601,57	3,95%	4,03%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO I...	1.011.741,08	2.000.000,00	0,00	3.065.009,23	53.268,15	1,77%	2,46%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	1.331.566,94	0,00	37.027,50	1.345.856,16	51.316,72	3,85%	3,93%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	2.594.341,78	0,00	0,00	2.644.990,05	50.648,27	1,95%	1,95%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	1.945.459,90	0,00	0,00	1.996.028,80	50.568,90	2,60%	2,60%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.245.590,52	0,00	34.571,06	1.258.404,33	47.384,87	3,80%	3,88%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	959.626,50	0,00	0,00	997.168,50	37.542,00	3,91%	3,91%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	705.265,19	0,00	19.674,20	713.425,04	27.834,05	3,95%	4,03%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	1.082.477,61	0,00	0,00	1.102.131,25	19.653,64	1,82%	1,82%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	516.630,90	0,00	14.222,66	521.166,00	18.757,76	3,63%	0,88%
Total Renda Fixa					12.744.840,62	3,02%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2022

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	3.544.926,49	0,00	0,00	3.995.301,14	450.374,65	12,70%	12,70%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4.714.335,46	0,00	0,00	5.125.545,40	411.209,94	8,72%	8,72%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.220.989,29	0,00	0,00	2.551.956,79	330.967,50	14,90%	14,90%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	5.319.529,26	0,00	0,00	5.530.738,90	211.209,64	3,97%	3,97%
BB DINÂMICO FIC MULTIMERCADO LP	6.758.827,62	0,00	0,00	6.957.133,11	198.305,49	2,93%	2,93%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	1.537.238,62	0,00	0,00	1.645.040,37	107.801,75	7,01%	7,01%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	3.088.027,94	0,00	0,00	3.190.380,00	102.352,06	3,31%	3,31%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2.143.951,73	0,00	0,00	2.242.748,55	98.796,82	4,61%	4,61%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1.142.813,77	0,00	0,00	1.216.267,73	73.453,96	6,43%	6,43%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.851.468,28	0,00	0,00	1.917.565,77	66.097,49	3,57%	3,57%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.904.946,89	0,00	0,00	1.959.083,19	54.136,30	2,84%	2,84%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	818.880,00	0,00	0,00	776.040,00	-42.840,00	-5,23%	-5,23%
Total Renda Variável					2.061.865,60	5,88%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2022

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	11.422.659,67	0,00	0,00	9.199.200,21	-2.223.459,46	-19,47%	-19,47%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	13.367.735,06	0,00	0,00	10.745.493,53	-2.622.241,53	-19,62%	-19,62%
Total Exterior					-4.845.700,99	-19,55%	

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.