

# 2021

## Relatório Mensal

# Julho

## Análise dos Investimentos

De acordo com a Portaria MTP nº 1.467 de 2 de junho de 2022, Capítulo VI, Seção V, Artigo 136º e com o Manual do Pró-Gestão RPPS versão 3.3, ítem 3.2.6 Nível I, aprovado pela Portaria SPREV nº 918, de 2 de Março de 2022.

| Ativo   | Saldo Atual   | % Carteira | PL R\$            | % PL  | Lei      |
|---|---------------|------------|-------------------|-------|----------|
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO       | 2.724.902,69  | 2,21%      | 10.405.647.705,04 | 0,03% | 7º I b   |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP                   | 4.331.326,72  | 3,52%      | 5.928.712.027,28  | 0,07% | 7º I b   |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA                | 23.475.306,58 | 19,05%     | 15.935.689.880,46 | 0,15% | 7º I b   |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP   | 14.725.153,01 | 11,95%     | 12.042.628.715,86 | 0,12% | 7º I b   |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP        | 7.726.183,61  | 6,27%      | 11.707.172.620,85 | 0,07% | 7º I b   |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP          | 9.008.670,62  | 7,31%      | 5.838.267.480,63  | 0,15% | 7º I b   |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA           | 10.508.581,04 | 8,53%      | 7.606.396.263,31  | 0,14% | 7º I b   |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 10.022.464,24 | 8,13%      | 4.460.514.993,96  | 0,22% | 7º IV a  |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP                 | 1.231.573,80  | 1,00%      | 5.930.887.062,81  | 0,02% | 7º IV a  |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP                | 2.057.175,59  | 1,67%      | 5.483.866.382,38  | 0,04% | 7º IV a  |
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES                                      | 4.450.152,58  | 3,61%      | 1.187.017.261,48  | 0,37% | 8º II a  |
| BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES                                     | 2.291.453,88  | 1,86%      | 1.269.495.027,18  | 0,18% | 8º II a  |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES                             | 6.432.637,16  | 5,22%      | 1.084.997.968,28  | 0,59% | 8º II a  |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES               | 5.901.533,16  | 4,79%      | 648.578.678,10    | 0,91% | 8º II a  |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES                               | 4.393.902,48  | 3,57%      | 1.198.050.351,88  | 0,37% | 8º II a  |
| BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP                         | 1.251.306,11  | 1,02%      | 6.525.181.925,42  | 0,02% | 8º III   |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP                      | 5.932.304,78  | 4,81%      | 4.481.301.501,35  | 0,13% | 8º III   |
| CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP             | 2.671.855,40  | 2,17%      | 1.376.363.729,27  | 0,19% | 8º III   |
| CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP                                | 2.049.263,06  | 1,66%      | 1.969.915.384,85  | 0,10% | 8º III   |
| BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I                    | 2.031.075,87  | 1,65%      | 1.012.432.125,91  | 0,20% | 9º A III |

Investimentos

\$ 123.216.822,38

Disponibilidades Financeiras

\$ 182.184,84

Total Carteira

\$ 123.399.007,22

Governança (Pró Gestão)

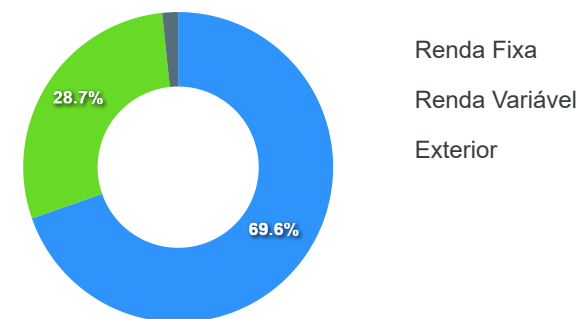
⚖️ Não possui

| Artigos                        | Limite (%) | Utilizado | Livre                |
|--------------------------------|------------|-----------|----------------------|
| 7º I b - FI 100% Títulos TN    | 100,00%    | 58,84%    | 72.500.124,27 41,16% |
| 7º IV a - FI de Renda Fixa     | 40,00%     | 10,80%    | 13.311.213,63 29,20% |
| 8º II a - FI em Ações          | 20,00%     | 19,05%    | 23.469.679,26 0,95%  |
| 8º III - FI Multimercado       | 10,00%     | 9,66%     | 11.904.729,35 0,34%  |
| 9º A III - Ações - BDR Nível I | 10,00%     | 1,65%     | 2.031.075,87 8,35%   |

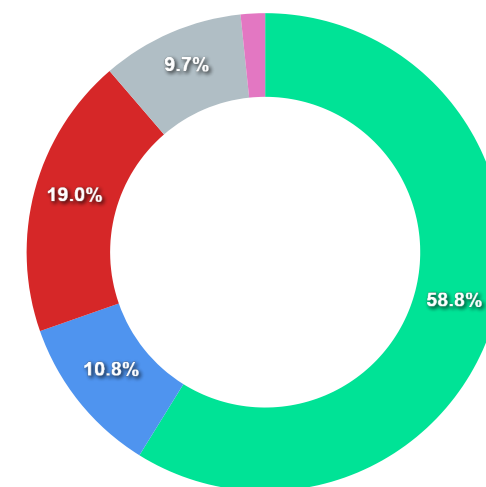
Governança (Pró Gestão)

🔗 Não possui

Segmentos



Artigos

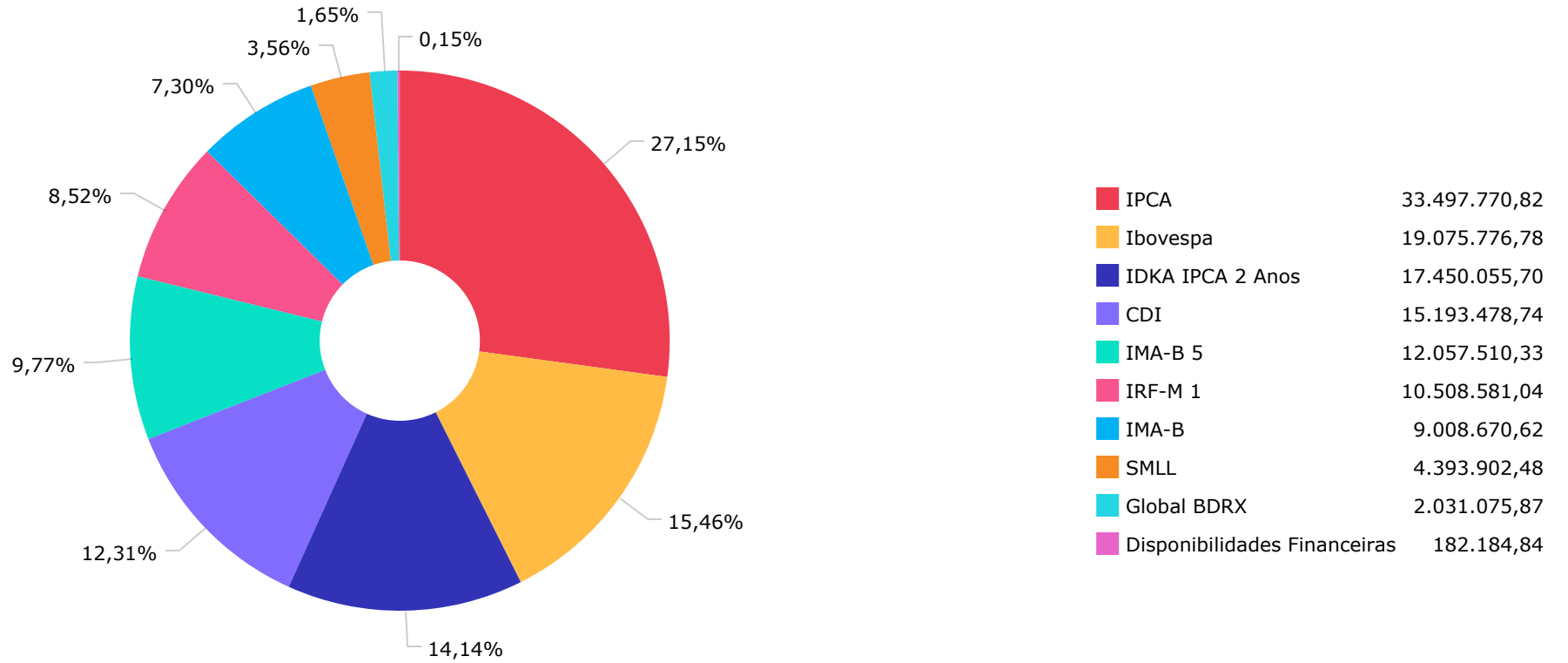


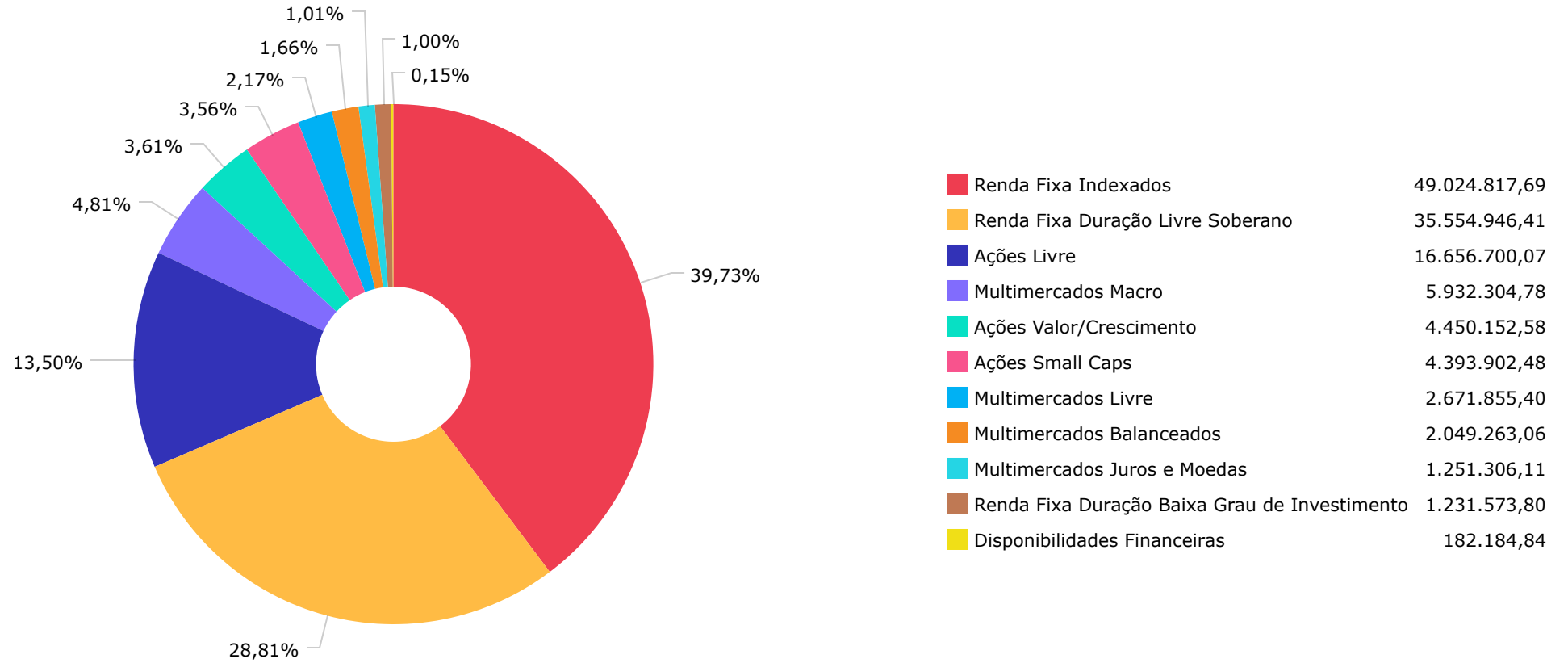
| Artigos                     | Atual  | Inferior | Alvo   | Superior | GAP Superior  |
|-----------------------------|--------|----------|--------|----------|---------------|
| 7° I b - FI 100% Títulos TN | 58,84% | 11,51%   | 51,06% | 71,95%   | 16.154.379,43 |
| 7° IV a - FI de Renda Fixa  | 10,80% | 4,07%    | 20,34% | 40,00%   | 35.975.515,32 |

| Artigos                           | Atual  | Inferior | Alvo   | Superior | GAP Superior |
|-----------------------------------|--------|----------|--------|----------|--------------|
| 8° II a - FI em Ações             | 19,05% | 3,68%    | 18,38% | 20,00%   | 1.173.685,22 |
| 8° III - FI Multimercado          | 9,66%  | 3,08%    | 9,58%  | 10,00%   | 416.952,89   |
| 9° A II - Constituídos no Bras... | 0,00%  | 0,00%    | 0,32%  | 5,00%    | 6.160.841,12 |
| 9° A III - Ações - BDR Nível I    | 1,65%  | 0,00%    | 0,32%  | 5,00%    | 4.129.765,25 |

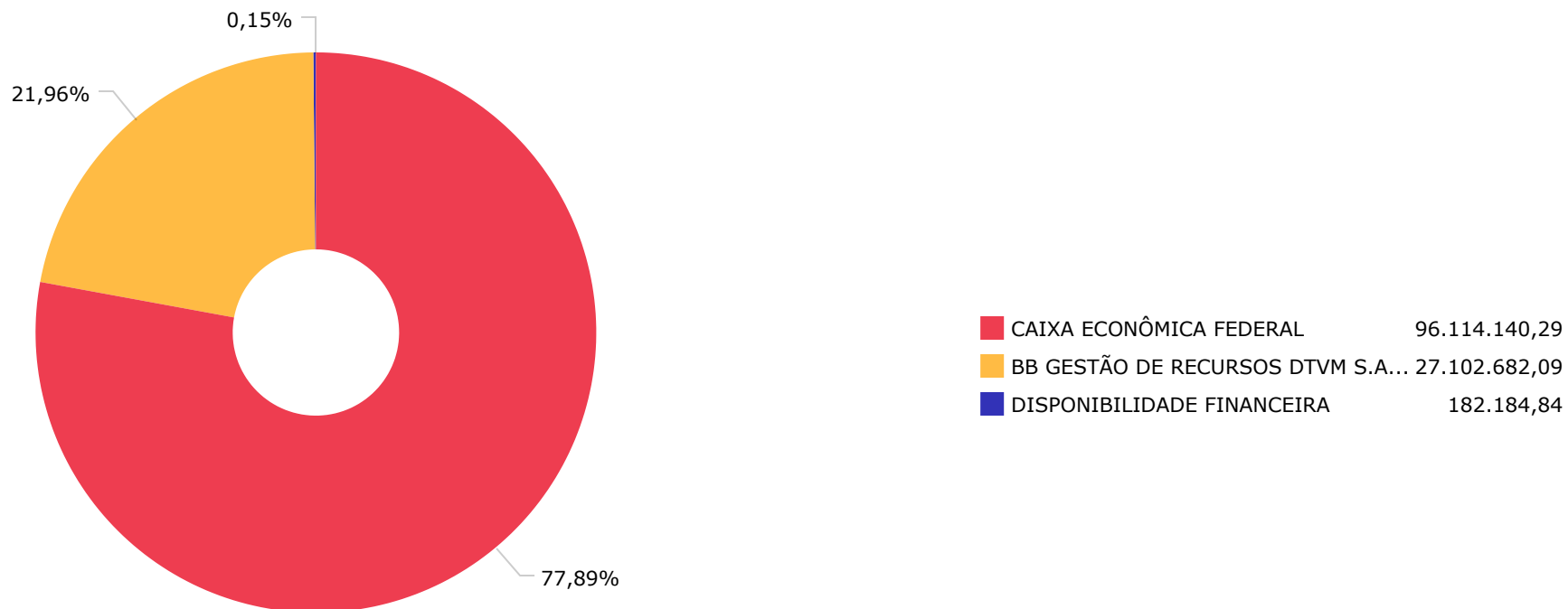
|   | Mês          | Ano          | 3M          | 6M           | 12M          | 24M           | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|---|--------------|--------------|-------------|--------------|--------------|---------------|-----------|--------------------|
| <b>CDI - BENCHMARK</b>                                      | <b>0,36</b>  | <b>1,64</b>  | <b>0,94</b> | <b>1,49</b>  | <b>2,44</b>  | <b>6,76</b>   |           |                    |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP               | 0,45         | 1,61         | 1,00        | 1,45         | 2,41         | 6,21          | 0,05      | 0,11               |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP              | 0,38         | 1,54         | 0,98        | 1,34         | 1,98         | 6,32          | 0,02      | 0,04               |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP                    | -0,36        | 2,74         | 0,90        | 2,83         | 5,97         | 12,71         | 1,59      | 3,36               |
| CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP           | -0,46        | 2,88         | 0,91        | 2,64         | 5,14         |               | 1,46      | 3,07               |
| CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP                              | -0,83        | 1,44         | 1,46        | 2,03         | 4,78         | 10,52         | 2,54      | 5,35               |
| BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP                       | 0,33         | 1,60         | 0,83        | 1,34         | 3,26         | 8,44          | 0,08      | 0,17               |
| <b>GLOBAL BDRX - BENCHMARK</b>                              | <b>5,91</b>  | <b>16,57</b> | <b>1,56</b> | <b>9,86</b>  | <b>33,20</b> | <b>107,01</b> |           |                    |
| BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I                  | 5,24         | 13,64        | 0,00        | 8,22         | 27,98        | 89,55         | 7,26      | 15,29              |
| <b>IBOVESPA - BENCHMARK</b>                                 | <b>-3,94</b> | <b>2,34</b>  | <b>2,45</b> | <b>5,85</b>  | <b>18,35</b> | <b>19,63</b>  |           |                    |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES             | -4,66        | 14,33        | 0,55        | 18,56        | 28,29        | 36,95         | 7,70      | 16,21              |
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES                                    | -2,32        | 2,10         | 2,44        | 8,14         | 24,15        | 24,17         | 8,21      | 17,29              |
| BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES                                   | -2,78        | 2,87         | 2,04        | 8,25         | 23,66        | 34,95         | 8,28      | 17,44              |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES                           | -4,81        | 2,64         | 1,63        | 5,36         | 11,43        | 21,62         | 7,73      | 16,27              |
| <b>IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK</b>                         | <b>-0,18</b> | <b>1,68</b>  | <b>0,38</b> | <b>1,54</b>  | <b>5,88</b>  | <b>15,07</b>  |           |                    |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | 0,08         | 1,50         | 0,66        | 1,32         | 5,61         | 14,05         | 0,88      | 1,85               |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | -0,06        | 1,50         | 0,50        | 1,36         | 5,46         | 14,00         | 0,95      | 2,01               |
| <b>IMA-B - BENCHMARK</b>                                    | <b>-0,37</b> | <b>-1,09</b> | <b>1,10</b> | <b>-0,24</b> | <b>2,53</b>  | <b>10,89</b>  |           |                    |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP        | -0,40        | -1,23        | 1,04        | -0,36        | 2,28         | 10,19         | 2,05      | 4,32               |
| <b>IMA-B 5 - BENCHMARK</b>                                  | <b>0,03</b>  | <b>1,32</b>  | <b>0,59</b> | <b>1,21</b>  | <b>5,06</b>  | <b>14,34</b>  |           |                    |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP                 | 0,02         | 1,19         | 0,52        | 1,09         | 4,79         | 13,79         | 1,02      | 2,14               |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP      | 0,01         | 1,17         | 0,53        | 1,08         | 4,77         | 13,71         | 1,00      | 2,11               |

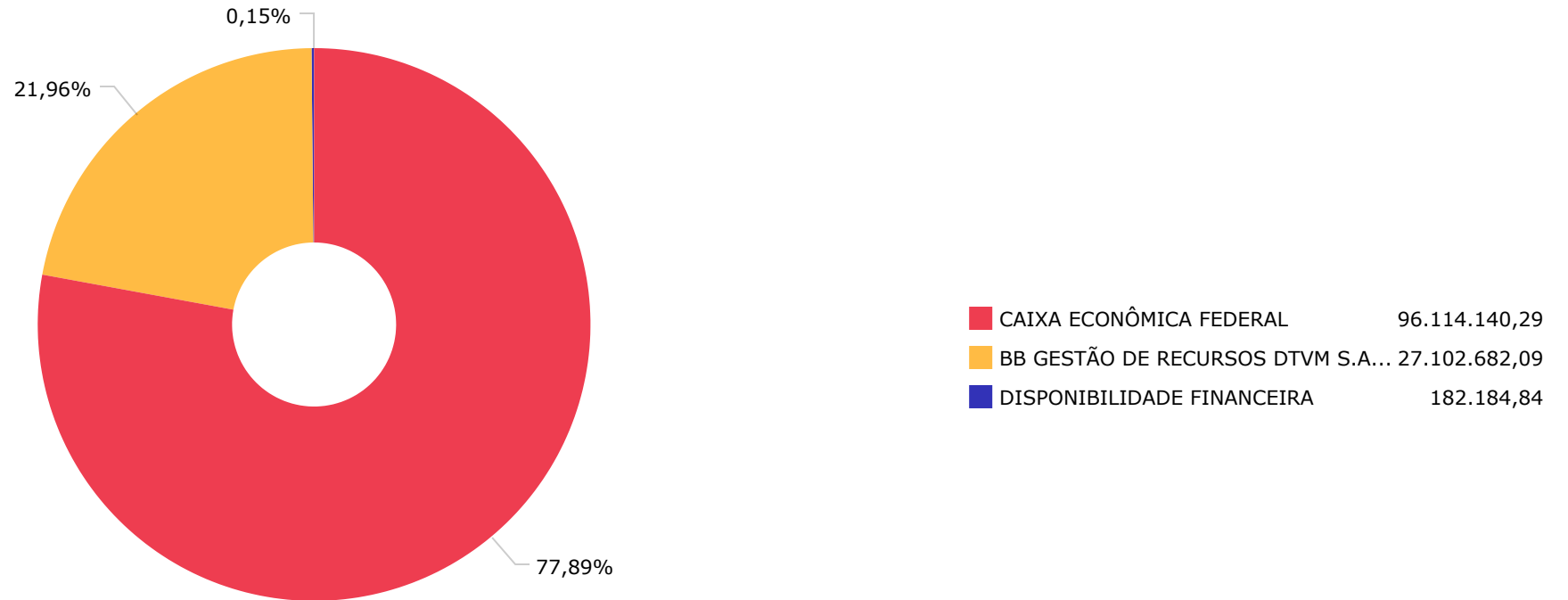
|   | Mês          | Ano         | 3M          | 6M          | 12M          | 24M          | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|---|--------------|-------------|-------------|-------------|--------------|--------------|-----------|--------------------|
| <b>IPCA - BENCHMARK</b>                                       | <b>0,96</b>  | <b>4,76</b> | <b>2,34</b> | <b>4,50</b> | <b>9,00</b>  | <b>11,51</b> |           |                    |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA                | -0,78        | -0,06       | -0,54       | -0,09       | 0,90         | 10,67        | 1,68      | 3,53               |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | -0,11        | -0,50       | 0,54        | -0,04       | 1,16         |              | 1,10      | 2,31               |
| <b>IRF-M 1 - BENCHMARK</b>                                    | <b>0,19</b>  | <b>1,00</b> | <b>0,60</b> | <b>0,96</b> | <b>1,99</b>  | <b>7,60</b>  |           |                    |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA           | 0,17         | 0,86        | 0,53        | 0,84        | 1,75         | 7,14         | 0,23      | 0,48               |
| <b>SMLL - BENCHMARK</b>                                       | <b>-5,80</b> | <b>4,96</b> | <b>1,45</b> | <b>8,69</b> | <b>20,13</b> | <b>29,57</b> |           |                    |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES                               | -5,25        | 5,60        | 2,12        | 9,40        | 19,06        | 26,32        | 8,98      | 18,92              |









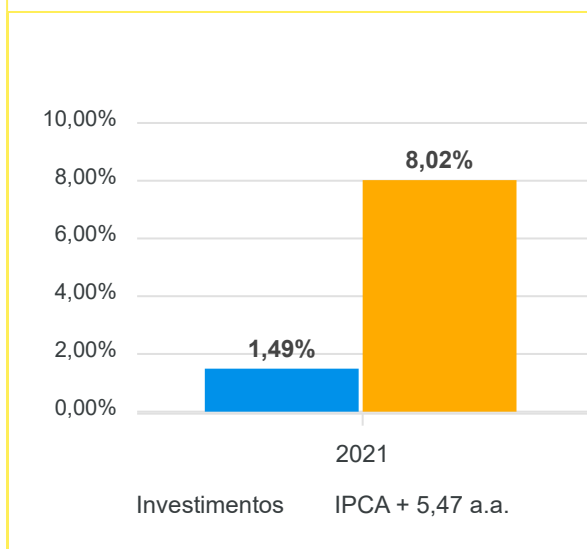


| Mês       | Saldo Anterior | Aplicações    | Resgates      | Saldo Atual    | Retorno \$    | Retorno Acumulado \$ | Retorno % | Retorno Acumulado % | Meta % | Meta Acumulado % | Meta x Retorno Acumulado % | Risco - VaR |
|-----------|----------------|---------------|---------------|----------------|---------------|----------------------|-----------|---------------------|--------|------------------|----------------------------|-------------|
| Janeiro   | 114.899.228,61 | 238.542,06    | 0,00          | 114.212.221,52 | -925.549,15   | -925.549,15          | -0,80% ▼  | -0,80%              | 0,67%  | 0,67%            | -119,40%                   | 3,05%       |
| Fevereiro | 114.212.221,52 | 357.145,01    | 0,00          | 113.429.875,60 | -1.139.490,93 | -2.065.040,08        | -0,99% ▼  | -1,79%              | 1,24%  | 1,93%            | -92,75%                    | 3,12%       |
| Março     | 113.429.875,60 | 2.350.529,64  | 0,00          | 117.182.636,95 | 1.402.231,71  | -662.808,37          | 1,21% ▲   | -0,60%              | 1,42%  | 3,38%            | -17,75%                    | 3,52%       |
| Abril     | 117.182.636,95 | 3.506.249,63  | 0,00          | 122.390.252,79 | 1.701.366,21  | 1.038.557,84         | 1,41% ▲   | 0,80%               | 0,73%  | 4,14%            | 19,32%                     | 1,99%       |
| Mai       | 122.390.252,79 | 11.421.920,25 | 12.361.392,64 | 123.391.927,70 | 1.941.147,30  | 2.979.705,14         | 1,59% ▲   | 2,40%               | 1,28%  | 5,47%            | 43,88%                     | 2,47%       |
| Junho     | 123.391.927,70 | 9.370.900,18  | 8.020.000,00  | 124.733.594,85 | -9.233,03     | 2.970.472,11         | -0,01% ▼  | 2,39%               | 0,98%  | 6,50%            | 36,77%                     | 2,17%       |
| Julho     | 124.733.594,85 | 6.428.238,95  | 6.841.717,25  | 123.216.822,38 | -1.103.294,17 | 1.867.177,94         | -0,88% ▼  | 1,49%               | 1,43%  | 8,02%            | 18,58%                     | 2,63%       |

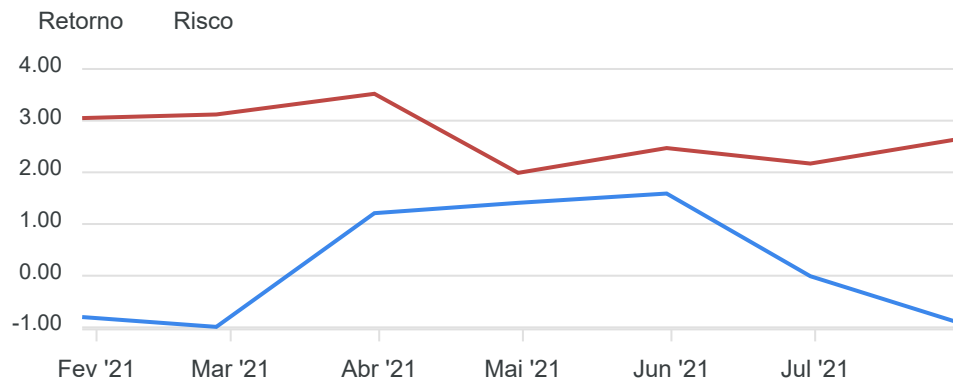
## Retorno Acumulado (Períodos)

| Período | Retorno \$   | Retorno % | Meta % |
|---------|--------------|-----------|--------|
| 1º Trim | -662.808,37  | -0,60%    | 3,38%  |
| 2º Trim | 3.633.280,48 | 3,01%     | 3,02%  |
| 1º Sem  | 2.970.472,11 | 2,39%     | 6,50%  |

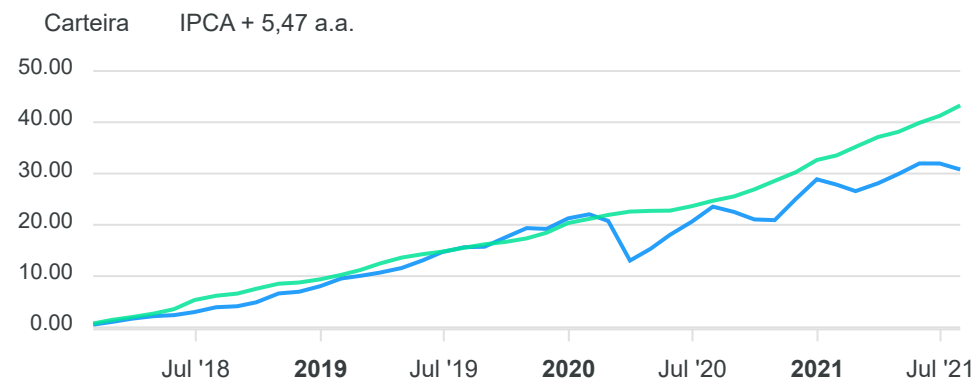
## Gráfico Retorno e Meta Acumulado



**Gráfico Risco x Retorno**

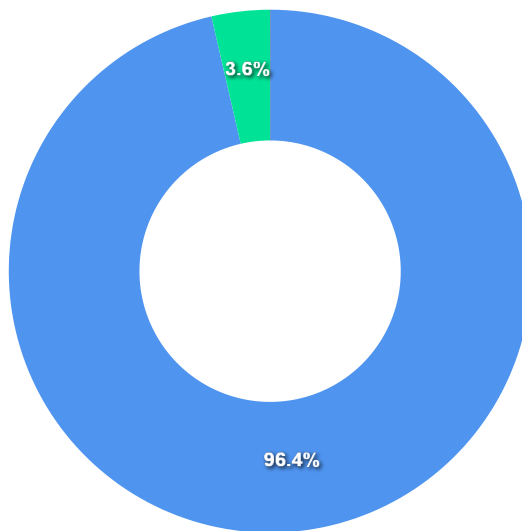


**Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade**



**Liquidez - 30/07/2021**

| Disponibilidade | Valor          | %     |
|-----------------|----------------|-------|
| Até D+30        | 118.948.854,64 | 96,54 |
| Até D+180       | 4.450.152,58   | 3,61  |
| Até D+360       | 0,00           | 0,00  |
| Até D+720       | 0,00           | 0,00  |
| Até D+1800      | 0,00           | 0,00  |
| Até D+3600      | 0,00           | 0,00  |
| Acima D+3600    | 0,00           | 0,00  |
| Indeterminado   | 0,00           | 0,00  |



| RENDA FIXA  | Saldo Anterior | Aplicações   | Resgates     | Saldo Atual   | Retorno \$  | Retorno % | Risco - VaR |
|---|----------------|--------------|--------------|---------------|-------------|-----------|-------------|
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 8.222.950,95   | 1.821.872,48 | 0,00         | 10.022.464,24 | -22.359,19  | -0,22% ▼  | 1,10%       |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO       | 2.722.630,39   | 0,00         | 0,00         | 2.724.902,69  | 2.272,30    | 0,08% ▲   | 0,88%       |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP                   | 4.330.348,79   | 0,00         | 0,00         | 4.331.326,72  | 977,93      | 0,02% ▲   | 1,02%       |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO        | 3.035.176,61   | 0,00         | 3.071.830,86 | 0,00          | 36.654,25   | 1,21% ▲   | 2,07%       |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP                 | 1.226.035,26   | 0,00         | 0,00         | 1.231.573,80  | 5.538,54    | 0,45% ▲   | 0,05%       |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA                | 22.166.122,76  | 1.500.000,00 | 0,00         | 23.475.306,58 | -190.816,18 | -0,81% ▼  | 1,68%       |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP   | 14.734.721,40  | 0,00         | 0,00         | 14.725.153,01 | -9.568,39   | -0,06% ▼  | 0,95%       |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP        | 7.725.109,79   | 0,00         | 0,00         | 7.726.183,61  | 1.073,82    | 0,01% ▲   | 1,00%       |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP          | 9.044.726,62   | 0,00         | 0,00         | 9.008.670,62  | -36.056,00  | -0,40% ▼  | 2,05%       |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA           | 12.401.024,43  | 1.763.805,39 | 3.677.283,69 | 10.508.581,04 | 21.034,91   | 0,15% ▲   | 0,23%       |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP                | 2.049.395,98   | 0,00         | 0,00         | 2.057.175,59  | 7.779,61    | 0,38% ▲   | 0,02%       |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                        | 0,00           | 92.561,08    | 92.602,70    | 0,00          | 41,62       | 0,04% ▲   | 0,01%       |
|   | 87.658.242,98  | 5.178.238,95 | 6.841.717,25 | 85.811.337,90 | -183.426,78 | -0,21%    | 1,17%       |

| RENDA VARIÁVEL                                    | Saldo Anterior | Aplicações   | Resgates | Saldo Atual   | Retorno \$    | Retorno % | Risco - VaR |
|---|----------------|--------------|----------|---------------|---------------|-----------|-------------|
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES                          | 4.555.789,39   | 0,00         | 0,00     | 4.450.152,58  | -105.636,81   | -2,32% ▼  | 8,21%       |
| BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES                         | 2.357.014,93   | 0,00         | 0,00     | 2.291.453,88  | -65.561,05    | -2,78% ▼  | 8,28%       |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES                 | 6.700.600,11   | 0,00         | 0,00     | 6.432.637,16  | -267.962,95   | -4,00% ▼  | 7,73%       |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP          | 5.954.005,44   | 0,00         | 0,00     | 5.932.304,78  | -21.700,66    | -0,36% ▼  | 1,59%       |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES   | 6.189.818,31   | 0,00         | 0,00     | 5.901.533,16  | -288.285,15   | -4,66% ▼  | 7,70%       |
| CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP | 2.684.324,45   | 0,00         | 0,00     | 2.671.855,40  | -12.469,05    | -0,46% ▼  | 1,46%       |
| CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP                    | 2.066.453,02   | 0,00         | 0,00     | 2.049.263,06  | -17.189,96    | -0,83% ▼  | 2,54%       |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES                   | 4.637.448,81   | 0,00         | 0,00     | 4.393.902,48  | -243.546,33   | -5,25% ▼  | 8,98%       |
| BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP             | 0,00           | 1.250.000,00 | 0,00     | 1.251.306,11  | 1.306,11      | 0,10% ▲   | 0,08%       |
| -   | 35.145.454,46  | 1.250.000,00 | 0,00     | 35.374.408,61 | -1.021.045,85 | -2,81%    | 5,90%       |

| ESTRUTURADOS                                      | Saldo Anterior | Aplicações   | Resgates | Saldo Atual   | Retorno \$    | Retorno % | Risco - VaR |
|---|----------------|--------------|----------|---------------|---------------|-----------|-------------|
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES                          | 4.555.789,39   | 0,00         | 0,00     | 4.450.152,58  | -105.636,81   | -2,32% ▼  | 8,21%       |
| BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES                         | 2.357.014,93   | 0,00         | 0,00     | 2.291.453,88  | -65.561,05    | -2,78% ▼  | 8,28%       |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES                 | 6.700.600,11   | 0,00         | 0,00     | 6.432.637,16  | -267.962,95   | -4,00% ▼  | 7,73%       |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP          | 5.954.005,44   | 0,00         | 0,00     | 5.932.304,78  | -21.700,66    | -0,36% ▼  | 1,59%       |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES   | 6.189.818,31   | 0,00         | 0,00     | 5.901.533,16  | -288.285,15   | -4,66% ▼  | 7,70%       |
| CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP | 2.684.324,45   | 0,00         | 0,00     | 2.671.855,40  | -12.469,05    | -0,46% ▼  | 1,46%       |
| CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP                    | 2.066.453,02   | 0,00         | 0,00     | 2.049.263,06  | -17.189,96    | -0,83% ▼  | 2,54%       |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES                   | 4.637.448,81   | 0,00         | 0,00     | 4.393.902,48  | -243.546,33   | -5,25% ▼  | 8,98%       |
| BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP             | 0,00           | 1.250.000,00 | 0,00     | 1.251.306,11  | 1.306,11      | 0,10% ▲   | 0,08%       |
| -   | 35.145.454,46  | 1.250.000,00 | 0,00     | 35.374.408,61 | -1.021.045,85 | -2,81%    | 5,90%       |

| FUNDOS IMOBILIÁRIOS                               | Saldo Anterior | Aplicações   | Resgates | Saldo Atual   | Retorno \$    | Retorno % | Risco - VaR |
|---|----------------|--------------|----------|---------------|---------------|-----------|-------------|
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES                          | 4.555.789,39   | 0,00         | 0,00     | 4.450.152,58  | -105.636,81   | -2,32% ▼  | 8,21%       |
| BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES                         | 2.357.014,93   | 0,00         | 0,00     | 2.291.453,88  | -65.561,05    | -2,78% ▼  | 8,28%       |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES                 | 6.700.600,11   | 0,00         | 0,00     | 6.432.637,16  | -267.962,95   | -4,00% ▼  | 7,73%       |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP          | 5.954.005,44   | 0,00         | 0,00     | 5.932.304,78  | -21.700,66    | -0,36% ▼  | 1,59%       |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES   | 6.189.818,31   | 0,00         | 0,00     | 5.901.533,16  | -288.285,15   | -4,66% ▼  | 7,70%       |
| CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP | 2.684.324,45   | 0,00         | 0,00     | 2.671.855,40  | -12.469,05    | -0,46% ▼  | 1,46%       |
| CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP                    | 2.066.453,02   | 0,00         | 0,00     | 2.049.263,06  | -17.189,96    | -0,83% ▼  | 2,54%       |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES                   | 4.637.448,81   | 0,00         | 0,00     | 4.393.902,48  | -243.546,33   | -5,25% ▼  | 8,98%       |
| BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP             | 0,00           | 1.250.000,00 | 0,00     | 1.251.306,11  | 1.306,11      | 0,10% ▲   | 0,08%       |
| -   | 35.145.454,46  | 1.250.000,00 | 0,00     | 35.374.408,61 | -1.021.045,85 | -2,81%    | 5,90%       |



| INVESTIMENTOS NO EXTERIOR                  | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual  | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|--|----------------|------------|----------|--------------|------------|-----------|-------------|
| BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | 1.929.897,41   | 0,00       | 0,00     | 2.031.075,87 | 101.178,46 | 5,24% ▲   | 7,26%       |
|  | 1.929.897,41   | 0,00       | 0,00     | 2.031.075,87 | 101.178,46 | 5,24%     | 0,00%       |

