



# INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS - CAPREV



Janeiro a Dezembro de 2021



Patrimônio  
R\$ 27.032.085,06

Rentabilidade  
Mês Acum.  
0,28% -0,69%

Meta  
Mês Acum.  
1,21% 16,52%

Gap  
Mês Acum.  
-0,93% -17,21%

VaR  
0,53%

### Evolução do Patrimônio

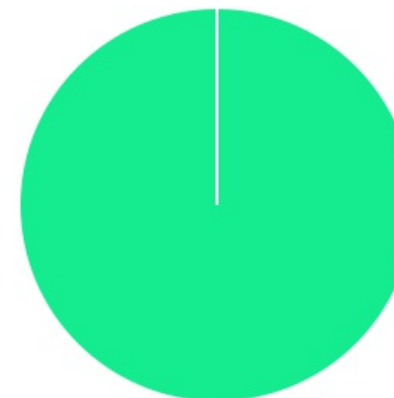


### Comparativo (Rentabilidades | Metas)

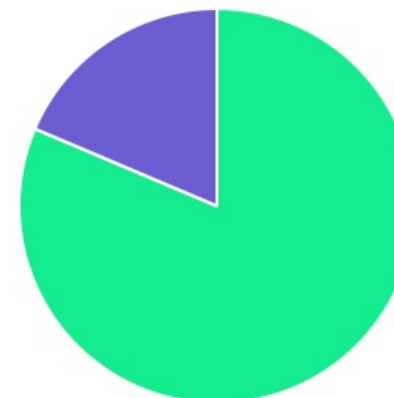


| ATIVO                           | SALDO             | CARTEIRA(%) | RESG. | 3.922     | RETORNO (R\$)   | (%)    |
|---------------------------------|-------------------|-------------|-------|-----------|-----------------|--------|
| CAIXA BRASIL IMA-B TP FI RF     | R\$ 4.721.353,96  | 17.47%      | D+0   | 7, I "b"  | R\$ -73.373,68  | 0,00%  |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP FI...   | R\$ 4.343.682,41  | 16.07%      | D+0   | 7, I "b"  | R\$ 179.583,88  | 0,00%  |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI...   | R\$ 1.058.964,32  | 3.92%       | D+0   | 7, I "b"  | R\$ 11.188,11   | 0,00%  |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP FI...  | R\$ 4.005.057,77  | 14.82%      | D+0   | 7, I "b"  | R\$ -301.555,75 | 0,00%  |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP... | R\$ 2.185.425,55  | 8.08%       | D+0   | 7, I "b"  | R\$ 126.267,24  | 0,00%  |
| BNB RPPS IMA-B FI RF            | R\$ 5.687.464,92  | 21.04%      | D+3   | 7, I "b"  | R\$ -56.448,32  | 0,00%  |
| CAIXA FIC FI NOVO BRASIL RF...  | R\$ 4.965.526,48  | 18.37%      | D+0   | 7, IV "a" | R\$ -75.419,60  | 0,00%  |
| CAIXA BRASIL FI RF REF DI...    | R\$ 64.005,31     | 0.24%       | D+0   | 7, IV "a" | R\$ 2.811,86    | 0,00%  |
| Total investimentos             | R\$ 27.031.480,72 | 100.00%     |       |           | R\$ -186.946,26 | -0,69% |
| Disponibilidade                 | R\$ 604,34        | -           |       |           | -               | -      |
| Total patrimônio                | R\$ 27.032.085,06 | 100.00%     |       |           | -               | -      |

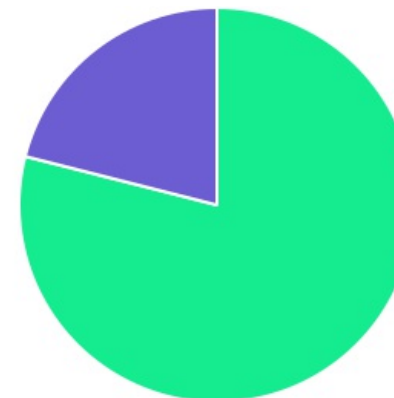
| CLASSE     | PERCENTUAL | VALOR             | LEG.                                                                                |
|------------|------------|-------------------|-------------------------------------------------------------------------------------|
| Renda Fixa | 100,00%    | R\$ 27.031.480,72 |  |
| Total      | 100,00%    | R\$ 27.031.480,72 |                                                                                     |



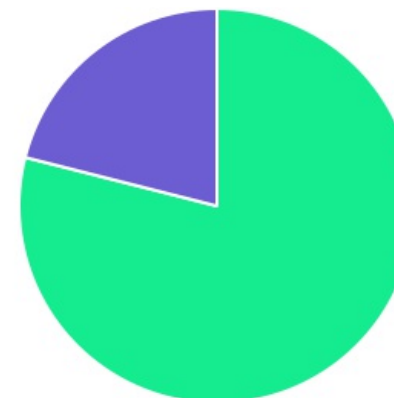
| ENQUADRAMENTO                     | PERCENTUAL | VALOR             | LEG.                                                                                |
|-----------------------------------|------------|-------------------|-------------------------------------------------------------------------------------|
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " | 81,39%     | R\$ 22.001.948,93 |  |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea "a"  | 18,61%     | R\$ 5.029.531,79  |  |
| Total                             | 100,00%    | R\$ 27.031.480,72 |                                                                                     |



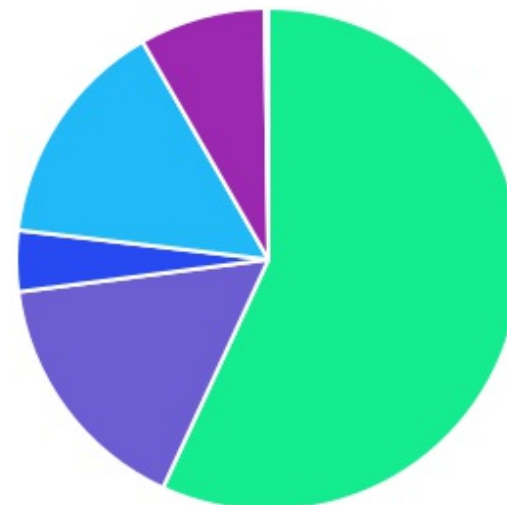
| GESTOR              | PERCENTUAL | VALOR             | LEG. |
|---------------------|------------|-------------------|------|
| CAIXA DISTRIBUIDORA | 78,96%     | R\$ 21.344.015,80 |      |
| BANCO DO NORDESTE   | 21,04%     | R\$ 5.687.464,92  |      |
| Total               | 100,00%    | R\$ 27.031.480,72 |      |



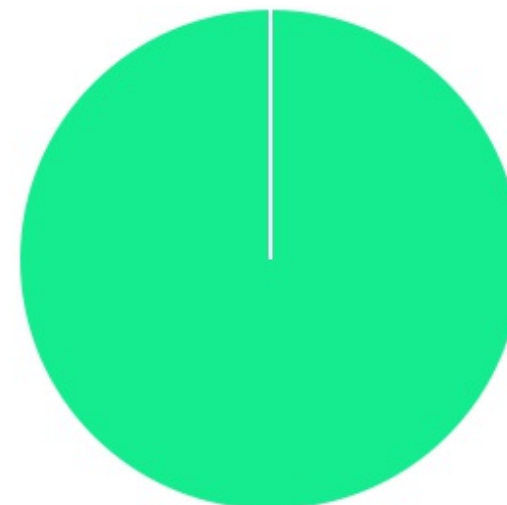
| ADMINISTRADOR    | PERCENTUAL | VALOR             | LEG. |
|------------------|------------|-------------------|------|
| CAIXA ECONOMICA  | 78,96%     | R\$ 21.344.015,80 |      |
| SANTANDER CACEIS | 21,04%     | R\$ 5.687.464,92  |      |
| Total            | 100,00%    | R\$ 27.031.480,72 |      |



| BENCHMARK    | PERCENTUAL     | VALOR                    | LEG. |
|--------------|----------------|--------------------------|------|
| IMA-B        | 56,88%         | R\$ 15.374.345,36        |      |
| IMA-B 5      | 16,07%         | R\$ 4.343.682,41         |      |
| IMA-B 5+     | 14,82%         | R\$ 4.005.057,77         |      |
| IDKA IPCA 2A | 8,08%          | R\$ 2.185.425,55         |      |
| IRF-M 1      | 3,92%          | R\$ 1.058.964,32         |      |
| CDI          | 0,24%          | R\$ 64.005,31            |      |
| <b>Total</b> | <b>100,00%</b> | <b>R\$ 27.031.480,72</b> |      |



| LIQUIDEZ    | PERCENTUAL | VALOR             | LEG.        |
|-------------|------------|-------------------|-------------|
| 0 a 30 dias | 100,00%    | R\$ 27.031.480,72 | <div></div> |
| Total       | 100,00%    | R\$ 27.031.480,72 |             |



| RENDA FIXA                                             | RESOLUÇÃO(%) | CARTEIRA (R\$)    | (%)     | POLÍTICA DE INVESTIMENTO |         |             |
|--------------------------------------------------------|--------------|-------------------|---------|--------------------------|---------|-------------|
|                                                        |              |                   |         | Inferior(%)              | Alvo(%) | Superior(%) |
| Títulos Tesouro Nacional - SELIC - 7, I "a"            | 100%         | R\$ 0,00          | 0.00%   | 0,00%                    | 0,00%   | 0,00%       |
| FI Renda Fixa Referenciado 100% títulos TN - 7, I "b"  | 100%         | R\$ 22.001.948,93 | 81.39%  | 50,00%                   | 55,00%  | 100,00%     |
| FI em Índices de Renda Fixa 100% títulos TN - 7, I "c" | 100%         | R\$ 0,00          | 0.00%   | 0,00%                    | 0,00%   | 100,00%     |
| Operações Compromissadas - 7, II                       | 5%           | R\$ 0,00          | 0.00%   | 0,00%                    | 0,00%   | 0,00%       |
| FI Renda Fixa Referenciados - 7, III "a"               | 60%          | R\$ 0,00          | 0.00%   | 0,00%                    | 10,00%  | 60,00%      |
| FI de Índices Renda Fixa - 7, III "b"                  | 60%          | R\$ 0,00          | 0.00%   | 0,00%                    | 0,00%   | 60,00%      |
| FI de Renda Fixa - 7, IV "a"                           | 40%          | R\$ 5.029.531,79  | 18.61%  | 0,00%                    | 10,00%  | 40,00%      |
| FI de Índices Renda Fixa - 7, IV "b"                   | 40%          | R\$ 0,00          | 0.00%   | 0,00%                    | 0,00%   | 40,00%      |
| Letras Imobiliárias Garantidas - 7, V "b"              | 20%          | R\$ 0,00          | 0.00%   | 0,00%                    | 0,00%   | 10,00%      |
| Certificados de Depósitos Bancários (CDB) - 7, VI "a"  | 15%          | R\$ 0,00          | 0.00%   | 0,00%                    | 0,00%   | 15,00%      |
| Poupança - 7, VI "b"                                   | 15%          | R\$ 0,00          | 0.00%   | 0,00%                    | 0,00%   | 0,00%       |
| FI Direitos Creditórios (FIDC) - sênior - 7, VII "a"   | 5%           | R\$ 0,00          | 0.00%   | 0,00%                    | 0,00%   | 5,00%       |
| FI Renda Fixa "Crédito Privado" - 7, VII "b"           | 5%           | R\$ 0,00          | 0.00%   | 0,00%                    | 5,00%   | 5,00%       |
| FI Debêntures - 7, VII "c"                             | 5%           | R\$ 0,00          | 0.00%   | 0,00%                    | 0,00%   | 5,00%       |
| Total Renda Fixa                                       |              | R\$ 27.031.480,72 | 100,00% |                          |         |             |

| RENDA VARIÁVEL                               | RESOLUÇÃO(%) | CARTEIRA (R\$)    | (%)     | POLÍTICA DE INVESTIMENTO |         |             |
|----------------------------------------------|--------------|-------------------|---------|--------------------------|---------|-------------|
|                                              |              |                   |         | Inferior(%)              | Alvo(%) | Superior(%) |
| FI Ações Referenciados - 8, I "a"            | 30%          | R\$ 0,00          | 0.00%   | 0,00%                    | 0,00%   | 20,00%      |
| FI de Índices Ações Referenciados - 8, I "b" | 30%          | R\$ 0,00          | 0.00%   | 0,00%                    | 0,00%   | 20,00%      |
| FI em Ações Livre - 8, II "a"                | 20%          | R\$ 0,00          | 0.00%   | 0,00%                    | 7,50%   | 20,00%      |
| FI de Índices em Ações Livre - 8, II "b"     | 20%          | R\$ 0,00          | 0.00%   | 0,00%                    | 0,00%   | 20,00%      |
| FI Multimercado - 8, III                     | 10%          | R\$ 0,00          | 0.00%   | 0,00%                    | 7,50%   | 10,00%      |
| FI em Participações - 8, IV "a"              | 5%           | R\$ 0,00          | 0.00%   | 0,00%                    | 0,00%   | 5,00%       |
| FI Imobiliário - 8, IV "b"                   | 5%           | R\$ 0,00          | 0.00%   | 0,00%                    | 5,00%   | 0,00%       |
| Total Renda Variável                         |              | R\$ 0,00          | 0,00%   |                          |         |             |
| INVESTIMENTOS NO EXTERIOR                    | RESOLUÇÃO(%) | CARTEIRA (R\$)    | (%)     | Inferior(%)              | Alvo(%) | Superior(%) |
| Renda Fixa - Dívida Externa - 9 - A, I       | 10%          | R\$ 0,00          | 0.00%   | 0,00%                    | 0,00%   | 0,00%       |
| Investimento no Exterior - 9 - A, II         | 10%          | R\$ 0,00          | 0.00%   | 0,00%                    | 0,00%   | 0,00%       |
| Ações – BDR Nível I - 9 - A, III             | 10%          | R\$ 0,00          | 0.00%   | 0,00%                    | 0,00%   | 0,00%       |
| Total Investimentos no exterior              |              | R\$ 0,00          | 0,00%   |                          |         |             |
| Total Global                                 |              | R\$ 27.031.480,72 | 100,00% |                          |         |             |

| PERÍODO   | SALDO ANTERIOR    | SALDO FINAL       | META   | RENT.(R\$)      | RENT.(%) | GAP     |
|-----------|-------------------|-------------------|--------|-----------------|----------|---------|
| 2021      | IPCA + 5.87% a.a. |                   |        |                 |          |         |
| Janeiro   | R\$ 26.483.918,17 | R\$ 25.958.942,48 | 0,73%  | R\$ -198.860,42 | -0,74%   | -1,47%  |
| Fevereiro | R\$ 25.958.942,48 | R\$ 26.305.698,20 | 1,34%  | R\$ -364.253,98 | -1,39%   | -2,72%  |
| Março     | R\$ 26.305.698,20 | R\$ 26.313.570,69 | 1,41%  | R\$ -98.434,68  | -0,36%   | -1,77%  |
| Abril     | R\$ 26.313.570,69 | R\$ 26.640.851,70 | 0,79%  | R\$ 173.579,71  | 0,66%    | -0,13%  |
| Maio      | R\$ 26.640.851,70 | R\$ 26.836.943,17 | 1,31%  | R\$ 262.394,00  | 0,98%    | -0,32%  |
| Junho     | R\$ 26.836.943,17 | R\$ 26.858.447,30 | 1,01%  | R\$ 80.906,84   | 0,30%    | -0,70%  |
| Julho     | R\$ 26.858.447,30 | R\$ 26.859.993,46 | 1,44%  | R\$ -87.192,46  | -0,32%   | -1,76%  |
| Agosto    | R\$ 26.859.993,46 | R\$ 27.008.762,53 | 1,35%  | R\$ -248.474,31 | -0,93%   | -2,28%  |
| Setembro  | R\$ 27.008.762,53 | R\$ 26.891.495,13 | 1,64%  | R\$ 10.797,72   | 0,04%    | -1,60%  |
| Outubro   | R\$ 26.891.495,13 | R\$ 26.248.360,20 | 1,73%  | R\$ -633.629,92 | -2,34%   | -4,07%  |
| Novembro  | R\$ 26.248.360,20 | R\$ 26.050.242,57 | 1,43%  | R\$ 846.010,27  | 3,23%    | 1,80%   |
| Dezembro  | R\$ 26.050.242,57 | R\$ 27.032.085,06 | 1,21%  | R\$ 70.210,97   | 0,28%    | -0,93%  |
| Total     | R\$ 26.050.242,57 | R\$ 27.032.085,06 | 16,52% | R\$ -186.946,26 | -0,69%   | -17,21% |

| ATIVO                           | CNPJ               | RENTABILIDADE |             | Ano |
|---------------------------------|--------------------|---------------|-------------|-----|
|                                 |                    | 1º Semestre   | 2º Semestre |     |
| CAIXA BRASIL FI RF REF DI...    | 03.737.206/0001-97 | -             | -           | -   |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI...   | 10.740.670/0001-06 | -             | -           | -   |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP FI...   | 11.060.913/0001-10 | -             | -           | -   |
| CAIXA BRASIL IMA-B TP FI RF     | 10.740.658/0001-93 | -             | -           | -   |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP... | 14.386.926/0001-71 | -             | -           | -   |
| BNB RPPS IMA-B FI RF            | 08.266.261/0001-60 | -             | -           | -   |
| CAIXA FIC FI NOVO BRASIL RF...  | 10.646.895/0001-90 | -             | -           | -   |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP FI...  | 10.577.503/0001-88 | -             | -           | -   |

| TÍTULO | VENC. | COMPRA | QTD. | P.U.   |       | MARCAÇÃO | VALOR COMPRA | VALOR ATUAL | RETORNO            |
|--------|-------|--------|------|--------|-------|----------|--------------|-------------|--------------------|
|        |       |        |      | COMPRA | ATUAL |          |              |             |                    |
|        |       |        |      |        |       |          | R\$ 0,00     | R\$ 0,00    | R\$ 0,00 ( 0,00% ) |

As informações deste relatório foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela LEMA, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.