

# 2021

## Relatório Mensal

### Janeiro

### Análise dos Investimentos

De acordo com a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.160.275,64	7,09%	9.200.599.633,08	0,01%	7º I b
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	172.970,24	1,06%	8.385.200.938,80	0,00%	7º I b
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	2.712.702,47	16,59%	606.033.486,21	0,45%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.915.088,76	17,82%	14.822.912.413,17	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.052.402,69	12,55%	10.852.113.121,11	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.359.169,31	8,31%	6.185.705.380,20	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	381.339,22	2,33%	10.435.150.283,00	0,00%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	341.799,51	2,09%	2.465.176.454,79	0,01%	7º I b
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	1.235.968,08	7,56%	781.607.838,45	0,16%	8º II a
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.365.189,79	8,35%	4.216.751.115,32	0,03%	8º II a
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	870.690,37	5,32%	1.713.137.037,95	0,05%	8º II a
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	835.404,11	5,11%	4.834.227.738,16	0,02%	8º III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	596.996,95	3,65%	968.155.241,19	0,06%	8º III
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	354.856,65	2,17%	120.527.585,40	0,29%	8º IV b

Investimentos

\$ 16.354.853,79

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 16.354.853,79

Governança (Pró Gestão)

📄 Não possui

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre	Política de Investimentos			GAP Superior		
				Inferior %	Alvo %	Superior %			
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	67,84%	11.095.747,84	32,16%	5.259.105,95	10,98%	54,88%	68,60%	123.681,86
7º IV a - FI de Renda Fixa	40,00%	0,00%	0,00	40,00%	6.541.941,52	4,07%	20,34%	40,00%	6.541.941,52
8º II a - FI em Ações	20,00%	21,23%	3.471.848,24	-1,23%	-200.877,48	3,68%	18,38%	20,00%	-200.877,48
8º III - FI Multimercado	10,00%	8,76%	1.432.401,06	1,24%	203.084,32	3,08%	3,08%	10,00%	203.084,32
8º IV b - FI Imobiliário	5,00%	2,17%	354.856,65	2,83%	462.886,04	0,00%	2,68%	5,00%	462.886,04
9º A II - Constituídos no Brasil	10,00%	0,00%	0,00	10,00%	1.635.485,38	0,00%	0,32%	5,00%	817.742,69
9º A III - Ações - BDR Nível I	10,00%	0,00%	0,00	10,00%	1.635.485,38	0,00%	0,32%	5,00%	817.742,69

Governança (Pró Gestão)

📄 Não possui

Renda Fixa

\$ 11.095.747,84 67,84%

Renda Variável

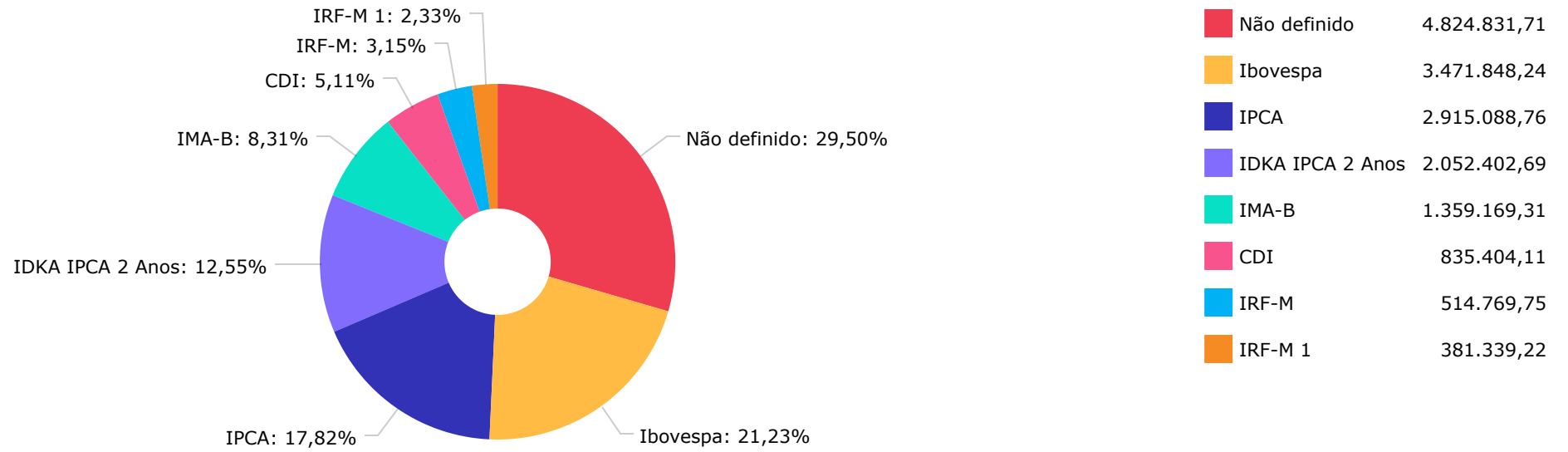
\$ 5.259.105,95 32,16%

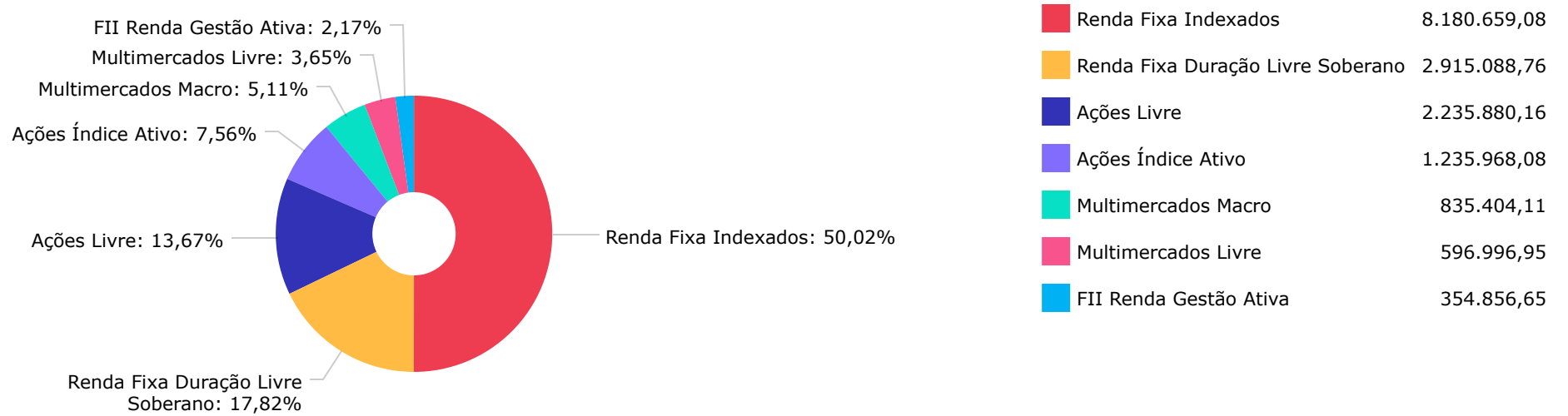
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
<b>NÃO DEFINIDO (BENCHMARK)</b>								
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,18	0,18	3,07	4,24	7,69	18,77	0,95	2,01
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	-0,84	-0,84	1,58	-0,12	6,32	18,27	1,65	3,47
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,23	0,23	4,92	2,43	3,04		2,43	5,12
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-1,43	-1,43	-12,66	-27,37	-40,00	-60,57	7,37	15,52
<b>CDI (BENCHMARK)</b>								
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,09	-0,09	4,50	3,05	2,72	17,79	1,73	3,65
<b>IBOVESPA (BENCHMARK)</b>								
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-3,32	-3,32	22,47	11,81	1,15	18,15		
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-2,91	-2,91	19,42	1,12	-24,63	-1,24	13,45	28,34
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	-2,48	-2,48	13,85	13,11	-4,84	13,16	12,40	26,12
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-1,46	-1,46	17,60	12,10	-6,09	23,46	10,78	22,70
<b>IDKA IPCA 2 ANOS (BENCHMARK)</b>								
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,13	0,13	3,03	4,04	7,68	18,78	1,02	2,15
<b>IMA-B (BENCHMARK)</b>								
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,85	-0,85	6,04	2,78	5,23	24,29		
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,87	-0,87	5,99	2,66	4,88	23,46	2,57	5,42
<b>IPCA (BENCHMARK)</b>								
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,25	0,25	2,51	4,30	4,56	8,94		
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,03	0,03	2,18	0,99	5,82	20,75	0,76	1,60
<b>IRF-M (BENCHMARK)</b>								
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,80	-0,80	1,50	-0,15	4,92	16,95		
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,80	-0,80	1,50	-0,29	4,65	16,40	1,53	3,21
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,77	-0,77	1,51	-0,25	4,73	16,38	1,53	3,23

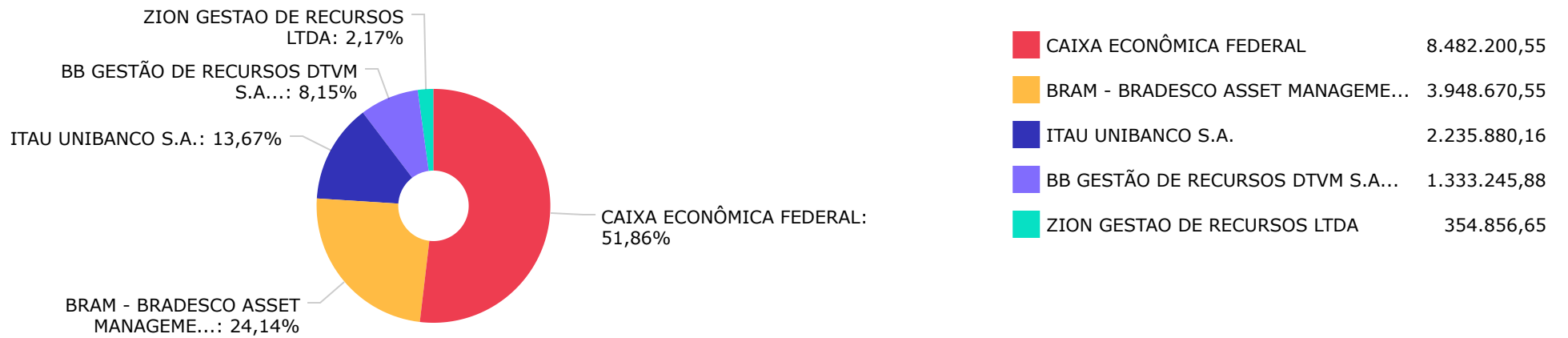
---

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
<b>IRF-M 1 (BENCHMARK)</b>	<b>0,04</b>	<b>0,04</b>	<b>0,58</b>	<b>1,02</b>	<b>3,43</b>	<b>10,27</b>		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,03	0,03	0,53	0,90	3,22	9,83	0,15	0,33

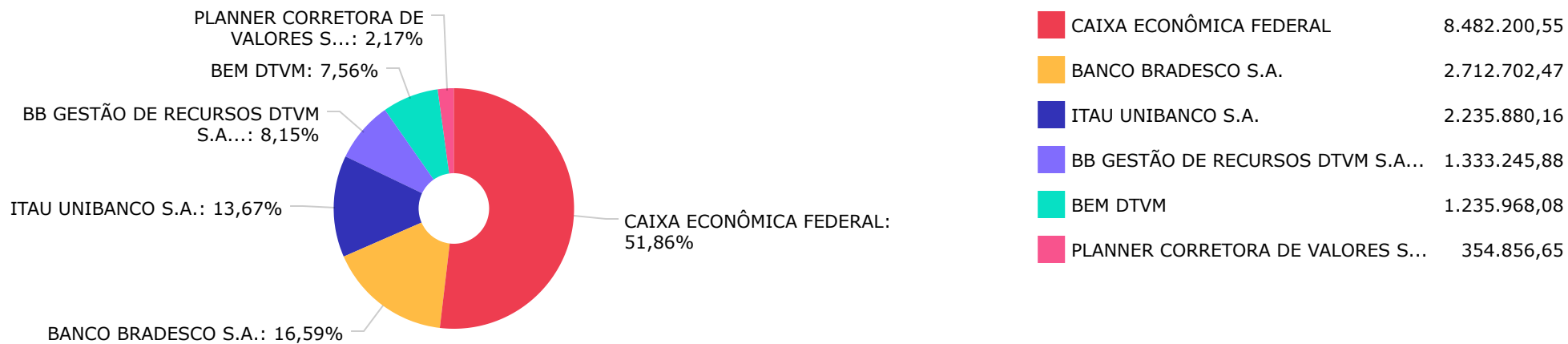
---



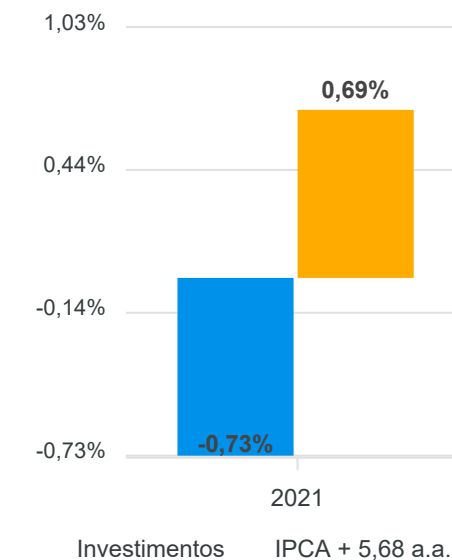
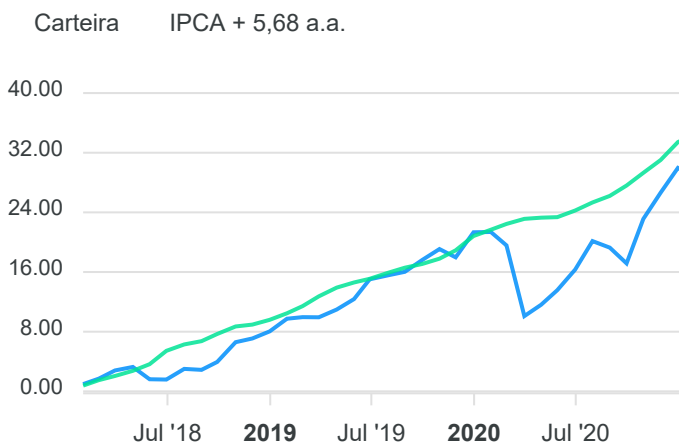
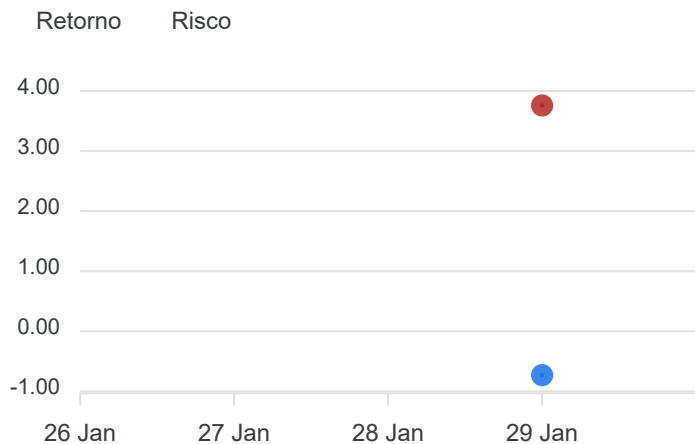








Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Meta %	Risco - VaR
Janeiro	16.999.182,71	0,00	520.000,00	16.354.853,79	-124.328,92	-0,73% ▼	0,69%	3,76%
<b>Acumulado</b>					<b>-124.328,92</b>	<b>-0,73% ▲</b>	<b>0,69%</b>	



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.158.225,69	0,00	0,00	1.160.275,64	2.049,95	0,18% ▲	0,95%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	174.363,00	0,00	0,00	172.970,24	-1.392,76	-0,80% ▼	1,53%
BRANCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	2.735.807,57	0,00	0,00	2.712.702,47	-23.105,10	-0,84% ▼	1,65%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.914.351,70	0,00	0,00	2.915.088,76	737,06	0,03% ▲	0,76%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.049.664,02	0,00	0,00	2.052.402,69	2.738,67	0,13% ▲	1,02%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.899.695,30	0,00	520.000,00	1.359.169,31	-20.525,99	-1,08% ▼	2,57%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	381.243,09	0,00	0,00	381.339,22	96,13	0,03% ▲	0,15%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	344.455,68	0,00	0,00	341.799,51	-2.656,17	-0,77% ▼	1,53%
	11.657.806,05	0,00	520.000,00	11.095.747,84	-42.058,21	-0,36%	1,28%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	1.267.406,71	0,00	0,00	1.235.968,08	-31.438,63	-2,48% ▼	12,40%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	359.999,50	0,00	0,00	354.856,65	-5.142,85	-1,43% ▼	7,37%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	836.142,60	0,00	0,00	835.404,11	-738,49	-0,09% ▼	1,73%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	595.603,33	0,00	0,00	596.996,95	1.393,62	0,23% ▲	2,43%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.385.473,12	0,00	0,00	1.365.189,79	-20.283,33	-1,46% ▼	10,78%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	896.751,40	0,00	0,00	870.690,37	-26.061,03	-2,91% ▼	13,45%
	5.341.376,66	0,00	0,00	5.259.105,95	-82.270,71	-1,54%	8,99%