

2022

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
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.727.291,41	15,37%	11.686.800.915,89	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.345.342,54	7,58%	10.879.369.499,05	0,01%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	319.134,15	1,80%	12.040.160.059,77	0,00%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.030.332,18	5,80%	4.513.989.587,78	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.054.789,95	17,21%	6.296.869.255,71	0,05%	7º I b
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.710.171,95	15,27%	1.144.155.045,62	0,24%	7º III a
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	615.765,34	3,47%	1.306.762.954,01	0,05%	7º III a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	303.602,78	1,71%	9.998.166.423,55	0,00%	7º III a
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	1.064.017,79	5,99%	1.713.886.049,91	0,06%	7º III a
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	619.756,70	3,49%	571.613.964,36	0,11%	8º I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	748.921,71	4,22%	3.306.700.129,00	0,02%	8º I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	583.758,31	3,29%	785.013.336,45	0,07%	8º I
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	223.525,78	1,26%	3.479.303.240,79	0,01%	9º III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	491.384,49	2,77%	245.412.810,09	0,20%	9º III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	553.337,95	3,12%	3.132.192.028,90	0,02%	10º I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	515.702,01	2,91%	1.086.032.593,80	0,05%	10º I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	629.170,15	3,54%	2.221.853.983,54	0,03%	10º I
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	213.942,56	1,21%	372.043.037,60	0,06%	11º

Investimentos

\$ 17.749.947,75

Disponibilidades Financeiras

\$ 34.300,23

Total Carteira

\$ 17.784.247,98

Governança (Pró Gestão)
 Não possui

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre	Política de Investimentos			GAP Superior		
				Inferior %	Alvo %	Superior %			
7° I a - Títulos TN SELIC	100,00%	0,00%	0,00	100,00%	17.784.247,98	0,00%	4,00%	100,00%	17.784.247,98
7° I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	47,67%	8.476.890,23	52,33%	9.307.357,75	0,00%	39,00%	100,00%	9.307.357,75
7° I c - ETF 100% Títulos TN	100,00%	0,00%	0,00	100,00%	17.784.247,98	0,00%	1,00%	100,00%	17.784.247,98
7° III a - FI Referenciados RF	60,00%	26,39%	4.693.557,86	33,61%	5.976.990,93	0,00%	20,00%	60,00%	5.976.990,93
7° IV - Ativos Financeiros de RF - Emissão de Instituições	20,00%	0,00%	0,00	20,00%	3.556.849,60	0,00%	1,00%	20,00%	3.556.849,60
7° V a - FIDC Cota Sênior	5,00%	0,00%	0,00	5,00%	889.212,40	0,00%	1,00%	5,00%	889.212,40
7° V b - Fundos de RF - Crédito Privado	5,00%	0,00%	0,00	5,00%	889.212,40	0,00%	1,00%	5,00%	889.212,40
7° V c - Fundos de Debentures Infraestrutura	5,00%	0,00%	0,00	5,00%	889.212,40	0,00%	1,00%	5,00%	889.212,40
8° I - Fundos de Ações	30,00%	10,98%	1.952.436,72	19,02%	3.382.837,67	0,00%	20,00%	30,00%	3.382.837,67
9° III - Ações - BDR Nível I	10,00%	4,02%	714.910,27	5,98%	1.063.514,53	0,00%	5,00%	10,00%	1.063.514,53
10° I - Fundos Multimercados	10,00%	9,55%	1.698.210,11	0,45%	80.214,69	0,00%	5,00%	10,00%	80.214,69
11° - Fundos Imobiliários	5,00%	1,20%	213.942,56	3,80%	675.269,84	0,00%	2,00%	5,00%	675.269,84

Governança (Pró Gestão)

📅 Não possui

Renda Fixa

\$ 13.170.448,09 74,06%

Renda Variável

\$ 1.952.436,72 10,98%

Estruturados

\$ 1.698.210,11 9,55%

Fundo Imobiliário

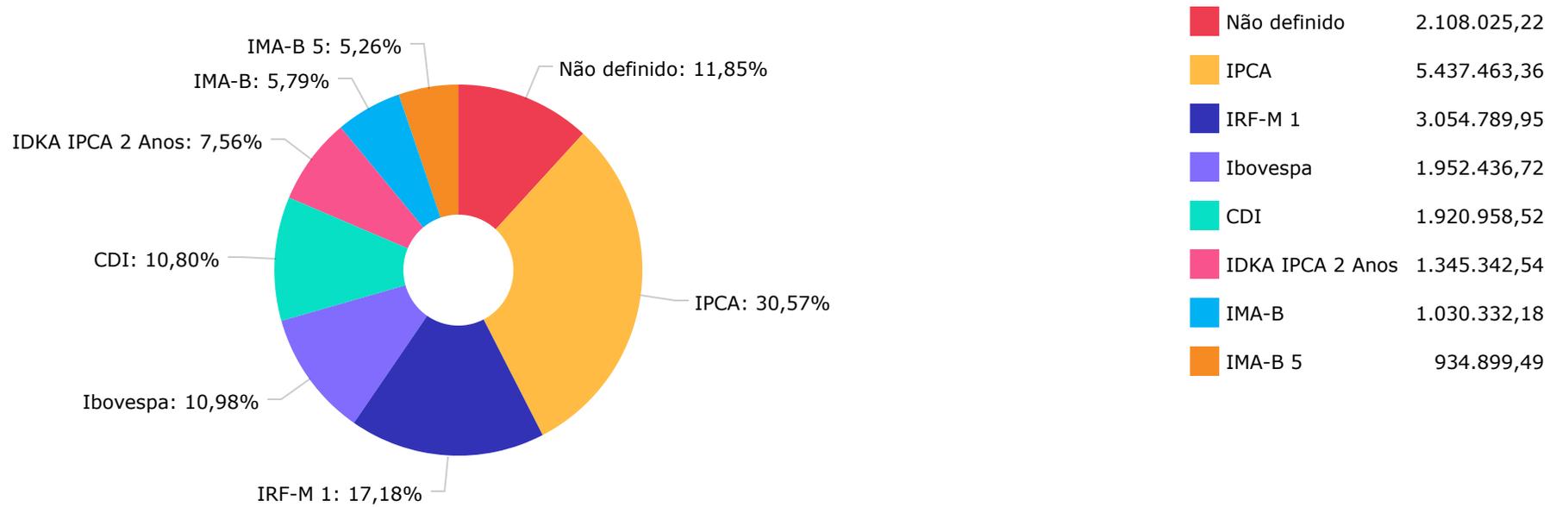
\$ 213.942,56 1,20%

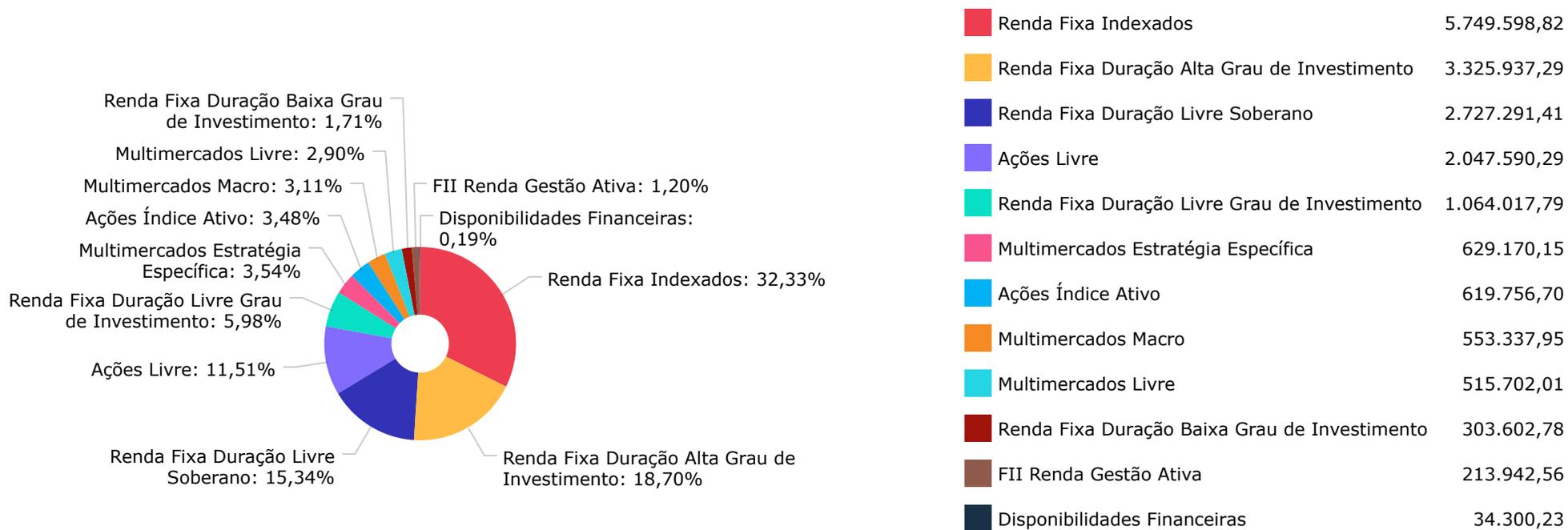
Exterior

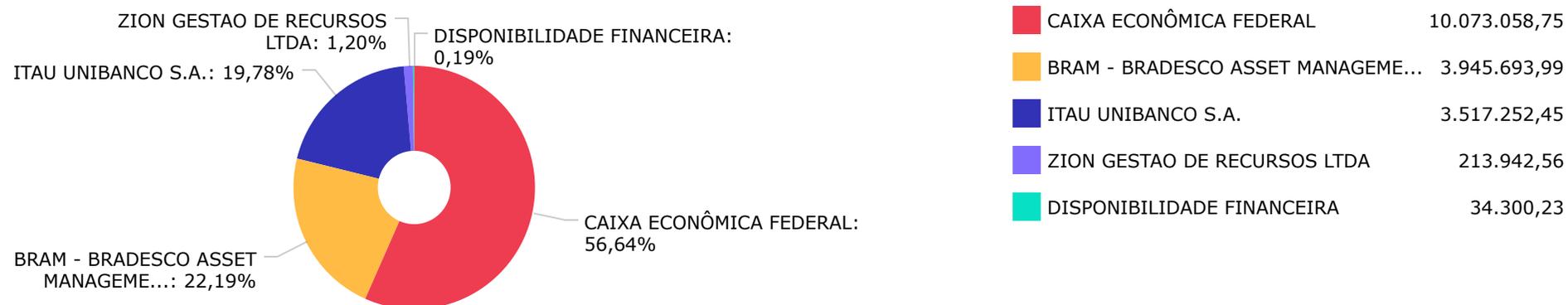
\$ 714.910,27 4,02%

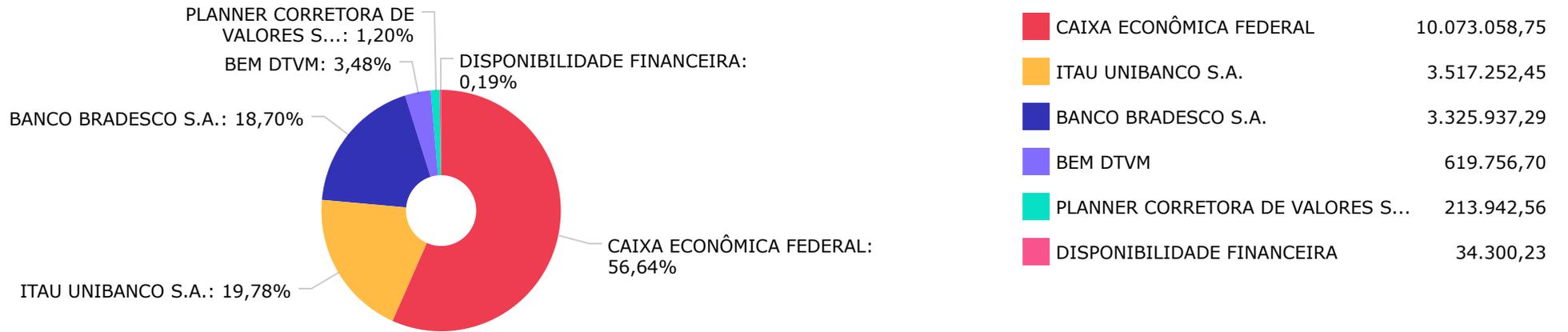
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
NÃO DEFINIDO (BENCHMARK)								
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	-5,29	-5,29	-0,54	5,54	25,95	41,47	8,58	18,07
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-24,91	-24,91	-18,43	170,13	201,45	80,87	41,52	87,43
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,83	-3,83	-4,05	9,54	20,21	57,28	9,23	19,44
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1,43	1,43	3,67	0,91	3,58	6,72	1,73	3,64
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-9,75	-9,75	-9,03	3,11	11,35	71,14	10,47	22,04
CDI (BENCHMARK)								
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,79	0,79	2,18	3,74	5,25	7,57	0,05	0,10
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,45	0,45	1,80	4,67	6,60	10,51	0,33	0,69
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,27	1,27	3,05	-0,01	2,83	5,63	1,39	2,92
IBOVESPA (BENCHMARK)								
BRADERCO SELECTION FI AÇÕES	6,78	6,78	6,78	-12,54	-9,79	-14,15	10,10	21,28
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1,34	1,34	0,85	-14,76	-5,90	-11,63	10,71	22,56
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	5,16	5,16	2,65	-20,19	-10,21	-32,32	10,97	23,11
IDKA IPCA 2 ANOS (BENCHMARK)								
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,02	0,02	3,17	3,14	4,54	12,57	1,11	2,33
IMA-B (BENCHMARK)								
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,73	-0,73	2,94	-0,91	-1,15	4,02	2,01	4,24
IMA-B 5 (BENCHMARK)								
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	0,08	0,08	3,34	3,06	3,76	11,27	0,98	2,07
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,09	0,09	3,35	3,20	4,32	11,89	0,99	2,08

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IPCA (BENCHMARK)	0,54	0,54	2,24	5,63	10,38	15,41		
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,24	0,24	2,49	1,09	0,67	4,30	0,70	1,47
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,67	0,67	2,42	0,62	0,53	6,39	0,36	0,76
IRF-M 1 (BENCHMARK)	0,63	0,63	2,31	2,55	3,53	7,08		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,61	0,61	2,25	2,44	3,30	6,63	0,37	0,79

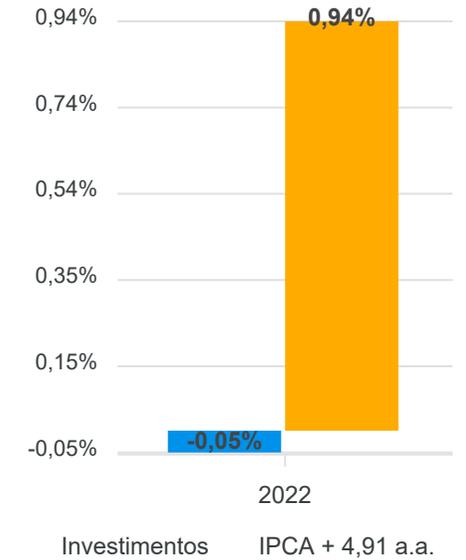
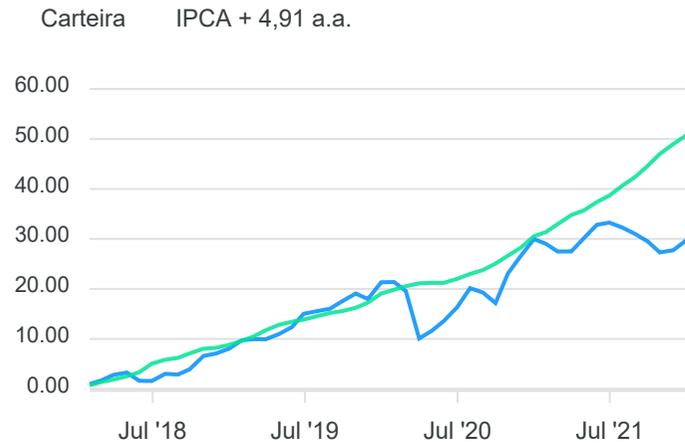
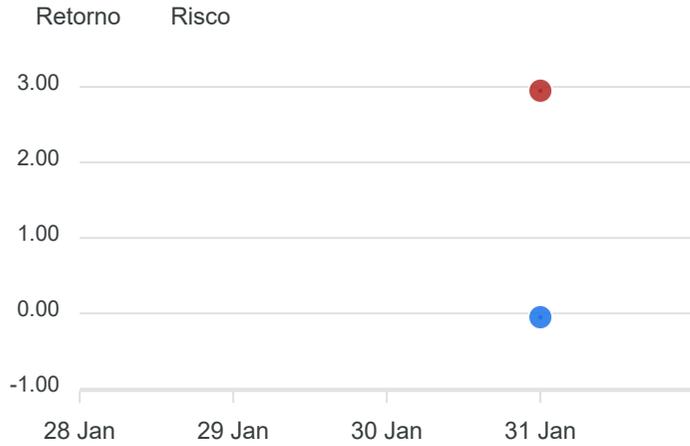








Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Meta %	Risco - VaR
Janeiro	18.540.137,29	0,00	780.527,08	17.749.947,75	-9.662,46	-0,05% ▼	0,94%	2,95%
Acumulado					-9.662,46	-0,05% ▲	0,94%	



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.703.744,95	0,00	0,00	2.710.171,95	6.427,00	0,24% ▲	0,70%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	615.302,51	0,00	0,00	615.765,34	462,83	0,08% ▲	0,98%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	301.232,27	0,00	0,00	303.602,78	2.370,51	0,79% ▲	0,05%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.709.204,58	0,00	0,00	2.727.291,41	18.086,83	0,67% ▲	0,36%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.345.089,49	0,00	0,00	1.345.342,54	253,05	0,02% ▲	1,11%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	318.845,98	0,00	0,00	319.134,15	288,17	0,09% ▲	0,99%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.038.192,72	0,00	0,00	1.030.332,18	-7.860,54	-0,76% ▼	2,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.812.110,28	0,00	780.527,08	3.054.789,95	23.206,75	0,61% ▲	0,37%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	1.059.221,01	0,00	0,00	1.064.017,79	4.796,78	0,45% ▲	0,33%
	13.902.943,79	0,00	780.527,08	13.170.448,09	48.031,38	0,35%	0,67%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	580.428,71	0,00	0,00	619.756,70	39.327,99	6,78% ▲	10,10%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	284.913,89	0,00	0,00	213.942,56	-70.971,33	-24,91% ▼	41,52%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	546.374,60	0,00	0,00	553.337,95	6.963,35	1,27% ▲	1,39%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	508.441,19	0,00	0,00	515.702,01	7.260,82	1,43% ▲	1,73%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	739.005,38	0,00	0,00	748.921,71	9.916,33	1,34% ▲	10,71%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	555.119,45	0,00	0,00	583.758,31	28.638,86	5,16% ▲	10,97%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	664.289,63	0,00	0,00	629.170,15	-35.119,48	-5,29% ▼	8,58%
	3.878.572,85	0,00	0,00	3.864.589,39	-13.983,46	-0,36%	9,48%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	247.663,12	0,00	0,00	223.525,78	-24.137,34	-9,75% ▼	10,47%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	510.957,53	0,00	0,00	491.384,49	-19.573,04	-3,83% ▼	9,23%
	758.620,65	0,00	0,00	714.910,27	-43.710,38	-5,76%	3,27%