

2021

Relatório Mensal

Novembro

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 | 2.687.018,26 | 16,20% | 13.063.702.370,09 | 0,02% | 7º I b |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1.335.477,91 | 8,05% | 10.904.431.852,46 | 0,01% | 7º I b |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 316.417,68 | 1,91% | 11.929.906.744,63 | 0,00% | 7º I b |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1.036.023,87 | 6,25% | 4.821.319.332,60 | 0,02% | 7º I b |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 2.121.118,80 | 12,79% | 6.377.941.010,36 | 0,03% | 7º I b |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 2.682.744,09 | 16,17% | 1.191.144.678,26 | 0,23% | 7º IV a |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA | 610.598,60 | 3,68% | 1.234.041.082,90 | 0,05% | 7º IV a |
| ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP | 1.054.349,93 | 6,36% | 1.661.985.161,11 | 0,06% | 7º IV a |
| BRADESCO SELECTION FI AÇÕES | 569.023,78 | 3,43% | 530.678.078,14 | 0,11% | 8º II a |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | 533.396,96 | 3,22% | 3.465.241.372,24 | 0,02% | 8º II a |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | 552.949,33 | 3,33% | 804.536.492,82 | 0,07% | 8º II a |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP | 538.649,38 | 3,25% | 3.617.061.388,69 | 0,01% | 8º III |
| CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP | 501.279,22 | 3,02% | 1.140.855.228,55 | 0,04% | 8º III |
| ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO | 629.390,42 | 3,79% | 2.308.841.355,72 | 0,03% | 8º III |
| BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11 | 179.999,75 | 1,09% | 313.016.978,75 | 0,06% | 8º IV b |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 542.338,07 | 3,27% | 3.764.762.598,77 | 0,01% | 9º A III |
| ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | 697.510,74 | 4,20% | 252.165.053,28 | 0,28% | 9º A III |

Investimentos

\$ 16.588.286,79

Disponibilidades Financeiras

\$ 234.026,06

Total Carteira

\$ 16.822.312,85

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% | 45,19% | 7.496.056,52 | 54,81% | 9.092.230,27 | 10,98% | 54,88% | 68,60% | 3.883.508,22 |
| 7º IV a - FI de Renda Fixa | 40,00% | 26,21% | 4.347.692,62 | 13,79% | 2.287.622,10 | 4,07% | 20,34% | 40,00% | 2.287.622,10 |
| 8º II a - FI em Ações | 20,00% | 9,98% | 1.655.370,07 | 10,02% | 1.662.287,29 | 3,68% | 18,38% | 20,00% | 1.662.287,29 |
| 8º III - FI Multimercado | 10,00% | 10,06% | 1.669.319,02 | -0,06% | -10.490,34 | 3,08% | 3,08% | 10,00% | -10.490,34 |
| 8º IV b - FI Imobiliário | 5,00% | 1,09% | 179.999,75 | 3,91% | 649.414,59 | 0,00% | 2,68% | 5,00% | 649.414,59 |
| 9º A II - Constituídos no Brasil | 10,00% | 0,00% | 0,00 | 10,00% | 1.658.828,68 | 0,00% | 0,32% | 5,00% | 829.414,34 |
| 9º A III - Ações - BDR Nível I | 10,00% | 7,47% | 1.239.848,81 | 2,53% | 418.979,87 | 0,00% | 0,32% | 5,00% | -410.434,47 |

Governança (Pró Gestão)

 Não possui

Renda Fixa

\$ 11.843.749,14 71,40%

Renda Variável

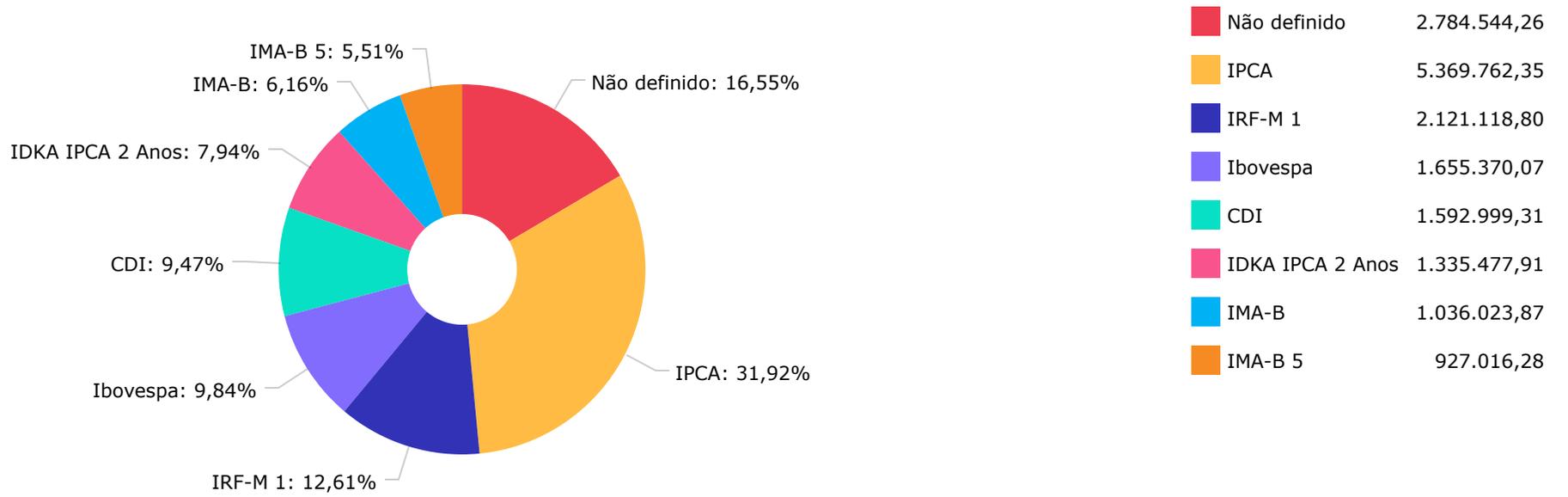
\$ 3.504.688,84 21,13%

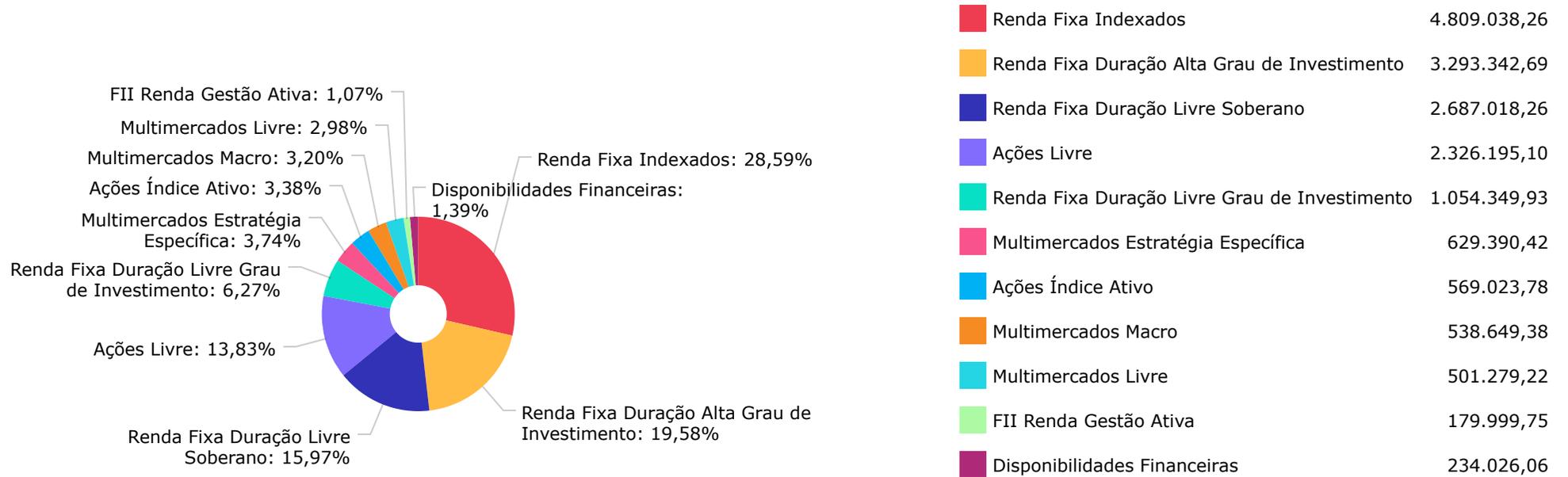
Exterior

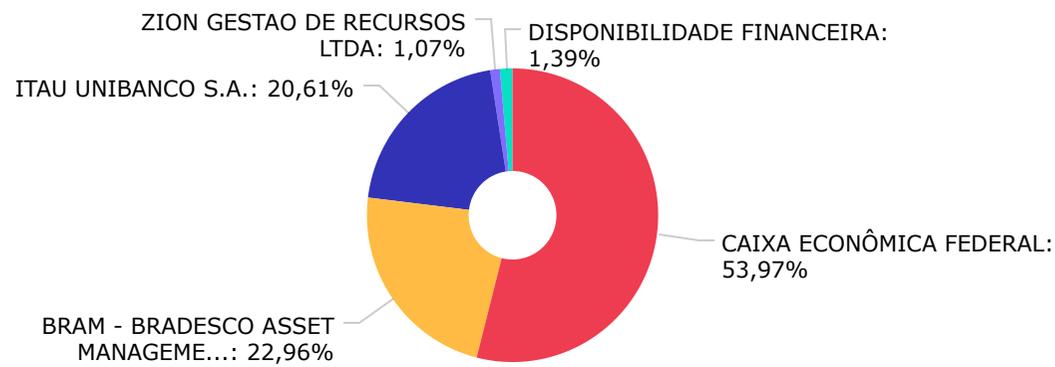
\$ 1.239.848,81 7,47%

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|---|--------|--------|--------|--------|--------|--------|-----------|--------------------|
| NÃO DEFINIDO (BENCHMARK) | | | | | | | | |
| ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO | -0,51 | 25,77 | 2,15 | 11,20 | 29,61 | 45,79 | 7,08 | 14,92 |
| CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP | 0,77 | 0,91 | -1,30 | -2,37 | 2,21 | 6,53 | 2,27 | 4,78 |
| BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11 | -31,37 | 150,00 | -52,05 | 121,52 | 121,52 | 66,67 | 24,86 | 52,35 |
| ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | -2,16 | 29,48 | 9,77 | 12,11 | 29,28 | 66,95 | 8,46 | 17,82 |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | -0,89 | 28,32 | 9,66 | 17,02 | 29,21 | 95,10 | 9,33 | 19,65 |
| CDI (BENCHMARK) | | | | | | | | |
| ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP | 0,88 | 5,51 | 3,00 | 4,70 | 5,82 | 10,51 | 0,36 | 0,76 |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP | 0,31 | 0,01 | -1,32 | -3,18 | 1,71 | 5,69 | 1,66 | 3,50 |
| IBOVESPA (BENCHMARK) | | | | | | | | |
| BRANCO SELECTION FI AÇÕES | -1,96 | -19,23 | -17,83 | -22,01 | -12,84 | -16,60 | 11,74 | 24,73 |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | -1,44 | -9,39 | -14,81 | -19,43 | -3,68 | -6,80 | 9,97 | 20,99 |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | -2,76 | -17,42 | -21,17 | -23,80 | -10,83 | -28,31 | 11,99 | 25,24 |
| IDKA IPCA 2 ANOS (BENCHMARK) | | | | | | | | |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 2,42 | 3,91 | 2,18 | 2,03 | 5,63 | 13,49 | 1,10 | 2,32 |
| IMA-B (BENCHMARK) | | | | | | | | |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 3,44 | -1,74 | 0,63 | -0,51 | 3,02 | 6,30 | 3,61 | 7,59 |
| IMA-B 5 (BENCHMARK) | | | | | | | | |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 2,47 | 3,52 | 2,19 | 2,18 | 5,40 | 12,88 | 1,20 | 2,53 |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA | 2,47 | 2,87 | 2,12 | 2,04 | 4,70 | 12,32 | 1,21 | 2,55 |
| IPCA (BENCHMARK) | | | | | | | | |
| | 0,95 | 9,26 | 3,40 | 5,86 | 10,74 | 15,51 | | |

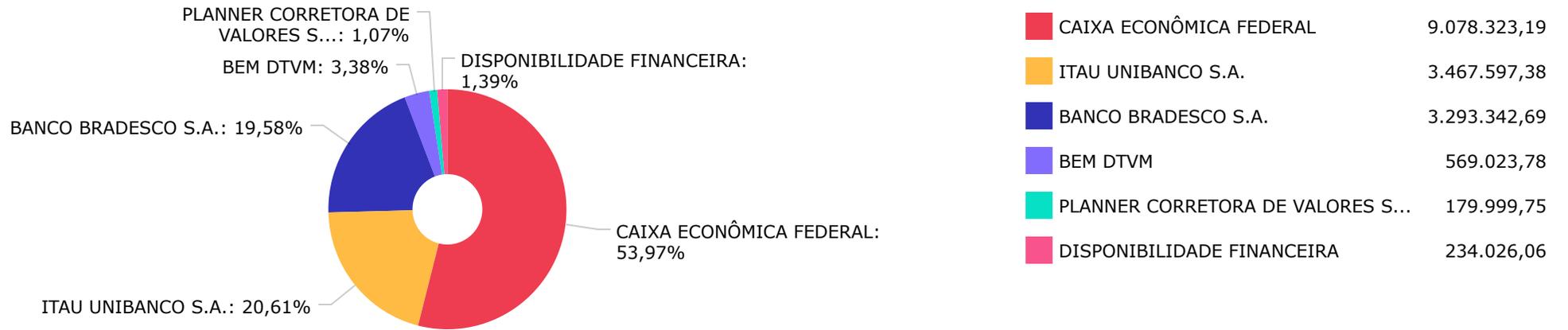
| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|---|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-----------|--------------------|
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 0,91 | -0,93 | 0,59 | -1,64 | 0,38 | 6,30 | 0,40 | 0,84 |
| BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 1,45 | -0,93 | 0,57 | 0,20 | 1,53 | 4,57 | 1,14 | 2,40 |
| IRF-M 1 (BENCHMARK) | 0,79 | 2,03 | 0,65 | 1,42 | 2,35 | 6,40 | | |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,78 | 1,84 | 0,62 | 1,32 | 2,13 | 5,96 | 0,32 | 0,68 |



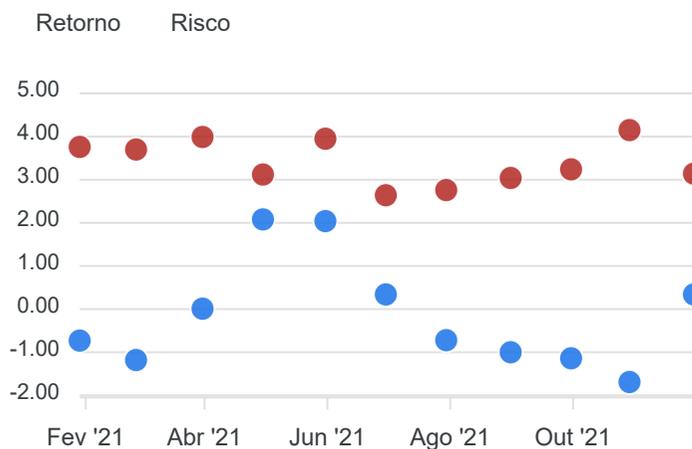
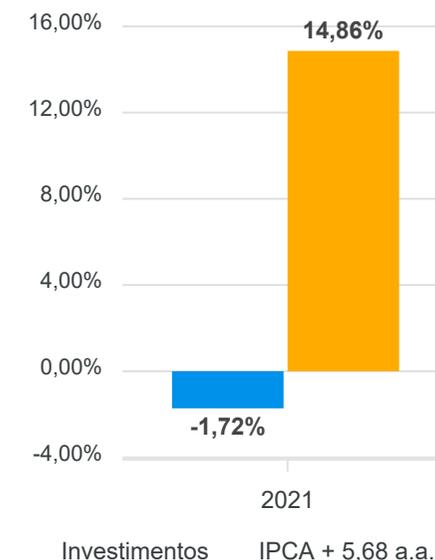




| | |
|-----------------------------------|--------------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | 9.078.323,19 |
| BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEME... | 3.862.366,47 |
| ITAU UNIBANCO S.A. | 3.467.597,38 |
| ZION GESTAO DE RECURSOS LTDA | 179.999,75 |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA | 234.026,06 |



| 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% |
| Fevereiro | 16.354.853,79 | 580.000,00 | 305.000,00 | 16.433.202,68 | -196.651,11 | -1,18% ▼ | 1,26% | 3,70% |
| Março | 16.433.202,68 | 1.180.000,00 | 1.003.339,05 | 16.612.305,04 | 2.441,41 | 0,01% ▲ | 1,44% | 3,99% |
| Abril | 16.612.305,04 | 940.000,00 | 955.000,00 | 16.943.066,43 | 345.761,39 | 2,08% ▲ | 0,75% | 3,12% |
| Mai | 16.943.066,43 | 4.968.441,92 | 5.315.289,75 | 16.941.571,66 | 345.353,06 | 2,04% ▲ | 1,30% | 3,95% |
| Junho | 16.941.571,66 | 4.908.692,17 | 4.039.818,96 | 17.870.455,82 | 60.010,95 | 0,34% ▲ | 0,99% | 2,64% |
| Julho | 17.870.455,82 | 1.532.800,81 | 1.673.355,05 | 17.601.934,57 | -127.967,01 | -0,72% ▼ | 1,45% | 2,76% |
| Agosto | 17.601.934,57 | 1.236.364,53 | 1.262.914,06 | 17.398.970,28 | -176.414,76 | -1,00% ▼ | 1,36% | 3,04% |
| Setembro | 17.398.970,28 | 1.013.250,02 | 1.177.844,17 | 17.035.322,46 | -199.053,67 | -1,14% ▼ | 1,63% | 3,24% |
| Outubro | 17.035.322,46 | 2.144.153,09 | 2.205.112,27 | 16.687.105,71 | -287.257,57 | -1,69% ▼ | 1,69% | 4,15% |
| Novembro | 16.687.105,71 | 4.269.155,94 | 4.424.521,43 | 16.588.286,79 | 56.546,57 | 0,34% ▲ | 1,39% | 3,14% |
| Acumulado | | | | | -301.559,66 | -1,72% ▲ | 14,86% | |



| RENDA FIXA | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|---|----------------|--------------|--------------|---------------|------------|-----------|-------------|
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1.174.991,09 | 0,00 | 1.180.076,60 | 0,00 | 5.085,51 | 0,43% ▲ | - |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 170.595,42 | 0,00 | 171.415,50 | 0,00 | 820,08 | 0,48% ▲ | - |
| BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 2.644.275,14 | 0,00 | 0,00 | 2.682.744,09 | 38.468,95 | 1,45% ▲ | 1,14% |
| BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA | 595.852,31 | 0,00 | 0,00 | 610.598,60 | 14.746,29 | 2,47% ▲ | 1,21% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 2.662.894,10 | 0,00 | 0,00 | 2.687.018,26 | 24.124,16 | 0,91% ▲ | 0,40% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1.303.971,68 | 0,00 | 0,00 | 1.335.477,91 | 31.506,23 | 2,42% ▲ | 1,10% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 308.797,19 | 0,00 | 0,00 | 316.417,68 | 7.620,49 | 2,47% ▲ | 1,20% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1.001.576,87 | 0,00 | 0,00 | 1.036.023,87 | 34.447,00 | 3,44% ▲ | 3,61% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1.211.789,09 | 2.164.307,60 | 1.269.673,09 | 2.121.118,80 | 14.695,20 | 0,44% ▲ | 0,32% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP | 0,00 | 1.053.356,24 | 0,00 | 1.054.349,93 | 993,69 | 0,09% ▲ | 0,36% |
| ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES | 0,00 | 1.051.492,10 | 1.053.356,24 | 0,00 | 1.864,14 | 0,18% ▲ | 0,00% |
| | 11.074.742,89 | 4.269.155,94 | 3.674.521,43 | 11.843.749,14 | 174.371,74 | 1,49% | 0,97% |

| RENDA VARIÁVEL | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|--|----------------|------------|------------|--------------|------------|-----------|-------------|
| BRDESCO SELECTION FI AÇÕES | 580.409,31 | 0,00 | 0,00 | 569.023,78 | -11.385,53 | -1,96% ▼ | 11,74% |
| BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11 | 262.285,35 | 0,00 | 0,00 | 179.999,75 | -82.285,60 | -31,37% ▼ | 24,86% |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP | 536.974,03 | 0,00 | 0,00 | 538.649,38 | 1.675,35 | 0,31% ▲ | 1,66% |
| CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP | 497.456,88 | 0,00 | 0,00 | 501.279,22 | 3.822,34 | 0,77% ▲ | 2,27% |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | 1.273.805,67 | 0,00 | 750.000,00 | 533.396,96 | 9.591,29 | 0,75% ▲ | 9,97% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | 568.661,14 | 0,00 | 0,00 | 552.949,33 | -15.711,81 | -2,76% ▼ | 11,99% |
| ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO | 632.610,70 | 0,00 | 0,00 | 629.390,42 | -3.220,28 | -0,51% ▼ | 7,08% |
| | 4.352.203,08 | 0,00 | 750.000,00 | 3.504.688,84 | -97.514,24 | -2,24% | 8,44% |

| INVESTIMENTOS NO EXTERIOR | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|--|----------------|------------|----------|--------------|------------|-----------|-------------|
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 547.219,62 | 0,00 | 0,00 | 542.338,07 | -4.881,55 | -0,89% ▼ | 9,33% |
| ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | 712.940,12 | 0,00 | 0,00 | 697.510,74 | -15.429,38 | -2,16% ▼ | 8,46% |
| | 1.260.159,74 | 0,00 | 0,00 | 1.239.848,81 | -20.310,93 | -1,61% | 4,08% |