

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
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.682.744,09	16,17%	1.191.144.678,26	0,23%	7º IV a
BRDESCO 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
BRDESCO 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

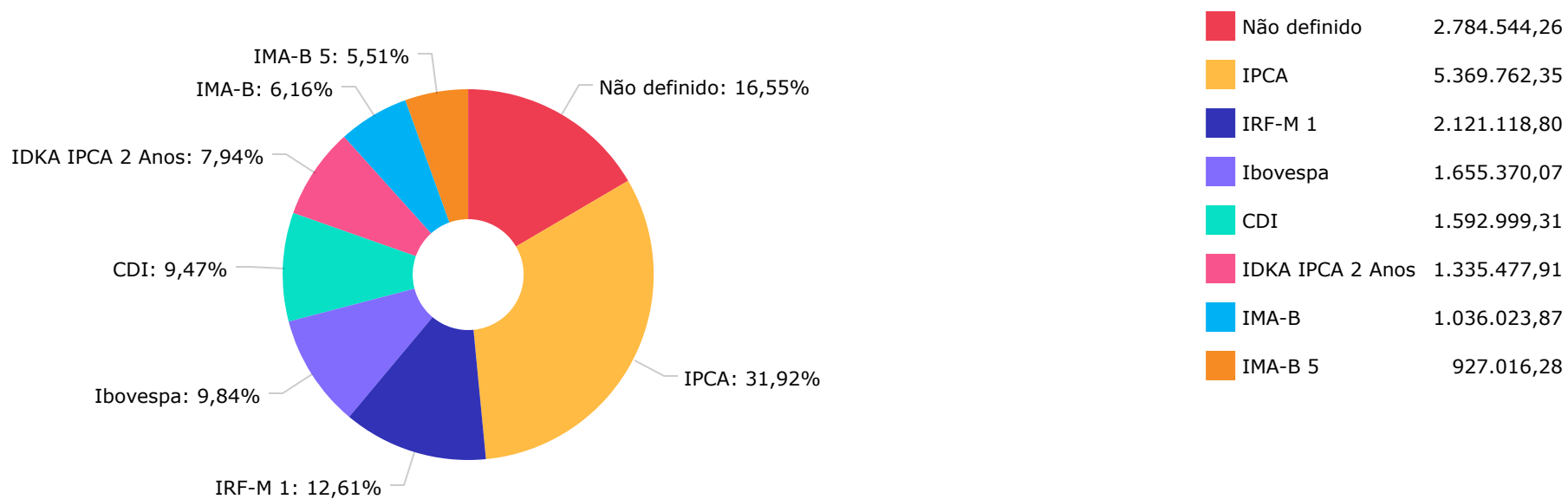
\$ 3.504.688,84 21,13%

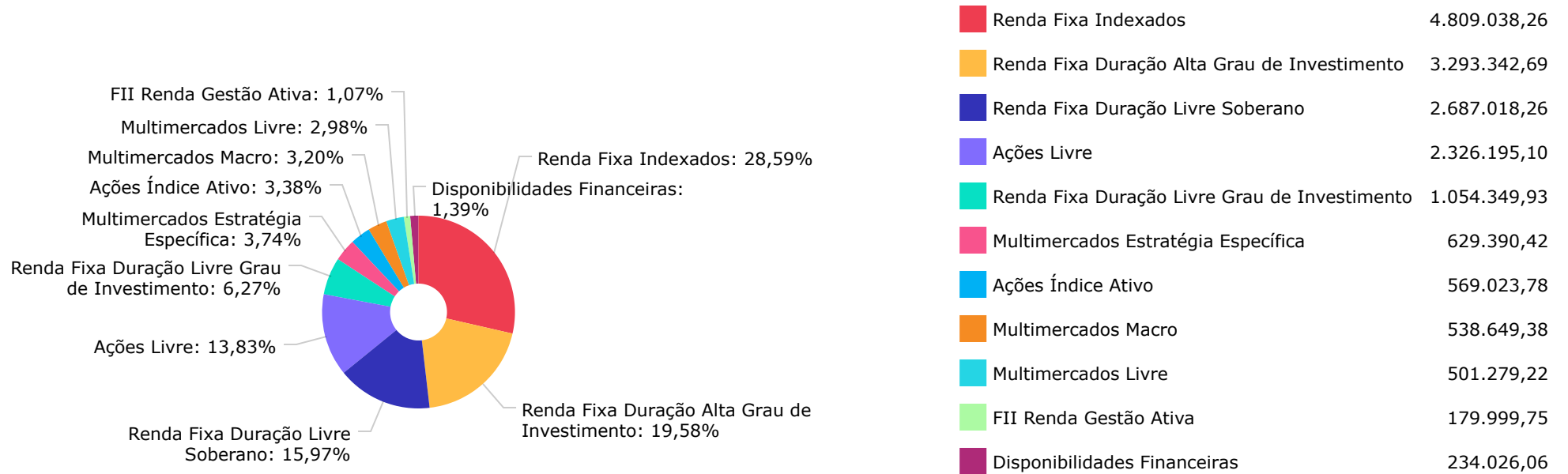
Exterior

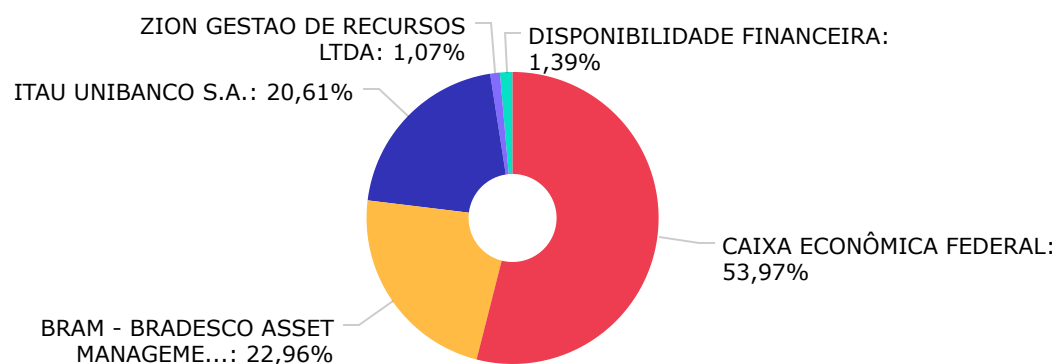
\$ 1.239.848,81 7,47%

	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		

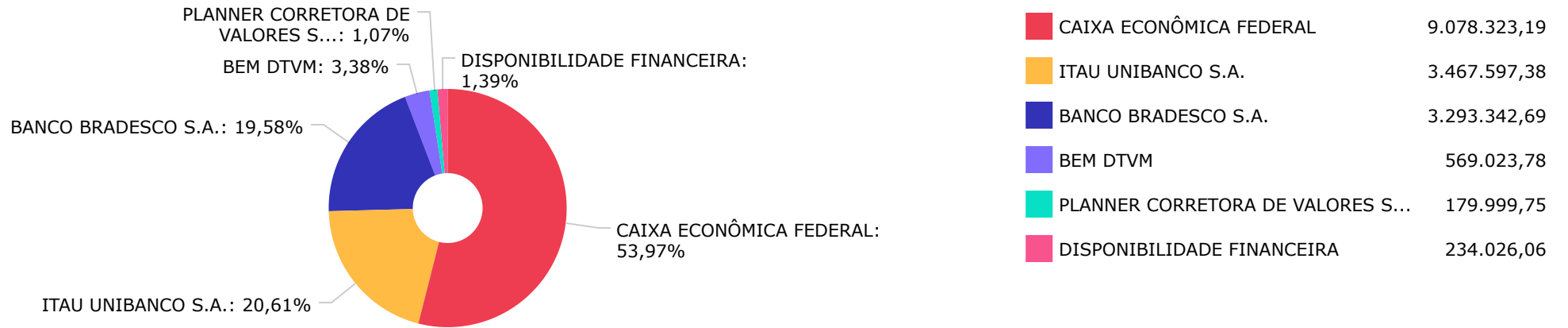
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,91	-0,93	0,59	-1,64	0,38	6,30	0,40	0,84
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,45	-0,93	0,57	0,20	1,53	4,57	1,14	2,40
IRF-M 1 (BENCHMARK)	0,79	2,03	0,65	1,42	2,35	6,40		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS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



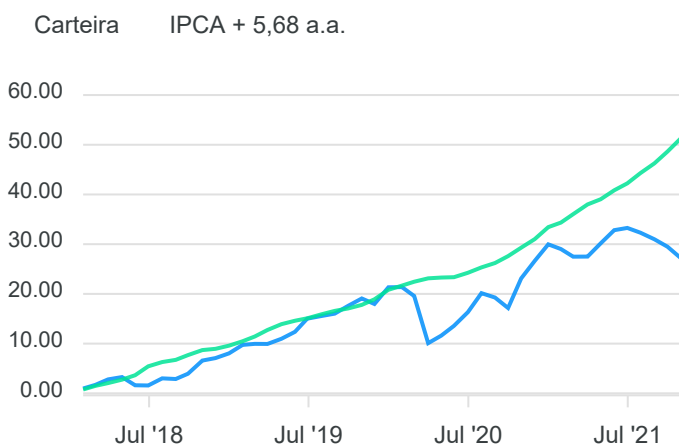
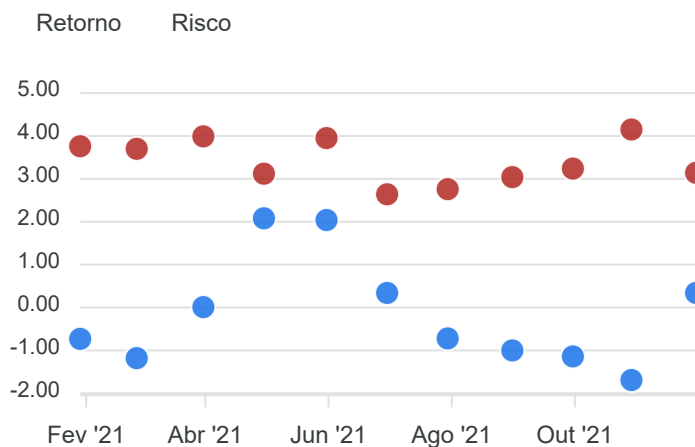
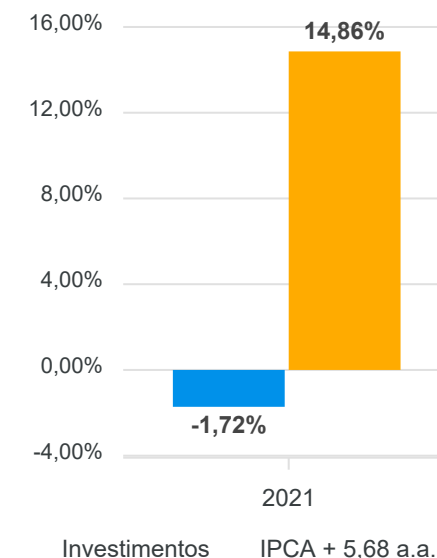




CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	9.078.323,19
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEME...	3.862.366,47
ITAU UNIBANCO S.A.	3.467.597,38
ZION GESTAO DE RECURSOS LTDA	179.999,75
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	234.026,06



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%