

2021

Relatório Mensal

Fevereiro

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	1.153.914,56	7,02%	8.720.364.653,89	0,01%	7º I b
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	170.910,89	1,04%	8.803.004.981,39	0,00%	7º I b
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	2.679.065,86	16,30%	568.971.296,52	0,47%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.900.293,46	17,65%	15.107.095.289,30	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.763.884,12	10,73%	10.914.192.598,49	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.905.486,26	11,60%	6.061.546.612,54	0,03%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	371.407,32	2,26%	9.935.744.303,82	0,00%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	322.858,21	1,96%	2.086.612.425,47	0,02%	7º I b
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	1.195.882,99	7,28%	748.567.197,38	0,16%	8º II a
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.371.651,42	8,35%	4.183.624.970,37	0,03%	8º II a
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	833.255,70	5,07%	1.485.782.395,03	0,06%	8º II a
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	830.626,61	5,05%	4.720.260.747,70	0,02%	8º III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	594.537,18	3,62%	983.583.081,34	0,06%	8º III
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	339.428,10	2,07%	115.287.255,60	0,29%	8º IV b

Investimentos

\$ 16.433.202,68

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 16.433.202,68

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%	68,57%	11.267.820,68	31,43%	5.165.382,00	10,98%	54,88%	68,60%	5.356,36
7º IV a - FI de Renda Fixa	40,00%	0,00%	0,00	40,00%	6.573.281,07	4,07%	20,34%	40,00%	6.573.281,07
8º II a - FI em Ações	20,00%	20,69%	3.400.790,11	-0,69%	-114.149,57	3,68%	18,38%	20,00%	-114.149,57
8º III - FI Multimercado	10,00%	8,67%	1.425.163,79	1,33%	218.156,48	3,08%	3,08%	10,00%	218.156,48
8º IV b - FI Imobiliário	5,00%	2,07%	339.428,10	2,93%	482.232,03	0,00%	2,68%	5,00%	482.232,03
9º A II - Constituídos no Brasil	10,00%	0,00%	0,00	10,00%	1.643.320,27	0,00%	0,32%	5,00%	821.660,13
9º A III - Ações - BDR Nível I	10,00%	0,00%	0,00	10,00%	1.643.320,27	0,00%	0,32%	5,00%	821.660,13

Governança (Pró Gestão)

📄 Não possui

Renda Fixa

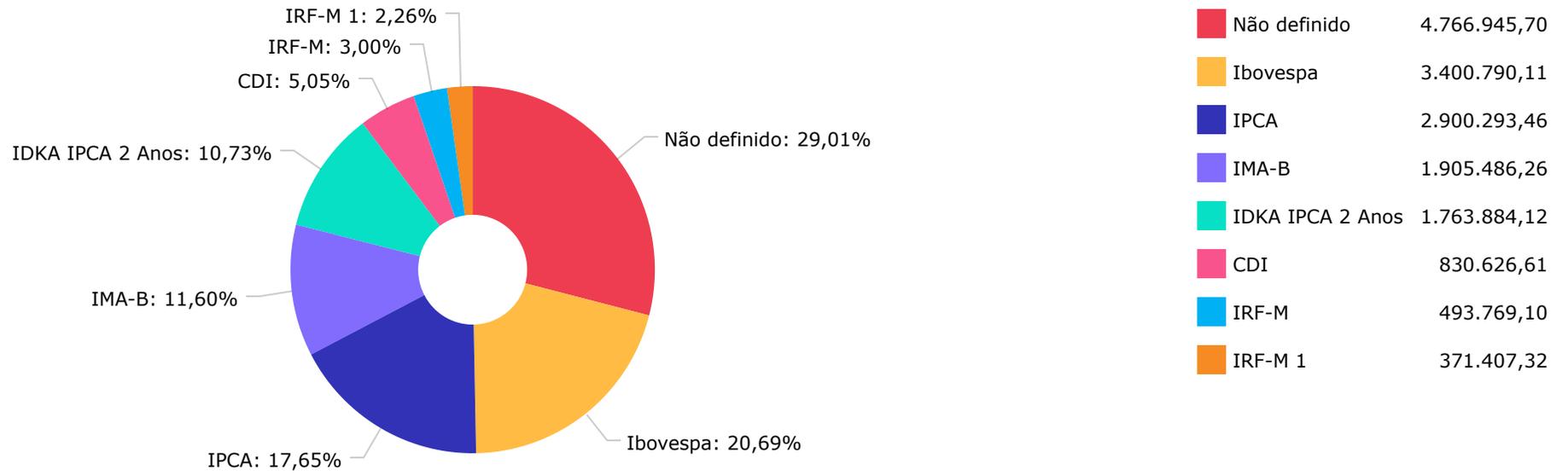
\$ 11.267.820,68 68,57%

Renda Variável

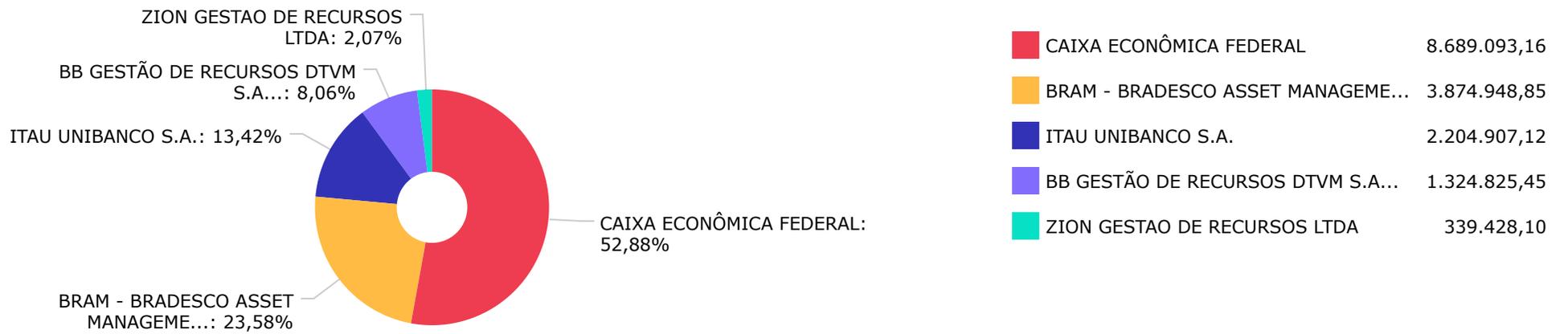
\$ 5.165.382,00 31,43%

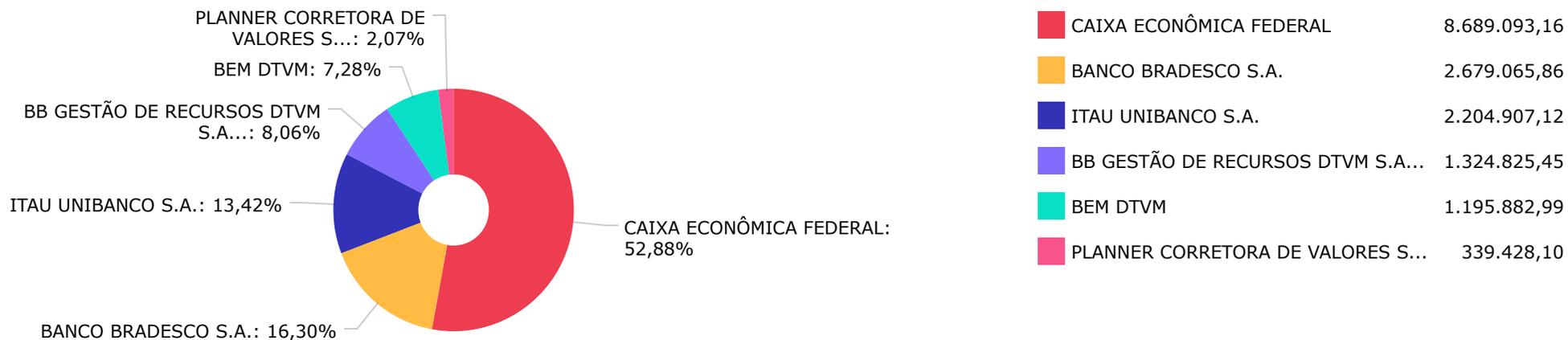
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
NÃO DEFINIDO (BENCHMARK)								
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,55	-0,37	1,15	2,96	6,43	17,41	1,09	2,29
BRADERCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	-1,24	-2,07	-0,16	-0,97	3,89	16,51	1,35	2,84
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	-0,41	-0,18	1,10	2,25	5,00		2,52	5,31
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-4,35	-5,71	-16,46	-26,67	-44,54	-61,18	11,93	25,13
CDI (BENCHMARK)								
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,57	-0,66	1,03	2,60	3,70	17,13	2,21	4,64
IBOVESPA (BENCHMARK)								
BRADERCO SELECTION FI AÇÕES	-3,24	-5,64	1,81	10,71	3,53	10,67	13,26	27,92
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	0,47	-1,00	5,23	12,85	4,60	25,63	10,10	21,27
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-4,30	-7,08	0,32	0,73	-20,50	-4,05	10,53	22,17
IDKA IPCA 2 ANOS (BENCHMARK)								
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,53	-0,39	1,25	2,68	6,48	17,50	1,30	2,74
IMA-B (BENCHMARK)								
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,54	-2,40	2,32	2,96	2,81	20,93	2,32	4,89
IPCA (BENCHMARK)								
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	-0,51	-0,48	0,83	1,04	4,64	19,53	0,95	2,01
IRF-M (BENCHMARK)								
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,19	-1,98	-0,05	-0,68	2,76	14,70	1,02	2,15
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,15	-1,92	0,01	-0,63	2,87	14,72	1,03	2,17

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IRF-M 1 (BENCHMARK)	0,04	0,08	0,39	0,94	3,08	9,80		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,02	0,04	0,33	0,82	2,87	9,36	0,10	0,22

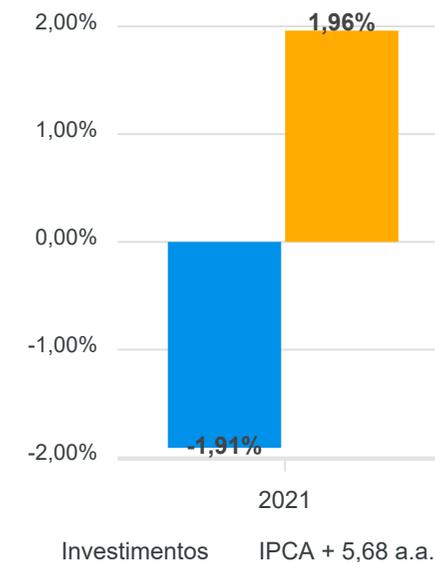
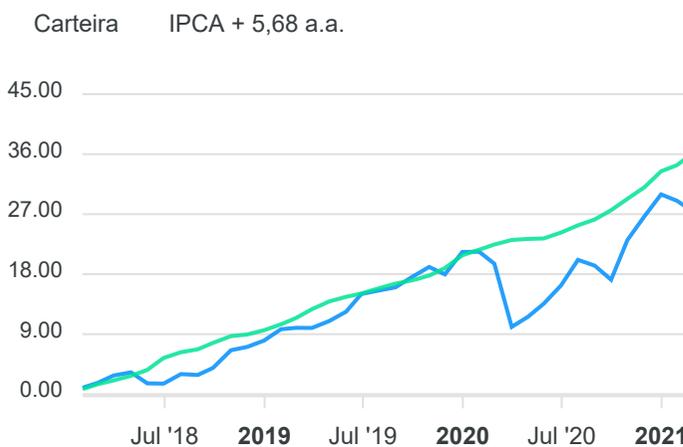
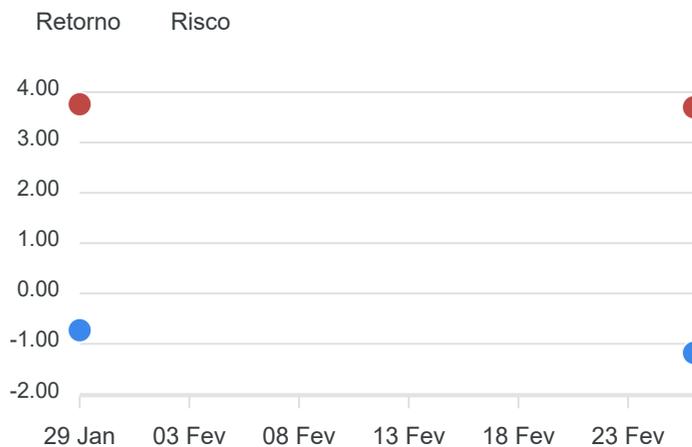








Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Meta %	Risco - VaR
Janeiro	16.999.182,71	0,00	520.000,00	16.354.853,79	-124.328,92	-0,73% ▼	0,69%	3,76%
Fevereiro	16.354.853,79	580.000,00	305.000,00	16.433.202,68	-196.651,11	-1,18% ▼	1,26%	3,70%
Acumulado					-320.980,03	-1,91% ▲	1,96%	



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.160.275,64	0,00	0,00	1.153.914,56	-6.361,08	-0,55% ▼	1,09%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	172.970,24	0,00	0,00	170.910,89	-2.059,35	-1,19% ▼	1,02%
BRANCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	2.712.702,47	0,00	0,00	2.679.065,86	-33.636,61	-1,24% ▼	1,35%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.915.088,76	0,00	0,00	2.900.293,46	-14.795,30	-0,51% ▼	0,95%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.052.402,69	0,00	280.000,00	1.763.884,12	-8.518,57	-0,42% ▼	1,30%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.359.169,31	580.000,00	0,00	1.905.486,26	-33.683,05	-1,74% ▼	2,32%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	381.339,22	0,00	10.000,00	371.407,32	68,10	0,02% ▲	0,10%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	341.799,51	0,00	15.000,00	322.858,21	-3.941,30	-1,15% ▼	1,03%
	11.095.747,84	580.000,00	305.000,00	11.267.820,68	-102.927,16	-0,91%	1,32%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	1.235.968,08	0,00	0,00	1.195.882,99	-40.085,09	-3,24% ▼	13,26%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	354.856,65	0,00	0,00	339.428,10	-15.428,55	-4,35% ▼	11,93%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	835.404,11	0,00	0,00	830.626,61	-4.777,50	-0,57% ▼	2,21%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	596.996,95	0,00	0,00	594.537,18	-2.459,77	-0,41% ▼	2,52%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.365.189,79	0,00	0,00	1.371.651,42	6.461,63	0,47% ▲	10,10%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	870.690,37	0,00	0,00	833.255,70	-37.434,67	-4,30% ▼	10,53%
	5.259.105,95	0,00	0,00	5.165.382,00	-93.723,95	-1,78%	8,88%