

# 2022

## 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      |
|---|--------------|------------|-------------------|-------|----------|
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA              | 174.861,34   | 1,03%      | 10.665.837.627,38 | 0,00% | 7º I b   |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 2.360.763,54 | 13,94%     | 10.680.932.817,60 | 0,02% | 7º I b   |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP      | 1.322.488,01 | 7,81%      | 11.612.568.005,11 | 0,01% | 7º I b   |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP     | 316.309,48   | 1,87%      | 1.307.933.038,85  | 0,02% | 7º I b   |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP        | 1.035.762,44 | 6,12%      | 4.318.650.723,31  | 0,02% | 7º I b   |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | 2.420.070,37 | 14,29%     | 5.808.584.551,28  | 0,04% | 7º I b   |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA                   | 2.728.351,71 | 16,11%     | 1.140.836.229,00  | 0,24% | 7º III a |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA               | 622.182,74   | 3,67%      | 1.292.134.068,48  | 0,05% | 7º III a |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP               | 306.089,50   | 1,81%      | 10.660.917.138,14 | 0,00% | 7º III a |
| ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP        | 1.073.442,95 | 6,34%      | 1.784.832.219,03  | 0,06% | 7º III a |
| BRADESCO SELECTION FI AÇÕES                                 | 607.701,93   | 3,59%      | 473.420.430,45    | 0,13% | 8º I     |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES                                      | 739.847,02   | 4,37%      | 3.107.474.506,24  | 0,02% | 8º I     |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES                        | 581.620,87   | 3,43%      | 806.172.605,99    | 0,07% | 8º I     |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I                    | 207.617,84   | 1,23%      | 2.975.370.153,41  | 0,01% | 9º III   |
| ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I                                  | 467.451,98   | 2,76%      | 219.193.307,26    | 0,21% | 9º III   |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP                    | 557.973,92   | 3,30%      | 3.013.896.606,88  | 0,02% | 10º I    |
| CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP           | 520.494,91   | 3,07%      | 1.011.298.001,63  | 0,05% | 10º I    |
| ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO                   | 615.430,96   | 3,63%      | 2.075.819.919,23  | 0,03% | 10º I    |
| BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11    | 274.628,19   | 1,62%      | 477.574.476,15    | 0,06% | 11º      |

**Investimentos**

\$ 16.933.089,70

**Disponibilidades Financeiras**

\$ 816.407,69

**Total Carteira**

\$ 17.749.497,39

**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%                   | 17.749.497,39 | 0,00%      | 4,00%        | 100,00% | 17.749.497,39 |
| 7° I b - FI 100% Títulos TN                                | 100,00%    | 42,99%    | 7.630.255,18 | 57,01%                    | 10.119.242,21 | 0,00%      | 39,00%       | 100,00% | 10.119.242,21 |
| 7° I c - ETF 100% Títulos TN                               | 100,00%    | 0,00%     | 0,00         | 100,00%                   | 17.749.497,39 | 0,00%      | 1,00%        | 100,00% | 17.749.497,39 |
| 7° III a - FI Referenciados RF                             | 60,00%     | 26,65%    | 4.730.066,90 | 33,35%                    | 5.919.631,53  | 0,00%      | 20,00%       | 60,00%  | 5.919.631,53  |
| 7° IV - Ativos Financeiros de RF - Emissão de Instituições | 20,00%     | 0,00%     | 0,00         | 20,00%                    | 3.549.899,48  | 0,00%      | 1,00%        | 20,00%  | 3.549.899,48  |
| 7° V a - FIDC Cota Sênior                                  | 5,00%      | 0,00%     | 0,00         | 5,00%                     | 887.474,87    | 0,00%      | 1,00%        | 5,00%   | 887.474,87    |
| 7° V b - Fundos de RF - Crédito Privado                    | 5,00%      | 0,00%     | 0,00         | 5,00%                     | 887.474,87    | 0,00%      | 1,00%        | 5,00%   | 887.474,87    |
| 7° V c - Fundos de Debentures Infraestrutura               | 5,00%      | 0,00%     | 0,00         | 5,00%                     | 887.474,87    | 0,00%      | 1,00%        | 5,00%   | 887.474,87    |
| 8° I - Fundos de Ações                                     | 30,00%     | 10,87%    | 1.929.169,82 | 19,13%                    | 3.395.679,40  | 0,00%      | 20,00%       | 30,00%  | 3.395.679,40  |
| 9° III - Ações - BDR Nível I                               | 10,00%     | 3,80%     | 675.069,82   | 6,20%                     | 1.099.879,92  | 0,00%      | 5,00%        | 10,00%  | 1.099.879,92  |
| 10° I - Fundos Multimercados                               | 10,00%     | 9,54%     | 1.693.899,79 | 0,46%                     | 81.049,95     | 0,00%      | 5,00%        | 10,00%  | 81.049,95     |
| 11° - Fundos Imobiliários                                  | 5,00%      | 1,55%     | 274.628,19   | 3,45%                     | 612.846,68    | 0,00%      | 2,00%        | 5,00%   | 612.846,68    |

#### Governança (Pró Gestão)

📊 Não possui

#### Renda Fixa

\$ 12.360.322,08 69,64%

#### Renda Variável

\$ 1.929.169,82 10,87%

#### Estruturados

\$ 1.693.899,79 9,54%

#### Fundo Imobiliário

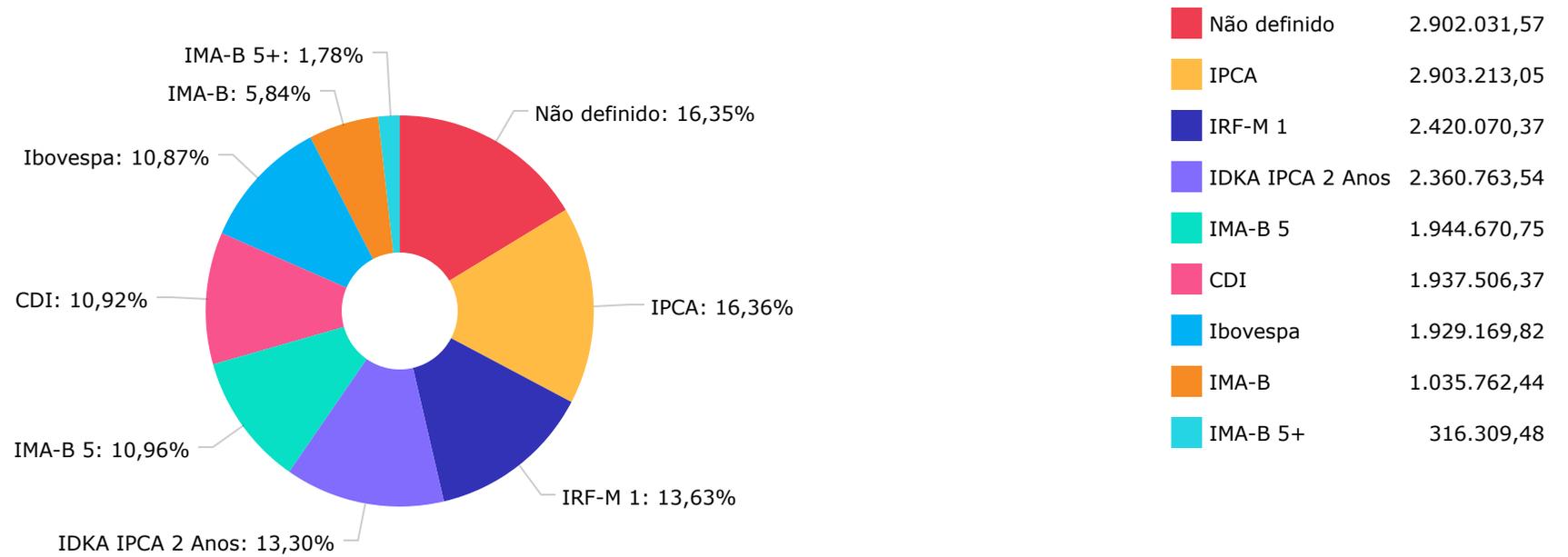
\$ 274.628,19 1,55%

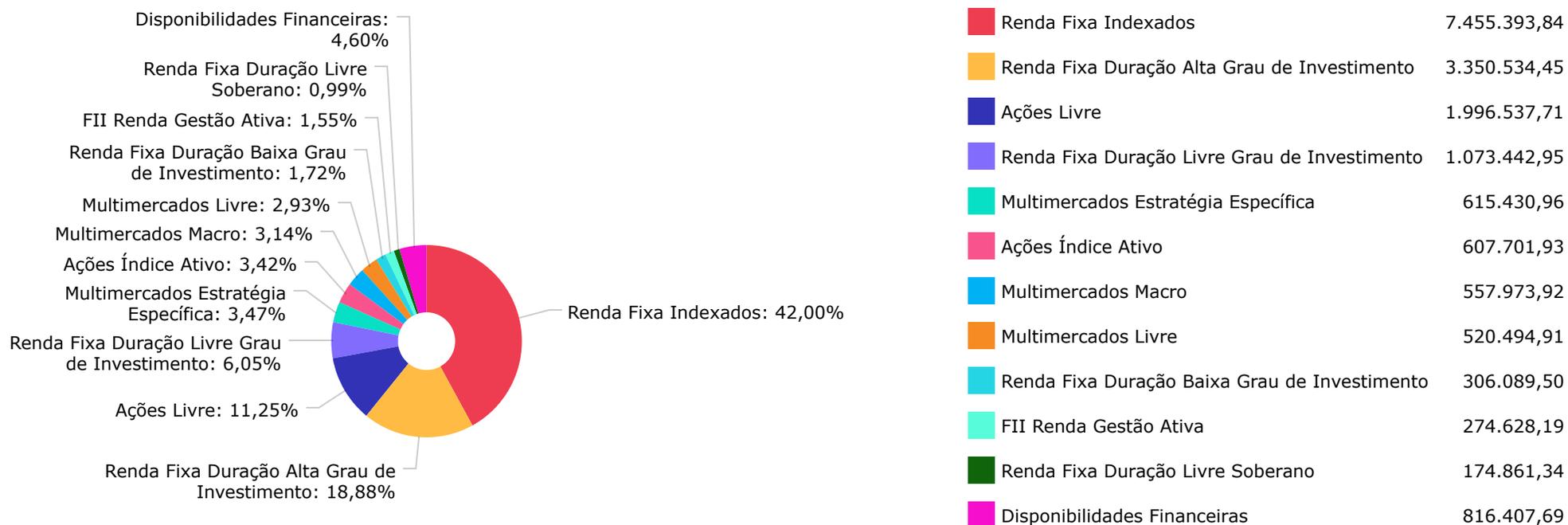
#### Exterior

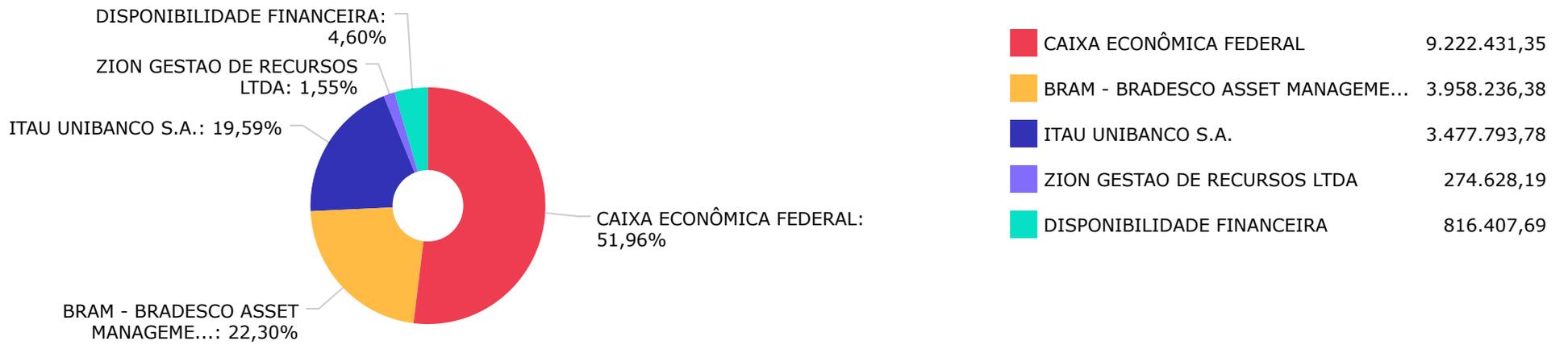
\$ 675.069,82 3,80%

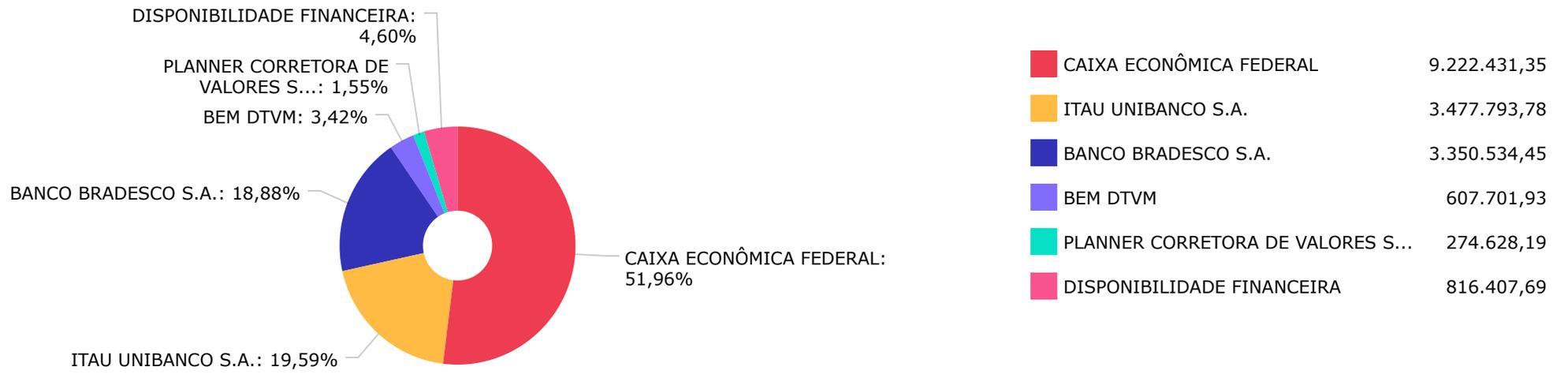
|   | Mês   | Ano    | 3M     | 6M     | 12M    | 24M    | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|---|-------|--------|--------|--------|--------|--------|-----------|--------------------|
| <b>NÃO DEFINIDO (BENCHMARK)</b>                             |       |        |        |        |        |        |           |                    |
| ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO                   | -2,18 | -7,36  | -2,22  | -0,12  | 19,95  | 49,66  | 10,43     | 21,96              |
| BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11    | 28,37 | -3,61  | 52,57  | -26,85 | 304,55 | 124,37 | 30,51     | 64,25              |
| ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I                                  | -4,87 | -8,51  | -6,70  | 2,41   | 6,56   | 63,89  | 11,09     | 23,35              |
| CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP           | 0,93  | 2,37   | 3,83   | 2,49   | 4,97   | 10,22  | 1,56      | 3,28               |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I                    | -7,12 | -16,17 | -14,74 | -6,50  | -0,12  | 68,54  | 13,05     | 27,49              |
| <b>CDI (BENCHMARK)</b>                                      |       |        |        |        |        |        |           |                    |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP               | 0,82  | 1,61   | 2,38   | 4,08   | 6,03   | 8,15   | 0,04      | 0,09               |
| ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP        | 0,89  | 1,34   | 1,81   | 4,86   | 7,71   | 10,92  | 0,28      | 0,58               |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP                    | 0,84  | 2,12   | 3,59   | 2,22   | 4,28   | 8,14   | 1,27      | 2,68               |
| <b>IBOVESPA (BENCHMARK)</b>                                 |       |        |        |        |        |        |           |                    |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES                                      | -1,21 | 0,11   | 1,09   | -13,89 | -7,48  | -3,23  | 6,53      | 13,75              |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES                        | -0,37 | 4,77   | 5,19   | -17,08 | -6,51  | -25,68 | 7,05      | 14,84              |
| BRADERCO SELECTION FI AÇÕES                                 | -1,95 | 4,70   | 6,80   | -12,25 | -8,58  | -5,36  | 6,08      | 12,81              |
| <b>IDKA IPCA 2 ANOS (BENCHMARK)</b>                         |       |        |        |        |        |        |           |                    |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,15  | 1,17   | 1,89   | 4,12   | 6,30   | 13,18  | 1,15      | 2,41               |
| <b>IMA-B (BENCHMARK)</b>                                    |       |        |        |        |        |        |           |                    |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP        | 0,53  | -0,23  | -0,03  | 0,61   | 0,65   | 3,48   | 1,78      | 3,74               |
| <b>IMA-B 5 (BENCHMARK)</b>                                  |       |        |        |        |        |        |           |                    |
| BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA               | 1,04  | 1,12   | 1,90   | 4,06   | 5,68   | 11,70  | 1,07      | 2,26               |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP      | 1,05  | 1,14   | 1,92   | 4,15   | 6,07   | 12,36  | 1,06      | 2,24               |

|   | Mês         | Ano          | 3M           | 6M           | 12M          | 24M          | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|---|-------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|-----------|--------------------|
| <b>IMA-B 5+ (BENCHMARK)</b>                             | <b>0,01</b> | <b>-1,60</b> | <b>-1,93</b> | <b>-2,75</b> | <b>-4,24</b> | <b>-3,33</b> |           |                    |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,02        | -1,60        | -1,93        | -2,98        | -4,67        | -3,94        | 2,65      | 5,59               |
| <b>IPCA (BENCHMARK)</b>                                 | <b>1,01</b> | <b>1,56</b>  | <b>2,30</b>  | <b>5,77</b>  | <b>10,54</b> | <b>16,29</b> |           |                    |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA               | 0,67        | 0,91         | 1,70         | 2,28         | 2,32         | 4,59         | 0,61      | 1,28               |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA          | 0,81        | 1,48         | 2,32         | 2,92         | 1,86         | 6,59         | 0,35      | 0,73               |
| <b>IRF-M 1 (BENCHMARK)</b>                              | <b>0,74</b> | <b>1,38</b>  | <b>2,27</b>  | <b>2,93</b>  | <b>4,26</b>  | <b>7,47</b>  |           |                    |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA     | 0,72        | 1,34         | 2,20         | 2,83         | 4,03         | 7,01         | 0,32      | 0,67               |

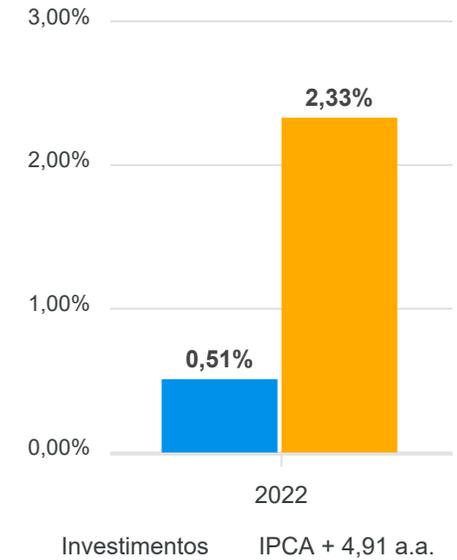
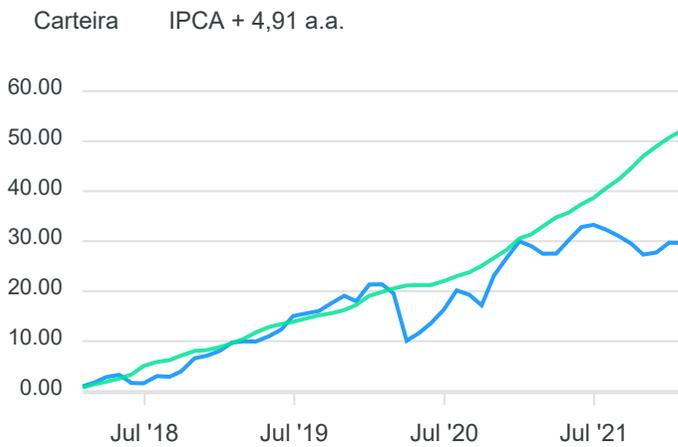








| Mês              | Saldo Anterior | Aplicações   | Resgates     | Saldo Atual   | Retorno \$       | Retorno %      | Meta %       | Risco - VaR |
|------------------|----------------|--------------|--------------|---------------|------------------|----------------|--------------|-------------|
| Janeiro          | 18.540.137,29  | 0,00         | 780.527,08   | 17.749.947,75 | -9.662,46        | -0,05% ▼       | 0,94%        | 2,95%       |
| Fevereiro        | 17.749.947,75  | 3.279.810,25 | 4.195.905,06 | 16.933.089,70 | 99.236,76        | 0,56% ▲        | 1,38%        | 2,78%       |
| <b>Acumulado</b> |                |              |              |               | <b>89.574,30</b> | <b>0,51% ▲</b> | <b>2,33%</b> |             |



| RENDA FIXA  | Saldo Anterior | Aplicações   | Resgates     | Saldo Atual   | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|---|----------------|--------------|--------------|---------------|------------|-----------|-------------|
| BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA                     | 2.710.171,95   | 0,00         | 0,00         | 2.728.351,71  | 18.179,76  | 0,67% ▲   | 0,61%       |
| BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA                 | 615.765,34     | 0,00         | 0,00         | 622.182,74    | 6.417,40   | 1,04% ▲   | 1,07%       |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP               | 303.602,78     | 0,00         | 0,00         | 306.089,50    | 2.486,72   | 0,82% ▲   | 0,04%       |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA              | 2.727.291,41   | 0,00         | 2.574.405,06 | 174.861,34    | 21.974,99  | 0,81% ▲   | 0,35%       |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1.345.342,54   | 1.000.000,00 | 0,00         | 2.360.763,54  | 15.421,00  | 0,66% ▲   | 1,15%       |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP      | 319.134,15     | 1.000.000,00 | 0,00         | 1.322.488,01  | 3.353,86   | 0,25% ▲   | 1,06%       |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP        | 1.030.332,18   | 0,00         | 0,00         | 1.035.762,44  | 5.430,26   | 0,53% ▲   | 1,78%       |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | 3.054.789,95   | 963.500,77   | 1.621.500,00 | 2.420.070,37  | 23.279,65  | 0,58% ▲   | 0,32%       |
| ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP        | 1.064.017,79   | 0,00         | 0,00         | 1.073.442,95  | 9.425,16   | 0,89% ▲   | 0,28%       |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP     | 0,00           | 316.309,48   | 0,00         | 316.309,48    | 0,00       | 0,00%     | 2,65%       |
|   | 13.170.448,09  | 3.279.810,25 | 4.195.905,06 | 12.360.322,08 | 105.968,80 | 0,80%     | 0,83%       |

| RENDA VARIÁVEL   | Saldo Anterior      | Aplicações  | Resgates    | Saldo Atual         | Retorno \$       | Retorno %    | Risco - VaR  |
|--|---------------------|-------------|-------------|---------------------|------------------|--------------|--------------|
| BRDESCO SELECTION FI AÇÕES                               | 619.756,70          | 0,00        | 0,00        | 607.701,93          | -12.054,77       | -1,95% ▼     | 6,08%        |
| BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11 | 213.942,56          | 0,00        | 0,00        | 274.628,19          | 60.685,63        | 28,37% ▲     | 30,51%       |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP                 | 553.337,95          | 0,00        | 0,00        | 557.973,92          | 4.635,97         | 0,84% ▲      | 1,27%        |
| CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP        | 515.702,01          | 0,00        | 0,00        | 520.494,91          | 4.792,90         | 0,93% ▲      | 1,56%        |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES                                   | 748.921,71          | 0,00        | 0,00        | 739.847,02          | -9.074,69        | -1,21% ▼     | 6,53%        |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES                     | 583.758,31          | 0,00        | 0,00        | 581.620,87          | -2.137,44        | -0,37% ▼     | 7,05%        |
| ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO                | 629.170,15          | 0,00        | 0,00        | 615.430,96          | -13.739,19       | -2,18% ▼     | 10,43%       |
|  | <b>3.864.589,39</b> | <b>0,00</b> | <b>0,00</b> | <b>3.897.697,80</b> | <b>33.108,41</b> | <b>0,86%</b> | <b>7,43%</b> |

| INVESTIMENTOS NO EXTERIOR                | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|--|----------------|------------|----------|-------------|------------|-----------|-------------|
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 223.525,78     | 0,00       | 0,00     | 207.617,84  | -15.907,94 | -7,12% ▼  | 13,05%      |
| ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I               | 491.384,49     | 0,00       | 0,00     | 467.451,98  | -23.932,51 | -4,87% ▼  | 11,09%      |
|  | 714.910,27     | 0,00       | 0,00     | 675.069,82  | -39.840,45 | -5,57%    | 4,01%       |