

2021

Relatório

Mensal e 1º trimestre de 2021

Março


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	1.158.184,33	6,97%	8.957.703.037,59	0,01%	7º I b
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	169.452,02	1,02%	7.393.196.134,71	0,00%	7º I b
BRADERCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	2.654.934,82	15,98%	500.079.676,72	0,53%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.909.024,77	17,51%	15.491.489.347,05	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.770.401,87	10,66%	10.861.361.928,62	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.885.807,59	11,35%	5.996.206.078,69	0,03%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	371.441,42	2,24%	9.801.758.898,12	0,00%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	307.326,03	1,85%	1.953.428.365,60	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	200.531,16	1,21%	5.035.220.681,40	0,00%	7º IV a
BRADERCO SELECTION FI AÇÕES	1.197.742,55	7,21%	736.778.248,58	0,16%	8º II a
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.400.700,38	8,43%	4.171.702.437,07	0,03%	8º II a
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	863.063,52	5,20%	1.393.752.317,90	0,06%	8º II a
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	842.041,57	5,07%	4.658.610.325,77	0,02%	8º III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	603.939,11	3,64%	1.047.700.700,67	0,06%	8º III
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	277.713,90	1,67%	94.325.936,40	0,29%	8º IV b

Investimentos
 16.612.305,04

Disponibilidades Financeiras
 0,00

Total Carteira
 16.612.305,04

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%	67,58%	11.226.572,85	32,42%	5.385.732,19	10,98%	54,88%	68,60%	169.468,41
7º IV a - FI de Renda Fixa	40,00%	1,21%	200.531,16	38,79%	6.444.390,86	4,07%	20,34%	40,00%	6.444.390,86
8º II a - FI em Ações	20,00%	20,84%	3.461.506,45	-0,84%	-139.045,44	3,68%	18,38%	20,00%	-139.045,44
8º III - FI Multimercado	10,00%	8,70%	1.445.980,68	1,30%	215.249,82	3,08%	3,08%	10,00%	215.249,82
8º IV b - FI Imobiliário	5,00%	1,67%	277.713,90	3,33%	552.901,35	0,00%	2,68%	5,00%	552.901,35
9º A II - Constituídos no Brasil	10,00%	0,00%	0,00	10,00%	1.661.230,50	0,00%	0,32%	5,00%	830.615,25
9º A III - Ações - BDR Nível I	10,00%	0,00%	0,00	10,00%	1.661.230,50	0,00%	0,32%	5,00%	830.615,25

Governança (Pró Gestão)

⚙️ Não possui

Renda Fixa

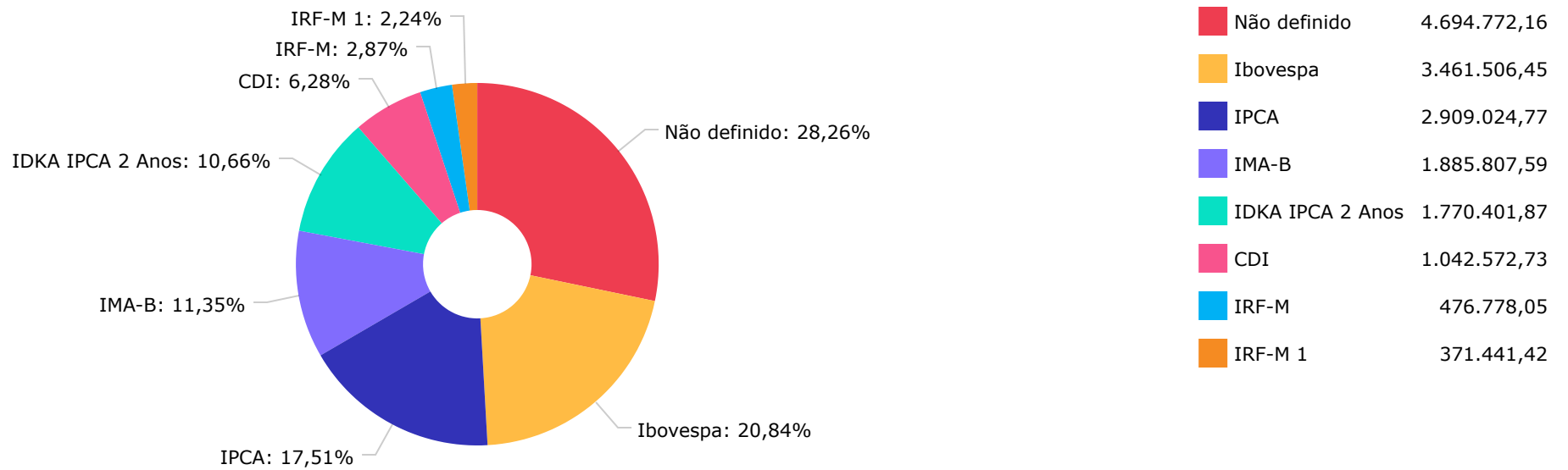
\$ 11.427.104,01 68,79%

Renda Variável

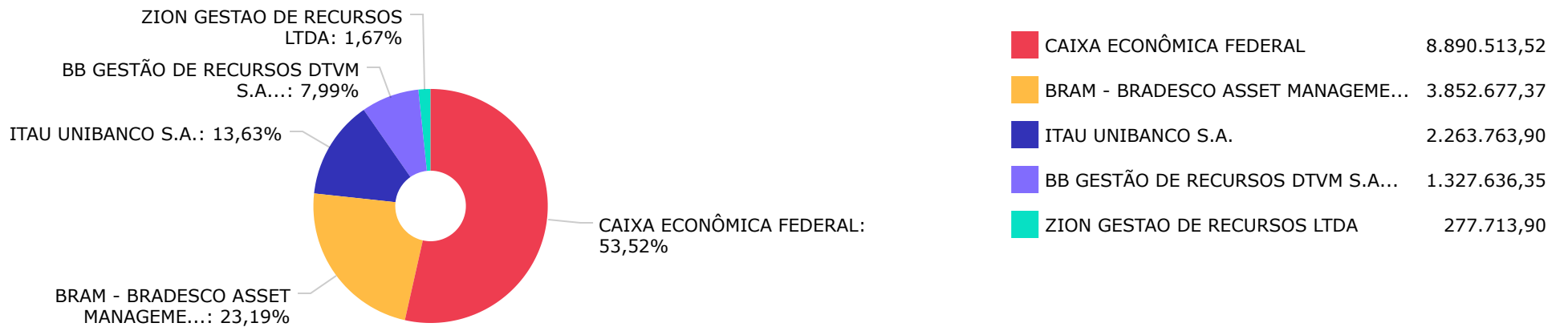
\$ 5.185.201,03 31,21%

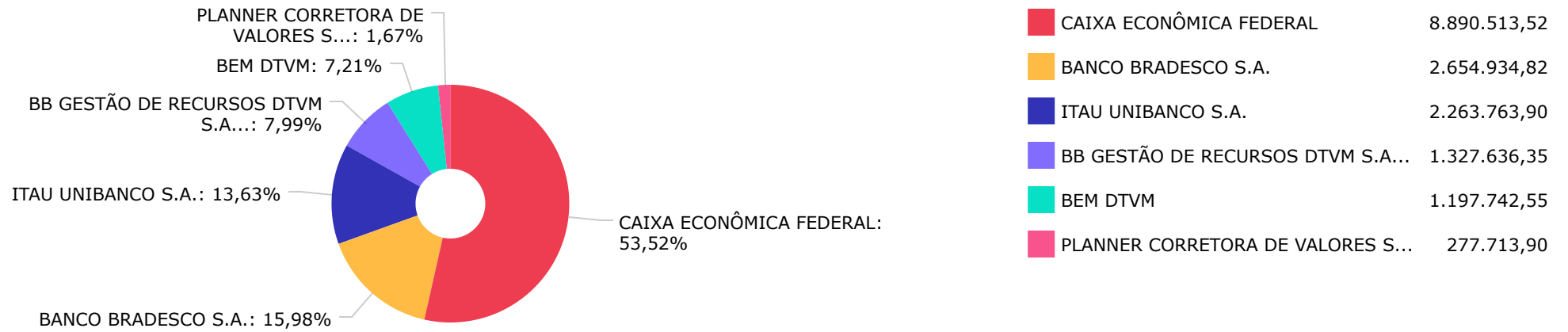
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
NÃO DEFINIDO (BENCHMARK)								
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	-0,90	-2,96	-2,96	-1,32	1,73	14,83	2,12	4,46
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,37	0,00	0,00	3,22	8,63	17,08	1,69	3,57
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1,58	1,40	1,40	5,57	15,83		2,11	4,44
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-18,18	-22,86	-22,86	-30,77	-49,53	-63,51	13,56	28,57
CDI (BENCHMARK)								
	0,20	0,49	0,49	0,96	2,22	7,78		
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,16	0,43	0,43	0,90	1,84	7,41	0,02	0,05
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,37	0,71	0,71	4,97	11,02	18,17	2,23	4,70
IBOVESPA (BENCHMARK)								
	6,00	-2,00	-2,00	23,29	59,73	22,24		
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2,12	1,10	1,10	21,26	58,11	30,49	10,08	21,23
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	3,58	-3,76	-3,76	13,44	41,69	0,30	12,81	26,98
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	0,16	-5,50	-5,50	14,00	51,45	10,58	10,61	22,35
IDKA IPCA 2 ANOS (BENCHMARK)								
	0,29	-0,05	-0,05	3,00	8,57	18,47		
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,37	-0,02	-0,02	3,02	8,45	17,15	1,73	3,65
IMA-B (BENCHMARK)								
	-0,46	-2,81	-2,81	4,17	10,39	20,48		
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,47	-2,86	-2,86	4,06	10,15	19,69	3,15	6,64
IPCA (BENCHMARK)								
	0,93	2,05	2,05	5,25	6,10	9,60		
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,30	-0,18	-0,18	1,85	5,09	19,24	1,36	2,86
IRF-M (BENCHMARK)								
	-0,84	-2,80	-2,80	-0,87	2,25	13,59		
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,85	-2,82	-2,82	-0,88	1,99	13,08	1,90	3,99
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,89	-2,79	-2,79	-0,91	2,08	13,08	1,91	4,02

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IRF-M 1 (BENCHMARK)	0,04	0,13	0,13	0,83	2,51	9,33		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,01	0,05	0,05	0,70	2,27	8,88	0,21	0,44

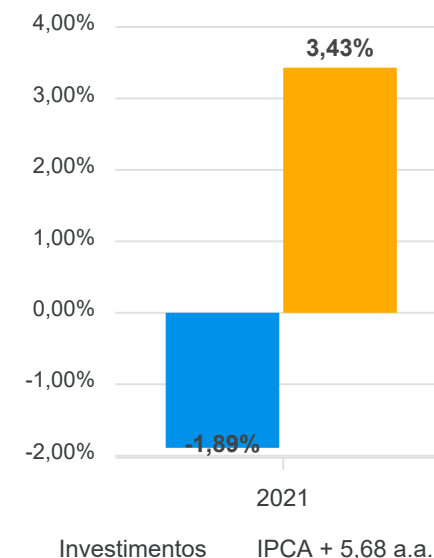
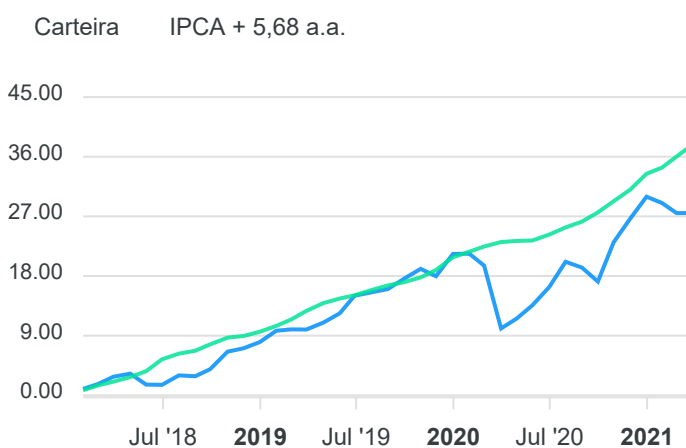
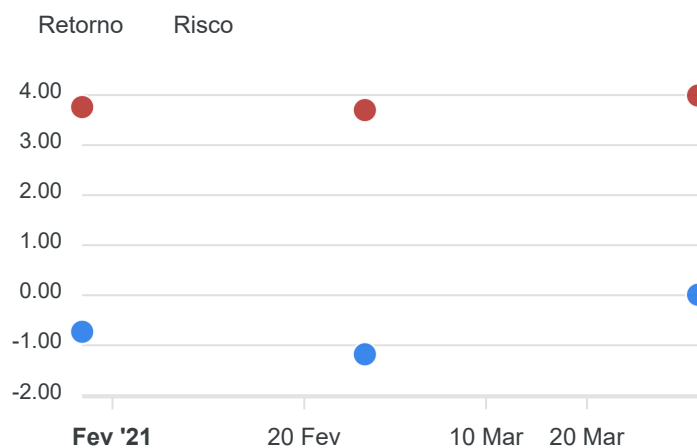








Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Meta %	Risco - VaR
Janeiro	16.999.182,71	0,00	520.000,00	16.354.853,79	-124.328,92	-0,73% ▼	0,69%	3,76%
Fevereiro	16.354.853,79	580.000,00	305.000,00	16.433.202,68	-196.651,11	-1,18% ▼	1,26%	3,70%
Março	16.433.202,68	1.180.000,00	1.003.339,05	16.612.305,04	2.441,41	0,01% ▲	1,44%	3,99%
Acumulado					-318.538,62	-1,89% ▲	3,43%	



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.153.914,56	0,00	0,00	1.158.184,33	4.269,77	0,37% ▲	1,69%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	170.910,89	0,00	0,00	169.452,02	-1.458,87	-0,85% ▼	1,90%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	2.679.065,86	0,00	0,00	2.654.934,82	-24.131,04	-0,90% ▼	2,12%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.900.293,46	0,00	0,00	2.909.024,77	8.731,31	0,30% ▲	1,36%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.763.884,12	0,00	0,00	1.770.401,87	6.517,75	0,37% ▲	1,73%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.905.486,26	0,00	10.586,10	1.885.807,59	-9.092,57	-0,48% ▼	3,15%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	371.407,32	0,00	0,00	371.441,42	34,10	0,01% ▲	0,21%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	322.858,21	0,00	12.752,95	307.326,03	-2.779,23	-0,86% ▼	1,91%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	1.180.000,00	980.000,00	200.531,16	531,16	0,05% ▲	0,02%
	11.267.820,68	1.180.000,00	1.003.339,05	11.427.104,01	-17.377,62	-0,15%	1,88%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	1.195.882,99	0,00	0,00	1.197.742,55	1.859,56	0,16% ▲	10,61%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	339.428,10	0,00	0,00	277.713,90	-61.714,20	-18,18% ▼	13,56%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	830.626,61	0,00	0,00	842.041,57	11.414,96	1,37% ▲	2,23%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	594.537,18	0,00	0,00	603.939,11	9.401,93	1,58% ▲	2,11%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.371.651,42	0,00	0,00	1.400.700,38	29.048,96	2,12% ▲	10,08%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	833.255,70	0,00	0,00	863.063,52	29.807,82	3,58% ▲	12,81%
	5.165.382,00	0,00	0,00	5.185.201,03	19.819,03	0,38%	8,64%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.158.225,69	0,00	0,00	1.158.184,33	-41,36	0,00% ▼
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	174.363,00	0,00	0,00	169.452,02	-4.910,98	-2,82% ▼
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	2.735.807,57	0,00	0,00	2.654.934,82	-80.872,75	-2,96% ▼
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.914.351,70	0,00	0,00	2.909.024,77	-5.326,93	-0,18% ▼
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.049.664,02	0,00	280.000,00	1.770.401,87	737,85	0,04% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.899.695,30	580.000,00	530.586,10	1.885.807,59	-63.301,61	-2,55% ▼
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	381.243,09	0,00	10.000,00	371.441,42	198,33	0,05% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	344.455,68	0,00	27.752,95	307.326,03	-9.376,70	-2,72% ▼
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	1.180.000,00	980.000,00	200.531,16	531,16	0,05% ▲
	11.657.806,05	1.760.000,00	1.828.339,05	11.427.104,01	-162.362,99	-1,39%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	1.267.406,71	0,00	0,00	1.197.742,55	-69.664,16	-5,50% ▼
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	359.999,50	0,00	0,00	277.713,90	-82.285,60	-22,86% ▼
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	836.142,60	0,00	0,00	842.041,57	5.898,97	0,71% ▲
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	595.603,33	0,00	0,00	603.939,11	8.335,78	1,40% ▲
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.385.473,12	0,00	0,00	1.400.700,38	15.227,26	1,10% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	896.751,40	0,00	0,00	863.063,52	-33.687,88	-3,76% ▼
	5.341.376,66	0,00	0,00	5.185.201,03	-156.175,63	-2,92%