

2021


Relatório Mensal

Maio


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	1.175.747,42	6,94%	10.138.018.656,57	0,01%	7º I b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	165.855,28	0,98%	5.747.060.006,20	0,00%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.935.345,75	17,33%	15.989.068.973,83	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.803.525,44	10,65%	11.767.802.943,40	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.041.341,69	6,15%	5.804.299.790,87	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.212.754,43	7,16%	8.656.296.995,82	0,01%	7º I b
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.677.461,20	15,80%	1.440.715.539,33	0,19%	7º IV a
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	201.356,61	1,19%	4.637.859.082,40	0,00%	7º IV a
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	1.312.612,64	7,75%	773.978.436,40	0,17%	8º II a
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.558.096,78	9,20%	4.525.126.567,58	0,03%	8º II a
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	971.896,62	5,74%	1.033.527.229,82	0,09%	8º II a
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	863.678,13	5,10%	4.460.356.627,81	0,02%	8º III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	615.614,52	3,63%	1.223.164.963,01	0,05%	8º III
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	406.285,15	2,40%	141.304.807,55	0,29%	8º IV b

Investimentos
 16.941.571,66

Disponibilidades Financeiras
 0,00

Total Carteira
 16.941.571,66

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%	49,20%	8.334.570,01	50,80%	8.607.001,65	10,98%	54,88%	68,60%	3.287.348,15
7º IV a - FI de Renda Fixa	40,00%	16,99%	2.878.817,81	23,01%	3.897.810,85	4,07%	20,34%	40,00%	3.897.810,85
8º II a - FI em Ações	20,00%	22,68%	3.842.606,04	-2,68%	-454.291,71	3,68%	18,38%	20,00%	-454.291,71
8º III - FI Multimercado	10,00%	8,73%	1.479.292,65	1,27%	214.864,52	3,08%	3,08%	10,00%	214.864,52
8º IV b - FI Imobiliário	5,00%	2,40%	406.285,15	2,60%	440.793,43	0,00%	2,68%	5,00%	440.793,43
9º A II - Constituídos no Brasil	10,00%	0,00%	0,00	10,00%	1.694.157,17	0,00%	0,32%	5,00%	847.078,58
9º A III - Ações - BDR Nível I	10,00%	0,00%	0,00	10,00%	1.694.157,17	0,00%	0,32%	5,00%	847.078,58

Governança (Pró Gestão)

⚙️ Não possui

Renda Fixa

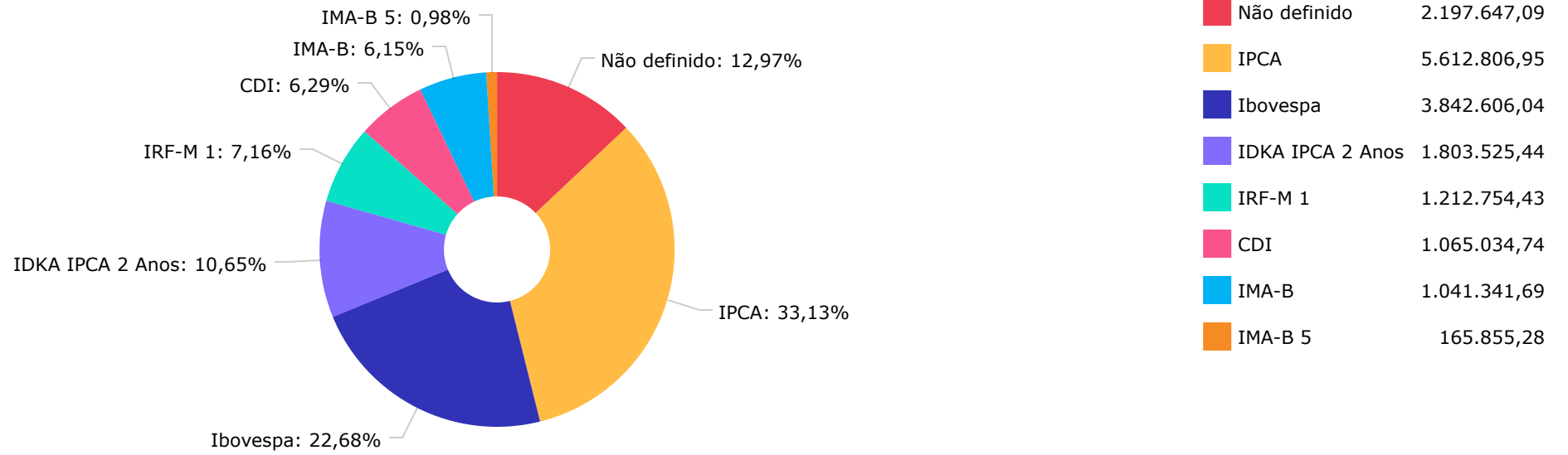
\$ 11.213.387,82 66,19%

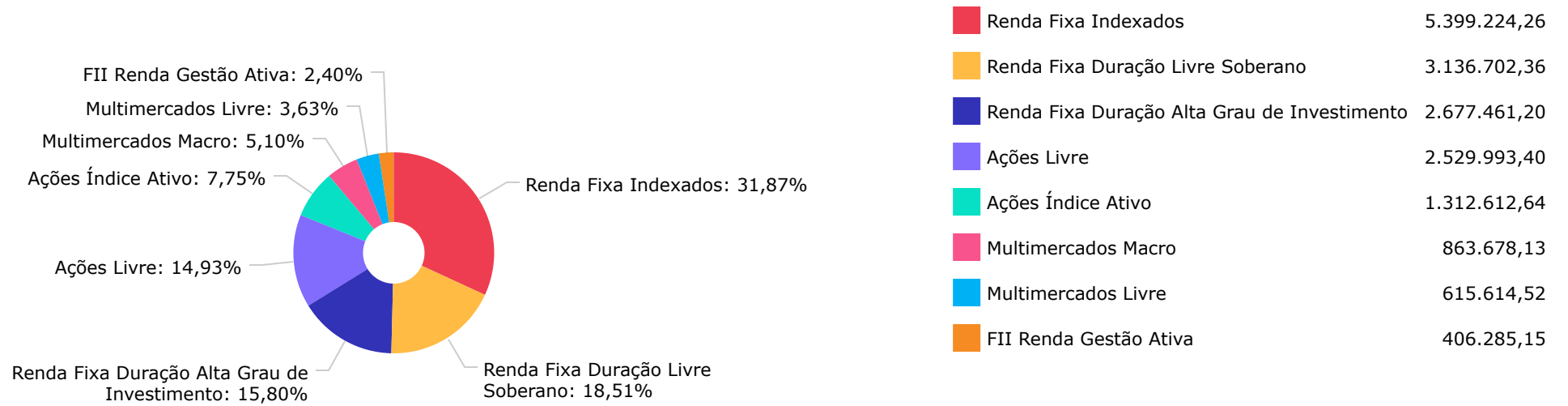
Renda Variável

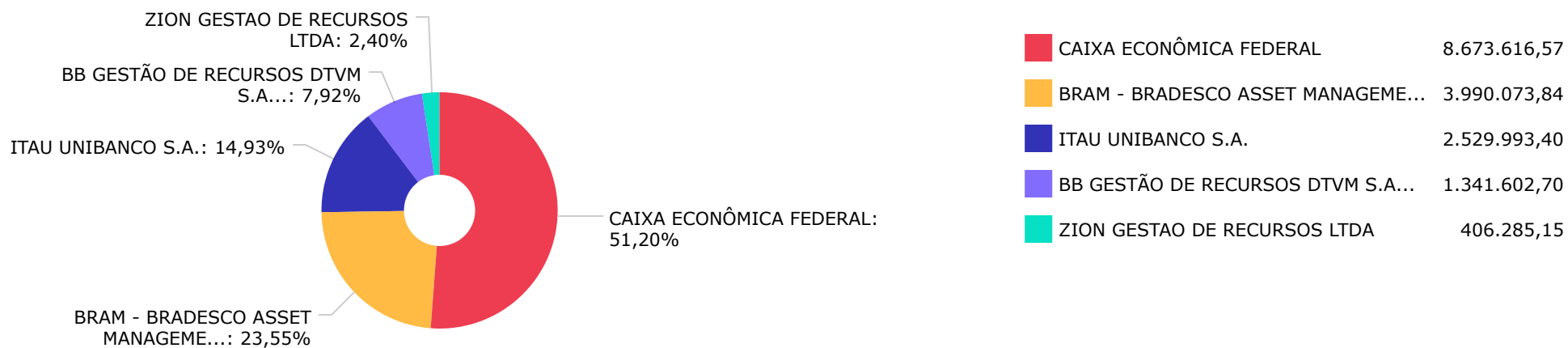
\$ 5.728.183,84 33,81%

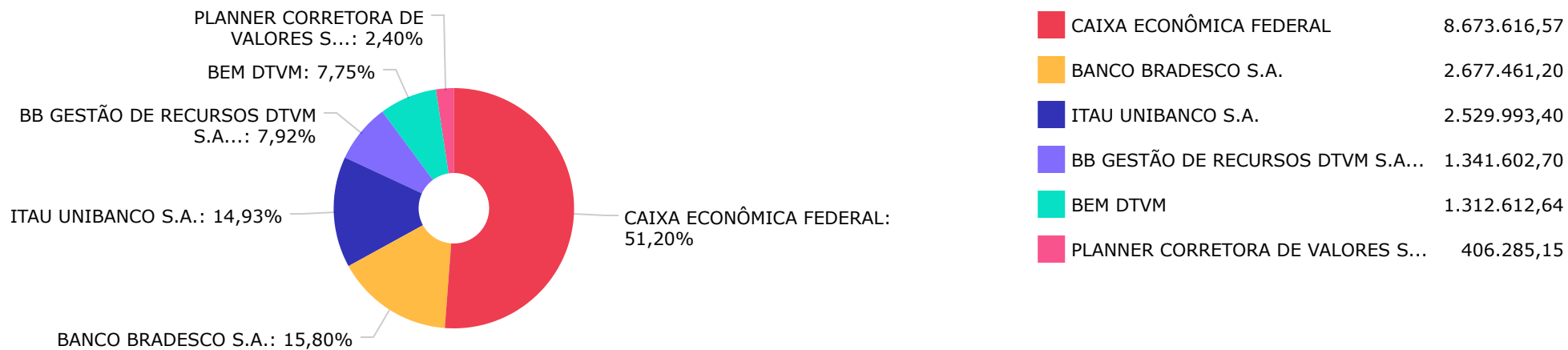
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
NÃO DEFINIDO (BENCHMARK)								
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,67	1,51	1,89	3,06	7,77	16,46	0,98	2,06
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1,37	3,36	3,55	4,69	10,72		1,31	2,75
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	5,33	12,86	19,70	0,00	14,49	-46,98	50,63	106,62
CDI (BENCHMARK)								
	0,27	0,97	0,68	1,13	2,18	7,16		
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,29	0,84	0,57	1,10	1,69	6,69	0,03	0,07
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,44	3,29	3,98	5,05	9,39	17,48	1,56	3,28
IBOVESPA (BENCHMARK)								
	6,16	6,05	14,71	15,91	44,41	30,08		
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	8,02	8,38	16,64	17,02	33,87	8,80	9,68	20,38
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	5,99	3,57	9,76	11,75	44,03	18,59	7,79	16,41
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	7,67	12,46	13,59	19,54	50,35	41,02	7,60	16,00
IDKA IPCA 2 ANOS (BENCHMARK)								
	0,88	2,19	2,53	3,96	8,47	18,26		
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,84	1,85	2,25	3,53	7,95	16,84	1,07	2,25
IMA-B (BENCHMARK)								
	1,06	-1,14	1,25	3,66	9,17	16,46		
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,04	-1,23	1,20	3,55	8,92	15,71	2,39	5,02
IMA-B 5 (BENCHMARK)								
	0,69	1,42	1,92	3,27	7,39	17,55		
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,69	1,36	1,89	3,19	7,12	17,04	1,01	2,14
IPCA (BENCHMARK)								
	0,83	3,22	2,08	4,61	8,06	10,09		
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,24	0,72	1,21	2,05	3,45	15,85	1,14	2,41
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,42	-1,13	0,41	1,33	2,64	10,28	1,27	2,67

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IRF-M 1 (BENCHMARK)	0,20	0,60	0,52	0,91	2,11	8,57		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,17	0,51	0,46	0,79	1,89	8,12	0,14	0,29

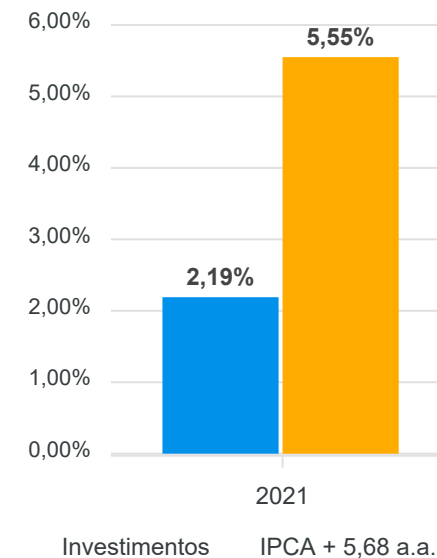
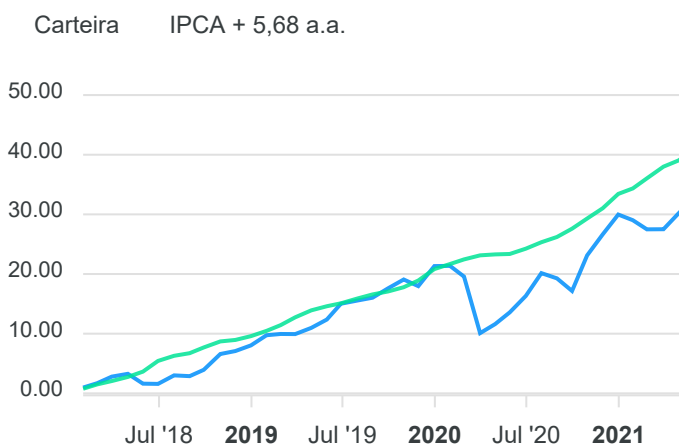
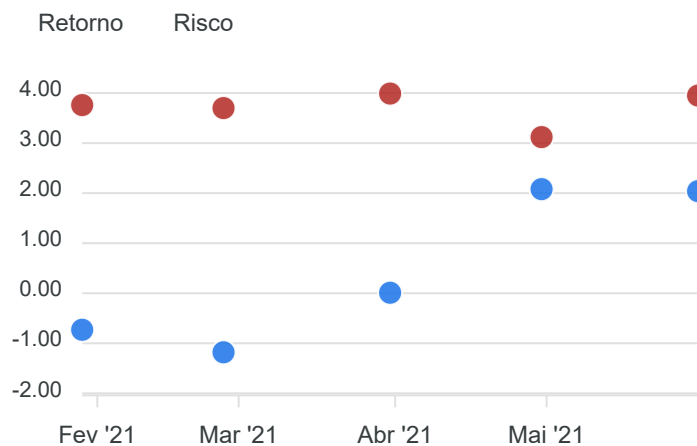








Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Meta %	Risco - VaR
Janeiro	16.999.182,71	0,00	520.000,00	16.354.853,79	-124.328,92	-0,73% ▼	0,69%	3,76%
Fevereiro	16.354.853,79	580.000,00	305.000,00	16.433.202,68	-196.651,11	-1,18% ▼	1,26%	3,70%
Março	16.433.202,68	1.180.000,00	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%
Acumulado					372.575,83	2,19% ▲	5,55%	



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.167.911,69	0,00	0,00	1.175.747,42	7.835,73	0,67% ▲	0,98%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	170.831,29	0,00	170.667,81	0,00	-163,48	-0,10% ▼	1,19%
BRANCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	2.676.674,95	0,00	2.677.461,20	0,00	786,25	0,03% ▲	1,38%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.928.356,06	0,00	0,00	2.935.345,75	6.989,69	0,24% ▲	1,14%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.788.436,31	0,00	0,00	1.803.525,44	15.089,13	0,84% ▲	1,07%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.913.235,21	0,00	885.000,00	1.041.341,69	13.106,48	0,69% ▲	2,39%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	357.452,72	884.709,00	30.000,00	1.212.754,43	592,71	0,05% ▲	0,14%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	309.712,52	1.240.982,62	1.552.160,74	0,00	1.465,60	0,09% ▲	1,19%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	200.781,02	0,00	0,00	201.356,61	575,59	0,29% ▲	0,03%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	165.289,10	0,00	165.855,28	566,18	0,34% ▲	1,01%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	2.677.461,20	0,00	2.677.461,20	0,00	0,00%	1,27%
	11.513.391,77	4.968.441,92	5.315.289,75	11.213.387,82	46.843,88	0,41%	1,13%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	1.238.405,57	0,00	0,00	1.312.612,64	74.207,07	5,99% ▲	7,79%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	385.713,75	0,00	0,00	406.285,15	20.571,40	5,33% ▲	50,63%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	851.448,00	0,00	0,00	863.678,13	12.230,13	1,44% ▲	1,56%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	607.284,05	0,00	0,00	615.614,52	8.330,47	1,37% ▲	1,31%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.447.100,28	0,00	0,00	1.558.096,78	110.996,50	7,67% ▲	7,60%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	899.723,01	0,00	0,00	971.896,62	72.173,61	8,02% ▲	9,68%
	5.429.674,66	0,00	0,00	5.728.183,84	298.509,18	5,50%	9,46%