

# 2021

## Relatório Mensal

### Julho

### 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	1.175.628,35	6,68%	10.405.647.705,04	0,01%	7º I b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	170.948,20	0,97%	5.928.712.027,28	0,00%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.912.490,74	16,55%	15.935.689.880,46	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.797.356,35	10,21%	12.042.628.715,86	0,01%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	309.235,40	1,76%	11.707.172.620,85	0,00%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.041.353,38	5,92%	5.838.267.480,63	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.835.931,82	10,43%	7.606.396.263,31	0,02%	7º I b
BRADERCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.680.944,60	15,23%	1.505.438.532,85	0,18%	7º IV a
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	597.463,93	3,39%	1.155.055.229,01	0,05%	7º IV a
BRADERCO SELECTION FI AÇÕES	708.578,86	4,03%	733.885.422,64	0,10%	8º II a
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.506.976,96	8,56%	4.394.409.970,64	0,03%	8º II a
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	731.393,39	4,16%	1.016.033.989,62	0,07%	8º II a
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	859.078,39	4,88%	4.481.301.501,35	0,02%	8º III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	612.781,17	3,48%	1.376.363.729,27	0,04%	8º III
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	395.999,45	2,25%	137.727.470,65	0,29%	8º IV b
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	265.773,58	1,51%	223.622.394,58	0,12%	9º A III

**Investimentos**

\$ 17.601.934,57

**Disponibilidades Financeiras**

\$ 5.339,28

**Total Carteira**

\$ 17.607.273,85

**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%	52,51%	9.242.944,24	47,49%	8.358.990,33	10,98%	54,88%	68,60%	2.831.982,88
7º IV a - FI de Renda Fixa	40,00%	18,63%	3.278.408,53	21,37%	3.762.365,30	4,07%	20,34%	40,00%	3.762.365,30
8º II a - FI em Ações	20,00%	16,74%	2.946.949,21	3,26%	573.437,70	3,68%	18,38%	20,00%	573.437,70
8º III - FI Multimercado	10,00%	8,36%	1.471.859,56	1,64%	288.333,90	3,08%	3,08%	10,00%	288.333,90
8º IV b - FI Imobiliário	5,00%	2,25%	395.999,45	2,75%	484.097,28	0,00%	2,68%	5,00%	484.097,28
9º A II - Constituídos no Brasil	10,00%	0,00%	0,00	10,00%	1.760.193,46	0,00%	0,32%	5,00%	880.096,73
9º A III - Ações - BDR Nível I	10,00%	1,51%	265.773,58	8,49%	1.494.419,88	0,00%	0,32%	5,00%	614.323,15

Governança (Pró Gestão)

⚙️ Não possui

Renda Fixa

\$ 12.521.352,77 71,14%

Renda Variável

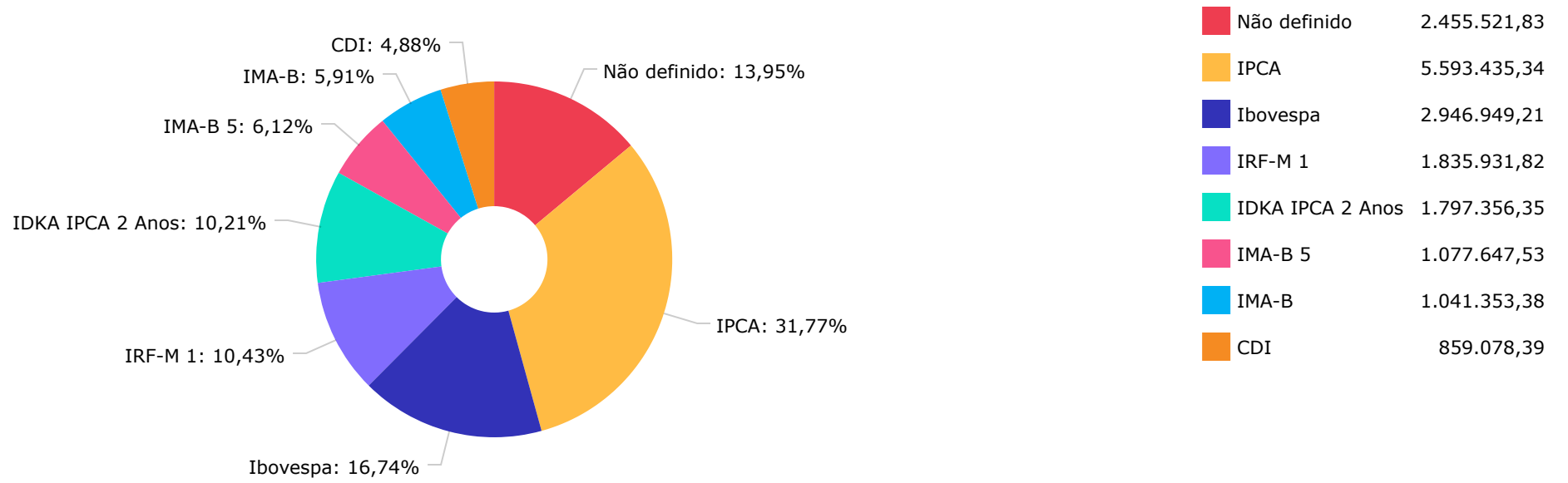
\$ 4.814.808,22 27,35%

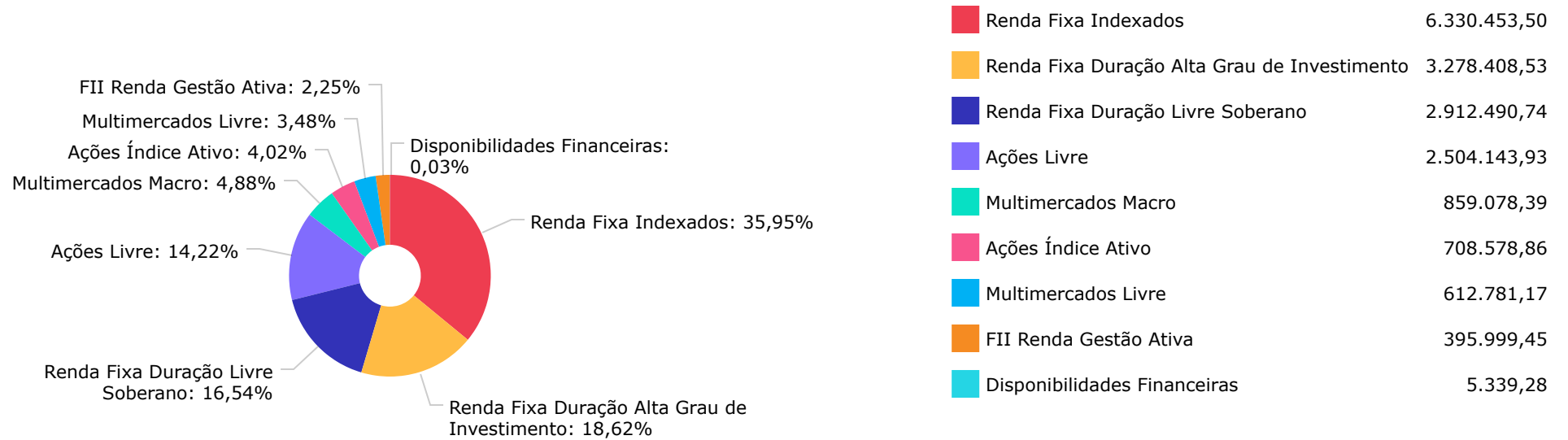
Exterior

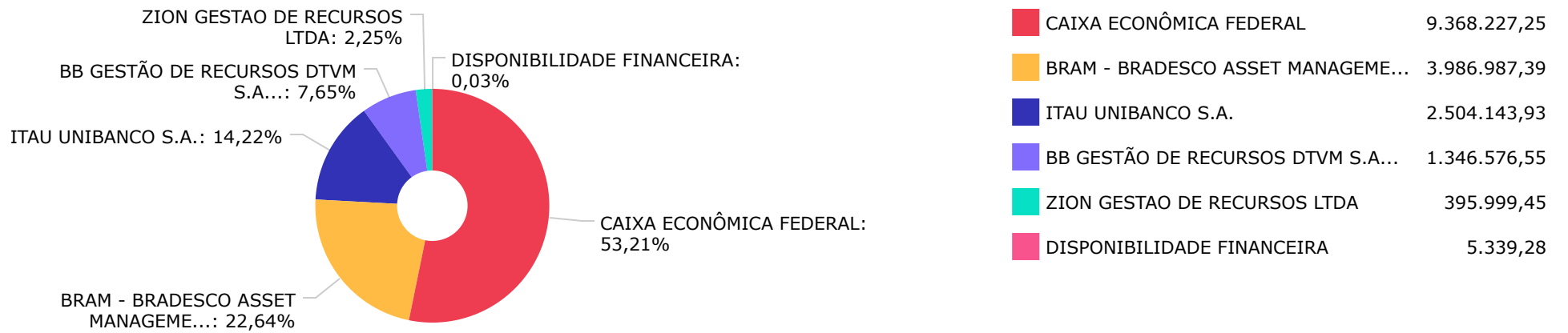
\$ 265.773,58 1,51%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
<b>NÃO DEFINIDO (BENCHMARK)</b>								
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08	1,50	0,66	1,32	5,61	14,05	0,88	1,85
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	-0,46	2,88	0,91	2,64	5,14		1,46	3,07
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-4,94	10,00	2,67	11,59	-18,95	-51,57	17,76	37,41
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	5,02	15,93	-2,31	9,74	30,87	77,59	7,97	16,78
<b>CDI (BENCHMARK)</b>								
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,36	2,74	0,90	2,83	5,97	12,71	1,59	3,36
<b>IBOVESPA (BENCHMARK)</b>								
BRANCO SELECTION FI AÇÕES	-4,87	0,58	2,94	3,14	16,66	9,20	8,64	18,20
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-3,08	8,77	4,14	10,39	23,74	22,61	6,67	14,04
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-0,66	9,23	8,87	12,50	13,76	-0,37	9,47	19,94
<b>IDKA IPCA 2 ANOS (BENCHMARK)</b>								
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,06	1,50	0,50	1,36	5,46	14,00	0,95	2,01
<b>IMA-B (BENCHMARK)</b>								
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,40	-1,23	1,04	-0,36	2,28	10,19	2,05	4,32
<b>IMA-B 5 (BENCHMARK)</b>								
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,01	1,17	0,53	1,08	4,77	13,71	1,00	2,11
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,02	1,19	0,52	1,09	4,79	13,79	1,02	2,14
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	-0,02	0,66	0,44	0,68	4,15	13,29	1,05	2,21
<b>IPCA (BENCHMARK)</b>								
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	-0,78	-0,06	-0,54	-0,09	0,90	10,67	1,68	3,53

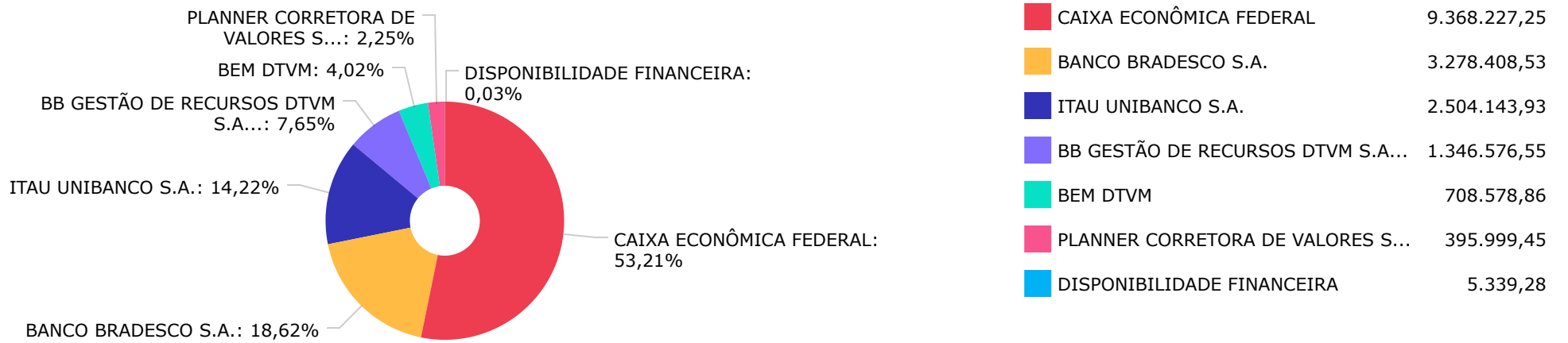
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,20	-1,00	0,55	-0,42	0,10	7,17	1,03	2,17
<b>IRF-M 1 (BENCHMARK)</b>	<b>0,19</b>	<b>1,00</b>	<b>0,60</b>	<b>0,96</b>	<b>1,99</b>	<b>7,60</b>		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,17	0,86	0,53	0,84	1,75	7,14	0,23	0,48



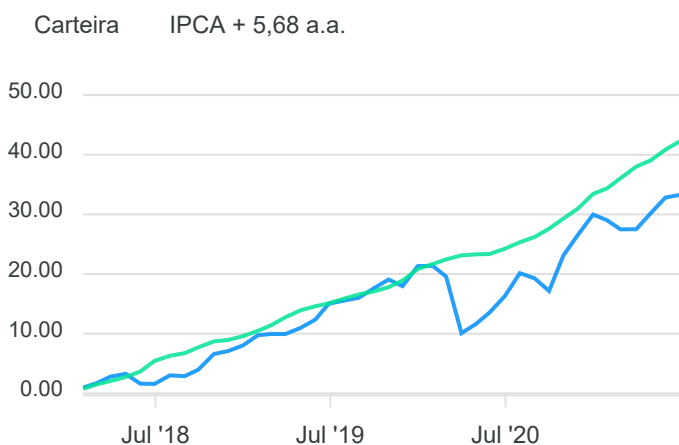
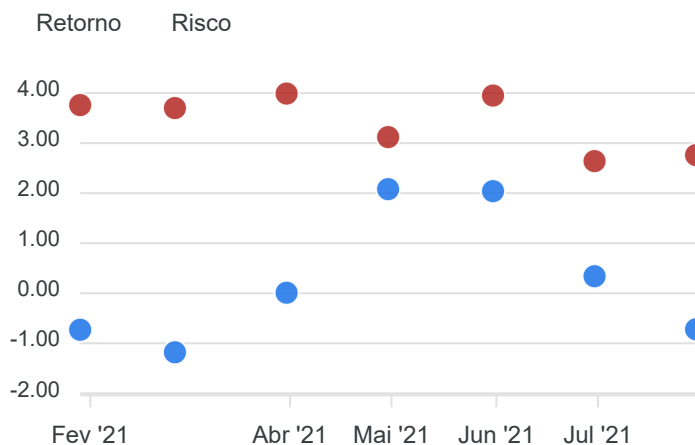
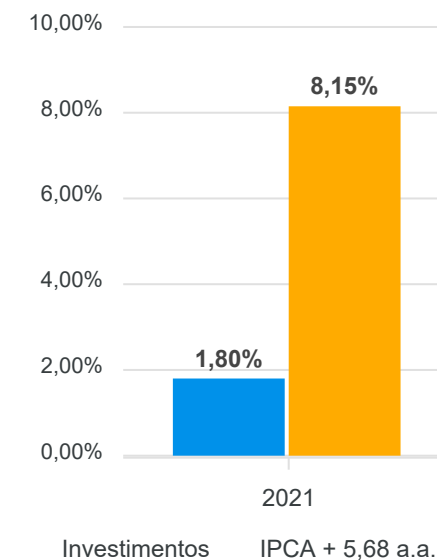








Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Meta %	Risco - VaR
Janeiro	16.999.182,71	0,00	520.000,00	16.354.853,79	-124.328,92	-0,73% ▼	0,69%	3,76%
Fevereiro	16.354.853,79	580.000,00	305.000,00	16.433.202,68	-196.651,11	-1,18% ▼	1,26%	3,70%
Março	16.433.202,68	1.180.000,00	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%
<b>Acumulado</b>					<b>304.619,77</b>	<b>1,80% ▲</b>	<b>8,15%</b>	



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.174.647,99	0,00	0,00	1.175.628,35	980,36	0,08% ▲	0,88%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	170.909,60	0,00	0,00	170.948,20	38,60	0,02% ▲	1,02%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.686.322,05	0,00	0,00	2.680.944,60	-5.377,45	-0,20% ▼	1,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.935.257,22	0,00	0,00	2.912.490,74	-22.766,48	-0,78% ▼	1,68%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.798.524,29	0,00	0,00	1.797.356,35	-1.167,94	-0,06% ▼	0,95%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	309.192,42	0,00	0,00	309.235,40	42,98	0,01% ▲	1,00%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.045.521,27	0,00	0,00	1.041.353,38	-4.167,89	-0,40% ▼	2,05%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.971.436,71	932.800,81	1.073.355,05	1.835.931,82	5.049,35	0,17% ▲	0,23%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	0,00	600.000,00	0,00	597.463,93	-2.536,07	-0,42% ▼	1,05%
	12.091.811,55	1.532.800,81	1.073.355,05	12.521.352,77	-29.904,54	-0,24%	1,12%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	1.340.065,36	0,00	600.000,00	708.578,86	-31.486,50	-2,35% ▼	8,64%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	416.570,85	0,00	0,00	395.999,45	-20.571,40	-4,94% ▼	17,76%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	862.220,94	0,00	0,00	859.078,39	-3.142,55	-0,36% ▼	1,59%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	615.640,91	0,00	0,00	612.781,17	-2.859,74	-0,46% ▼	1,46%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.554.808,74	0,00	0,00	1.506.976,96	-47.831,78	-3,08% ▼	6,67%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	736.273,25	0,00	0,00	731.393,39	-4.879,86	-0,66% ▼	9,47%
	<b>5.525.580,05</b>	<b>0,00</b>	<b>600.000,00</b>	<b>4.814.808,22</b>	<b>-110.771,83</b>	<b>-2,00%</b>	<b>6,73%</b>

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	253.064,22	0,00	0,00	265.773,58	12.709,36	5,02% ▲	7,97%
	253.064,22	0,00	0,00	265.773,58	12.709,36	5,02%	0,00%