

2021 Relatório Mensal

Agosto 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	1.177.726,47	6,77%	9.863.752.148,95	0,01%	7º I b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	171.125,29	0,98%	5.975.243.184,05	0,00%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.870.271,74	16,50%	15.341.053.159,31	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.800.849,08	10,35%	11.382.462.168,68	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	309.649,28	1,78%	11.104.044.700,21	0,00%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.029.511,90	5,92%	5.489.990.227,20	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.439.661,88	8,27%	7.025.686.891,77	0,02%	7º I b
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.667.440,27	15,33%	1.351.295.808,04	0,20%	7º IV a
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	597.917,10	3,44%	1.164.277.281,46	0,05%	7º IV a
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	692.512,49	3,98%	705.518.161,69	0,10%	8º II a
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.473.744,91	8,47%	4.202.316.659,20	0,04%	8º II a
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	701.409,33	4,03%	1.035.351.918,33	0,07%	8º II a
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	847.359,55	4,87%	4.324.411.114,88	0,02%	8º III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	608.945,32	3,50%	1.362.768.698,44	0,04%	8º III
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	375.428,05	2,16%	130.572.796,85	0,29%	8º IV b
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	635.417,62	3,65%	232.171.129,81	0,27%	9º A III

Investimentos

\$ 17.398.970,28

Disponibilidades Financeiras

\$ 124.859,39

Total Carteira

\$ 17.523.829,67

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%	50,57%	8.798.795,64	49,43%	8.600.174,64	10,98%	54,88%	68,60%	3.136.897,97
7º IV a - FI de Renda Fixa	40,00%	18,77%	3.265.357,37	21,23%	3.694.230,74	4,07%	20,34%	40,00%	3.694.230,74
8º II a - FI em Ações	20,00%	16,48%	2.867.666,73	3,52%	612.127,33	3,68%	18,38%	20,00%	612.127,33
8º III - FI Multimercado	10,00%	8,37%	1.456.304,87	1,63%	283.592,16	3,08%	3,08%	10,00%	283.592,16
8º IV b - FI Imobiliário	5,00%	2,16%	375.428,05	2,84%	494.520,46	0,00%	2,68%	5,00%	494.520,46
9º A II - Constituídos no Brasil	10,00%	0,00%	0,00	10,00%	1.739.897,03	0,00%	0,32%	5,00%	869.948,51
9º A III - Ações - BDR Nível I	10,00%	3,65%	635.417,62	6,35%	1.104.479,41	0,00%	0,32%	5,00%	234.530,89

Governança (Pró Gestão)

 Não possui

Renda Fixa

\$ 12.064.153,01 69,34%

Renda Variável

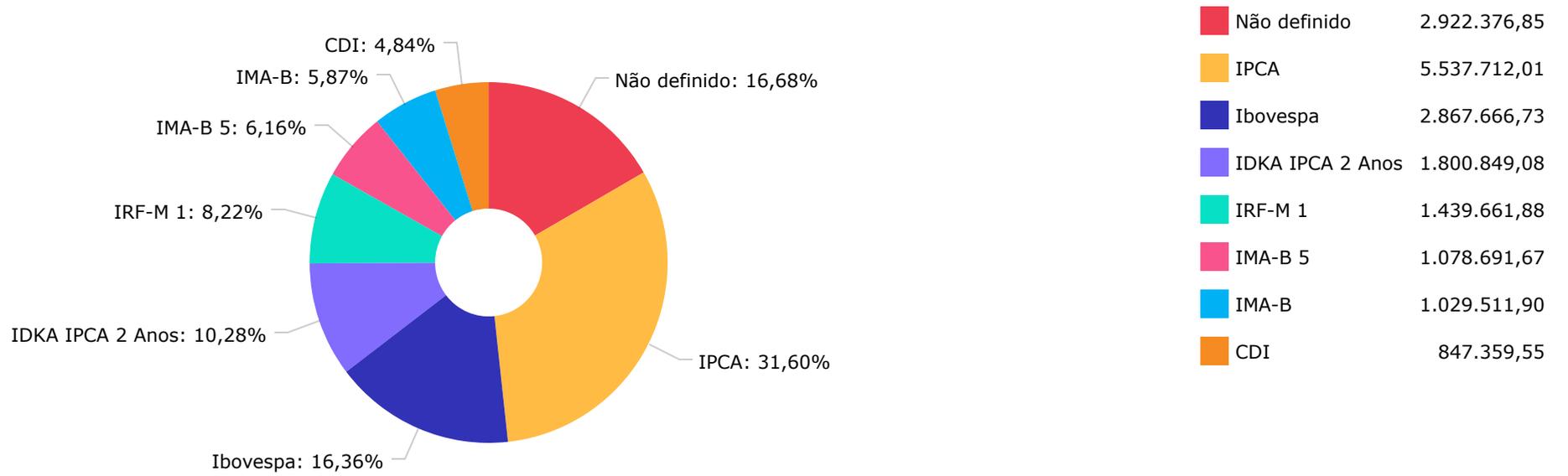
\$ 4.699.399,65 27,01%

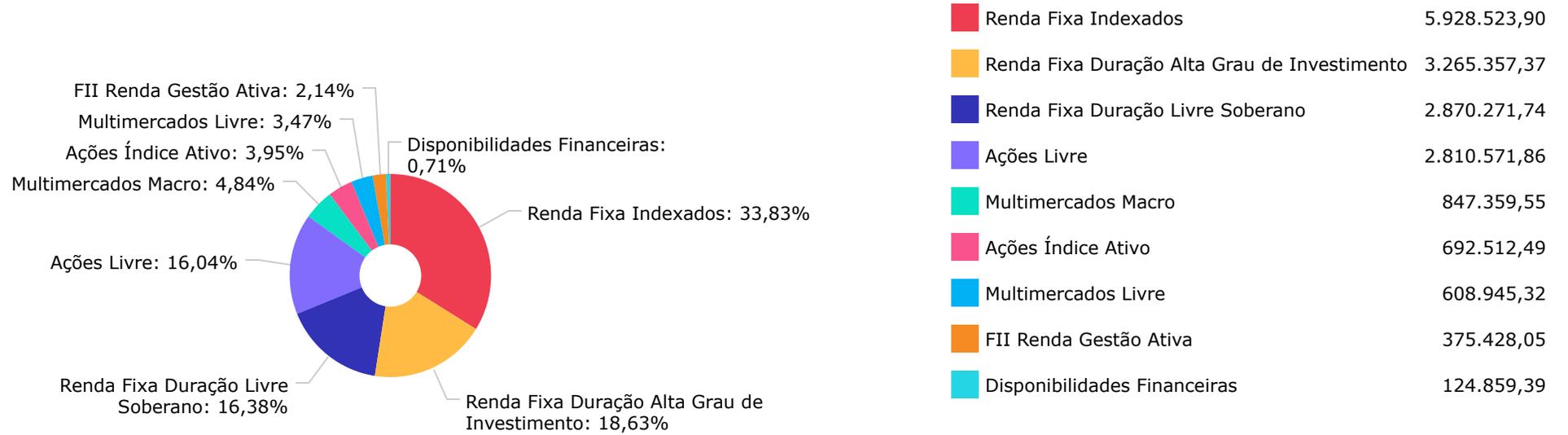
Exterior

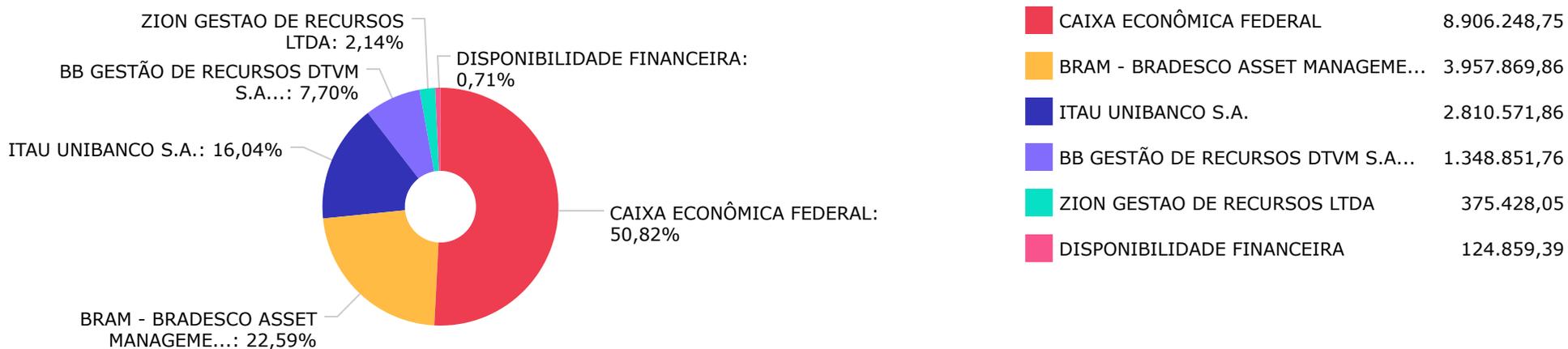
\$ 635.417,62 3,65%

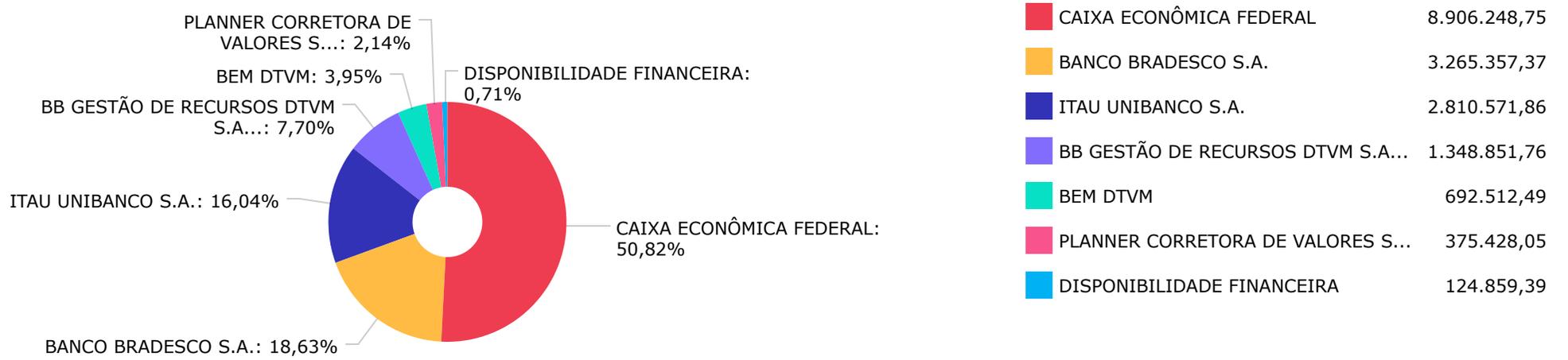
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
NÃO DEFINIDO (BENCHMARK)								
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,18	1,68	0,17	2,06	5,08	14,20	1,09	2,29
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	-0,63	2,24	-1,08	2,42	4,73		1,83	3,85
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	374,03	421,43	362,03	453,03	305,56	133,97	11,20	23,60
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1,75	17,95	2,13	4,05	18,37	73,15	6,26	13,19
CDI (BENCHMARK)								
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-1,36	1,34	-1,89	2,01	4,67	10,50	1,74	3,67
IBOVESPA (BENCHMARK)								
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-4,10	4,76	-3,34	12,74	13,56	-5,94	10,10	21,27
BRABESCO SELECTION FI AÇÕES	-2,27	-1,70	-5,08	4,18	15,34	3,86	8,05	16,95
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-2,21	6,37	-5,41	7,44	21,25	18,06	7,73	16,28
IDKA IPCA 2 ANOS (BENCHMARK)								
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,19	1,69	-0,15	2,10	4,83	14,10	1,13	2,38
IMA-B (BENCHMARK)								
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,14	-2,35	-1,14	0,05	3,01	9,40	3,40	7,16
IMA-B 5 (BENCHMARK)								
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,10	1,30	-0,06	1,82	4,51	13,87	1,31	2,75
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,13	1,30	0,00	1,85	4,50	13,83	1,29	2,72
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	0,08	0,74	-0,08	1,56	3,79	13,37	1,30	2,73
IPCA (BENCHMARK)								
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	-1,45	-1,51	-2,22	-1,04	-0,01	9,20	1,87	3,93

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,50	-1,50	-0,37	0,04	0,46	6,52	1,57	3,32
IRF-M 1 (BENCHMARK)	0,37	1,37	0,77	1,29	2,24	7,41		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,34	1,21	0,70	1,17	2,00	6,95	0,15	0,31

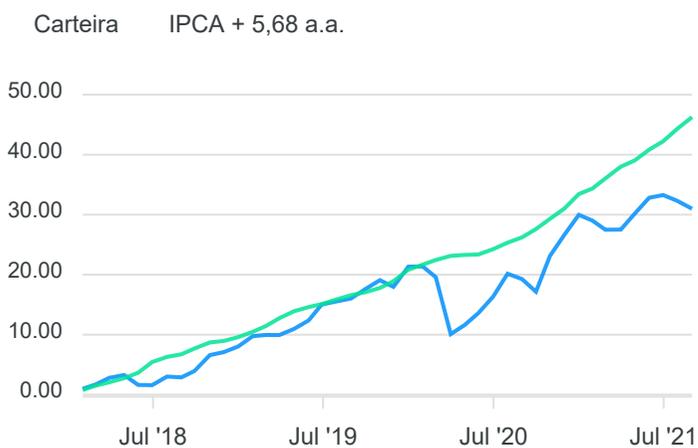
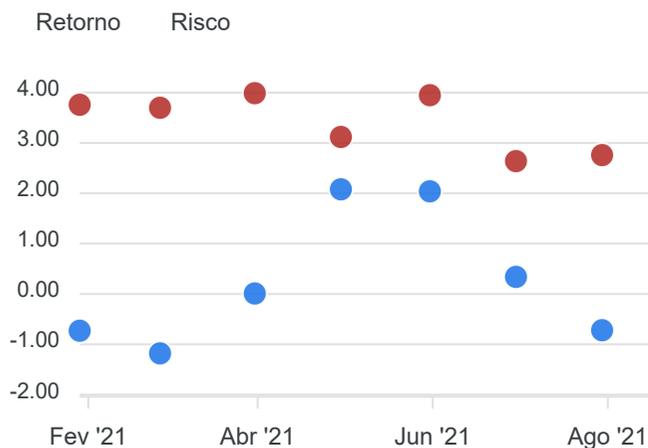
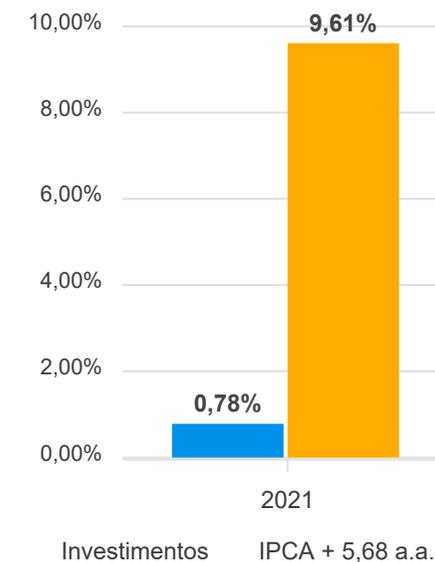








Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Meta %	Risco - VaR
Janeiro	16.999.182,71	0,00	520.000,00	16.354.853,79	-124.328,92	-0,73% ▼	0,69%	3,76%
Fevereiro	16.354.853,79	580.000,00	305.000,00	16.433.202,68	-196.651,11	-1,18% ▼	1,26%	3,70%
Março	16.433.202,68	1.180.000,00	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%
Agosto	17.601.934,57	1.236.364,53	1.262.914,06	17.398.970,28	-176.414,76	-1,00% ▼	1,36%	3,04%
Acumulado					128.205,01	0,78% ▲	9,61%	



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.175.628,35	0,00	0,00	1.177.726,47	2.098,12	0,18% ▲	1,09%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	170.948,20	0,00	0,00	171.125,29	177,09	0,10% ▲	1,31%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.680.944,60	0,00	0,00	2.667.440,27	-13.504,33	-0,50% ▼	1,57%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	597.463,93	0,00	0,00	597.917,10	453,17	0,08% ▲	1,30%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.912.490,74	0,00	0,00	2.870.271,74	-42.219,00	-1,45% ▼	1,87%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.797.356,35	0,00	0,00	1.800.849,08	3.492,73	0,19% ▲	1,13%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	309.235,40	0,00	0,00	309.649,28	413,88	0,13% ▲	1,29%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.041.353,38	0,00	0,00	1.029.511,90	-11.841,48	-1,14% ▼	3,40%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.835.931,82	859.685,76	1.262.914,06	1.439.661,88	6.958,36	0,26% ▲	0,15%
	12.521.352,77	859.685,76	1.262.914,06	12.064.153,01	-53.971,46	-0,43%	1,49%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	708.578,86	0,00	0,00	692.512,49	-16.066,37	-2,27% ▼	8,05%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	395.999,45	0,00	0,00	375.428,05	-20.571,40	-5,19% ▼	11,20%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	859.078,39	0,00	0,00	847.359,55	-11.718,84	-1,36% ▼	1,74%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	612.781,17	0,00	0,00	608.945,32	-3.835,85	-0,63% ▼	1,83%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.506.976,96	0,00	0,00	1.473.744,91	-33.232,05	-2,21% ▼	7,73%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	731.393,39	0,00	0,00	701.409,33	-29.984,06	-4,10% ▼	10,10%
	4.814.808,22	0,00	0,00	4.699.399,65	-115.408,57	-2,40%	6,56%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	265.773,58	376.678,77	0,00	635.417,62	-7.034,73	-1,09% ▼	6,26%
	265.773,58	376.678,77	0,00	635.417,62	-7.034,73	-1,09%	0,00%