

2021

Relatório

Mensal e 3º trimestre de 2021

Setembro

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	1.189.897,64	6,98%	9.425.482.510,34	0,01%	7º I b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	172.798,19	1,01%	6.090.651.961,97	0,00%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.880.459,89	16,91%	14.407.320.968,51	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.820.267,89	10,69%	11.068.272.487,58	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	312.687,14	1,84%	11.150.255.278,19	0,00%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.027.908,16	6,03%	5.161.580.539,44	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.282.904,19	7,53%	6.805.654.314,46	0,02%	7º I b
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.663.332,59	15,63%	1.272.446.776,14	0,21%	7º IV a
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	603.599,45	3,54%	1.161.932.475,65	0,05%	7º IV a
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	635.139,05	3,73%	600.652.318,90	0,11%	8º II a
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.377.630,51	8,09%	3.895.479.143,27	0,04%	8º II a
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	644.622,61	3,78%	942.592.014,60	0,07%	8º II a
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	841.090,85	4,94%	4.076.882.979,35	0,02%	8º III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	604.153,94	3,55%	1.242.647.953,27	0,05%	8º III
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	329.142,40	1,93%	114.474.780,80	0,29%	8º IV b
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	649.687,96	3,81%	237.693.607,20	0,27%	9º A III

Investimentos

\$ 17.035.322,46

Disponibilidades Financeiras

\$ 5.031,46

Total Carteira

\$ 17.040.353,92

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%	50,99%	8.686.923,10	49,01%	8.348.399,36	10,98%	54,88%	68,60%	2.999.308,11
7º IV a - FI de Renda Fixa	40,00%	19,18%	3.266.932,04	20,82%	3.547.196,94	4,07%	20,34%	40,00%	3.547.196,94
8º II a - FI em Ações	20,00%	15,60%	2.657.392,17	4,40%	749.672,32	3,68%	18,38%	20,00%	749.672,32
8º III - FI Multimercado	10,00%	8,48%	1.445.244,79	1,52%	258.287,46	3,08%	3,08%	10,00%	258.287,46
8º IV b - FI Imobiliário	5,00%	1,93%	329.142,40	3,07%	522.623,72	0,00%	2,68%	5,00%	522.623,72
9º A II - Constituídos no Brasil	10,00%	0,00%	0,00	10,00%	1.703.532,25	0,00%	0,32%	5,00%	851.766,12
9º A III - Ações - BDR Nível I	10,00%	3,81%	649.687,96	6,19%	1.053.844,29	0,00%	0,32%	5,00%	202.078,16

Governança (Pró Gestão)

 Não possui

Renda Fixa

\$ 11.953.855,14 70,17%

Renda Variável

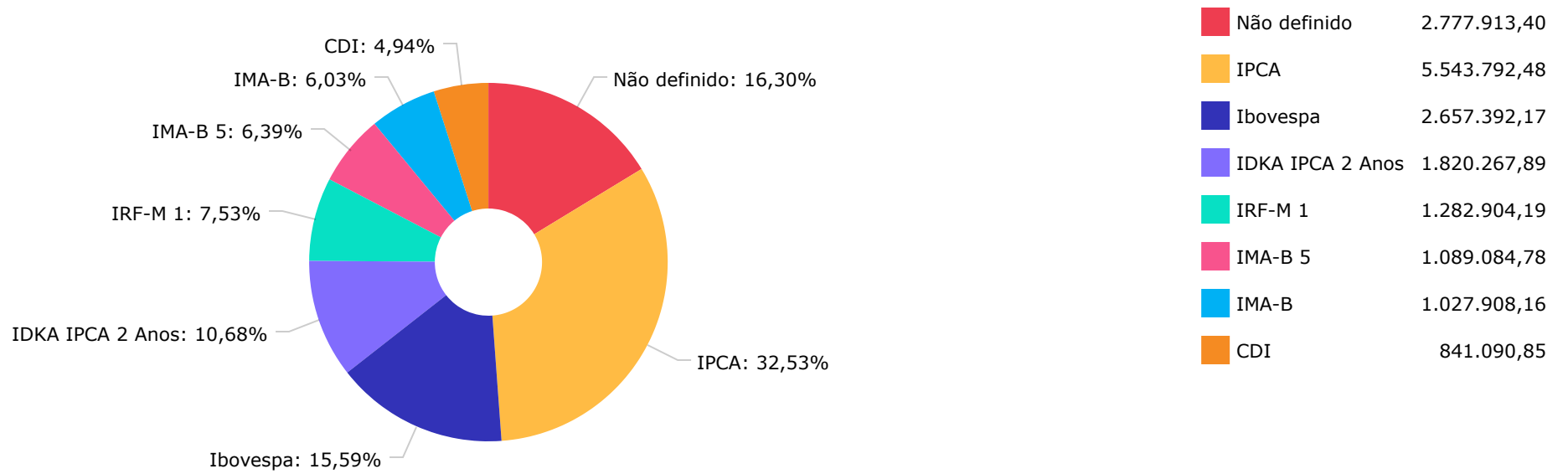
\$ 4.431.779,36 26,02%

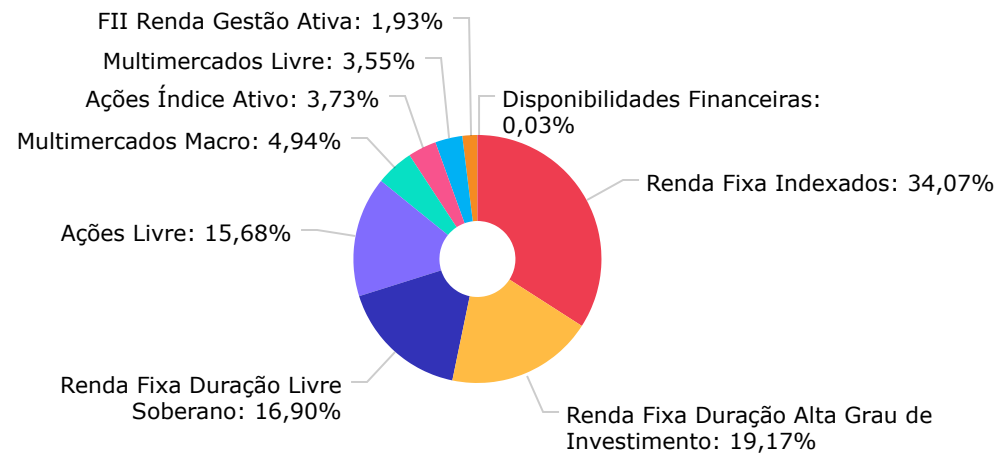
Exterior

\$ 649.687,96 3,81%

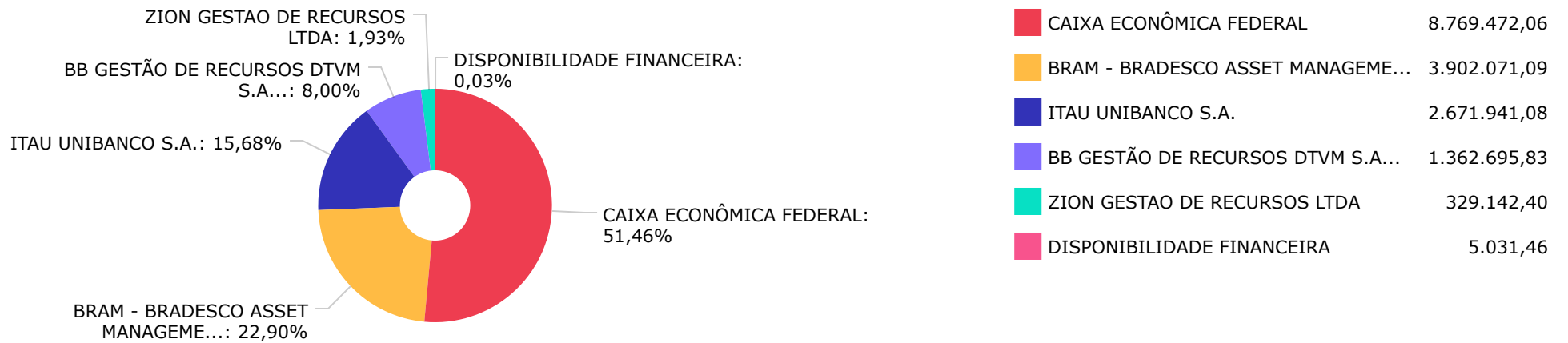
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
NÃO DEFINIDO (BENCHMARK)								
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,03	2,73	1,30	2,74	6,05	13,77	0,73	1,53
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	-0,79	1,44	-1,87	0,04	5,61		2,46	5,17
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-12,33	357,14	295,06	492,59	310,26	109,15	20,93	44,09
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2,25	20,60	9,26	1,86	25,38	66,94	7,43	15,65
CDI (BENCHMARK)								
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,74	0,59	-2,45	-0,11	4,85	8,05	1,80	3,79
IBOVESPA (BENCHMARK)								
BRANCO SELECTION FI AÇÕES	-8,28	-9,84	-14,73	-4,60	8,76	-5,07	12,42	26,15
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-6,52	-0,57	-11,40	-1,65	19,26	6,71	10,48	22,07
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-8,10	-3,72	-12,45	0,03	13,48	-13,14	12,57	26,46
IDKA IPCA 2 ANOS (BENCHMARK)								
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,08	2,79	1,21	2,82	5,92	13,71	0,78	1,63
IMA-B (BENCHMARK)								
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,16	-2,51	-1,68	0,37	4,45	6,20	2,16	4,56
IMA-B 5 (BENCHMARK)								
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,98	2,30	1,13	2,53	5,69	13,00	0,81	1,71
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,98	2,29	1,11	2,49	5,70	13,04	0,82	1,73
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	0,95	1,69	1,01	2,43	4,98	12,47	0,81	1,71
IPCA (BENCHMARK)								
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,35	-1,16	-1,87	-0,98	0,85	7,32	0,48	1,01

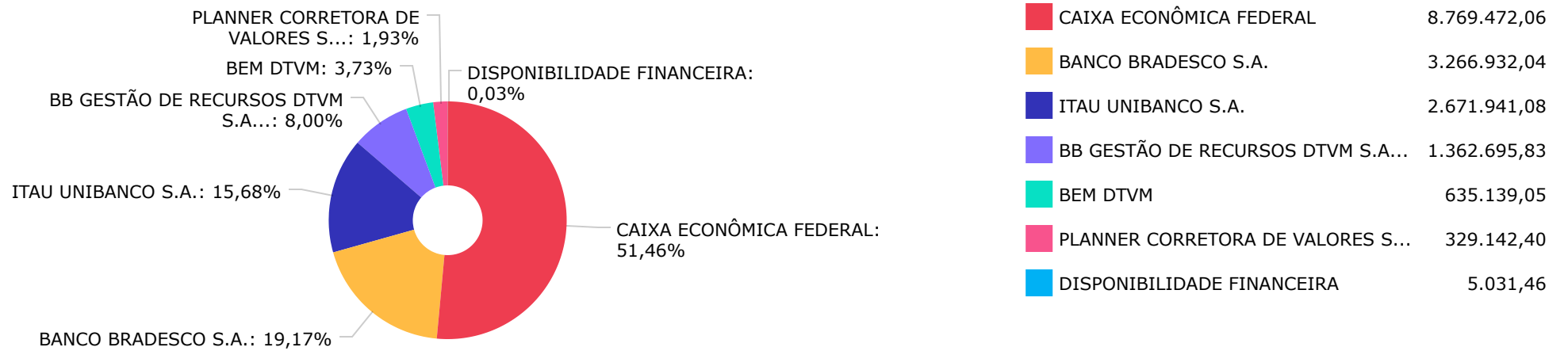
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,15	-1,65	-0,86	0,43	1,30	4,80	1,07	2,25
IRF-M 1 (BENCHMARK)	0,40	1,78	0,96	1,65	2,49	7,15		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,38	1,59	0,89	1,54	2,25	6,68	0,29	0,61



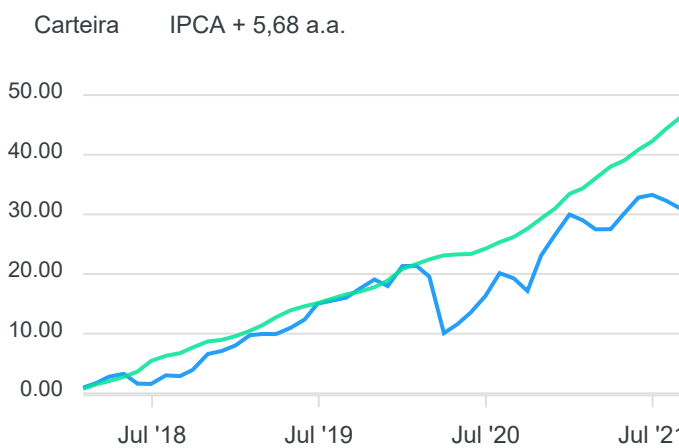
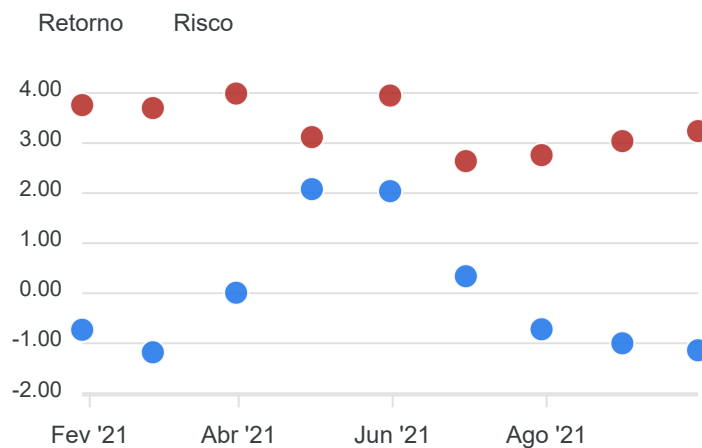
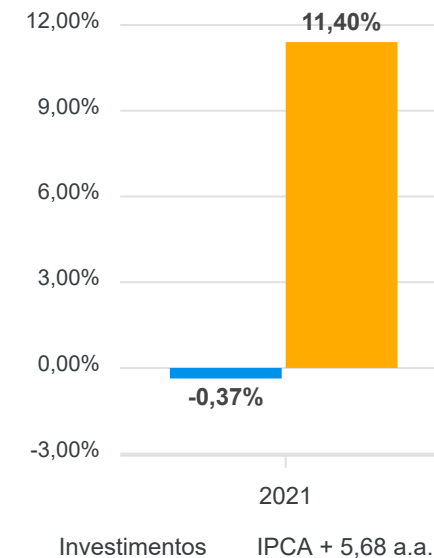


Renda Fixa Indexados	5.806.463,21
Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento	3.266.932,04
Renda Fixa Duração Livre Soberano	2.880.459,89
Ações Livre	2.671.941,08
Multimercados Macro	841.090,85
Ações Índice Ativo	635.139,05
Multimercados Livre	604.153,94
FII Renda Gestão Ativa	329.142,40
Disponibilidades Financeiras	5.031,46





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%
Setembro	17.398.970,28	1.013.250,02	1.177.844,17	17.035.322,46	-199.053,67	-1,14% ▼	1,63%	3,24%
Acumulado					-70.848,66	-0,37% ▲	11,40%	



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.177.726,47	0,00	0,00	1.189.897,64	12.171,17	1,03% ▲	0,73%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	171.125,29	0,00	0,00	172.798,19	1.672,90	0,98% ▲	0,82%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.667.440,27	0,00	0,00	2.663.332,59	-4.107,68	-0,15% ▼	1,07%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	597.917,10	0,00	0,00	603.599,45	5.682,35	0,95% ▲	0,81%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.870.271,74	0,00	0,00	2.880.459,89	10.188,15	0,35% ▲	0,48%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.800.849,08	0,00	0,00	1.820.267,89	19.418,81	1,08% ▲	0,78%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	309.649,28	0,00	0,00	312.687,14	3.037,86	0,98% ▲	0,81%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.029.511,90	0,00	0,00	1.027.908,16	-1.603,74	-0,16% ▼	2,16%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.439.661,88	1.013.250,02	1.177.844,17	1.282.904,19	7.836,46	0,32% ▲	0,29%
	12.064.153,01	1.013.250,02	1.177.844,17	11.953.855,14	54.296,28	0,45%	0,84%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	692.512,49	0,00	0,00	635.139,05	-57.373,44	-8,28% ▼	12,42%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	375.428,05	0,00	0,00	329.142,40	-46.285,65	-12,33% ▼	20,93%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	847.359,55	0,00	0,00	841.090,85	-6.268,70	-0,74% ▼	1,80%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	608.945,32	0,00	0,00	604.153,94	-4.791,38	-0,79% ▼	2,46%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.473.744,91	0,00	0,00	1.377.630,51	-96.114,40	-6,52% ▼	10,48%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	701.409,33	0,00	0,00	644.622,61	-56.786,72	-8,10% ▼	12,57%
	4.699.399,65	0,00	0,00	4.431.779,36	-267.620,29	-5,69%	9,10%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	635.417,62	0,00	0,00	649.687,96	14.270,34	2,25% ▲	7,43%
	635.417,62	0,00	0,00	649.687,96	14.270,34	2,25%	0,00%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.174.647,99	0,00	0,00	1.189.897,64	15.249,65	1,30% ▲
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	170.909,60	0,00	0,00	172.798,19	1.888,59	1,11% ▲
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.686.322,05	0,00	0,00	2.663.332,59	-22.989,46	-0,86% ▼
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	0,00	600.000,00	0,00	603.599,45	3.599,45	0,60% ▲
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.935.257,22	0,00	0,00	2.880.459,89	-54.797,33	-1,87% ▼
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.798.524,29	0,00	0,00	1.820.267,89	21.743,60	1,21% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	309.192,42	0,00	0,00	312.687,14	3.494,72	1,13% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.045.521,27	0,00	0,00	1.027.908,16	-17.613,11	-1,68% ▼
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.971.436,71	2.805.736,59	3.514.113,28	1.282.904,19	19.844,17	0,42% ▲
	12.091.811,55	3.405.736,59	3.514.113,28	11.953.855,14	-29.579,72	-0,24%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	1.340.065,36	0,00	600.000,00	635.139,05	-104.926,31	-7,83% ▼
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	416.570,85	0,00	0,00	329.142,40	-87.428,45	-20,99% ▼
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	862.220,94	0,00	0,00	841.090,85	-21.130,09	-2,45% ▼
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	615.640,91	0,00	0,00	604.153,94	-11.486,97	-1,87% ▼
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.554.808,74	0,00	0,00	1.377.630,51	-177.178,23	-11,40% ▼
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	736.273,25	0,00	0,00	644.622,61	-91.650,64	-12,45% ▼
	5.525.580,05	0,00	600.000,00	4.431.779,36	-493.800,69	-8,94%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	253.064,22	376.678,77	0,00	649.687,96	19.944,97	3,17% ▲
	253.064,22	376.678,77	0,00	649.687,96	19.944,97	3,17%