

2021

Relatório Mensal

Outubro

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	1.174.991,09	7,04%	9.253.803.912,06	0,01%	7º I b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	170.595,42	1,02%	6.081.334.244,20	0,00%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.662.894,10	15,96%	13.374.488.418,39	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.303.971,68	7,81%	11.036.712.361,17	0,01%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	308.797,19	1,85%	10.998.044.937,35	0,00%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.001.576,87	6,00%	4.811.776.336,97	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.211.789,09	7,26%	6.589.712.896,46	0,02%	7º I b
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.644.275,14	15,85%	1.258.083.247,62	0,21%	7º IV a
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	595.852,31	3,57%	1.191.680.411,60	0,05%	7º IV a
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	580.409,31	3,48%	548.943.483,80	0,11%	8º II a
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.273.805,67	7,63%	3.599.452.679,06	0,04%	8º II a
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	568.661,14	3,41%	839.472.553,32	0,07%	8º II a
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	536.974,03	3,22%	3.850.582.638,70	0,01%	8º III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	497.456,88	2,98%	1.176.806.306,53	0,04%	8º III
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	632.610,70	3,79%	2.337.314.930,65	0,03%	8º III
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	262.285,35	1,57%	91.222.090,95	0,29%	8º IV b
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	547.219,62	3,28%	3.720.209.176,93	0,01%	9º A III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	712.940,12	4,27%	261.911.489,67	0,27%	9º A III

Investimentos

\$ 16.687.105,71

Disponibilidades Financeiras

\$ 8.819,42

Total Carteira

\$ 16.695.925,13

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%	46,95%	7.834.615,44	53,05%	8.852.490,27	10,98%	54,88%	68,60%	3.612.739,08
7º IV a - FI de Renda Fixa	40,00%	19,42%	3.240.127,45	20,58%	3.434.714,83	4,07%	20,34%	40,00%	3.434.714,83
8º II a - FI em Ações	20,00%	14,52%	2.422.876,12	5,48%	914.545,02	3,68%	18,38%	20,00%	914.545,02
8º III - FI Multimercado	10,00%	9,99%	1.667.041,61	0,01%	1.668,96	3,08%	3,08%	10,00%	1.668,96
8º IV b - FI Imobiliário	5,00%	1,57%	262.285,35	3,43%	572.069,94	0,00%	2,68%	5,00%	572.069,94
9º A II - Constituídos no Brasil	10,00%	0,00%	0,00	10,00%	1.668.710,57	0,00%	0,32%	5,00%	834.355,29
9º A III - Ações - BDR Nível I	10,00%	7,55%	1.260.159,74	2,45%	408.550,83	0,00%	0,32%	5,00%	-425.804,45

Governança (Pró Gestão)

📄 Não possui

Renda Fixa

\$ 11.074.742,89 66,37%

Renda Variável

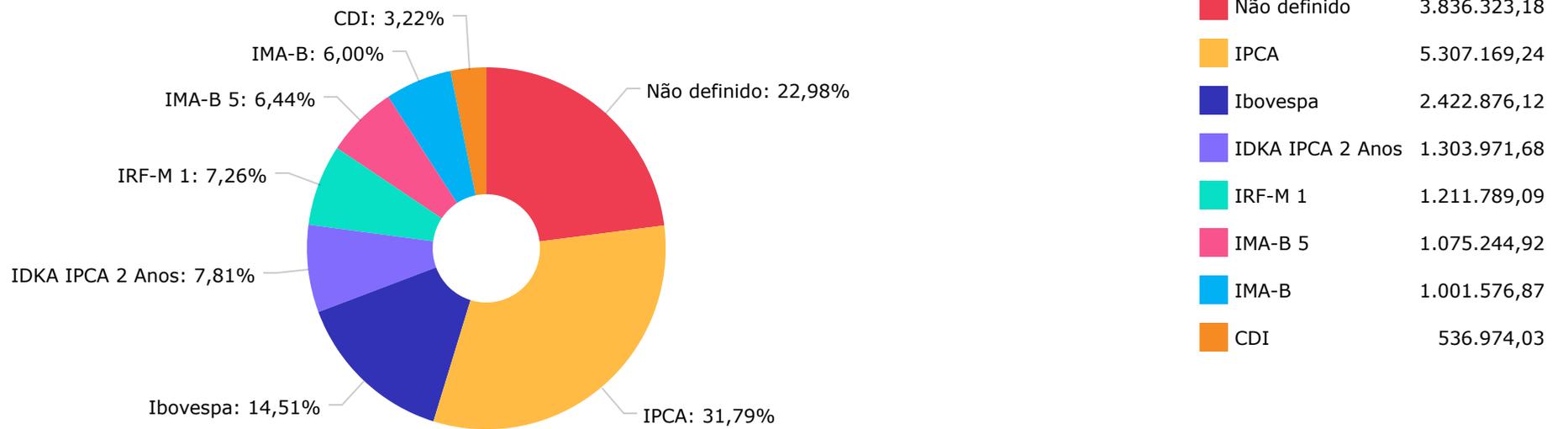
\$ 4.352.203,08 26,08%

Exterior

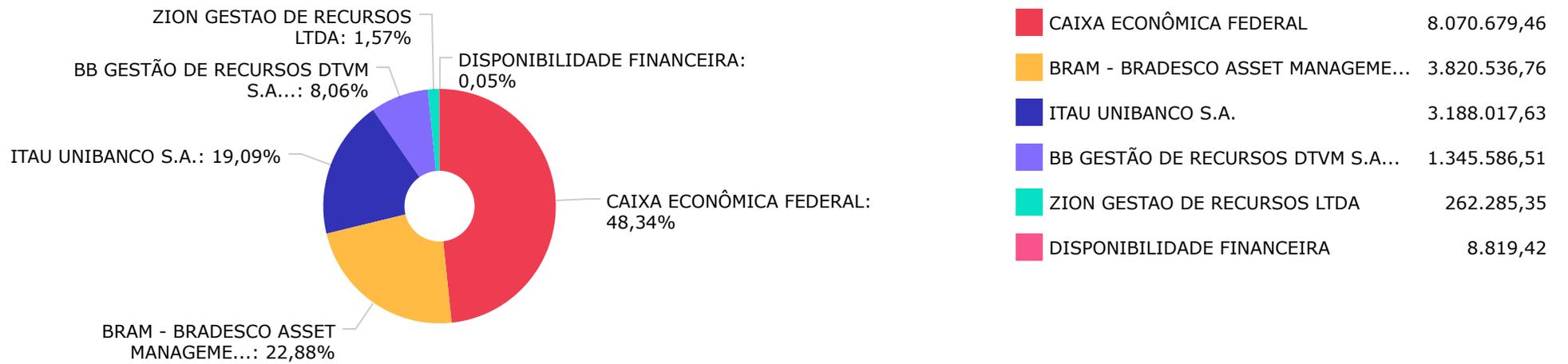
\$ 1.260.159,74 7,55%

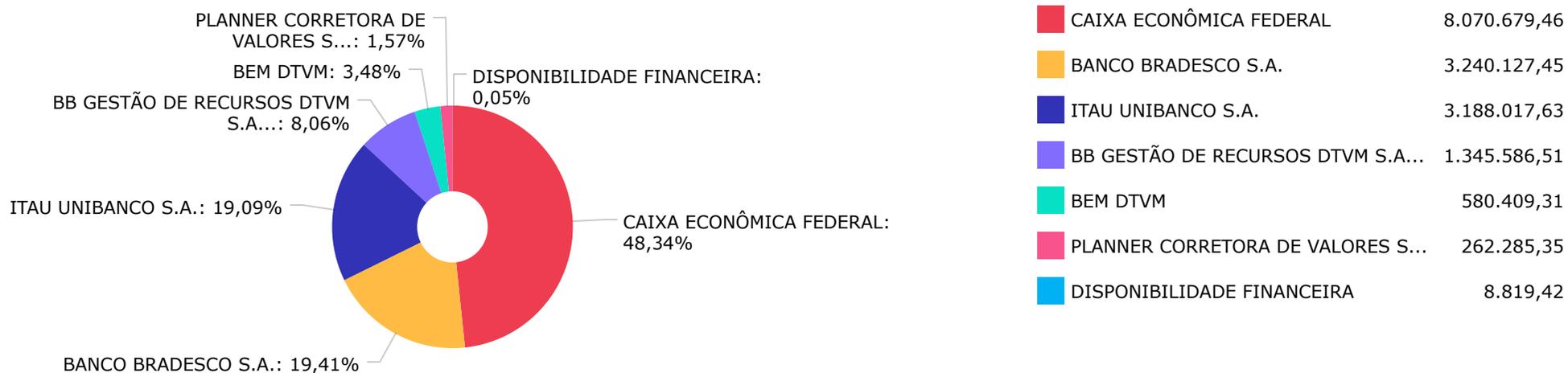
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
NÃO DEFINIDO (BENCHMARK)								
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,25	1,45	-0,05	0,61	4,38	10,97	1,89	3,98
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	-1,27	0,15	-2,66	-1,78	4,83	5,96	2,48	5,22
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	7,63	26,41	6,12	12,21	44,35	52,17	5,83	12,28
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-20,31	264,29	231,17	240,00	222,78	90,30	28,85	60,77
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	10,93	29,48	13,35	13,59	33,54	114,42	7,94	16,72
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	9,74	32,35	14,16	11,53	40,45	85,40	8,19	17,26
CDI (BENCHMARK)								
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,89	-0,30	-2,96	-2,09	4,27	6,17	1,70	3,57
IBOVESPA (BENCHMARK)								
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-7,54	-8,06	-15,47	-11,98	9,73	-3,63	9,84	20,73
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-11,78	-15,07	-22,25	-15,35	4,46	-24,06	13,42	28,27
BRANCO SELECTION FI AÇÕES	-8,62	-17,61	-18,09	-15,68	-3,81	-16,16	13,27	27,94
IDKA IPCA 2 ANOS (BENCHMARK)								
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,29	1,46	-0,03	0,46	4,40	10,83	1,97	4,15
IMA-B (BENCHMARK)								
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-2,54	-4,79	-3,73	-2,67	1,83	0,81	3,57	7,52
IMA-B 5 (BENCHMARK)								
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	-1,27	0,98	-0,21	0,31	4,16	9,80	2,00	4,22
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,24	1,03	-0,14	0,39	4,19	9,79	1,99	4,19
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	-1,28	0,39	-0,27	0,17	3,50	9,18	2,00	4,22

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IPCA (BENCHMARK)	1,25	8,24	3,32	5,73	10,67	15,01		
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	-0,66	-1,82	-1,75	-2,29	0,30	4,82	0,96	2,01
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,72	-2,35	-1,37	-0,82	0,85	2,10	1,48	3,11
IRF-M 1 (BENCHMARK)	-0,54	1,23	0,23	0,83	1,78	5,91		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,54	1,05	0,18	0,71	1,55	5,47	0,73	1,54

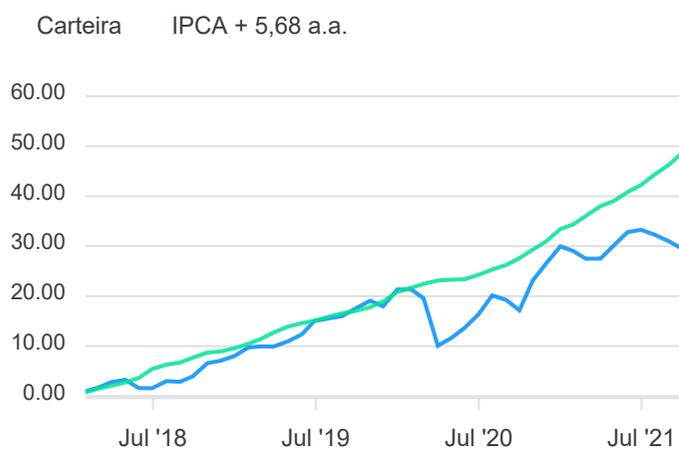
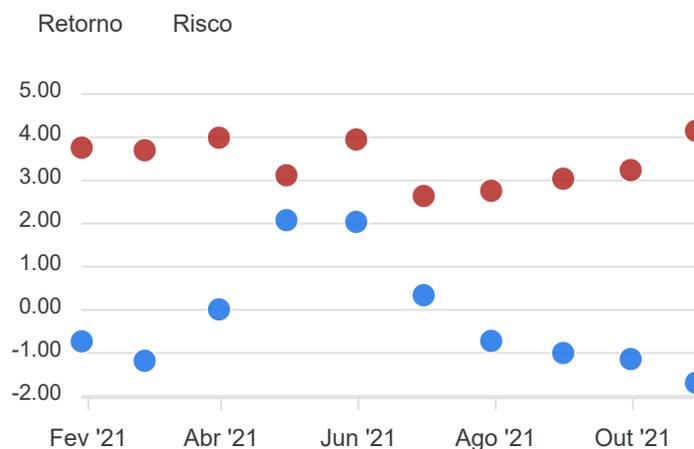
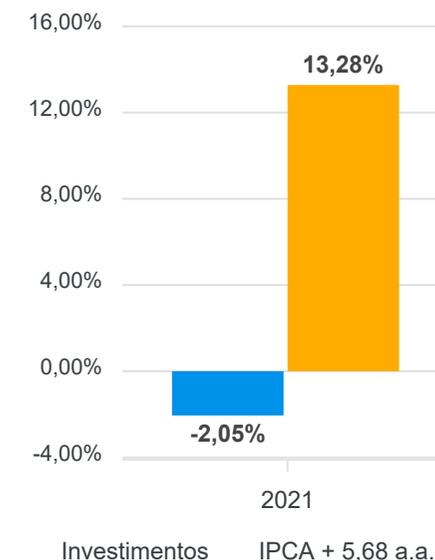








Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Meta %	Risco - VaR
Janeiro	16.999.182,71	0,00	520.000,00	16.354.853,79	-124.328,92	-0,73% ▼	0,69%	3,76%
Fevereiro	16.354.853,79	580.000,00	305.000,00	16.433.202,68	-196.651,11	-1,18% ▼	1,26%	3,70%
Março	16.433.202,68	1.180.000,00	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%
Outubro	17.035.322,46	2.144.153,09	2.205.112,27	16.687.105,71	-287.257,57	-1,69% ▼	1,69%	4,15%
Acumulado					-358.106,23	-2,05% ▲	13,28%	



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.189.897,64	0,00	0,00	1.174.991,09	-14.906,55	-1,25% ▼	1,89%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	172.798,19	0,00	0,00	170.595,42	-2.202,77	-1,27% ▼	2,00%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.663.332,59	0,00	0,00	2.644.275,14	-19.057,45	-0,72% ▼	1,48%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	603.599,45	0,00	0,00	595.852,31	-7.747,14	-1,28% ▼	2,00%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.880.459,89	0,00	200.000,00	2.662.894,10	-17.565,79	-0,61% ▼	0,96%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.820.267,89	0,00	500.000,00	1.303.971,68	-16.296,21	-0,90% ▼	1,97%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	312.687,14	0,00	0,00	308.797,19	-3.889,95	-1,24% ▼	1,99%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.027.908,16	0,00	0,00	1.001.576,87	-26.331,29	-2,56% ▼	3,57%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.282.904,19	1.044.153,09	1.105.112,27	1.211.789,09	-10.155,92	-0,44% ▼	0,73%
	11.953.855,14	1.044.153,09	1.805.112,27	11.074.742,89	-118.153,07	-0,99%	1,61%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	635.139,05	0,00	0,00	580.409,31	-54.729,74	-8,62% ▼	13,27%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	329.142,40	0,00	0,00	262.285,35	-66.857,05	-20,31% ▼	28,85%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	841.090,85	0,00	300.000,00	536.974,03	-4.116,82	-0,49% ▼	1,70%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	604.153,94	0,00	100.000,00	497.456,88	-6.697,06	-1,11% ▼	2,48%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.377.630,51	0,00	0,00	1.273.805,67	-103.824,84	-7,54% ▼	9,84%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	644.622,61	0,00	0,00	568.661,14	-75.961,47	-11,78% ▼	13,42%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	0,00	600.000,00	0,00	632.610,70	32.610,70	5,44% ▲	5,83%
	4.431.779,36	600.000,00	400.000,00	4.352.203,08	-279.576,28	-6,04%	9,48%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	649.687,96	0,00	0,00	712.940,12	63.252,16	9,74% ▲	8,19%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	500.000,00	0,00	547.219,62	47.219,62	9,44% ▲	7,94%
	649.687,96	500.000,00	0,00	1.260.159,74	110.471,78	9,61%	4,63%