

2021

Relatório

Mensal, 2º trimestre e 1º semestre de 2021

Junho

Análise dos Investimentos

De acordo com a Portaria MPS nº 519 de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V, e com o Manual do Pró-Gestão RPPS versão 3.2, ítem 3.2.6, aprovado pela Portaria SPREV nº 3030, de 15 de Março de 2021.

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.174.647,99	6,57%	10.494.201.076,30	0,01%	7º I b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	170.909,60	0,96%	5.768.393.191,74	0,00%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.935.257,22	16,43%	16.058.908.177,46	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.798.524,29	10,06%	11.796.463.834,87	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	309.192,42	1,73%	14.363.834.668,17	0,00%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.045.521,27	5,85%	5.867.854.510,24	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.971.436,71	11,03%	8.267.613.291,28	0,02%	7º I b
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.686.322,05	15,03%	1.501.428.504,12	0,18%	7º IV a
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	1.340.065,36	7,50%	776.844.725,37	0,17%	8º II a
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.554.808,74	8,70%	4.531.988.113,87	0,03%	8º II a
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	736.273,25	4,12%	1.034.622.494,72	0,07%	8º II a
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	862.220,94	4,82%	4.432.831.656,33	0,02%	8º III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	615.640,91	3,45%	1.337.700.540,25	0,05%	8º III
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	416.570,85	2,33%	144.882.144,45	0,29%	8º IV b
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	253.064,22	1,42%	213.215.830,79	0,12%	9º A III

Investimentos

\$ 17.870.455,82

Disponibilidades Financeiras

\$ 5.525,32

Total Carteira

\$ 17.875.981,14

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%	52,63%	9.405.489,50	47,37%	8.464.966,32	10,98%	54,88%	68,60%	2.853.643,19
7º IV a - FI de Renda Fixa	40,00%	15,03%	2.686.322,05	24,97%	4.461.860,28	4,07%	20,34%	40,00%	4.461.860,28
8º II a - FI em Ações	20,00%	20,32%	3.631.147,35	-0,32%	-57.056,19	3,68%	18,38%	20,00%	-57.056,19
8º III - FI Multimercado	10,00%	8,27%	1.477.861,85	1,73%	309.183,73	3,08%	3,08%	10,00%	309.183,73
8º IV b - FI Imobiliário	5,00%	2,33%	416.570,85	2,67%	476.951,94	0,00%	2,68%	5,00%	476.951,94
9º A II - Constituídos no Brasil	10,00%	0,00%	0,00	10,00%	1.787.045,58	0,00%	0,32%	5,00%	893.522,79
9º A III - Ações - BDR Nível I	10,00%	1,42%	253.064,22	8,58%	1.533.981,36	0,00%	0,32%	5,00%	640.458,57

Governança (Pró Gestão)

⚙️ Não possui

Renda Fixa

\$ 12.091.811,55 67,66%

Renda Variável

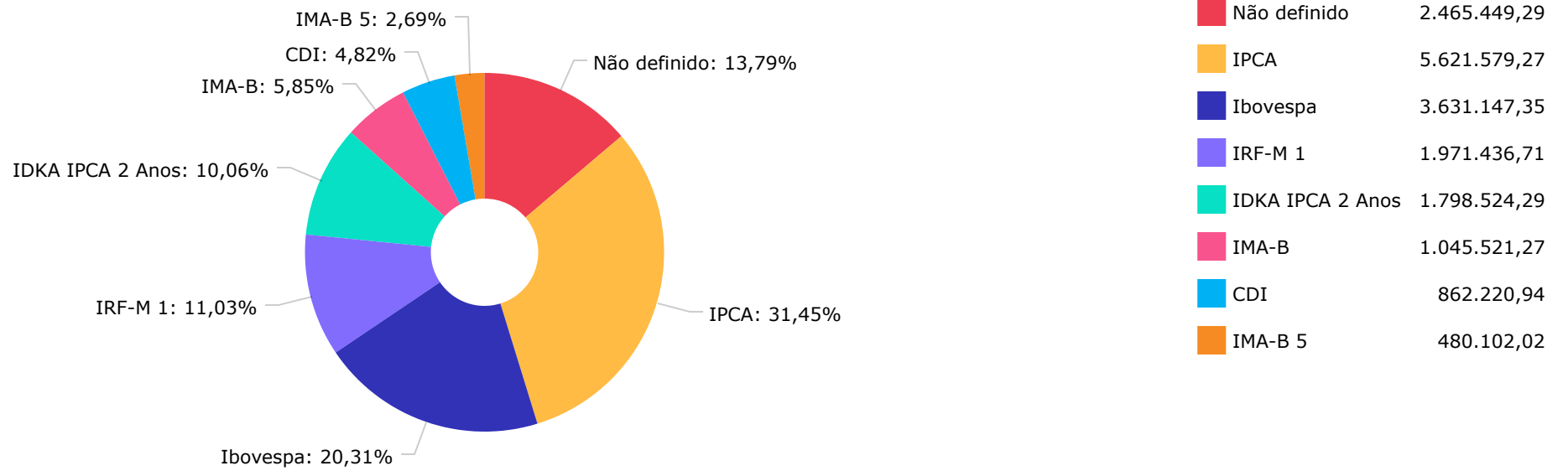
\$ 5.525.580,05 30,92%

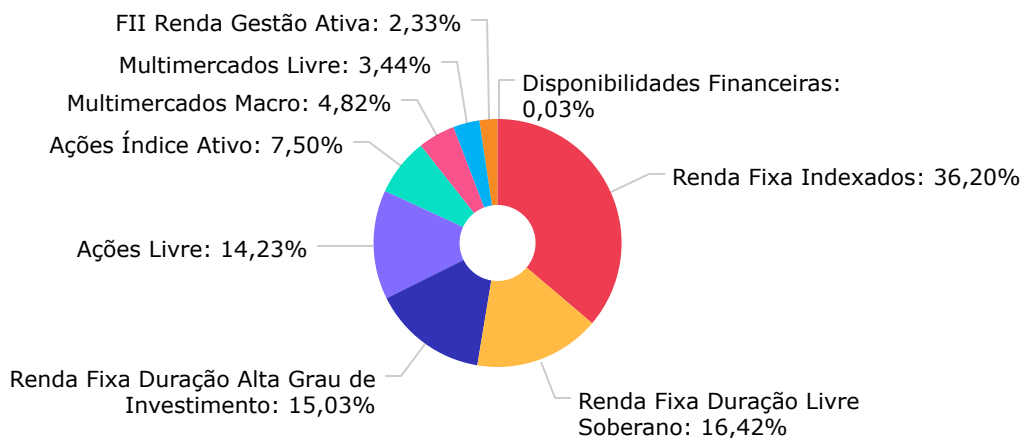
Exterior

\$ 253.064,22 1,42%

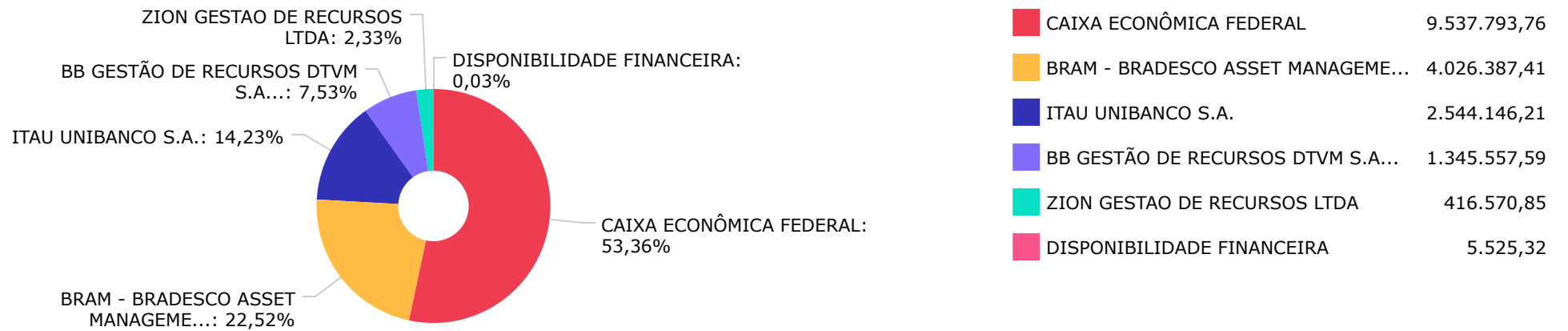
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
NÃO DEFINIDO (BENCHMARK)								
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,09	1,42	1,42	1,42	6,38	15,08	1,36	2,86
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,00	3,36	1,94	3,36	8,30		0,80	1,68
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	2,53	15,71	50,00	15,71	14,08	-54,75	30,23	63,67
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-4,43	10,38	-6,78	10,38	23,67	70,93	6,56	13,82
CDI (BENCHMARK)								
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,17	3,12	2,40	3,12	7,86	14,62	1,32	2,78
IBOVESPA (BENCHMARK)								
BRANCO SELECTION FI AÇÕES	2,09	5,73	11,88	5,73	34,96	16,77	4,46	9,39
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-0,21	12,22	11,00	12,22	37,29	31,25	4,87	10,27
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1,46	9,96	14,26	9,96	21,16	5,25	5,18	10,91
IDKA IPCA 2 ANOS (BENCHMARK)								
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,28	1,56	1,59	1,56	6,40	15,12	1,53	3,22
IMA-B (BENCHMARK)								
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,40	-0,84	2,09	-0,84	7,19	12,04	2,43	5,12
IMA-B 5 (BENCHMARK)								
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	-0,19	1,17	1,37	1,17	5,78	14,87	1,55	3,27
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,15	1,15	1,38	1,15	5,77	14,77	1,53	3,22
IPCA (BENCHMARK)								
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,00	0,72	0,90	0,72	2,68	12,77	0,97	2,04
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,33	-0,80	1,29	-0,80	2,01	8,37	1,16	2,44

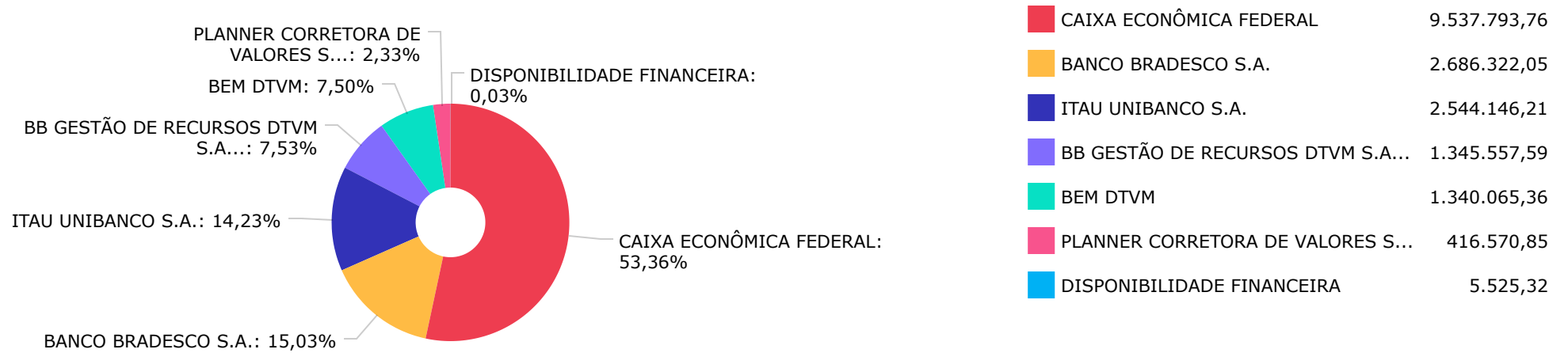
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IRF-M 1 (BENCHMARK)	0,21	0,81	0,69	0,81	2,04	8,17		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,19	0,70	0,64	0,70	1,82	7,71	0,16	0,33



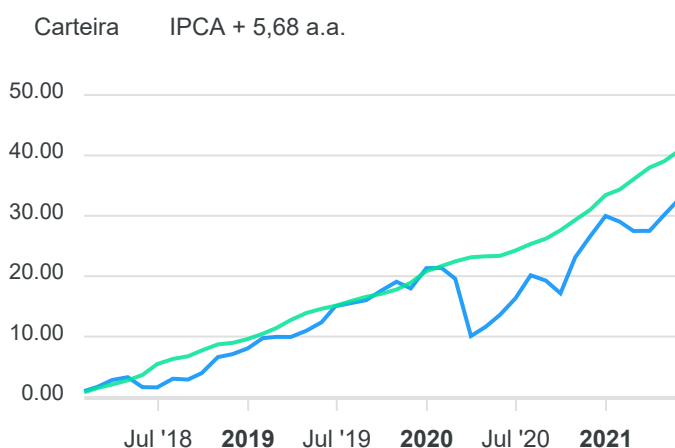
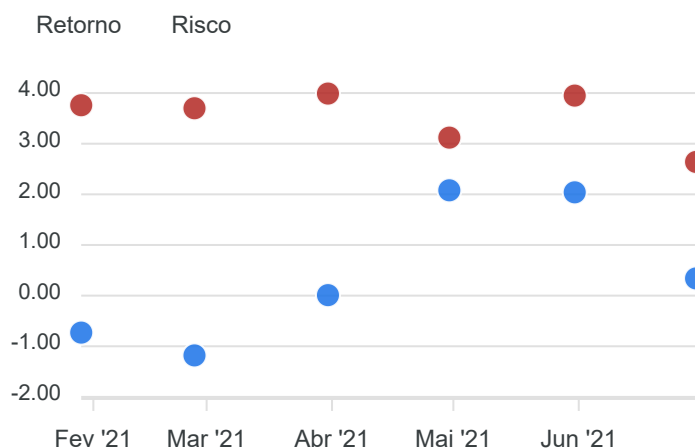
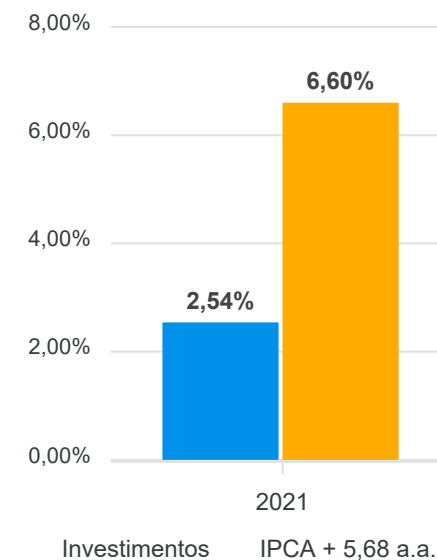


Renda Fixa Indexados	6.470.232,28
Renda Fixa Duração Livre Soberano	2.935.257,22
Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento	2.686.322,05
Ações Livre	2.544.146,21
Ações Índice Ativo	1.340.065,36
Multimercados Macro	862.220,94
Multimercados Livre	615.640,91
FII Renda Gestão Ativa	416.570,85
Disponibilidades Financeiras	5.525,32





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%
Acumulado					432.586,78	2,54% ▲	6,60%	



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.175.747,42	0,00	0,00	1.174.647,99	-1.099,43	-0,09% ▼	1,36%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	165.855,28	5.378,71	0,00	170.909,60	-324,39	-0,19% ▼	1,55%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.677.461,20	0,00	0,00	2.686.322,05	8.860,85	0,33% ▲	1,16%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.935.345,75	0,00	0,00	2.935.257,22	-88,53	0,00% ▼	0,97%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.803.525,44	2.005.776,01	2.005.776,01	1.798.524,29	-5.001,15	-0,13% ▼	1,53%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.041.341,69	526.234,38	526.234,38	1.045.521,27	4.179,58	0,27% ▲	2,43%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.212.754,43	1.811.590,55	1.056.426,96	1.971.436,71	3.518,69	0,12% ▲	0,16%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	201.356,61	0,00	201.381,61	0,00	25,00	0,01% ▲	0,02%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	309.712,52	0,00	309.192,42	-520,10	-0,17% ▼	1,53%
	11.213.387,82	4.658.692,17	3.789.818,96	12.091.811,55	9.550,52	0,08%	1,15%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	1.312.612,64	0,00	0,00	1.340.065,36	27.452,72	2,09% ▲	4,46%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	406.285,15	0,00	0,00	416.570,85	10.285,70	2,53% ▲	30,23%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	863.678,13	0,00	0,00	862.220,94	-1.457,19	-0,17% ▼	1,32%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	615.614,52	0,00	0,00	615.640,91	26,39	0,00% ▲	0,80%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.558.096,78	0,00	0,00	1.554.808,74	-3.288,04	-0,21% ▼	4,87%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	971.896,62	0,00	250.000,00	736.273,25	14.376,63	1,48% ▲	5,18%
	5.728.183,84	0,00	250.000,00	5.525.580,05	47.396,21	0,83%	5,72%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	250.000,00	0,00	253.064,22	3.064,22	1,23% ▲	6,56%
	0,00	250.000,00	0,00	253.064,22	3.064,22	1,23%	0,00%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.158.184,33	0,00	0,00	1.174.647,99	16.463,66	1,42% ▲
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	170.667,81	0,00	170.909,60	241,79	0,14% ▲
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	169.452,02	0,00	170.667,81	0,00	1.215,79	0,72% ▲
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	2.677.461,20	0,00	2.686.322,05	8.860,85	0,33% ▲
BRANCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	2.654.934,82	0,00	2.677.461,20	0,00	22.526,38	0,85% ▲
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.909.024,77	0,00	0,00	2.935.257,22	26.232,45	0,90% ▲
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.770.401,87	2.005.776,01	2.005.776,01	1.798.524,29	28.122,42	0,74% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	309.712,52	0,00	309.192,42	-520,10	-0,17% ▼
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.885.807,59	1.466.234,38	2.351.234,38	1.045.521,27	44.713,68	1,33% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	371.441,42	2.696.299,55	1.101.426,96	1.971.436,71	5.122,70	0,17% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	307.326,03	1.240.982,62	1.552.160,74	0,00	3.852,09	0,25% ▲
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	200.531,16	0,00	201.381,61	0,00	850,45	0,42% ▲
	11.427.104,01	10.567.134,09	10.060.108,71	12.091.811,55	157.682,16	1,32%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	1.197.742,55	0,00	0,00	1.340.065,36	142.322,81	11,88% ▲
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	277.713,90	0,00	0,00	416.570,85	138.856,95	50,00% ▲
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	842.041,57	0,00	0,00	862.220,94	20.179,37	2,40% ▲
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	603.939,11	0,00	0,00	615.640,91	11.701,80	1,94% ▲
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.400.700,38	0,00	0,00	1.554.808,74	154.108,36	11,00% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	863.063,52	0,00	250.000,00	736.273,25	123.209,73	14,28% ▲
	5.185.201,03	0,00	250.000,00	5.525.580,05	590.379,02	11,39%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	250.000,00	0,00	253.064,22	3.064,22	1,23% ▲
	0,00	250.000,00	0,00	253.064,22	3.064,22	1,23%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.158.225,69	0,00	0,00	1.174.647,99	16.422,30	1,42% ▲
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	170.667,81	0,00	170.909,60	241,79	0,14% ▲
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	174.363,00	0,00	170.667,81	0,00	-3.695,19	-2,12% ▼
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	2.677.461,20	0,00	2.686.322,05	8.860,85	0,33% ▲
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	2.735.807,57	0,00	2.677.461,20	0,00	-58.346,37	-2,13% ▼
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.914.351,70	0,00	0,00	2.935.257,22	20.905,52	0,72% ▲
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.049.664,02	2.005.776,01	2.285.776,01	1.798.524,29	28.860,27	0,71% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	309.712,52	0,00	309.192,42	-520,10	-0,17% ▼
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.899.695,30	2.046.234,38	2.881.820,48	1.045.521,27	-18.587,93	-0,47% ▼
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	381.243,09	2.696.299,55	1.111.426,96	1.971.436,71	5.321,03	0,17% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	344.455,68	1.240.982,62	1.579.913,69	0,00	-5.524,61	-0,35% ▼
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	1.180.000,00	1.181.381,61	0,00	1.381,61	0,12% ▲
	11.657.806,05	12.327.134,09	11.888.447,76	12.091.811,55	-4.680,83	-0,04%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	1.267.406,71	0,00	0,00	1.340.065,36	72.658,65	5,73% ▲
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	359.999,50	0,00	0,00	416.570,85	56.571,35	15,71% ▲
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	836.142,60	0,00	0,00	862.220,94	26.078,34	3,12% ▲
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	595.603,33	0,00	0,00	615.640,91	20.037,58	3,36% ▲
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.385.473,12	0,00	0,00	1.554.808,74	169.335,62	12,22% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	896.751,40	0,00	250.000,00	736.273,25	89.521,85	9,98% ▲
	5.341.376,66	0,00	250.000,00	5.525.580,05	434.203,39	8,13%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	250.000,00	0,00	253.064,22	3.064,22	1,23% ▲
	0,00	250.000,00	0,00	253.064,22	3.064,22	1,23%