

2022

Fevereiro

Relatório Mês

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 Fundo	Lei
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	22.240.961,25	9,28%	0,35%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	17.287.501,21	7,22%	0,27%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	26.334.615,58	10,99%	0,25%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	17.813.629,07	7,44%	0,15%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	33.867.213,14	14,14%	0,78%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	25.710.729,25	10,73%	1,83%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	35.657.526,88	14,88%	14,90%	7º I b
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	3.624.654,00	1,51%	0,01%	7º I b
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	25.740.127,69	10,74%	1,99%	7º III a
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	9.729.354,90	4,06%	0,40%	7º III a
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	13.244,70	0,01%	1,20%	7º V a
PREMIUM FIDC SÊNIOR	3.726.624,91	1,56%	4,86%	7º V a
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	4.534.958,37	1,89%	0,96%	8º I
ITAÚ OLIMPO FIC AÇÕES	5.092.941,02	2,13%	0,82%	8º I
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	8.193.130,95	3,42%	3,79%	10º I

Investimentos

\$ 239.567.212,92

Disponibilidades Financeiras

\$ 435.915,31

Total Carteira

\$ 240.003.128,23

Governança (Pró Gestão)
 Não possui

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre	Política de Investimentos			GAP - Superior		
				Inferior %	Alvo %	Superior %			
7º I a - Títulos TN SELIC	100,00%	0,00%	0,00	100,00%	239.567.212,92	0,00%	10,00%	100,00%	239.567.212,92
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	76,19%	182.536.830,38	23,81%	57.030.382,54	0,00%	27,00%	100,00%	57.030.382,54
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	14,81%	35.469.482,59	45,19%	108.270.845,16	0,00%	20,00%	60,00%	108.270.845,16
7º V a - FIDC Cota Sênior	5,00%	1,56%	3.739.869,61	3,44%	8.238.491,04	0,00%	2,00%	5,00%	8.238.491,04
7º V b - Fundos de Renda Fixa - Crédito Privado	5,00%	0,00%	0,00	5,00%	11.978.360,65	0,00%	1,00%	5,00%	11.978.360,65
8º I - Fundos de Ações	30,00%	4,02%	9.627.899,39	25,98%	62.242.264,49	0,00%	25,00%	30,00%	62.242.264,49
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	0,00%	0,00	10,00%	23.956.721,29	0,00%	10,00%	10,00%	23.956.721,29
10º I - Fundos Multimercados	5,00%	3,42%	8.193.130,95	1,58%	3.785.229,70	0,00%	5,00%	10,00%	15.763.590,34

Governança (Pró Gestão)

📄 Não possui

Renda Fixa

\$ 221.746.182,58 92,56%

Renda Variável

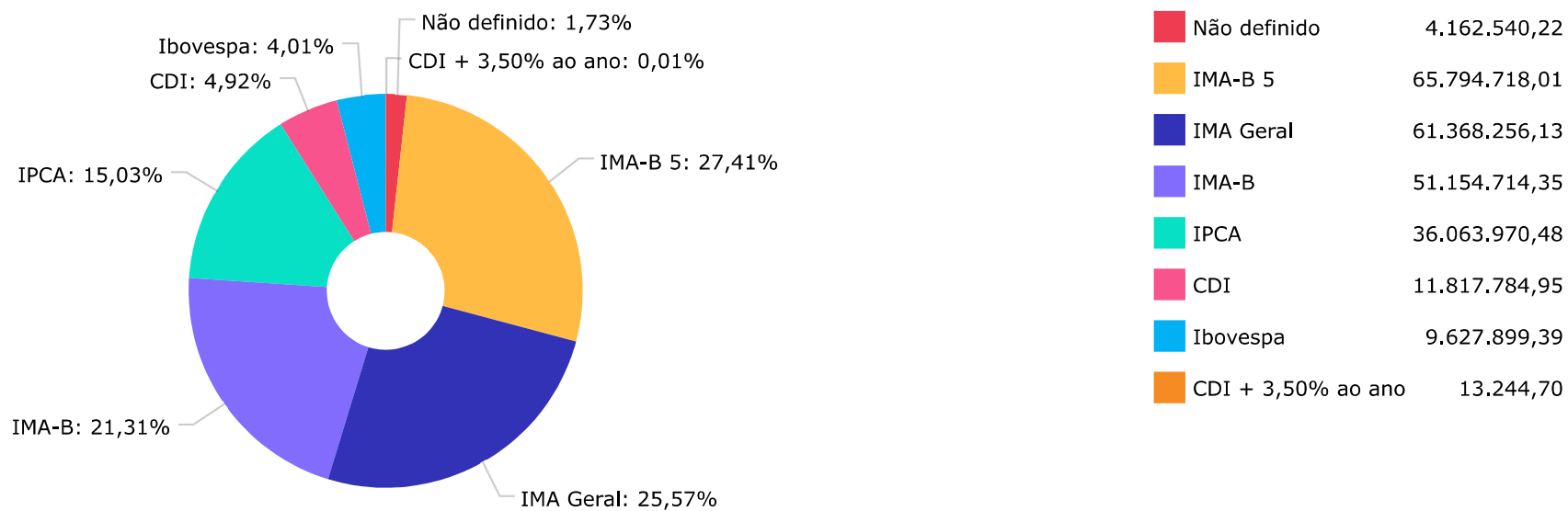
\$ 9.627.899,39 4,02%

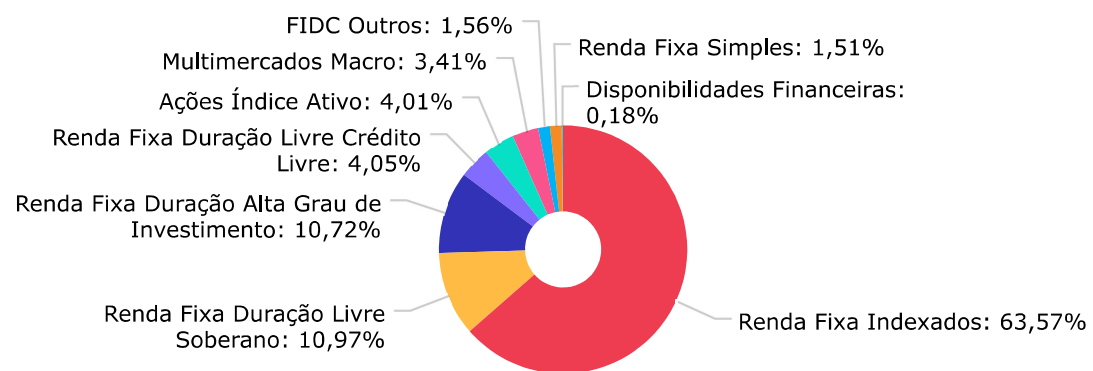
Estruturados

\$ 8.193.130,95 3,42%

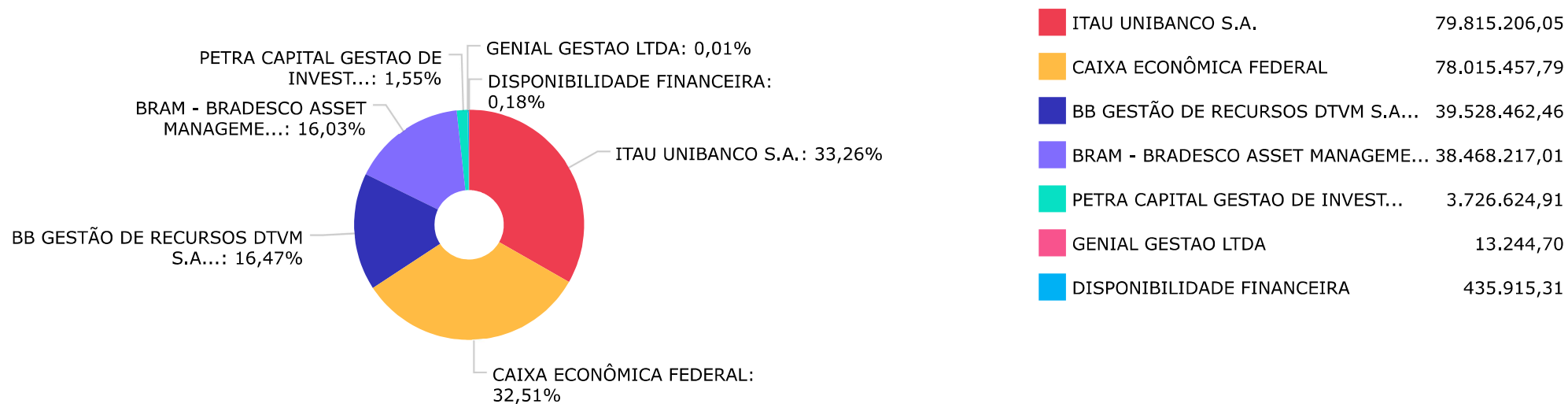
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
NÃO DEFINIDO (BENCHMARK)								
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,16	-0,33	-0,63	-1,52	-5,76	-10,02	0,01	0,01
CDI (BENCHMARK)								
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	0,74	1,35	2,60	2,38	3,14	8,08	0,28	0,58
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,81	1,57	2,34	3,92	5,70	7,91	0,04	0,08
CDI + 3,50% AO ANO (BENCHMARK)								
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1,96	4,07	-4,17	-38,75	-50,87	3,07		
IBOVESPA (BENCHMARK)								
ITAÚ OLIMPO FIC AÇÕES	1,16	7,33	7,02	-13,35	-9,14	-3,88	6,24	13,15
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	-1,95	4,70	6,80	-12,25	-8,58	-5,36	6,08	12,81
IMA GERAL (BENCHMARK)								
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,53	-0,22	-0,01	0,64	0,71	3,60	1,76	3,71
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	1,05	1,15	1,93	4,17	6,11	12,49	1,06	2,23
IMA-B (BENCHMARK)								
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,53	-0,23	-0,03	0,61	0,65	3,48	1,78	3,74
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,53	-0,24	-0,04	0,58	0,65	3,56	1,77	3,73
IMA-B 5 (BENCHMARK)								
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,05	1,14	1,92	4,15	6,07	12,36	1,06	2,24
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,05	1,13	1,90	4,10	6,00	12,29	1,07	2,25
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	1,04	1,12	1,90	4,06	5,68	11,70	1,07	2,26

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IPCA (BENCHMARK)	1,01	1,56	2,30	5,77	10,54	16,29		
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,81	1,48	2,32	2,92	1,86	6,59	0,35	0,73
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,93	1,46	2,33	4,51	5,85	8,44	0,45	0,96

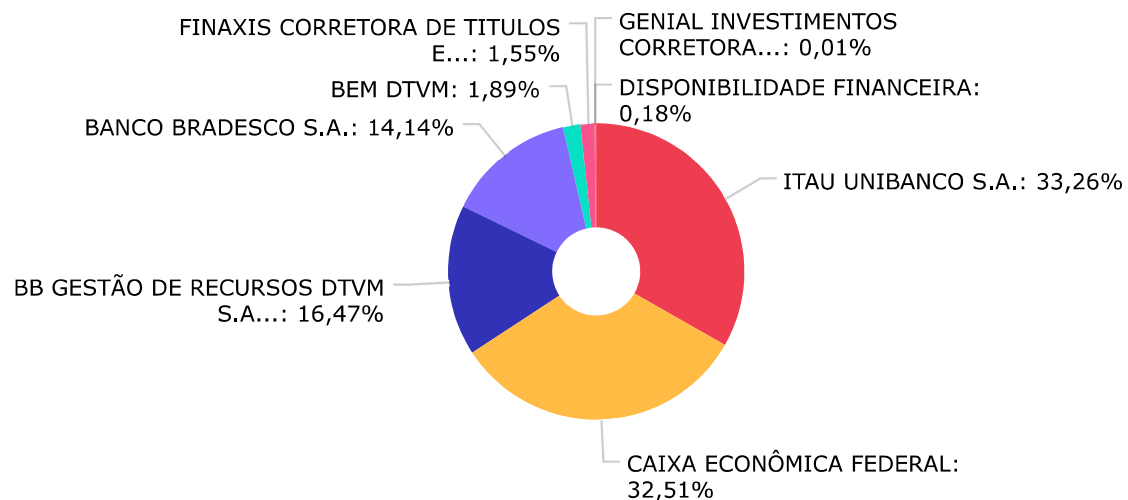




Renda Fixa Indexados	152.577.560,80
Renda Fixa Duração Livre Soberano	26.334.615,58
Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento	25.740.127,69
Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre	9.729.354,90
Ações Índice Ativo	9.627.899,39
Multimercados Macro	8.193.130,95
FIDC Outros	3.739.869,61
Renda Fixa Simples	3.624.654,00
Disponibilidades Financeiras	435.915,31

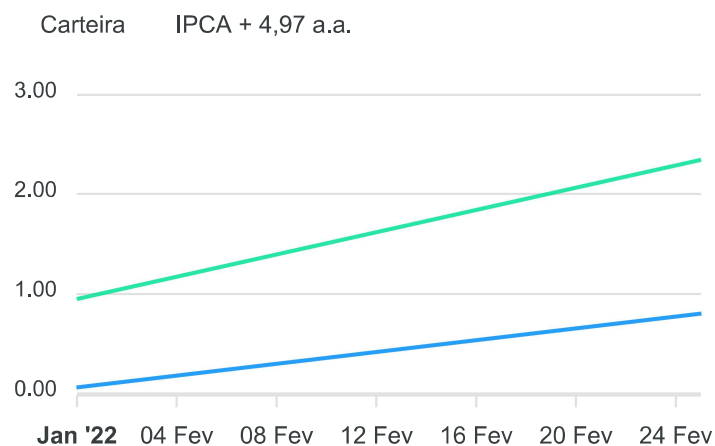
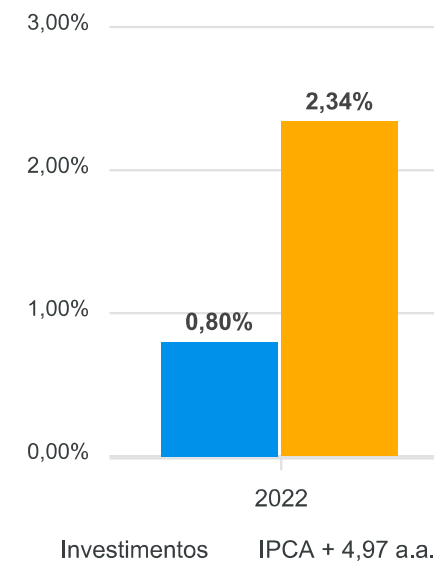


ITAU UNIBANCO S.A.	79.815.206,05
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	78.015.457,79
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	39.528.462,46
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEME...	38.468.217,01
PETRA CAPITAL GESTAO DE INVEST...	3.726.624,91
GENIAL GESTAO LTDA	13.244,70
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	435.915,31



ITAU UNIBANCO S.A.	79.815.206,05
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	78.015.457,79
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	39.528.462,46
BANCO BRADESCO S.A.	33.933.258,64
BEM DTVM	4.534.958,37
FINAXIS CORRETORA DE TITULOS E...	3.726.624,91
GENIAL INVESTIMENTOS CORRETORA...	13.244,70
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	435.915,31

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Meta %	Risco - VaR
Janeiro	238.010.289,94	9.611.734,61	9.434.958,23	237.984.707,19	151.193,63	0,06% ▲	0,95%	1,61%
Fevereiro	237.984.707,19	500.000,00	323.194,90	239.567.212,92	1.759.310,83	0,74% ▲	1,38%	1,36%
				Acumulado	1.910.504,46	0,80% ▲	2,34%	



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	21.949.773,91	59.697,58	0,00	22.240.961,25	231.489,76	1,05% ▲	1,07%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	17.195.749,43	0,00	0,00	17.287.501,21	91.751,78	0,53% ▲	1,77%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	25.474.635,24	0,00	0,00	25.740.127,69	265.492,45	1,04% ▲	1,07%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	26.124.122,01	0,00	0,00	26.334.615,58	210.493,57	0,81% ▲	0,35%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	17.628.368,23	0,00	0,00	17.813.629,07	185.260,84	1,05% ▲	1,06%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	33.689.655,39	0,00	0,00	33.867.213,14	177.557,75	0,53% ▲	1,78%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	9.378.466,19	263.497,32	0,00	9.729.354,90	87.391,39	0,91% ▲	0,45%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	25.443.494,03	0,00	0,00	25.710.729,25	267.235,22	1,05% ▲	1,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	35.966.637,07	0,00	500.000,00	35.657.526,88	190.889,81	0,53% ▲	1,76%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	3.595.487,08	0,00	0,00	3.624.654,00	29.166,92	0,81% ▲	0,04%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	12.989,62	0,00	0,00	13.244,70	255,08	1,96% ▲	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	3.732.764,55	0,00	0,00	3.726.624,91	-6.139,64	-0,16% ▼	0,01%
	220.192.142,75	323.194,90	500.000,00	221.746.182,58	1.730.844,93	0,79%	1,19%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	4.624.916,76	0,00	0,00	4.534.958,37	-89.958,39	-1,95% ▼	6,08%
ITAÚ OLIMPO FIC AÇÕES	5.034.744,93	0,00	0,00	5.092.941,02	58.196,09	1,16% ▲	6,24%
	9.659.661,69	0,00	0,00	9.627.899,39	-31.762,30	-0,33%	6,16%