

2022

Relatório Mensal

Janeiro

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
TÍTULOS PÚBLICOS	3.120.247,84	5,00%	0,00		7º I a
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	608.363,75	0,98%	7.461.201.984,89	0,01%	7º I b
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.459.455,37	3,94%	9.258.989.052,65	0,03%	7º I b
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.096.701,35	4,96%	954.093.578,76	0,32%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.784.034,88	4,46%	6.778.952.571,30	0,04%	7º I b
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.401.335,07	2,25%	4.743.847.539,71	0,03%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	712.905,48	1,14%	590.843.362,96	0,12%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.998.803,03	3,20%	911.505.616,42	0,22%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.128.015,77	1,81%	11.686.800.915,89	0,01%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.368.431,14	8,61%	12.040.160.059,77	0,04%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	331.772,29	0,53%	1.205.162.298,95	0,03%	7º I b
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	1.731.425,25	2,78%	992.957.009,73	0,17%	7º I b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	293.150,19	0,47%	3.101.943.229,29	0,01%	7º III a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	929.158,15	1,49%	7.223.462.787,00	0,01%	7º III a
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	6.951.261,11	11,14%	1.144.155.045,62	0,61%	7º III a
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	5.139.740,30	8,24%	2.422.224.309,42	0,21%	7º III a
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	938.638,02	1,50%	1.900.035.039,47	0,05%	8º I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.802.850,76	2,89%	1.143.503.101,80	0,16%	8º I
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	2.127.788,76	3,41%	1.044.534.082,51	0,20%	8º I
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	1.019.362,79	1,63%	439.322.901,59	0,23%	8º I
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	348.881,78	0,56%	880.765.225,69	0,04%	8º I
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	1.304.310,59	2,09%	1.385.056.471,22	0,09%	8º I
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	6.632.656,02	10,63%	610.620.642,63	1,09%	8º I
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.258.047,65	2,02%	922.999.669,02	0,14%	8º I
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	1.244.201,74	1,99%	667.174.224,22	0,19%	8º I
GERAÇÃO FI AÇÕES	517.911,67	0,83%	263.444.381,80	0,20%	8º I
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	191.605,99	0,31%	1.063.688.808,08	0,02%	8º I

Investimentos

\$ 62.373.218,56

Disponibilidades Financeiras

\$ 65.528,97

Total Carteira

\$ 62.438.747,53

Governança (Pró Gestão)

 Não possui

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
SANTANDER PETROBRAS 2 FIC AÇÕES	190.317,67	0,31%	120.429.284,92	0,16%	8º I
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.025.800,36	1,64%	1.260.558.701,28	0,08%	9º III
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	745.923,87	1,20%	677.797.398,12	0,11%	9º III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.840.562,80	6,16%	3.479.303.240,79	0,11%	9º III
SANTANDER MASTER FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.129.557,12	1,81%	4.086.347.092,15	0,03%	NE

Investimentos

\$ 62.373.218,56

Disponibilidades Financeiras

\$ 65.528,97

Total Carteira

\$ 62.438.747,53

Governança (Pró Gestão)


 Não possui

Título	Data Compra	Marcacao	Qtde	PU	Valor \$
NTN-B - 15/08/2050	05/11/2021	Curva - Taxa: 5,2400%	240	4.330,510169	1.039.322,44
NTN-B - 15/08/2040	09/11/2021	Curva - Taxa: 5,2800%	250	4.225,154362	1.056.288,59
NTN-B - 15/08/2030	09/11/2021	Curva - Taxa: 5,2500%	250	4.098,547259	1.024.636,81
NTN-B - 15/08/2040	01/04/2022	Curva - Taxa: 5,4900%	240	4.129,971967	991.193,27
NTN-B - 15/05/2045	01/04/2022	Curva - Taxa: 5,6000%	25	4.049,371335	101.234,28
NTN-B - 15/05/2045	01/04/2022	Curva - Taxa: 5,6000%	200	4.049,371335	809.874,27
NTN-B - 15/08/2050	01/04/2022	Curva - Taxa: 5,6000%	240	4.124,662943	989.919,11


Investimentos

 62.373.218,56

Disponibilidades Financeiras

 65.528,97

Total Carteira

 62.438.747,53

Governança (Pró Gestão)

 Não possui

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre	Política de Investimentos			GAP Superior		
				Inferior %	Alvo %	Superior %			
7° I a - Títulos TN SELIC	100,00%	5,00%	3.120.247,84	95,00%	59.318.499,69	0,00%	5,00%	100,00%	59.318.499,69
7° I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	34,63%	21.621.243,38	65,37%	40.817.504,15	0,00%	30,00%	100,00%	40.817.504,15
7° III a - FI Referenciados RF	60,00%	21,32%	13.313.309,75	38,68%	24.149.938,77	0,00%	25,00%	60,00%	24.149.938,77
8° I - Fundos de Ações	30,00%	28,15%	17.576.573,44	1,85%	1.155.050,82	0,00%	29,00%	30,00%	1.155.050,82
9° III - Ações - BDR Nível I	10,00%	8,99%	5.612.287,03	1,01%	631.587,72	0,00%	10,00%	10,00%	631.587,72
10° I - Fundos Multimercados	10,00%	0,00%	0,00	10,00%	6.243.874,75	0,00%	1,00%	10,00%	6.243.874,75
Não Enquadrado	0,00%	1,81%	1.129.557,12	-1,81%	-1.129.557,12	0,00%	0,00%	0,00%	-1.129.557,12

Governança (Pró Gestão)

 Não possui

Renda Fixa

\$ 39.184.358,09 62,76%

Renda Variável

\$ 17.576.573,44 28,15%

Exterior

\$ 5.612.287,03 8,99%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
NÃO DEFINIDO (BENCHMARK)								
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-9,75	-9,75	-9,03	3,11	11,35	71,14	10,47	22,04
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,01	0,01	3,16	3,11	4,47	12,51	1,06	2,23
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,04	0,04	2,70	0,57	0,19	4,20	1,02	2,16
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	6,70	6,70	8,41	-9,80	-2,87	-2,40	9,12	19,21
CDI (BENCHMARK)								
	0,73	0,73	2,10	3,47	5,00	7,67		
SANTANDER MASTER FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,72	0,72	2,03	3,42	4,89	6,40	0,02	0,05
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,78	0,78	2,23	3,66	5,27	7,60	0,02	0,05
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,65	0,65	1,84	2,91	3,86	5,35	0,00	0,01
GLOBAL BDRX (BENCHMARK)								
	-9,83	-9,83	-8,91	3,38	13,57	74,33		
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-10,62	-10,62	-9,28	3,95	12,50	68,78	10,14	21,36
IBOVESPA (BENCHMARK)								
	6,98	6,98	8,35	-7,93	-2,54	-1,42		
SANTANDER PETROBRAS 2 FIC AÇÕES	14,68	14,68	39,83	47,84	52,18	35,18	15,82	33,32
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	9,48	9,48	10,23	-8,18	-4,17	-6,79	8,76	18,44
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-7,58	-7,58	-10,88	-23,24	-16,77	-5,14	12,36	26,02
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	6,87	6,87	5,50	-11,03	-9,08	-21,38	9,11	19,18
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	6,93	6,93	8,30	-8,03	-2,79	-1,80	8,49	17,89
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3,68	3,68	6,98	-3,28	4,59	6,18	6,86	14,45
GERAÇÃO FI AÇÕES	5,48	5,48	4,70	-11,36	-8,83	-9,94	8,01	16,86
IBX (BENCHMARK)								
	6,87	6,87	8,36	-9,14	-2,11	-0,51		
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	2,64	2,64	0,83	-14,35	-5,47	-15,82	9,39	19,78
BRANCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	3,96	3,96	4,59	-14,52	-3,69	-9,51	14,13	29,76

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IDIV (BENCHMARK)	7,47	7,47	10,17	0,27	5,96	1,18		
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	8,81	8,81	9,74	-3,09	1,19	-1,16	7,87	16,58
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	6,92	6,92	10,54	-2,98	2,10	-5,22	8,30	17,48
IMA-B (BENCHMARK)	-0,73	-0,73	2,94	-0,91	-1,15	4,02		
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	-0,76	-0,76	2,87	-1,03	-1,41	3,20	2,01	4,23
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,76	-0,76	2,84	-1,05	-1,38	3,43	2,05	4,32
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,77	-0,77	2,85	-1,09	-1,42	3,46	2,02	4,25
IMA-B 5 (BENCHMARK)	0,11	0,11	3,42	3,33	4,57	12,47		
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,09	0,09	3,35	3,20	4,32	11,89	0,99	2,08
IMA-B 5+ (BENCHMARK)	-1,61	-1,61	2,45	-4,92	-6,47	-3,03		
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,63	-1,63	2,40	-5,08	-6,71	-3,70	3,36	7,09
IPCA (BENCHMARK)	0,54	0,54	2,24	5,63	10,38	15,41		
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,24	0,24	2,49	1,09	0,67	4,30	0,70	1,47
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,67	0,67	2,42	0,62	0,53	6,39	0,36	0,76
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO								
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,39	0,39	3,10	3,83	5,71	12,72	0,80	1,69
IRF-M (BENCHMARK)	-0,08	-0,08	3,63	-0,03	-1,28	3,58		
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,13	-0,13	3,58	-0,22	-1,62	2,96	1,67	3,52
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,07	-0,07	3,64	-0,11	-1,50	3,17	1,65	3,49
SMLL (BENCHMARK)	3,42	3,42	4,89	-17,43	-10,25	-14,29		
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	4,33	4,33	5,26	-18,84	-12,25	-21,46	16,10	33,92

Mês

Ano

3M

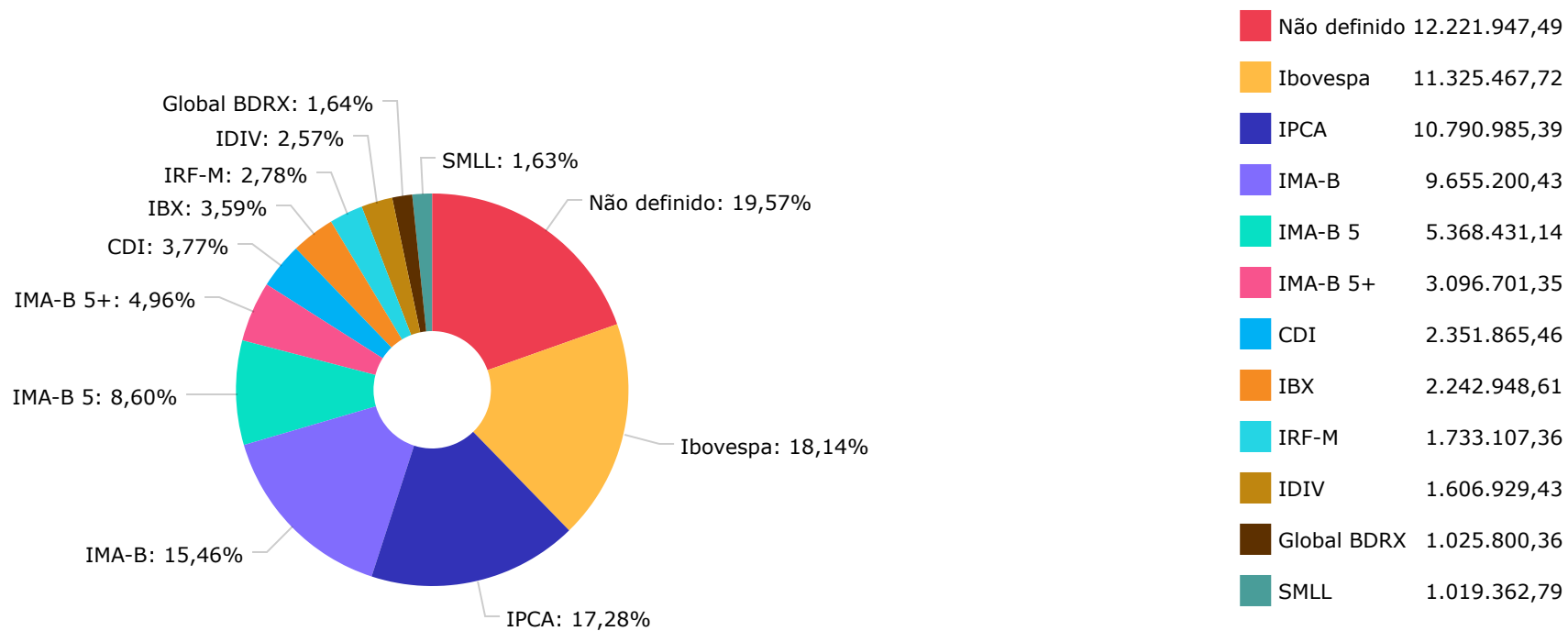
6M

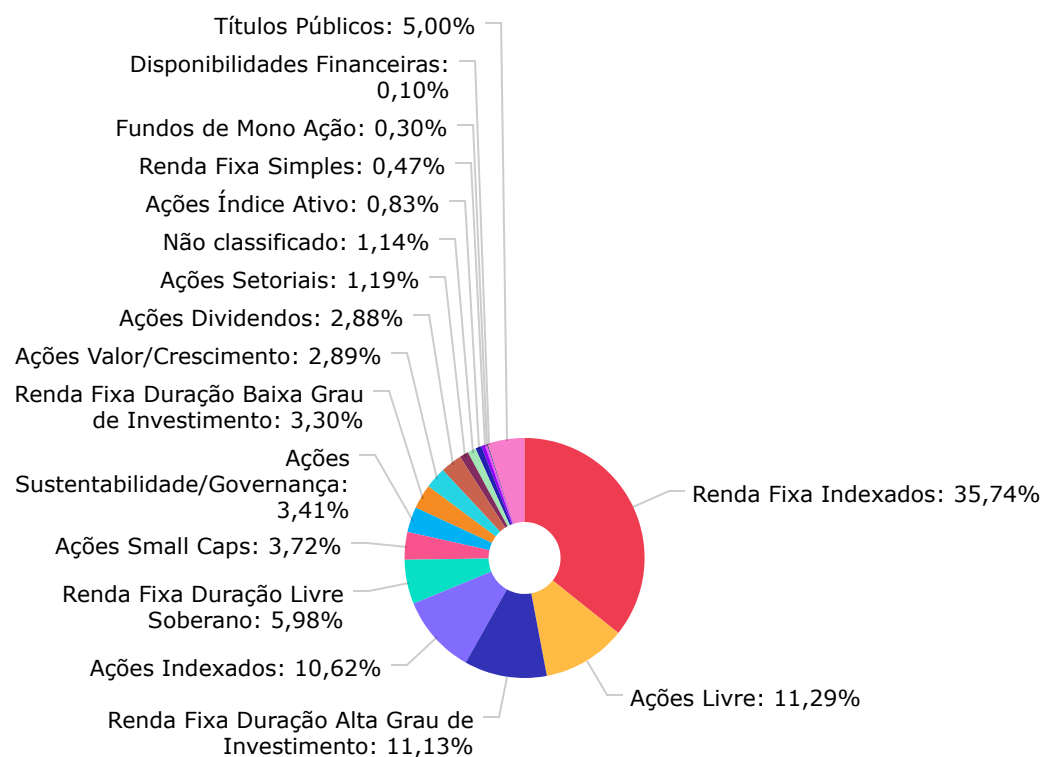
12M

24M

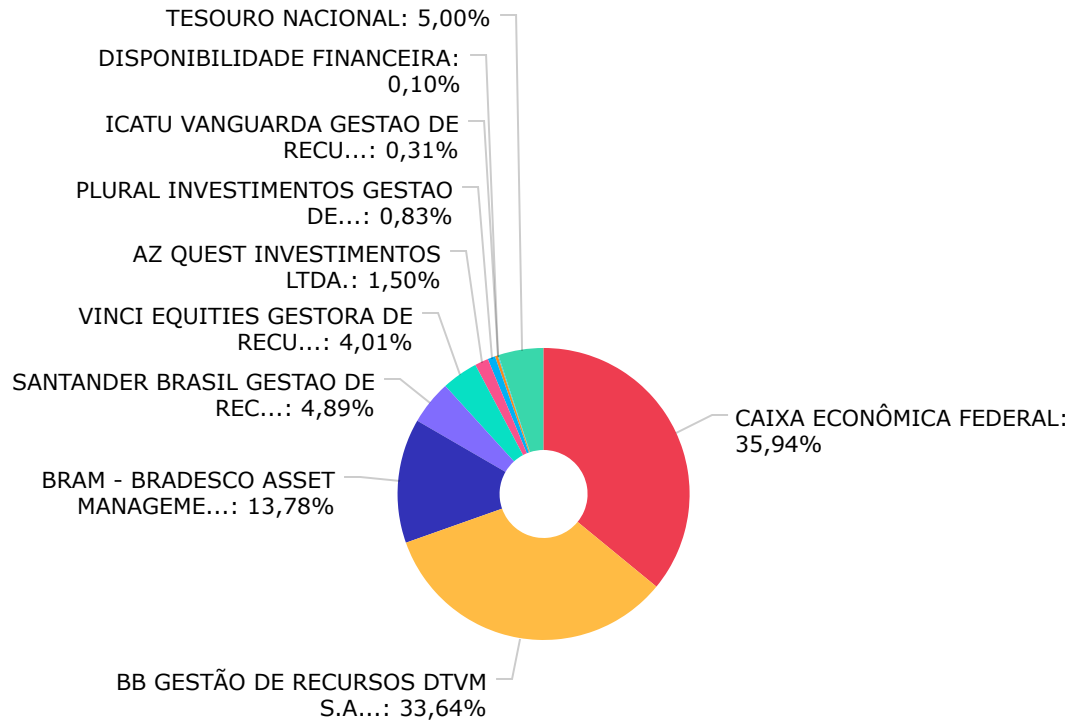
VaR - Mês

Volatilidade - Mês

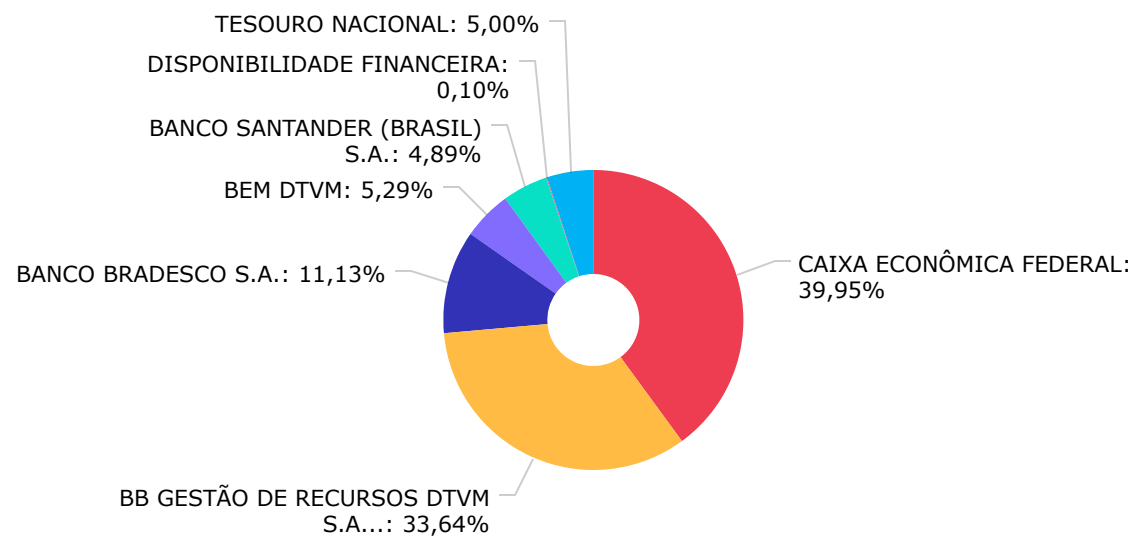




Renda Fixa Indexados	22.312.895,65
Ações Livre	7.049.202,92
Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento	6.951.261,11
Ações Indexados	6.632.656,02
Renda Fixa Duração Livre Soberano	3.735.182,55
Ações Small Caps	2.323.673,38
Ações Sustentabilidade/Governança	2.127.788,76
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	2.058.715,27
Ações Valor/Crescimento	1.802.850,76
Ações Dividendos	1.798.535,42
Ações Setoriais	745.923,87
Não classificado	712.905,48
Ações Índice Ativo	517.911,67
Renda Fixa Simples	293.150,19
Fundos de Mono Ação	190.317,67
Disponibilidades Financeiras	65.528,97
Títulos Públicos	3.120.247,84



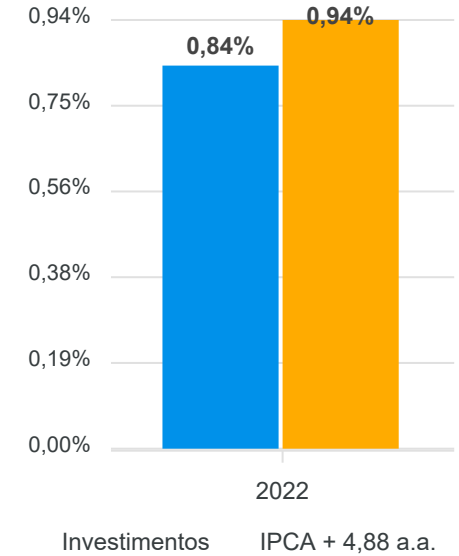
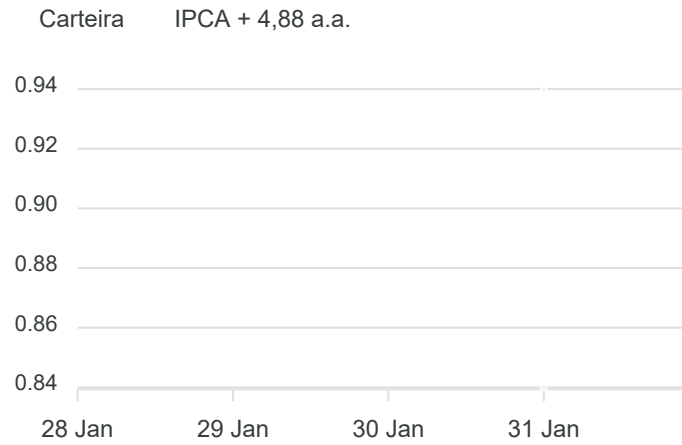
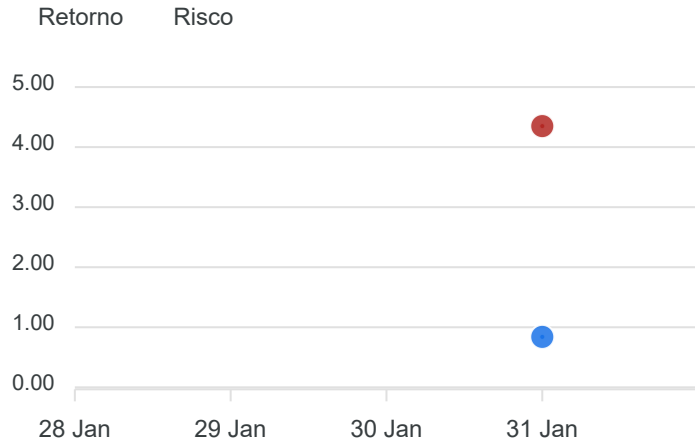
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	22.441.178,32
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	21.005.633,81
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMEM...	8.604.453,48
SANTANDER BRASIL GESTAO DE REC...	3.051.300,04
VINCI EQUITIES GESTORA DE RECU...	2.502.249,39
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	938.638,02
PLURAL INVESTIMENTOS GESTAO DE...	517.911,67
ICATU VANGUARDA GESTAO DE RECU...	191.605,99
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	65.528,97
TESOURO NACIONAL	3.120.247,84



CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	24.943.427,71
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	21.005.633,81
BANCO BRADESCO S.A.	6.951.261,11
BEM DTVM	3.301.348,05
BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	3.051.300,04
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	65.528,97
TESOURO NACIONAL	3.120.247,84

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Meta %	Risco - VaR
Janeiro	62.114.937,77	8.554.304,33	8.815.127,90	62.373.218,56	519.104,36	0,84% ▲	0,94%	4,35%

Acumulado 519.104,36 0,84% ▲ 0,94%



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
TÍTULOS PÚBLICOS	3.086.329,99	0,00	0,00	3.120.247,84	33.917,85	1,10% ▲	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.609.482,11	0,00	4.000.000,00	608.363,75	-1.118,36	-0,02% ▼	1,02%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.598.744,82	0,00	1.315.127,90	293.150,19	9.533,27	0,60% ▲	0,00%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	461.442,71	2.000.000,00	0,00	2.459.455,37	-1.987,34	-0,08% ▼	1,06%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.109.195,97	2.000.000,00	0,00	3.096.701,35	-12.494,62	-0,40% ▼	3,36%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.805.578,56	0,00	0,00	2.784.034,88	-21.543,68	-0,77% ▼	2,02%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.403.120,92	0,00	0,00	1.401.335,07	-1.785,85	-0,13% ▼	1,67%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.914.862,88	0,00	1.000.000,00	929.158,15	14.295,27	0,75% ▲	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	710.169,04	0,00	0,00	712.905,48	2.736,44	0,39% ▲	0,80%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	6.934.776,62	0,00	0,00	6.951.261,11	16.484,49	0,24% ▲	0,70%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.603.745,17	0,00	2.500.000,00	1.128.015,77	24.270,60	0,67% ▲	0,36%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.314.989,45	2.054.304,33	0,00	5.368.431,14	-862,64	-0,02% ▼	0,99%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	332.010,66	0,00	0,00	331.772,29	-238,37	-0,07% ▼	1,65%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	5.179.279,92	0,00	0,00	5.139.740,30	-39.539,62	-0,76% ▼	2,05%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	1.744.628,69	0,00	0,00	1.731.425,25	-13.203,44	-0,76% ▼	2,01%
SANTANDER MASTER FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.121.459,67	0,00	0,00	1.129.557,12	8.097,45	0,72% ▲	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	2.000.000,00	0,00	1.998.803,03	-1.196,97	-0,06% ▼	-
	39.929.817,18	8.054.304,33	8.815.127,90	39.184.358,09	15.364,48	0,04%	1,27%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	914.501,33	0,00	0,00	938.638,02	24.136,69	2,64% ▲	9,39%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.738.790,11	0,00	0,00	1.802.850,76	64.060,65	3,68% ▲	6,86%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.994.249,85	0,00	0,00	2.127.788,76	133.538,91	6,70% ▲	9,12%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	977.045,32	0,00	0,00	1.019.362,79	42.317,47	4,33% ▲	16,10%
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	326.303,60	0,00	0,00	348.881,78	22.578,18	6,92% ▲	8,30%
BRADERCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	1.254.601,93	0,00	0,00	1.304.310,59	49.708,66	3,96% ▲	14,13%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	6.202.872,43	0,00	0,00	6.632.656,02	429.783,59	6,93% ▲	8,49%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.156.167,12	0,00	0,00	1.258.047,65	101.880,53	8,81% ▲	7,87%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	1.136.499,17	0,00	0,00	1.244.201,74	107.702,57	9,48% ▲	8,76%
GERAÇÃO FI AÇÕES	491.016,70	0,00	0,00	517.911,67	26.894,97	5,48% ▲	8,01%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	179.288,69	0,00	0,00	191.605,99	12.317,30	6,87% ▲	9,11%
SANTANDER PETROBRAS 2 FIC AÇÕES	165.953,72	0,00	0,00	190.317,67	24.363,95	14,68% ▲	15,82%
	16.537.289,97	0,00	0,00	17.576.573,44	1.039.283,47	6,28%	9,35%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.147.647,94	0,00	0,00	1.025.800,36	-121.847,58	-10,62% ▼	10,14%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	807.070,18	0,00	0,00	745.923,87	-61.146,31	-7,58% ▼	12,36%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.693.112,50	500.000,00	0,00	3.840.562,80	-352.549,70	-8,41% ▼	10,47%
	5.647.830,62	500.000,00	0,00	5.612.287,03	-535.543,59	-8,71%	3,50%