

2022

Relatório Mensal

Fevereiro

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	3.070.260,55	4,93%	0,00		7º I a
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	612.111,35	0,98%	6.887.287.977,51	0,01%	7º I b
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.487.903,47	4,00%	9.012.864.987,26	0,03%	7º I b
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.096.054,75	4,97%	936.801.809,27	0,33%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.798.889,72	4,50%	6.297.272.157,92	0,04%	7º I b
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.409.293,25	2,26%	4.398.251.592,64	0,03%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	700.946,71	1,13%	580.932.851,15	0,12%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.963.155,71	3,15%	895.249.518,55	0,22%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.137.104,69	1,83%	10.665.837.627,38	0,01%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.424.849,30	8,72%	11.612.568.005,11	0,05%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	333.734,77	0,54%	962.262.156,33	0,03%	7º I b
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	1.740.557,96	2,80%	880.760.697,37	0,20%	7º I b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	504.176,82	0,81%	3.177.445.522,66	0,02%	7º III a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	936.575,78	1,50%	7.639.104.845,31	0,01%	7º III a
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	6.997.889,99	11,24%	1.140.836.229,00	0,61%	7º III a
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	5.164.559,83	8,30%	2.339.591.507,81	0,22%	7º III a
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	924.807,46	1,49%	1.968.091.527,75	0,05%	8º I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.796.244,92	2,89%	1.135.333.998,55	0,16%	8º I
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	2.144.851,29	3,45%	1.039.411.814,62	0,21%	8º I
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	962.896,55	1,55%	406.145.027,99	0,24%	8º I
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	353.457,67	0,57%	791.471.969,13	0,04%	8º I
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	1.285.569,17	2,07%	1.330.917.641,81	0,10%	8º I
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	6.688.677,42	10,75%	563.109.784,87	1,19%	8º I
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.249.173,34	2,01%	982.856.679,21	0,13%	8º I
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	1.256.227,01	2,02%	737.787.983,23	0,17%	8º I
GERAÇÃO FI AÇÕES	518.075,65	0,83%	262.289.613,72	0,20%	8º I
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	193.016,23	0,31%	1.024.930.838,04	0,02%	8º I

Investimentos

\$ 62.246.769,53

Disponibilidades Financeiras

\$ 96.705,47

Total Carteira

\$ 62.343.475,00


Governança (Pró Gestão)
 Não possui

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
SANTANDER PETROBRAS 2 FIC AÇÕES	195.956,54	0,31%	119.556.225,09	0,16%	8º I
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	966.060,14	1,55%	1.110.111.462,43	0,09%	9º III
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	698.672,34	1,12%	593.209.756,84	0,12%	9º III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.567.236,72	5,73%	2.975.370.153,41	0,12%	9º III
SANTANDER MASTER FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.067.782,43	1,72%	4.027.834.874,71	0,03%	NE

Investimentos

 62.246.769,53

Disponibilidades Financeiras

 96.705,47

Total Carteira

 62.343.475,00

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	4.264,146831	1.023.395,24
NTN-B - 15/08/2040	09/11/2021	Curva - Taxa: 5,2800%	250	4.157,767311	1.039.441,83
NTN-B - 15/08/2030	09/11/2021	Curva - Taxa: 5,2500%	250	4.029,694008	1.007.423,50
NTN-B - 15/08/2040	01/04/2022	Curva - Taxa: 5,4900%	240	4.062,171543	974.921,17
NTN-B - 15/05/2045	01/04/2022	Curva - Taxa: 5,6000%	25	4.094,323804	102.358,10
NTN-B - 15/05/2045	01/04/2022	Curva - Taxa: 5,6000%	200	4.094,323804	818.864,76
NTN-B - 15/08/2050	01/04/2022	Curva - Taxa: 5,6000%	240	4.057,127901	973.710,70

Investimentos

\$ 62.246.769,53

Disponibilidades Financeiras

\$ 96.705,47

Total Carteira

\$ 62.343.475,00

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%	4,92%	3.070.260,55	95,08%	59.273.214,45	0,00%	5,00%	100,00%	59.273.214,45
7° I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	34,81%	21.704.601,68	65,19%	40.638.873,32	0,00%	30,00%	100,00%	40.638.873,32
7° III a - FI Referenciados RF	60,00%	21,82%	13.603.202,42	38,18%	23.802.882,58	0,00%	25,00%	60,00%	23.802.882,58
8° I - Fundos de Ações	30,00%	28,18%	17.568.953,25	1,82%	1.134.089,25	0,00%	29,00%	30,00%	1.134.089,25
9° III - Ações - BDR Nível I	10,00%	8,39%	5.231.969,20	1,61%	1.002.378,30	0,00%	10,00%	10,00%	1.002.378,30
10° I - Fundos Multimercados	10,00%	0,00%	0,00	10,00%	6.234.347,50	0,00%	1,00%	10,00%	6.234.347,50
Não Enquadrado	0,00%	1,71%	1.067.782,43	-1,71%	-1.067.782,43	0,00%	0,00%	0,00%	-1.067.782,43

Governança (Pró Gestão)

 Não possui

Renda Fixa

\$ 39.445.847,08 63,27%

Renda Variável

\$ 17.568.953,25 28,18%

Exterior

\$ 5.231.969,20 8,39%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
NÃO DEFINIDO (BENCHMARK)								
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16	1,17	1,88	4,11	6,26	13,10	1,13	2,38
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,62	0,65	1,57	1,65	1,74	4,37	0,87	1,82
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	0,80	7,55	11,25	-6,12	1,23	6,67	6,02	12,69
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-7,12	-16,17	-14,74	-6,50	-0,12	68,54	13,05	27,49
CDI (BENCHMARK)								
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,68	1,33	2,01	3,29	4,51	5,83	0,02	0,03
SANTANDER MASTER FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,77	1,50	2,23	3,79	5,60	6,98	0,03	0,07
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,80	1,59	2,40	4,02	6,01	8,16	0,02	0,05
GLOBAL BDRX (BENCHMARK)								
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-5,82	-15,82	-13,38	-4,95	1,87	66,41	13,40	28,21
IBOVESPA (BENCHMARK)								
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	0,97	10,53	10,60	-4,55	1,20	0,98	5,44	11,47
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-6,33	-13,43	-13,54	-26,97	-22,57	-4,63	12,70	26,75
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,74	7,66	8,65	-7,65	-4,79	-14,84	5,02	10,57
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	0,84	7,83	10,92	-4,87	2,52	7,99	5,94	12,51
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-0,37	3,30	7,52	-1,86	9,72	16,21	6,03	12,69
GERAÇÃO FI AÇÕES	0,03	5,51	7,52	-8,52	-5,98	-1,36	6,03	12,69
SANTANDER PETROBRAS 2 FIC AÇÕES	2,96	18,08	32,41	42,17	93,70	55,87	15,31	32,25
IBX (BENCHMARK)								
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	-1,44	2,47	6,46	-13,36	-4,34	-3,15	7,40	15,59
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-1,47	1,13	3,47	-11,11	-7,61	-11,59	6,78	14,28

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IDIV (BENCHMARK)	-2,32	4,98	6,67	-1,56	9,19	5,34		
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	1,31	8,32	11,70	0,34	7,62	4,83	4,63	9,74
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-0,71	8,04	7,69	-2,49	5,01	4,82	5,18	10,91
IMA-B (BENCHMARK)	0,55	-0,19	0,03	0,73	0,92	4,12		
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
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	0,53	-0,23	-0,03	0,61	0,66	3,30	1,76	3,71
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	0,48	-0,28	-0,06	0,55	0,66	3,48	1,79	3,78
IMA-B 5 (BENCHMARK)	1,06	1,18	1,97	4,27	6,32	12,94		
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
IMA-B 5+ (BENCHMARK)	0,01	-1,60	-1,93	-2,75	-4,24	-3,33		
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,02	-1,65	-1,97	-2,92	-4,52	-4,01	2,67	5,62
IPCA (BENCHMARK)	1,01	1,56	2,30	5,77	10,54	16,29		
BRADERCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,67	0,91	1,70	2,28	2,32	4,59	0,61	1,28
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,81	1,48	2,32	2,92	1,86	6,59	0,35	0,73
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,06						1,33	2,80
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11	1,50	2,17	4,65	7,36	13,34	0,58	1,22
IRF-M (BENCHMARK)	0,58	0,50	2,40	1,16	0,48	3,51		
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,59	0,52	2,40	1,12	0,24	3,13	1,23	2,59
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,57	0,44	2,32	1,00	0,13	2,89	1,22	2,58
SMLL (BENCHMARK)	-5,19	-1,95	1,77	-18,60	-13,32	-11,41		
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	-5,54	-1,45	2,05	-19,38	-15,22	-18,60	8,62	18,16

Mês

Ano

3M

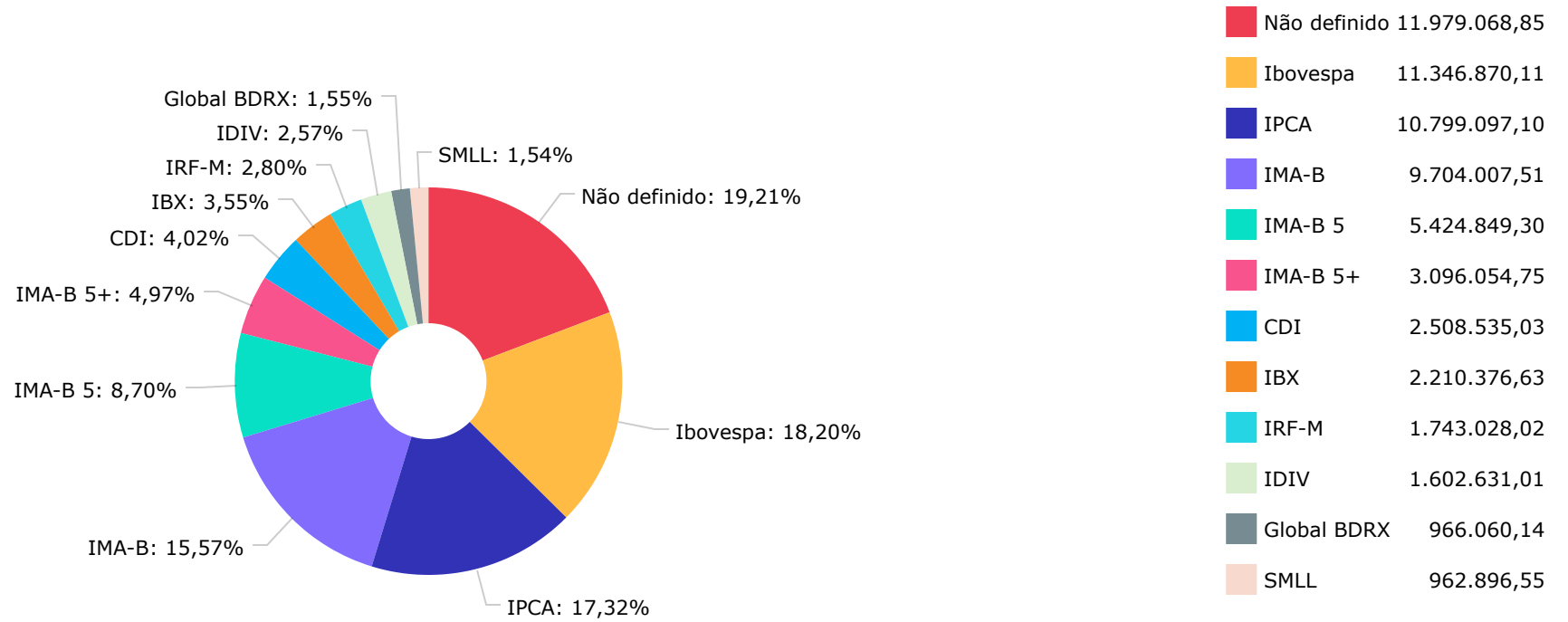
6M

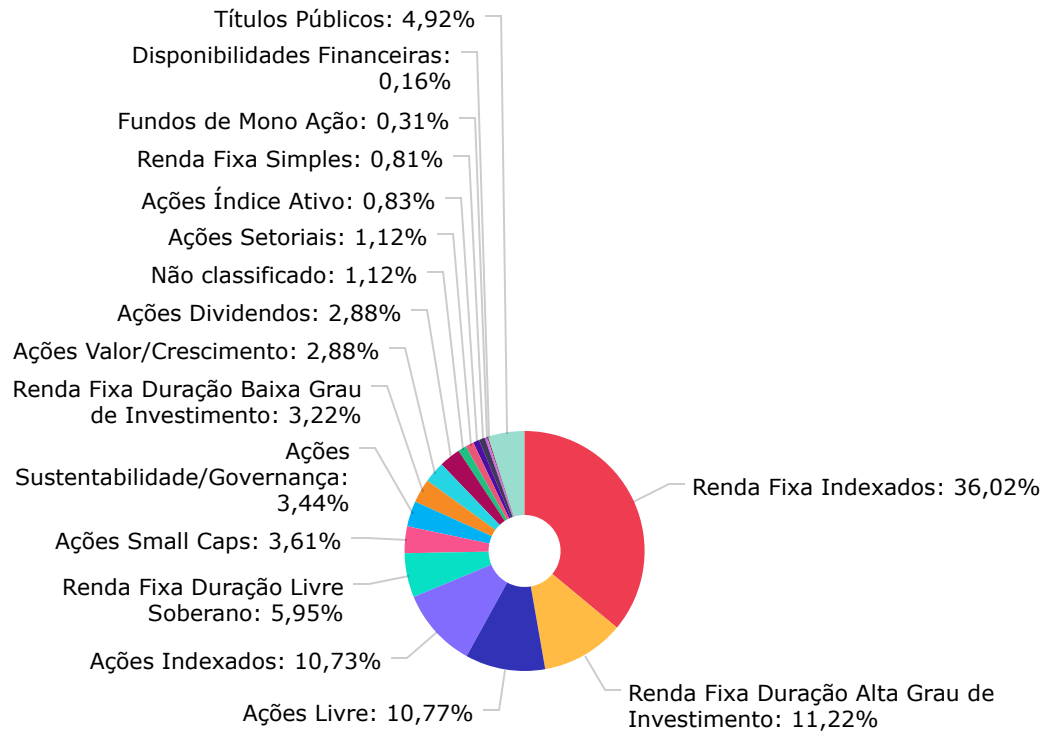
12M

24M

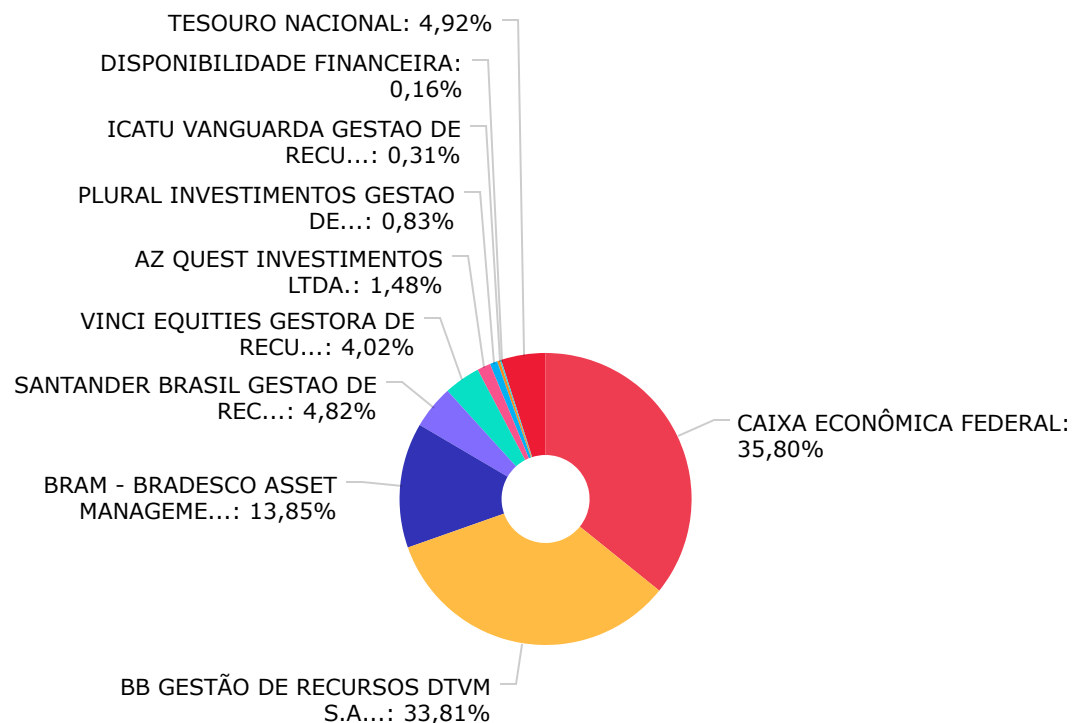
VaR - Mês

Volatilidade - Mês





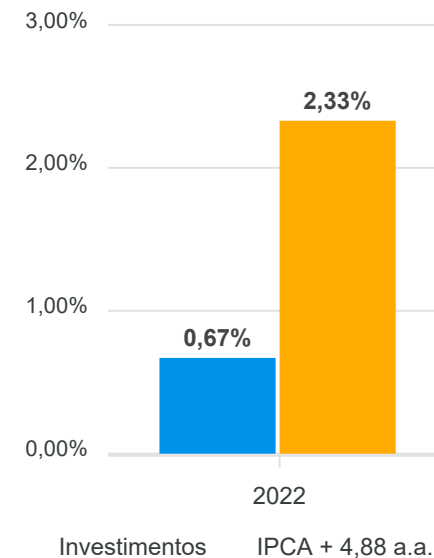
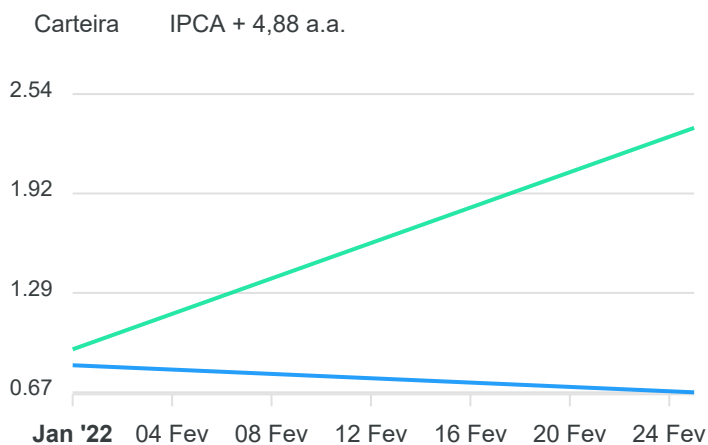
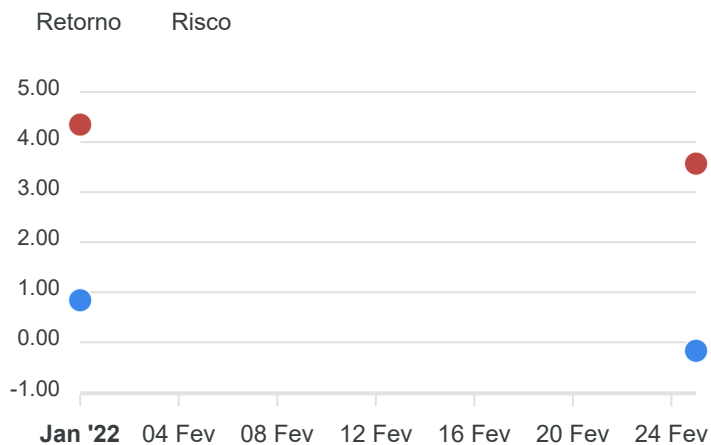
Renda Fixa Indexados	22.455.843,05
Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento	6.997.889,99
Ações Livres	6.714.331,33
Ações Indexados	6.688.677,42
Renda Fixa Duração Livre Soberano	3.712.371,75
Ações Small Caps	2.248.465,72
Ações Sustentabilidade/Governança	2.144.851,29
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	2.004.358,21
Ações Valor/Crescimento	1.796.244,92
Ações Dividendos	1.795.647,24
Não classificado	700.946,71
Ações Setoriais	698.672,34
Ações Índice Ativo	518.075,65
Renda Fixa Simples	504.176,82
Fundos de Mono Ação	195.956,54
Disponibilidades Financeiras	96.705,47
Títulos Públicos	3.070.260,55



CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	22.316.162,73
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	21.077.832,80
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMEM...	8.636.916,83
SANTANDER BRASIL GESTAO DE REC...	3.004.296,93
VINCI EQUITIES GESTORA DE RECU...	2.505.400,35
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	924.807,46
PLURAL INVESTIMENTOS GESTAO DE...	518.075,65
ICATU VANGUARDA GESTAO DE RECU...	193.016,23
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	96.705,47
TESOURO NACIONAL	3.070.260,55



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%
Fevereiro	62.373.218,56	463.775,23	486.085,73	62.246.769,53	-104.138,53	-0,17% ▼	1,37%	3,57%
Acumulado					414.965,83	0,67% ▲	2,33%	



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
TÍTULOS PÚBLICOS	3.120.247,84	0,00	83.368,75	3.070.260,55	33.381,46	1,07% ▲	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	608.363,75	0,00	0,00	612.111,35	3.747,60	0,62% ▲	0,87%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	293.150,19	463.775,23	256.334,32	504.176,82	3.585,72	0,47% ▲	0,02%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.459.455,37	0,00	0,00	2.487.903,47	28.448,10	1,16% ▲	1,13%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.096.701,35	0,00	0,00	3.096.054,75	-646,60	-0,02% ▼	2,67%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.784.034,88	0,00	0,00	2.798.889,72	14.854,84	0,53% ▲	1,77%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.401.335,07	0,00	0,00	1.409.293,25	7.958,18	0,57% ▲	1,22%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	929.158,15	0,00	0,00	936.575,78	7.417,63	0,80% ▲	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	712.905,48	0,00	19.748,00	700.946,71	7.789,23	1,09% ▲	0,58%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.998.803,03	0,00	56.634,66	1.963.155,71	20.987,34	1,05% ▲	1,33%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	6.951.261,11	0,00	0,00	6.997.889,99	46.628,88	0,67% ▲	0,61%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.128.015,77	0,00	0,00	1.137.104,69	9.088,92	0,81% ▲	0,35%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.368.431,14	0,00	0,00	5.424.849,30	56.418,16	1,05% ▲	1,06%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	331.772,29	0,00	0,00	333.734,77	1.962,48	0,59% ▲	1,23%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	5.139.740,30	0,00	0,00	5.164.559,83	24.819,53	0,48% ▲	1,79%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	1.731.425,25	0,00	0,00	1.740.557,96	9.132,71	0,53% ▲	1,76%
SANTANDER MASTER FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.129.557,12	0,00	70.000,00	1.067.782,43	8.225,31	0,73% ▲	0,03%
	39.184.358,09	463.775,23	486.085,73	39.445.847,08	283.799,49	0,72%	1,13%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	938.638,02	0,00	0,00	924.807,46	-13.830,56	-1,47% ▼	6,78%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.802.850,76	0,00	0,00	1.796.244,92	-6.605,84	-0,37% ▼	6,03%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	2.127.788,76	0,00	0,00	2.144.851,29	17.062,53	0,80% ▲	6,02%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	1.019.362,79	0,00	0,00	962.896,55	-56.466,24	-5,54% ▼	8,62%
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	348.881,78	0,00	0,00	353.457,67	4.575,89	1,31% ▲	4,63%
BRADERCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	1.304.310,59	0,00	0,00	1.285.569,17	-18.741,42	-1,44% ▼	7,40%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	6.632.656,02	0,00	0,00	6.688.677,42	56.021,40	0,84% ▲	5,94%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.258.047,65	0,00	0,00	1.249.173,34	-8.874,31	-0,71% ▼	5,18%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	1.244.201,74	0,00	0,00	1.256.227,01	12.025,27	0,97% ▲	5,44%
GERAÇÃO FI AÇÕES	517.911,67	0,00	0,00	518.075,65	163,98	0,03% ▲	6,03%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	191.605,99	0,00	0,00	193.016,23	1.410,24	0,74% ▲	5,02%
SANTANDER PETROBRAS 2 FIC AÇÕES	190.317,67	0,00	0,00	195.956,54	5.638,87	2,96% ▲	15,31%
	17.576.573,44	0,00	0,00	17.568.953,25	-7.620,19	-0,04%	6,24%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.025.800,36	0,00	0,00	966.060,14	-59.740,22	-5,82% ▼	13,40%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	745.923,87	0,00	0,00	698.672,34	-47.251,53	-6,33% ▼	12,70%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.840.562,80	0,00	0,00	3.567.236,72	-273.326,08	-7,12% ▼	13,05%
	5.612.287,03	0,00	0,00	5.231.969,20	-380.317,83	-6,78%	4,17%