

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
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.875.318,47	6,38%	6.406.714.372,41	0,04%	7º I b
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	833.468,64	1,85%	4.743.847.539,71	0,02%	7º I b
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	10.594.640,56	23,51%	591.516.478,08	1,79%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	516.469,20	1,15%	460.087.397,32	0,11%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.886.483,41	15,28%	10.879.369.499,05	0,06%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.144.771,52	4,76%	1.336.256.948,50	0,16%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	178.396,66	0,40%	848.732.387,83	0,02%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	3.213.443,82	7,13%	1.441.183.712,68	0,22%	7º I b
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	692.454,47	1,54%	25.565.411.477,43	0,00%	7º I b
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	980.838,61	2,18%	146.320.676,30	0,67%	7º III a
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	318.786,18	0,71%	3.821.913.743,91	0,01%	7º III a
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	4.858.655,83	10,78%	502.964.015,45	0,97%	7º III a
PREMIUM FIDC SÊNIOR	253.601,87	0,56%	76.764.715,33	0,33%	7º V a
ATHENA TOTAL RETURN INSTITUCIONAL II FI AÇÕES	1.205.803,64	2,68%	19.462.217,74	6,20%	8º I
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	3.677.590,06	8,16%	409.364.366,55	0,90%	8º I
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	2.746.221,96	6,09%	364.990.908,84	0,75%	8º I
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	482.489,99	1,07%	677.797.398,12	0,07%	9º III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.599.491,99	5,77%	3.479.303.240,79	0,07%	9º III

Investimentos

\$ 45.058.926,88

Disponibilidades Financeiras

\$ 157.504,61

Total Carteira

\$ 45.216.431,49

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%	0,00%	0,00	100,00%	45.058.926,88	0,00%	10,00%	10,00%	4.505.892,69
7° I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	62,00%	27.935.446,75	38,00%	17.123.480,13	0,00%	30,00%	100,00%	17.123.480,13
7° III a - FI Referenciados RF	60,00%	13,67%	6.158.280,62	46,33%	20.877.075,51	0,00%	19,00%	60,00%	20.877.075,51
7° V a - FIDC Cota Sênior	5,00%	0,56%	253.601,87	4,44%	1.999.344,47	0,00%	1,00%	15,00%	6.505.237,16
8° I - Fundos de Ações	30,00%	16,93%	7.629.615,66	13,07%	5.888.062,40	0,00%	29,00%	30,00%	5.888.062,40
9° III - Ações - BDR Nível I	10,00%	6,84%	3.081.981,98	3,16%	1.423.910,71	0,00%	10,00%	10,00%	1.423.910,71
10° I - Fundos Multimercados	10,00%	0,00%	0,00	10,00%	4.505.892,69	0,00%	1,00%	10,00%	4.505.892,69

Governança (Pró Gestão)

📄 Não possui

Renda Fixa

\$ 34.347.329,24 76,23%

Renda Variável

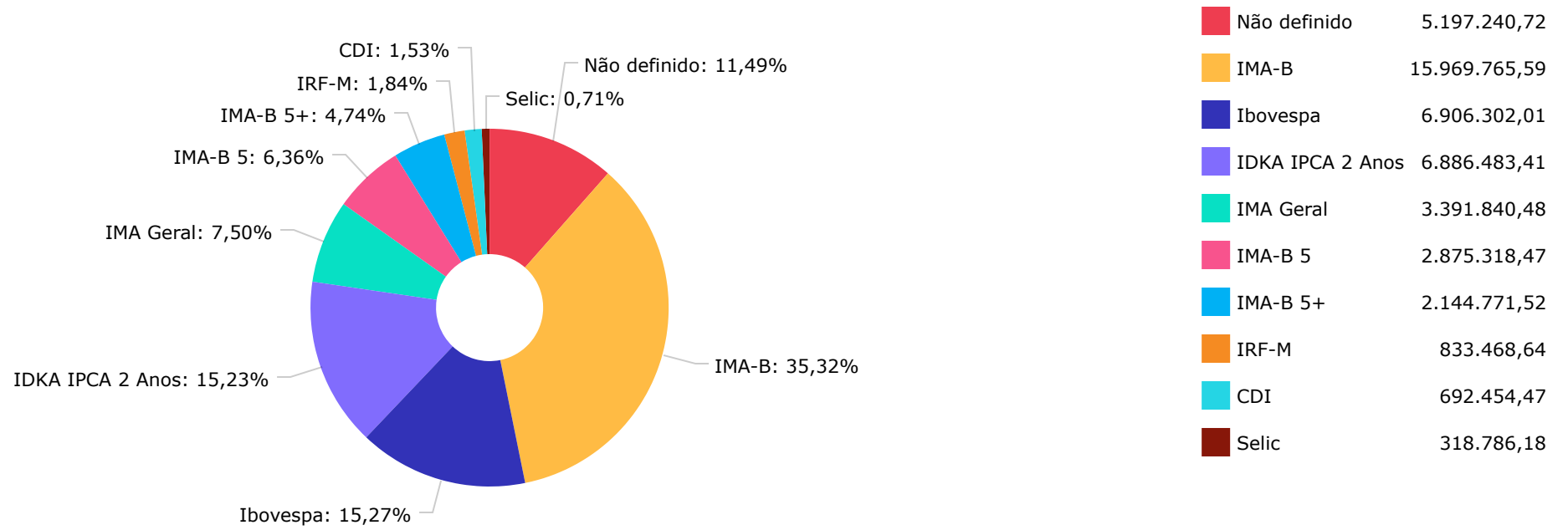
\$ 7.629.615,66 16,93%

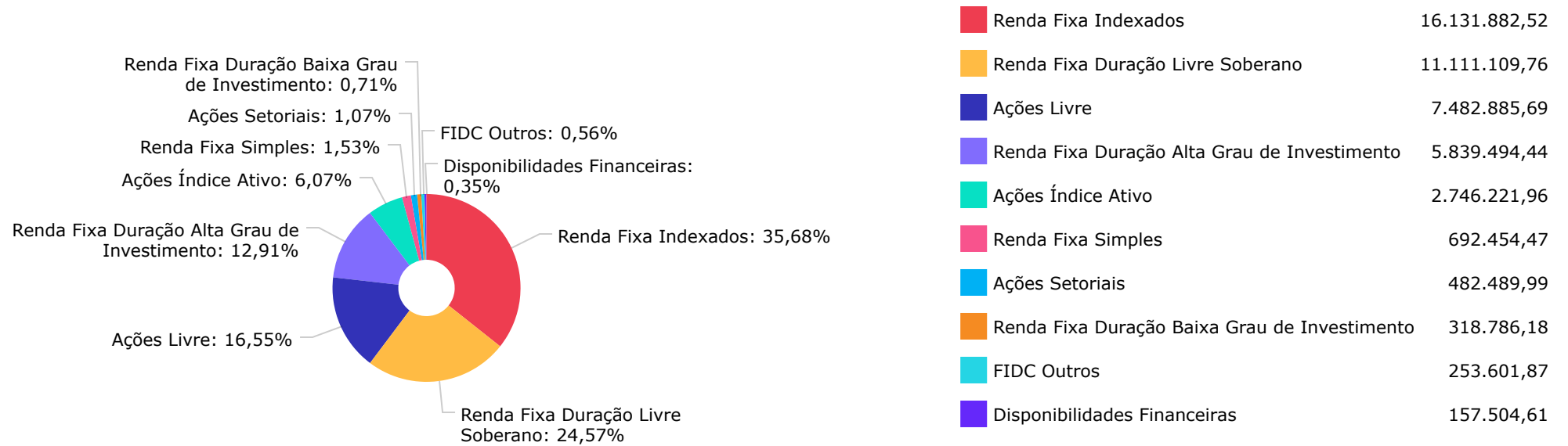
Exterior

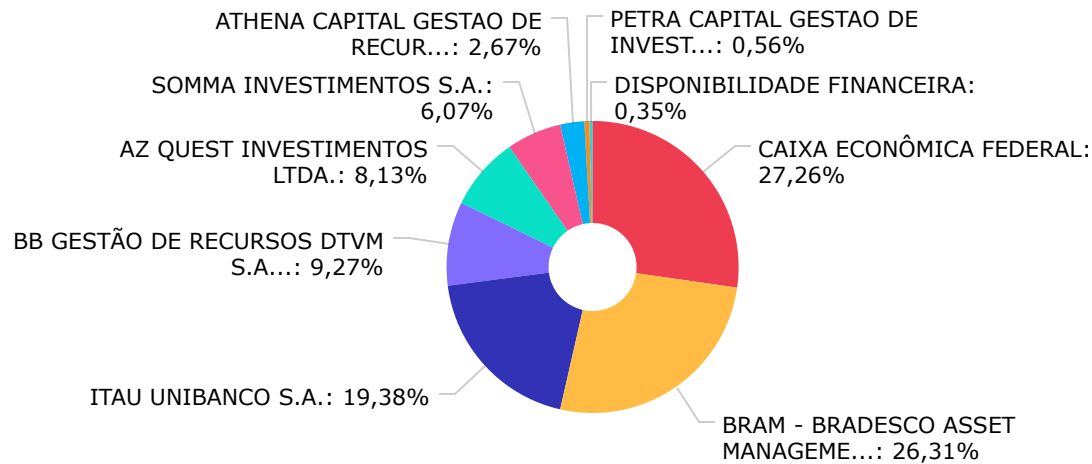
\$ 3.081.981,98 6,84%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
NÃO DEFINIDO (BENCHMARK)								
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	-1,55	-1,55	2,19	-5,42	-6,94	-4,33	3,24	6,83
ATHENA TOTAL RETURN INSTITUCIONAL II FI AÇÕES	4,25	4,25	5,75	-11,53	-4,45	-18,39	13,16	27,72
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,17	-0,17	-1,01	-1,66	-5,79	-10,04	0,01	0,01
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-9,75	-9,75	-9,03	3,11	11,35	71,14	10,47	22,04
CDI (BENCHMARK)								
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,73	0,73	2,10	3,47	5,00	7,67		
	0,75	0,75	2,11	3,52	4,95	7,34	0,01	0,02
IBOVESPA (BENCHMARK)								
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-7,58	-7,58	-10,88	-23,24	-16,77	-5,14	12,36	26,02
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	7,51	7,51	7,25	-8,88	-0,08	-10,08	9,32	19,63
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	7,72	7,72	5,42	-12,07	-7,60	-16,70	8,08	17,01
IDKA IPCA 2 ANOS (BENCHMARK)								
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,05	0,05	3,41	3,29	4,87	13,47		
	0,02	0,02	3,17	3,14	4,54	12,57	1,11	2,33
IMA GERAL (BENCHMARK)								
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,21	0,21	2,90	1,13	1,42	5,98		
	0,04	0,04	2,85	0,97	0,85	4,72	1,06	2,24
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	0,10	0,10	3,38	3,23	4,37	12,02	0,98	2,06
IMA-B (BENCHMARK)								
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-0,73	-0,73	2,94	-0,91	-1,15	4,02		
	-0,76	-0,76	2,86	-1,07	-1,50	3,29	2,01	4,23
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	-1,09	-1,09	2,84	-1,46	-1,51	4,58	2,23	4,70
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,03	-0,03	3,55	0,25	-2,07	0,69	1,31	2,76
IMA-B 5 (BENCHMARK)								
	0,11	0,11	3,42	3,33	4,57	12,47		

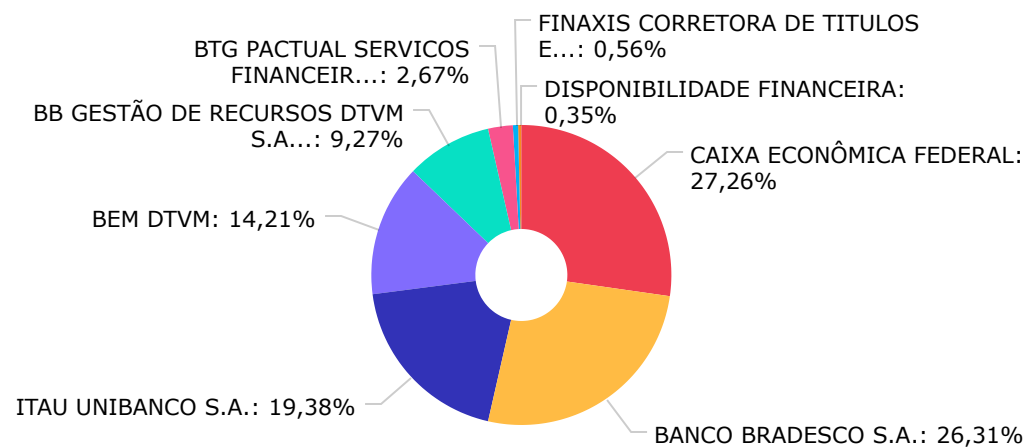
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,08	0,08	3,33	3,12	4,25	11,85	1,00	2,10
IMA-B 5+ (BENCHMARK)	-1,61	-1,61	2,45	-4,92	-6,47	-3,03		
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,62	-1,62	2,31	-5,29	-6,93	-3,68	3,33	7,01
IRF-M (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
SELIC (BENCHMARK)	0,73	0,73	2,10	3,47	5,00	7,67		
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,78	0,78	2,24	3,85	5,59	7,61	0,01	0,02







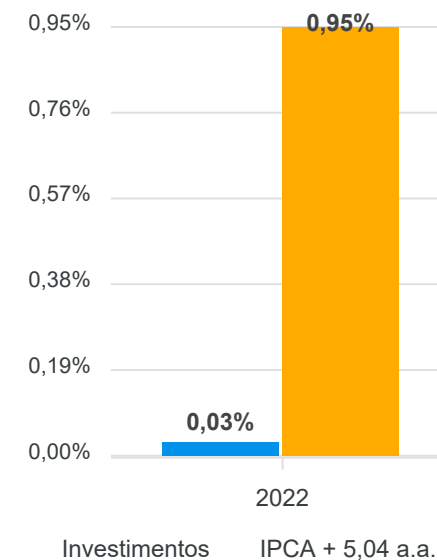
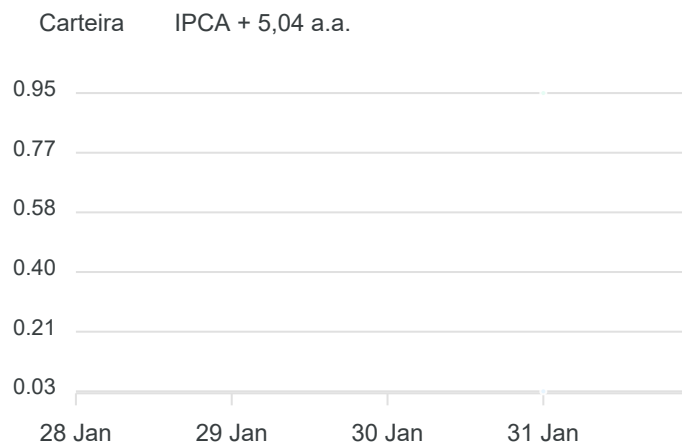
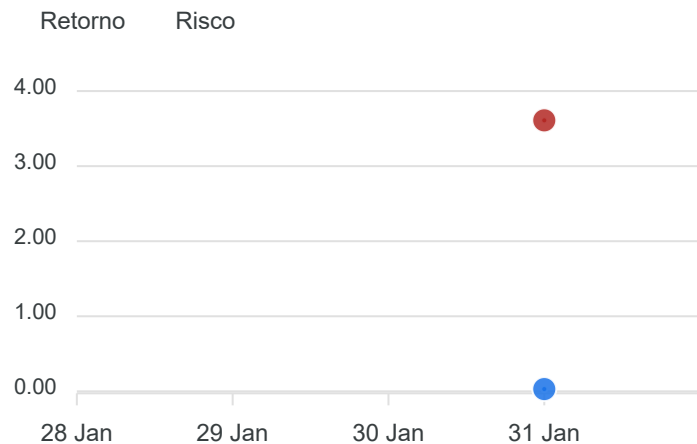
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	12.325.612,78
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEME...	11.894.265,35
ITAU UNIBANCO S.A.	8.764.554,12
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	4.191.277,10
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	3.677.590,06
SOMMA INVESTIMENTOS S.A.	2.746.221,96
ATHENA CAPITAL GESTAO DE RECUR...	1.205.803,64
PETRA CAPITAL GESTAO DE INVEST...	253.601,87
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	157.504,61



CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	12.325.612,78
BANCO BRADESCO S.A.	11.894.265,35
ITAU UNIBANCO S.A.	8.764.554,12
BEM DTVM	6.423.812,02
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	4.191.277,10
BTG PACTUAL SERVICOS FINANCEIR...	1.205.803,64
FINAXIS CORRETORA DE TITULOS E...	253.601,87
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	157.504,61

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Meta %	Risco - VaR
Janeiro	45.190.813,95	0,00	144.000,00	45.058.926,88	12.112,93	0,03% ▲	0,95%	3,61%

Acumulado 12.112,93 0,03% ▲ 0,95%



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.873.111,55	0,00	0,00	2.875.318,47	2.206,92	0,08% ▲	1,00%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	834.530,80	0,00	0,00	833.468,64	-1.062,16	-0,13% ▼	1,67%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	996.256,96	0,00	0,00	980.838,61	-15.418,35	-1,55% ▼	3,24%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	10.675.946,04	0,00	0,00	10.594.640,56	-81.305,48	-0,76% ▼	2,01%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	316.332,65	0,00	0,00	318.786,18	2.453,53	0,78% ▲	0,01%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	516.630,90	0,00	0,00	516.469,20	-161,70	-0,03% ▼	1,31%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.885.188,11	0,00	0,00	6.886.483,41	1.295,30	0,02% ▲	1,11%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.180.054,48	0,00	0,00	2.144.771,52	-35.282,96	-1,62% ▼	3,33%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	178.325,39	0,00	0,00	178.396,66	71,27	0,04% ▲	1,06%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	4.912.349,80	0,00	0,00	4.858.655,83	-53.693,97	-1,09% ▼	2,23%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	3.210.290,53	0,00	0,00	3.213.443,82	3.153,29	0,10% ▲	0,98%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	830.451,02	0,00	144.000,00	692.454,47	6.003,45	0,72% ▲	0,01%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	254.028,04	0,00	0,00	253.601,87	-426,17	-0,17% ▼	0,01%
	34.663.496,27	0,00	144.000,00	34.347.329,24	-172.167,03	-0,50%	1,70%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
ATHENA TOTAL RETURN INSTITUCIONAL II FI AÇÕES	1.156.691,53	0,00	0,00	1.205.803,64	49.112,11	4,25% ▲	13,16%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	3.413.935,59	0,00	0,00	3.677.590,06	263.654,47	7,72% ▲	8,08%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	2.554.451,91	0,00	0,00	2.746.221,96	191.770,05	7,51% ▲	9,32%
	7.125.079,03	0,00	0,00	7.629.615,66	504.536,63	7,08%	9,33%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	522.041,59	0,00	0,00	482.489,99	-39.551,60	-7,58% ▼	12,36%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.880.197,06	0,00	0,00	2.599.491,99	-280.705,07	-9,75% ▼	10,47%
	3.402.238,65	0,00	0,00	3.081.981,98	-320.256,67	-9,41%	1,93%