

2021

Relatório Mensal

Janeiro

Análise dos Investimentos

De acordo com a Portaria MTP nº 1.467 de 2 de junho de 2022, Capítulo VI, Seção V, Artigo 136º e com o Manual do Pró-Gestão RPPS versão 3.3, ítem 3.2.6 Nível I, aprovado pela Portaria SPREV nº 918, de 2 de Março de 2022.

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.689.317,75	2,35%	9.200.599.633,08	0,03%	7º I b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	4.284.465,79	3,75%	5.043.806.710,80	0,08%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.091.181,65	7,96%	8.335.200.025,45	0,11%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	22.013.817,23	19,27%	14.822.912.413,17	0,15%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.552.166,49	10,99%	10.852.113.121,11	0,12%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.643.303,47	6,69%	13.518.203.391,91	0,06%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.049.293,87	6,17%	6.185.705.380,20	0,11%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.690.028,20	8,48%	10.435.150.283,00	0,09%	7º I b
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.204.832,03	4,56%	2.584.217.542,07	0,20%	7º IV a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.213.973,20	1,06%	5.006.506.249,23	0,02%	7º IV a
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.030.010,49	1,78%	4.253.317.532,07	0,05%	7º IV a
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4.115.124,43	3,60%	1.137.598.937,97	0,36%	8º II a
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.206.347,88	1,06%	660.307.850,27	0,18%	8º II a
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	6.054.040,64	5,30%	1.019.809.762,10	0,59%	8º II a
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	4.977.796,87	4,36%	327.573.225,05	1,52%	8º II a
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	4.016.200,59	3,52%	1.192.287.997,72	0,34%	8º II a
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.768.823,73	5,05%	4.834.227.738,16	0,12%	8º III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2.603.032,84	2,28%	968.155.241,19	0,27%	8º III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2.008.464,37	1,76%	2.188.049.553,95	0,09%	8º III

Investimentos

\$ 114.212.221,52

Disponibilidades Financeiras

\$ 250.072,57

Total Carteira

\$ 114.462.294,09

Governança (Pró Gestão)

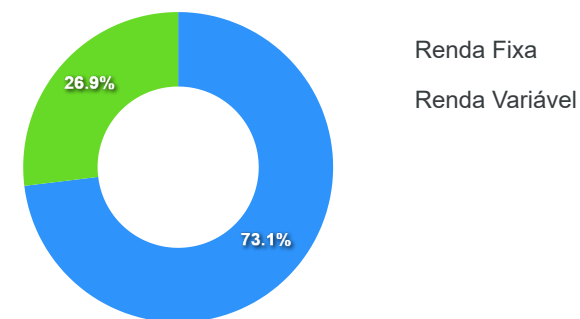
🏛️ Não possui

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	65,68% 75.013.574,45	34,32% 39.198.647,07
7º IV a - FI de Renda Fixa	40,00%	7,40% 8.448.815,72	32,60% 37.236.072,89
8º II a - FI em Ações	20,00%	17,83% 20.369.510,41	2,17% 2.472.933,89
8º III - FI Multimercado	10,00%	9,09% 10.380.320,94	0,91% 1.040.901,21

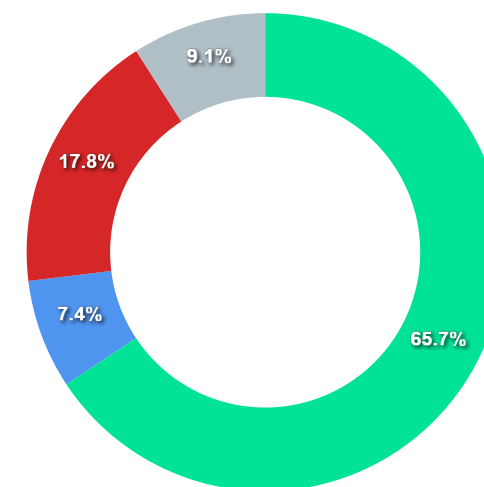
Governança (Pró Gestão)

 Não possui

Segmentos



Artigos

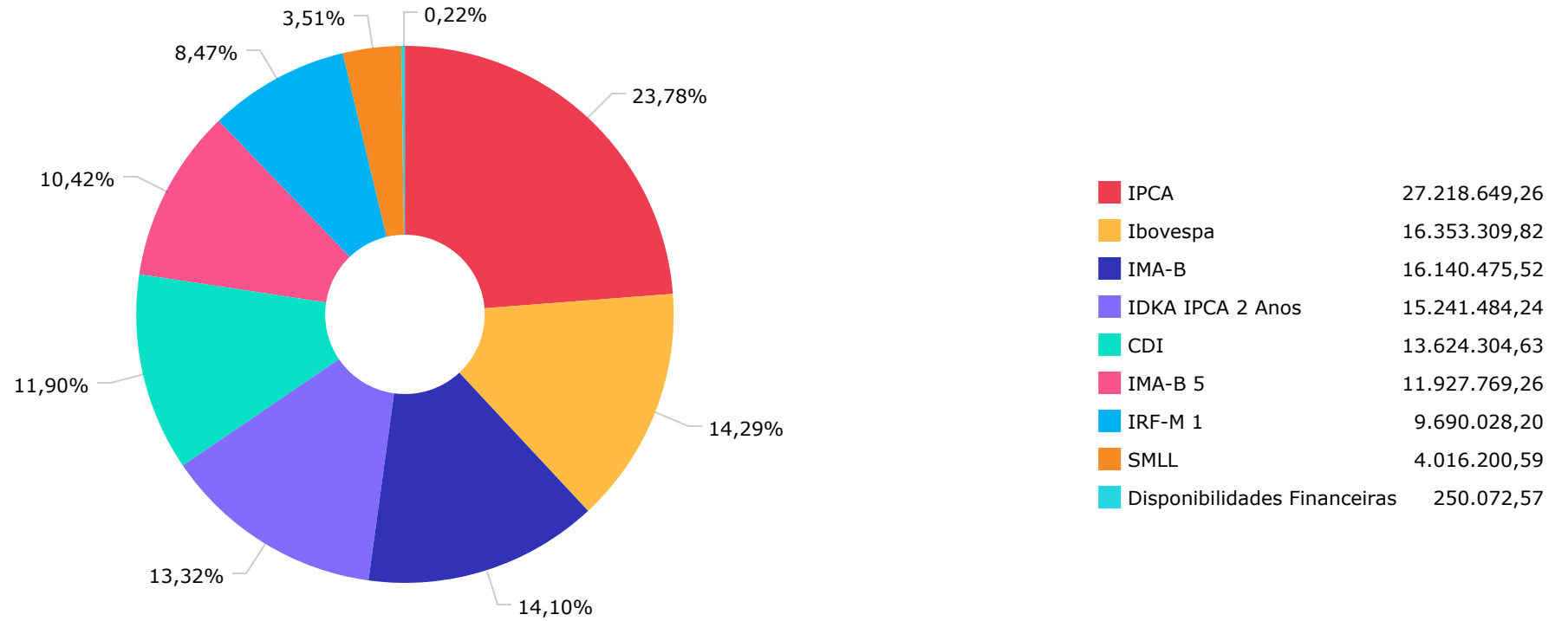


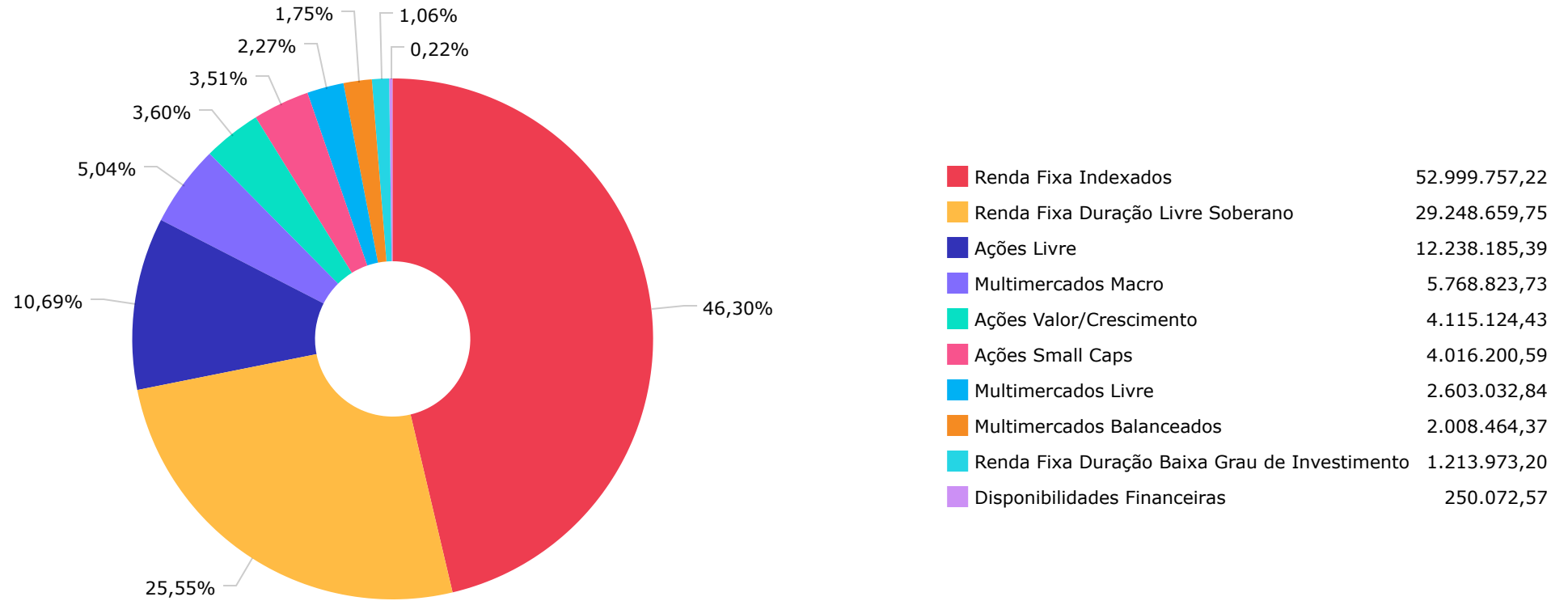
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I b - FI 100% Títulos TN	65,68%	11,51%	51,06%	71,95%	7.162.118,93
7° IV a - FI de Renda Fixa	7,40%	4,07%	20,34%	40,00%	37.236.072,89

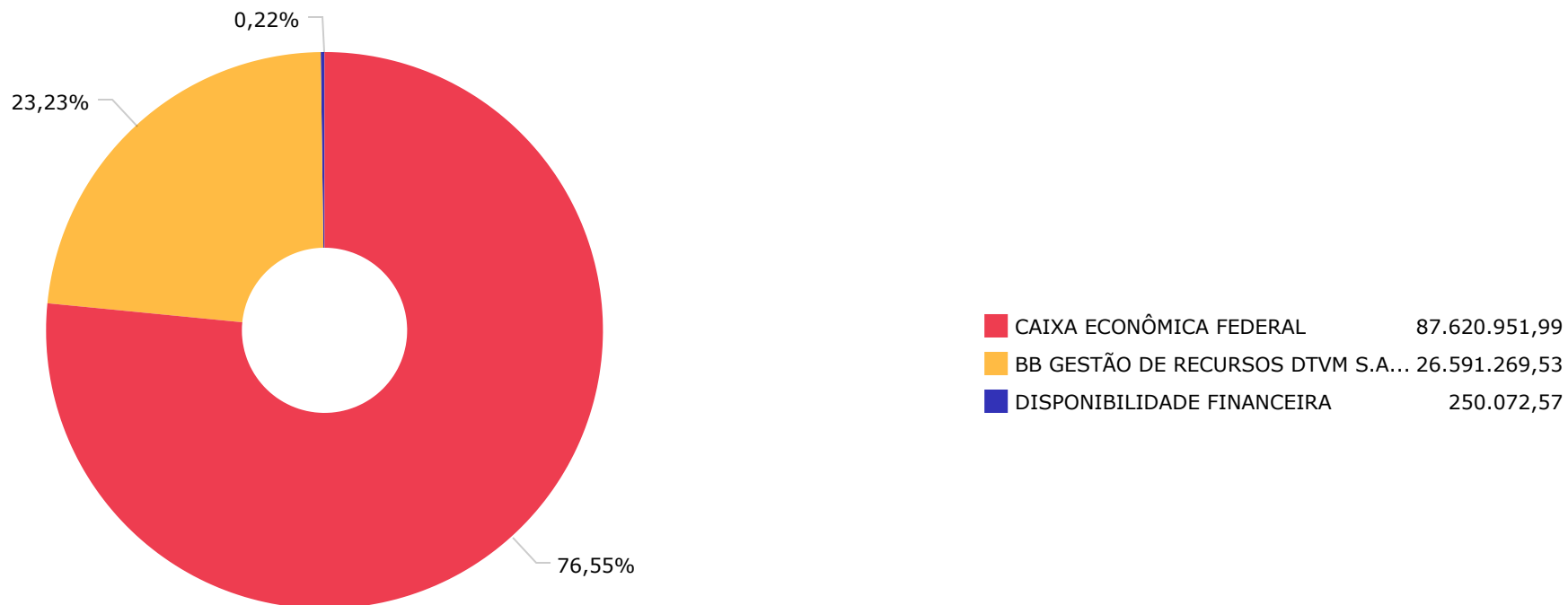
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
8° II a - FI em Ações	17,83%	3,68%	18,38%	20,00%	2.472.933,89
8° III - FI Multimercado	9,09%	3,08%	9,58%	10,00%	1.040.901,21
9° A II - Constituídos no Bras...	0,00%	0,00%	0,32%	5,00%	5.710.611,08
9° A III - Ações - BDR Nível I	0,00%	0,00%	0,32%	5,00%	5.710.611,08

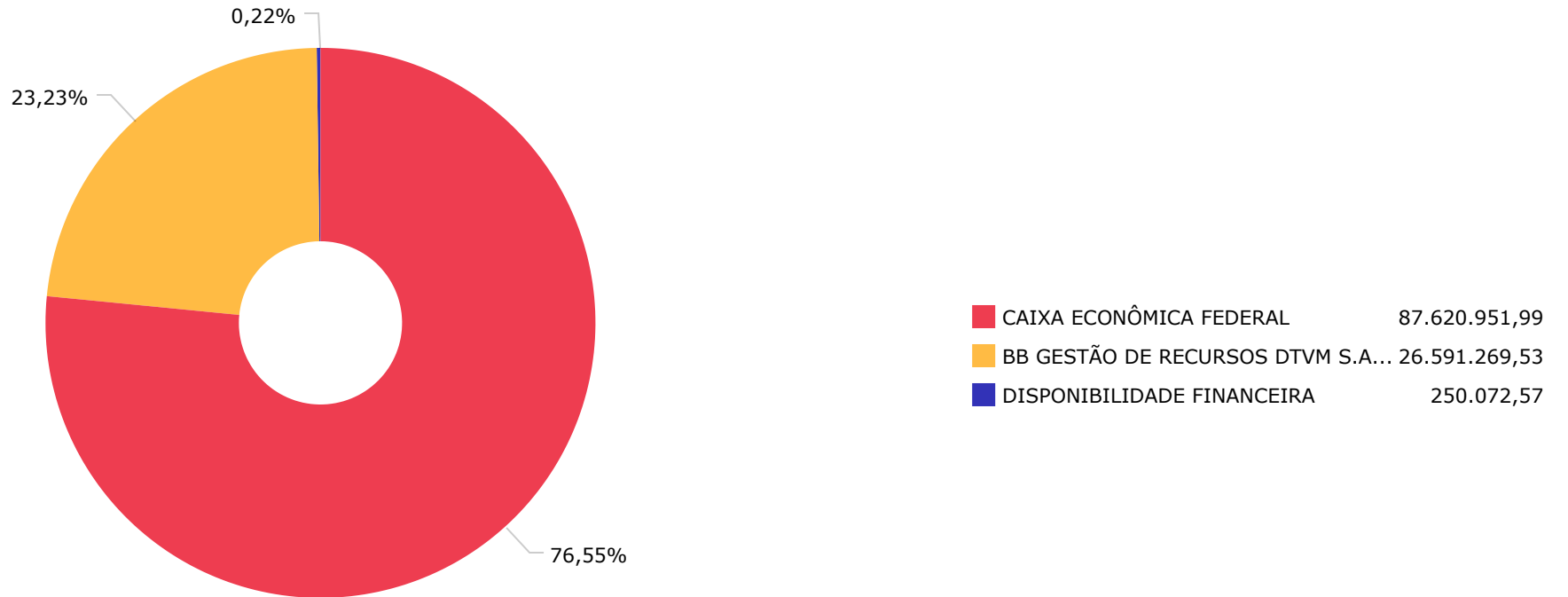
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	0,15	0,15	0,46	0,94	2,53	8,46		
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,20	0,20	0,55	0,63	2,27	8,16	0,03	0,07
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,16	0,16	0,68	0,95	2,20	7,87	0,02	0,04
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,23	0,23	4,92	2,43	3,04		2,43	5,12
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,09	-0,09	4,50	3,05	2,72	17,79	1,73	3,65
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-0,58	-0,58	6,06	2,69	2,18	12,11	3,29	6,92
IBOVESPA - BENCHMARK	-3,32	-3,32	22,47	11,81	1,15	18,15		
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-4,97	-4,97	22,58	14,23	5,75	36,55	11,79	24,82
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-5,59	-5,59	22,28	14,80	1,52	22,76	12,13	25,55
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-3,56	-3,56	14,87	8,21	-2,16		9,94	20,94
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-2,57	-2,57	18,02	5,76	-4,46		11,08	23,33
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK	0,15	0,15	3,16	4,28	8,20	20,12		
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,18	0,18	3,07	4,24	7,69	18,77	0,95	2,01
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,13	0,13	3,03	4,04	7,68	18,78	1,02	2,15
IMA-B - BENCHMARK	-0,85	-0,85	6,04	2,78	5,23	24,29		
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,86	-0,86	6,00	2,62	4,95	23,66	2,59	5,46
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,87	-0,87	5,99	2,66	4,88	23,46	2,57	5,42
IMA-B 5 - BENCHMARK	0,11	0,11	3,28	3,80	7,56	20,52		
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,10	0,10	3,24	3,66	7,29	19,97	1,04	2,19
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,08	0,08	3,22	3,64	7,25	19,86	1,04	2,19
IPCA - BENCHMARK	0,25	0,25	2,51	4,30	4,56	8,94		
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,03	0,03	2,18	0,99	5,82	20,75	0,76	1,60

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,47	-0,47	3,25	1,20			1,56	3,28
IRF-M 1 - BENCHMARK	0,04	0,04	0,58	1,02	3,43	10,27		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,03	0,03	0,53	0,90	3,22	9,83	0,15	0,33
SMLL - BENCHMARK	-3,43	-3,43	21,10	10,52	-4,50	38,71		
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-3,48	-3,48	20,19	8,82	-7,06	31,28	12,27	25,84









Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	114.899.228,61	238.542,06	0,00	114.212.221,52	-925.549,15	-925.549,15	-0,80% ▼	-0,80%	0,67%	0,67%	-119,40%	3,05%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

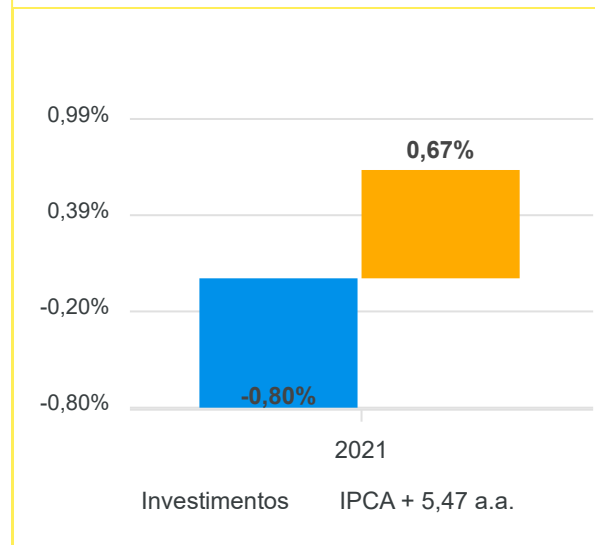
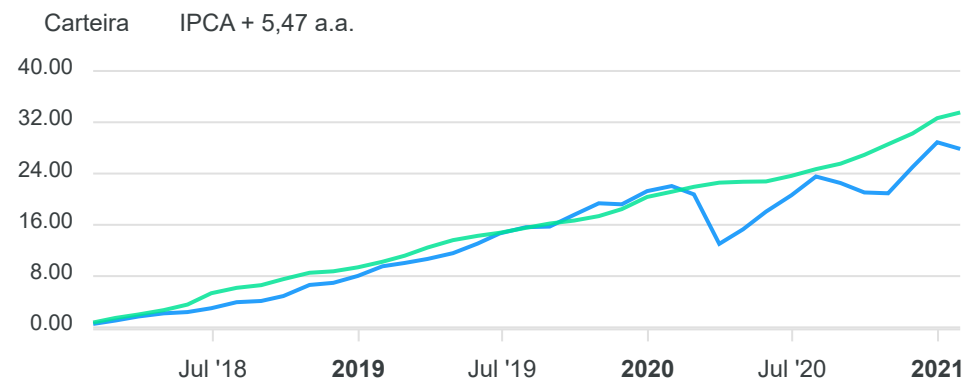


Gráfico Risco x Retorno

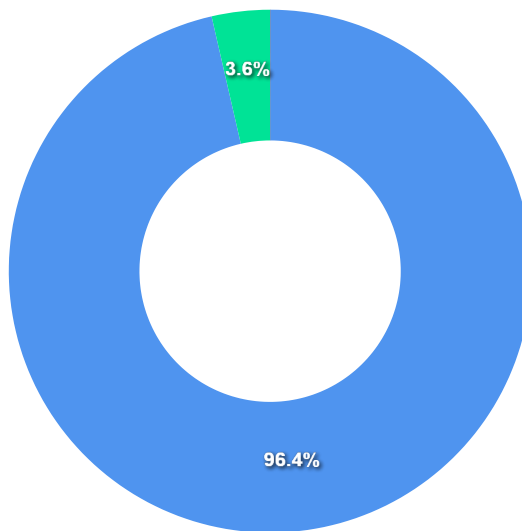


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 29/01/2021

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	110.347.169,66	96,62
Até D+180	4.115.124,43	3,60
Até D+360	0,00	0,00
Até D+720	0,00	0,00
Até D+1800	0,00	0,00
Até D+3600	0,00	0,00
Acima D+3600	0,00	0,00
Indeterminado	0,00	0,00



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.229.208,73	0,00	0,00	5.204.832,03	-24.376,70	-0,47% ▼	1,56%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.684.566,32	0,00	0,00	2.689.317,75	4.751,43	0,18% ▲	0,95%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	4.280.337,31	0,00	0,00	4.284.465,79	4.128,48	0,10% ▲	1,04%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.170.391,22	0,00	0,00	9.091.181,65	-79.209,57	-0,86% ▼	2,59%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.212.013,90	0,00	0,00	1.213.973,20	1.959,30	0,16% ▲	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	22.008.251,10	0,00	0,00	22.013.817,23	5.566,13	0,03% ▲	0,76%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.535.417,16	0,00	0,00	12.552.166,49	16.749,33	0,13% ▲	1,02%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.636.945,72	0,00	0,00	7.643.303,47	6.357,75	0,08% ▲	1,04%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.111.339,21	0,00	0,00	7.049.293,87	-62.045,34	-0,87% ▼	2,57%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.449.103,09	238.542,06	0,00	9.690.028,20	2.383,05	0,02% ▲	0,15%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.025.939,60	0,00	0,00	2.030.010,49	4.070,89	0,20% ▲	0,03%
	83.343.513,36	238.542,06	0,00	83.462.390,17	-119.665,25	-0,14%	1,15%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4.358.612,75	0,00	0,00	4.115.124,43	-243.488,32	-5,59% ▼	12,13%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.269.423,99	0,00	0,00	1.206.347,88	-63.076,11	-4,97% ▼	11,79%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	6.213.959,65	0,00	0,00	6.054.040,64	-159.919,01	-2,57% ▼	11,08%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.773.923,30	0,00	0,00	5.768.823,73	-5.099,57	-0,09% ▼	1,73%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	5.161.713,32	0,00	0,00	4.977.796,87	-183.916,45	-3,56% ▼	9,94%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2.596.956,37	0,00	0,00	2.603.032,84	6.076,47	0,23% ▲	2,43%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2.020.166,34	0,00	0,00	2.008.464,37	-11.701,97	-0,58% ▼	3,29%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	4.160.959,53	0,00	0,00	4.016.200,59	-144.758,94	-3,48% ▼	12,27%
-	31.555.715,25	0,00	0,00	30.749.831,35	-805.883,90	-2,55%	8,22%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4.358.612,75	0,00	0,00	4.115.124,43	-243.488,32	-5,59% ▼	12,13%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.269.423,99	0,00	0,00	1.206.347,88	-63.076,11	-4,97% ▼	11,79%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	6.213.959,65	0,00	0,00	6.054.040,64	-159.919,01	-2,57% ▼	11,08%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.773.923,30	0,00	0,00	5.768.823,73	-5.099,57	-0,09% ▼	1,73%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	5.161.713,32	0,00	0,00	4.977.796,87	-183.916,45	-3,56% ▼	9,94%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2.596.956,37	0,00	0,00	2.603.032,84	6.076,47	0,23% ▲	2,43%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2.020.166,34	0,00	0,00	2.008.464,37	-11.701,97	-0,58% ▼	3,29%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	4.160.959,53	0,00	0,00	4.016.200,59	-144.758,94	-3,48% ▼	12,27%
-	31.555.715,25	0,00	0,00	30.749.831,35	-805.883,90	-2,55%	8,22%

FUNDOS IMOBILIÁRIOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4.358.612,75	0,00	0,00	4.115.124,43	-243.488,32	-5,59% ▼	12,13%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.269.423,99	0,00	0,00	1.206.347,88	-63.076,11	-4,97% ▼	11,79%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	6.213.959,65	0,00	0,00	6.054.040,64	-159.919,01	-2,57% ▼	11,08%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.773.923,30	0,00	0,00	5.768.823,73	-5.099,57	-0,09% ▼	1,73%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	5.161.713,32	0,00	0,00	4.977.796,87	-183.916,45	-3,56% ▼	9,94%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2.596.956,37	0,00	0,00	2.603.032,84	6.076,47	0,23% ▲	2,43%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2.020.166,34	0,00	0,00	2.008.464,37	-11.701,97	-0,58% ▼	3,29%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	4.160.959,53	0,00	0,00	4.016.200,59	-144.758,94	-3,48% ▼	12,27%
-	31.555.715,25	0,00	0,00	30.749.831,35	-805.883,90	-2,55%	8,22%

