

2020

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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.214.543,69	4,54%	6.477.324.446,92	0,07%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	18.258.143,28	19,65%	10.136.705.212,45	0,18%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15.989.247,75	17,21%	8.791.015.868,25	0,18%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	16.257.910,05	17,50%	9.706.276.068,00	0,17%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.235.205,85	4,56%	6.604.088.892,56	0,06%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.214.621,07	7,76%	10.529.932.746,92	0,07%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.185.173,98	4,50%	2.361.861.808,09	0,18%	7º I b
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.187.816,51	1,28%	5.345.385.558,02	0,02%	7º IV a
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.985.005,58	2,14%	3.449.563.810,54	0,06%	7º IV a
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.126.808,09	1,21%	828.085.660,89	0,14%	8º II a
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	4.372.278,06	4,71%	788.946.693,79	0,55%	8º II a
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	5.087.638,26	5,48%	177.344.656,69	2,87%	8º II a
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.615.941,52	6,04%	6.423.116.574,31	0,09%	8º III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	3.192.067,17	3,44%	3.249.056.142,28	0,10%	8º III

Investimentos
 92.922.400,86

Disponibilidades Financeiras
 64.412,45

Total Carteira
 92.986.813,31

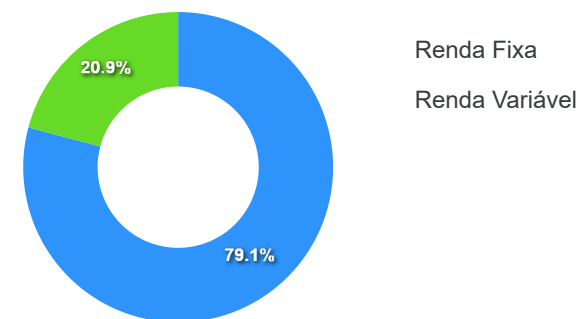
Governança (Pró Gestão)
 Não possui

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	75,71% 70.354.845,67	24,29% 22.567.555,19
7º IV a - FI de Renda Fixa	40,00%	3,41% 3.172.822,09	36,59% 33.996.138,25
8º II a - FI em Ações	20,00%	11,39% 10.586.724,41	8,61% 7.997.755,76
8º III - FI Multimercado	10,00%	9,48% 8.808.008,69	0,52% 484.231,40

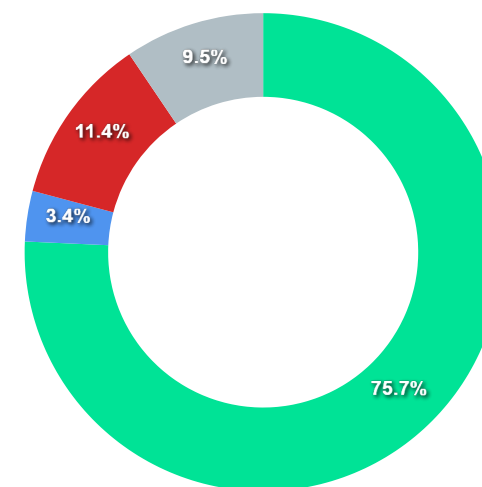
Governança (Pró Gestão)

 Não possui

Segmentos



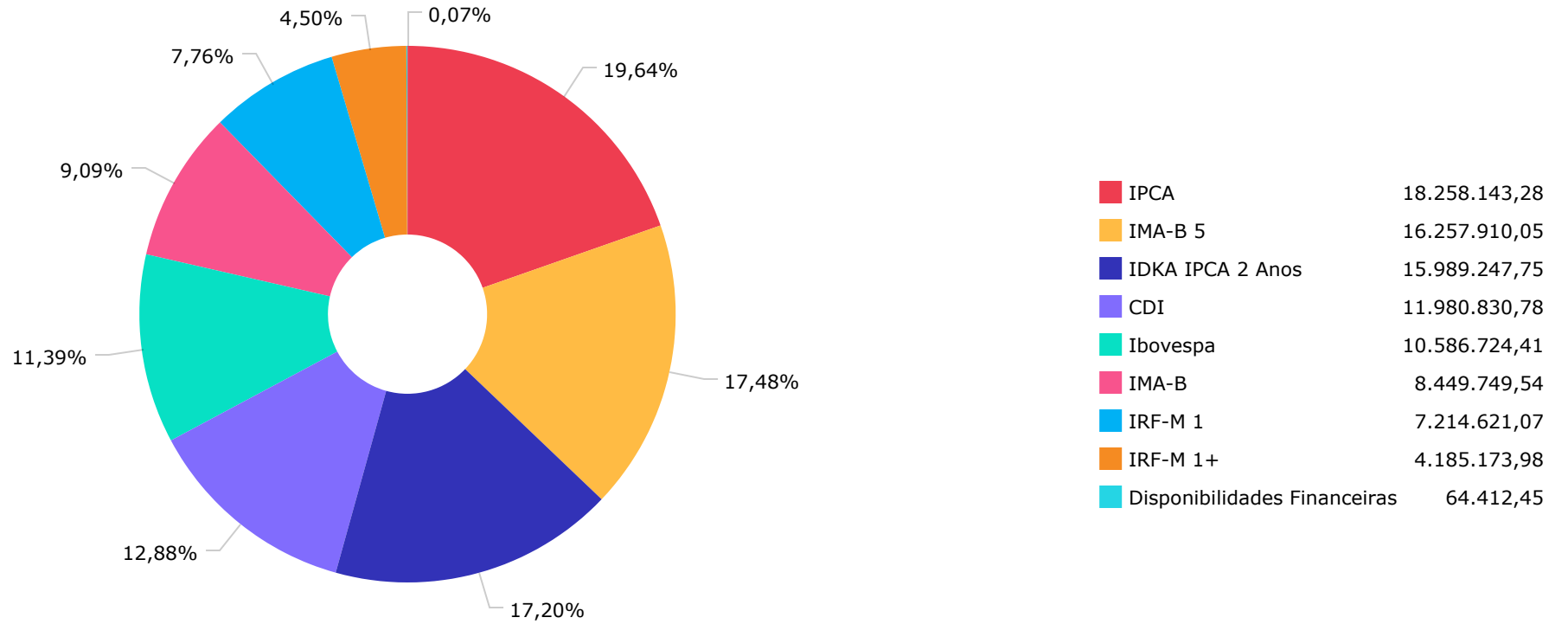
Artigos

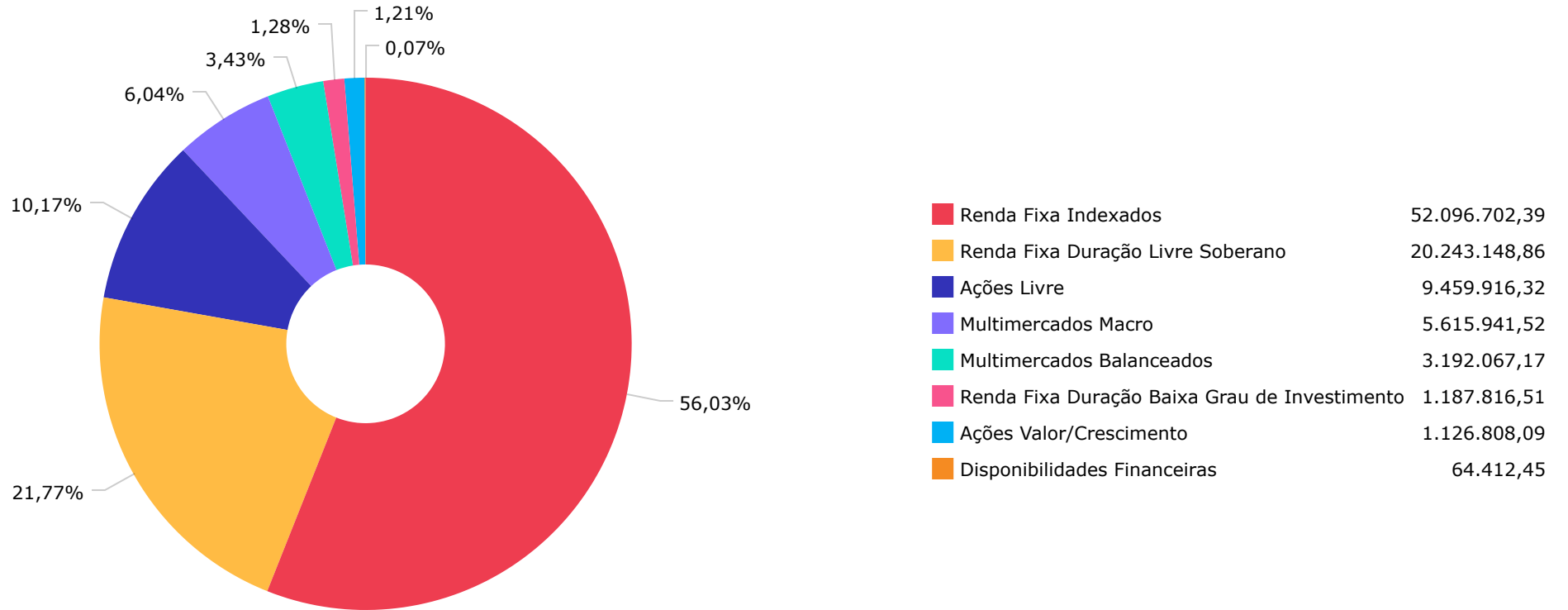


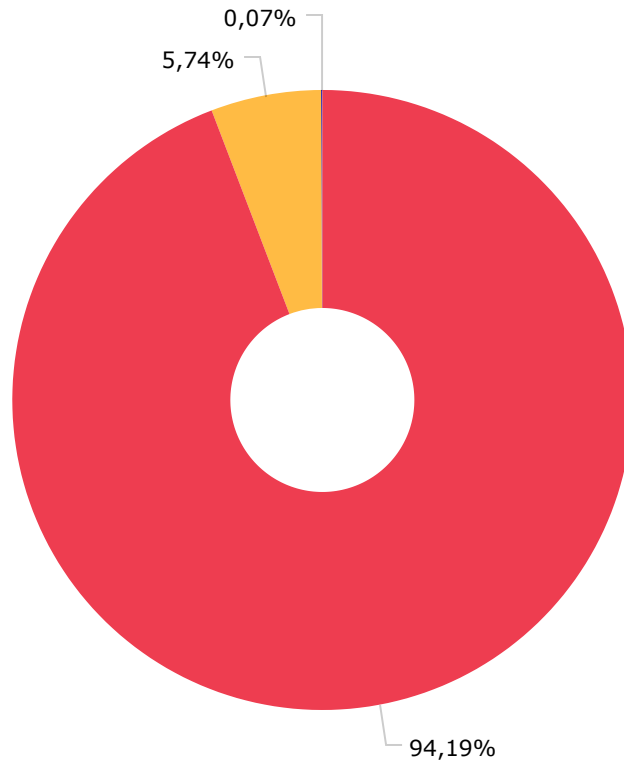
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I b - FI 100% Títulos TN	75,71%	20,00%	30,00%	90,00%	13.275.315,10	8° II a - FI em Ações	11,39%	0,00%	15,00%	20,00%	7.997.755,76
7° III a - FI Referenciados RF	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	55.753.440,52	8° III - FI Multimercado	9,48%	7,00%	10,00%	10,00%	484.231,40
7° IV a - FI de Renda Fixa	3,41%	10,00%	30,00%	40,00%	33.996.138,25	8° IV b - FI Imobiliário	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	4.646.120,04
7° VI a - Certificados de Depó...	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	13.938.360,13						
7° VII b - FI Renda Fixa - Cré...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.646.120,04						
7° VII c - FI de Debêntures In...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.646.120,04						

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	0,38	0,38	1,14	2,60	5,78	12,53		
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,39	0,39	1,09	2,59	5,76	12,25	0,03	0,07
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,37	0,37	1,03	2,44	5,55	12,08	0,01	0,03
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,68	0,68	3,58	6,70	14,67	28,07	1,97	4,16
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-0,25	-0,25	3,09	6,01	9,71	18,68	2,96	6,24
IBOVESPA - BENCHMARK	-1,63	-1,63	6,10	11,74	16,81	33,97		
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-1,44	-1,44	10,33	13,10	20,92	48,45	9,53	20,08
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1,24	1,24	16,41	18,06			7,66	16,12
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3,17	3,17	14,95	20,83			7,96	16,76
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK	0,54	0,54	1,76	4,74	11,02	22,45		
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,46	0,46	1,57	4,44	10,30	20,93	0,55	1,16
IMA-B - BENCHMARK	0,26	0,26	-0,24	5,64	18,12	34,79		
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,26	0,26	-0,30	5,54	17,83	34,11	1,65	3,48
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,25	0,25	-0,36	5,44	17,72	34,14	1,67	3,51
IMA-B 5 - BENCHMARK	0,56	0,56	1,51	5,04	12,06	23,36		
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,54	0,54	1,41	4,89	11,76	22,83	0,64	1,35
IPCA - BENCHMARK	0,21	0,21	1,88	2,05	4,19	8,13		
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,82	0,82	0,91	4,67	14,10	25,30	0,64	1,34
IRF-M 1 - BENCHMARK	0,44	0,44	1,20	3,05	6,61	14,04		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,42	0,42	1,14	2,93	6,40	13,64	0,09	0,19

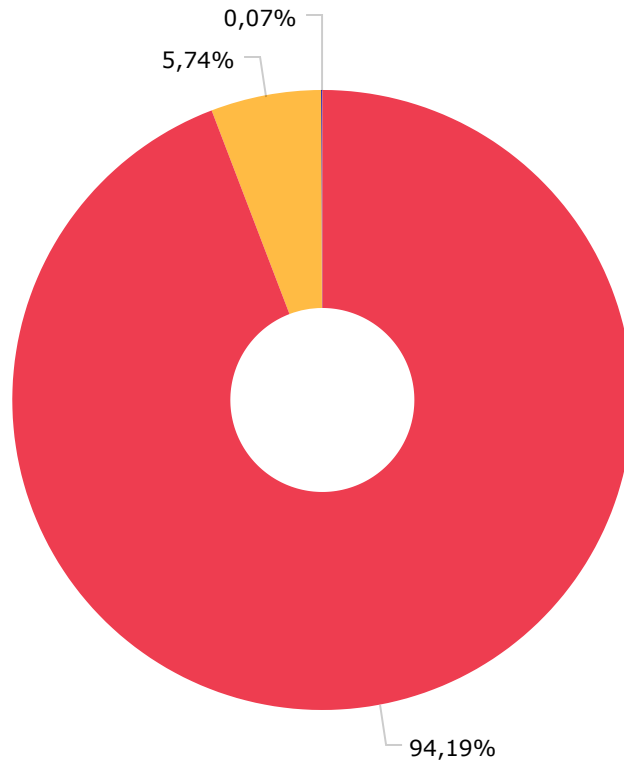
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IRF-M 1+ - BENCHMARK	1,12	1,12	0,99	5,27	13,57	27,71		
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,08	1,08	0,92	5,12	13,23	27,17	0,96	2,03







CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	87.581.049,08
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	5.341.351,78
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	64.412,45



■ CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	87.581.049,08
■ BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	5.341.351,78
■ DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	64.412,45

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	92.117.087,73	2.496.821,41	2.290.000,00	92.922.400,86	598.491,72	598.491,72	0,65% ▲	0,65%	0,71%	0,71%	91,55%	1,66%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

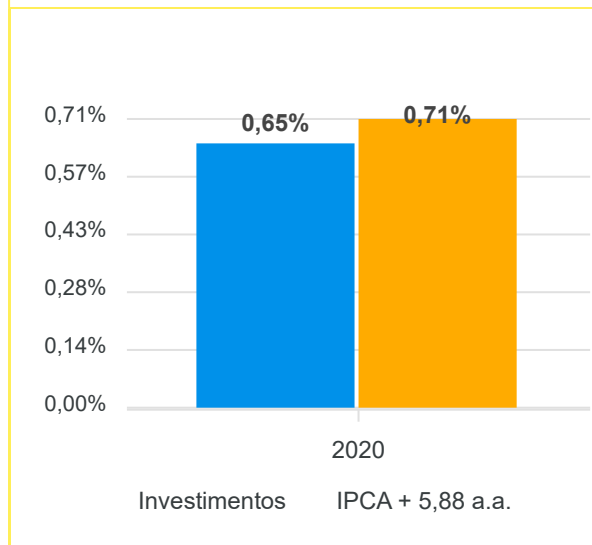
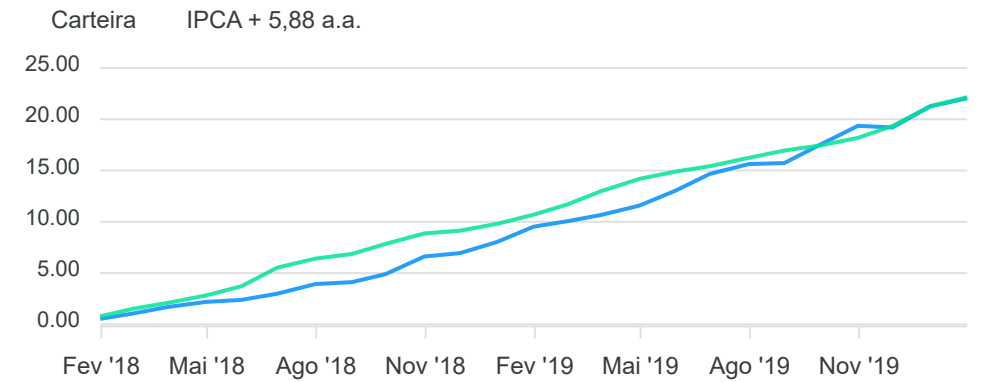


Gráfico Risco x Retorno

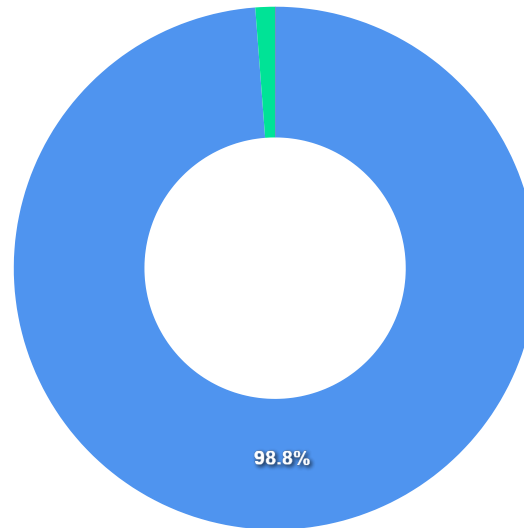


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 31/01/2020

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	91.860.005,22	98,86
Até D+180	1.126.808,09	1,21
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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.203.614,81	0,00	0,00	4.214.543,69	10.928,88	0,26% ▲	1,65%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.182.363,73	0,00	1.000.000,00	1.187.816,51	5.452,78	0,25% ▲	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	18.109.769,76	0,00	0,00	18.258.143,28	148.373,52	0,82% ▲	0,64%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15.916.484,94	0,00	0,00	15.989.247,75	72.762,81	0,46% ▲	0,55%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	16.169.929,17	0,00	0,00	16.257.910,05	87.980,88	0,54% ▲	0,64%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.224.784,96	0,00	0,00	4.235.205,85	10.420,89	0,25% ▲	1,67%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.977.957,70	496.821,41	290.000,00	7.214.621,07	29.841,96	0,40% ▲	0,09%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.140.626,81	0,00	0,00	4.185.173,98	44.547,17	1,08% ▲	0,96%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.976.221,60	0,00	1.000.000,00	1.985.005,58	8.783,98	0,30% ▲	0,03%
	74.901.753,48	496.821,41	2.290.000,00	73.527.667,76	419.092,87	0,56%	0,68%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.143.262,25	0,00	0,00	1.126.808,09	-16.454,16	-1,44% ▼	9,53%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.269.117,51	2.000.000,00	0,00	4.372.278,06	103.160,55	2,42% ▲	7,96%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.577.812,98	0,00	0,00	5.615.941,52	38.128,54	0,68% ▲	1,97%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	5.025.077,36	0,00	0,00	5.087.638,26	62.560,90	1,24% ▲	7,66%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	3.200.064,15	0,00	0,00	3.192.067,17	-7.996,98	-0,25% ▼	2,96%
-	17.215.334,25	2.000.000,00	0,00	19.394.733,10	179.398,85	0,93%	5,42%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.143.262,25	0,00	0,00	1.126.808,09	-16.454,16	-1,44% ▼	9,53%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.269.117,51	2.000.000,00	0,00	4.372.278,06	103.160,55	2,42% ▲	7,96%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.577.812,98	0,00	0,00	5.615.941,52	38.128,54	0,68% ▲	1,97%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	5.025.077,36	0,00	0,00	5.087.638,26	62.560,90	1,24% ▲	7,66%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	3.200.064,15	0,00	0,00	3.192.067,17	-7.996,98	-0,25% ▼	2,96%
-	17.215.334,25	2.000.000,00	0,00	19.394.733,10	179.398,85	0,93%	5,42%

FUNDOS IMOBILIÁRIOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.143.262,25	0,00	0,00	1.126.808,09	-16.454,16	-1,44% ▼	9,53%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.269.117,51	2.000.000,00	0,00	4.372.278,06	103.160,55	2,42% ▲	7,96%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.577.812,98	0,00	0,00	5.615.941,52	38.128,54	0,68% ▲	1,97%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	5.025.077,36	0,00	0,00	5.087.638,26	62.560,90	1,24% ▲	7,66%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	3.200.064,15	0,00	0,00	3.192.067,17	-7.996,98	-0,25% ▼	2,96%
-	17.215.334,25	2.000.000,00	0,00	19.394.733,10	179.398,85	0,93%	5,42%

