

Relatório Analítico dos Investimentos

em dezembro, 4º trimestre e ano de 2020

Este relatório atende a Portaria MTP Nº 1.467, de 2 de junho de 2022.

Total para cálculo dos limites da Resolução: R\$ 133.981.034,72

Disponibilidades Financeiras: R\$ 0,00

PL Total: R\$ 133.981.034,72

Fundo	Resgate Carência	Saldo	Particip. S/ PL	Cotistas	% PL Fundo	Lei
25.078.994/0001-90 BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3 Não há	8.805.174,48	6,57%	588	0,09%	7º I b
20.734.931/0001-20 BB TÍTULOS PÚBLICOS X RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0 15/08/2024	5.564.437,08	4,15%	93	1,28%	7º I b
11.484.558/0001-06 BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	D+0 Não há	1.809.110,77	1,35%	265	0,21%	7º I b
23.215.097/0001-55 CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	D+0 Não há	20.875.338,41	15,58%	885	0,14%	7º I b
14.386.926/0001-71 CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA LP	D+0 Não há	23.594.412,29	17,61%	1.005	0,22%	7º I b
11.060.913/0001-10 CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA LP	D+0 Não há	15.040.390,32	11,23%	976	0,07%	7º I b
10.740.670/0001-06 CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	D+0 Não há	25.537.405,29	19,06%	1.361	0,15%	7º I b
13.077.418/0001-49 BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0 Não há	4.051.680,52	3,02%	576	0,16%	7º IV a
03.737.206/0001-97 CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0 Não há	8.400.682,40	6,27%	641	0,00%	7º IV a
05.164.356/0001-84 CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA LP	D+0 Não há	5.119.199,98	3,82%	412	0,14%	7º IV a
21.838.150/0001-49 ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	D+1 Não há	5.242.694,83	3,91%	269	0,14%	7º IV a
06.018.364/0001-85 PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ... Não se aplica	84.519,30	0,06%	98	0,10%	7º VII a

Fundo	Resgate Carência	Saldo	Particip. S/ PL	Cotistas	% PL Fundo	Lei
11.392.165/0001-72 AZ QUEST SMALL MID CAPS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+30 Não há	1.380.637,98	1,03%	5.816	0,07%	8º II a
06.916.384/0001-73 BRADESCO DIVIDENDOS RESP LIMITADA FIF AÇÕES	D+4 Não há	1.087.645,92	0,81%	1.847	0,06%	8º II a
24.571.992/0001-75 ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+24 Não há	1.121.861,42	0,84%	42.737	0,03%	8º II a
08.070.841/0001-87 CAIXA ALOCAÇÃO MACRO RESP LIMITADA FIF CIC MULTIMERCADO LP	D+4 Não há	5.294.623,60	3,95%	18.848	0,11%	8º III
17.098.794/0001-70 CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ... Não se aplica	971.220,13	0,72%		0,45%	8º IV b

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA FIXA) - base (Dezembro / 2020) - Resolução CMN nº 3.922 de 25/11/2010

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia PI - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	101.226.268,64	75,55%	20,00%	30,00%	90,00%	19.356.662,61
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	80.388.620,83
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a	40,00%	22.814.257,73	17,03%	10,00%	30,00%	40,00%	30.778.156,16
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea a	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	20.097.155,21
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea a	5,00%	84.519,30	0,06%	0,00%	0,00%	5,00%	6.614.532,44
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea b	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	6.699.051,74
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea c	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	6.699.051,74
Total Renda Fixa	100,00%	124.125.045,67	92,64%	30,00%	70,00%	220,00%	

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Dezembro / 2020) - Resolução CMN nº 3.922 de 25/11/2010

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia PI - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea a	20,00%	3.590.145,32	2,68%	0,00%	15,00%	20,00%	23.206.061,62
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	5.294.623,60	3,95%	0,00%	10,00%	10,00%	8.103.479,87
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea b	5,00%	971.220,13	0,72%	0,00%	5,00%	5,00%	5.727.831,61
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	9.855.989,05	7,36%	0,00%	30,00%	35,00%	

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	101.226.268,64	75,55	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a	22.814.257,73	17,03	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea a	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea a	84.519,30	0,06	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea b	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea c	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea a	3.590.145,32	2,68	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	5.294.623,60	3,95	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea b	971.220,13	0,72	0,00	5,00

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2020 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,15%	-4,83%	-0,46%	-3,33%	-4,83%	-13,52%	0,01%	11,39%

IPCA (Benchmark)	1,35%	4,52%	3,13%	4,42%	4,52%	9,02%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	1,32%	6,67%	2,04%	1,95%	6,67%	24,19%	0,55%	2,38%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,82%	7,48%	3,38%	4,45%	7,48%	22,37%	0,85%	3,66%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA ...	0,20%	2,86%	0,39%	0,58%	2,86%	15,12%	0,02%	0,89%

CDI (Benchmark)	0,16%	2,76%	0,47%	0,99%	2,76%	8,88%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,38%	5,09%	3,18%	3,28%	5,09%	18,83%	1,02%	4,24%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVID...	0,25%	2,40%	0,57%	1,01%	2,40%	8,28%	0,02%	0,38%
CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,36%	2,42%	0,64%	1,03%	2,42%	8,27%	0,15%	0,44%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA LP	0,25%	2,46%	0,47%	0,62%	2,46%	8,52%	0,03%	0,53%

IMA-B 5 (Benchmark)	1,83%	8,04%	3,38%	4,72%	8,04%	22,25%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIX...	1,82%	7,75%	3,32%	4,57%	7,75%	21,60%	0,74%	3,49%

IRF-M 1 (Benchmark)	0,31%	3,84%	0,70%	1,21%	3,84%	10,86%	-	-
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,33%	3,48%	0,67%	1,01%	3,48%	10,18%	0,10%	0,55%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIX...	0,29%	3,63%	0,65%	1,12%	3,63%	10,42%	0,10%	0,51%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2020 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,73%	8,62%	3,05%	5,10%	8,62%	21,46%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	1,65%	8,03%	3,05%	4,76%	8,03%	20,12%	0,71%	3,02%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2020 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,16%	2,76%	0,47%	0,99%	2,76%	8,88%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO RESP LIMITADA FIF CIC MULTIMERCADO LP	1,70%	3,52%	4,23%	4,60%	3,52%	22,23%	0,93%	7,69%
Ibovespa (Benchmark)	9,30%	2,92%	25,81%	25,21%	2,92%	35,42%	-	-
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	6,30%	-4,87%	19,94%	22,34%	-4,87%	38,19%	6,12%	42,49%
IDIV (Benchmark)	8,94%	-1,00%	25,44%	21,29%	-1,00%	43,71%	-	-
BRADESCO DIVIDENDOS RESP LIMITADA FIF AÇÕES	9,43%	-5,65%	25,79%	21,37%	-5,65%	16,62%	6,90%	39,13%
IFIX (Benchmark)	2,19%	-10,24%	2,69%	2,28%	-10,24%	22,05%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-4,97%	-8,15%	-26,02%	-12,28%	-8,15%	35,59%	15,57%	53,39%
SMLL (Benchmark)	7,52%	-0,65%	22,54%	25,33%	-0,65%	57,16%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	6,93%	-3,16%	16,95%	21,44%	-3,16%	44,95%	5,86%	48,64%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Dezembro / 2020)

Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Dezembro / 2020)



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2020

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	108.383.280,30	1.475.000,00	274.094,45	110.153.959,39	569.773,54	569.773,54	0,52%	0,52%	0,68%	0,68%	76,52%	1,05%
Fevereiro	110.153.959,39	1.879.056,99	1.087.093,54	111.032.529,36	86.606,52	656.380,06	0,08%	0,60%	0,63%	1,32%	45,41%	1,54%
Março	111.032.529,36											