

Relatório Analítico dos Investimentos

em março e 1º trimestre de 2022

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	2.197.073,13	21,56%	793	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.123.838,36	11,03%	613	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	1.404.840,95	13,78%	309	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	1.607.395,18	15,77%	921	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	712.016,74	6,99%	1.024	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.032.623,90	10,13%	831	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	1.301.851,85	12,77%	188	0,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	813.179,34	7,98%	2.389	0,07%	Artigo 8º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			10.192.819,45				

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Março / 2022)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	32,00%	62,20%	6.339.933,70
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	7.045.164,36	69,12%	24,00%	32,00%	62,20%	-705.230,66
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	2.334.475,75	22,90%	7,50%	10,00%	40,00%	1.742.652,03
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	2.038.563,89
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	509.640,97
Total Renda Fixa	100,00%	9.379.640,11	92,02%	31,50%	81,00%	189,40%	

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Março / 2022)

Artigos - Renda Variável / Estruturado	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	813.179,34	7,98%	15,00%	20,00%	20,00%	1.225.384,55
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	2,25%	3,00%	10,00%	1.019.281,95
Total Renda Variável / Estruturado	30,00%	813.179,34	7,98%	17,25%	23,00%	30,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	1.019.281,95
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	

Enquadramento por Gestores - base (Março / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	5.166.714,73	50,69	0,00
CAIXA DTVM	3.724.252,87	36,54	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	1.301.851,85	12,77	0,00

Artigo 20º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR) - (Resolução 4963)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2022		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	62,20
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	7.045.164,36	69,12	24,00	62,20
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	2.334.475,75	22,90	7,50	40,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	813.179,34	7,98	15,00	20,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	0,00	0,00	2,25	10,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2022 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA-B 5 (Benchmark)	2,61%	3,81%	3,81%	5,92%	8,72%	17,96%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,59%	3,76%	3,76%	5,80%	8,48%	17,37%	1,34%	0,04%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2,58%	3,74%	3,74%	5,75%	8,38%	17,29%	1,35%	0,04%
IMA-B (Benchmark)	3,07%	2,87%	2,87%	3,96%	4,50%	15,36%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,01%	2,76%	2,76%	3,77%	4,18%	14,69%	2,67%	0,06%
CDI (Benchmark)	0,92%	2,42%	2,42%	4,31%	6,41%	8,78%	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,79%	2,04%	2,04%	3,56%	5,11%	6,55%	0,01%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,83%	2,18%	2,18%	3,79%	5,27%	6,45%	0,01%	0,01%
IPCA (Benchmark)	1,62%	3,20%	3,20%	6,25%	11,30%	18,09%	-	-
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,42%	2,35%	2,35%	3,90%	4,34%	8,37%	0,99%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,82%	2,32%	2,32%	3,41%	2,39%	7,61%	0,34%	0,03%



Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	6,06%	14,48%	14,48%	8,13%	2,89%	64,34%	-	-
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	5,25%	8,72%	8,72%	5,96%	6,30%	67,64%	9,70%	0,12%



CRÉDITO
& MERCADO

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Março / 2022)



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Março / 2022)



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2022

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	10.076.894,23	0,00	483.413,70	9.642.936,59	49.456,06	49.456,06	0,49%	0,49%	0,94%	0,94%	52,17%	1,22%
Fevereiro	9.642.936,59	216.794,43	609.606,83	9.316.657,08	66.532,89	115.988,95	0,69%	1,18%	1,37%	2,33%	50,87%	1,18%
Março	9.316.657,08	1.270.334,40	584.112,21	10.192.819,45	189.940,18	305.929,13	1,90%	3,11%	2,04%	4,42%	70,26%	1,64%

Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

- Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B
- IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1
- IRF-M 1+ Ibovespa IBX SMLL IDIV
- Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B
- IMA-B 5
- IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1 IRF-M 1+
- Ibovespa IBX SMLL IDIV

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Março/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.091.001,13	0,00	0,00	1.123.838,36	32.837,23	3,01%	3,01%	2,67%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	694.065,87	0,00	0,00	712.016,74	17.950,87	2,59%	2,59%	1,34%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.141.841,62	0,00	0,00	2.197.073,13	55.231,51	2,58%	2,58%	1,35%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.283.582,01	0,00	0,00	1.301.851,85	18.269,84	1,42%	1,42%	0,99%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.024.094,90	0,00	0,00	1.032.623,90	8.529,00	0,83%	0,83%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.594.255,51	0,00	0,00	1.607.395,18	13.139,67	0,82%	0,82%	0,34%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	715.161,92	1.270.334,40	584.112,21	1.404.840,95	3.456,84	0,17%	0,79%	0,01%
Total Renda Fixa	8.544.002,96	1.270.334,40	584.112,21	9.379.640,11	149.414,96	1,62%		0,94%



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Março/2022

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável/Estruturados/Imobiliário	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	772.654,12	0,00	0,00	813.179,34	40.525,22	5,24%	5,24%	9,70%
Total Renda Variável	772.654,12	0,00	0,00	813.179,34	40.525,22	5,24%		9,70%