

# Relatório Analítico dos Investimentos

em abril de 2022



Carteira consolidada de investimentos - base (Abril / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			2.601.685,67	8,78%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	1.602.878,45	5,41%	1.042	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.651.886,46	12,33%	238	0,60%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	4.829.450,26	16,30%	912	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.365.343,09	11,36%	1.024	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.251.187,53	7,60%	103	0,18%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	858.482,79	2,90%	948	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	4.626.338,28	15,62%	184	0,48%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.393.651,41	11,46%	165	0,25%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	89.097,16	0,30%	922	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	418.043,80	1,41%	2.281	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO CRESCIMENTO FIC AÇÕES	D+12 du	Não há	410.895,72	1,39%	283	0,64%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	413.452,17	1,40%	1.699	0,05%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	153.246,61	0,52%	73	0,13%	Artigo 9º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	523.191,09	1,77%	101	0,44%	Artigo 10º, Inciso I
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	436.568,70	1,47%		0,32%	Artigo 11º
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		7.706,92	0,03%		0,00%	DF - Artigo 6º
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>29.625.399,19</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>7.706,92</b>				Artigo 6º
<b>PL Total</b>			<b>29.633.106,11</b>				



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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	2.601.685,67	8,78%	5,00%	8,00%	20,00%	3.323.394,17
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	13.449.558,26	45,40%	30,00%	56,00%	90,00%	13.213.301,01
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	11.218.757,17	37,87%	20,00%	30,00%	60,00%	6.556.482,34
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	2.962.539,92
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.481.269,96
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>27.270.001,10</b>	<b>92,05%</b>	<b>55,00%</b>	<b>94,00%</b>	<b>185,00%</b>	



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	1.242.391,69	4,19%	0,00%	3,00%	10,00%	1.720.148,23
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	2.962.539,92
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	523.191,09	1,77%	0,00%	1,00%	10,00%	2.439.348,83
Artigo 11º	5,00%	436.568,70	1,47%	0,00%	1,00%	5,00%	1.044.701,26
<b>Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário</b>	<b>30,00%</b>	<b>2.202.151,48</b>	<b>7,43%</b>	<b>0,00%</b>	<b>5,00%</b>	<b>35,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	153.246,61	0,52%	0,00%	0,00%	10,00%	2.809.293,31
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>153.246,61</b>	<b>0,52%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>10,00%</b>	



Enquadramento por Gestores - base (Abril / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	12.236.018,48	41,30	0,00
CAIXA DTVM	8.697.342,68	29,36	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	5.653.783,66	19,08	0,00
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	2.601.685,67	8,78	-
ZION INVEST	436.568,70	1,47	0,11

**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 '	2.601.685,67	8,78	5,00	20,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	13.449.558,26	45,40	30,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	11.218.757,17	37,87	20,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	1.242.391,69	4,19	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	153.246,61	0,52	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	523.191,09	1,77	0,00	10,00
Artigo 11º	436.568,70	1,47	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	1,51%	5,45%	5,39%	8,99%	9,27%	19,55%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,48%	5,36%	5,35%	8,68%	9,34%	19,39%	1,13%	0,04%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,75%	3,04%	2,40%	4,76%	5,63%	8,09%	-	-
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,68%	2,95%	2,32%	4,63%	5,46%	7,46%	0,24%	0,01%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	1,56%	5,43%	5,31%	8,92%	9,45%	19,21%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,54%	5,35%	5,26%	8,78%	9,20%	18,62%	1,01%	0,04%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	1,51%	5,24%	5,16%	8,67%	8,86%	17,72%	1,04%	0,04%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,83%	3,28%	2,53%	4,68%	7,08%	9,38%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,80%	3,38%	2,57%	4,80%	7,48%	9,87%	0,03%	0,01%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,82%	3,39%	2,61%	4,90%	7,47%	10,36%	0,03%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,78%	3,37%	2,57%	4,85%	7,40%	9,81%	0,03%	0,01%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	1,06%	4,29%	3,73%	6,05%	12,13%	19,71%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,91%	3,25%	2,56%	5,04%	2,64%	7,39%	0,39%	0,03%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,53%	2,89%	2,64%	5,20%	4,34%	7,84%	0,89%	0,02%



CRÉDITO  
& MERCADO

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>Global BDRX (Benchmark)</b>	-6,96%	-24,94%	-16,76%	-24,17%	-12,60%	25,44%	-	-
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	-10,10%	2,91%	-3,81%	4,23%	-9,27%	34,00%	-	-
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-7,78%	1,12%	-4,35%	0,88%	-15,37%	19,86%	7,37%	0,18%
BRADESCO CRESCIMENTO FIC AÇÕES	-9,52%	0,44%	-3,15%	1,30%	-12,94%	22,69%	8,70%	0,21%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-8,34%	-0,34%	-3,88%	2,82%	-4,77%	41,77%	8,52%	0,15%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,83%	3,28%	2,53%	4,68%	7,08%	9,38%	-	-
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,61%	3,95%	3,19%	6				