



IPMC

 Janeiro a Dezembro de 2021



Patrimônio
R\$ 112.324.741,60

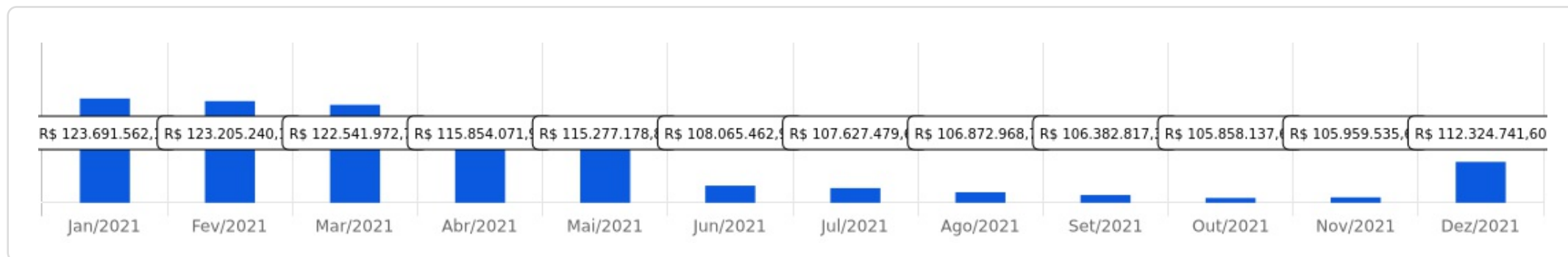
Rentabilidade
Mês Acum.
0,70% -5,18%

Meta
Mês Acum.
1,15% 15,74%

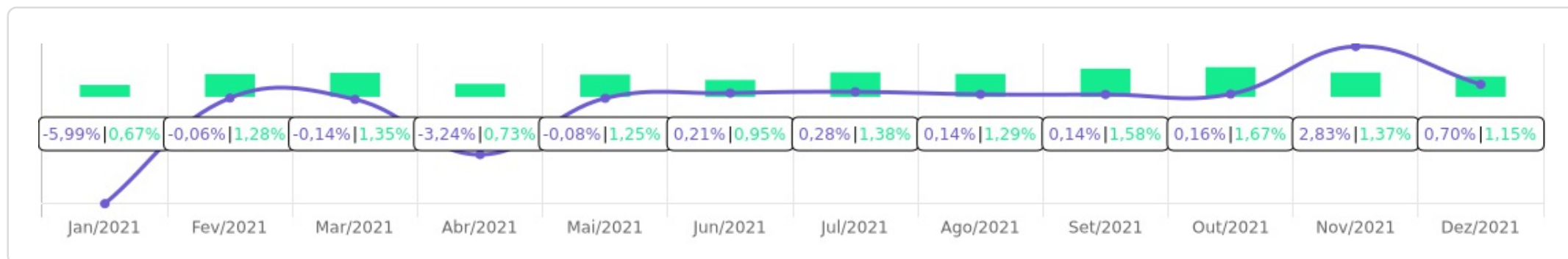
Gap
Mês Acum.
-0,45p.p. -20,92p.p.

VaR_{1,252}
0,83%

Evolução do Patrimônio






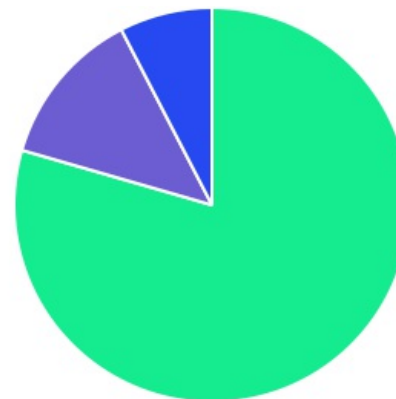
Comparativo (Rentabilidades | Metas)










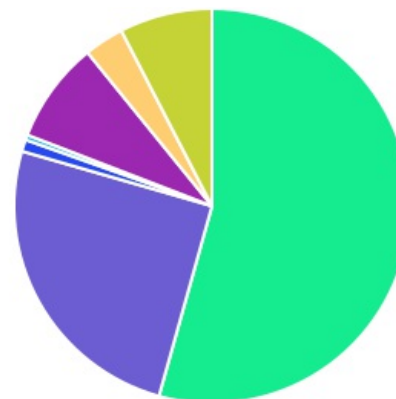
ATIVO	SALDO	CARTEIRA(%)	RESG.	3.922	RETORNO (R\$)	(%)	TX ADM
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RF PREVID	R\$ 10.691.122,52	9,52%	D+1	7, I "b"	R\$ -42.767,90	-0,40%	0,30%
BRDESCO IDKA PRÉ 2 FI RF	R\$ 1.253.656,58	1,12%	D+0	7, I "b"	R\$ -45.847,50	-3,53%	0,20%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF	R\$ 13.385.224,28	11,92%	D+0	7, I "b"	R\$ 471.913,43	2,70%	0,20%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RF	R\$ 20.074.845,76	17,87%	D+0	7, I "b"	R\$ 201.031,73	-0,07%	0,40%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP FI RF	R\$ 4.738.173,55	4,22%	D+0	7, I "b"	R\$ -247.521,20	-4,48%	0,20%
BNB RPPS IMA-B FI RF	R\$ 1.218.624,97	1,08%	D+3	7, I "b"	R\$ -12.094,91	-0,98%	2,00%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP FI RF	R\$ 9.655.029,29	8,60%	D+0	7, I "b"	R\$ 275.370,68	2,94%	0,20%
BB MAIS AUTOMÁTICO FIC RENDA FIXA SIMPL...	R\$ 6.760,71	0,01%	D+0	7, IV "a"	R\$ 1.210,37	1,82%	1,75%
BB FLUXO FIC RF PREVID	R\$ 12.160.949,78	10,83%	D+0	7, IV "a"	R\$ 291.690,70	2,39%	1,00%
BNB PLUS FIC RF LP	R\$ 1.463.644,88	1,30%	D+1	7, IV "a"	R\$ 59.384,06	4,23%	0,50%
CATÂNIA FI RF LP	R\$ 13.306.667,50	11,85%	D+30	7, IV "a"	R\$ -8.339.147,54	-38,53%	1,26%
CAIXA PRÁTICO FIC RF CURTO PRAZO	R\$ 0,02	0,00%	D+0	7, IV "a"	R\$ 289,17	2,38%	1,70%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RF	R\$ 956.954,82	0,85%	D+0	7, IV "a"	R\$ 43.822,27	3,08%	0,80%
CAIXA BRASIL FI RF REF DI LP	R\$ 357.053,11	0,32%	D+0	7, IV "a"	R\$ 101.401,65	4,48%	0,20%
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RF	R\$ 5.372,87	0,00%	D+0	7, IV "a"	R\$ 195.847,71	4,52%	0,20%
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	R\$ 1.084.932,15	0,97%	D+3	8, II "a"	R\$ -73.668,65	-6,36%	2,00%
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉD...	R\$ 470.257,64	0,42%	D+1	8, III	R\$ -52.191,78	-1,99%	1,50%
FP2 MULTIESTRATÉGIA FIP	R\$ 6.679.152,61	5,95%	VR	8, IV "a"	R\$ 58,00	0,00%	1,00%
AUSTRO MULTISSETORIAL FIP MULTIESTRATÉ...	R\$ 2.657.602,11	2,37%	-	8, IV "a"	R\$ 2.657.602,11	-0,28%	1,50%
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL F...	R\$ 3.645.670,51	3,25%	VR	8, IV "b"	R\$ -555.603,52	-13,22%	2,00%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	R\$ 8.513.045,93	7,58%	D+3	9 - A, III	R\$ 1.990.068,76	30,51%	0,70%
Total investimentos	R\$ 112.324.741,59	100,00%			R\$ -7.298.923,17	-5,18%	










Disponibilidade	R\$ 0,00	-	-	-
Total patrimônio	R\$ 112.324.741,59	100.00%	-	-

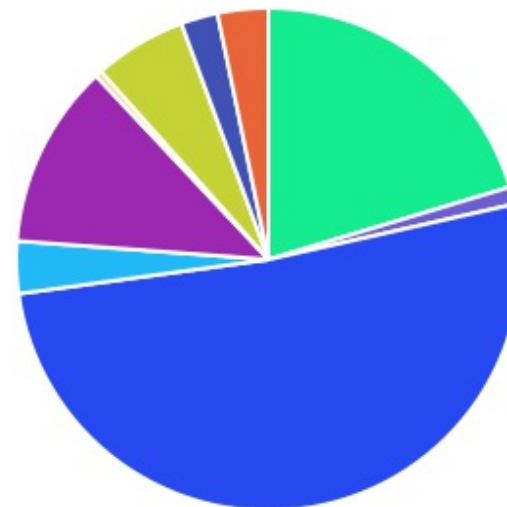
CLASSE	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Renda Fixa	79,48%	R\$ 89.274.080,64	
Renda Variável	12,94%	R\$ 14.537.615,02	
Investimentos no Exterior	7,58%	R\$ 8.513.045,93	
Total	100,00%	R\$ 112.324.741,59	










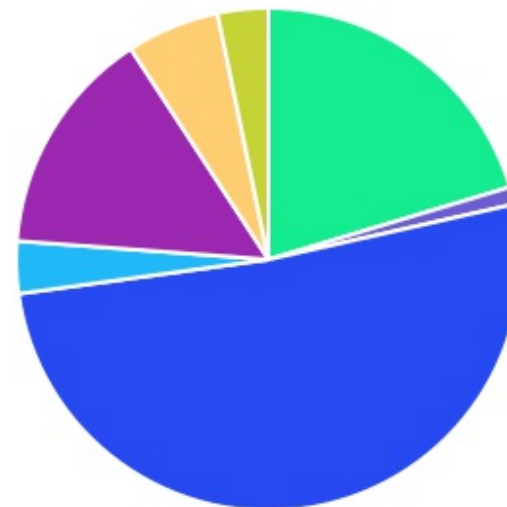
ENQUADRAMENTO	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	54,32%	R\$ 61.016.676,95	
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea "a"	25,16%	R\$ 28.257.403,69	
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	8,31%	R\$ 9.336.754,72	
Artigo 9º - A, Inciso III	7,58%	R\$ 8.513.045,93	
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	3,25%	R\$ 3.645.670,51	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	0,97%	R\$ 1.084.932,15	
Artigo 8º, Inciso III	0,42%	R\$ 470.257,64	
Total	100,00%	R\$ 112.324.741,59	













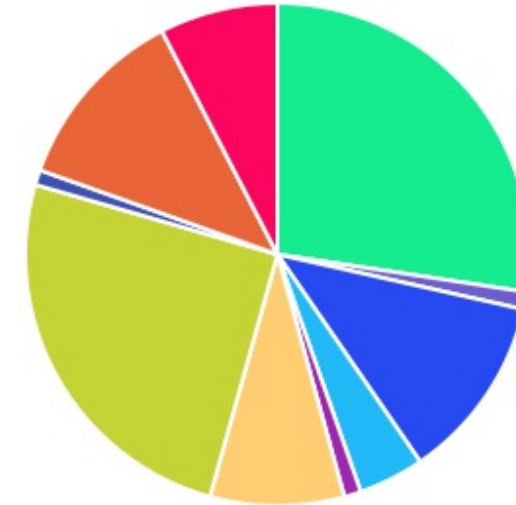
GESTOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
CAIXA DISTRIBUIDORA	51,36%	R\$ 57.685.699,63	
BB GESTAO	20,35%	R\$ 22.858.833,01	
ARENA CAPITAL	11,85%	R\$ 13.306.667,50	
LAD CAPITAL	5,95%	R\$ 6.679.152,61	
BANCO DO NORDESTE	3,35%	R\$ 3.767.202,00	
OURO PRETO	3,25%	R\$ 3.645.670,51	
RENDA ASSET	2,37%	R\$ 2.657.602,11	
BRAM - BRADESCO	1,12%	R\$ 1.253.656,58	
VCM GESTÃO	0,42%	R\$ 470.257,64	
Total	100,00%	R\$ 112.324.741,59	





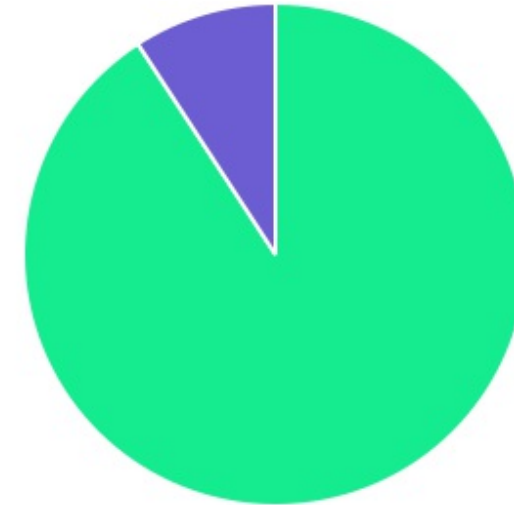
ADMINISTRADOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
CAIXA ECONOMICA	51,36%	R\$ 57.685.699,63	
BB GESTAO	20,35%	R\$ 22.858.833,01	
BFL ADMINISTRAÇÃO	14,63%	R\$ 16.434.527,25	
LAD CAPITAL	5,95%	R\$ 6.679.152,61	
SANTANDER CACEIS	3,35%	R\$ 3.767.202,00	
PLANNER CORRETORA	3,25%	R\$ 3.645.670,51	
BANCO BRADESCO	1,12%	R\$ 1.253.656,58	
Total	100,00%	R\$ 112.324.741,59	



BENCHMARK	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
IMA Geral ex-C	27,39%	R\$ 30.765.968,28	
CDI	25,16%	R\$ 28.257.403,69	
IPCA	11,98%	R\$ 13.452.682,87	
IRF-M 1	11,92%	R\$ 13.385.224,28	
IDKA IPCA 2A	8,60%	R\$ 9.655.029,29	
GLOBAL BDRX	7,58%	R\$ 8.513.045,93	
IRF-M 1+	4,22%	R\$ 4.738.173,55	
IDKA PRÉ 2A	1,12%	R\$ 1.253.656,58	
IMA-B	1,08%	R\$ 1.218.624,97	
IBOVESPA	0,97%	R\$ 1.084.932,15	
Total	100,00%	R\$ 112.324.741,59	



LIQUIDEZ	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
0 a 30 dias	90,81%	R\$ 101.999.918,47	
(vide regulamento)	9,19%	R\$ 10.324.823,12	
Total	100,00%	R\$ 112.324.741,59	



RENDA FIXA	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Títulos Tesouro Nacional - SELIC - 7, I "a"	100%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	2,00%	100,00%
FI Renda Fixa Referenciado 100% títulos TN - 7, I "b"	100%	R\$ 61.016.676,95	54.32%	30,00%	50,00%	100,00%
FI em Índices de Renda Fixa 100% títulos TN - 7, I "c"	100%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	100,00%
Operações Compromissadas - 7, II	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	5,00%
FI Renda Fixa Referenciados - 7, III "a"	60%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	60,00%
FI de Índices Renda Fixa - 7, III "b"	60%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	60,00%
FI de Renda Fixa - 7, IV "a"	40%	R\$ 28.257.403,69	25.16%	0,00%	20,00%	40,00%
FI de Índices Renda Fixa - 7, IV "b"	40%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	40,00%
Letras Imobiliárias Garantidas - 7, V "b"	20%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	20,00%
Certificados de Depósitos Bancários (CDB) - 7, VI "a"	15%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	15,00%
Poupança - 7, VI "b"	15%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	15,00%
FI Direitos Creditórios (FIDC) - sênior - 7, VII "a"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	5,00%
FI Renda Fixa "Crédito Privado" - 7, VII "b"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	5,00%
FI Debêntures - 7, VII "c"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa		R\$ 89.274.080,64	79,48%			

RENDA VARIÁVEL	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Ações Referenciados - 8, I "a"	30%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%
FI de Índices Ações Referenciados - 8, I "b"	30%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%
FI em Ações Livre - 8, II "a"	20%	R\$ 1.084.932,15	0,97%	0,00%	4,00%	20,00%
FI de Índices em Ações Livre - 8, II "b"	20%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%
FI Multimercado - 8, III	10%	R\$ 470.257,64	0,42%	0,00%	4,00%	10,00%
FI em Participações - 8, IV "a"	5%	R\$ 9.336.754,72	8,31%	0,00%	8,00%	5,00%
FI Imobiliário - 8, IV "b"	5%	R\$ 3.645.670,51	3,25%	0,00%	3,00%	5,00%
Total Renda Variável		R\$ 14.537.615,02	12,94%			
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Renda Fixa - Dívida Externa - 9 - A, I	10%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%
Investimento no Exterior - 9 - A, II	10%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%
Ações - BDR Nível I - 9 - A, III	10%	R\$ 8.513.045,93	7,58%	0,00%	3,00%	10,00%
Total Investimentos no exterior		R\$ 8.513.045,93	7,58%			
Total Global		R\$ 112.324.741,59	100,00%			

PERÍODO	SALDO ANTERIOR	SALDO FINAL	META	RENT.(R\$)	RENT.(%)	GAP
2021			IPCA + 5.16% a.a.			
Janeiro	R\$ 129.115.270,05	R\$ 123.691.562,18	0,67%	R\$ -7.907.806,31	-5,99%	-6,66p.p.
Fevereiro	R\$ 123.691.562,18	R\$ 123.205.240,16	1,28%	R\$ -74.170,78	-0,06%	-1,34p.p.
Março	R\$ 123.205.240,16	R\$ 122.541.972,76	1,35%	R\$ -169.258,73	-0,14%	-1,49p.p.
Abril	R\$ 122.541.972,76	R\$ 115.854.071,98	0,73%	R\$ -3.854.711,03	-3,24%	-3,97p.p.
Maio	R\$ 115.854.071,98	R\$ 115.277.178,87	1,25%	R\$ -82.584,70	-0,08%	-1,33p.p.
Junho	R\$ 115.277.178,87	R\$ 108.065.462,99	0,95%	R\$ 233.039,84	0,21%	-0,74p.p.
Julho	R\$ 108.065.462,99	R\$ 107.627.479,64	1,38%	R\$ 313.668,63	0,28%	-1,10p.p.
Agosto	R\$ 107.627.479,64	R\$ 106.872.968,77	1,29%	R\$ 154.532,64	0,14%	-1,15p.p.
Setembro	R\$ 106.872.968,77	R\$ 106.382.817,35	1,58%	R\$ 149.635,79	0,14%	-1,44p.p.
Outubro	R\$ 106.382.817,35	R\$ 105.858.137,64	1,67%	R\$ 153.684,89	0,16%	-1,51p.p.
Novembro	R\$ 105.858.137,64	R\$ 105.959.535,61	1,37%	R\$ 3.009.857,50	2,83%	1,46p.p.
Dezembro	R\$ 105.959.535,61	R\$ 112.324.741,60	1,15%	R\$ 775.189,09	0,70%	-0,45p.p.
Total	R\$ 105.959.535,61	R\$ 112.324.741,60	15,74%	R\$ -7.298.923,17	-5,18%	-20,92p.p.

ATIVO	CNPJ	RENTABILIDADE		
		1º Semestre	2º Semestre	Ano
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP FI...	10.577.519/0001-90	-3,43%	-1,92%	-4,48%
BB FLUXO FIC RF PREVID	13.077.415/0001-05	0,66%	0,77%	2,39%
CAIXA BRASIL FI RF REF DI...	03.737.206/0001-97	1,16%	1,37%	4,48%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES...	14.508.643/0001-55	0,75%	0,88%	3,08%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RF PREVID	25.078.994/0001-90	-0,68%	-0,70%	-0,40%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RF	23.215.097/0001-55	0,72%	-1,83%	-0,07%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI...	10.740.670/0001-06	0,70%	0,89%	2,70%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP...	14.386.926/0001-71	-	2,94%	2,94%
CAIXA PRÁTICO FIC RF CURTO PRAZO	00.834.074/0001-23	0,42%	0,68%	2,38%
BNB PLUS FIC RF LP	06.124.241/0001-29	1,03%	1,29%	4,23%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR...	17.502.937/0001-68	8,36%	7,72%	30,51%
BNB RPPS IMA-B FI RF	08.266.261/0001-60	-0,68%	-1,28%	-0,98%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RF	24.022.566/0001-82	-2,17%	-1,80%	-3,53%
CAIS MAUÁ DO BRASIL FIP	17.213.821/0001-09	-100,00%	-	-100,00%
JT PREV DESENVOLVIMENTO...	23.876.086/0001-16	-5,31%	0,93%	-13,22%
SICÍLIA FI RF LP	17.213.849/0001-46	-0,00%	-	-100,00%
OSLO FI MULTIMERCADO...	17.412.812/0001-47	-0,48%	-	-0,48%
FP2 MULTIESTRATÉGIA FIP...	20.886.575/0001-60	-0,01%	0,01%	0,00%
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	63.375.216/0001-51	3,93%	-7,51%	-6,36%
CATÂNIA FI RF LP	17.517.779/0001-10	-37,80%	-0,65%	-38,53%
BB MAIS AUTOMÁTICO FIC RENDA FIXA...	05.102.500/0001-58	0,25%	0,61%	1,82%

AUSTRO MULTIPAR FIC...	18.366.002/0001-64	-0,42%	-0,89%	-1,99%
AUSTRO MULTISSETORIAL FIP...	12.231.743/0001-51	-	-0,28%	-0,28%
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RF	23.215.008/0001-70	1,13%	1,45%	4,52%

TÍTULO	VENC.	COMPRA	QTD.	P.U. COMPRA	ATUAL	MARCAÇÃO	VALOR COMPRA	VALOR ATUAL	RETORNO
Total Públicos							R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00 (0,00%)
Total Privados							R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00 (0,00%)
Total Global							R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00 (0,00%)