

Relatório de Análise, Enquadramento, Rentabilidade e Risco - Base: 31/03/2021 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)								
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,50%	-0,05%	-0,05%	3,00%	8,57%	18,47%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,37%	0,00%	0,00%	3,22%	8,63%	17,08%	1,69%	0,02%
	0,37%	-0,03%	-0,03%	3,02%	8,45%	17,16%	1,73%	0,02%
IMA Geral (Benchmark)								
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,58%	-1,32%	-1,52%	1,50%	4,98%	13,88%	-	-
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,39%	-1,67%	-1,67%	1,13%	4,17%	12,58%	1,54%	0,03%
	-0,44%	-1,71%	-1,71%	1,09%	3,90%	12,24%	1,51%	0,03%
IMA-B 5+ (Benchmark)								
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,17%	-5,10%	-5,10%	4,90%	12,01%	21,24%	-	-
	-1,20%	-5,15%	-5,15%	4,87%	11,75%	20,41%	4,61%	0,13%
IRF-M 1 (Benchmark)								
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,04%	0,13%	0,13%	0,83%	2,51%	9,33%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,02%	0,05%	0,05%	0,68%	2,12%	8,66%	0,21%	0,01%
	0,01%	0,05%	0,05%	0,70%	2,27%	8,88%	0,21%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)								
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,34%	-0,15%	-0,15%	3,23%	8,50%	18,63%	-	-
	0,31%	-0,23%	-0,23%	3,08%	8,20%	17,97%	1,76%	0,03%
IMA-B (Benchmark)								
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,46%	-2,81%	-2,81%	4,17%	10,39%	20,48%	-	-
	-0,48%	-2,85%	-2,85%	4,08%	10,09%	19,91%	3,15%	0,08%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CARX NEN C 50,00% BIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IIRJA-B LP	-0,40%	-0,90%	-2,85%	4,00%	10,00%	19,55%	3,15%	0,03%
CARX NEN C 50,00% BIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IIRJA-B LP	-0,40%	-0,90%	-2,85%	4,07%	10,15%	19,59%	3,15%	0,03%

CDI (Benchmark)	0,20%	0,49%	0,49%	0,96%	2,22%	7,78%	-
Caixa Brasil FI Renda Fixa Referenciado DI LP	0,10%	0,34%	0,34%	0,98%	1,96%	7,05%	0,00%
BB Perfil FIC Renda Fixa Referenciado LP	0,24%	0,50%	0,50%	1,07%	2,31%	7,23%	0,00%

IPCA (Benchmark)		0,93%	2,05%	2,05%	5,25%	6,10%	9,60%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO		-0,35%	-1,73%	-1,73%	1,86%	4,77%	-	1,94%	0,04%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP		0,33%	-0,11%	-0,11%	1,46%	-	-	1,32%	-

Não Informado (Benchmark)									
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA		-	-	-	-	-	-	-	-
		0,30%	-0,18%	-0,18%	1,86%	5,09%	19,24%	1,36%	0,03%

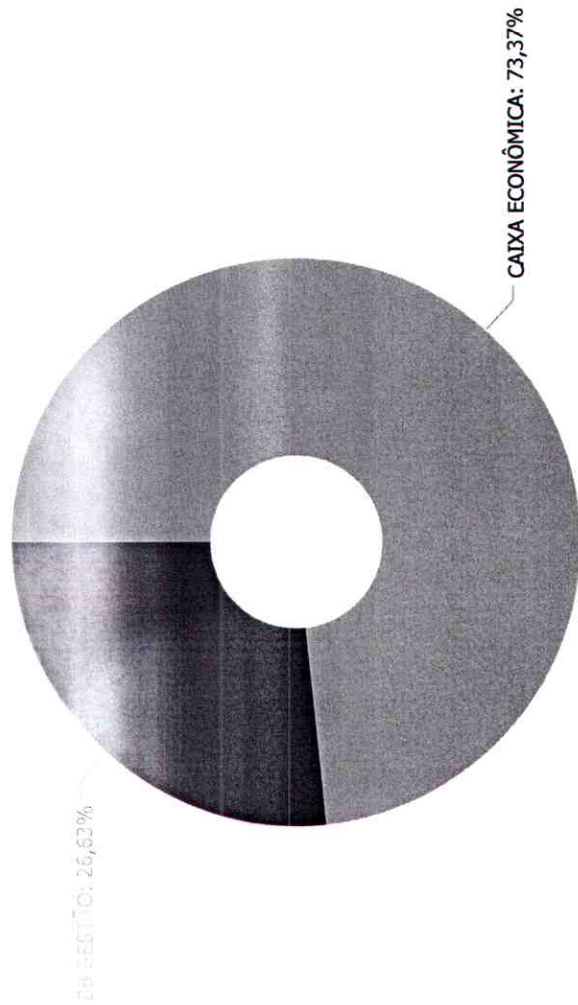
Relatório de Performance - 30 de Março de 2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	6,00%	-2,00%	-2,00%	23,29%	59,73%	22,24%	-	-
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	8,63%	-2,00%	-2,60%	28,56%	57,70%	29,30%	10,16%	0,25%

CDI (Benchmark)	0,20%	0,49%	0,49%	0,96%	2,22%	7,78%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,37%	0,71%	0,71%	4,97%	11,02%	18,17%	2,23%	0,04%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,26%	0,04%	0,04%	2,71%	6,37%	10,17%	0,95%	0,03%

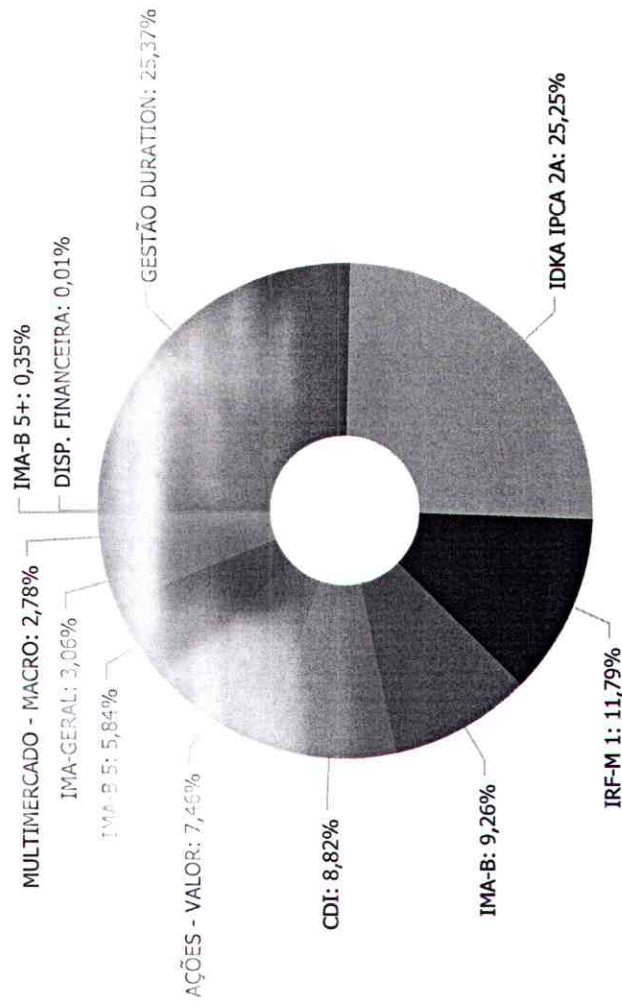
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	5,09%	-2,68%	-2,68%	17,77%	52,20%	37,89%	11,00%	0,23%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Março / 2021)



CAIXA ECONÔMICA	190.340.015,97
BB GESTÃO	69.080.712,24

Relatório de Análise de Risco e Retorno - Base: 31/03/2021



GESTÃO DURATION	65.816.942,17
IDKA IPCA 2A	65.514.178,73
IRF-M 1	30.589.352,44
IMA-B	24.029.505,60
CDI	22.886.838,91
AÇÕES - VALOR	19.367.222,82
IMA-B 5	15.148.693,53
IMA-GERAL	7.950.512,22
MULTIMERCADO - MACRO	7.207.150,80
IMA-B 5+	910.330,99
DISP. FINANCEIRA	27.596,89

Relatório de Administração - Rendimentos acumulados no ano de 2021

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Jan/21	236.226.545,48	8.223.106,00	1.805.524,64	244.832.527,86	-810.798,98	-810.798,98	-0,33%	-0,33%	0,67%	0,67%	-49,26%	1,73%
Fev/21	244.832.527,86	7.668.269,91	1.827.181,92	248.569.408,07	-2.104.507,78	-2.915.306,76	-0,84%	-1,17%	1,24%	1,92%	-60,81%	1,77%
Mar/21	248.569.408,07	7.933.776,47	1.742.429,47	255.739.170,99	1.528.415,92	-1.386.890,84	0,60%	-0,57%	1,42%	3,36%	-17,03%	2,15%

Investimentos X Meta de Rentabilidade

