



# MILAGRES

 Março/2022



<p>Patrimônio</p> <p><b>R\$ 33.170.581,59</b></p>	<p>Rentabilidade</p> <p>Mês: 2,08%</p> <p>Acum.: 4,94%</p>	<p>Meta</p> <p>Mês: 2,02%</p> <p>Acum.: 17,19%</p>	<p>Gap</p> <p>Mês: 0,07%</p> <p>Acum.: -12,25%</p>	<p>VaR</p> <p>0,35%</p>
---	--	--	--	-------------------------





Evolução do Patrimônio (Últimos 12 meses)

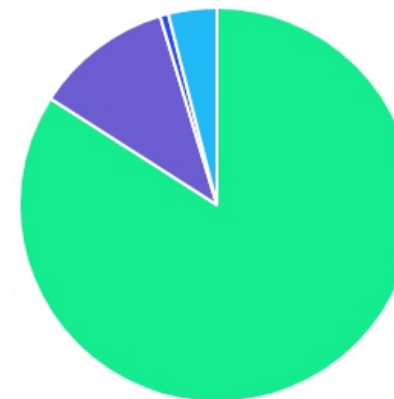







Comparativo (Rentabilidades | Metas) (Últimos 12 meses)

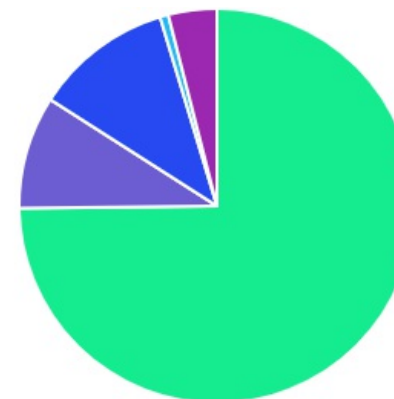






ATIVO	SALDO	CARTEIRA(%)	RESG.	4.963	RETORNO (R\$)	(%)
BNB RPPS IMA-B FI RF	R\$ 2.930.587,11	8.84%	D+1	7, I "b"	R\$ 83.496,25	2,93%
BB IRF-M 1 TP FIC RF...	R\$ 4.452.666,21	13.42%	D+0	7, I "b"	R\$ 38.789,41	0,85%
BB IDKA 2 TP FI RF...	R\$ 3.623.039,07	10.92%	D+1	7, I "b"	R\$ 92.505,71	2,62%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RF PREVID	R\$ 4.353.903,87	13.13%	D+1	7, I "b"	R\$ 57.671,92	1,34%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI...	R\$ 2.449.064,68	7.38%	D+0	7, I "b"	R\$ 21.024,52	0,87%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RF	R\$ 4.185.705,62	12.62%	D+0	7, I "b"	R\$ 34.216,10	0,82%
BB IMA-B 5 FIC RF PREVID...	R\$ 2.823.619,30	8.51%	D+1	7, I "b"	R\$ 70.982,04	2,58%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC...	R\$ 1.371.695,34	4.14%	D+3	7, III "a"	R\$ 18.418,07	1,36%
BNB INSTITUCIONAL FIC RF REF DI	R\$ 1.164.563,38	3.51%	D+0	7, III "a"	R\$ 10.533,43	0,91%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA...	R\$ 528.755,49	1.59%	D+1	7, III "a"	R\$ 6.080,04	1,16%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVID	R\$ 665.149,01	2.01%	D+3	8, I	R\$ 38.217,98	6,10%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	R\$ 923.555,78	2.78%	D+3	8, I	R\$ 82.124,97	9,76%
ITAÚ DUNAMIS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	R\$ 2.154.973,02	6.50%	D+23	8, I	R\$ 113.119,32	5,54%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI...	R\$ 226.403,03	0.68%	D+3	9, III	R\$ -9.708,41	-4,11%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVID	R\$ 1.005.107,66	3.03%	D+5	10, I	R\$ 15.375,81	1,55%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	R\$ 309.699,50	0.93%	D+3	10, I	R\$ 8.057,95	2,67%
<b>Total investimentos</b>	<b>R\$ 33.168.488,07</b>	<b>100.00%</b>			<b>R\$ 680.905,11</b>	<b>2,08%</b>
Disponibilidade	R\$ 2.093,52	-			-	-
<b>Total patrimônio</b>	<b>R\$ 33.170.581,59</b>	<b>100.00%</b>			<b>-</b>	<b>-</b>

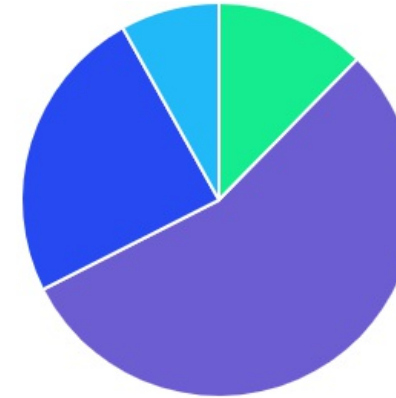
CLASSE	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Renda Fixa	84,07%	R\$ 27.883.600,07	
Renda Variável	11,29%	R\$ 3.743.677,81	
Estruturados	3,96%	R\$ 1.314.807,16	
Exterior	0,68%	R\$ 226.403,03	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 33.168.488,07</b>	







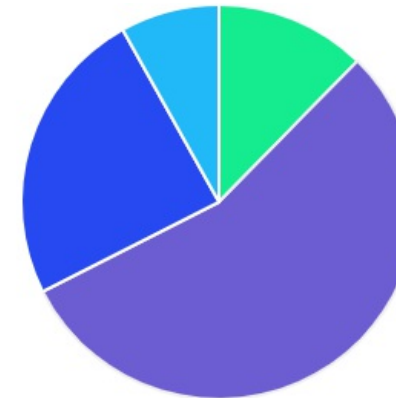
ENQUADRAMENTO	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	74,83%	R\$ 24.818.585,86	
Artigo 8º, Inciso I	11,29%	R\$ 3.743.677,81	
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	9,24%	R\$ 3.065.014,21	
Artigo 10º, Inciso I	3,96%	R\$ 1.314.807,16	
Artigo 9º, Inciso III	0,68%	R\$ 226.403,03	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 33.168.488,07</b>	














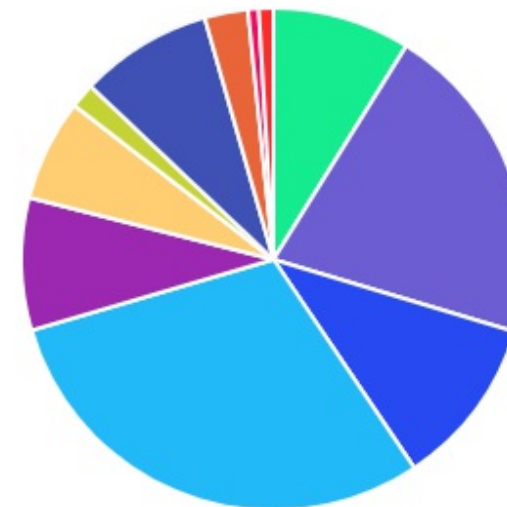
GESTOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
BB GESTAO	55,16%	R\$ 18.295.180,46	
CAIXA DISTRIBUIDORA	24,40%	R\$ 8.094.428,61	
BANCO DO NORDESTE	12,35%	R\$ 4.095.150,49	
ITAU UNIBANCO	8,09%	R\$ 2.683.728,51	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 33.168.488,07</b>	



ADMINISTRADOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
BB GESTAO	55,16%	R\$ 18.295.180,46	
CAIXA ECONOMICA	24,40%	R\$ 8.094.428,61	
SANTANDER CACEIS	12,35%	R\$ 4.095.150,49	
ITAU UNIBANCO	8,09%	R\$ 2.683.728,51	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 33.168.488,07</b>	



BENCHMARK	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
IMA Geral ex-C	29,88%	R\$ 9.911.304,83	
IRF-M 1	20,81%	R\$ 6.901.730,89	
IDKA IPCA 2A	10,92%	R\$ 3.623.039,07	
IMA-B	8,84%	R\$ 2.930.587,11	
IMA-B 5	8,51%	R\$ 2.823.619,30	
IBOVESPA	8,50%	R\$ 2.820.122,03	
CDI	6,54%	R\$ 2.169.671,04	
IDIV	2,78%	R\$ 923.555,78	
IPCA	1,59%	R\$ 528.755,49	
125% do CDI	0,93%	R\$ 309.699,50	
GLOBAL BDRX	0,68%	R\$ 226.403,03	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 33.168.488,07</b>	



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%	4,00%	100,00%
FI Renda Fixa Referenciado 100% títulos TN - 7, I "b"	100%	R\$ 24.818.585,86	74.83%	40,00%	55,00%	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 - 7, III "a"	60%	R\$ 3.065.014,21	9.24%	0,00%	10,00%	60,00%
FI de Índices Renda Fixa - 7, III "b"	60%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	60,00%
Ativos Bancários - 7, IV	20%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	3,00%	20,00%
FI Direitos Creditórios (FIDC) - sênior - 7, V "a"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	5,00%
FI Renda Fixa "Crédito Privado" - 7, V "b"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	5,00%
FI Debêntures - 7, V "c"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>		<b>R\$ 27.883.600,07</b>	<b>84,07%</b>			
RENDA VARIÁVEL	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Ações - 8, I	30%	R\$ 3.743.677,81	11.29%	0,00%	10,00%	30,00%
FI de Índices Ações - 8, II	30%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	30,00%
<b>Total Renda Variável</b>		<b>R\$ 3.743.677,81</b>	<b>11,29%</b>			
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Renda Fixa - Dívida Externa - 9, I	10%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	10,00%
FI Investimento no Exterior - 9, II	10%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	10,00%

FI Ações – BDR Nível I - 9, III	10%	R\$ 226.403,03	0.68%	0,00%	4,00%	10,00%
Total Investimentos no Exterior		R\$ 226.403,03	0,68%			



FUNDOS ESTRUTURADOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Multimercado - aberto - 10, I	10%	R\$ 1.314.807,16	3,96%	0,00%	5,00%	10,00%
FI em Participações - 10, II	5%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%
FI "Ações - Mercado de Acesso" - 10, III	5%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%
<b>Total Fundos Estruturados</b>		<b>R\$ 1.314.807,16</b>	<b>3,96%</b>			
FUNDOS IMOBILIÁRIOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Imobiliário - 11	5%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%
<b>Total Fundos Imobiliários</b>		<b>R\$ 0,00</b>	<b>0,00%</b>			
EMPRÉSTIMOS CONSIGNADOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Empréstimos Consignados - 12	5%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	3,00%	5,00%
<b>Total Empréstimos Consignados</b>		<b>R\$ 0,00</b>	<b>0,00%</b>			
<b>Total Global</b>		<b>R\$ 33.168.488,07</b>	<b>100,00%</b>			

PERÍODO	SALDO ANTERIOR	SALDO FINAL	META	RENT.(R\$)	RENT.(%)	GAP
			2022			
			IPCA + 4.88% a.a.			
Janeiro	R\$ 29.210.886,53	R\$ 31.129.493,79	0,94%	R\$ 210.438,52	0,67%	-0,27%
Fevereiro	R\$ 31.129.493,79	R\$ 31.846.009,15	1,41%	R\$ 165.983,72	0,53%	-0,88%
Março	R\$ 31.846.009,15	R\$ 33.168.488,07	2,02%	R\$ 680.905,11	2,08%	0,07%
<b>Total</b>	<b>R\$ 31.846.009,15</b>	<b>R\$ 33.168.488,07</b>	<b>4,44%</b>	<b>R\$ 1.057.327,35</b>	<b>3,31%</b>	<b>-1,13%</b>
			2021			
			IPCA + 5.43% a.a.			
Janeiro	R\$ 0,00	R\$ 23.600.809,87	0,69%	R\$ 23.207.957,90	-0,90%	-1,59%
Fevereiro	R\$ 23.600.809,87	R\$ 23.831.867,38	1,30%	R\$ -320.699,60	-1,30%	-2,60%
Março	R\$ 23.831.867,38	R\$ 24.559.912,91	1,37%	R\$ 211.217,57	0,89%	-0,48%
Abril	R\$ 24.559.912,91	R\$ 25.360.127,52	0,75%	R\$ 285.354,80	1,15%	0,40%
Maiο	R\$ 25.360.127,52	R\$ 26.143.314,53	1,27%	R\$ 273.333,66	1,06%	-0,21%
Junho	R\$ 26.143.314,53	R\$ 26.651.734,24	0,97%	R\$ 21.816,95	0,09%	-0,89%
Julho	R\$ 26.651.734,24	R\$ 27.110.461,21	1,40%	R\$ -137.477,86	-0,50%	-1,90%
Agosto	R\$ 27.110.461,21	R\$ 27.470.029,38	1,31%	R\$ -132.277,37	-0,48%	-1,79%
Setembro	R\$ 27.470.029,38	R\$ 27.887.000,24	1,60%	R\$ -82.957,71	-0,30%	-1,91%
Outubro	R\$ 27.887.000,24	R\$ 27.936.998,89	1,69%	R\$ -451.754,54	-1,58%	-3,27%
Novembro	R\$ 27.936.998,89	R\$ 28.779.386,26	1,39%	R\$ 384.041,43	1,37%	-0,02%
Dezembro	R\$ 28.779.386,26	R\$ 29.210.886,53	1,17%	R\$ 227.684,13	0,79%	-0,38%
<b>Total</b>	<b>R\$ 28.779.386,26</b>	<b>R\$ 29.210.886,53</b>	<b>16,04%</b>	<b>R\$ 23.486.239,36</b>	<b>0,23%</b>	<b>-15,81%</b>

ATIVO	CNPJ	RENTABILIDADE				
		Mês (%)	Ano (%)	12 meses (%)	24 meses (%)	Início (%)
BB IRF-M 1 TP FIC RF...	11.328.882/0001-35	0,85%	1,96%	2,09%	-	2,10%
BB IDKA 2 TP FI RF...	13.322.205/0001-35	2,62%	3,82%	4,74%	-	8,73%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RF PREVID	25.078.994/0001-90	1,34%	2,01%	-0,38%	-	1,85%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RF	23.215.097/0001-55	0,82%	2,32%	-0,09%	-	2,27%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI...	10.740.670/0001-06	0,87%	2,22%	2,70%	-	4,95%
BB IMA-B 5 FIC RF PREVID...	03.543.447/0001-03	2,58%	3,74%	8,60%	-	8,60%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI...	17.502.937/0001-68	-4,11%	-19,62%	-9,44%	-	-9,44%
BNB RPPS IMA-B FI RF	08.266.261/0001-60	2,93%	2,90%	-0,98%	-	1,89%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVID	10.418.335/0001-88	6,10%	14,11%	-11,53%	-	0,95%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	05.900.798/0001-41	9,76%	14,90%	3,63%	-	11,03%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	03.737.188/0001-43	2,67%	6,43%	-0,82%	-	5,55%
BNB INSTITUCIONAL FIC RF REF DI	21.307.581/0001-89	0,91%	2,47%	-	-	5,87%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC...	35.292.588/0001-89	1,36%	2,23%	0,60%	-	3,40%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVID	35.292.597/0001-70	1,55%	3,31%	1,40%	-	4,76%
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	16.718.302/0001-30	-	-	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA...	21.838.150/0001-49	1,16%	2,64%	-	-	5,75%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	42.318.981/0001-60	4,95%	12,19%	-	-	-4,67%
ITAÚ DUNAMIS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	36.347.815/0001-99	5,54%	7,75%	-	-	7,75%