



MILAGRES

 Agosto/2022

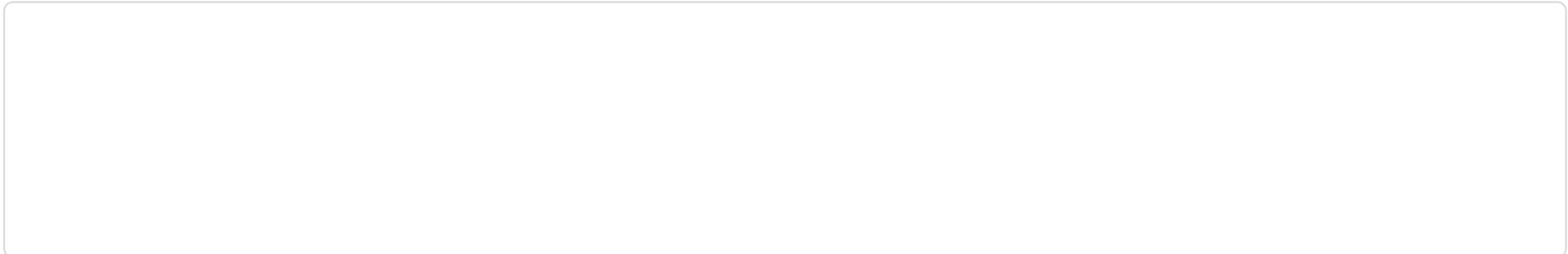


<p>Patrimônio</p> <p>R\$ 36.949.347,27</p>	<p>Rentabilidade</p> <table border="1"> <tr> <td>Mês</td> <td>Acum.</td> </tr> <tr> <td>0,98%</td> <td>5,52%</td> </tr> </table>	Mês	Acum.	0,98%	5,52%	<p>Meta</p> <table border="1"> <tr> <td>Mês</td> <td>Acum.</td> </tr> <tr> <td>0,04%</td> <td>14,23%</td> </tr> </table>	Mês	Acum.	0,04%	14,23%	<p>Gap</p> <table border="1"> <tr> <td>Mês</td> <td>Acum.</td> </tr> <tr> <td>0,95%</td> <td>-8,71%</td> </tr> </table>	Mês	Acum.	0,95%	-8,71%	<p>VaR</p> <p>0,35%</p>
Mês	Acum.															
0,98%	5,52%															
Mês	Acum.															
0,04%	14,23%															
Mês	Acum.															
0,95%	-8,71%															





Evolução do Patrimônio (Últimos 12 meses)

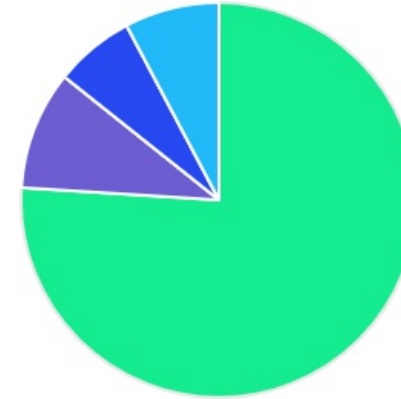







Comparativo (Rentabilidades | Metas) (Últimos 12 meses)

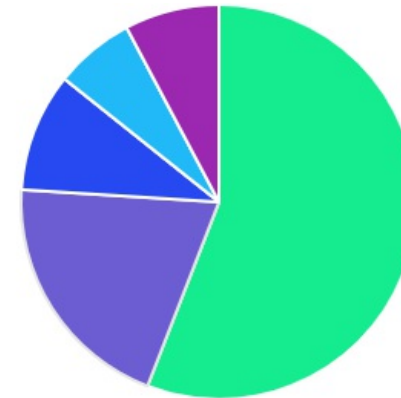






ATIVO	SALDO	CARTEIRA(%)	RESG.	4.963	RETORNO (R\$)	(%)
BNB RPPS IMA-B FI RF	R\$ 0,00	0.00%	D+1	7, I "b"	R\$ 44.811,42	1,04%
BB IRF-M 1 TP FIC RF...	R\$ 2.625.742,68	7.11%	D+0	7, I "b"	R\$ 31.848,53	1,16%
BB IDKA 2 TP FI RF...	R\$ 6.709.701,15	18.16%	D+1	7, I "b"	R\$ -2.991,18	-0,04%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI...	R\$ 205.037,36	0.55%	D+0	7, I "b"	R\$ 2.452,69	1,21%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RF	R\$ 4.388.545,75	11.88%	D+0	7, I "b"	R\$ 63.611,07	1,47%
BB IMA-B 5 FIC RF PREVID...	R\$ 6.719.304,30	18.19%	D+1	7, I "b"	R\$ 410,83	0,01%
BNB INSTITUCIONAL FIC RF REF DI	R\$ 4.229.353,80	11.45%	D+0	7, III "a"	R\$ 25.062,16	0,60%
BB PERFIL FIC RF REF DI...	R\$ 2.599.771,74	7.04%	D+0	7, III "a"	R\$ 30.403,48	1,18%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA...	R\$ 602.925,96	1.63%	D+1	7, III "a"	R\$ 2.925,96	0,49%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVID	R\$ 604.599,70	1.64%	D+3	8, I	R\$ 37.308,17	6,58%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	R\$ 887.006,88	2.40%	D+3	8, I	R\$ 35.250,22	4,14%
ITAÚ DUNAMIS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	R\$ 2.102.792,11	5.69%	D+23	8, I	R\$ 128.994,02	6,54%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI...	R\$ 2.415.146,92	6.54%	D+3	9, III	R\$ -136.532,72	-5,35%
CAIXA ESG FIC AÇÕES BDR NÍVEL...	R\$ 0,00	0.00%	D+3	9, III	R\$ 45.641,30	-1,35%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVID	R\$ 1.987.581,30	5.38%	D+5	10, I	R\$ 21.384,11	1,09%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	R\$ 316.366,85	0.86%	D+3	10, I	R\$ 10.843,94	3,55%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC...	R\$ 555.470,77	1.50%	D+1	10, I	R\$ 6.405,08	1,17%
Total investimentos	R\$ 36.949.347,27	100.00%			R\$ 347.829,08	0,98%
Disponibilidade	R\$ 0,00	-			-	-
Total patrimônio	R\$ 36.949.347,27	100.00%			-	-

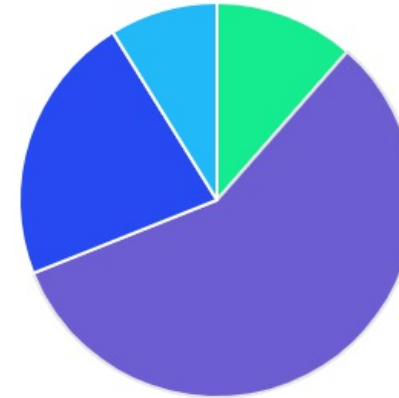
CLASSE	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Renda Fixa	76,00%	R\$ 28.080.382,74	
Renda Variável	9,73%	R\$ 3.594.398,69	
Estruturados	7,74%	R\$ 2.859.418,92	
Exterior	6,54%	R\$ 2.415.146,92	
Total	100,00%	R\$ 36.949.347,27	







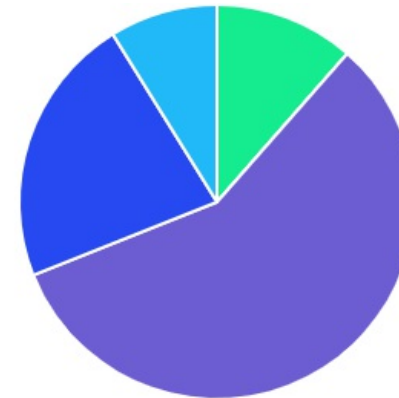
ENQUADRAMENTO	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	55,88%	R\$ 20.648.331,24	
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	20,11%	R\$ 7.432.051,50	
Artigo 8º, Inciso I	9,73%	R\$ 3.594.398,69	
Artigo 10º, Inciso I	7,74%	R\$ 2.859.418,92	
Artigo 9º, Inciso III	6,54%	R\$ 2.415.146,92	
Total	100,00%	R\$ 36.949.347,27	













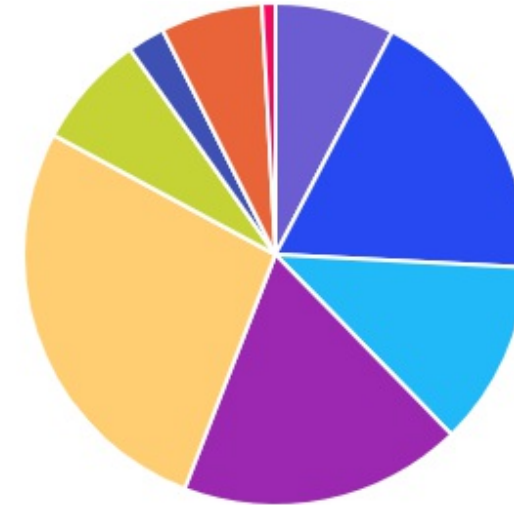
GESTOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
BB GESTAO	57,50%	R\$ 21.246.700,87	
CAIXA DISTRIBUIDORA	22,23%	R\$ 8.212.103,76	
BANCO DO NORDESTE	11,45%	R\$ 4.229.353,80	
ITAU UNIBANCO	8,83%	R\$ 3.261.188,84	
Total	100,00%	R\$ 36.949.347,27	



ADMINISTRADOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
BB GESTAO	57,50%	R\$ 21.246.700,87	
CAIXA ECONOMICA	22,23%	R\$ 8.212.103,76	
SANTANDER CACEIS	11,45%	R\$ 4.229.353,80	
ITAU UNIBANCO	8,83%	R\$ 3.261.188,84	
Total	100,00%	R\$ 36.949.347,27	



BENCHMARK	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
CDI	27,00%	R\$ 9.975.103,57	
IMA-B 5	18,19%	R\$ 6.719.304,30	
IDKA IPCA 2A	18,16%	R\$ 6.709.701,15	
IMA Geral ex-C	11,88%	R\$ 4.388.545,75	
IRF-M 1	7,66%	R\$ 2.830.780,04	
IBOVESPA	7,33%	R\$ 2.707.391,81	
GLOBAL BDRX	6,54%	R\$ 2.415.146,92	
IDIV	2,40%	R\$ 887.006,88	
125% do CDI	0,86%	R\$ 316.366,85	
IMA-B	0,00%	R\$ 0,00	
Total	100,00%	R\$ 36.949.347,27	



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\$ 20.648.331,24	55.88%	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\$ 7.432.051,50	20.11%	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%
Total Renda Fixa		R\$ 28.080.382,74	76,00%			
RENDA VARIÁVEL	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Ações - 8, I	30%	R\$ 3.594.398,69	9.73%	0,00%	10,00%	30,00%
FI de Índices Ações - 8, II	30%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	30,00%
Total Renda Variável		R\$ 3.594.398,69	9,73%			
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\$ 2.415.146,92	6.54%	0,00%	4,00%	10,00%
Total Investimentos no Exterior		R\$ 2.415.146,92	6,54%			

FUNDOS ESTRUTURADOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Multimercado - aberto - 10, I	10%	R\$ 2.859.418,92	7.74%	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%
Total Fundos Estruturados		R\$ 2.859.418,92	7,74%			
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%
Total Fundos Imobiliários		R\$ 0,00	0,00%			
EMPRÉSTIMOS CONSIGNADOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Empréstimos Consignados - 12	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	3,00%	5,00%
Total Empréstimos Consignados		R\$ 0,00	0,00%			
Total Global		R\$ 36.949.347,27	100,00%			

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%
Abril	R\$ 33.168.488,07	R\$ 33.796.965,57	1,46%	R\$ -9.171,65	-0,03%	-1,49%
Mai	R\$ 33.796.965,57	R\$ 34.755.015,83	0,87%	R\$ 360.166,26	1,04%	0,18%
Junho	R\$ 34.755.015,83	R\$ 34.925.943,90	1,07%	R\$ -291.222,44	-0,81%	-1,88%
Julho	R\$ 34.925.943,90	R\$ 35.992.089,70	-0,28%	R\$ 252.263,02	0,68%	0,97%
Agosto	R\$ 35.992.089,70	R\$ 36.949.347,27	0,04%	R\$ 347.829,08	0,98%	0,95%
Total	R\$ 35.992.089,70	R\$ 36.949.347,27	7,76%	R\$ 1.717.191,62	5,25%	-2,51%
			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%
Mai	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%
Total	R\$ 28.779.386,26	R\$ 29.210.886,53	16,04%	R\$ 23.486.239,36	0,23%	-15,81%

ATIVO	CNPJ	RENTABILIDADE				
		Mês (%)	Ano (%)	12 meses (%)	24 meses (%)	Início (%)
BB IRF-M 1 TP FIC RF...	11.328.882/0001-35	1,16%	6,53%	2,09%	-	3,71%
BB PERFIL FIC RF REF DI...	13.077.418/0001-49	1,18%	3,99%	-	-	3,99%
BB IDKA 2 TP FI RF...	13.322.205/0001-35	-0,04%	5,88%	4,74%	-	5,97%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RF PREVID	25.078.994/0001-90	1,21%	5,39%	-0,38%	-	5,23%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RF	23.215.097/0001-55	1,47%	6,96%	-0,09%	-	6,89%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI...	10.740.670/0001-06	1,21%	7,17%	2,70%	-	5,18%
BB IMA-B 5 FIC RF PREVID...	03.543.447/0001-03	0,01%	6,15%	8,60%	-	4,99%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI...	17.502.937/0001-68	-5,35%	-26,31%	-9,44%	-	-6,48%
BNB RPPS IMA-B FI RF	08.266.261/0001-60	1,04%	4,65%	-0,98%	-	3,62%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVID	10.418.335/0001-88	6,58%	3,72%	-11,53%	-	-8,24%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	05.900.798/0001-41	4,14%	10,35%	3,63%	-	6,64%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	03.737.188/0001-43	3,55%	8,72%	-0,82%	-	7,82%
BNB INSTITUCIONAL FIC RF REF DI	21.307.581/0001-89	0,60%	7,07%	7,74%	-	3,29%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC...	35.292.588/0001-89	1,15%	6,17%	0,60%	-	7,38%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA...	32.972.942/0001-28	0,49%	0,49%	-	-	0,49%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVID	35.292.597/0001-70	1,09%	6,68%	1,40%	-	5,45%
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	16.718.302/0001-30	-	-	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA...	21.838.150/0001-49	0,61%	6,77%	10,01%	-	10,01%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	42.318.981/0001-60	6,84%	4,10%	-	-	-11,54%
ITAÚ DUNAMIS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	36.347.815/0001-99	6,54%	5,14%	-	-	5,14%

CAIXA ESG FIC AÇÕES BDR NÍVEL...	43.760.251/0001-87	-1,35%	-2,45%	-	-	-1,89%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC...	00.973.117/0001-51	1,17%	4,00%	-	-	4,00%