

**DEPARTAMENTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO
MUNICÍPIO DE PORTO ALEGRE**

COMITÊ DE INVESTIMENTOS DO PREVIMPA

ATA Nº 26/2021

Reunião Ordinária 26/2021 - Comitê de Investimentos - PREVIMPA

Data e Hora	Local
14/09/2021 - 14 horas	Rua João Manuel, 50 - 10º andar - Sala de Reuniões - PREVIMPA
Participantes	
Rodrigo Machado Costa - Diretor Geral - Previmpa, Daniela Silveira Machado - Diretora Administrativo-Financeira - Previmpa, Dalvin Gabriel José de Souza - Chefe da Unidade de Investimentos - Previmpa, Rogério de Oliveira - Economista - Previmpa, e Roger Sotoriva Piccini - Administrador - Unidade de Investimento - Previmpa. Participou ainda da reunião o membro suplente Renan da Silva Aguiar - Chefe da Assessoria de Planejamento.	
Pauta:	
1 – Informes 2- Apresentação de resultados	
Resumo da Reunião	
Formado Quórum, Rodrigo declara a reunião aberta. Na primeira pauta, Rodrigo Informa que foi aprovado o recurso do FRAP para participar dos integrantes do comitê de investimentos e 3 conselheiros no evento GIRO de investimentos da ABIPEN, que será realizado em Porto Alegre. Dalvin informa que foi realizado os movimentos nos fundos de renda fixa, aprovados na última reunião. No segundo item de pauta. Foi feita a apresentação do Relatório dos Resultados dos Investimentos de Agosto/2021 pelo Dalvin, conforme documento anexo 15574578. A rentabilidade no mês ficou negativa em 0,6889%, e o acumulado do exercício negativo em 2,22%, frente a meta atuarial acumulada de 9,47%. Dalvin destacou a grande volatilidade do mercado de renda variável em função do risco político. Concluída a pauta, não havendo mais assuntos a serem debatidos, foi encerrada a sessão, nos termos desta Ata, que vai lida e assinada por todos.	
Encaminhamentos	
Pendências	



Documento assinado eletronicamente por **Renan da Silva Aguiar, Administrador(a)**, em 04/10/2021, às 17:13, conforme o art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006, e o Decreto Municipal 18.916/2015.



Documento assinado eletronicamente por **Daniela Silveira Machado, Diretor Administrativo-Financeiro**, em 14/10/2021, às 10:36, conforme o art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006, e o Decreto Municipal 18.916/2015.



Documento assinado eletronicamente por **Rogério de Oliveira, Economista**, em 22/10/2021, às 10:22, conforme o art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006, e o Decreto Municipal 18.916/2015.



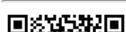
Documento assinado eletronicamente por **Dalvin Gabriel José de Souza, Chefe de Unidade**, em 29/10/2021, às 12:18, conforme o art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006, e o Decreto Municipal 18.916/2015.



Documento assinado eletronicamente por **Roger Sotoriva Piccini, Servidor Público**, em 29/10/2021, às 14:47, conforme o art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006, e o Decreto Municipal 18.916/2015.



Documento assinado eletronicamente por **Rodrigo Machado Costa, Diretor(a)-Geral**, em 29/10/2021, às 15:34, conforme o art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006, e o Decreto Municipal 18.916/2015.





A autenticidade do documento pode ser conferida no site
<http://sei.procempa.com.br/autenticidade/seipmpa> informando o código verificador **15574197**
e o código CRC **AF612EF2**.

21.13.000000274-0

15574197v8

Relatório de Resultados dos Investimentos do PREVIMPA

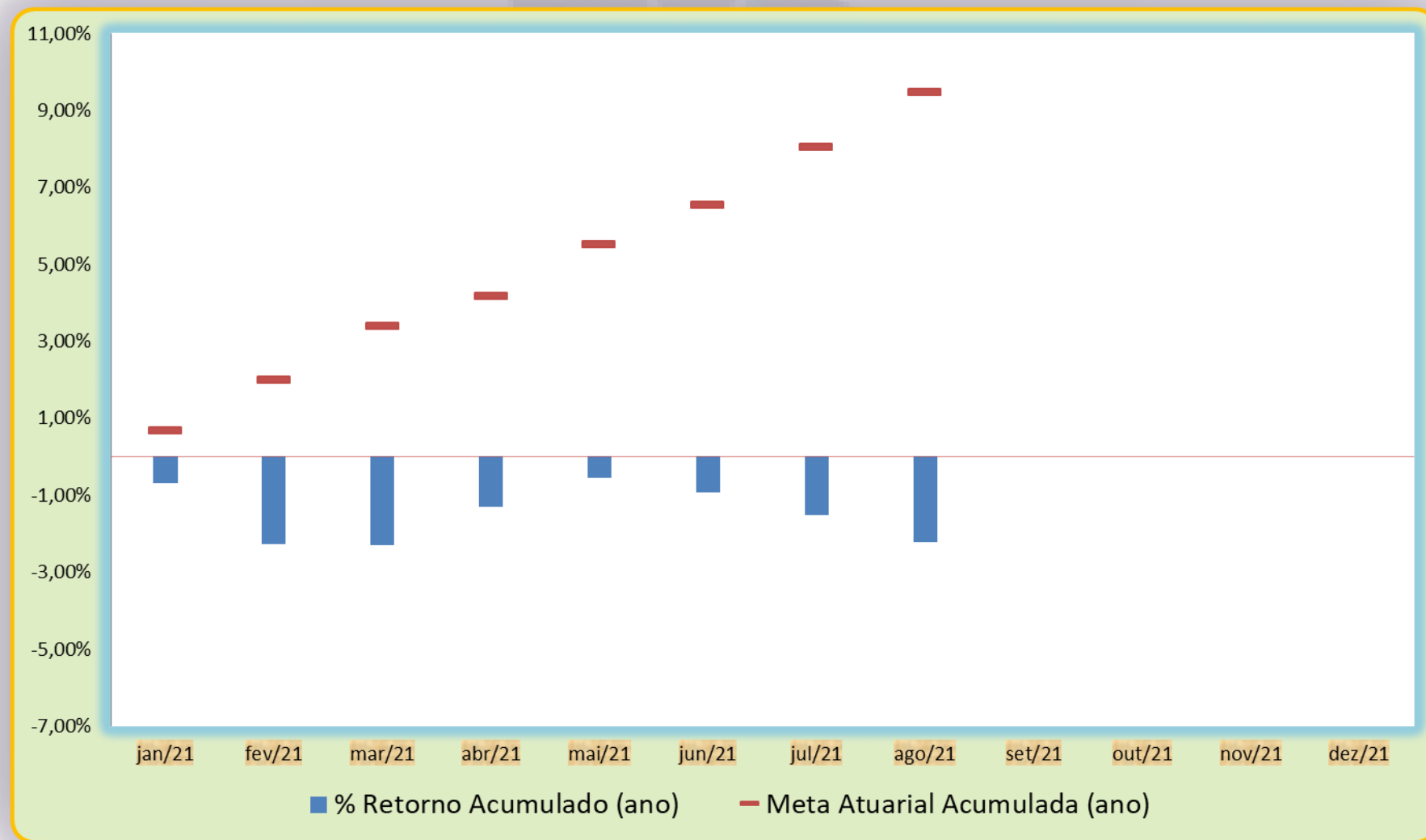
Competência: Agosto/2021



Competência	Patrimônio Líquido Inicial (R\$)	Aplicação (R\$)	Resgate (R\$)	Fluxo de Caixa (R\$)	Fluxo de Caixa Acumulado Anual (R\$)	Patrimônio Líquido Final (R\$)	Retorno Mensal (R\$)	Retorno Acumulado Anual (R\$)	% Retorno Mensal	% Retorno Acumulado (ano)
jan/21	R\$ 3.035.629.264,65	R\$ 125.625.889,51	R\$ 93.233.489,12	R\$ 32.392.400,39	R\$ 32.392.400,39	R\$ 3.046.935.151,30	-R\$ 21.086.513,74	-R\$ 21.086.513,74	-0,6909%	-0,69%
fev/21	R\$ 3.046.935.151,30	R\$ 160.862.699,82	R\$ 144.722.412,08	R\$ 16.140.287,74	R\$ 48.532.688,13	R\$ 3.014.342.224,63	-R\$ 48.733.214,41	-R\$ 69.819.728,15	-1,5952%	-2,28%
mar/21	R\$ 3.014.342.224,63	R\$ 107.715.260,23	R\$ 91.433.667,50	R\$ 16.281.592,73	R\$ 64.814.280,86	R\$ 3.030.110.587,07	-R\$ 513.230,29	-R\$ 70.332.958,44	-0,0170%	-2,29%
abr/21	R\$ 3.030.110.587,07	R\$ 2.275.561.697,61	R\$ 2.259.185.074,20	R\$ 16.376.623,41	R\$ 81.190.904,27	R\$ 3.076.452.937,17	R\$ 29.965.726,69	-R\$ 40.367.231,75	0,9863%	-1,31%
mai/21	R\$ 3.076.452.937,17	R\$ 948.277.545,93	R\$ 929.784.392,19	R\$ 18.493.153,74	R\$ 99.684.058,01	R\$ 3.118.068.350,95	R\$ 23.122.260,04	-R\$ 17.244.971,71	0,7493%	-0,56%
jun/21	R\$ 3.118.068.350,95	R\$ 709.261.495,94	R\$ 693.479.247,07	R\$ 15.782.248,87	R\$ 115.466.306,88	R\$ 3.122.537.498,15	-R\$ 11.313.101,67	-R\$ 28.558.073,38	-0,3619%	-0,92%
jul/21	R\$ 3.122.537.498,15	R\$ 518.639.212,77	R\$ 502.318.984,91	R\$ 16.320.227,86	R\$ 131.786.534,74	R\$ 3.119.928.823,45	-R\$ 18.928.902,56	-R\$ 47.486.975,94	-0,6046%	-1,53%
ago/21	R\$ 3.119.928.823,45	R\$ 484.692.101,28	R\$ 467.945.946,37	R\$ 16.746.154,91	R\$ 148.532.689,65	R\$ 3.115.122.750,07	-R\$ 21.552.228,29	-R\$ 69.039.204,23	-0,6889%	-2,22%
set/21										
out/21										
nov/21										
dez/21										
TOTAL ANC	R\$ 3.035.629.264,65	R\$ 5.330.635.903,09	R\$ 5.182.103.213,44	R\$ 148.532.689,65		R\$ 3.115.122.750,07	-R\$ 69.039.204,23			-2,22%

Indicadores de Performance do Fundo Capitalizado: 2021

Competência	IPCA (mês)	IPCA (ano)	Meta Atuarial (mês)	Meta Atuarial Acumulada (ano)	Retorno Acumulado (12 meses)	Meta Atuarial Acumulada (12 meses)	% Atingido da Meta Atuarial (12 meses)
jan/21	0,25%	0,25%	0,69%	0,69%	5,61%	10,78%	51,98%
fev/21	0,86%	1,11%	1,31%	2,01%	4,90%	11,41%	42,92%
mar/21	0,93%	2,05%	1,38%	3,41%	11,03%	12,32%	89,58%
abr/21	0,31%	2,37%	0,75%	4,19%	9,18%	12,97%	70,78%
mai/21	0,83%	3,22%	1,28%	5,52%	7,12%	14,29%	49,81%
jun/21	0,53%	3,77%	0,97%	6,55%	4,02%	14,54%	27,61%
jul/21	0,96%	4,76%	1,41%	8,05%	0,62%	15,18%	4,05%
ago/21	0,87%	5,67%	1,32%	9,47%	0,86%	15,85%	5,44%
set/21							
out/21							
nov/21							
dez/21							
		5,67%		9,47%			



Performance do Fundo Capitalizado – 2010 à 2021

ANO	Patrimônio Líquido Inicial (R\$)	Aplicação (R\$)	Resgate (R\$)	Fluxo de Caixa (R\$)	Patrimônio Líquido Final (R\$)	Retorno Acumulado Anual (R\$)	% Retorno Anual	Meta Anual	IPCA
2021	R\$ 3.035.629.264,65	R\$ 5.330.635.903,09	R\$ 5.182.103.213,44	R\$ 148.532.689,65	R\$ 3.115.122.750,07	-R\$ 69.039.204,23	-2,22%	9,47%	5,67%
2020	R\$ 2.621.348.416,16	R\$ 2.678.972.677,54	R\$ 2.460.817.910,32	R\$ 218.154.767,22	R\$ 3.035.629.264,65	R\$ 196.126.081,27	7,18%	10,79%	4,52%
2019	R\$ 2.066.742.820,09	R\$ 5.098.914.651,21	R\$ 4.901.210.037,97	R\$ 197.704.613,24	R\$ 2.621.348.416,16	R\$ 356.900.982,83	16,48%	10,56%	4,31%
2018	R\$ 1.666.433.054,76	R\$ 4.181.145.254,86	R\$ 3.980.408.901,95	R\$ 200.736.352,91	R\$ 2.067.179.818,46	R\$ 200.010.410,79	11,32%	9,97%	3,75%
2017	R\$ 1.333.235.977,38	R\$ 30.506.885.389,69	R\$ 30.337.743.784,59	R\$ 169.141.605,10	R\$ 1.666.433.054,76	R\$ 164.055.472,28	11,57%	9,12%	2,95%
2016	R\$ 968.655.049,75	R\$ 28.343.626.845,13	R\$ 28.214.966.883,22	R\$ 128.659.961,91	R\$ 1.333.235.977,38	R\$ 235.920.965,72	22,84%	12,67%	6,29%
2015	R\$ 727.153.705,27	R\$ 6.764.020.071,41	R\$ 6.629.567.470,69	R\$ 134.452.600,72	R\$ 968.655.049,75	R\$ 107.048.743,77	13,48%	17,31%	10,67%
2014	R\$ 551.117.589,01	R\$ 781.769.904,64	R\$ 667.849.629,03	R\$ 113.920.275,61	R\$ 727.153.705,27	R\$ 62.115.840,64	10,22%	12,79%	6,41%
2013	R\$ 446.049.829,58	R\$ 132.577.926,35	R\$ 35.998.354,56	R\$ 96.579.571,79	R\$ 551.117.589,01	R\$ 8.488.187,64	1,72%	12,27%	5,91%
2012	R\$ 300.296.104,28	R\$ 138.967.762,11	R\$ 62.076.033,94	R\$ 76.891.728,17	R\$ 446.049.829,58	R\$ 68.861.997,14	20,33%	12,19%	5,84%
2011	R\$ 215.257.115,74	R\$ 189.031.083,64	R\$ 133.161.695,79	R\$ 55.869.387,85	R\$ 300.296.104,28	R\$ 29.169.600,69	11,99%	12,89%	6,50%
2010	R\$ 152.080.762,67	R\$ 87.151.631,72	R\$ 47.265.691,10	R\$ 39.885.940,62	R\$ 215.257.115,74	R\$ 23.290.412,45	13,54%	12,26%	5,91%

Movimentações : Regime Capitalizado

Títulos Públicos da Carteira Previmpa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
Títulos Públicos Federais	1.961.867.465,16	325.032.909,49	R\$ 317.193.172,31	1.966.502.055,66	-R\$ 3.205.146,68	-0,16%

Fundos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
Caixa FIC Brasil Disponibilidades RF	R\$ 156.060,45	R\$ 54.770.164,90	R\$ 54.778.090,47	R\$ 156.040,64	R\$ 7.905,76	0,01%
Caixa FI Brasil Idka IPCA 2a RF LP	R\$ 380.650.191,66	R\$ 17.452.566,66	R\$ 77.839.737,18	R\$ 320.845.647,14	R\$ 582.626,00	0,17%
FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	R\$ 17.287.834,36			R\$ 17.310.972,56	R\$ 23.138,20	0,13%
BB Prev Fluxo RF Simples FICFI	R\$ 3.721.517,34	R\$ 440.876,55	R\$ 1.139.362,73	R\$ 3.033.139,07	R\$ 10.107,91	0,30%
BB Prev RF Idka 2 FI	R\$ 185.042.265,89			R\$ 185.372.506,61	R\$ 330.240,72	0,18%
Banrisul Automatico FI RF CP	R\$ 17.273.207,98	R\$ 31.997,65	R\$ 16.995.583,68	R\$ 313.263,80	R\$ 3.641,85	0,04%
TOTAL DOS FUNDO DE RENDA FIXA	R\$ 604.131.077,68	R\$ 72.695.605,76	R\$ 150.752.774,06	R\$ 527.031.569,82	R\$ 957.660,44	0,17%

TOTAL DA RENDA FIXA	R\$ 2.565.998.542,84	R\$ 397.728.515,25	R\$ 467.945.946,37	R\$ 2.493.533.625,48	-R\$ 2.247.486,24	-0,09%
---------------------	----------------------	--------------------	--------------------	----------------------	-------------------	--------

Movimentações: Regime Capitalizado

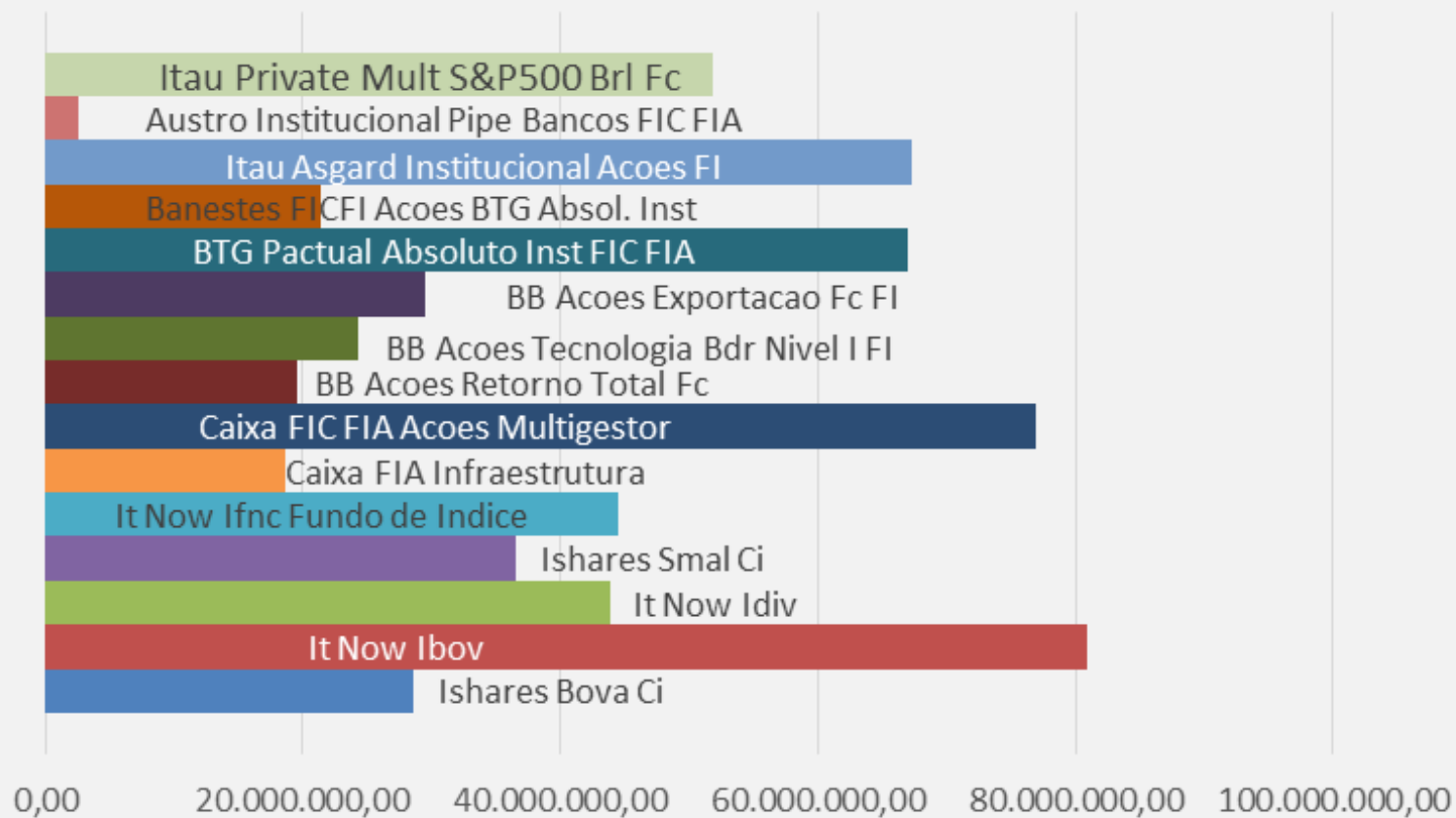
Fundos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
Ishares Bova Ci	R\$ 29.532.500,00			R\$ 28.547.500,00	-R\$ 985.000,00	-3,34%
It Now Ifnc Fundo de Indice	R\$ 46.480.000,00			R\$ 44.544.000,00	-R\$ 1.936.000,00	-4,17%
It Now Ibov	R\$ 46.697.614,14	36.963.586,03		R\$ 80.844.884,31	-R\$ 2.816.315,86	-4,32%
It Now Idiv	R\$ 44.548.664,81			R\$ 43.895.702,63	-R\$ 652.962,18	-1,47%
Ishares Smal Ci	R\$ 38.189.958,66			R\$ 36.595.049,28	-R\$ 1.594.909,38	-4,18%
BB Acoes Retorno Total Fc	R\$ 20.160.456,91			R\$ 19.581.670,62	-R\$ 578.786,29	-2,87%
BB Acoes Tecnologia Bdr Nivel I FI	R\$ 24.627.370,44			R\$ 24.247.319,66	-R\$ 380.050,78	-1,54%
BB Acoes Exportacao Fc FI	R\$ 29.663.387,75			R\$ 29.464.828,49	-R\$ 198.559,26	-0,67%
Caixa FIC FIA Acoes Multigestor	R\$ 79.127.441,10			R\$ 76.926.067,25	-R\$ 2.201.373,85	-2,78%
Caixa FIA Infraestrutura	R\$ 19.020.077,41			R\$ 18.687.578,90	-R\$ 332.498,51	-1,75%
Austro Institucional Pipe Bancos FIC FIA	R\$ 2.663.375,13			R\$ 2.615.053,75	-R\$ 48.321,38	-1,81%
Banestes FICFI Acoes BTG Absol. Inst	R\$ 22.982.852,42			R\$ 21.422.143,01	-R\$ 1.560.709,41	-6,79%
BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	R\$ 71.889.363,90			R\$ 66.985.424,87	-R\$ 4.903.939,03	-6,82%
Itau Asgard Institucional Acoes FI	R\$ 70.147.217,94			R\$ 67.214.686,80	-R\$ 2.932.531,14	-4,18%
Itau Private Mult S&P500 Brl Fc	R\$ -	R\$ 50.000.000,00		R\$ 51.817.215,02	R\$ 1.817.215,02	3,63%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 545.730.280,61	R\$ 86.963.586,03	R\$ -	R\$ 613.389.124,59	-R\$ 19.304.742,05	-3,28%

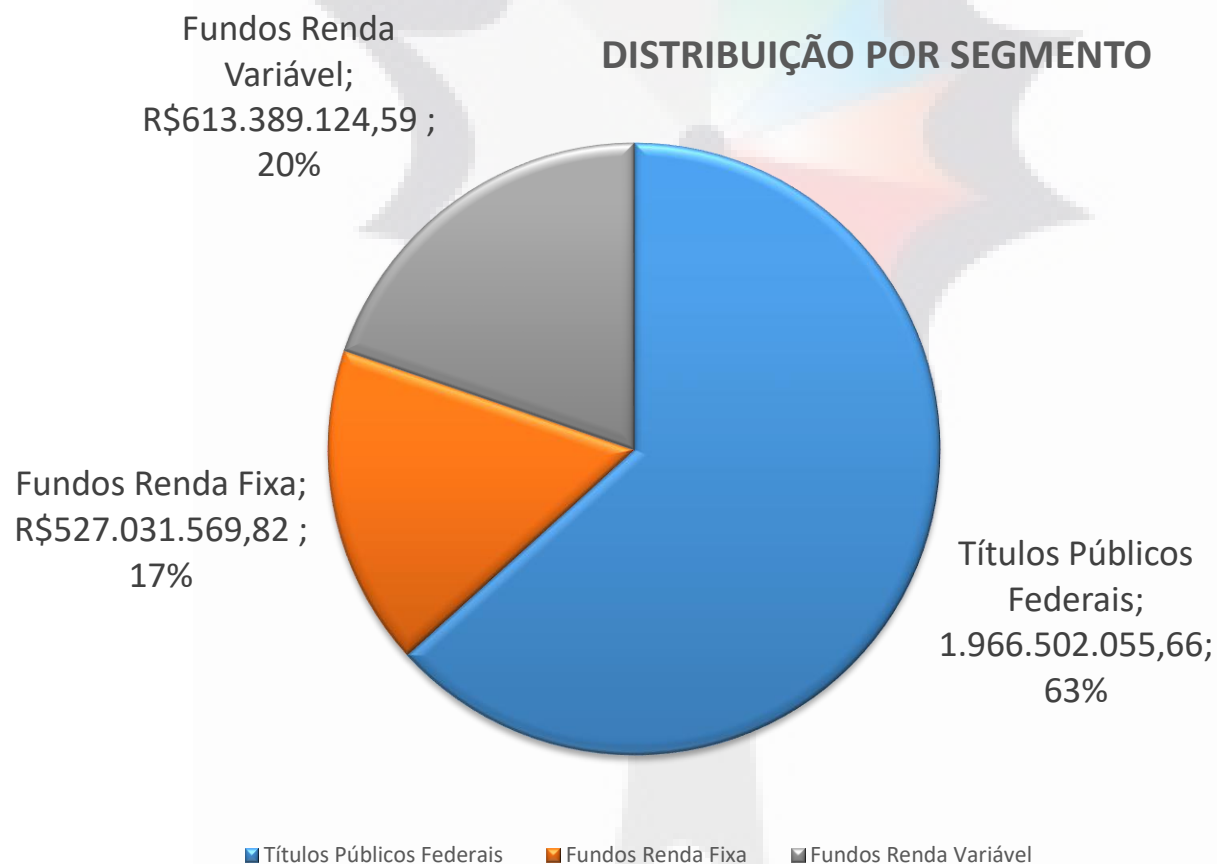
RENTABILIDADE DO REGIME CAPITALIZADO	R\$ 3.111.728.823,45	R\$ 484.692.101,28	R\$ 467.945.946,37	R\$ 3.106.922.750,07	-R\$ 21.552.228,29	-0,69%
---	-----------------------------	---------------------------	---------------------------	-----------------------------	---------------------------	---------------

IMÓVEL	Saldo Atual	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
IMÓVEL - ESTACIONAMENTO	R\$ 8.200.000,00			R\$ 8.200.000,00	R\$ -	0,00%

RENTABILIDADE TOTAL DO REGIME CAPITALIZADO	R\$ 3.119.928.823,45	R\$ 484.692.101,28	R\$ 467.945.946,37	R\$ 3.115.122.750,07	-R\$ 21.552.228,29	-0,69%
---	-----------------------------	---------------------------	---------------------------	-----------------------------	---------------------------	---------------

Distribuição por fundo de renda variável





Movimentações: Outras Contas

Taxa de Administração e Repartição Simples	Saldo Atual	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
COMPREV - BB Prev RF IRFM-1	R\$ 977.572,14			R\$ 980.841,73	R\$ 3.269,59	0,33%
COMPREV - BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 2.381.525,54			R\$ 2.385.775,79	R\$ 4.250,25	0,18%
COMPREV - BB Previd RF Fluxo	R\$ 6.630.182,80	R\$ 1.041.494,09		R\$ 7.693.964,06	R\$ 22.287,17	0,31%
FUNDO PREVIDENCIA - BB Previd RF Fluxo	R\$ 357.632,93	R\$ 6.948,99	R\$ 70.415,19	R\$ 295.190,91	R\$ 1.024,18	0,31%
REPARTIÇÃO SIMPLES - Caixa Disponibilidades RF	R\$ 11.103.831,21	R\$ 3.961.316,51	R\$ 4.254.225,74	R\$ 10.843.736,02	R\$ 32.814,04	0,30%
TAXA ADM - Caixa IDKA2	R\$ 137.065,88			R\$ 137.332,23	R\$ 266,35	0,19%
TAXA ADM - Caixa IRFM-1	R\$ 269.496,99	R\$ 64.660,00		R\$ 335.291,43	R\$ 1.134,44	0,38%
TAXA ADM - Caixa Disponibilidades	R\$ 20.232,30	R\$ 74,17	R\$ 3.444,54	R\$ 16.925,18	R\$ 63,25	0,34%
TAXA ADM - BB Prev RF IRFM-1	R\$ 7.959.676,14			R\$ 7.986.298,09	R\$ 26.621,95	0,33%
TAXA ADM - BB Previd RF Fluxo	R\$ 8.494.670,35	R\$ 2.249.196,93	R\$ 776.770,16	R\$ 9.992.777,12	R\$ 25.680,00	0,28%
FRAP - BB Previd RF Fluxo	R\$ 927.551,81	R\$ 30.426,69		R\$ 960.821,98	R\$ 2.843,48	0,30%
ADIANTAMENTO - BB Previd RF Fluxo	R\$ 4,48	R\$ 1.000,00	R\$ 405,74	R\$ 600,12	R\$ 1,38	0,46%
Conta Corrente	R\$ 1.829,22			R\$ -		0,00%
TOTAL TAXA ADM E REPARTIÇÃO SIMPLES	R\$ 39.261.271,79	R\$ 7.355.117,38	R\$ 5.105.261,37	R\$ 41.629.554,66	R\$ 118.426,86	0,29%
RENTABILIDADE CONSOLIDADA DO PREVIMPA	R\$ 3.159.190.095,24	R\$ 492.047.218,66	R\$ 473.051.207,74	R\$ 3.156.752.304,73	-R\$ 21.433.801,43	-0,68%

Gestor e Administrador

Administrador	Gestor	Valor	Distribuição
TESOURO NACIONAL	GESTÃO PRÓPRIA - PREVIMPA	R\$ 1.966.502.055,66	63,3%
Caixa	Caixa	R\$ 433.926.306,49	14,0%
BB DtvM S.A	BB DtvM S.A	R\$ 261.699.464,45	8,4%
Itau Unibanco SA	Itau Unibanco SA	R\$ 288.316.488,76	9,3%
BTG Pactual Servicos Financeiros SA DtvM	BTG Pactual Servicos Financeiros SA DtvM	R\$ 66.985.424,87	2,2%
BNP Paribas	Blackrock Brasil Gestora	R\$ 65.142.549,28	2,1%
Banestes	Banestes DTVM	R\$ 21.422.143,01	0,7%
BFL INVESTIMENTOS DE RECURSOS LTDA	Austro Capital	R\$ 2.615.053,75	0,1%
Banrisul Corretora	Banrisul Corretora	R\$ 313.263,80	0,0%

Enquadramento Renda Fixa

Títulos públicos	Valor atual	PL do fundo	Participação Previmpa no fundo	Limite por fundo conf. Resolução	Enquadramento resolução 3922	Limite do enquadramento 3922	Limite da política de investimentos	Alvo da política de investimentos	Valor por Carteira	% Alocado Carteira
Títulos da carteira Previmpa	1.966.502.055,66	N. A.	N. A.	N. A.	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a '	100%	100%	70%	1.966.502.055,66	64,37%

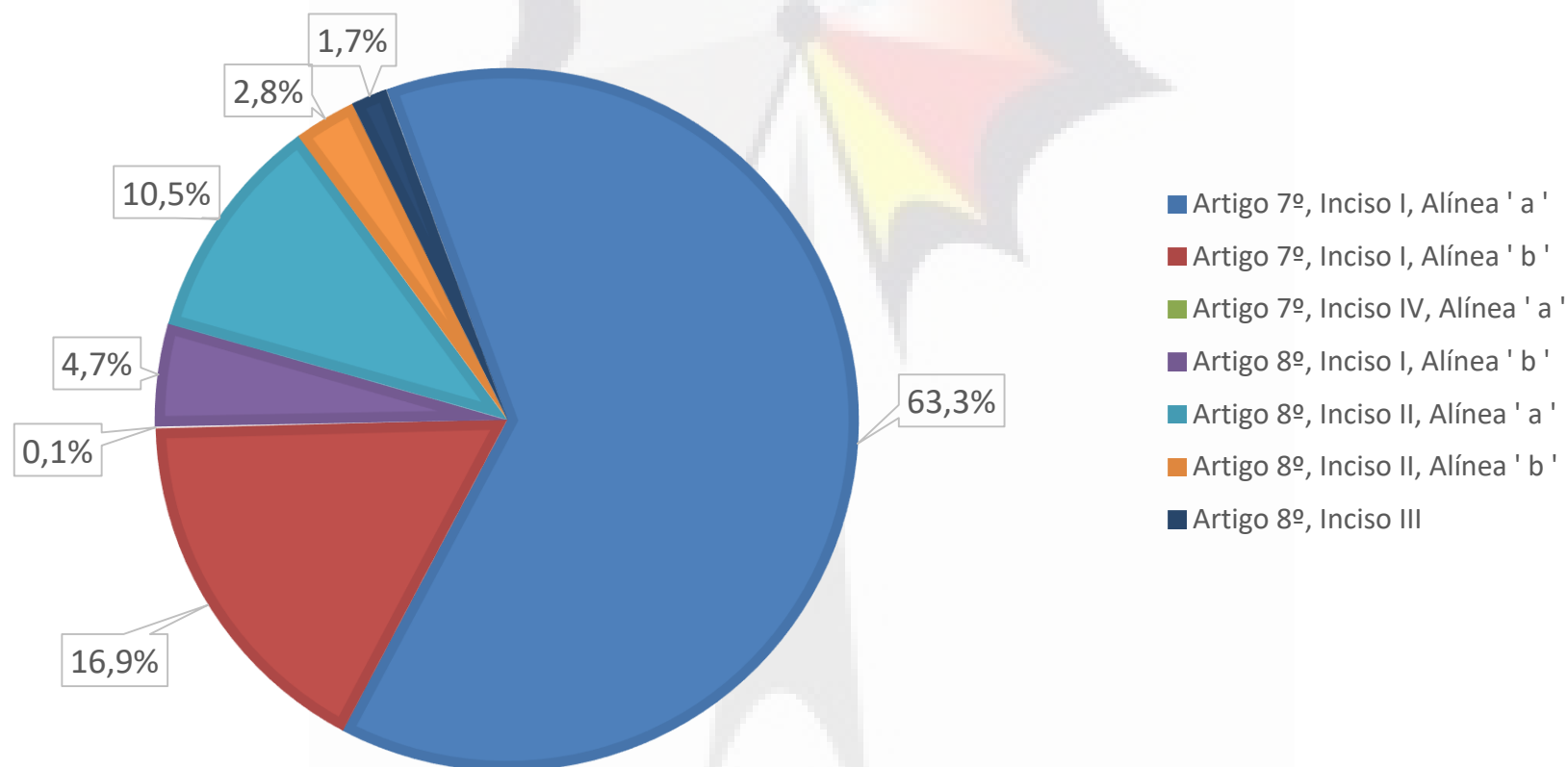
Fundos de Renda fixa	Valor atual	PL do fundo	Participação Previmpa no fundo	Limite por fundo conf. Resolução	Enquadramento resolução 3922	Limite do enquadramento 3922	Limite da política de investimentos	Alvo da política de investimentos	Valor por Carteira	% Carteira
Caixa FI Brasil Idka IPCA 2a RF LP	320.845.647,14	11.382.462.168,69	2,82%	15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b '	100%	100%	6%	523.529.126,31	17,14%
FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	17.310.972,56	11.104.044.700,20	0,16%							
BB Prev RF Idka 2 FI	185.372.506,61	9.863.752.148,95	1,88%							
Caixa FIC Brasil Disponibilidades RF	156.040,64	708.843.877,92	0,02%	15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a '	40%	40%	1%	3.502.443,51	0,11%
BB Prev Fluxo RF Simples FICFI	3.033.139,07	2.195.853.513,66	0,14%							
Banrisul Automatico FI RF CP	313.263,80	946.980.493,04	0,03%							

Enquadramento Renda Variável

Fundos de Renda Variável	Valor atual	PL do fundo	Participação Previmpa no fundo	Limite por fundo conf. Resolução	Enquadramento resolução 3922	Limite do enquadramento 3922	Limite da política de investimentos	Alvo da política de investimentos	Valor por Carteira	% Carteira
Ishares Bova Ci	28.547.500,00	14.477.524.504,88	0,20%	15%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30%	30%	6%	145.987.433,59	4,78%
It Now Ibov	80.844.884,31	8.416.195.671,00	0,96%							
Ishares Smal Ci	36.595.049,28	1.610.813.410,47	2,27%							
Caixa FIA Infraestrutura	18.687.578,90	437.227.724,66	4,27%	15%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20%	20%	4%	327.144.773,35	10,71%
Caixa FIC FIA Acoes Multigestor	76.926.067,25	1.039.744.161,52	7,40%							
BB Acoes Retorno Total Fc	19.581.670,62	1.889.588.301,49	1,04%							
BB Acoes Tecnologia Bdr Nivel I FI	24.247.319,66	1.099.226.885,40	2,21%							
BB Acoes Exportacao Fc FI	29.464.828,49	372.130.499,41	7,92%							
BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	66.985.424,87	2.748.098.825,53	2,44%							
Banestes FICFI Acoes BTG Absol. Inst	21.422.143,01	226.424.567,70	9,46%							
Itau Asgard Institucional Acoes FI	67.214.686,80	620.487.609,33	10,83%							
Austro Institucional Pipe Bancos FIC FIA	2.615.053,75	20.937.363,89	12,49%							
It Now Ifnc Fundo de Indice	44.544.000,00	480.681.377,10	9,27%	15%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20%	20%	2%	88.439.702,63	2,89%
It Now Idiv	43.895.702,63	377.231.635,00	11,64%							
Itau Private Mult S&P500 Brl Fc	51.817.215,02	2.487.417.356,50	2,08%	5%	Artigo 8º, Inciso III	10%	10%	1%	51.817.215,02	1,70%

*Fundo Austro Institucional Pipe Bancos FIC FIA está com Desenquadramento Passivo, pois não atende o Artigo 15 Resolução 3922/2010.

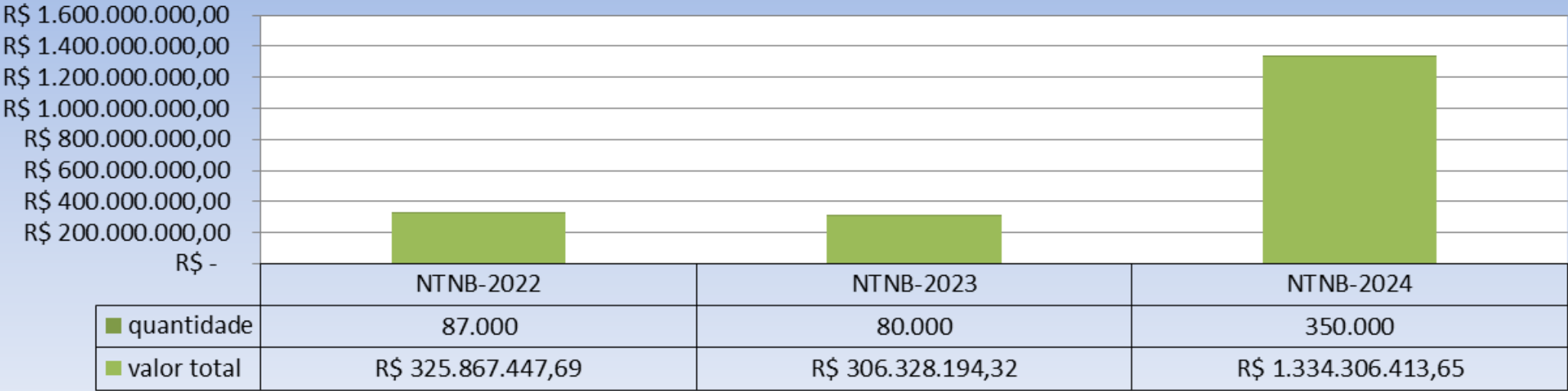
Distribuição por enquadramento



Carteira de Títulos públicos

Cód. Papel	Vencimento	Data Compra	Qtde. Bloq.	Qtde. Total	PU Compra	Preço Unitário	Taxa %	Valor Total à Mercado	Valor Total na Curva	%PL
Títulos Públicos										
NTN-PÓS										
NTNB20220815 - 760199	15/08/2022	17/08/2021	0	87.000	3.736,01045400	3.745,60284700	2,359074	325.867.447,69	326.371.399,36	16,57%
NTNB20230515 - 760199	15/05/2023	14/04/2021	0	80.000	3.860,87637900	3.829,10242900	2,259018	306.328.194,32	312.427.457,92	15,58%
NTNB20240815 - 760199	15/08/2024	17/12/2020	0	40.000	3.987,99033100	3.812,30403900	1,629008	152.492.161,56	163.077.608,92	7,75%
NTNB20240815 - 760199	15/08/2024	14/04/2021	0	160.000	3.836,63293600	3.812,30403900	3,315875	609.968.646,24	623.443.271,84	31,02%
NTNB20240815 - 760199	15/08/2024	29/04/2021	0	40.000	3.916,92915700	3.812,30403900	2,709981	152.492.161,56	158.400.415,88	7,75%
NTNB20240815 - 760199	15/08/2024	14/05/2021	0	20.000	3.919,21988300	3.812,30403900	2,789006	76.246.080,78	79.032.948,12	3,88%
NTNB20240815 - 760199	15/08/2024	14/05/2021	20.000	60.000	3.919,10708500	3.812,30403900	2,790000	228.738.242,34	237.092.544,96	11,63%
NTNB20240815 - 760199	15/08/2024	14/05/2021	0	30.000	3.919,21988300	3.812,30403900	2,789006	114.369.121,17	118.549.422,18	5,82%
Total NTN-PÓS:			20.000	517.000				1.966.502.055,66	2.018.395.069,18	100,00%
Total Títulos Públicos:						517.000				R\$ 1.966.502.055,66 R\$ 2.018.395.069,18 100,0%

Distribuição dos Títulos Públicos em Carteira



Duration de MACAULAY (anos)	Duration Modificada	Variação % Preço (100 PB)	Variação em MOEDA (100 PB)	Variação em MOEDA (1 PB)	Duration do Passivo Atuarial
2,28	2,19	2,19%	-R\$ 42.975.886,53	-R\$ 4.297,59	20,99 anos

Conceitos de Avaliação de Risco

AVALIAÇÃO DE RISCO – Busca avaliar a probabilidade do impacto dos riscos.

VAR 95% - estima a perda potencial máxima de um investimento em 1 mês, com 95% de grau de confiança.

Volatilidade - Mede a variação do retorno do fundo em relação à sua média.

Sortino - Considera apenas a volatilidade negativa como fator de risco.

Se o resultado for acima de 100% significa que para cada 1,00% de risco adicionado à carteira, houve 1,00% ou mais de rendimento obtido em relação à taxa livre de risco.

Se o resultado for abaixo de 100% significa que para cada 1,00% de risco adicionado à carteira, houve 1,00% ou menos de rendimento obtido em relação à taxa livre de risco.

Sharpe - Mede o retorno excedente de uma aplicação financeira em relação a outra aplicação livre de risco(CDI).

Beta - Representa a volatilidade média com relação ao seu benchmark, Se $B > 1$ a carteira oscila mais (mais arriscada)

Rentabilidade e Risco Renda Fixa

Títulos Públicos	1 mês	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	No ano					
BENCHMARK IMA EX-G	-0,34	-0,12	0,49	1,31	7,55	-0,78					
Títulos Públicos da carteira Previmpa	-0,1622	-0,8296	-0,3997	-1,6940	8,8029	-3,2799					

Fundos de Renda fixa	1 mês	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	No ano	Volatilidade	VaR 95% 1 M	Sortino 12M	Sharpe 12M	Beta 12M
BENCHMARK CDI	0,43	1,10	1,78	2,72	6,68	2,07					
Caixa FIC Brasil Disponibilidades RF	0,32	0,81	1,28	1,79	4,84	1,43	0,06%	0,00%	-1597,64%	-88,04	0,00
BB Prev Fluxo RF Simples FICFI	0,30	0,77	1,18	1,53	4,35	1,31	0,16%	0,00%	-963,28%	-8,09	0,00
Banrisul Automatico FI RF CP	0,25	0,58	0,85	0,97	1,73	0,88	0,06%	0,00%	-1598,33%	-103,66	0,00

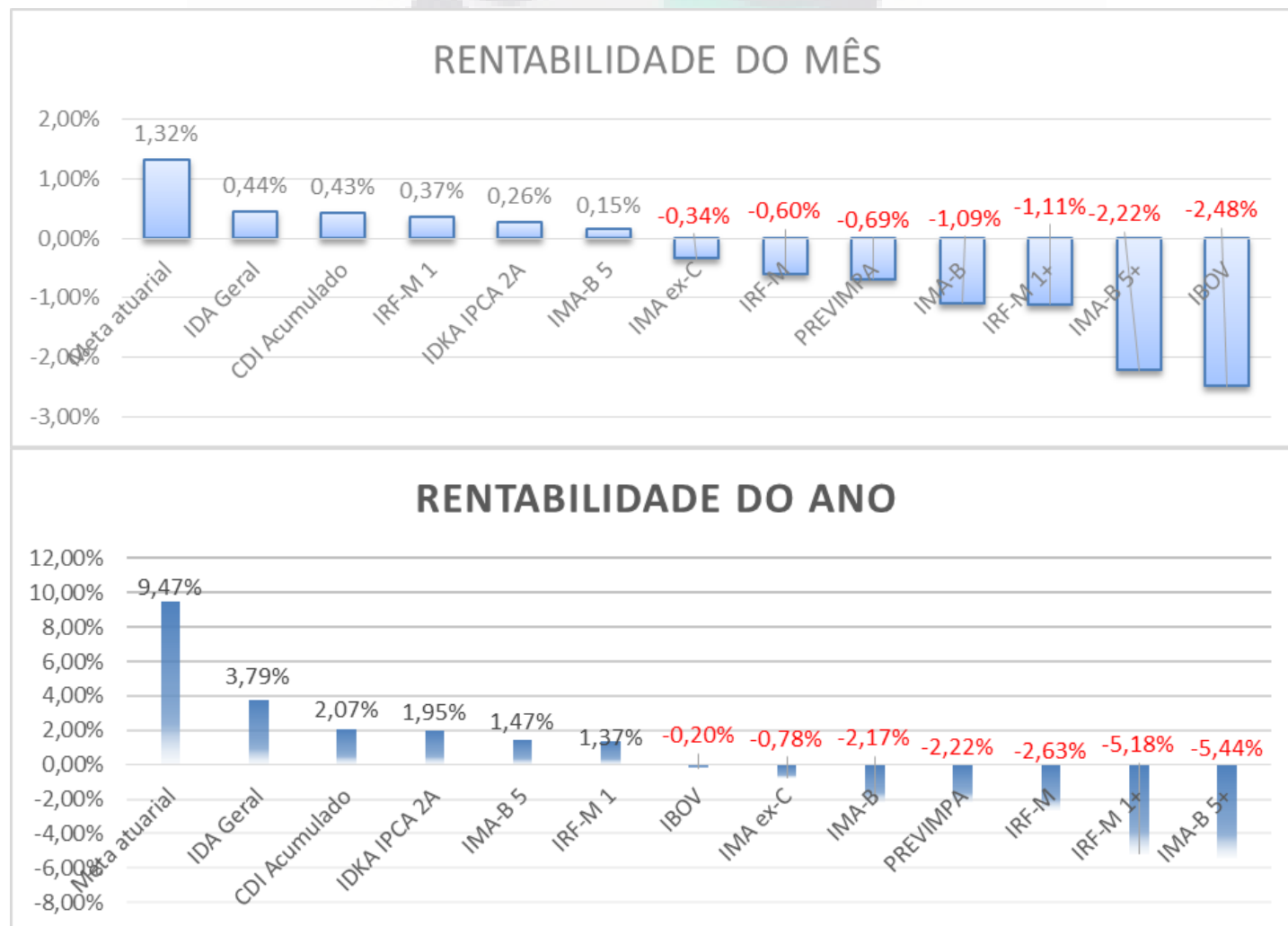
BENCHMARK IMA B 5	-0,12	0,15	0,05	1,97	4,77	14,45					
FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	-0,13	0,13	0,00	1,85	4,50	13,83	0,27%	2,62%	96,23%	0,68	0,09

BENCHMARK IDKA 2A	0,26	-0,23	2,29	5,08	15,28	1,95					
Caixa FI Brasil Idka IPCA 2a RF LP	0,19	-0,15	2,10	4,83	14,10	1,69	2,53%	0,24%	119,06%	0,83	0,08
BB Prev RF Idka 2 FI	0,18	0,17	2,06	5,08	14,20	1,68	2,38%	0,23%	142,72%	0,98	0,08

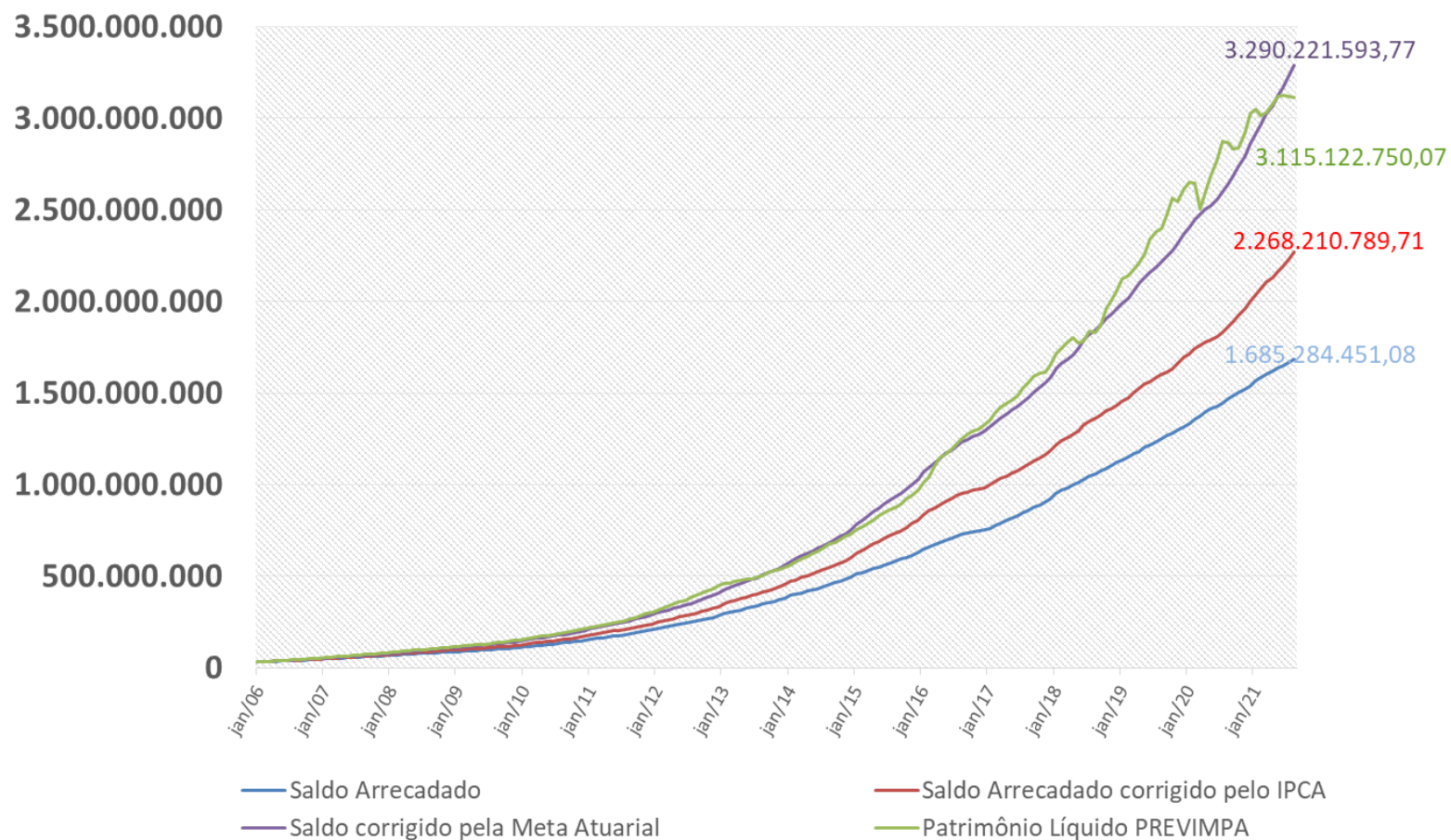
Rentabilidade e Risco Renda Variável

Fundos Renda Variável	1 mês	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	No ano	Volatilidade 12M	Var 95% 1M	Sortino 12M	Sharpe	Beta 12M
BENCHMARK IBOVESPA	-2,48	-5,89	7,95	19,54	17,45	-0,20					
It Now Ibov	-2,64	-5,90	8,15	19,39	17,31	-0,28	21,21%	1,82%	131,23%	0,91	1,01
Ishares Bova Ci	-2,59	-5,91	8,04	19,21	16,87	-0,50	21,37%	1,80%	128,81%	0,90	1,00
It Now Idiv	-0,81	-4,57	10,42	18,27	14,38	-0,70	18,61%	1,90%	137,73%	0,94	0,96
Ishares Smal Ci	-3,86	-8,72	7,21	17,53	22,27	0,76	23,50%	2,46%	108,77%	0,77	1,02
It Now Ifnc Fundo de Indice	-2,99	-7,00	6,90	14,46	-5,23	-6,99	25,90%	2,36%	90,80%	0,60	1,21
Itau Asgard Institucional Acoes FI	-4,01	-9,01	1,15	18,47	N.A	-3,55	18,42%	1,81%	139,27%	0,94	0,70
Itau Private Mult S&P500 Brl Fc	3,36	8,86	20,09	30,77	54,73	23,12	14,89%	0,82%	293,25%	1,94	0,40
Caixa FIC FIA Acoes Multigestor	-2,78	-5,92	5,36	12,20	19,12	-0,21	18,32%	1,85%	86,04%	0,61	0,84
BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	-6,82	-9,94	-4,11	1,31	11,58	-7,11	20,38%	1,99%	4,83%	0,03	0,63
Banestes FICFI Acoes BTG Absol. Inst	-6,79	-9,90	-4,09	1,27	11,46	-7,08	20,30%	1,98%	4,47%	0,03	0,63
BB Acoes Retorno Total Fc	-2,87	-7,43	9,79	19,41	20,87	4,86	19,94%	1,84%	133,17%	0,94	0,82
BB Acoes Tecnologia Bdr Nivel I FI	-1,54	2,37	6,03	17,11	57,09	12,52	18,03%	1,57%	123,19%	0,89	0,28
BB Acoes Exportacao Fc FI	-0,67	-2,19	15,15	41,00	61,65	18,09	19,99%	1,80%	300,80%	2,01	0,65
Caixa FIA Infraestrutura	-1,75	-5,28	7,41	11,93	13,82	-2,39	21,60%	2,06%	77,03%	0,54	0,95
Austro Institucional Pipe Bancos FIC FIA	-1,81	-7,74	-2,79	-25,09	-72,16	-23,71	27,58%	13,53%	-120,35%	-0,88	0,53

Benchmark



Patrimônio Financeiro Líquido Regime Capitalizado (Janeiro de 2006 a Agosto de 2021)



Informação dos fundos

Administrador	Gestor	Custodiante	Nome do fundo	CNPJ do fundo	Taxa de Adm % a.a.	Taxa de Performance % a.a.	Liquidação Financeira - Aplicação	Liquidação Financeira - Resgate	Carência	Horário Limite Aplicação/ Resgate
Renda Fixa										
Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Brasil Disponibilidades RF	14.508.643/0001-55	0,80%	Não há	D+0	D+0	Não há	18:00
			Caixa IMAB 5 RF LP	11.060.913/0001-10	0,20%	Não há	D+0	D+0	Não há	16:00
			Caixa IRFM-1 RF LP	10.740.670/0001-06	0,20%	Não há	D+0	D+0	Não há	17:00
			Caixa IDKA IPCA RF LP	14.386.926/0001-71	0,20%	Não há	D+0	D+0	Não há	16:00
BB Gestão de Recursos DTVM	BB Gestão de Recursos DTVM	Banco do Brasil	BB RPPS RF Fluxo	13.077.415/0001-05	1,00%	Não há	D+0 Abertura	D+0	Não há	23:00
			BB PREV IRFM-1	11.328.882/0001-35	0,30%	Não há	D+0	D+0	Não há	15:00
			BB PREV IDKA 2A	13.322.205/0001-35	0,20%	Não há	D+0	D+1	Não há	15:00
Banco do Estado do Rio Grande do Sul	Banrisul Corretora	Banrisul Corretora	Banrisul Foco IDKA 2A	21.007.180/0001-03	0,20%	Não há	D+0	D+1	Não há	15:00
			Banrisul Automático FI RF CP	01.353.260/0001-03	1,60%	Não há	D+0	D+0	Não há	17:30
Renda Variável										
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	Caixa Institucional BDR I	17.502.937/0001-68	0,70%	Não há	D+1	D+1	Não há	17:00
			Caixa FI Ações Infraestrutura	10.551.382/0001-03	2,00%	Não há	D+1	D+3	Não há	17:00
			Caixa FIC FIA Ações Multigestor	30.068.224/0001-04	1,50%	Não há	D+1	D+3	Não há	13:00
BB Gestão de Recursos DTVM	BB Gestão de Recursos DTVM	Banco do Brasil	BB Ações Retorno Total	09.005.805/0001-00	1,00%	Não há	D+1	D+3	Não há	17:00
			BB Acoes Exportacao Fc FI	05.100.213/0001-09	2,00%	Não há	D+1	D+3	Não há	17:00
			BB Acoes Energia FI	02.020.528/0001-58	2,00%	Não há	D+1	D+3	Não há	17:00
			BB Ações Tecnologia	01.578.474/0001-88	2,00%	Não há	D+1	D+3	Não há	17:00
ITAÚ UNIBANCO S.A.	ITAÚ UNIBANCO S.A.	ITAÚ UNIBANCO S.A.	Itaú Private Multimercado S&P500	26.269.692/0001-61	0,80%	Não há	D+0	D+1	Não há	15:00
			Itaú Ações Asgard Instit. FICFIA	35.495.250/0001-24	2,00%	Não há	D+0	D+23	Não há	16:00
BFL INVESTIMENTOS DE RECURSOS LTDA	Austro Capital	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	Austro Pipe Bancos	28.319.463/0001-30	0,40%	6,00% do que exceder (IPCA + 6,00% a.a.)	D+1	D+30	30/04/2021	13:00
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS S.A.	BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM	Banco BTG PACTUAL	BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	11.977.794/0001-64	3,00%	Não há	D+1	D+32	Não há	15:30
ITAÚ UNIBANCO S.A.	ITAÚ UNIBANCO S.A.	Banrisul Corretora	ETF FIND 11	11.961.094/0001-81	0,60%	Não há	D+2	D+2	Não há	17:00
			ETF DIVO 11	13.416.245/0001-46	0,50%	Não há	D+2	D+2	Não há	17:00
			ETF BOVV 11	21.407.758/0001-19	0,30%	Não há	D+2	D+2	Não há	17:00
BNB Paribas	Black Rock	Banrisul Corretora	ETF BOVA 11	10.406.511/0001-61	0,30%	Não há	D+2	D+2	Não há	17:00
			ETF SMAL 11	10.406.600/0001-08	0,69%	Não há	D+2	D+2	Não há	17:00
BANCO SANTANDER BRASIL S.A.	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS	SANTANDER CACEIS BRASIL DISTRIBUIDORA	Santander Global Equities Dolar	17.804.792/0001-50	1,00%	Não há	D+1	D+8	Não há	12:00
BANESTES SA BANCO DO ESTADO DO ESPIRITO SANTO	BANESTES DTVM SA	BANESTES SA BANCO DO ESTADO DO ESPIRITO SANTO	Banestes BTG Absoluto FIC FIA	08.018.849/0001-02	3,00%	Não há	D+1	D+30	Não há	15:00