

# Relatório de Resultados dos Investimentos do PREVIMPA

Competência: Setembro/2021

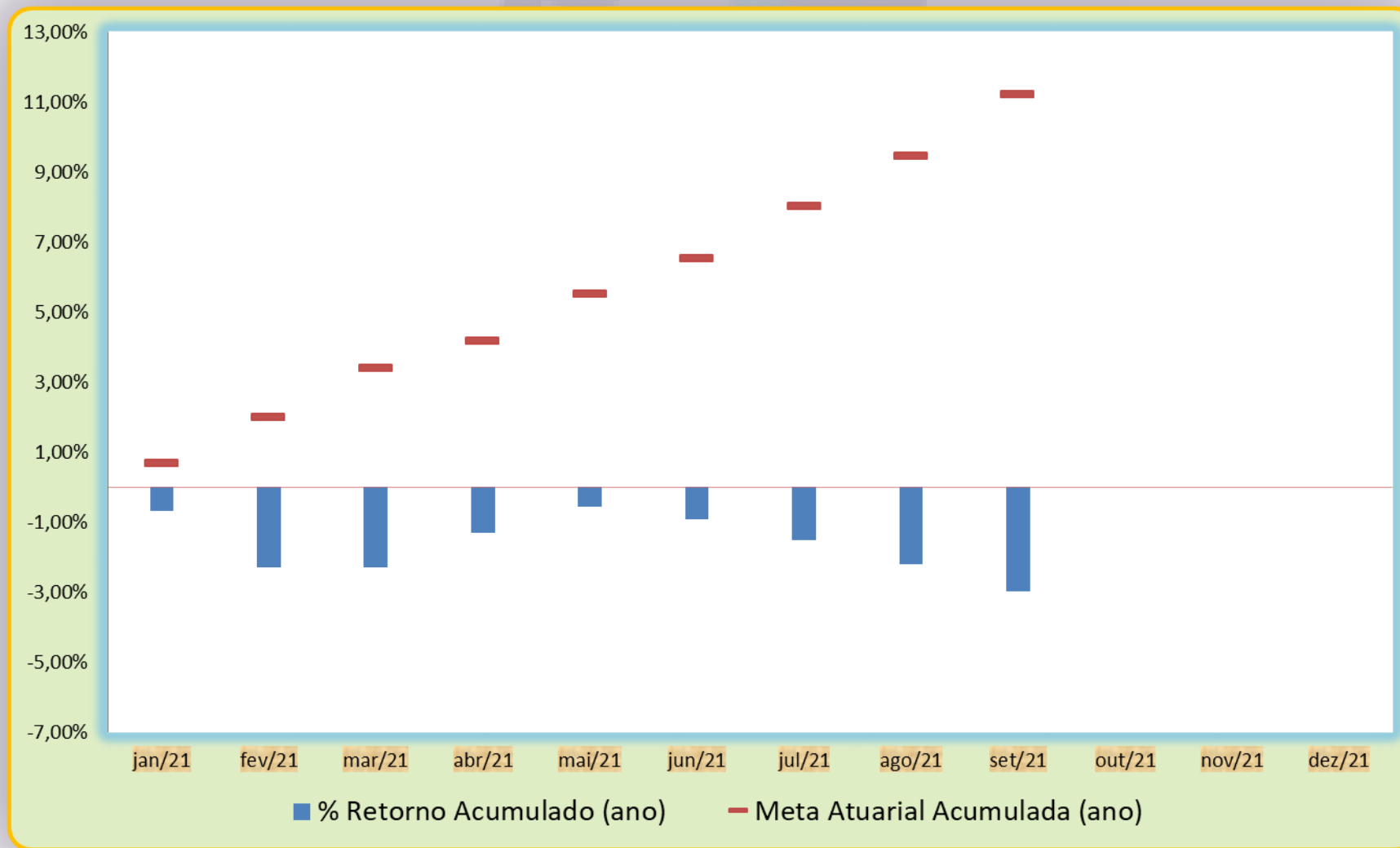
# Demonstrativo mensal

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	-0,69%	-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	-1,60%	-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	-0,02%	-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	0,99%	-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	0,75%	-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	-0,36%	-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	-0,60%	-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	-0,69%	-2,22%
set/21	R\$ 3.115.122.750,07	R\$ 3.299.489.348,56	R\$ 3.283.145.195,26	R\$ 16.344.153,30	R\$ 164.876.842,95	R\$ 3.107.340.508,26	-R\$ 24.126.395,11	-R\$ 93.165.599,34	-0,77%	-2,99%
out/21										
nov/21										
dez/21										
<b>TOTAL ANO</b>	R\$ 3.035.629.264,65	R\$ 8.630.125.251,65	R\$ 8.465.248.408,70	R\$ 164.876.842,95		R\$ 3.107.340.508,26	-R\$ 93.165.599,34			-2,99%

# 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	1,16%	6,90%	1,61%	11,23%	1,62%	16,40%	9,89%
out/21							
nov/21							
dez/21							
		6,90%		11,23%			

# Rentabilidade X Meta



## 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\$ 8.630.125.251,65	R\$ 8.465.248.408,70	R\$ 164.876.842,95	R\$ 3.107.340.508,26	-R\$ 93.165.599,34	-2,99%	11,23%	6,90%
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	R\$ 1.966.502.055,66	R\$ 1.315.594.166,36	R\$ 1.333.596.434,50	R\$ 1.960.240.745,73	R\$ 11.740.958,21	0,60%

Fundos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
Caixa FIC Brasil Disponibilidades RF	R\$ 156.040,64	R\$ 1.366.530.302,96	R\$ 1.366.800.085,48	R\$ 85.916,57	R\$ 199.658,45	0,01%
Caixa FI Brasil Idka IPCA 2a RF LP	R\$ 320.845.647,14		R\$ 320.985.559,16		R\$ 139.912,02	0,09%
Caixa FI Brasil RF Ref DI LP		R\$ 226.116.366,96		R\$ 226.880.344,18	R\$ 763.977,22	0,34%
FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	R\$ 17.310.972,56		R\$ 17.294.957,88		-R\$ 16.014,68	-0,18%
BB Prev Fluxo RF Simples Fc FI	R\$ 3.033.139,07	R\$ 7.019.827,23	R\$ 8.236.160,51	R\$ 1.826.815,78	R\$ 10.009,99	0,41%
BB Prev RF Idka 2 FI	R\$ 185.372.506,61		R\$ 186.419.508,43		R\$ 1.047.001,82	1,14%
BB Prev RF Ref DI LP Perfil Fc		R\$ 186.416.195,75		R\$ 186.906.810,95	R\$ 490.615,20	0,26%
Banrisul Automatico FI RF CP	R\$ 313.263,80			R\$ 314.143,89	R\$ 880,09	0,28%
Itau Institucional RF Ref DI FI		R\$ 49.812.489,30		R\$ 49.890.255,68	R\$ 77.766,38	0,16%
BTG Pact Cre Cor I FICFI RF Cred Priv		R\$ 55.000.000,00		R\$ 55.361.012,68	R\$ 361.012,68	0,66%
Santander RF Créd Priv Crescimento Institucional F		R\$ 93.000.000,00		R\$ 93.351.061,34	R\$ 351.061,34	0,38%
<b>TOTAL DOS FUNDO DE RENDA FIXA</b>	<b>R\$ 527.031.569,82</b>	<b>R\$ 1.983.895.182,20</b>	<b>R\$ 1.899.736.271,46</b>	<b>R\$ 614.616.361,07</b>	<b>R\$ 3.425.880,51</b>	<b>0,60%</b>

<b>TOTAL DA RENDA FIXA</b>	<b>R\$ 2.493.533.625,48</b>	<b>R\$ 3.299.489.348,56</b>	<b>R\$ 3.233.332.705,96</b>	<b>R\$ 2.574.857.106,80</b>	<b>R\$ 15.166.838,72</b>	<b>0,60%</b>
----------------------------	-----------------------------	-----------------------------	-----------------------------	-----------------------------	--------------------------	--------------

# Movimentações: Regime Capitalizado

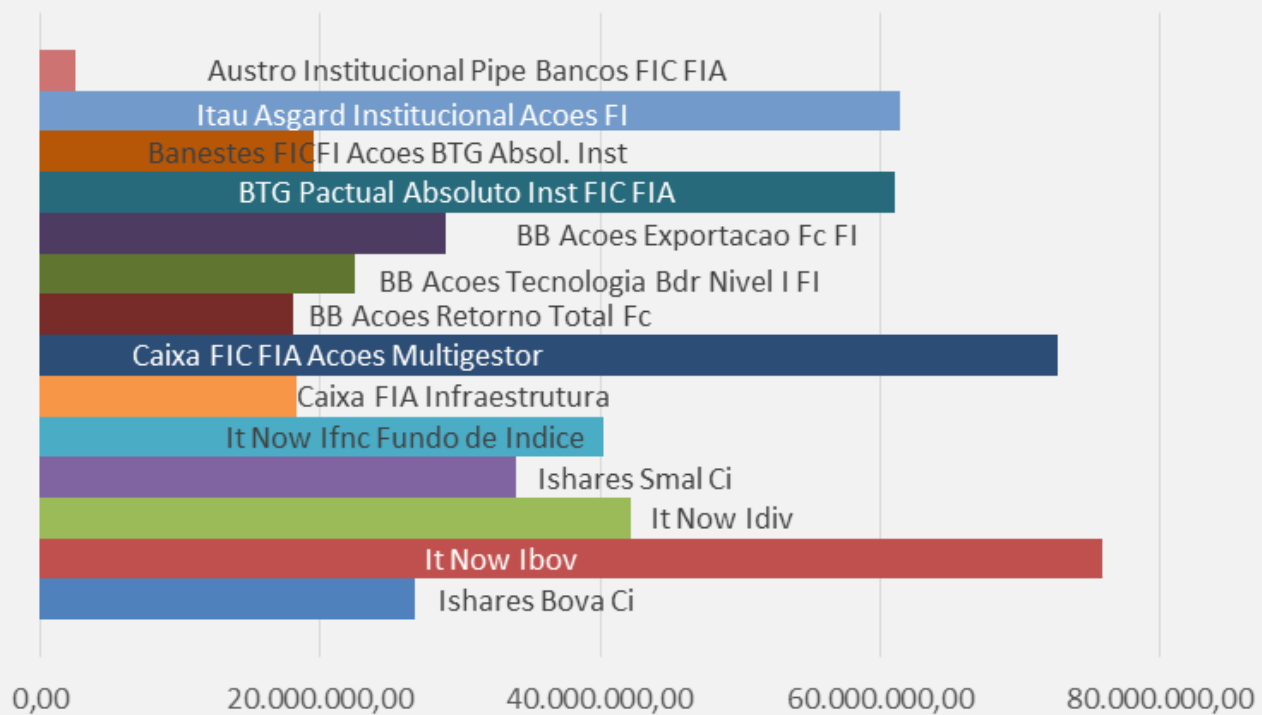
Fundos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
Ishares Bova Ci	R\$ 28.547.500,00			R\$ 26.812.500,00	-R\$ 1.735.000,00	-6,08%
It Now Ifnc Fundo de Indice	R\$ 44.544.000,00			R\$ 40.288.000,00	-R\$ 4.256.000,00	-9,55%
It Now Ibov	R\$ 80.844.884,31			R\$ 75.812.820,22	-R\$ 5.032.064,09	-6,22%
It Now Idiv	R\$ 43.895.702,63			R\$ 42.141.666,97	-R\$ 1.754.035,66	-4,00%
Ishares Smal Ci	R\$ 36.595.049,28			R\$ 34.046.921,94	-R\$ 2.548.127,34	-6,96%
BB Acoes Retorno Total Fc	R\$ 19.581.670,62			R\$ 18.071.243,51	-R\$ 1.510.427,11	-7,71%
BB Acoes Tecnologia Bdr Nivel I FI	R\$ 24.247.319,66			R\$ 22.527.853,46	-R\$ 1.719.466,20	-7,09%
BB Acoes Exportacao Fc FI	R\$ 29.464.828,49			R\$ 29.033.075,97	-R\$ 431.752,52	-1,47%
Caixa FIC FIA Acoes Multigestor	R\$ 76.926.067,25			R\$ 72.676.596,92	-R\$ 4.249.470,33	-5,52%
Caixa FIA Infraestrutura	R\$ 18.687.578,90			R\$ 18.335.421,19	-R\$ 352.157,71	-1,88%
Austro Institucional Pipe Bancos FIC FIA	R\$ 2.615.053,75			R\$ 2.542.816,31	-R\$ 72.237,44	-2,76%
Banestes FICFI Acoes BTG Absol. Inst	R\$ 21.422.143,01			R\$ 19.535.186,80	-R\$ 1.886.956,21	-8,81%
BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	R\$ 66.985.424,87			R\$ 61.063.192,13	-R\$ 5.922.232,74	-8,84%
Itau Asgard Institucional Acoes FI	R\$ 67.214.686,80			R\$ 61.396.106,04	-R\$ 5.818.580,76	-8,66%
Itau Private Mult S&P500 Brl Fc	R\$ 51.817.215,02		49.812.489,30	R\$ -	-R\$ 2.004.725,72	-3,87%
<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b>	<b>R\$ 613.389.124,59</b>	<b>R\$ -</b>	<b>R\$ 49.812.489,30</b>	<b>R\$ 524.283.401,46</b>	<b>-R\$ 39.293.233,83</b>	<b>-6,68%</b>

<b>RENTABILIDADE DO REGIME CAPITALIZADO</b>	<b>R\$ 3.106.922.750,07</b>	<b>R\$ 3.299.489.348,56</b>	<b>R\$ 3.283.145.195,26</b>	<b>R\$ 3.099.140.508,26</b>	<b>-R\$ 24.126.395,11</b>	<b>-0,77%</b>
---	-----------------------------	-----------------------------	-----------------------------	-----------------------------	---------------------------	---------------

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

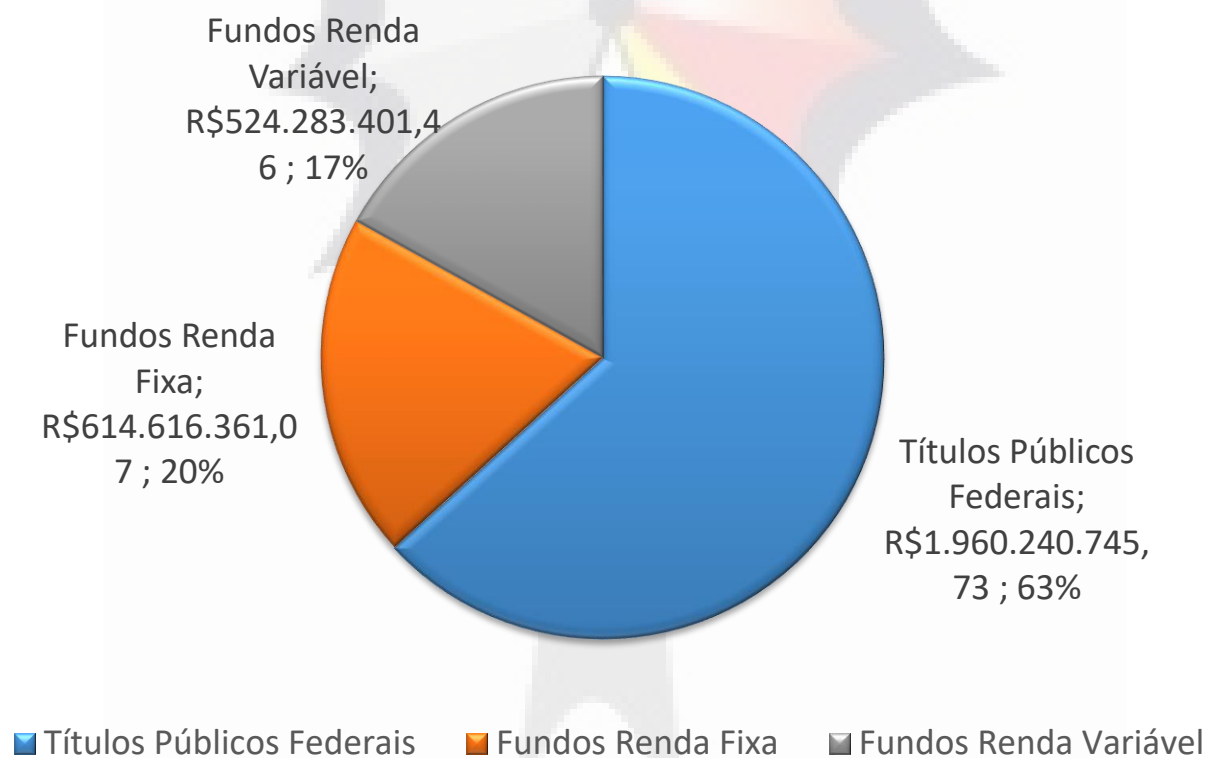
<b>RENTABILIDADE TOTAL DO REGIME CAPITALIZADO</b>	<b>R\$ 3.115.122.750,07</b>	<b>R\$ 3.299.489.348,56</b>	<b>R\$ 3.283.145.195,26</b>	<b>R\$ 3.107.340.508,26</b>	<b>-R\$ 24.126.395,11</b>	<b>-0,77%</b>
---	-----------------------------	-----------------------------	-----------------------------	-----------------------------	---------------------------	---------------

## Distribuição por fundo de renda variável





## Distribuição por segmento



# Movimentações: Outras Contas

Taxa de Administração e Repartição Simples	Saldo Atual	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
COMPREV - BB Prev RF IRFM-1	R\$ 980.841,73		R\$ 980.958,31	R\$ -	R\$ 116,58	0,02%
COMPREV - BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 2.385.775,79		R\$ 2.399.250,89	R\$ -	R\$ 13.475,10	1,14%
COMPREV - BB Previd RF Fluxo	R\$ 7.693.964,06	R\$ 1.034.262,52	R\$ 8.738.116,32	R\$ -	R\$ 9.889,74	0,26%
COMPREV - BB Previd RF Perfil		R\$ 12.038.605,18		R\$ 12.072.908,14	R\$ 34.302,96	0,28%
FUNDO PREVIDENCIA - BB Previd RF Fluxo	R\$ 295.190,91	R\$ 8.717,32	R\$ 17.652,33	R\$ 287.296,44	R\$ 1.040,54	0,36%
REPARTIÇÃO SIMPLES - Caixa Disponibilidades RF	R\$ 10.843.736,02	R\$ 5.809.683,63	R\$ 13.104.541,78	R\$ 3.566.190,82	R\$ 17.312,95	0,24%
REPARTIÇÃO SIMPLES - Caixa Brasil DI		R\$ 9.000.000,00	R\$ 2.000.000,00	R\$ 7.026.472,08	R\$ 26.472,08	0,29%
TAXA ADM - Caixa IDKA2	R\$ 137.332,23		R\$ 137.658,35	R\$ -	R\$ 326,12	0,48%
TAXA ADM - Caixa IRFM-1	R\$ 335.291,43	R\$ 62.990,00	R\$ 398.341,76	R\$ -	R\$ 60,33	0,04%
TAXA ADM - Caixa Disponibilidades	R\$ 16.925,18	R\$ 33.917,90	R\$ 37.447,32	R\$ 13.456,46	R\$ 60,70	0,40%
TAXA ADM - Caixa Brasil DI		R\$ 536.000,11	R\$ -	R\$ 537.908,59	R\$ 1.908,48	0,36%
TAXA ADM - BB Prev RF IRFM-1	R\$ 7.986.298,09		R\$ 7.987.247,37	R\$ -	R\$ 949,28	0,02%
TAXA ADM - BB Previd RF Fluxo	R\$ 9.992.777,12	R\$ 2.207.010,29	R\$ 9.025.471,77	R\$ 3.191.405,56	R\$ 17.089,92	0,26%
TAXA ADM - BB Previd RF Perfil		R\$ 16.000.000,00		R\$ 16.046.480,20	R\$ 46.480,20	0,29%
FRAP - BB Previd RF Fluxo	R\$ 960.821,98	R\$ 52.365,20	R\$ 4.900,00	R\$ 1.011.769,52	R\$ 3.482,34	0,35%
ADIANTAMENTO - BB Previd RF Fluxo	R\$ 600,12		R\$ 52,90	R\$ 549,13	R\$ 1,91	0,33%
Conta Corrente	R\$ -			R\$ -		
<b>TOTAL TAXA ADM E REPARTIÇÃO SIMPLES</b>	<b>R\$ 41.629.554,66</b>	<b>R\$ 46.783.552,15</b>	<b>R\$ 44.831.639,10</b>	<b>R\$ 43.754.436,94</b>	<b>R\$ 172.969,23</b>	<b>0,41%</b>
<b>RENTABILIDADE CONSOLIDADA DO PREVIMPA</b>	<b>R\$ 3.156.752.304,73</b>	<b>R\$ 3.346.272.900,71</b>	<b>R\$ 3.327.976.834,36</b>	<b>R\$ 3.151.094.945,20</b>	<b>-R\$ 23.953.425,88</b>	<b>-0,76%</b>

# Gestor e Administrador

Administrador	Gestor	Valor	Distribuição
TESOURO NACIONAL	GESTÃO PRÓPRIA - PREVIMPA	R\$ 1.960.240.745,73	63,3%
Caixa	Caixa	R\$ 317.978.278,86	10,3%
Itau Unibanco SA	Itau Unibanco SA	R\$ 269.528.848,91	8,7%
BB Dsvm S.A	BB Dsvm S.A	R\$ 258.365.799,67	8,3%
BTG Pactual Servicos Financeiros SA Dsvm	BTG Pactual Servicos Financeiros SA Dsvm	R\$ 116.424.204,81	3,8%
Banco Santander (Brasil) SA	Santander Brasil Gestão de Recursos LTDA	R\$ 93.351.061,34	3,0%
BNP Paribas	Blackrock Brasil Gestora	R\$ 60.859.421,94	2,0%
Banestes	Banestes DTVM	R\$ 19.535.186,80	0,6%
BFL INVESTIMENTOS DE RECURSOS LTDA	Austro Capital	R\$ 2.542.816,31	0,1%
Banrisul Corretora	Banrisul Corretora	R\$ 314.143,89	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	1.960.240.745,73	N. A.	N. A.	N. A.	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100%	100%	70%	1.960.240.745,73	63,25%

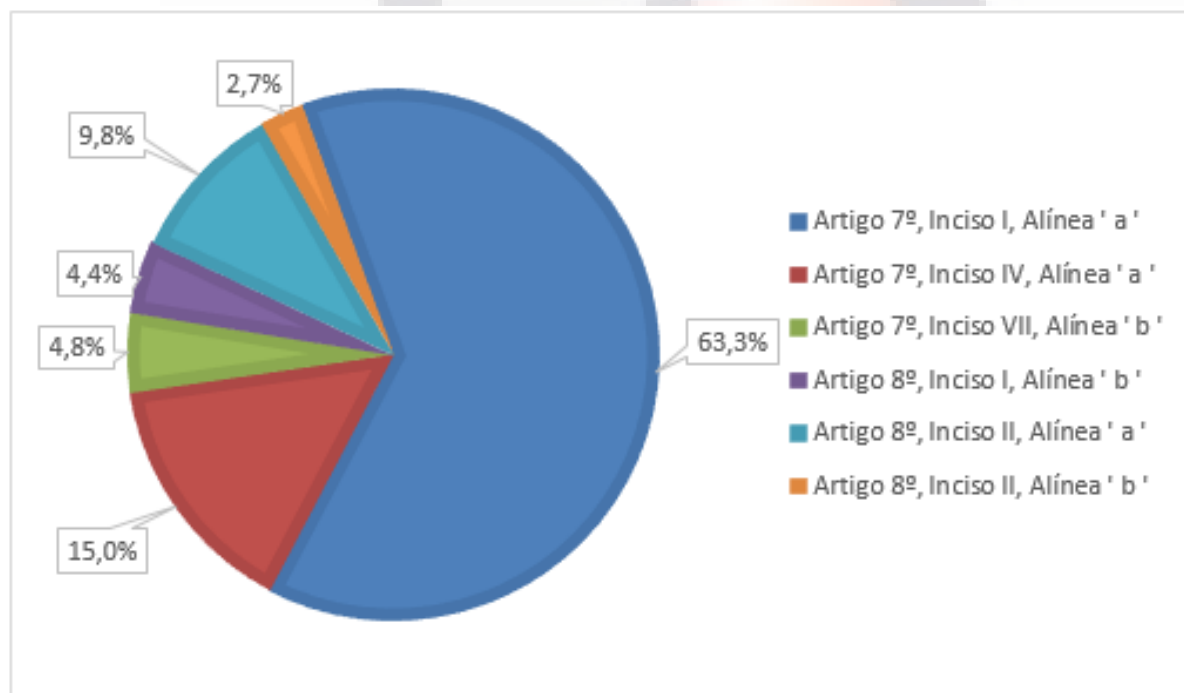
Fundos de Renda fixa	Valor atual	PL do fundo	Participação Previmpa no fundo	Limite por fundo conf. Resolução	Enquadramento resolução 3922	Limite do enquadramento 3922	Limite da política de investimentos	Alvo da política de investimentos	Valor por Carteira	% Carteira
Caixa FIC Brasil Disponibilidades RF	85.916,57	598.538.196,75	0,01%							
BB Prev Fluxo RF Simples Fc FI	1.826.815,78	2.310.961.339,30	0,08%							
Banrisul Automatico FI RF CP	314.143,89	886.141.991,69	0,04%	15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40%	40%	1%	465.904.287,05	15,03%
Caixa FI Brasil RF Ref DI LP	226.880.344,18	7.234.670.708,96	3,14%							
BB Prev RF Ref DI LP Perfil Fc	186.906.810,95	5.468.058.659,45	3,42%							
Itau Institucional RF Ref DI FI	49.890.255,68	1.487.489.592,68	3,35%							
BTG Pact Cre Cor I FICFI RF Cred Priv	55.361.012,68	1.235.617.227,96	4,48%	5%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	5%	5%	0,5%	148.712.074,02	4,80%
Santander RF Créd Priv Crescimento Institú	93.351.061,34	2.137.441.586,33	4,37%							

# 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	26.812.500,00	15.342.948.844,27	0,17%							
It Now Ibov	75.812.820,22	7.233.509.659,65	1,05%	15%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30%	30%	6%	136.672.242,16	4,41%
Ishares Smal Ci	34.046.921,94	1.455.462.440,27	2,34%							
Caixa FIA Infraestrutura	18.335.421,19	378.964.582,69	4,84%							
Caixa FIC FIA Acoes Multigestor	72.676.596,92	970.935.376,15	7,49%							
BB Acoes Retorno Total Fc	18.071.243,51	1.709.110.671,86	1,06%							
BB Acoes Tecnologia Bdr Nivel I FI	22.527.853,46	999.486.616,10	2,25%							
BB Acoes Exportacao Fc FI	29.033.075,97	358.347.201,68	8,10%	15%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20%	20%	4%	305.181.492,33	9,85%
BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	61.063.192,13	2.403.304.462,99	2,54%							
Banestes FICFI Acoes BTG Absol. Inst	19.535.186,80	196.446.321,75	9,94%							
Itau Asgard Institucional Acoes FI	61.396.106,04	546.078.284,52	11,24%							
Austro Institucional Pipe Bancos FIC FIA	2.542.816,31	20.358.996,26	12,49%							
It Now Ifnc Fundo de Indice	40.288.000,00	410.188.546,70	9,82%	15%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20%	20%	2%	82.429.666,97	2,66%
It Now Idiv	42.141.666,97	353.651.581,07	11,92%							

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

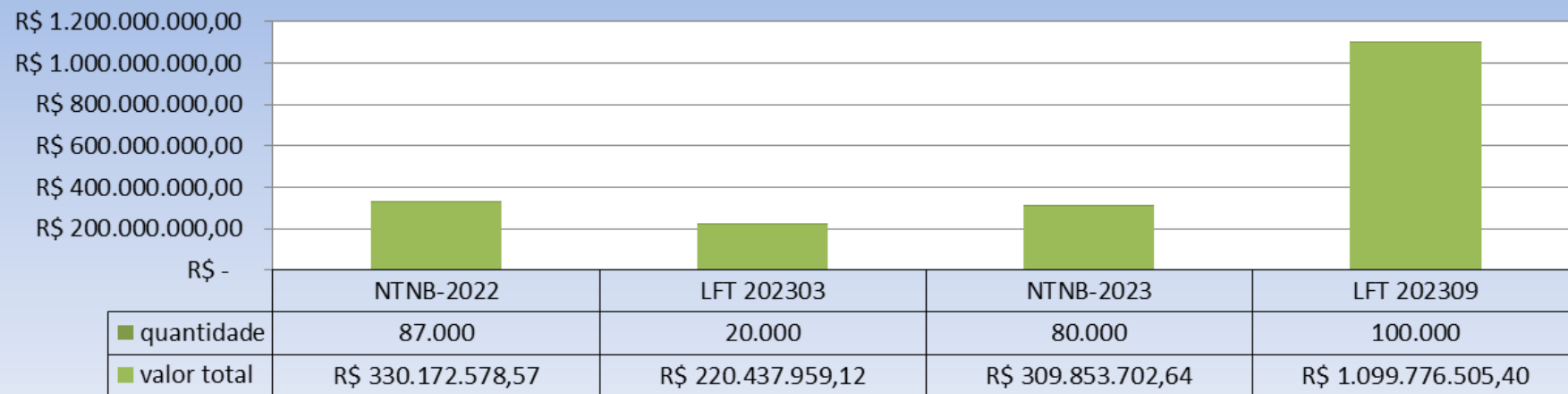
# Distribuição por enquadramento



# 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										
LFT										
LFT20230301 - 210100	01/03/2023	06/09/2021	0	20.000	10.976,51408100	11.021,89795600	0,085005	220.437.959,12	219.842.014,20	11,25%
LFT20230901 - 210100	01/09/2023	08/09/2021	0	40.000	10.960,12439900	10.997,76505400	0,149000	439.910.602,16	438.944.889,80	22,44%
LFT20230901 - 210100	01/09/2023	08/09/2021	0	60.000	10.960,98181300	10.997,76505400	0,145000	659.865.903,24	658.468.841,04	33,66%
<b>Total LFT:</b>				<b>120.000</b>				<b>1.320.214.464,52</b>	<b>1.317.255.745,04</b>	<b>67,35%</b>
NTN-PÓS										
NTNB20220815 - 760199	15/08/2022	17/08/2021	0	87.000	3.736,01045400	3.795,08711000	2,359074	330.172.578,57	220.329.206,64	16,84%
NTNB20230515 - 760199	15/05/2023	14/04/2021	20.000	80.000	3.860,87637900	3.873,17128300	2,259018	309.853.702,64	439.929.131,96	15,81%
<b>Total NTN-PÓS:</b>			<b>0</b>	<b>167.000</b>				<b>640.026.281,21</b>	<b>660.258.338,60</b>	<b>32,65%</b>
<b>Total Títulos Públicos:</b>				<b>287.000</b>				<b>R\$ 1.960.240.745,73</b>	<b>R\$ 1.977.514.083,64</b>	<b>100,0%</b>

## Distribuição dos Títulos Públicos em Carteira



Duration de MACAULAY (anos)	Duration Modificada	Varição % Preço (100 PB)	Varição em MOEDA (100 PB)	Varição em MOEDA (1 PB)	Duration do Passivo Atuarial
0,39	0,38	0,38%	-R\$ 7.431.300,52	-R\$ 743,13	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)

# Histórico de Rentabilidade e Risco

## - Renda Fixa

Títulos Públicos	1 mês	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	No ano	VaR 95% 1 M	Volatilid ade	Beta 12M	Sortino 12M	Sharpe 12M
<b>BENCHMARK IMA EX-C</b>	0,02	-0,42	0,89	2,05	6,02	-0,76					
Títulos Públicos da carteira Previmpa	0,5796	0,0673	1,7283	0,6936	6,0135	-2,7193					

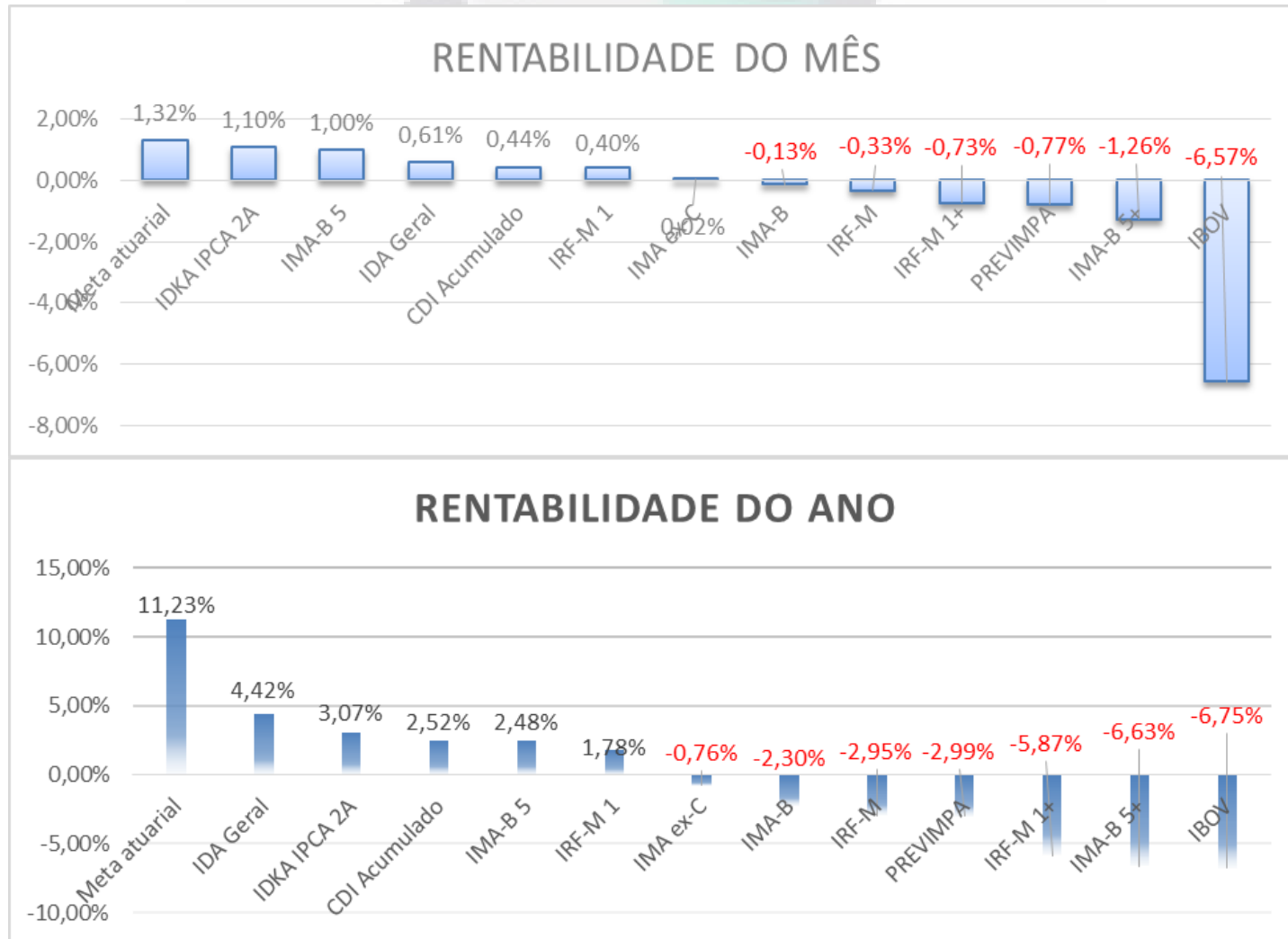
Fundos de Renda fixa	1 mês	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	No ano	VaR 95% 1 M	Volatilid ade	Beta 12M	Sortino 12M	Sharpe 12M
<b>BENCHMARK CDI</b>	<b>0,44</b>	<b>1,23</b>	<b>2,03</b>	<b>3,01</b>	<b>6,66</b>	<b>2,52</b>					
Caixa FIC Brasil Disponibilidades RF	0,33	0,91	1,49	2,04	4,77	1,77	0,00%	0,07%	-0,01	-1592,41%	-74,86
BB Prev Fluxo RF Simples Fc FI	0,35	0,90	1,43	1,88	4,33	1,66	0,00%	0,16%	-0,01	-947,19%	-7,74
Banrisul Automatico FI RF CP	0,28	0,70	1,08	1,23	1,98	1,17	0,00%	0,07%	-0,01	-1601,37%	-100,07
Caixa FI Brasil RF Ref DI LP	0,53	1,48	2,31	3,31	6,30	2,65	0,03%	0,28%	-0,01	202,14%	1,14
BB Prev RF Ref DI LP Perfil Fc	0,46	1,31	2,13	3,23	6,30	2,64	0,01%	0,18%	-0,01	209,92%	1,32
Itau Institucional RF Ref DI FI	0,53	1,49	2,47	3,47	6,77	2,96	0,01%	0,13%	-0,01	1938,33%	5,50
BTG Pact Cre Cor I FICFI RF Cred Priv	0,73	2,21	3,77	6,90	5,75	5,76	0,04%	0,54%	-0,02	1672,01%	7,06
Santander RF Créd Priv Crescimento Instit	0,60	1,83	3,24	4,74	7,01	3,85	0,03%	0,39%	-0,01	1048,45%	4,48

# Histórico de Rentabilidade e Risco

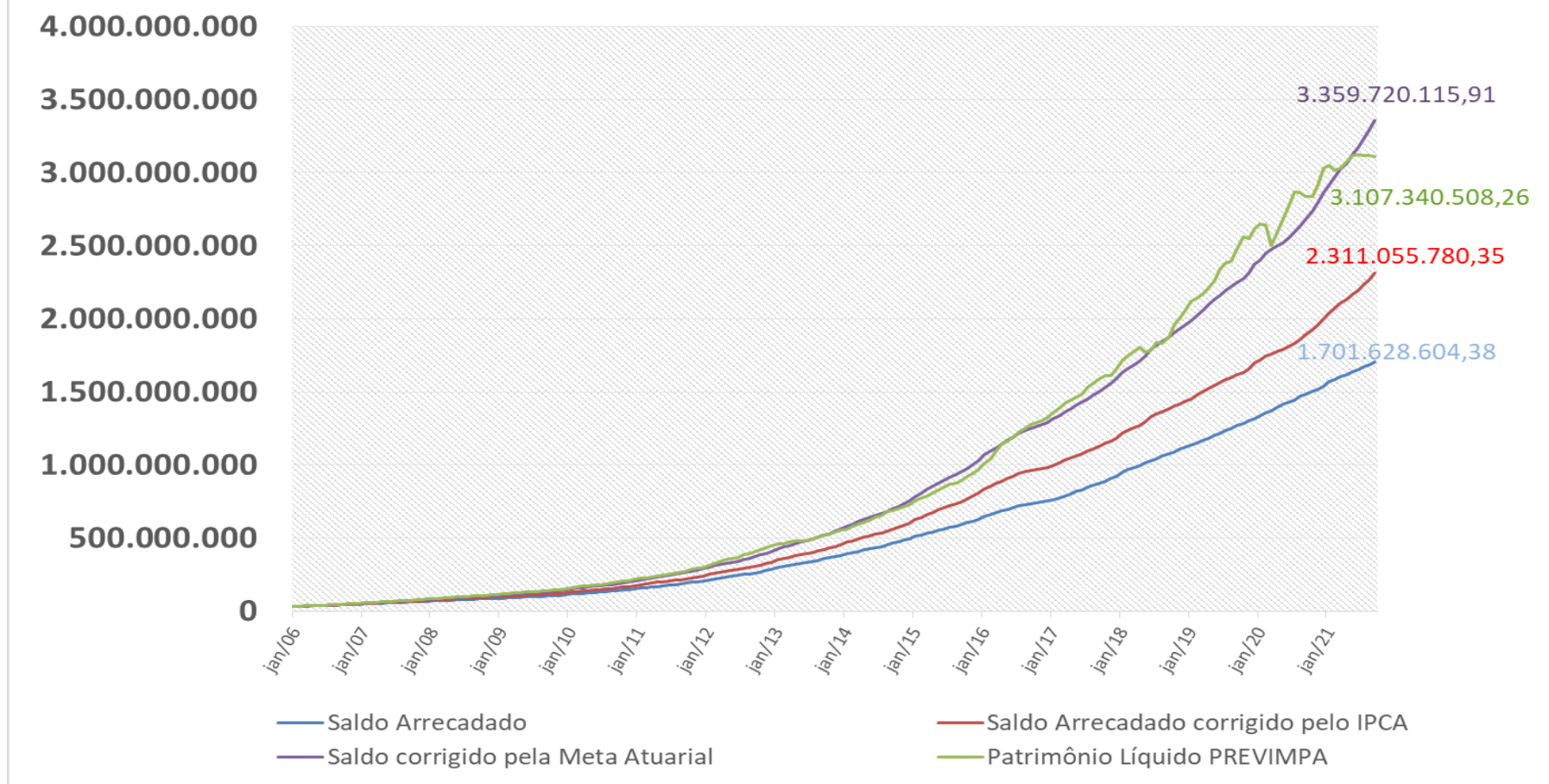
## - Renda Variável

Fundos Renda Variável	1 mês	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	No ano	VaR 95% 1M	Volatilid ade 12M	Beta 12M	Sortino 12M	Sharpe
<b>BENCHMARK IBOVESPA</b>	<b>-6,57</b>	<b>-12,48</b>	<b>-4,85</b>	<b>17,31</b>	<b>5,95</b>	<b>-6,75</b>					
It Now Ibov	-6,57	-12,61	-4,84	17,19	5,94	-6,83	2,74%	21,66%	1,01	110,36%	0,78
Ishares Bova Ci	-6,65	-12,58	-4,94	16,96	5,43	-7,12	2,77%	21,88%	1,00	108,02%	0,76
It Now Idiv	-3,69	-6,54	-0,95	19,71	8,45	-4,37	2,58%	18,95%	0,91	144,18%	0,99
Ishares Smal Ci	-6,55	-15,07	-5,03	15,45	12,94	-5,84	2,90%	23,74%	1,02	92,57%	0,66
It Now Ifnc Fundo de Indice	-8,50	-14,62	-7,98	11,39	-15,24	-14,89	3,32%	26,65%	1,22	68,18%	0,46
Itau Asgard Institucional Acoes FI	-8,50	-16,58	-9,00	10,82	N.A	-11,75	2,96%	19,24%	0,80	71,10%	0,50
Caixa FIC FIA Acoes Multigestor	-5,52	-12,57	-3,53	12,03	9,28	-5,72	2,28%	18,57%	0,82	80,76%	0,58
BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	-8,84	-18,94	-14,07	-4,83	0,46	-15,32	2,81%	20,87%	0,72	-37,39%	-0,27
Banestes FICFI Acoes BTG Absol. Inst	-8,81	-18,88	-14,02	-4,84	0,39	-15,27	2,80%	20,78%	0,71	-37,71%	-0,27
BB Acoes Retorno Total Fc	-7,71	-14,35	-5,38	16,49	8,55	-3,23	2,70%	20,24%	0,84	106,80%	0,77
BB Acoes Tecnologia Bdr Nivel I FI	-7,09	-6,74	-0,01	15,46	47,38	4,54	2,33%	17,78%	0,32	108,95%	0,79
BB Acoes Exportacao Fc FI	-1,47	-4,64	5,18	42,42	52,97	16,36	2,68%	20,44%	0,61	299,81%	2,03
Caixa FIA Infraestrutura	-1,88	-6,58	-0,76	15,82	9,79	-4,23	2,34%	21,54%	0,85	102,21%	0,70
Austro Institucional Pipe Bancos FIC FIA	-2,76	-10,42	-5,68	-32,16	-72,75	-25,81	13,53%	25,60%	0,64	-168,08%	-1,29

# Benchmark



### Patrimônio Financeiro Líquido Regime Capitalizado (Janeiro de 2006 a Setembro 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
<b>Renda Fixa</b>										
Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica	Caixa Econômica	Caixa Brasil Disponibilidades RF	14.508.643/0001-55	0,80%	Não há	D+0	D+0	Não há	18:00
			Caixa Brasil DI	03.737.206/0001-97	0,20%	Não há	D+0	D+0	Não há	17:00
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 Perfil DI	13.077.418/0001-49	0,20%	Não há	D+0	D+0	Não há	17:00
Banco do Estado do Rio Grande do Sul	Banrisul Corretora	Banrisul Corretora	Banrisul Automático FI RF CP	01.353.260/0001-03	1,60%	Não há	D+0	D+0	Não há	17:30
<b>Renda Variável</b>										
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	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 Ações Tecnologia	01.578.474/0001-88	2,00%	Não há	D+1	D+3	Não há	17:00
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.	ITAÚ UNIBANCO S.A.	Itaú Ações Asgard Instit. FICFIA	35.495.250/0001-24	2,00%	Não há	D+0	D+23	Não há	16:00
		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
BNB Paribas	Black Rock	Banrisul Corretora	ETF BOVV 11	21.407.758/0001-19	0,30%	Não há	D+2	D+2	Não há	17:00
			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
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