

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

COMITÊ DE INVESTIMENTOS DO PREVIMPA

ATA Nº 42 2021

Reunião Extraordinária 42/2021 - Comitê de Investimentos - PREVIMPA

Data e Hora	Local
13/12/2021 - 14 horas	Rua João Manuel, 50 - 9º 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 - Unidade de Investimentos-Previmpa. Ausências justificadas: Giordana Zimmermann Besen, Atuária, ASSEPLA - Previmpa, Renan da Silva Aguiar - Chefe da Assessoria de Planejamento - Previmpa e Roger Sotoriva Piccini - Administrador - Previmpa.	
Pauta:	
1 – Apresentação Resultados dos Investimentos Novembro/2021	
Resumo da Reunião	
Verificado quórum, a sessão foi iniciada tendo como pauta a Apresentação dos Resultados dos Investimentos de Novembro/2021. Sr. Dalvin inicia a apresentação, cujo resultado no mês, apresentou rentabilidade de 0,1837%, e acumulado no ano de 4,13% negativos. Ressalta que a rentabilidade negativa é na marcação à mercado, sendo que não representa efetivamente perda, uma vez que não foram realizados, resgatados nenhum ativo cuja rentabilidade está abaixo de zero. Atualmente, os ativos em Renda Variável tem sofrido mais que a renda fixa, em especial títulos públicos federais, pois pelo quinto mês consecutivo, os últimos dias do mês tem sido de grande queda do índice Ibovespa. Porém a tendência já para Dezembro, aponta para recuperação da Bolsa de Valores brasileira, o que poderá agregar na carteira de investimentos do Departamento. A apresentação foi aprovada, bem como o Parecer 10/2021, o qual será encaminhado ao Conselho Fiscal.	
Encaminhamentos	
Aprovação Parecer 10/2021, constante no processo 21.13.000000760-1	
Pendências	



Documento assinado eletronicamente por **Dalvin Gabriel José de Souza, Chefe de Unidade**, em 21/12/2021, às 17:07, 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 23/12/2021, às 09:11, 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 23/12/2021, às 11:20, conforme o art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006, e o Decreto Municipal 18.916/2015.



Documento assinado eletronicamente por **Renan da Silva Aguiar, Administrador(a)**, em 30/12/2021, às 13:33, 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 **16682411** e o código CRC **95827061**.

Relatório de Resultados dos Investimentos do PREVIMPA

Competência: Novembro/2021

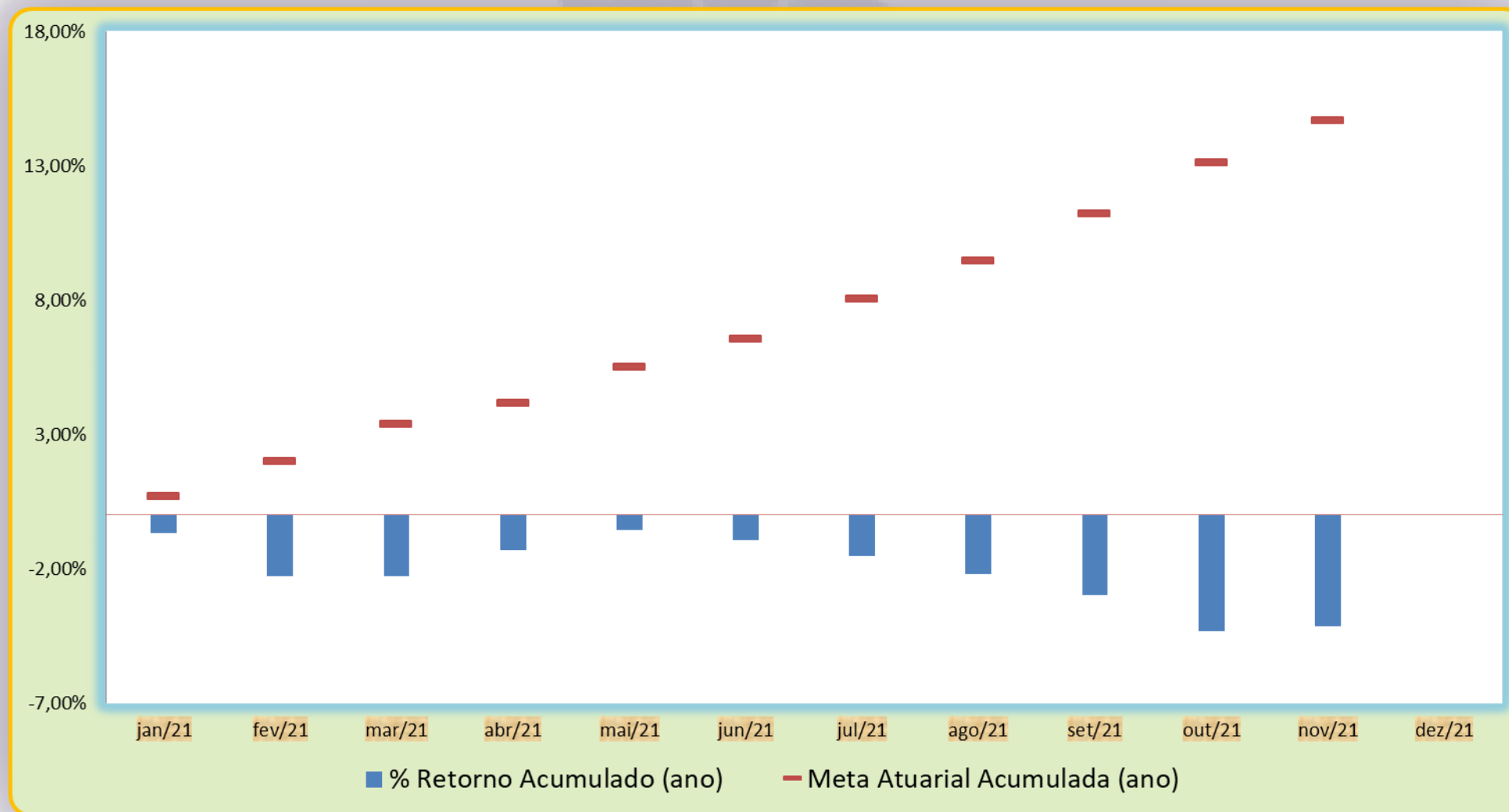
Demonstrativo mensal

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	-0,6909%	-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	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	-0,7725%	-2,99%
out/21	R\$ 3.107.340.508,26	R\$ 74.139.774,49	R\$ 57.292.497,88	R\$ 16.847.276,61	R\$ 181.724.119,56	R\$ 3.082.043.830,86	-R\$ 42.143.954,01	-R\$ 135.309.553,35	-1,3526%	-4,33%
nov/21	R\$ 3.082.043.830,86	R\$ 37.989.592,03	R\$ 18.284.962,24	R\$ 19.704.629,79	R\$ 201.428.749,35	R\$ 3.107.428.200,90	R\$ 5.679.740,25	-R\$ 129.629.813,10	0,1837%	-4,13%
dez/21										
TOTAL ANO	R\$ 3.035.629.264,65	R\$ 8.742.254.618,17	R\$ 8.540.825.868,82	R\$ 201.428.749,35		R\$ 3.107.428.200,90	-R\$ 129.629.813,10			-4,13%

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)	Retorno Mensal Anualizado
jan/21	0,25%	0,25%	0,69%	0,69%	5,61%	10,78%	51,98%	-7,98%
fev/21	0,86%	1,11%	1,31%	2,01%	4,90%	11,41%	42,92%	-17,55%
mar/21	0,93%	2,05%	1,38%	3,41%	11,03%	12,32%	89,58%	-0,20%
abr/21	0,31%	2,37%	0,75%	4,19%	9,18%	12,97%	70,78%	12,50%
mai/21	0,83%	3,22%	1,28%	5,52%	7,12%	14,29%	49,81%	9,37%
jun/21	0,53%	3,77%	0,97%	6,55%	4,02%	14,54%	27,61%	-4,26%
jul/21	0,96%	4,76%	1,41%	8,05%	0,62%	15,18%	4,05%	-7,02%
ago/21	0,87%	5,67%	1,32%	9,47%	0,86%	15,85%	5,44%	-7,96%
set/21	1,16%	6,90%	1,61%	11,23%	1,62%	16,40%	9,89%	-8,89%
out/21	1,25%	8,24%	1,70%	13,12%	0,74%	16,80%	4,42%	-15,08%
nov/21	0,95%	9,26%	1,40%	14,70%	-1,20%	16,81%	-7,13%	2,23%
dez/21								
		9,26%		14,70%				

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\$ 8.742.254.618,17	R\$ 8.540.825.868,82	R\$ 201.428.749,35	R\$ 3.107.428.200,90	-R\$ 129.629.813,10	-4,13%	14,70%	9,26%
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\$ 1.963.238.265,97		R\$ 8.815.710,00	R\$ 1.974.416.049,31	R\$ 19.993.493,34	1,02%

Fundos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
Caixa FIC Brasil Disponibilidades RF	R\$ 78.244,01	R\$ 8.815.710,00	R\$ 8.823.711,92	R\$ 72.685,12	R\$ 2.443,03	0,03%
Caixa FI Brasil RF Ref DI LP	R\$ 245.717.771,88	R\$ 26.392.184,44		R\$ 273.733.162,79	R\$ 1.623.206,47	0,63%
BB Prev Fluxo RF Simples Fc FI	R\$ 1.049.702,63	R\$ 2.781.697,59	R\$ 645.540,32	R\$ 3.190.230,24	R\$ 4.370,34	0,21%
BB Prev RF Ref DI LP Perfil Fc	R\$ 134.293.624,58			R\$ 135.140.468,74	R\$ 846.844,16	0,63%
Banrisul Automatico FI RF CP	R\$ 315.179,13			R\$ 316.540,93	R\$ 1.361,80	0,43%
Itau Institucional RF Ref DI FI	R\$ 50.176.059,30			R\$ 50.491.018,59	R\$ 314.959,29	0,63%
BTG Pact Cre Cor I FICFI RF Cred Priv	R\$ 55.861.892,05			R\$ 56.200.686,34	R\$ 338.794,29	0,61%
Sant RF Cred Priv Crescimento Inst FI LP	R\$ 93.983.428,47			R\$ 94.544.153,82	R\$ 560.725,35	0,60%
TOTAL DOS FUNDO DE RENDA FIXA	R\$ 581.475.902,05	R\$ 37.989.592,03	R\$ 9.469.252,24	R\$ 613.688.946,57	R\$ 3.692.704,73	0,62%

TOTAL DA RENDA FIXA	R\$ 2.544.714.168,02	R\$ 37.989.592,03	R\$ 18.284.962,24	R\$ 2.588.104.995,88	R\$ 23.686.198,07	0,93%
----------------------------	-----------------------------	--------------------------	--------------------------	-----------------------------	--------------------------	--------------

Movimentações: Regime Capitalizado

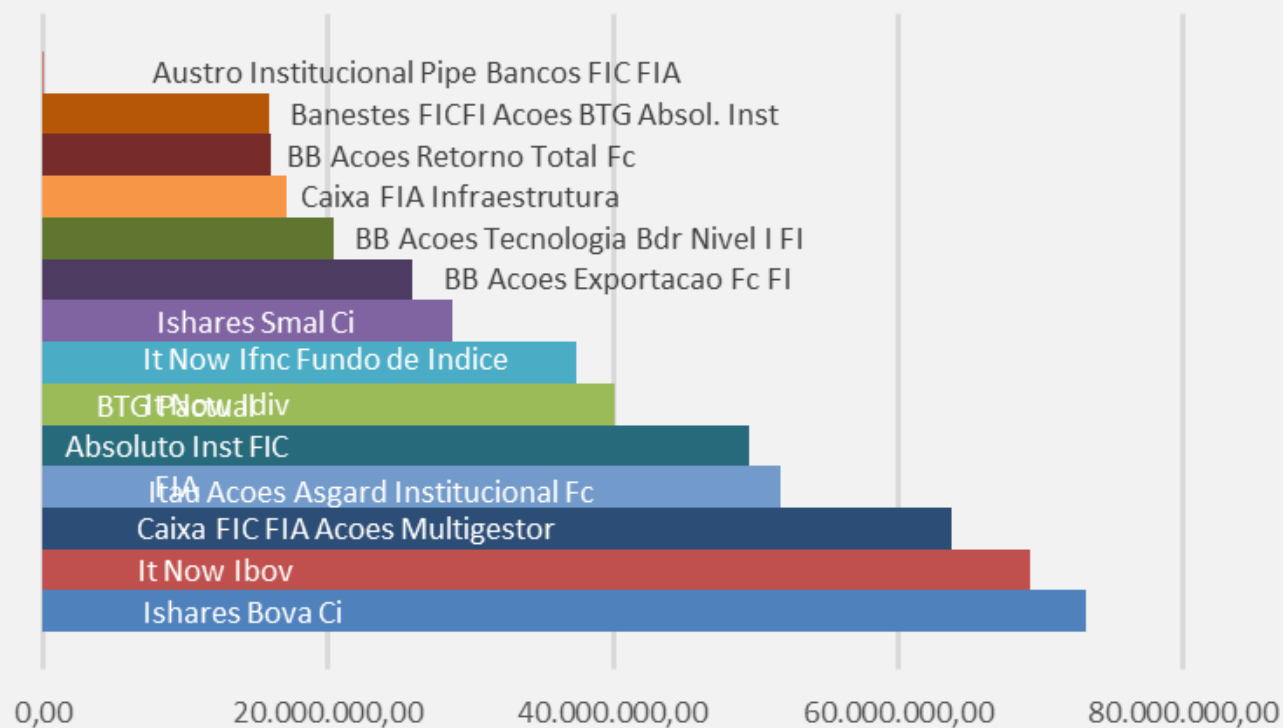
Fundos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
Ishares Bova Ci	R\$ 75.435.000,00			R\$ 73.215.000,00	-R\$ 2.220.000,00	-2,94%
It Now Ifnc Fundo de Indice	R\$ 38.524.000,00			R\$ 37.376.000,00	-R\$ 1.148.000,00	-2,98%
It Now Ibov	R\$ 71.058.433,96			R\$ 69.189.188,08	-R\$ 1.869.245,88	-2,63%
It Now Idiv	R\$ 40.611.686,96			R\$ 40.137.969,30	-R\$ 473.717,66	-1,17%
Ishares Smal Ci	R\$ 29.994.414,30			R\$ 28.703.043,60	-R\$ 1.291.370,70	-4,31%
BB Acoes Retorno Total Fc	R\$ 16.535.651,52			R\$ 15.997.075,71	-R\$ 538.575,81	-3,26%
BB Acoes Tecnologia Bdr Nivel I FI	R\$ 21.212.362,71			R\$ 20.480.124,15	-R\$ 732.238,56	-3,45%
BB Acoes Exportacao Fc FI	R\$ 27.340.229,55			R\$ 25.903.852,47	-R\$ 1.436.377,08	-5,25%
Caixa FIC FIA Acoes Multigestor	R\$ 65.314.227,10			R\$ 63.766.224,26	-R\$ 1.548.002,84	-2,37%
Caixa FIA Infraestrutura	R\$ 16.557.399,32			R\$ 17.062.105,01	R\$ 504.705,69	3,05%
Austro Institucional Pipe Bancos FIC FIA	R\$ 84.464,57			R\$ 84.464,57	R\$ -	0,00%
Banestes FICFI Acoes BTG Absol. Inst	R\$ 16.995.534,89			R\$ 15.864.107,17	-R\$ 1.131.427,72	-6,66%
BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	R\$ 53.088.587,94			R\$ 49.528.258,29	-R\$ 3.560.329,65	-6,71%
Itau Acoes Asgard Institucional Fc	R\$ 54.154.128,38			R\$ 51.773.786,21	-R\$ 2.380.342,17	-4,40%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 526.906.121,20	R\$ -	R\$ -	R\$ 509.081.198,82	-R\$ 17.824.922,38	-3,38%

RENTABILIDADE DO REGIME CAPITALIZADO	R\$ 3.071.620.289,22	R\$ 37.989.592,03	R\$ 18.284.962,24	R\$ 3.097.186.194,70	R\$ 5.861.275,69	0,19%
---	-----------------------------	--------------------------	--------------------------	-----------------------------	-------------------------	--------------

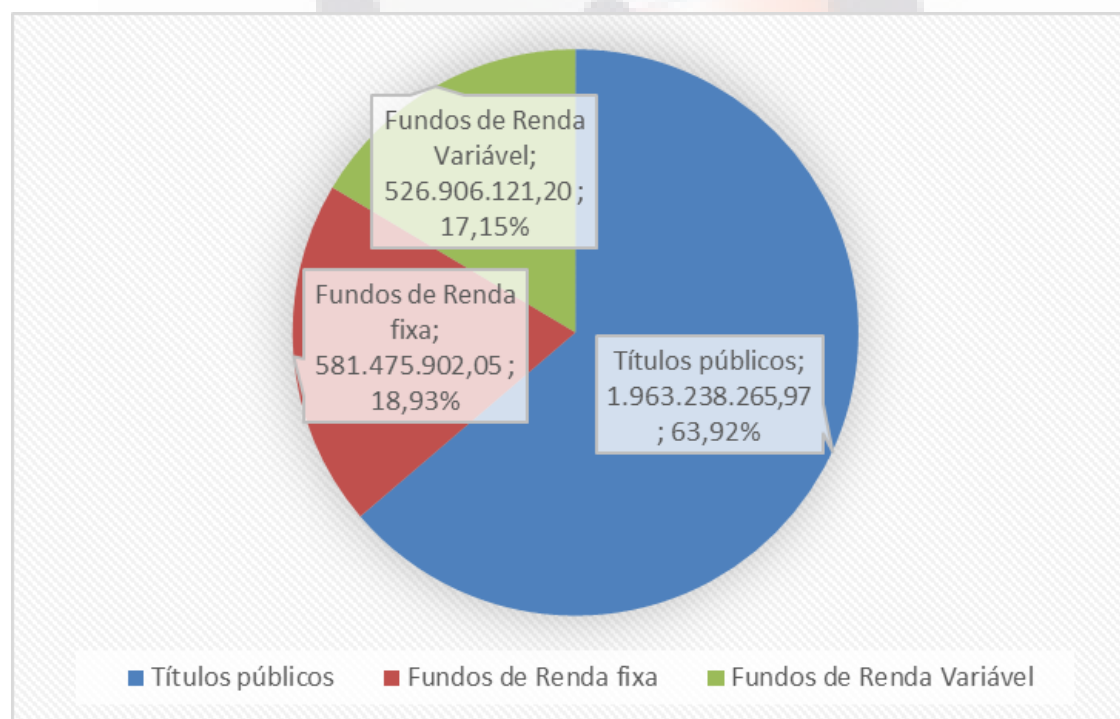
OUTROS ATIVOS	Saldo Atual	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
TERRENO	R\$ 8.240.000,00			R\$ 8.240.000,00	R\$ -	0,00%
113.982 AÇÕES BANRISUL ON N1	R\$ 1.435.033,38			R\$ 1.309.653,18	-R\$ 125.380,20	-8,74%
68.482 AÇÕES BANRISUL PNB N1	R\$ 748.508,26			R\$ 692.353,02	-R\$ 56.155,24	-7,50%

RENTABILIDADE TOTAL DO REGIME CAPITALIZADO	R\$ 3.082.043.830,86	R\$ 37.989.592,03	R\$ 18.284.962,24	R\$ 3.107.428.200,90	R\$ 5.679.740,25	0,18%
---	-----------------------------	--------------------------	--------------------------	-----------------------------	-------------------------	--------------

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 Previd RF Fluxo	R\$ 1.032.353,11	R\$ 1.034.772,34		R\$ 2.076.245,82	R\$ 9.120,37	0,59%
COMPREV - BB Previd RF Perfil	R\$ 11.880.182,20			R\$ 11.955.097,61	R\$ 74.915,41	0,63%
FUNDO PREVIDENCIA - BB Previd RF Fluxo	R\$ 297.103,40	R\$ 14.487,37	R\$ 6.821,48	R\$ 306.297,22	R\$ 1.527,93	0,51%
REPARTIÇÃO SIMPLES - Caixa Disponibilidades RF	R\$ 4.195.400,89	R\$ 3.812.786,55	R\$ 4.148.223,56	R\$ 3.876.090,15	R\$ 16.126,27	0,40%
REPARTIÇÃO SIMPLES - Caixa Brasil DI	R\$ 6.059.244,63			R\$ 6.096.954,46	R\$ 37.709,83	0,62%
TAXA ADM - Caixa Disponibilidades	R\$ 10.044,53	R\$ 68.150,00	R\$ 71.602,17	R\$ 6.653,73	R\$ 61,37	0,74%
TAXA ADM - Caixa Brasil DI	R\$ 622.052,91	R\$ 68.150,00	R\$ 5.000,00	R\$ 689.401,51	R\$ 4.198,60	0,64%
TAXA ADM - BB Previd RF Fluxo	R\$ 4.821.114,91	R\$ 2.879.368,04	R\$ 804.921,68	R\$ 6.920.556,87	R\$ 24.995,60	0,43%
TAXA ADM - BB Previd RF Perfil	R\$ 16.124.930,94		R\$ 12.500.000,00	R\$ 3.722.253,79	R\$ 97.322,85	0,99%
FRAP - BB Previd RF Fluxo	R\$ 1.057.720,49	R\$ 91.688,76	R\$ 16.742,30	R\$ 1.138.288,88	R\$ 5.621,93	0,51%
ADIANTAMENTO - BB Previd RF Fluxo	R\$ 792,05	R\$ 1.000,00	R\$ 781,81	R\$ 1.012,95	R\$ 2,71	0,30%
Conta Corrente	R\$ 3,15			R\$ 7.594,02	R\$ 7.590,87	
TOTAL TAXA ADM E REPARTIÇÃO SIMPLES	R\$ 46.100.943,21	R\$ 7.970.403,06	R\$ 17.554.093,00	R\$ 36.796.447,01	R\$ 279.193,74	0,68%
RENTABILIDADE CONSOLIDADA DO PREVIMPA	R\$ 3.128.144.774,07	R\$ 45.959.995,09	R\$ 35.839.055,24	R\$ 3.144.224.647,91	R\$ 5.958.933,99	0,19%

Gestor e Administrador

Administrador	Gestor	Valor	Distribuição
TESOURO NACIONAL	GESTÃO PRÓPRIA - PREVIMPA	R\$ 1.974.416.049,31	63,7%
Caixa	Caixa	R\$ 354.634.177,18	11,5%
Itau Unibanco SA	Itau Unibanco SA	R\$ 248.967.962,18	8,0%
BB Dtvn S.A	BB Dtvn S.A	R\$ 200.711.751,31	6,5%
BTG Pactual Servicos Financeiros SA Dtvn	BTG Pactual Servicos Financeiros SA Dtvn	R\$ 105.728.944,63	3,4%
Banco Santander (Brasil) SA	Santander Brasil Gestão de Recursos LTDA	R\$ 94.544.153,82	3,1%
BNP Paribas	Blackrock Brasil Gestora	R\$ 101.918.043,60	3,3%
Banestes	Banestes DTVN	R\$ 15.864.107,17	0,5%
BFL INVESTIMENTOS DE RECURSOS LTDA	Austro Capital	R\$ 84.464,57	0,0%
Banrisul Corretora	Banrisul Corretora	R\$ 316.540,93	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	1.974.416.049,31	N. A.	N. A.	N. A.	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a '	100%	100%	70%	1.974.416.049,31	63,75%

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	72.685,12	704.319.166,54	0,01%	15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a '	40%	40%	1%	462.944.106,41	14,95%
BB Prev Fluxo RF Simples Fc FI	3.190.230,24	2.679.858.220,32	0,12%							
Banrisul Automatico FI RF CP	316.540,93	1.012.988.345,18	0,03%							
Caixa FI Brasil RF Ref DI LP	273.733.162,79	8.064.205.057,36	3,39%							
BB Prev RF Ref DI LP Perfil Fc	135.140.468,74	6.797.782.473,23	1,99%							
Itau Institucional RF Ref DI FI	50.491.018,59	1.625.006.572,20	3,11%	5%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b '	5%	5%	0,5%	150.744.840,16	4,87%
BTG Pact Cre Cor I FICFI RF Cred Priv	56.200.686,34	1.405.415.305,82	4,00%							
Sant RF Cred Priv Crescimento Inst FI LP	94.544.153,82	2.047.237.554,19	4,62%							

Enquadramento Renda Variável

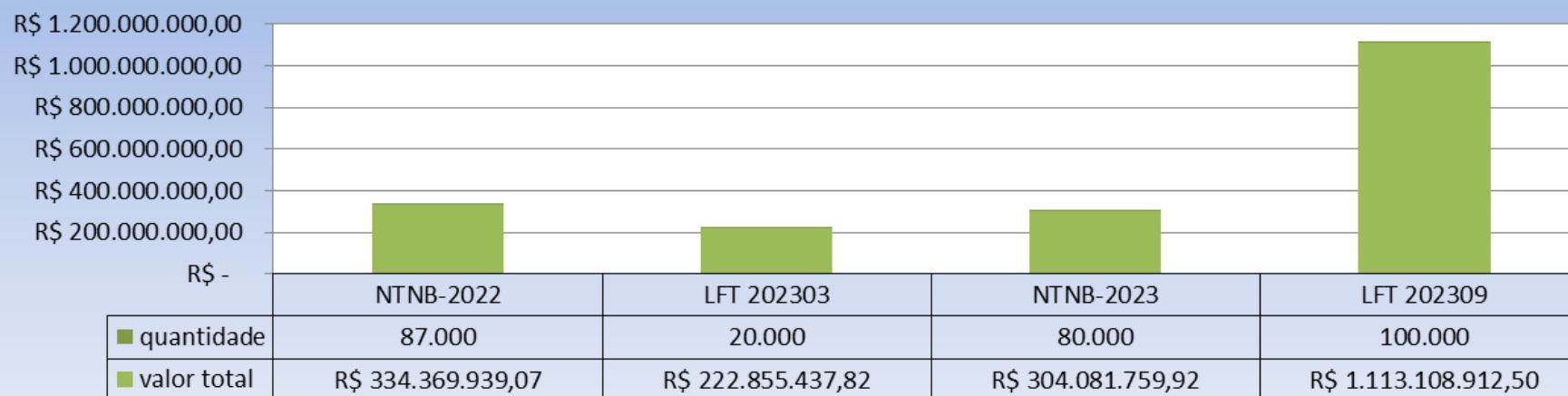
Fundos de Renda Variável	Valor atual	PL do fundo	Participação Previmpa no fundo	Limite por fundo conf. Resolução	Enquadramento resolução 3922	Limite do enquadramento 3922	Limite da política de investimentos	Alvo da política de investimentos	Valor por Carteira	% Carteira
Ishares Bova Ci	73.215.000,00	18.351.640.719,66	0,40%	15%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	30%	30%	6%	171.107.231,68	5,52%
It Now Ibov	69.189.188,08	4.898.153.904,20	1,41%							
Ishares Smal Ci	28.703.043,60	1.355.323.131,61	2,12%							
Caixa FIA Infraestrutura	17.062.105,01	328.405.052,63	5,20%	15%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20%	20%	4%	260.459.997,84	8,41%
Caixa FIC FIA Acoes Multigestor	63.766.224,26	822.161.736,23	7,76%							
BB Acoes Retorno Total Fc	15.997.075,71	1.441.645.710,62	1,11%							
BB Acoes Tecnologia Bdr Nivel I FI	20.480.124,15	832.394.837,47	2,46%							
BB Acoes Exportacao Fc FI	25.903.852,47	293.772.568,51	8,82%							
BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	49.528.258,29	1.947.793.507,85	2,54%							
Banestes FICFI Acoes BTG Absol. Inst	15.864.107,17	163.580.355,20	9,70%							
Itau Acoes Asgard Institucional Fc	51.773.786,21	390.683.174,62	13,25%							
Austro Institucional Pipe Bancos FIC FIA	84.464,57			15%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	20%	20%	2%	77.513.969,30	2,50%
It Now Ifnc Fundo de Indice	37.376.000,00	378.880.737,60	9,86%							
It Now Idiv	40.137.969,30	442.958.068,00	9,06%							

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

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	11.142,77189100	0,085005	222.855.437,82	219.842.014,20	11,29%
LFT20230901 - 210100	01/09/2023	08/09/2021	0	40.000	10.960,12439900	11.131,08912500	0,149000	445.243.565,00	438.944.889,80	22,55%
LFT20230901 - 210100	01/09/2023	08/09/2021	0	60.000	10.960,98181300	11.131,08912500	0,145000	667.865.347,50	658.468.841,04	33,83%
Total LFT:				120.000				1.335.964.350,32	1.317.255.745,04	67,66%
NTN-PÓS										
NTNB20220815 - 760199	15/08/2022	17/08/2021	0	87.000	3.736,01045400	3.843,33263300	2,359074	334.369.939,07	222.716.760,72	16,94%
NTNB20230515 - 760199	15/05/2023	14/04/2021	20.000	80.000	3.860,87637900	3.801,02199900	2,259018	304.081.759,92	444.741.473,64	15,40%
Total NTN-PÓS:				0	167.000			638.451.698,99	667.458.234,36	32,34%
Total Títulos Públicos:					287.000			R\$ 1.974.416.049,31	R\$ 1.984.713.979,40	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
0,34	0,32	0,32%	-R\$ 6.343.644,83	-R\$ 634,36	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	12 meses	24 meses	36 meses	No ano	VaR 95% 1 M	Volatilid ade	Beta 12M	Sortino 12M	Sharpe 12M
BENCHMARK IMA EX-C	1,82	0,46	1,79	5,46	19,09	-0,32					
Títulos Públicos da carteira Previmpa	1,02	1,72	0,92	-0,02	26,671	-1,58					

Fundos de Renda fixa	1 mês	3 meses	12 meses	24 meses	36 meses	No ano	VaR 95% 1 M	Volatilid ade	Beta 12M	Sortino 12M	Sharpe 12M
BENCHMARK CDI	0,59	1,52	3,80	6,88	13,39	3,63					
Caixa FIC Brasil Disponibilidades RF	0,47	1,19	2,74	4,91	10,37	2,64	0,00%	0,10%	-0,01	-1588,90%	-62,09
BB Prev Fluxo RF Simples Fc FI	0,51	1,26	2,69	4,56	9,73	2,58	0,00%	0,11%	-0,01	-1562,82%	-49,93
Banrisul Automatico FI RF CP	0,43	1,05	1,96	2,56	3,29	1,94	0,00%	0,10%	-0,01	-1603,04%	-80,59
Caixa FI Brasil RF Ref DI LP	0,62	1,66	4,19	6,69	12,94	3,81	0,01%	0,21%	-0,01	555,98%	2,27
BB Prev RF Ref DI LP Perfil Fc	0,63	1,59	4,06	6,66	12,91	3,79	0,01%	0,13%	-0,01	607,68%	3,89
Itau Institucional RF Ref DI FI	0,63	1,74	4,40	7,19	13,54	4,20	0,01%	0,15%	-0,02	2837,68%	6,94
BTG Pact Cre Cor I FICFI RF Cred Priv	0,61	2,26	7,65	7,10	13,72	7,36	0,03%	0,54%	-0,02	1667,50%	6,96
Sant RF Cred Priv Crescimento Inst FI LP	0,60	1,89	5,62	7,73	14,22	5,18	0,01%	0,36%	-0,01	1748,39%	5,23

OBS: Dados históricos dos Ativos que constam na Carteira do Previmpa.

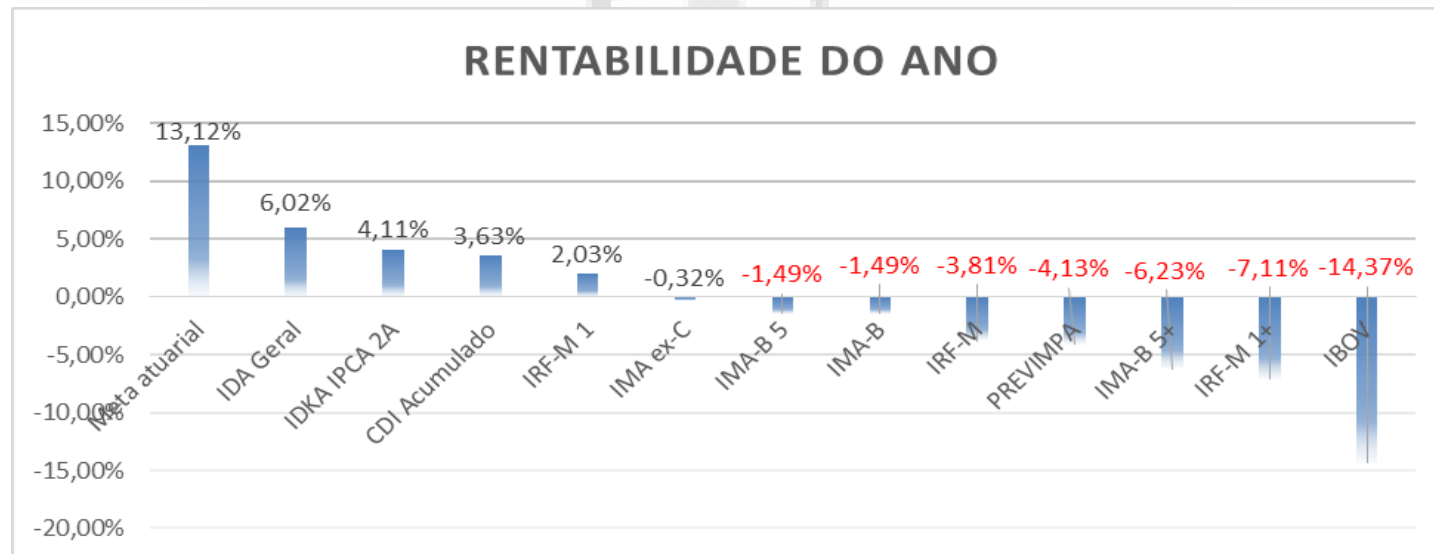
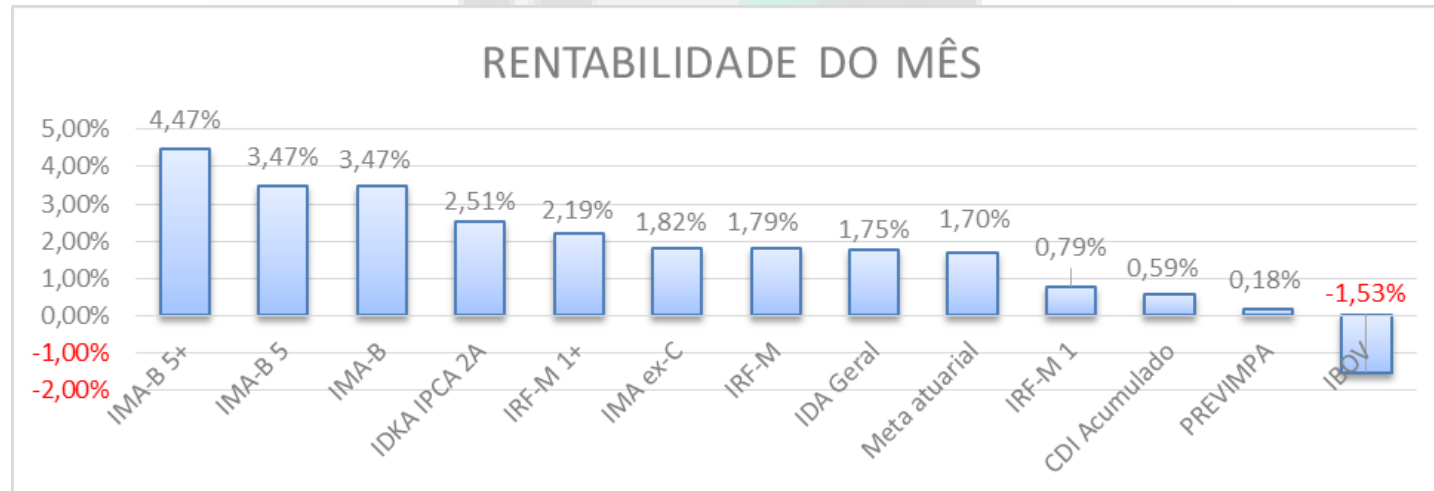
Histórico de Rentabilidade e Risco

- Renda Variável

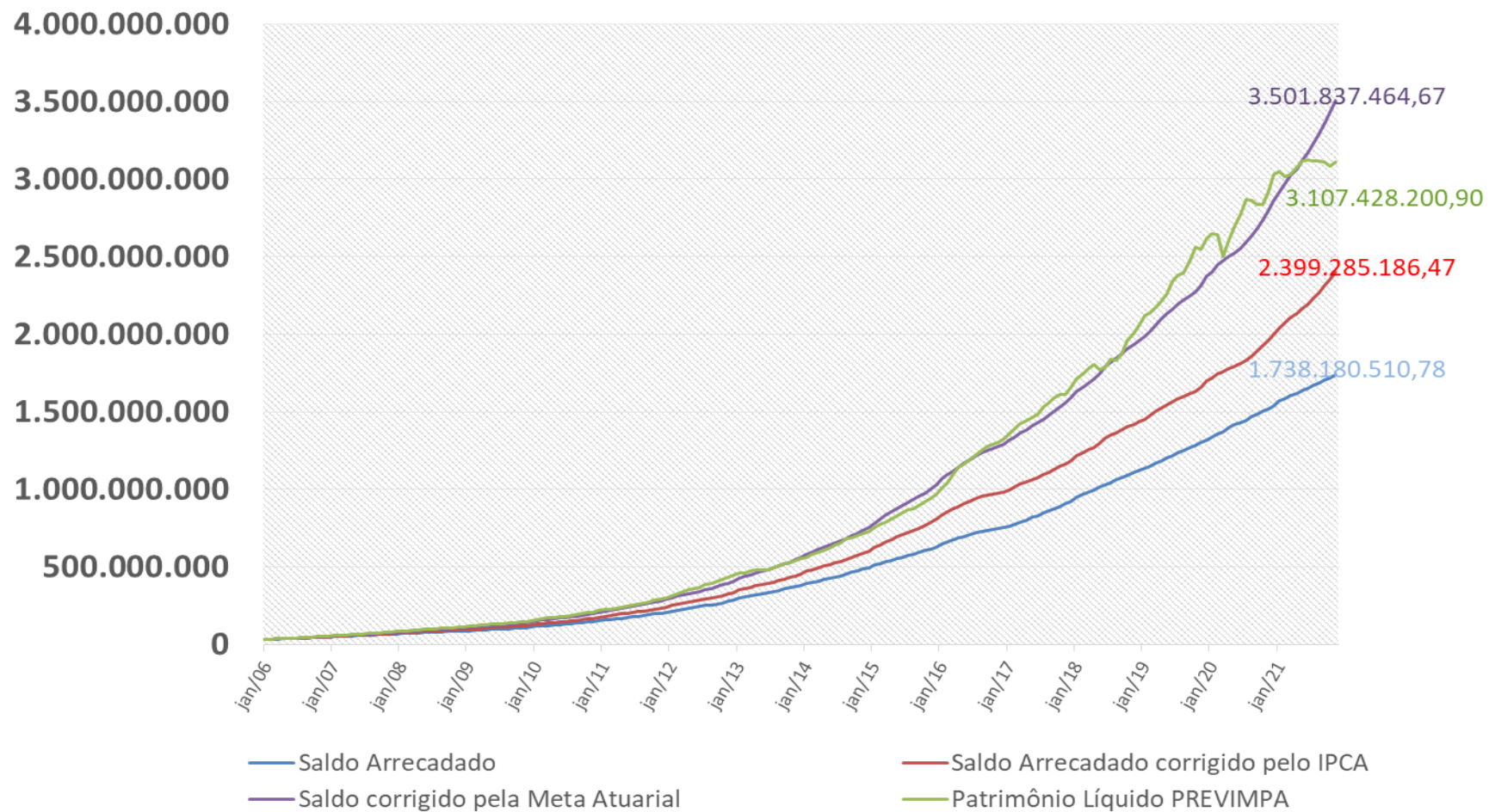
Fundos Renda Variável	1 mês	3 meses	12 meses	24 meses	36 meses	No ano	VaR 95% 1M	Volatilidade 12M	Beta 12M	Sortino 12M	Sharpe
BENCHMARK IBOVESPA	-1,53	-14,20	-6,41	-5,84	13,87	-14,37					
It Now Ibov	-1,45	-13,87	-6,31	-5,56	14,28	-14,11	2,28%	21,27%	1,00	-50,32%	-0,37
Ishares Bova Ci	-1,33	-13,79	-6,33	-5,75	13,87	-14,22	2,31%	21,51%	0,99	-49,63%	-0,37
It Now Idiv	1,89	-7,02	0,71	0,95	33,02	-7,67	2,51%	19,42%	0,88	-8,47%	-0,06
Ishares Smal Ci	-2,16	-20,19	-14,13	-10,23	26,53	-19,59	3,37%	25,57%	1,09	-78,87%	-0,59
It Now Ifnc Fundo de Indice	-2,89	-15,91	-12,30	-23,35	-6,24	-21,79	3,13%	26,54%	1,18	-67,28%	-0,48
Itau Acoes Asgard Institucional Fc	-4,40	-22,97	-20,95	N.A.	N.A.	-26,95	2,66%	20,86%	1,04	-141,33%	-1,08
Caixa FIC FIA Acoes Multigestor	-2,37	-17,11	-10,96	-8,53	N.A.	-17,28	2,58%	19,54%	0,93	-86,80%	-0,65
BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	-6,71	-26,06	-27,72	-20,58	6,14	-31,32	3,61%	23,41%	0,94	-160,02%	-1,23
Banestes FICFI Acoes BTG Absol. Inst	-6,66	-25,95	-27,63	-20,53	6,23	-31,19	3,59%	23,31%	0,94	-160,29%	-1,23
BB Acoes Retorno Total Fc	-3,26	-18,31	-7,49	-9,26	20,78	-14,33	2,22%	20,39%	0,99	-59,70%	-0,45
BB Acoes Tecnologia Bdr Nivel I FI	-3,45	-15,54	1,34	22,97	81,03	-4,97	2,11%	17,94%	0,43	-6,09%	-0,04
BB Acoes Exportacao Fc FI	-5,25	-12,09	11,83	26,81	53,39	3,81	2,01%	20,09%	0,67	70,59%	0,50
Caixa FIA Infraestrutura	3,05	-8,70	-3,46	-2,00	39,53	-10,88	2,78%	22,60%	0,90	-28,81%	-0,21

OBS: Dados históricos dos Ativos que constam na Carteira do Previmpa.

Benchmark



Patrimônio Financeiro Líquido Regime Capitalizado (Janeiro de 2006 a Novembro 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	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
Renda Variável										
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
			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
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