

Relatório de Resultados dos Investimentos do PREVIMPA

Competência: Junho/2020



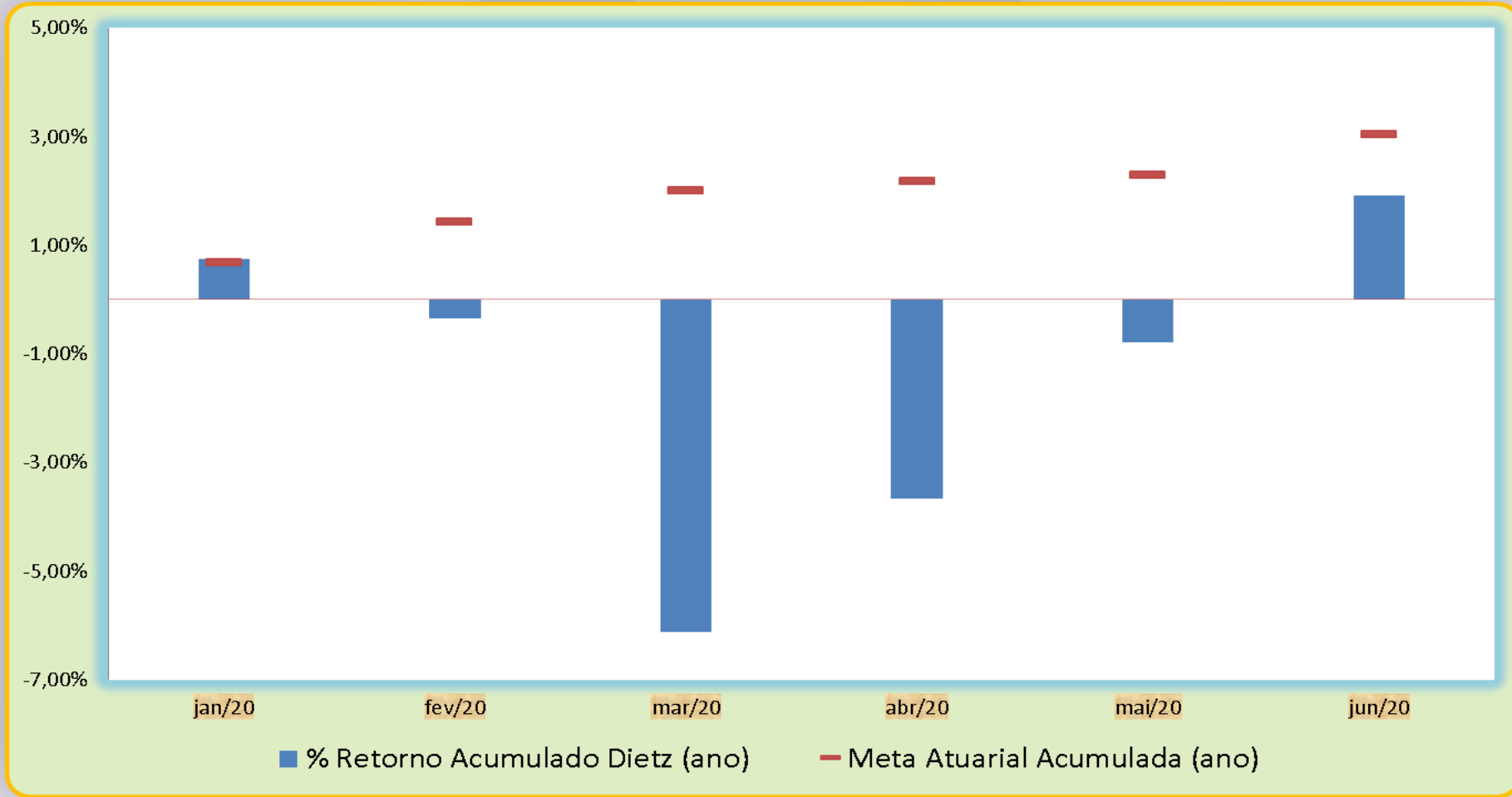
Performance do Fundo Previmpa Capitalizado

Patrimônio Líquido, Fluxo de Caixa, Retorno, Inflação e Meta Atuarial

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 Dietz	% Retorno Acumulado Dietz (ano)	IPCA (mês)	IPCA (ano)	Meta Atuarial (mês)	Meta Atuarial Acumulada (ano)
jan/20	R\$ 2.621.348.416,16	R\$ 693.886.550,38	R\$ 678.067.286,86	R\$ 15.819.263,52	R\$ 15.819.263,52	R\$ 2.656.707.119,14	R\$ 19.539.439,46	R\$ 19.539.439,46	0,7432%	0,74%	0,21%	0,21%	0,70%	0,70%
fev/20	R\$ 2.656.707.119,14	R\$ 433.429.794,92	R\$ 410.102.357,43	R\$ 23.327.437,49	R\$ 39.146.701,01	R\$ 2.651.410.831,75	-R\$ 28.623.724,88	-R\$ 9.084.285,42	-1,0727%	-0,34%	0,25%	0,46%	0,74%	1,44%
mar/20	R\$ 2.651.410.831,75	R\$ 113.058.545,97	R\$ 97.319.261,32	R\$ 15.739.284,65	R\$ 54.885.985,66	R\$ 2.512.279.437,53	-R\$ 154.870.678,87	-R\$ 163.954.964,29	-5,8238%	-6,12%	0,07%	0,53%	0,56%	2,01%
abr/20	R\$ 2.512.279.437,53	R\$ 25.931.227,92	R\$ 1.360.955,34	R\$ 24.570.272,58	R\$ 79.456.258,24	R\$ 2.607.111.970,46	R\$ 70.262.260,35	-R\$ 93.692.703,94	2,7831%	-3,67%	-0,31%	0,22%	0,18%	2,18%
mai/20	R\$ 2.607.111.970,46	R\$ 17.652.722,89	R\$ 1.319.045,66	R\$ 16.333.677,23	R\$ 95.789.935,47	R\$ 2.696.255.488,96	R\$ 72.809.841,27	-R\$ 20.882.862,67	2,7840%	-0,78%	-0,38%	-0,16%	0,10%	2,29%
jun/20	R\$ 2.696.255.488,96	R\$ 82.490.103,16	R\$ 66.408.844,33	R\$ 16.081.258,83	R\$ 111.871.194,30	R\$ 2.784.531.710,52	R\$ 72.194.962,73	R\$ 51.312.100,06	2,6696%	1,92%	0,26%	0,10%	0,75%	3,06%
jul/20														
ago/20														
set/20														
out/20														
nov/20														
dez/20														
TOTAL ANO	R\$ 2.621.348.416,16	R\$ 1.366.448.945,24	R\$ 1.254.577.750,94	R\$ 111.871.194,30		R\$ 2.784.531.710,52	R\$ 51.312.100,06			1,92%		0,10%		3,06%

Indicadores de Performance do Fundo Capitalizado: 2020

Competência	Retorno Acumulado (12 meses)	Meta Atuarial Acumulada (12 meses)	% Atingido da Meta Atuarial (12 meses)
jan/20	14,63%	10,44%	140,08%
fev/20	13,02%	10,25%	127,08%
mar/20	5,25%	9,50%	55,25%
abr/20	7,41%	8,54%	86,73%
mai/20	8,98%	7,99%	112,39%
jun/20	8,93%	8,26%	108,05%
jul/20			
ago/20			
set/20			
out/20			
nov/20			
dez/20			





Performance do Fundo Capitalizado – 2010 à 2020



ANO	Patrimônio Líquido Inicial (R\$)	Aplicação (R\$)	Resgate (R\$)	Fluxo de Caixa (R\$)	Patrimônio Líquido Final (R\$)	Retorno Acumulado Anual (R\$)	% Retorno Anual Dietz	Meta Anual	IPCA
2020	R\$ 2.621.348.416,16	R\$ 1.366.448.945,24	R\$ 1.254.577.750,94	R\$ 111.871.194,30	R\$ 2.784.531.710,52	R\$ 51.312.100,06	1,92%	3,06%	0,10%
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



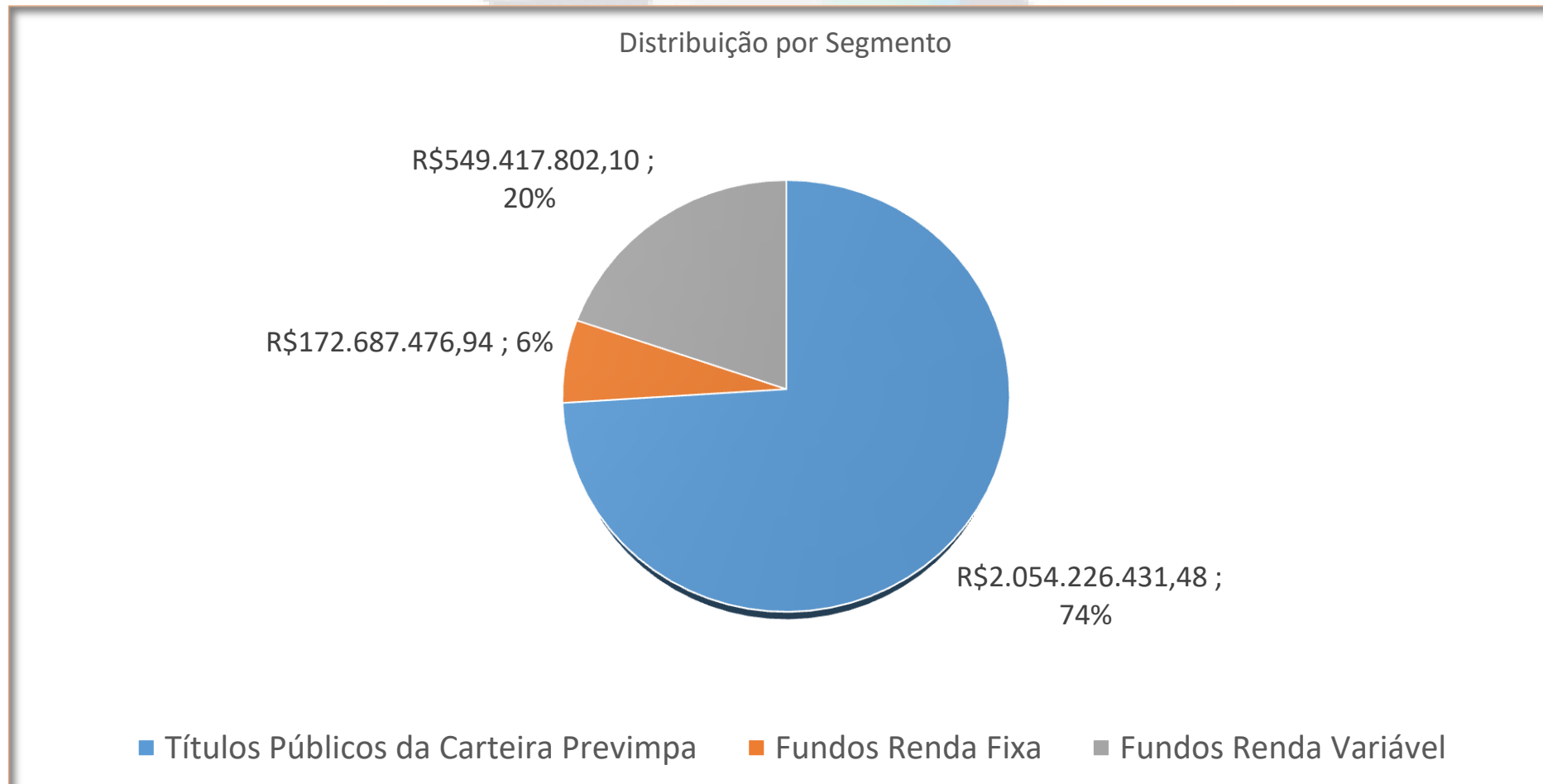
Conta	Títulos Públicos da Carteira Previmpa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
	Títulos Públicos Federais	R\$ 2.027.279.385,36			R\$ 2.054.226.431,48	R\$ 26.947.046,12	1,33%
Conta	Fundos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
702-5	Caixa FI Brasil Disponibilidades RF	R\$ 40,59	R\$ 370.620,55	R\$ 308.064,89	R\$ 62.694,56	R\$ 98,31	0,31%
702-5	Caixa FI Brasil RF Ref DI LP	R\$ 457.481,04		R\$ 457.614,24	R\$ -	R\$ 133,20	0,06%
702-5	Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF	R\$ 54.750.625,12	R\$ 6.232.493,37	R\$ 800.000,00	R\$ 60.604.151,62	R\$ 421.033,13	0,73%
702-5	FI Caixa Brasil Irf M 1 Tp RF	R\$ 41.230.279,76		R\$ 41.249.324,91	R\$ -	R\$ 19.045,15	0,09%
702-5	Caixa FI Brasil Idka IPCA 2a RF LP	R\$ 31.122.430,52	R\$ 17.079.202,22	R\$ 5.000.000,00	R\$ 43.655.384,00	R\$ 453.751,26	1,22%
73.339-2	BB Prev RF Fluxo Fc FI	R\$ 350.555,60	R\$ 740.516,02	R\$ 526.569,29	R\$ 565.051,13	R\$ 548,80	0,12%
73.339-2	BB Prev RF Idka 2 FI	R\$ 35.587.487,81			R\$ 36.019.168,55	R\$ 431.680,74	1,21%
95756.0-2	Banrisul Foco Idka IPCA 2a FI RF	R\$ 367.444,72	R\$ 18.067.271,00		R\$ 18.468.005,71	R\$ 33.289,99	0,35%
95756.0-2	Banrisul Foco Irf M 1 FI RF	R\$ 18.024.172,05		R\$ 18.067.271,00	R\$ -	R\$ 43.098,95	0,48%
40957560-2	Mirae Fixa	R\$ 13.182.991,86			R\$ 13.313.021,37	R\$ 130.029,51	0,99%
TOTAL DOS FUNDO DE RENDA FIXA		R\$ 195.073.509,07	R\$ 42.490.103,16	R\$ 66.408.844,33	R\$ 172.687.476,94	R\$ 1.532.709,04	0,84%
TOTAL DA RENDA FIXA		R\$ 2.222.352.894,43	R\$ 42.490.103,16	R\$ 66.408.844,33	R\$ 2.226.913.908,42	R\$ 28.479.755,16	1,2884%



Movimentações: Regime Capitalizado



Conta	Fundos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
702-5	Caixa FIC Cap Prot Bolsa de Valores Mult	R\$ 11.741.700,44			R\$ 11.754.586,66	R\$ 12.886,22	0,11%
702-5	Caixa FIA Institucional Bdr Nivel I	R\$ 76.311.582,14	40.000.000,00		R\$ 122.149.340,07	R\$ 5.837.757,93	6,06%
702-5	Caixa FIA Infraestrutura	R\$ 14.852.638,51			R\$ 15.966.779,26	R\$ 1.114.140,75	7,50%
702-5	Caixa FIC FIA Acoes Multigestor	R\$ 59.173.822,00			R\$ 65.018.523,84	R\$ 5.844.701,84	9,88%
73.339-2	BB Acoes Vale FI	R\$ 19.622.075,29			R\$ 20.670.259,74	R\$ 1.048.184,45	5,34%
73.339-2	BB Acoes Alocacao FIA	R\$ 22.409.095,92			R\$ 24.441.907,91	R\$ 2.032.811,99	9,07%
73.339-2	BB Acoes Retorno Total Fc	R\$ 14.768.222,78			R\$ 15.732.108,11	R\$ 963.885,33	6,53%
73.339-2	BB Acoes Tecnologia Bdr Nivel I FI	R\$ 16.154.168,41			R\$ 17.389.113,90	R\$ 1.234.945,49	7,64%
	Austro Institucional Pipe Bancos FICFIA	R\$ 4.608.697,46			R\$ 4.432.944,65	-R\$ 175.752,81	-3,81%
40957560-2	It Now Ibov	R\$ 56.290.000,00			R\$ 62.367.500,00	R\$ 6.077.500,00	10,80%
40957560-2	It Now Idiv	R\$ 26.128.290,80			R\$ 28.840.290,00	R\$ 2.711.999,20	10,38%
40957560-2	Ishares Smal Ci	R\$ 40.988.434,20			R\$ 47.260.530,80	R\$ 6.272.096,60	15,30%
40957560-2	Ishares Bova Ci	R\$ 87.370.500,00			R\$ 96.547.500,00	R\$ 9.177.000,00	10,50%
29.921.251	Banestes FICFI Acoes BTG Absol. Inst	R\$ 15.283.366,58			R\$ 16.846.417,16	R\$ 1.563.050,58	10,23%
TOTAL RENDA VARIÁVEL		R\$ 465.702.594,53	R\$ 40.000.000,00	R\$ -	R\$ 549.417.802,10	R\$ 43.715.207,57	9,00%
RENTABILIDADE FINANCEIRA DO REGIME CAPITALIZADO		R\$ 2.688.055.488,96	R\$ 82.490.103,16	R\$ 66.408.844,33	R\$ 2.776.331.710,52	R\$ 72.194.962,73	2,68%
Conta	IMÓVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
702-5	IMÓVEL - ESTACIONAMENTO	R\$ 8.200.000,00			R\$ 8.200.000,00	R\$ -	0,00%
RENTABILIDADE TOTAL DO REGIME CAPITALIZADO		R\$ 2.696.255.488,96	R\$ 82.490.103,16	R\$ 66.408.844,33	R\$ 2.784.531.710,52	R\$ 72.194.962,73	2,67%





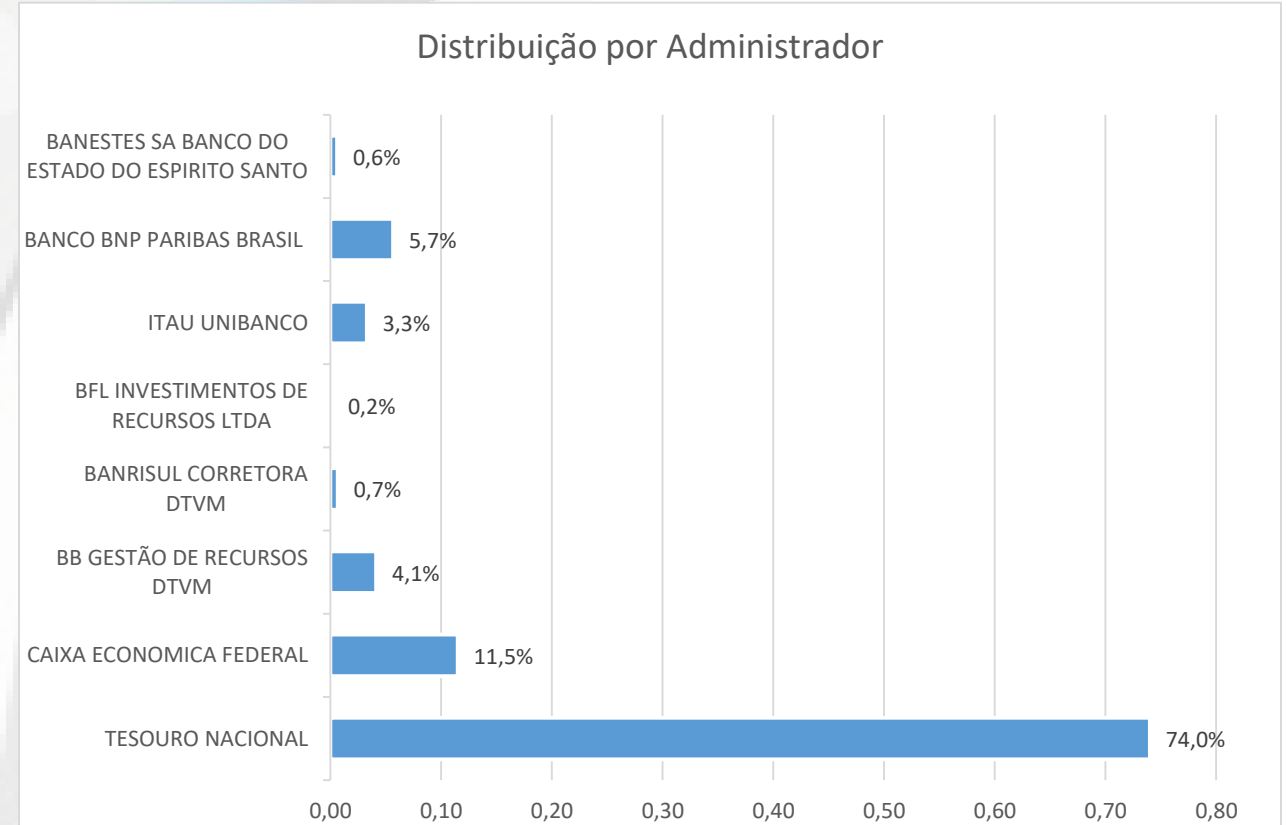
Movimentações: Outras Contas



Conta	Taxa de Administração e Repartição Simples	Saldo Atual	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
73.342-3	COMPREV - BB Prev RF IRFM-1	R\$ 6.933.089,80	R\$ 1.105.809,27		R\$ 8.058.678,60	R\$ 19.779,53	0,26%
73.334-2	FUNDO PREVIDENCIA - BB Previd RF Fluxo	R\$ 236.809,40	R\$ 7.536,72	R\$ 17.019,63	R\$ 227.639,51	R\$ 313,02	0,13%
703-3	REPARTIÇÃO SIMPLES - Caixa Disponibilidades RF	R\$ 8.470.570,65	R\$ 4.014.404,87	R\$ 3.092.049,70	R\$ 9.404.772,43	R\$ 11.846,61	0,13%
704-1	GRATIFICACAO NAT - Caixa IRFM-1	R\$ 277.365,43	R\$ 70.240,00		R\$ 348.497,15	R\$ 891,72	0,29%
704-1	TAXA ADM - Caixa Disponibilidades	R\$ 8.277,91		R\$ 3.430,91	R\$ 4.858,73	R\$ 11,73	0,18%
73.360-1	TAXA ADM - BB Prev RF IRFM-1	R\$ 7.916.284,30			R\$ 7.936.606,00	R\$ 20.321,70	0,26%
73.360-1	TAXA ADM - BB Previd RF Fluxo	R\$ 7.589.832,98	R\$ 2.340.580,23	R\$ 4.163.070,05	R\$ 5.776.922,28	R\$ 9.579,12	0,14%
73.360-1	TAXA ADM - BB PREVID RF IDKA 2	R\$ -	R\$ 3.553.316,66		R\$ 3.559.066,11	R\$ 5.749,45	0,32%
73.400-4	FRAP - BB Previd RF Fluxo	R\$ 671.524,37	R\$ 39.932,93	R\$ 34.019,84	R\$ 678.304,07	R\$ 866,61	0,13%
73.459-4	IMÓVEL - BB Previd RF Fluxo	R\$ 1.205,22		R\$ 1.206,67	R\$ -	R\$ 1,45	0,24%
420.000-4	ADIANTAMENTO - BB Previd RF Fluxo	R\$ 1.101,22		R\$ 1.087,16	R\$ 14,60	R\$ 0,54	0,10%
	Conta Corrente	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 3.575,64		
TOTAL TAXA ADM E REPARTIÇÃO SIMPLES		R\$ 32.106.061,28	R\$ 11.131.820,68	R\$ 7.311.883,96	R\$ 35.998.935,12	R\$ 72.937,12	0,21%
RENTABILIDADE CONSOLIDADA DO PREVIMPA		R\$ 2.728.361.550,24	R\$ 93.621.923,84	R\$ 73.720.728,29	R\$ 2.820.530.645,64	R\$ 72.267.899,85	2,6391%

Distribuição por Administrador

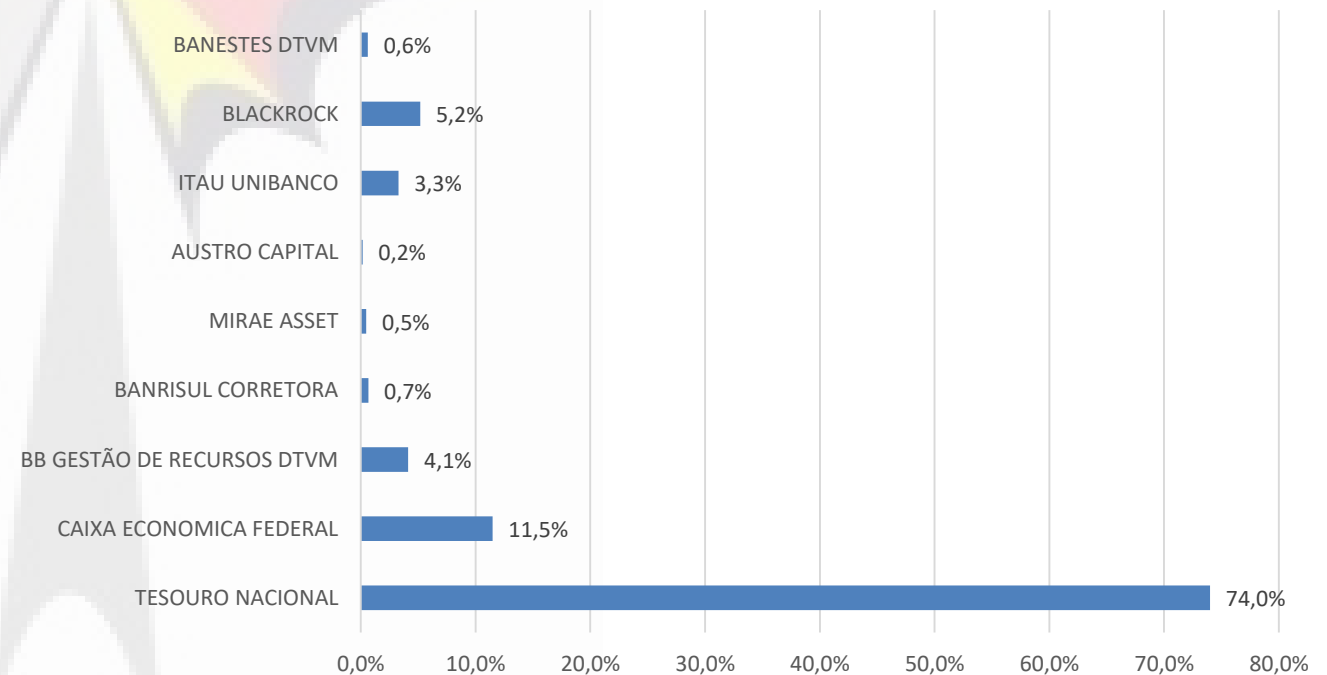
Administrador	Valor por Adm	Distribuição por Administrador
TESOURO NACIONAL	R\$ 2.054.226.431,48	74,0%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$ 319.211.460,01	11,5%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	R\$ 114.817.609,34	4,1%
BANRISUL CORRETORA DTVM	R\$ 18.468.005,71	0,7%
BFL INVESTIMENTOS DE RECURSOS LTDA	R\$ 4.432.944,65	0,2%
ITAU UNIBANCO	R\$ 91.207.790,00	3,3%
BANCO BNP PARIBAS BRASIL	R\$ 157.121.052,17	5,7%
BANESTES SA BANCO DO ESTADO DO ESPIRITO SANTO	R\$ 16.846.417,16	0,6%



Distribuição por Gestor

Gestor	Valor por Adm	Distribuição por Gestor
TESOURO NACIONAL	2.054.226.431,48	74,0%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	319.211.460,01	11,5%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	114.817.609,34	4,1%
BANRISUL CORRETORA	18.468.005,71	0,7%
MIRAE ASSET	13.313.021,37	0,5%
AUSTRO CAPITAL	4.432.944,65	0,2%
ITAU UNIBANCO	91.207.790,00	3,3%
BLACKROCK	143.808.030,80	5,2%
BANESTES DTVM	16.846.417,16	0,6%

Distribuição por Gestor





Enquadramento Renda Fixa

Títulos públicos	Valor atual	PL do fundo	Participação Previmpa no fundo	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	2.027.279.385,36			Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100%	100%	70%	2.027.279.385,36	72,81%

Renda fixa	Valor atual	PL do fundo	Participação Previmpa no fundo	Enquadramento resolução 3922	limite do enquadramento	Limite da política de investimentos	Alvo da política de investimentos	Valor por carteira	% Carteira
Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF	60.604.151,62	12.211.119.756,17	0,50%						
FI Caixa Brasil Irf M 1 Tp RF	0,00	11.257.382.974,77	0,00%						
Caixa FI Brasil Idka IPCA 2a RF LP	43.655.384,00	7.740.606.629,29	0,56%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100%	100%	2%	158.746.709,88	5,70%
BB Prev RF Idka 2 FI	36.019.168,55	6.212.458.601,64	0,58%						
Banrisul Foco Idka IPCA 2a FI RF	18.468.005,71	743.272.235,17	2,48%						
Banrisul Foco Irf M 1 FI RF	0,00	1.703.587.538,44	0,00%						
Mirae Fixa	13.313.021,37	160.837.508,60	8,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100%	100%	0%	13.313.021,37	0,48%
Caixa FI Brasil Disponibilidades RF	62.694,56	517.750.287,34	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40%	40%	1%	627.745,69	0,02%
Caixa FI Brasil RF Ref DI LP	0,00	5.172.945.706,81	0,00%						
BB Prev RF Fluxo Fc FI	565.051,13	1.768.065.678,44	0,03%						



Enquadramento Renda Variável



Renda Variável	Valor atual	PL do fundo	Participação Previmpa no fundo	Enquadramento resolução 3922	limite do enquadramento	Limite da política de investimentos	Alvo da política de investimentos	Valor por carteira	% Carteira
It Now Ibov	62.367.500,00	1.065.637.623,86	5,85%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30%	30%	6%	206.175.530,80	7,40%
Ishares Smal Ci	47.260.530,80	1.429.895.777,57	3,31%						
Ishares Bova Ci	96.547.500,00	12.509.310.312,96	0,77%						
Banrisul Foco Idka IPCA 2a FI RF	15.966.779,26	473.877.856,42	3,37%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20%	20%	6%	160.098.330,66	5,75%
Caixa FIC FIA Acoes Multigestor	65.018.523,84	767.311.521,81	8,47%						
BB Acoes Vale FI	20.670.259,74	764.171.231,46	2,70%						
BB Acoes Alocacao FIA	24.441.907,91	385.656.588,00	6,34%						
BB Acoes Retorno Total Fc	15.732.108,11	1.071.740.172,09	1,47%						
BB Acoes Tecnologia Bdr Nivel I FI	17.389.113,90	409.692.803,08	4,24%						
Banestes FICFI Acoes BTG Absol. Inst	16.846.417,16	158.247.917,35	10,65%						
It Now Idiv	28.840.290,00	238.901.825,34	12,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20%	20%	2%	28.840.290,00	1,04%
Caixa FIC Cap Prot Bolsa de Valores Mult	11.754.586,66	507.594.109,51	2,32%	Artigo 8º, Inciso III	10%	10%	2%	11.754.586,66	0,42%
Caixa FIA Institucional Bdr Nivel I	122.149.340,07	1.181.944.568,52	10,33%	Artigo 9º - A, Inciso III	10%	10%	1%	122.149.340,07	4,39%
Austro Institucional Pipe Bancos FICFIA	4.432.944,65	35.492.262,80	12,49%	Desenquadrado - RV	N. A.	N. A.	N. A.	4.432.944,65	0,16%

Carteira de Títulos públicos

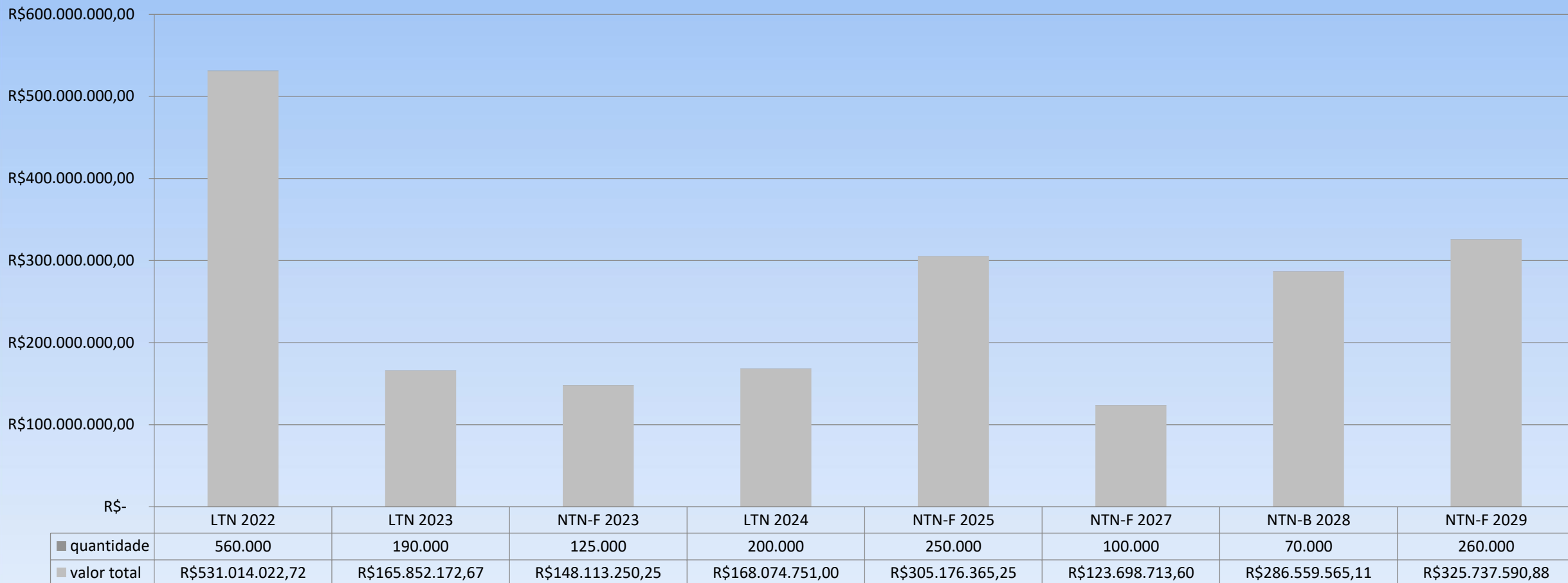
Cód. Papel	Vencimento	Data Compra	Qtde. Total	PU Compra	Preço Unitário	Taxa %	Valor Total à Mercado	Valor Total na Curva	%PL
Títulos Públicos									
LTN									
LTN20220101 - 100000	01/01/2022	21/03/2018	80.000	727,41891400	956,93408900	8,799000	76.554.727,12	70.446.911,44	3,73%
LTN20220101 - 100000	01/01/2022	09/04/2018	200.000	732,97834600	956,93408900	8,694000	191.386.817,80	176.373.889,60	9,32%
LTN20220401 - 100000	01/04/2022	07/02/2020	160.000	898,51867100	944,85804400	5,140000	151.177.287,04	146.534.419,84	7,36%
LTN20220701 - 100000	01/07/2022	26/06/2019	120.000	825,38325200	932,45992300	6,579000	111.895.190,76	105.642.328,08	5,45%
LTN20230701 - 100000	01/07/2023	14/06/2019	190.000	753,63622400	872,90617200	7,260000	165.852.172,67	154.014.286,13	8,07%
LTN20240101 - 100000	01/01/2024	03/01/2020	200.000	787,45838900	840,37375500	6,200000	168.074.751,00	162.106.908,80	8,18%
Total LTN:			950.000				864.940.946,39	815.118.743,89	42,11%
NTN-PÓS									
NTNB20280815 - 760199	15/08/2028	06/06/2019	20.000	3.820,89142600	4.093,70807300	3,819000	81.874.161,46	76.898.221,30	3,99%
NTNB20280815 - 760199	15/08/2028	06/06/2019	20.000	3.820,89142600	4.093,70807300	3,819000	81.874.161,46	76.898.221,30	3,99%
NTNB20280815 - 760199	15/08/2028	06/06/2019	30.000	3.820,89142600	4.093,70807300	3,819000	122.811.242,19	115.347.331,95	5,98%
Total NTN-PÓS:			70.000				286.559.565,11	269.143.774,55	13,95%

Carteira de Títulos Públicos

Cód. Papel	Vencimento	Data Compra	Qtde. Total	PU Compra	Preço Unitário	Taxa %	Valor Total à Mercado	Valor Total na Curva	%PL
NTN-PRÉ									
NTNF20230101 - 950199	01/01/2023	10/10/2017	25.000	1.050,74722900	1.184,90600200	9,429000	29.622.650,05	26.500.964,75	1,44%
NTNF20230101 - 950199	01/01/2023	13/10/2017	50.000	1.052,64080900	1.184,90600200	9,400000	59.245.300,10	53.029.401,55	2,88%
NTNF20230101 - 950199	01/01/2023	17/10/2017	50.000	1.051,66190700	1.184,90600200	9,444000	59.245.300,10	52.988.473,50	2,88%
NTNF20250101 - 950199	01/01/2025	13/10/2017	60.000	1.049,13298400	1.220,70546100	9,604000	73.242.327,66	63.724.329,90	3,57%
NTNF20250101 - 950199	01/01/2025	14/11/2018	50.000	1.037,69901300	1.220,70546100	9,989000	61.035.273,05	52.499.113,90	2,97%
NTNF20250101 - 950199	01/01/2025	14/11/2018	140.000	1.038,99625800	1.220,70546100	9,959000	170.898.764,54	147.131.068,28	8,32%
NTNF20270101 - 950199	01/01/2027	20/05/2019	100.000	1.092,53252800	1.236,98713600	8,949000	123.698.713,60	109.582.163,00	6,02%
NTNF20290101 - 950199	01/01/2029	20/05/2019	50.000	1.094,98101100	1.252,83688800	9,069000	62.641.844,40	54.984.758,95	3,05%
NTNF20290101 - 950199	01/01/2029	01/08/2019	60.000	1.192,01765100	1.252,83688800	7,199000	75.170.213,28	4.448.406,72	3,66%
NTNF20290101 - 950199	01/01/2029	08/11/2019	140.000	1.257,99416700	1.252,83688800	6,619000	175.397.164,32	176.291.957,80	8,54%
NTNF20290101 - 950199	01/01/2029	12/11/2019	10.000	1.254,15538900	1.252,83688800	6,679000	12.528.368,88	12.550.089,90	0,61%
Total NTN-PRÉ:			735.000				902.725.919,98	753.730.728,25	43,94%
Total Títulos Públicos:			1.755.000				R\$ 2.054.226.431,48	R\$ 1.837.993.246,69	100,0%



Distribuição dos Títulos Públicos em Carteira



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

Fundos de Renda fixa	1 mês	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	No ano	VaR 95% 1 M	Volatilid ade	Sortino 12M	Sharpe 12M	Beta 12M
BENCHMARK CDI	0,21	0,73	1,75	4,60	11,21	1,75					
Caixa FI Brasil Disponibilidades RF	0,14	0,54	1,34	3,73	9,38	1,34	0,00%	0,07%	-1642,28%	-137,76	0,00
Caixa FI Brasil RF Ref DI LP	0,24	0,58	1,37	4,03	10,44	1,37	0,01%	0,29%	-208,04%	-1,92	0,00
BB Prev RF Fluxo Fc FI	0,13	0,49	1,24	3,50	8,88	1,24	0,00%	0,07%	-1632,55%	-104,07	0,00
BENCHMARK IRFM-1	0,28	1,15	2,60	6,01	13,67	2,60					
FI Caixa Brasil Irf M 1 Tp RF	0,26	1,09	2,48	5,78	13,28	2,48	0,01%	0,53%	336,64%	2,14	0,00
Banrisul Foco Irf M 1 FI RF	0,27	1,09	2,49	5,78	13,22	2,49	0,01%	0,56%	318,46%	2,02	0,00
BENCHMARK IDKA 2A	0,99	3,35	3,35	8,77	23,17	3,35					
Caixa FI Brasil Idka IPCA 2a RF LP	1,18	3,54	3,12	8,19	21,36	3,12	0,18%	4,00%	109,22%	0,88	0,06
BB Prev RF Idka 2 FI	1,21	3,57	2,88	8,18	21,13	2,88	0,17%	4,09%	106,59%	0,86	0,06
Banrisul Foco Idka IPCA 2a FI RF	1,06	3,53	3,22	8,23	21,49	3,22	0,18%	4,25%	103,88%	0,84	0,06
BENCHMARK IMA EX-G	0,90	2,74	1,71	6,32	22,95	1,71					
Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF	0,75	3,27	4,63	9,82	28,20	4,63	0,25%	5,94%	117,80%	0,87	0,03
Mirae Fixa	0,99	4,39	6,91	12,61	N.A.	6,91	0,32%	8,53%	135,70%	0,97	0,03

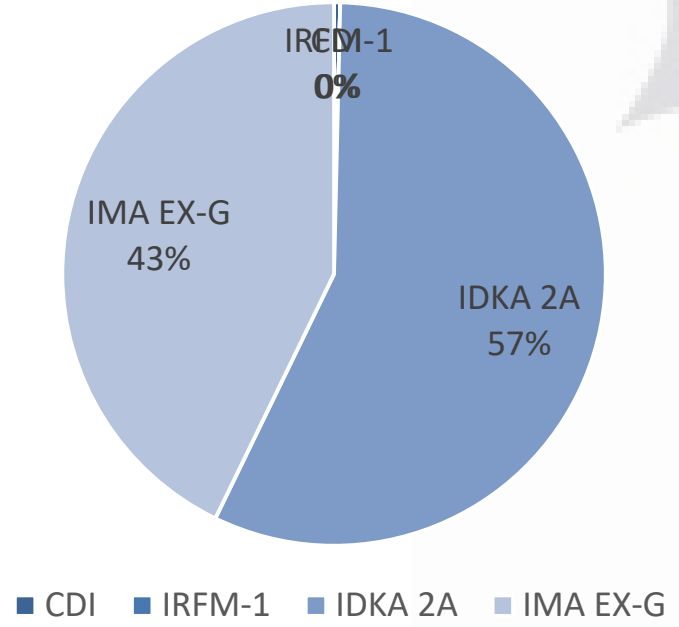


Rentabilidade e Risco Renda Variável

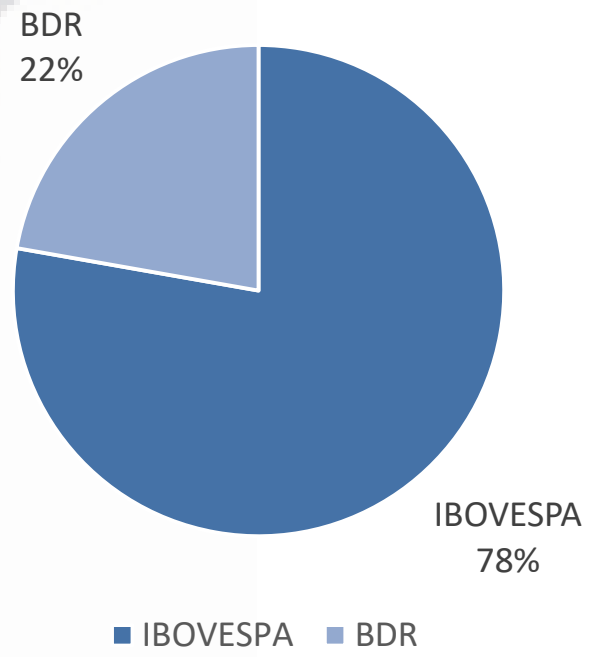
Fundos Renda Variável	1 mês	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	No ano	VaR 95% 1M	Volatilid ade	Sortino 12M	Sharpe	Beta 12M
BENCHMARK IBOVESPA	8,76	30,18	-17,80	-5,85	30,64	-17,80					
Caixa FIC Cap Prot Bolsa de Valores Mult	0,11	0,62	1,79	5,40	N.A.	1,79	0,01%	1,77%	54,67%	0,44	0,00
Caixa FIA Infraestrutura	7,50	31,89	-16,14	4,63	60,37	-16,14	2,65%	46,31%	33,32%	0,25	1,05
Caixa FIC FIA Acoes Multigestor	9,88	33,22	-14,67	N.A.	N.A.	-14,67	2,63%	43,98%	32,47%	0,25	1,09
BB Acoes Vale FI	5,34	28,09	2,11	6,59	11,89	2,11	2,19%	52,00%	50,45%	0,32	0,34
BB Acoes Alocacao FIA	9,07	27,93	-21,10	-8,75	24,85	-21,10	2,60%	42,31%	-15,02%	-0,11	1,05
BB Acoes Retorno Total Fc	6,53	23,92	-18,67	5,27	45,78	-18,67	2,22%	39,59%	29,63%	0,22	0,97
BB Acoes Tecnologia Bdr Nivel I FI	7,64	23,99	-8,50	27,97	66,49	-8,50	1,88%	35,73%	117,75%	0,86	0,83
Austro Institucional Pipe Bancos FICFIA	-3,81	-28,84	-51,31	-52,41	-29,39	-51,31	4,81%	35,74%	-192,72%	-1,44	0,51
It Now Ibov	9,03	30,64	-17,74	-5,71	31,09	-17,74	2,63%	44,05%	-2,68%	-0,02	1,01
It Now Idiv	8,52	19,88	-18,27	-0,18	48,03	-18,27	2,89%	35,50%	6,15%	0,05	0,82
Ishares Smal Ci	13,89	36,96	-20,99	4,05	47,27	-20,99	3,88%	49,89%	34,02%	0,26	1,30
Ishares Bova Ci	8,88	32,11	-17,63	-5,65	30,23	-17,63	2,67%	43,33%	-3,49%	-0,03	1,04
Banestes FICFI Acoes BTG Absol. Inst	10,23	41,46	-8,36	8,76	58,50	-8,36	2,17%	44,65%	45,71%	0,34	1,09
BENCHMARK BDR	4,50	25,08	32,44	54,81	68,50	32,44					
Caixa FIA Institucional Bdr Nivel I	4,37	24,40	32,85	54,59	66,72	32,85	2,64%	26,22%	320,59%	2,01	0,03

Distribuição dos Fundos

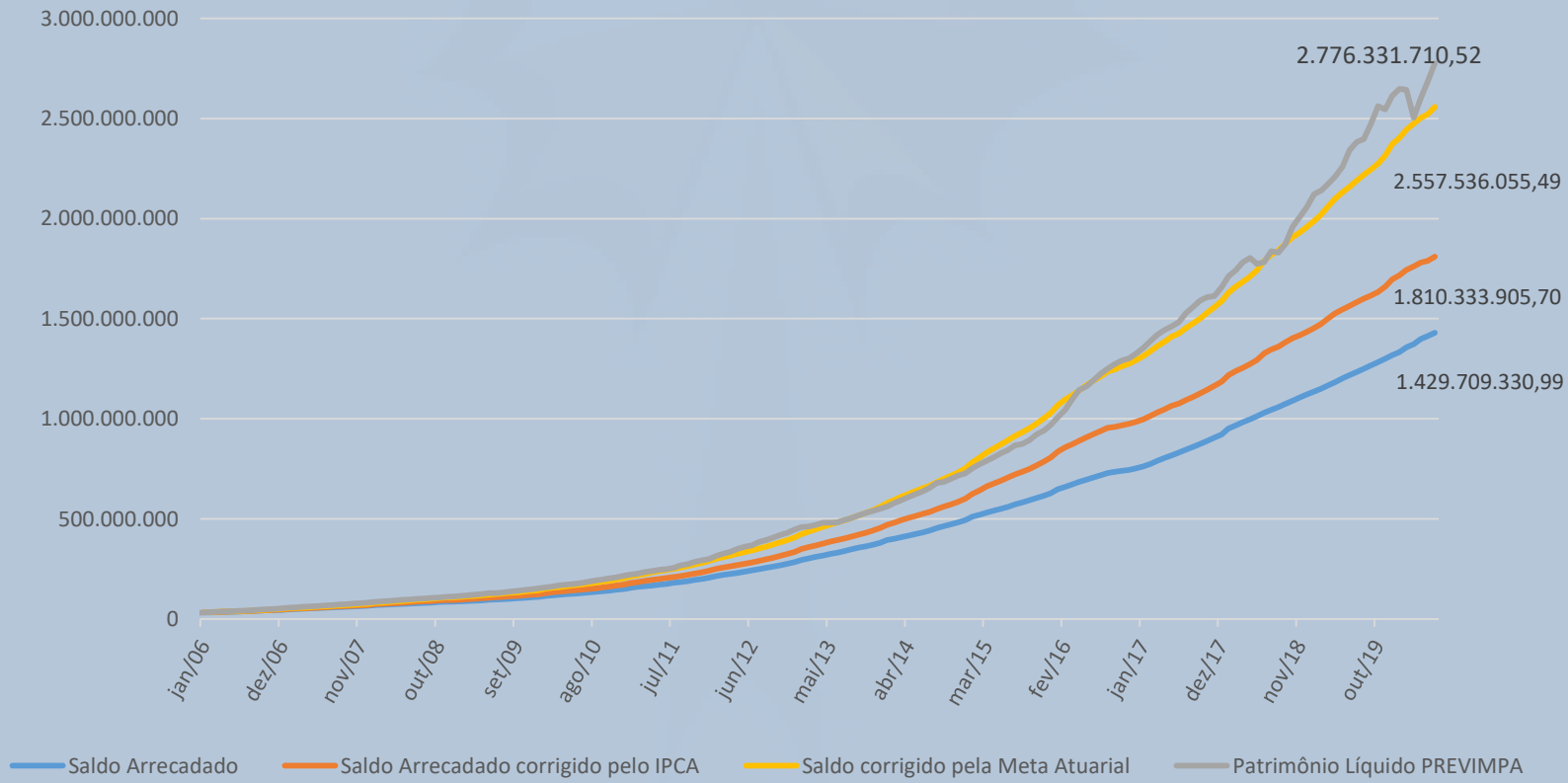
Distribuição Fundo Renda fixa



Distribuição do fundo de renda variavel



Patrimônio Financeiro Líquido Regime Capitalizado
(Janeiro de 2006 a Junho de 2020)





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 FI Brasil RF DI	03.737.206/0001-97	0,20%	Não há	D+0	D+0	Não há	17:00
			CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRAT.	23.215.097/0001-55	0,40%	Não há	D+0	D+0	Não há	16:00
			Caixa IRFM-1	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 Previd RF Fluxo - IMÓVEL	13.077.415/0001-05	1,00%	Não há	D+0 Abertura	D+0	Não há	23:00
			BB Prev RF IRFM-1 - COMPREV	11.328.882/0001-35	0,30%	Não há	D+0	D+0	Não há	17:00
			BB PREV IDKA 2A	13.322.205/0001-35	0,20%	Não há	D+0	D+1	Não há	15:00
			BB RPPS RF Fluxo - COMPREV	13.077.415/0001-05	1,00%	Não há	D+0 Abertura	D+0	Não há	23:00
Banco do Estado do Rio Grande do Sul	Banrisul Corretora	Banrisul Corretora	Banrisul Foco IDK 2A	21.007.180/0001-03	0,20%	Não há	D+0	D+1	Não há	15:00
			Banrisul IRF-M1	18.466.245/0001-74	0,20%	Não há	D+0	D+1	Não há	17:30
BNB Paribas	Mirae Asset	Banrisul Corretora	ETF FIXA11	26.845.780/0001-64	0,30%	Não há	D+1	D+1	Não há	17:00
Renda Variável										
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	FIC Capital Protegido BV	29.388.994/0001-47	1,60%	Não há	D+0	D+0	01/10/2020	14:00
			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 Vale	04.881.682/0001-40	2,00%	Não há	D+1	D+3	Não há	17:00
			BB Previd Ações Alocação	18.270.783/0001-99	1,00%	Não há	D+1	D+3	Não há	13:00
			BB Ações Retorno Total	09.005.805/0001-00	1,00%	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
UM INVESTIMENTOS SA CTVM	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
ITAÚ UNIBANCO S.A.	ITAÚ UNIBANCO S.A.	Banrisul Corretora	ETF BOVV 11	21.407.758/0001-19	0,30%	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 SMAL 11	10.406.600/0001-08	0,69%	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
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