

# Relatório de Resultados dos Investimentos do PREVIMPA

Competência: Julho/2020



**Performance do Fundo Previmpa Capitalizado**

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

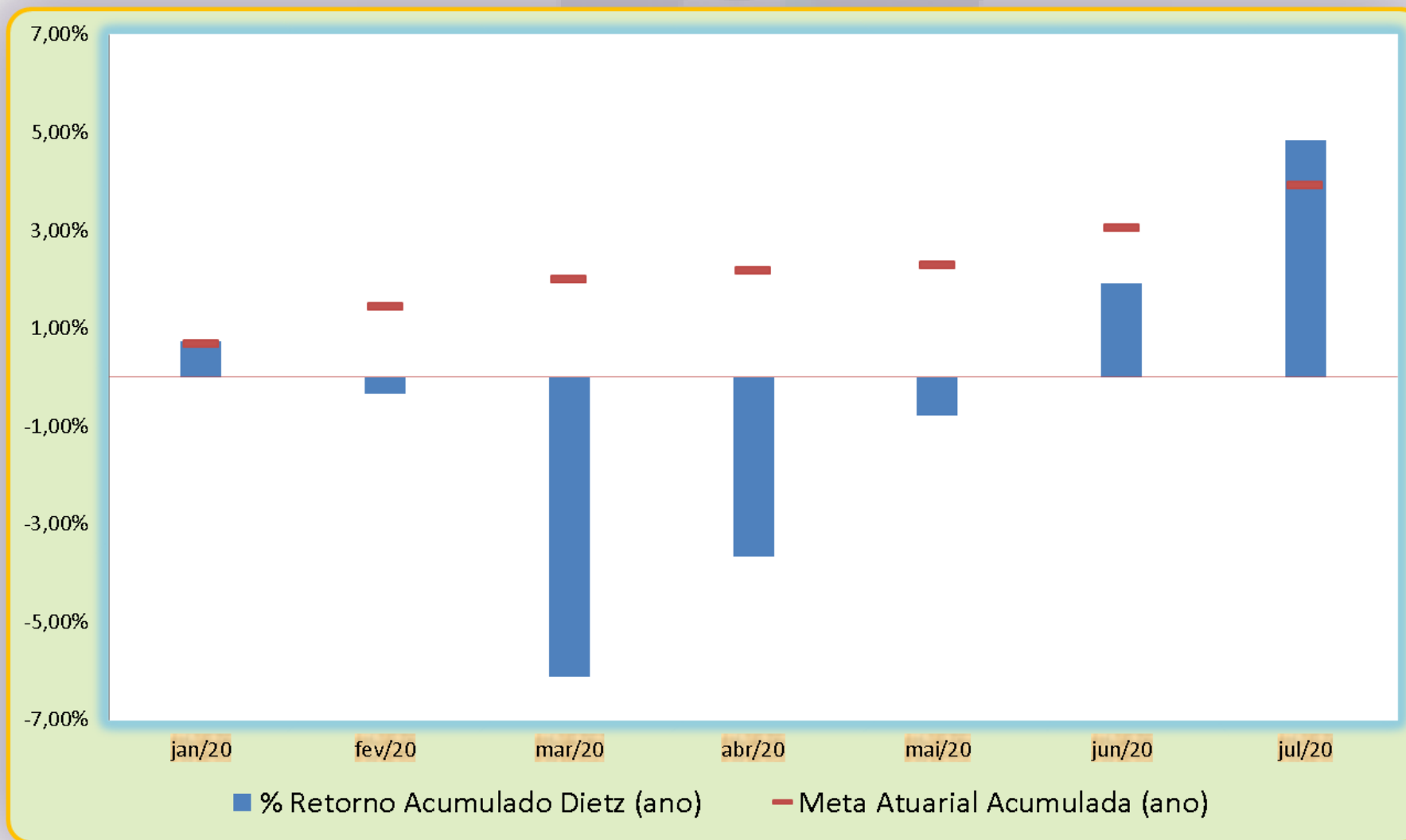
Competência	Patrimônio Líquido Inicial (R\$)	Aplicação (R\$)	Resgate (R\$)	Fluxo de Caixa (R\$)	Fluxo de Caixa Acumulado Anual (R\$)	Patrimônio Líquido Final (R\$)	Retorno Mensal (R\$)	Retorno Acumulado Anual (R\$)	% Retorno Mensal Dietz	% Retorno Acumulado Dietz (ano)
jan/20	R\$ 2.621.348.416,16	R\$ 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%
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%
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%
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%
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%
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%
jul/20	R\$ 2.784.531.710,52	R\$ 176.065.802,99	R\$ 159.827.626,14	R\$ 16.238.176,85	R\$ 128.109.371,15	R\$ 2.879.701.254,54	R\$ 78.931.367,17	R\$ 130.243.467,23	2,8264%	4,85%
ago/20										
set/20										
out/20										
nov/20										
dez/20										
<b>TOTAL ANO</b>	R\$ 2.621.348.416,16	R\$ 1.542.514.748,23	R\$ 1.414.405.377,08	R\$ 128.109.371,15		R\$ 2.879.701.254,54	R\$ 130.243.467,23			4,85%



IPCA (mês)	IPCA (ano)	Meta Atuarial (mês)	Meta Atuarial Acumulada (ano)	Competência	Retorno Acumulado (12 meses)	Meta Atuarial Acumulada (12 meses)	% Atingido da Meta Atuarial (12 meses)
0,21%	0,21%	0,70%	0,70%	jan/20	14,63%	10,44%	140,08%
0,25%	0,46%	0,74%	1,44%	fev/20	13,02%	10,25%	127,08%
0,07%	0,53%	0,56%	2,01%	mar/20	5,25%	9,50%	55,25%
-0,31%	0,22%	0,18%	2,18%	abr/20	7,41%	8,54%	86,73%
-0,38%	-0,16%	0,10%	2,29%	mai/20	8,98%	7,99%	112,39%
0,26%	0,10%	0,75%	3,06%	jun/20	8,93%	8,26%	108,05%
0,36%	0,46%	0,85%	3,93%	jul/20	10,92%	8,44%	129,35%
				ago/20			
				set/20			
				out/20			
				nov/20			
				dez/20			
	0,46%		3,93%				

## Indicadores de Performance do Fundo Capitalizado: 2020

<b>Competência</b>	<b>Retorno Acumulado (12 meses)</b>	<b>Meta Atuarial Acumulada (12 meses)</b>	<b>% Atingido da Meta Atuarial (12 meses)</b>
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	10,92%	8,44%	129,35%
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\$ 1.542.514.748,23	R\$ 1.414.405.377,08	R\$ 128.109.371,15	R\$ 2.879.701.254,54	R\$ 130.243.467,23	4,85%	3,93%	0,46%
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\$ 2.054.226.431,48	R\$ 85.304.250,15	R\$ 35.874.504,75	2.145.209.225,31	R\$ 41.553.048,43	2,00%
Conta	Fundos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
702-5	Caixa FI Brasil Disponibilidades RF	R\$ 62.694,56	R\$ 43.037.584,59	R\$ 43.045.008,39	R\$ 57.523,87	R\$ 2.253,11	3,82%
702-5	Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF	R\$ 60.604.151,62		R\$ 57.600.000,00	R\$ 3.047.055,18	R\$ 42.903,56	0,13%
702-5	Caixa FI Brasil Idka IPCA 2a RF LP	R\$ 43.655.384,00	24.469.771,55		R\$ 68.567.464,27	R\$ 442.308,72	0,79%
73.339-2	BB Prev RF Fluxo Fc FI	R\$ 565.051,13	R\$ 505.366,58	R\$ 559.282,88	R\$ 511.359,25	R\$ 224,42	0,04%
73.339-2	BB Prev RF Idka 2 FI	R\$ 36.019.168,55	R\$ 22.748.830,12		R\$ 59.125.910,88	R\$ 357.912,21	0,76%
95756.0-2	Banrisul Foco Idka IPCA 2a FI RF	R\$ 18.468.005,71			R\$ 18.626.019,69	R\$ 158.013,98	0,86%
40957560-2	Mirae Fixa	R\$ 13.313.021,37			R\$ 13.503.064,50	R\$ 190.043,13	1,43%
<b>TOTAL DOS FUNDO DE RENDA FIXA</b>		<b>R\$ 172.687.476,94</b>	<b>R\$ 90.761.552,84</b>	<b>R\$ 101.204.291,27</b>	<b>R\$ 163.438.397,64</b>	<b>R\$ 1.193.659,13</b>	<b>0,71%</b>
<b>TOTAL DA RENDA FIXA</b>		<b>R\$ 2.226.913.908,42</b>	<b>R\$ 176.065.802,99</b>	<b>R\$ 137.078.796,02</b>	<b>R\$ 2.308.647.622,95</b>	<b>R\$ 42.746.707,56</b>	<b>1,90%</b>

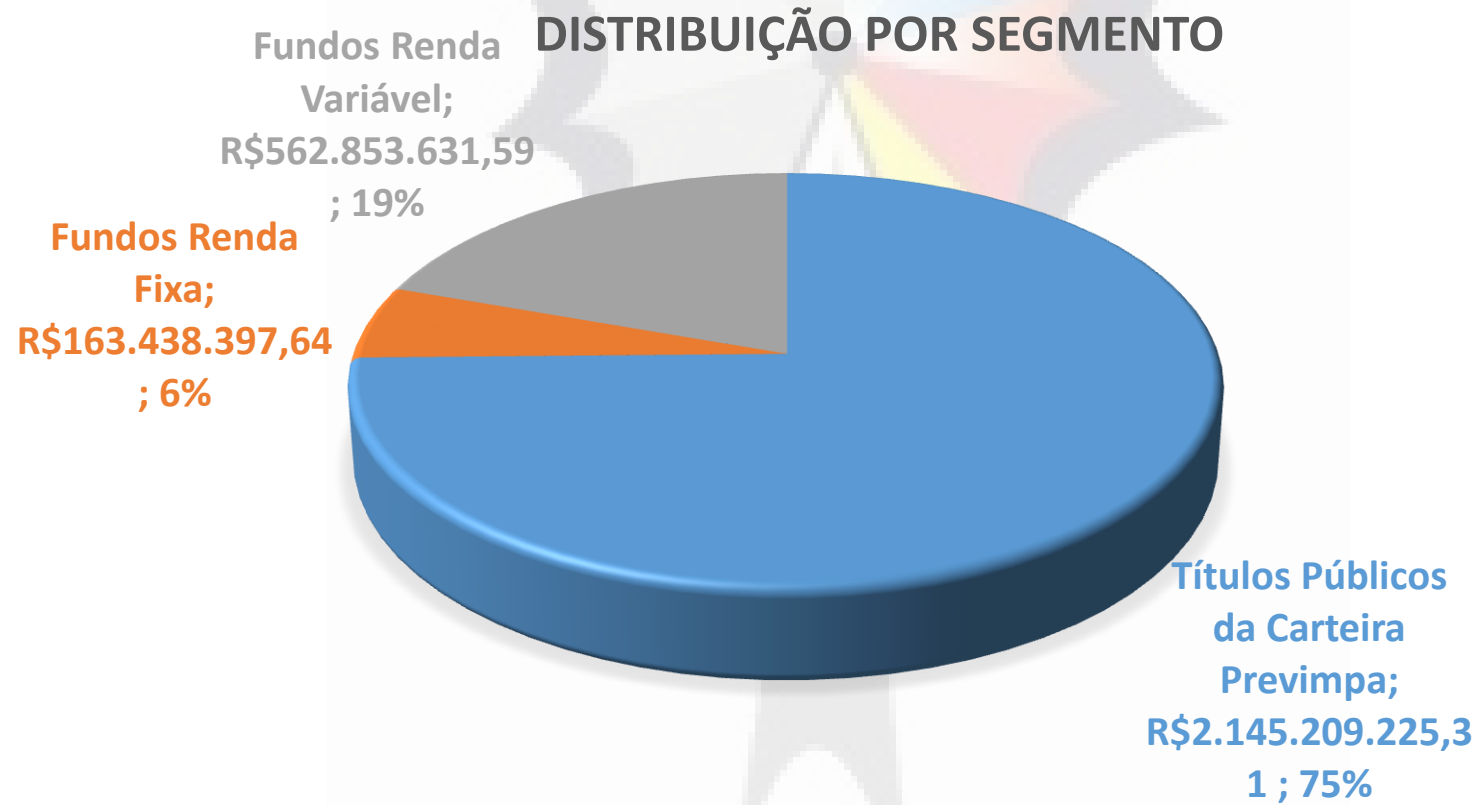


# Movimentações: Regime Capitalizado



Conta	Fundos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
702-5	Caixa FIC Cap Prot Bolsa de Valores Mult	R\$ 11.754.586,66			R\$ 11.761.021,59	R\$ 6.434,93	0,05%
702-5	Caixa FIA Institucional Bdr Nivel I	R\$ 122.149.340,07			R\$ 124.439.649,17	R\$ 2.290.309,10	1,88%
702-5	Caixa FIA Infraestrutura	R\$ 15.966.779,26			R\$ 17.329.338,10	R\$ 1.362.558,84	8,53%
702-5	Caixa FIC FIA Acoes Multigestor	R\$ 65.018.523,84			R\$ 71.013.481,90	R\$ 5.994.958,06	9,22%
73.339-2	BB Acoes Vale FI	R\$ 20.670.259,74		22.748.830,12	R\$ -	R\$ 2.078.570,38	10,06%
73.339-2	BB Acoes Alocao FIA	R\$ 24.441.907,91			R\$ 26.265.893,47	R\$ 1.823.985,56	7,46%
73.339-2	BB Acoes Retorno Total Fc	R\$ 15.732.108,11			R\$ 16.964.113,11	R\$ 1.232.005,00	7,83%
73.339-2	BB Acoes Tecnologia Bdr Nivel I FI	R\$ 17.389.113,90			R\$ 18.920.428,42	R\$ 1.531.314,52	8,81%
	Austro Institucional Pipe Bancos FICFIA	R\$ 4.432.944,65			R\$ 3.529.462,44	-R\$ 903.482,21	-20,38%
40957560-2	It Now Ibov	R\$ 62.367.500,00			R\$ 67.671.500,00	R\$ 5.304.000,00	8,50%
40957560-2	It Now Idiv	R\$ 28.840.290,00			R\$ 30.530.229,80	R\$ 1.689.939,80	5,86%
40957560-2	Ishares Smal Ci	R\$ 47.260.530,80			R\$ 51.656.656,80	R\$ 4.396.126,00	9,30%
40957560-2	Ishares Bova Ci	R\$ 96.547.500,00			R\$ 104.517.000,00	R\$ 7.969.500,00	8,25%
29.921.251	Banestes FICFI Acoes BTG Absol. Inst	R\$ 16.846.417,16			R\$ 18.254.856,79	R\$ 1.408.439,63	8,36%
<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b>		<b>R\$ 549.417.802,10</b>	<b>R\$ -</b>	<b>R\$ 22.748.830,12</b>	<b>R\$ 562.853.631,59</b>	<b>R\$ 36.184.659,61</b>	<b>6,73%</b>
<b>RENTABILIDADE FINANCEIRA DO REGIME CAPITALIZADO</b>		<b>R\$ 2.776.331.710,52</b>	<b>R\$ 176.065.802,99</b>	<b>R\$ 159.827.626,14</b>	<b>R\$ 2.871.501.254,54</b>	<b>R\$ 78.931.367,17</b>	<b>2,83%</b>
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%
<b>RENTABILIDADE TOTAL DO REGIME CAPITALIZADO</b>		<b>R\$ 2.784.531.710,52</b>	<b>R\$ 176.065.802,99</b>	<b>R\$ 159.827.626,14</b>	<b>R\$ 2.879.701.254,54</b>	<b>R\$ 78.931.367,17</b>	<b>2,83%</b>





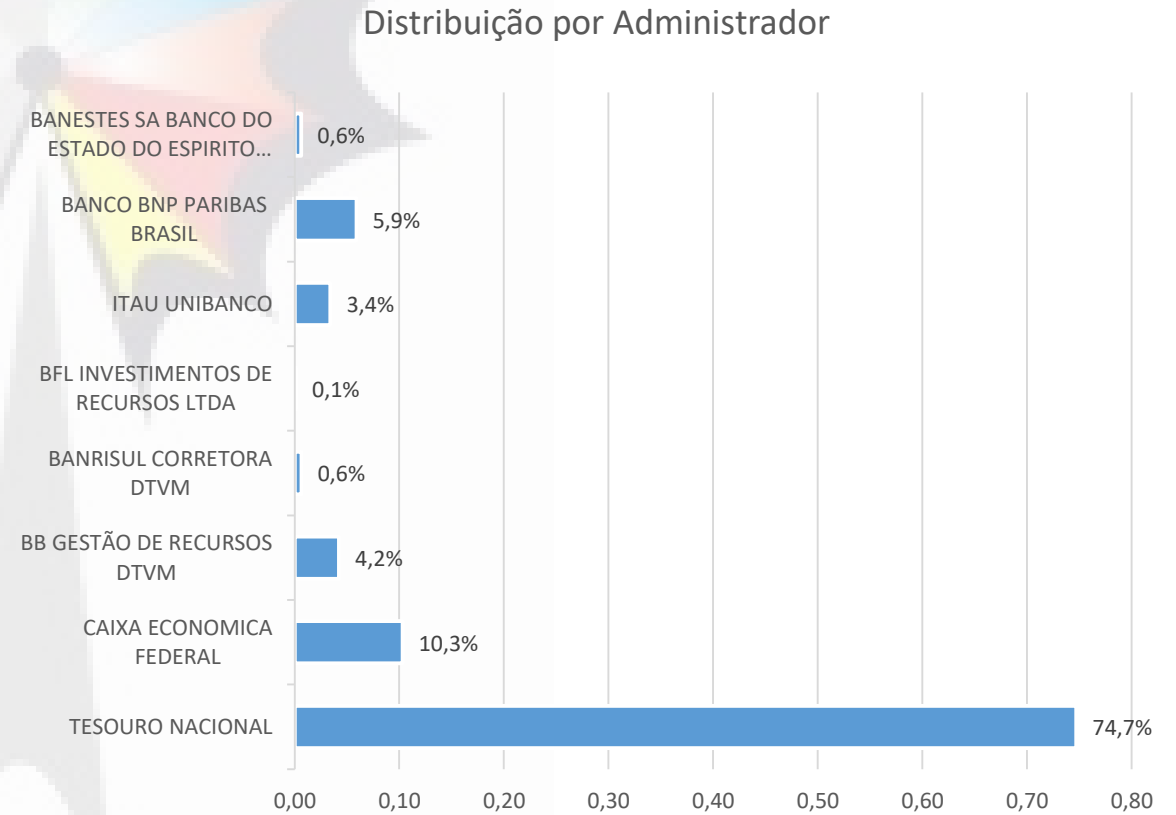


## Movimentações: Outras Contas

Conta	Taxa de Administração e Repartição Simples	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
73.342-3	COMPREV - BB Prev RF IRFM-1	R\$ 8.058.678,60			R\$ 8.077.448,94	R\$ 18.770,34	0,23%
73.342-3	COMPREV - BB Prev RF IDKA2	R\$ -	R\$ 1.038.566,56		R\$ 1.042.867,46	R\$ 4.300,90	0,83%
73.334-2	FUNDO PREVIDENCIA - BB Previd RF Fluxo	R\$ 227.639,51	R\$ 7.544,14	R\$ 17.166,30	R\$ 218.255,51	R\$ 238,16	0,11%
703-3	REPARTIÇÃO SIMPLES - Caixa Disponibilidades RF	R\$ 9.404.772,43	R\$ 4.019.693,07	R\$ 3.601.938,85	R\$ 9.832.839,78	R\$ 10.313,13	0,11%
704-1	GRATIFICACAO NAT - Caixa IRFM-1	R\$ 348.497,15	R\$ 70.520,00		R\$ 420.020,96	R\$ 1.003,81	0,26%
704-1	TAXA ADM - Caixa Disponibilidades	R\$ 4.858,73		R\$ 3.410,33	R\$ 1.453,52	R\$ 5,12	0,16%
73.360-1	TAXA ADM - BB Prev RF IRFM-1	R\$ 7.936.606,00			R\$ 7.955.092,01	R\$ 18.486,01	0,23%
73.360-1	TAXA ADM - BB Previd RF Fluxo	R\$ 5.776.922,28	R\$ 2.222.571,04	R\$ 817.379,54	R\$ 7.187.990,57	R\$ 5.876,79	0,09%
73.360-1	TAXA ADM - BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 3.559.066,11			R\$ 3.587.775,28	R\$ 28.709,17	0,81%
73.400-4	FRAP - BB Previd RF Fluxo	R\$ 678.304,07	R\$ 35.662,00		R\$ 714.687,33	R\$ 721,26	0,10%
420.000-4	ADIANTAMENTO - BB Previd RF Fluxo	R\$ 14,60		R\$ 9,17	R\$ 5,44	R\$ 0,01	0,10%
	Conta Corrente	R\$ 3.575,64			R\$ 1.257,75		0,00%
<b>TOTAL TAXA ADM E REPARTIÇÃO SIMPLES</b>		<b>R\$ 35.998.935,12</b>	<b>R\$ 7.394.556,81</b>	<b>R\$ 4.439.904,19</b>	<b>R\$ 39.039.694,55</b>	<b>R\$ 86.106,81</b>	<b>0,23%</b>
<b>RENTABILIDADE CONSOLIDADA DO PREVIMPA</b>		<b>R\$ 2.820.530.645,64</b>	<b>R\$ 183.460.359,80</b>	<b>R\$ 164.267.530,33</b>	<b>R\$ 2.918.740.949,09</b>	<b>R\$ 79.017.473,98</b>	<b>2,79%</b>

## Distribuição por Administrador

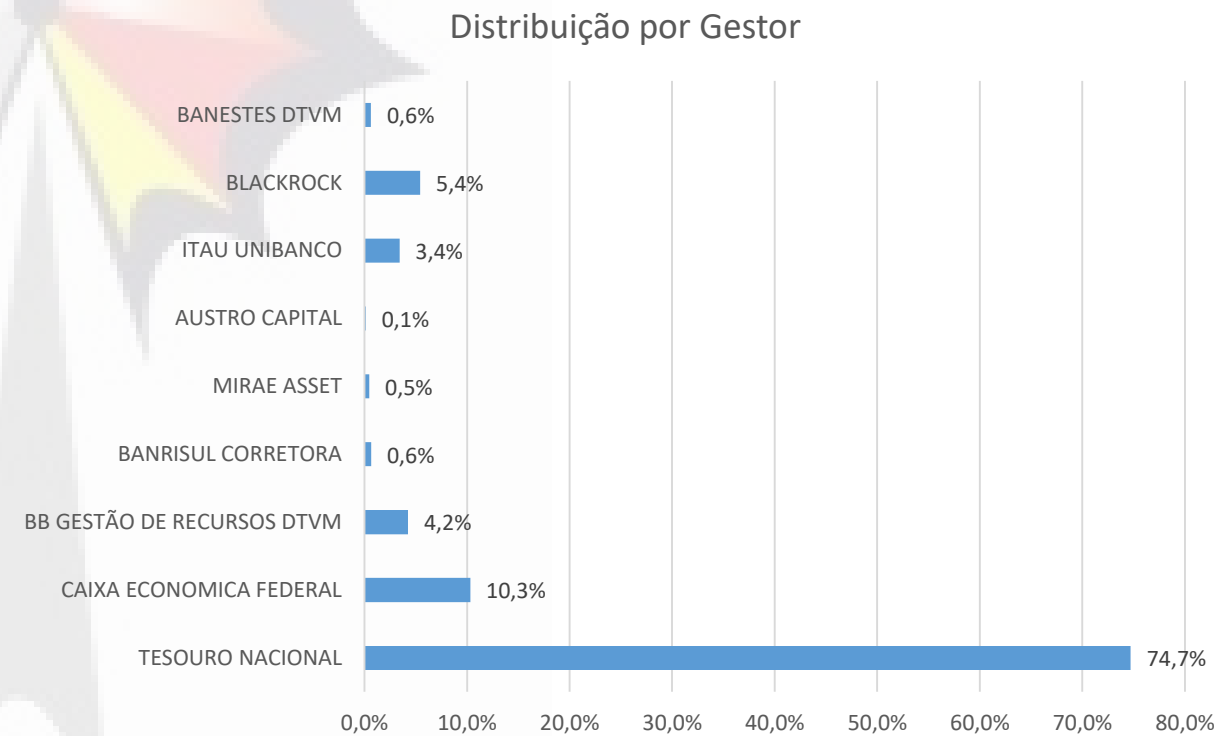
Administrador	Valor por Adm	Distribuição por Administrador
TESOURO NACIONAL	R\$ 2.145.209.225,31	74,7%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$ 296.215.534,08	10,3%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	R\$ 121.787.705,13	4,2%
BANRISUL CORRETORA DTVM	R\$ 18.626.019,69	0,6%
BFL INVESTIMENTOS DE RECURSOS LTDA	R\$ 3.529.462,44	0,1%
ITAU UNIBANCO	R\$ 98.201.729,80	3,4%
BANCO BNP PARIBAS BRASIL	R\$ 169.676.721,30	5,9%
BANESTES SA BANCO DO ESTADO DO ESPIRITO SANTO	R\$ 18.254.856,79	0,6%





# Distribuição por Gestor

Gestor	Valor por Adm	Distribuição por Gestor
TESOURO NACIONAL	2.145.209.225,31	74,7%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	296.215.534,08	10,3%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	121.787.705,13	4,2%
BANRISUL CORRETORA	18.626.019,69	0,6%
MIRAE ASSET	13.503.064,50	0,5%
AUSTRO CAPITAL	3.529.462,44	0,1%
ITAU UNIBANCO	98.201.729,80	3,4%
BLACKROCK	156.173.656,80	5,4%
BANESTES DTVM	18.254.856,79	0,6%





## Enquadramento Renda Fixa



Títulos públicos	Valor atual	PL do fundo	Participação Previmpa no fundo	Enquadramento resolução 3922	limite do enquadrame nto 3922	Limite da política de investiment os	Alvo da política de investiment os	Valor por carteira	% Alocado Carteira
Títulos da carteira Previmpa	2.145.209.225,31			Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100%	100%	70%	2.145.209.225,31	74,49%

Renda fixa	Valor atual	PL do fundo	Participação Previmpa no fundo	Enquadramento resolução 3922	limite do enquadrame nto	Limite da política de investiment os	Alvo da política de investiment os	Valor por carteira	% Carteira
Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF	3.047.055,18	12.451.209.797,34	0,02%						
Caixa FI Brasil Idka IPCA 2a RF LP	68.567.464,27	7.954.778.997,85	0,86%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100%	100%	2%	149.366.450,02	5,19%
BB Prev RF Idka 2 FI	59.125.910,88	6.099.396.938,17	0,97%						
Banrisul Foco Idka IPCA 2a FI RF	18.626.019,69	804.208.141,79	2,32%						
Mirae Fixa	13.503.064,50	160.837.508,60	8,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100%	100%	0%	13.503.064,50	0,47%
Caixa FI Brasil Disponibilidades RF	57.523,87	506.083.614,11	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40%	40%	1%	568.883,12	0,02%
BB Prev RF Fluxo Fc FI	511.359,25	1.725.378.039,09	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	67.671.500,00	1.065.637.623,86	6,35%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30%	30%	6%	223.845.156,80	7,77%
Ishares Smal Ci	51.656.656,80	1.429.895.777,57	3,61%						
Ishares Bova Ci	104.517.000,00	12.509.310.312,96	0,84%						
Caixa FIA Infraestrutura	17.329.338,10	534.839.440,79	3,24%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20%	20%	6%	168.748.111,79	5,86%
Caixa FIC FIA Acoes Multigestor	71.013.481,90	872.764.957,41	8,14%						
BB Acoes Alocao FIA	26.265.893,47	429.632.224,85	6,11%						
BB Acoes Retorno Total Fc	16.964.113,11	1.186.372.822,45	1,43%						
BB Acoes Tecnologia Bdr Nivel I FI	18.920.428,42	503.658.548,41	3,76%						
Banestes FICFI Acoes BTG Absol. Inst	18.254.856,79	154.315.606,33	11,83%						
It Now Idiv	30.530.229,80	238.901.825,34	12,78%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20%	20%	2%	30.530.229,80	1,06%
Caixa FIC Cap Prot Bolsa de Valores Mult	11.761.021,59	507.871.987,12	2,32%	Artigo 8º, Inciso III	10%	10%	2%	11.761.021,59	0,41%
Caixa FIA Institucional Bdr Nivel I	124.439.649,17	1.279.266.331,34	9,73%	Artigo 9º - A, Inciso III	10%	10%	1%	124.439.649,17	4,32%
Austro Institucional Pipe Bancos FICFIA	3.529.462,44	28.258.554,30	12,49%	Desenquadrado - RV	N. A.	N. A.	N. A.	3.529.462,44	0,12%

# 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	962,49592000	8,799000	76.999.673,60	70.991.230,96	3,59%
LTN20220101 - 100000	01/01/2022	09/04/2018	200.000	732,97834600	962,49592000	8,694000	192.499.184,00	177.721.008,60	8,97%
LTN20220401 - 100000	01/04/2022	07/02/2020	160.000	898,51867100	951,63522300	5,140000	152.261.635,68	147.206.304,00	7,10%
LTN20220701 - 100000	01/07/2022	26/06/2019	120.000	825,38325200	940,30962000	6,579000	112.837.154,40	106.258.467,96	5,26%
LTN20230701 - 100000	01/07/2023	14/06/2019	190.000	753,63622400	885,84022200	7,260000	168.309.642,17	155.002.627,37	7,85%
LTN20240101 - 100000	01/01/2024	03/01/2020	200.000	787,45838900	853,97150100	6,200000	170.794.300,20	162.999.362,00	7,96%

<b>Total LTN:</b>			<b>950.000</b>				<b>873.701.590,05</b>	<b>820.179.000,89</b>	<b>40,73%</b>
-------------------	--	--	----------------	--	--	--	-----------------------	-----------------------	---------------

### NTN-PÓS

NTNB20280815 - 760199	15/08/2028	06/06/2019	20.000	3.820,89142600	4.243,66814200	3,819000	84.873.362,84	77.363.409,18	3,96%
NTNB20280815 - 760199	15/08/2028	06/06/2019	20.000	3.820,89142600	4.243,66814200	3,819000	84.873.362,84	77.363.409,18	3,96%
NTNB20280815 - 760199	15/08/2028	06/06/2019	30.000	3.820,89142600	4.243,66814200	3,819000	127.310.044,26	116.045.113,77	5,93%

<b>Total NTN-PÓS:</b>			<b>70.000</b>				<b>297.056.769,94</b>	<b>270.771.932,13</b>	<b>13,85%</b>
-----------------------	--	--	---------------	--	--	--	-----------------------	-----------------------	---------------



# Carteira de Títulos Públicos

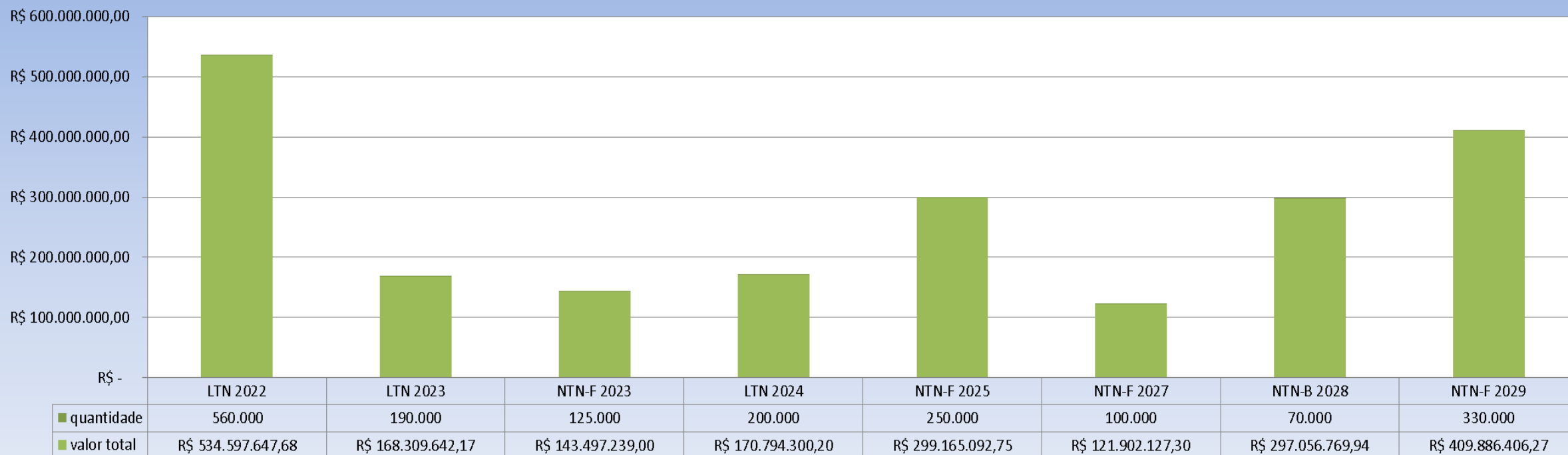


Cód. Papel	Vencimento	Data Compra	Qtde. Total	PU Compra	Preço Unitário	Taxa %	Valor Total à Mercado	Valor Total na Curva	%PL
NTN-PRÉ									
NTNF20230101 - 950199	01/01/2023	10/10/2017	25.000	1.050,74722900	1.147,97791200	9,429000	28.699.447,80	25.470.657,87	1,34%
NTNF20230101 - 950199	01/01/2023	13/10/2017	50.000	1.052,64080900	1.147,97791200	9,400000	57.398.895,60	50.967.775,00	2,68%
NTNF20230101 - 950199	01/01/2023	17/10/2017	50.000	1.051,66190700	1.147,97791200	9,444000	57.398.895,60	50.928.355,60	2,68%
NTNF20250101 - 950199	01/01/2025	13/10/2017	60.000	1.049,13298400	1.196,66037100	9,604000	71.799.622,26	61.260.428,22	3,35%
NTNF20250101 - 950199	01/01/2025	14/11/2018	140.000	1.038,99625800	1.196,66037100	9,959000	167.532.451,94	141.413.834,38	7,81%
NTNF20250101 - 950199	01/01/2025	14/11/2018	50.000	1.037,69901300	1.196,66037100	9,989000	59.833.018,55	50.458.214,00	2,79%
NTNF20270101 - 950199	01/01/2027	20/05/2019	100.000	1.092,53252800	1.219,02127300	8,949000	121.902.127,30	105.435.406,90	5,68%
NTNF20290101 - 950199	01/01/2029	20/05/2019	50.000	1.094,98101100	1.242,08001900	9,069000	62.104.000,95	52.917.166,95	2,90%
NTNF20290101 - 950199	01/01/2029	01/08/2019	60.000	1.192,01765100	1.242,08001900	7,199000	74.524.801,14	1.871.153,34	3,47%
NTNF20290101 - 950199	01/01/2029	08/11/2019	140.000	1.257,99416700	1.242,08001900	6,619000	173.891.202,66	170.454.641,56	8,11%
NTNF20290101 - 950199	01/01/2029	12/11/2019	10.000	1.254,15538900	1.242,08001900	6,679000	12.420.800,19	12.133.515,32	0,58%
NTNF20290101 - 950199	01/01/2029	08/07/2020	20000	1.218,63214500	1.242,08001900	6,529000	24.841.600,38	24.476.855,02	1,16%
NTNF20290101 - 950199	01/01/2029	08/07/2020	50000	1.218,63214500	1.242,08001900	6,529000	62.104.000,95	61.192.137,55	2,90%
Total NTN-PRÉ:			805.000				974.450.865,32	808.980.141,71	45,42%
<b>Total Títulos Públicos:</b>			<b>1.825.000</b>				<b>R\$ 2.145.209.225,31</b>	<b>R\$ 1.899.931.074,73</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)
3,94	3,76	3,76%	-R\$ 80.740.553,13	-R\$ 8.074,06

## 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

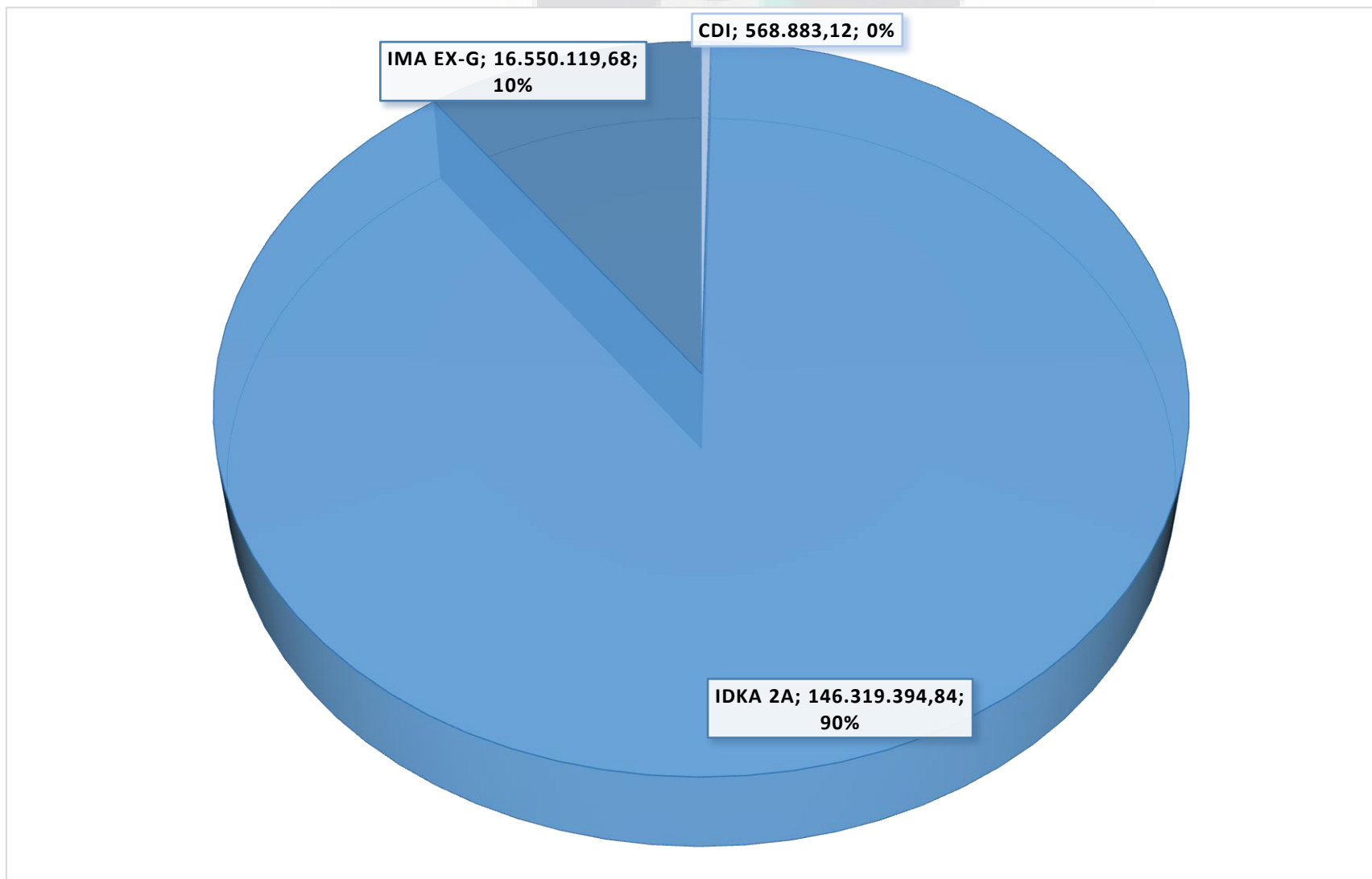
Fundos de Renda fixa	1 mês	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	No ano	VaR 95% 1 M	Volatilid ade	Sortino 12M	Sharpe 12M	Beta 12M
<b>BENCHMARK CDI</b>	<b>0,19</b>	<b>0,64</b>	<b>1,57</b>	<b>4,21</b>	<b>10,83</b>	<b>1,95</b>					
Caixa FI Brasil Disponibilidades RF	0,12	0,43	1,15	3,35	8,99	1,46	0,00%	0,07%	-1636,22%	-137,74	0,00
BB Prev RF Fluxo Fc FI	0,10	0,39	1,06	3,12	8,50	1,35	0,00%	0,07%	-1627,53%	-106,81	0,00
<b>BENCHMARK IDKA 2A</b>	<b>0,94</b>	<b>3,72</b>	<b>3,76</b>	<b>8,68</b>	<b>22,37</b>	<b>4,31</b>					
Caixa FI Brasil Idka IPCA 2a RF LP	0,83	3,96	3,50	8,10	20,93	3,97	0,16%	4,01%	117,80%	0,95	0,06
BB Prev RF Idka 2 FI	0,81	4,07	3,32	7,99	20,62	3,71	0,16%	4,10%	112,28%	0,90	0,06
Banrisul Foco Idka IPCA 2a FI RF	0,86	3,90	3,55	8,17	21,06	4,10	0,16%	4,26%	113,20%	0,91	0,06
<b>BENCHMARK IMA EX-G</b>	<b>1,66</b>	<b>3,57</b>	<b>2,88</b>	<b>7,07</b>	<b>23,27</b>	<b>3,39</b>					
Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF	0,98	3,14	4,79	9,68	28,24	5,65	0,20%	5,94%	123,42%	0,91	0,03
Mirae Fixa	1,43	4,17	7,40	12,50	N.A.	8,43	0,32%	8,47%	139,86%	1,00	0,03



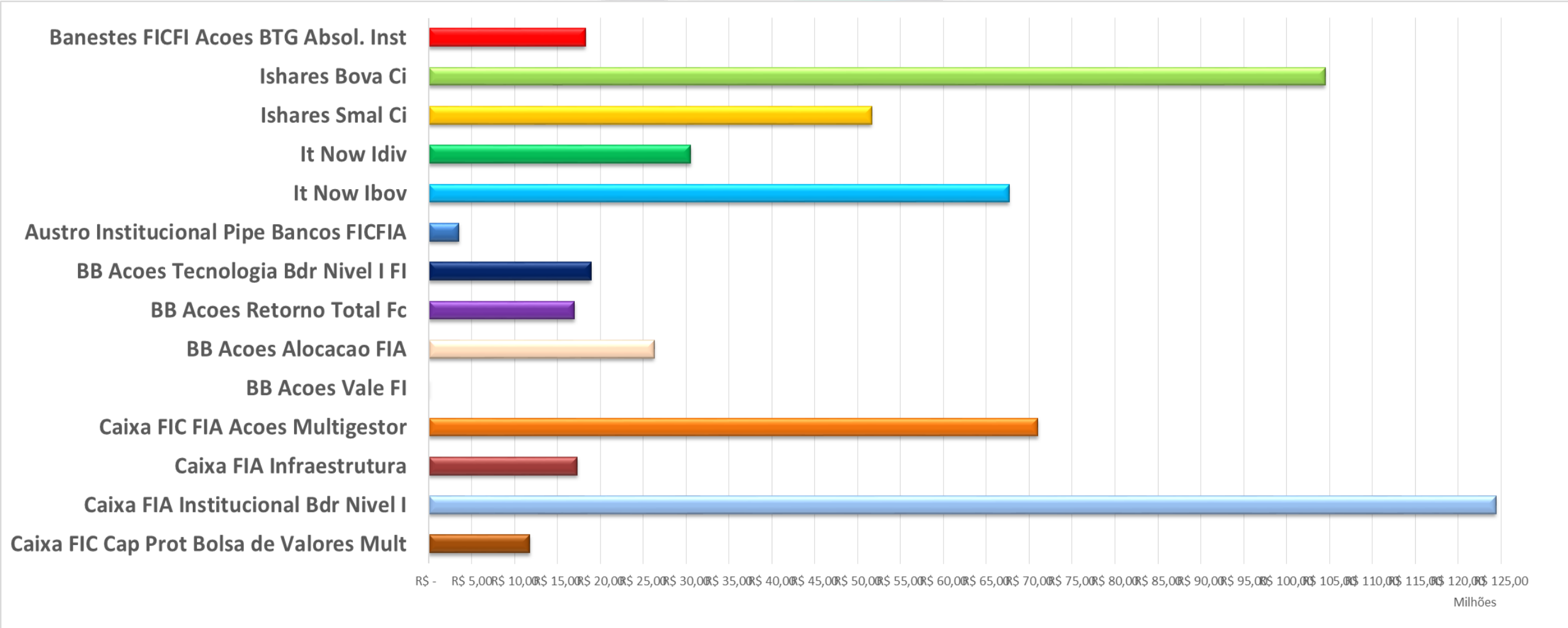
## Rentabilidade e Risco Renda Variável

Fundos Renda Variável	1 mês	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	No ano	VaR 95% 1M	Volatilid ade 12M	Sortino 12M	Sharpe	Beta 12M
<b>BENCHMARK IBOVESPA</b>	<b>8,27</b>	<b>27,83</b>	<b>-9,54</b>	<b>1,08</b>	<b>29,91</b>	<b>-11,01</b>					
Caixa FIC Cap Prot Bolsa de Valores Mult	0,05	0,43	1,53	4,66	N.A.	1,85	0,00%	1,76%	31,14%	0,25	-0,01
Caixa FIA Infraestrutura	8,53	29,55	-9,99	7,29	67,90	-8,98	1,97%	46,55%	43,08%	0,32	1,04
Caixa FIC FIA Acoes Multigestor	9,22	29,18	-9,66	9,15	N.A.	-6,80	1,87%	44,20%	46,70%	0,35	1,08
BB Acoes Alocao FIA	7,46	25,57	-14,03	-2,29	22,77	-15,22	1,94%	42,56%	8,09%	0,06	1,04
BB Acoes Retorno Total Fc	7,83	22,79	-13,24	10,01	46,04	-12,30	1,95%	39,84%	47,71%	0,36	0,96
BB Acoes Tecnologia Bdr Nivel I FI	8,81	15,74	-5,06	32,17	84,16	-0,44	2,02%	36,06%	135,62%	0,99	0,83
Austro Institucional Pipe Bancos FICFIA	-20,38	-38,31	-59,88	-62,77	-45,95	-61,23	3,10%	36,66%	-218,88%	-1,69	0,41
It Now Ibov	8,24	28,12	-9,48	1,27	30,35	-10,96	2,31%	44,34%	22,17%	0,16	1,01
It Now Idiv	5,99	20,76	-11,47	3,53	46,47	-13,38	1,85%	35,65%	22,45%	0,17	0,82
Ishares Smal Ci	9,46	30,50	-13,81	7,03	53,25	-13,52	2,35%	50,10%	44,03%	0,33	1,29
Ishares Bova Ci	8,37	28,60	-8,82	1,34	29,88	-10,73	2,20%	43,56%	21,64%	0,16	1,04
Banestes FICFI Acoes BTG Absol. Inst	8,36	31,68	-2,67	12,67	62,04	-0,70	1,91%	44,82%	59,84%	0,44	1,08
<b>BENCHMARK BDR</b>	<b>1,77</b>	<b>9,44</b>	<b>26,60</b>	<b>55,42</b>	<b>70,67</b>	<b>34,78</b>					
Caixa FIA Institucional Bdr Nivel I	1,88	9,28	27,06	55,47	69,34	35,34	1,81%	26,61%	323,09%	2,04	0,02

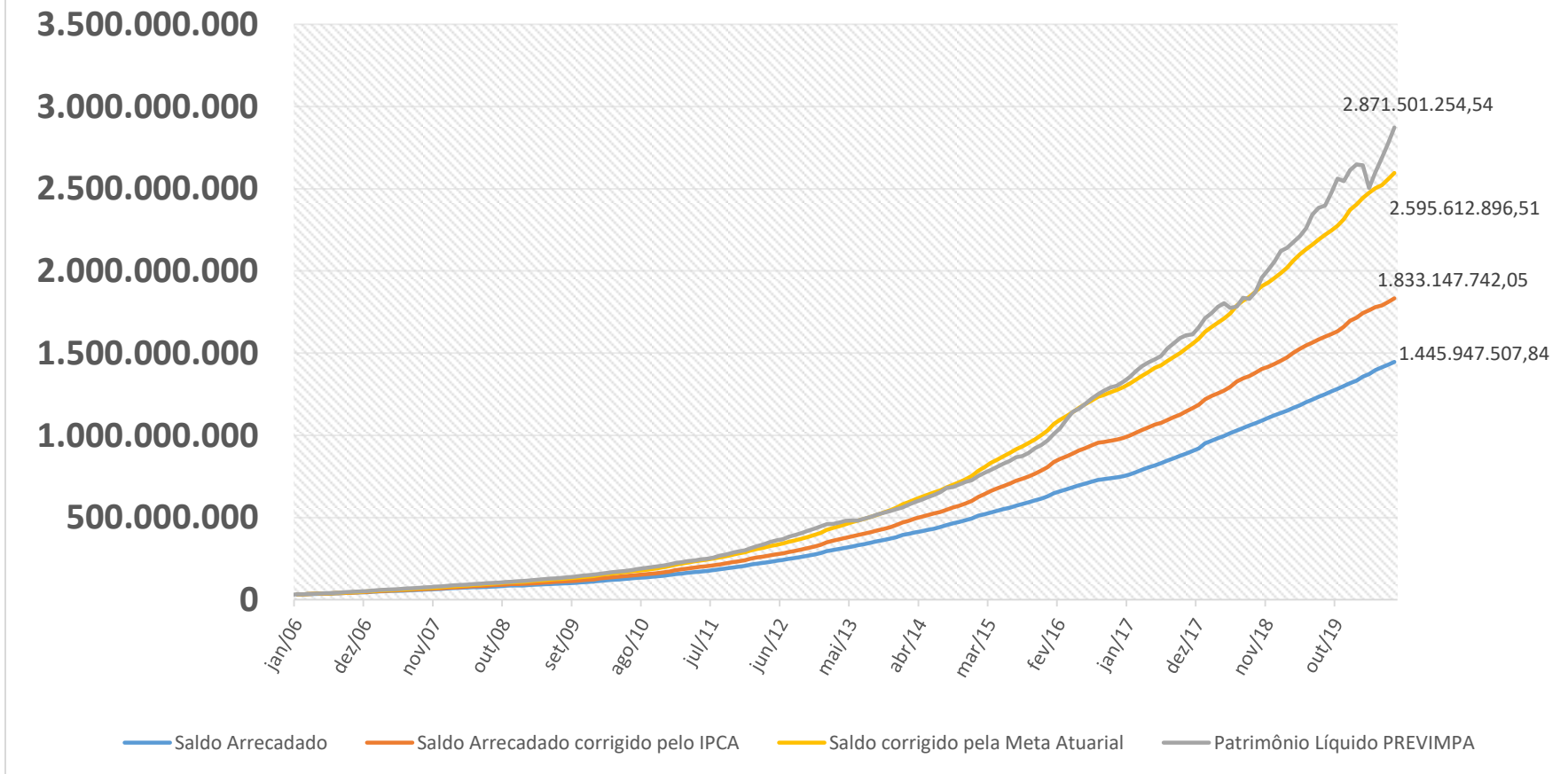
## Distribuição dos Fundos Renda Fixa



# Distribuição dos Fundos Renda Variável



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





# 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 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 BRASIL GESTÃO ESTRAT.	23.215.097/0001-55	0,40%	Não há	D+0	D+0	Não há	16:00
			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 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 IDK 2A	21.007.180/0001-03	0,20%	Não há	D+0	D+1	Não há	15:00
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
<b>Renda Variável</b>										
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 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
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
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