

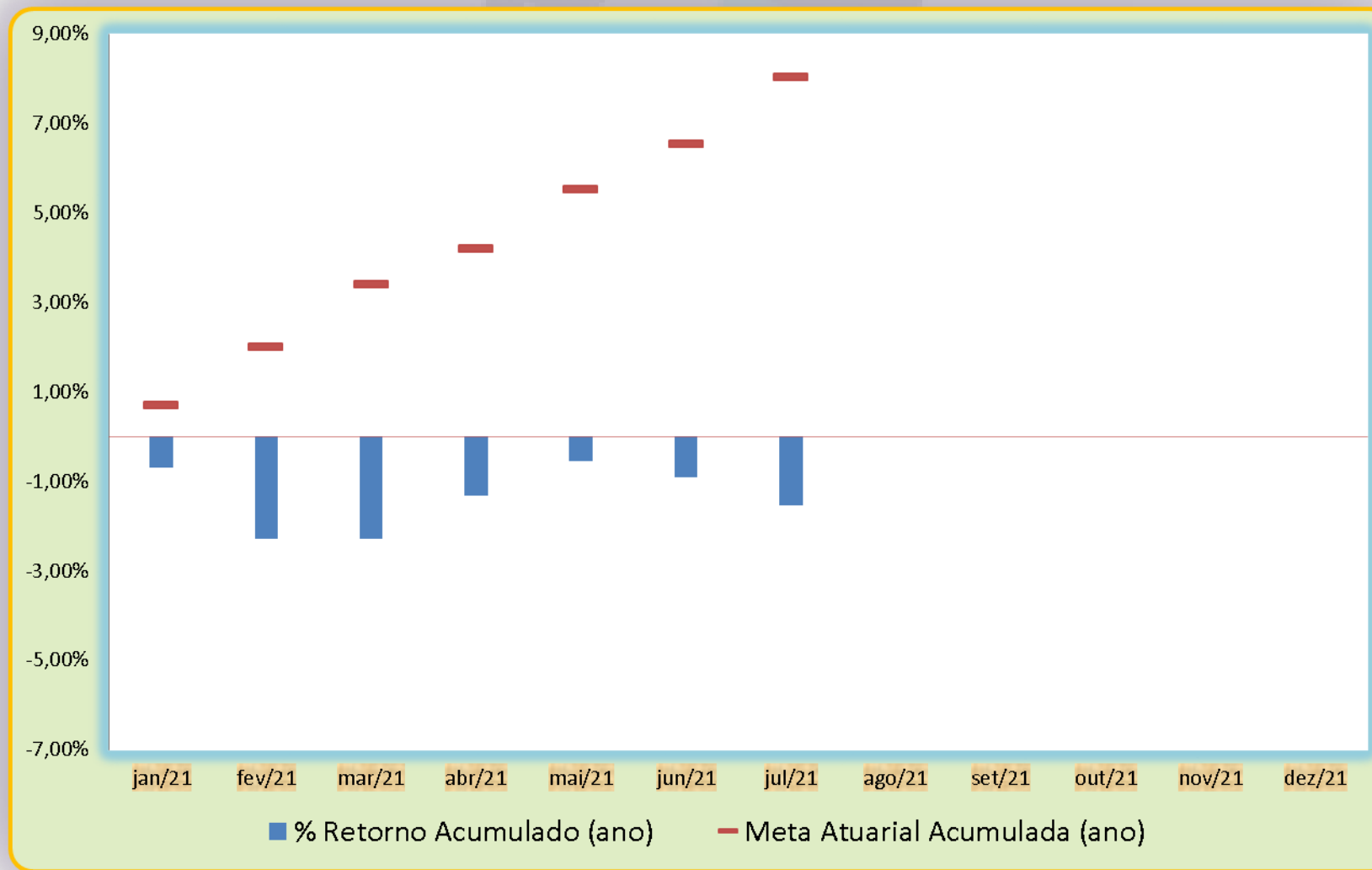
# Relatório de Resultados dos Investimentos do PREVIMPA

Competência: Julho/2021

Competência	Patrimônio Líquido Inicial (R\$)	Aplicação (R\$)	Resgate (R\$)	Fluxo de Caixa (R\$)	Fluxo de Caixa Acumulado Anual (R\$)	Patrimônio Líquido Final (R\$)	Retorno Mensal (R\$)	Retorno Acumulado Anual (R\$)	% Retorno Mensal	% Retorno Acumulado (ano)
jan/21	R\$ 3.035.629.264,65	R\$ 125.625.889,51	R\$ 93.233.489,12	R\$ 32.392.400,39	R\$ 32.392.400,39	R\$ 3.046.935.151,30	-R\$ 21.086.513,74	-R\$ 21.086.513,74	-0,6909%	-0,69%
fev/21	R\$ 3.046.935.151,30	R\$ 160.862.699,82	R\$ 144.722.412,08	R\$ 16.140.287,74	R\$ 48.532.688,13	R\$ 3.014.342.224,63	-R\$ 48.733.214,41	-R\$ 69.819.728,15	-1,5952%	-2,28%
mar/21	R\$ 3.014.342.224,63	R\$ 107.715.260,23	R\$ 91.433.667,50	R\$ 16.281.592,73	R\$ 64.814.280,86	R\$ 3.030.110.587,07	-R\$ 513.230,29	-R\$ 70.332.958,44	-0,0170%	-2,29%
abr/21	R\$ 3.030.110.587,07	R\$ 2.275.561.697,61	R\$ 2.259.185.074,20	R\$ 16.376.623,41	R\$ 81.190.904,27	R\$ 3.076.452.937,17	R\$ 29.965.726,69	-R\$ 40.367.231,75	0,9863%	-1,31%
mai/21	R\$ 3.076.452.937,17	R\$ 948.277.545,93	R\$ 929.784.392,19	R\$ 18.493.153,74	R\$ 99.684.058,01	R\$ 3.118.068.350,95	R\$ 23.122.260,04	-R\$ 17.244.971,71	0,7493%	-0,56%
jun/21	R\$ 3.118.068.350,95	R\$ 709.261.495,94	R\$ 693.479.247,07	R\$ 15.782.248,87	R\$ 115.466.306,88	R\$ 3.122.537.498,15	-R\$ 11.313.101,67	-R\$ 28.558.073,38	-0,3619%	-0,92%
jul/21	R\$ 3.122.537.498,15	R\$ 518.639.212,77	R\$ 502.318.984,91	R\$ 16.320.227,86	R\$ 131.786.534,74	R\$ 3.119.928.823,45	-R\$ 18.928.902,56	-R\$ 47.486.975,94	-0,6046%	-1,53%
ago/21										
set/21										
out/21										
nov/21										
dez/21										
<b>TOTAL ANO</b>	<b>R\$ 3.035.629.264,65</b>	<b>R\$ 4.845.943.801,81</b>	<b>R\$ 4.714.157.267,07</b>	<b>R\$ 131.786.534,74</b>		<b>R\$ 3.119.928.823,45</b>	<b>-R\$ 47.486.975,94</b>			<b>-1,53%</b>

## 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							
set/21							
out/21							
nov/21							
dez/21							
		4,76%		8,05%			



## 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\$ 4.845.943.801,81	R\$ 4.714.157.267,07	R\$ 131.786.534,74	R\$ 3.119.928.823,45	-R\$ 47.486.975,94	-1,53%	8,05%	4,76%
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%

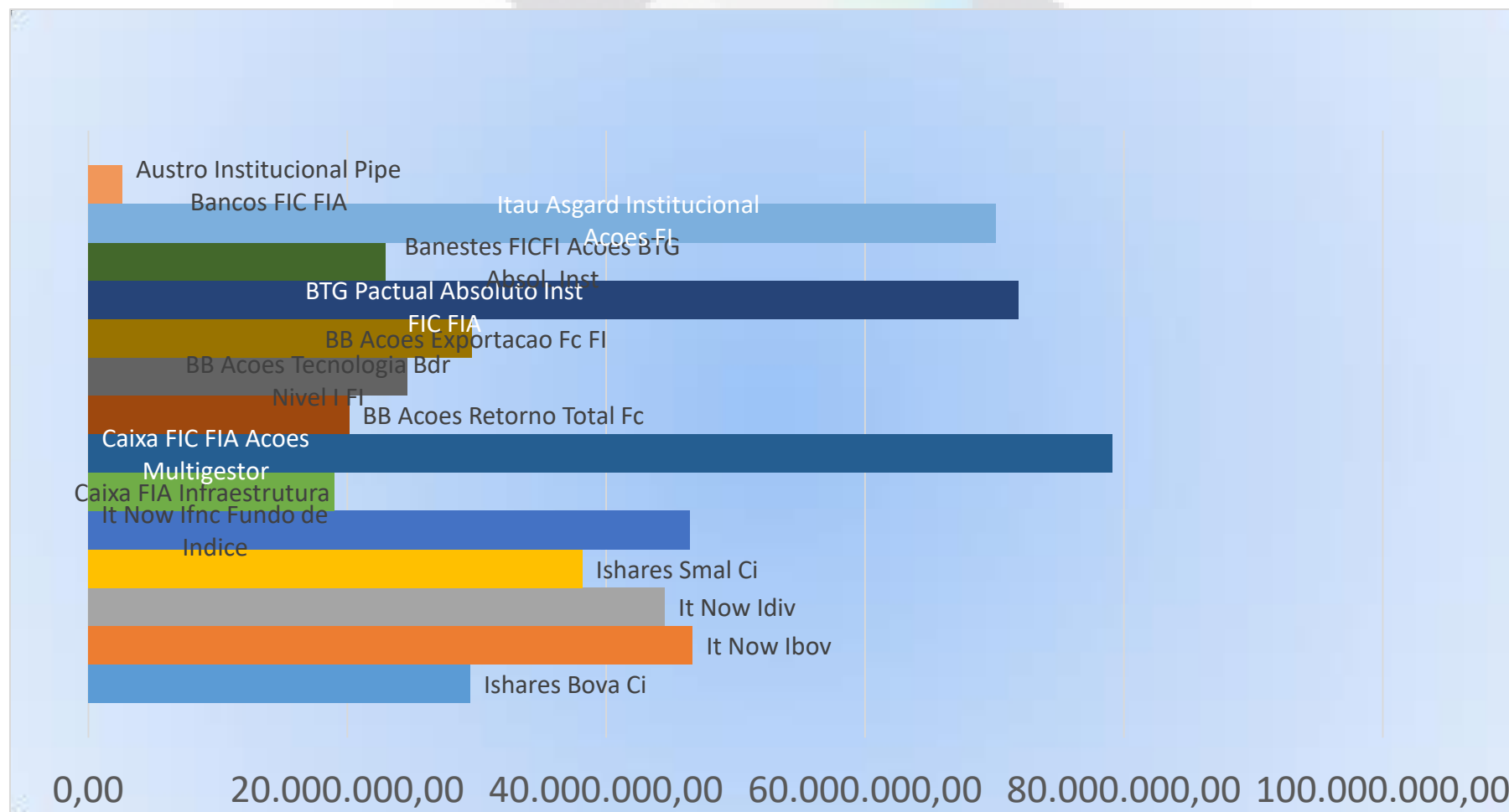
## Movimentações : Regime Capitalizado

Conta	Títulos Públicos da Carteira Previmpa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
	Títulos Públicos Federais	1.965.983.036,00			1.961.867.465,16 -R\$	4.115.570,84	-0,21%
Conta	Fundos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
702-5	Caixa FIC Brasil Disponibilidades RF	R\$ 163.363,82		R\$ 7.706,54	R\$ 156.060,45	R\$ 403,17	0,25%
702-5	Caixa FI Brasil Idka IPCA 2a RF LP	R\$ 364.834.505,59	R\$ 62.235.623,43	R\$ 46.300.000,00	R\$ 380.650.191,66	-R\$ 119.937,36	-0,03%
702-5	FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	R\$ 17.285.431,62			R\$ 17.287.834,36	R\$ 2.402,74	0,01%
73.339-3	BB Prev RF Fluxo Fc FI	R\$ 4.723.022,66	R\$ 812.687,54	R\$ 1.824.868,01	R\$ 3.721.517,34	R\$ 10.675,15	0,25%
73.339-3	BB Prev RF Idka 2 FI	R\$ 184.887.959,11			R\$ 185.042.265,89	R\$ 154.306,78	0,08%
95756.0-2	Banrisul Foco Idka IPCA 2a FI RF	R\$ 107.590.005,38		R\$ 107.692.395,23	R\$ -	R\$ 102.389,85	0,10%
95756.0-2	Banrisul Automatico FI RF CP	R\$ 6.394.650,50	R\$ 172.016.630,34	R\$ 161.194.764,23	R\$ 17.273.207,98	R\$ 56.691,37	0,48%
TOTAL DOS FUNDO DE RENDA FIXA		R\$ 685.878.938,68	R\$ 235.064.941,31	R\$ 317.019.734,01	R\$ 604.131.077,68	R\$ 206.931,70	0,03%
TOTAL DA RENDA FIXA		R\$ 2.651.861.974,68	R\$ 235.064.941,31	R\$ 317.019.734,01	R\$ 2.565.998.542,84	-R\$ 3.908.639,14	-0,15%

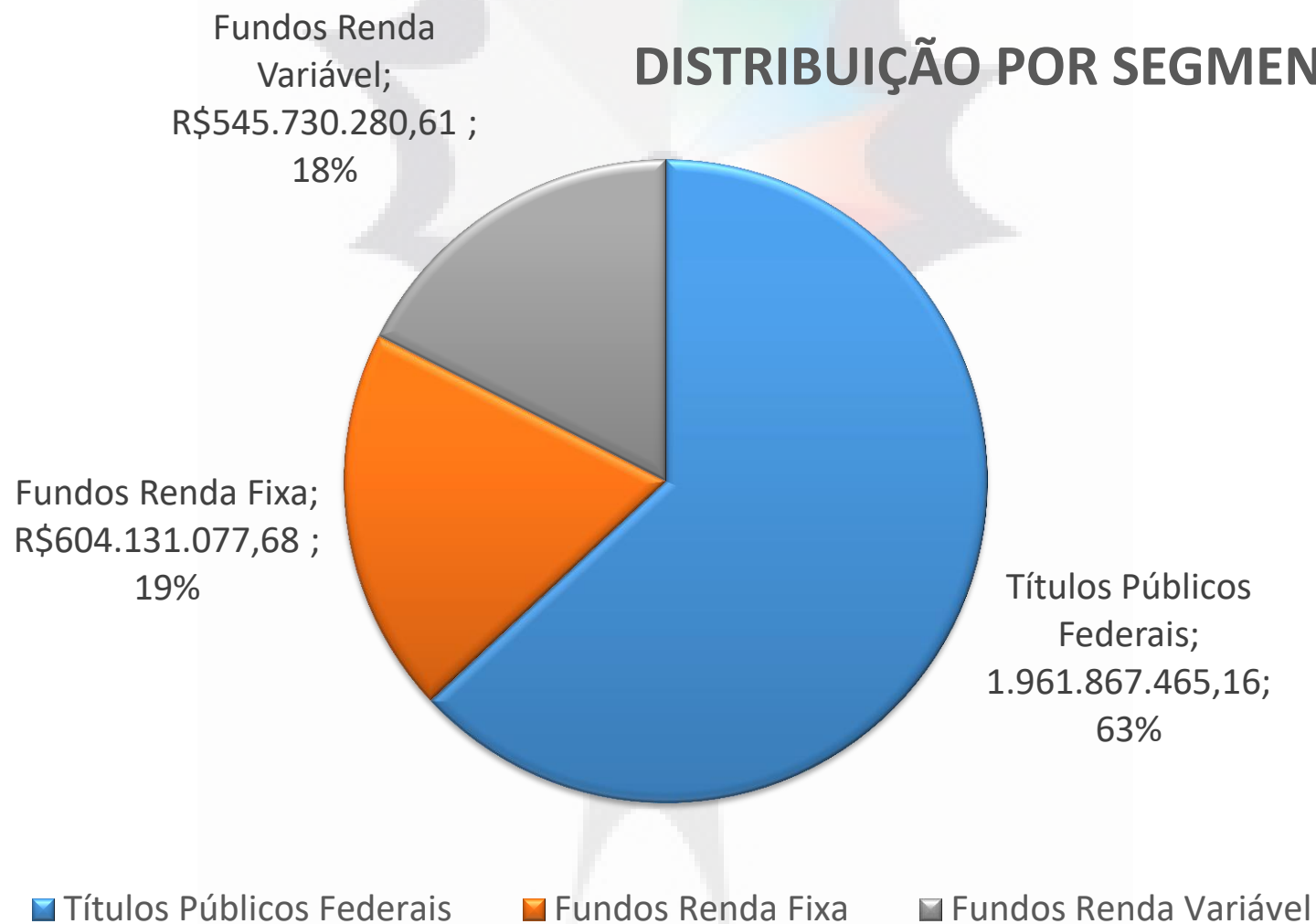
## Movimentações: Regime Capitalizado

Conta	Fundos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
40957560-2	Ishares Bova Ci	R\$ 60.986.198,82	R\$ 60.433.647,32	R\$ 92.848.306,81	R\$ 29.532.500,00	R\$ 960.960,67	2,15%
40957560-2	It Now Ifnc Fundo de Indice	R\$ 47.172.000,00			R\$ 46.480.000,00	-R\$ 692.000,00	-1,47%
40957560-2	It Now Ibov	R\$ -	94.458.714,54	R\$ 47.555.435,53	R\$ 46.697.614,14	-R\$ 205.664,87	-0,22%
40957560-2	It Now Idiv	R\$ -	R\$ 45.038.665,71		R\$ 44.548.664,81	-R\$ 490.000,90	-1,09%
40957560-2	Ishares Smal Ci	R\$ -	R\$ 38.643.243,89		R\$ 38.189.958,66	-R\$ 453.285,23	-1,17%
73.339-3	BB Acoes Retorno Total Fc	R\$ 21.099.541,85			R\$ 20.160.456,91	-R\$ 939.084,94	-4,45%
73.339-3	BB Acoes Tecnologia Bdr Nivel I FI	R\$ 24.156.132,13			R\$ 24.627.370,44	R\$ 471.238,31	1,95%
73.339-3	BB Acoes Exportacao Fc FI	R\$ 30.446.502,01			R\$ 29.663.387,75	-R\$ 783.114,26	-2,57%
702-5	Caixa FIC FIA Acoes Multigestor	R\$ 83.125.847,29			R\$ 79.127.441,10	-R\$ 3.998.406,19	-4,81%
702-5	Caixa FIA Infraestrutura	R\$ 19.627.503,85			R\$ 19.020.077,41	-R\$ 607.426,44	-3,09%
	Austro Institucional Pipe Bancos FIC FIA	R\$ 2.838.446,24			R\$ 2.663.375,13	-R\$ 175.071,11	-6,17%
29.921.251	Banestes FICFI Acoes BTG Absol. Inst	R\$ 24.080.378,84			R\$ 22.982.852,42	-R\$ 1.097.526,42	-4,56%
	BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	R\$ 50.595.392,13	R\$ 25.000.000,00		R\$ 71.889.363,90	-R\$ 3.706.028,23	-5,87%
73.339-3	Itau Asgard Institucional Acoes FI	R\$ 53.452.071,75	R\$ 20.000.000,00		R\$ 70.147.217,94	-R\$ 3.304.853,81	-5,21%
45000004-7	Santander Global Equities Dólar Master Mult Ie FI	R\$ 44.895.508,56		R\$ 44.895.508,56	R\$ -	R\$ -	0,00%
<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b>		<b>R\$ 462.475.523,47</b>	<b>R\$ 283.574.271,46</b>	<b>R\$ 185.299.250,90</b>	<b>R\$ 545.730.280,61</b>	<b>-R\$ 15.020.263,42</b>	<b>-2,94%</b>
<b>RENTABILIDADE FINANCEIRA DO REGIME CAPITALIZADO</b>		<b>R\$ 3.114.337.498,15</b>	<b>R\$ 518.639.212,77</b>	<b>R\$ 502.318.984,91</b>	<b>R\$ 3.111.728.823,45</b>	<b>-R\$ 18.928.902,56</b>	<b>-0,61%</b>
Conta	IMÓVEL	Saldo Atual	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\$ 3.122.537.498,15</b>	<b>R\$ 518.639.212,77</b>	<b>R\$ 502.318.984,91</b>	<b>R\$ 3.119.928.823,45</b>	<b>-R\$ 18.928.902,56</b>	<b>-0,60%</b>

# Distribuição por fundo de renda variável





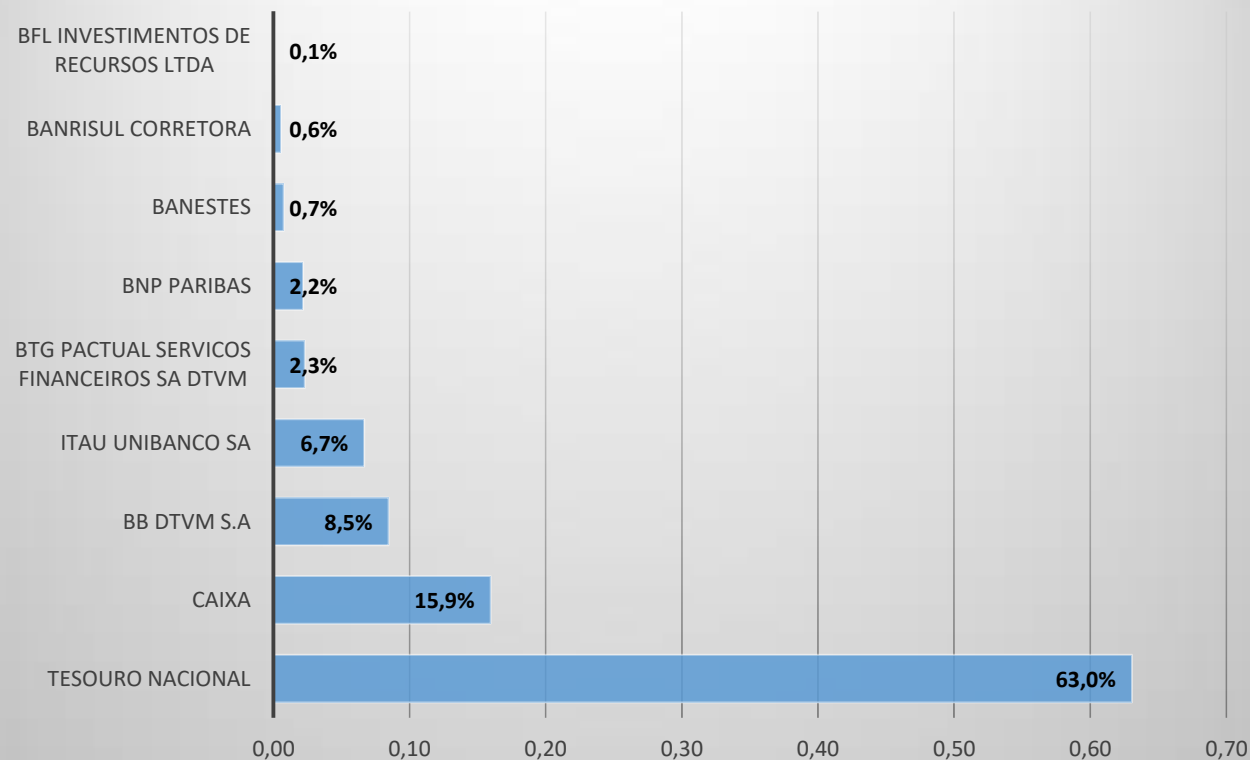


## Movimentações: Outras Contas

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\$ 975.968,21			R\$ 977.572,14	R\$ 1.603,93	0,16%
73.342-3	COMPREV - BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 2.379.539,58			R\$ 2.381.525,54	R\$ 1.985,96	0,08%
73.342-3	COMPREV - BB Previd RF Fluxo	R\$ 5.561.662,50	R\$ 1.052.934,14		R\$ 6.630.182,80	R\$ 15.586,16	0,26%
73.334-2	FUNDO PREVIDENCIA - BB Previd RF Fluxo	R\$ 383.666,97	R\$ 7.532,34	R\$ 34.497,32	R\$ 357.632,93	R\$ 930,94	0,25%
703-3	REPARTIÇÃO SIMPLES - Caixa Disponibilidades RF	R\$ 11.567.404,69	R\$ 4.101.019,36	R\$ 4.591.924,70	R\$ 11.103.831,21	R\$ 27.331,86	0,24%
704-1	TAXA ADM - Caixa IDKA2	R\$ 137.154,95			R\$ 137.065,88	-R\$ 89,07	-0,06%
704-1	TAXA ADM - Caixa IRFM-1	R\$ 203.472,48	R\$ 65.580,00		R\$ 269.496,99	R\$ 444,51	0,19%
704-1	TAXA ADM - Caixa Disponibilidades	R\$ 23.605,78		R\$ 3.433,02	R\$ 20.232,30	R\$ 59,54	0,27%
73.360-1	TAXA ADM - BB Prev RF IRFM-1	R\$ 7.946.616,49			R\$ 7.959.676,14	R\$ 13.059,65	0,16%
73.360-1	TAXA ADM - BB Previd RF Fluxo	R\$ 6.889.215,07	R\$ 2.332.224,07	R\$ 744.076,29	R\$ 8.494.670,35	R\$ 17.307,50	0,23%
73.400-4	FRAP - BB Previd RF Fluxo	R\$ 899.631,64	R\$ 26.691,85	R\$ 1.037,27	R\$ 927.551,81	R\$ 2.265,59	0,25%
420.000-4	ADIANTAMENTO - BB Previd RF Fluxo	R\$ 755,35		R\$ 752,00	R\$ 4,48	R\$ 1,13	0,30%
	Conta Corrente	R\$ 1.829,22			R\$ 1.829,22		0,00%
<b>TOTAL TAXA ADM E REPARTIÇÃO SIMPLES</b>		<b>R\$ 36.970.522,93</b>	<b>R\$ 7.585.981,76</b>	<b>R\$ 5.375.720,60</b>	<b>R\$ 39.261.271,79</b>	<b>R\$ 80.487,70</b>	<b>0,21%</b>
<b>RENTABILIDADE CONSOLIDADA DO PREVIMPA</b>		<b>R\$ 3.159.508.021,08</b>	<b>R\$ 526.225.194,53</b>	<b>R\$ 507.694.705,51</b>	<b>R\$ 3.159.190.095,24</b>	<b>-R\$ 18.848.414,86</b>	<b>-0,59%</b>

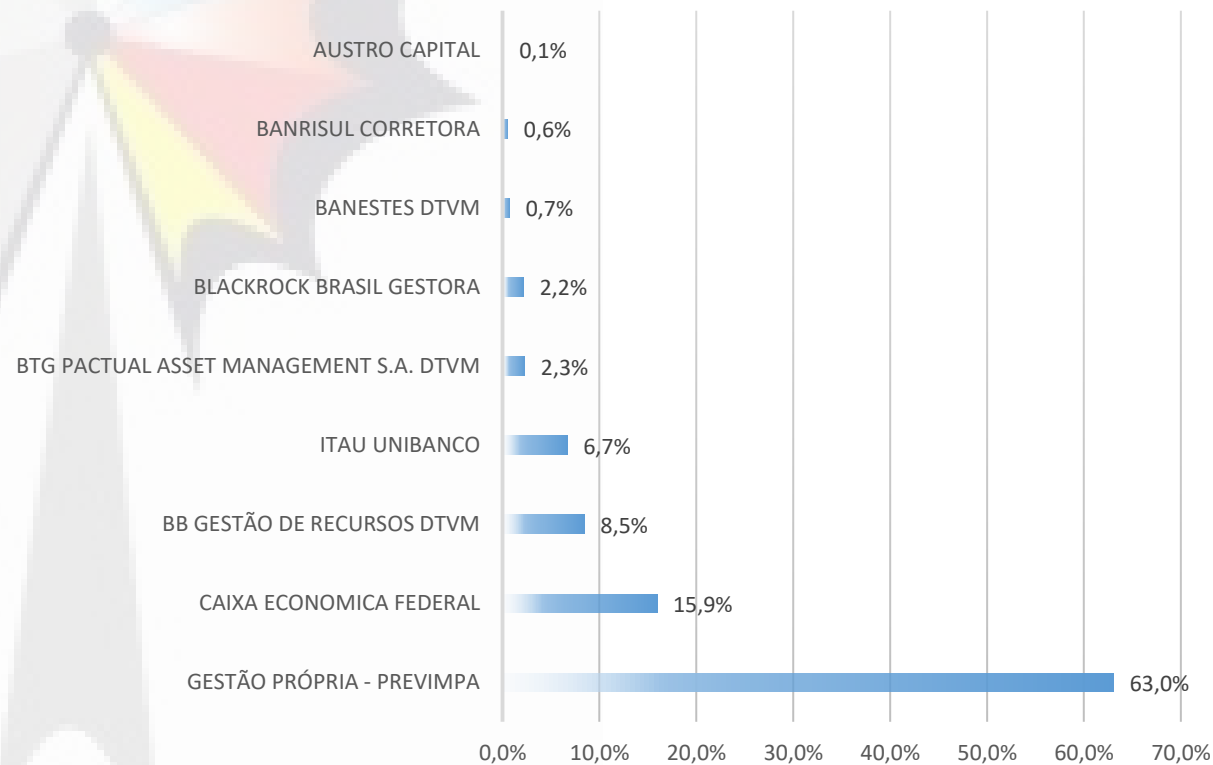
Administrador	Valor por Adm	Distribuição por Administrador
TESOURO NACIONAL	R\$ 1.961.867.465,16	63,0%
Caixa	R\$ 496.241.604,98	15,9%
BB DtvM S.A	R\$ 263.214.998,33	8,5%
Itau Unibanco SA	R\$ 207.873.496,89	6,7%
BTG Pactual Servicos Financeiros SA DtvM	R\$ 71.889.363,90	2,3%
BNP Paribas	R\$ 67.722.458,66	2,2%
Banestes	R\$ 22.982.852,42	0,7%
Banrisul Corretora	R\$ 17.273.207,98	0,6%
BFL INVESTIMENTOS DE RECURSOS LTDA	R\$ 2.663.375,13	0,1%

### Distribuição por Administrador



Gestor	Valor por Gestor	Distribuição por Gestor
GESTÃO PRÓPRIA - PREVIMPA	1.961.867.465,16	63,0%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	496.241.604,98	15,9%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	263.214.998,33	8,5%
ITAU UNIBANCO	207.873.496,89	6,7%
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S.A. D <sup>1</sup>	71.889.363,90	2,3%
BLACKROCK BRASIL GESTORA	67.722.458,66	2,2%
BANESTES DTVM	22.982.852,42	0,7%
BANRISUL CORRETORA	17.273.207,98	0,6%
AUSTRO CAPITAL	2.663.375,13	0,1%

## 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	1.961.867.465,16			Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100%	100%	70%	1.961.867.465,16	63,05%

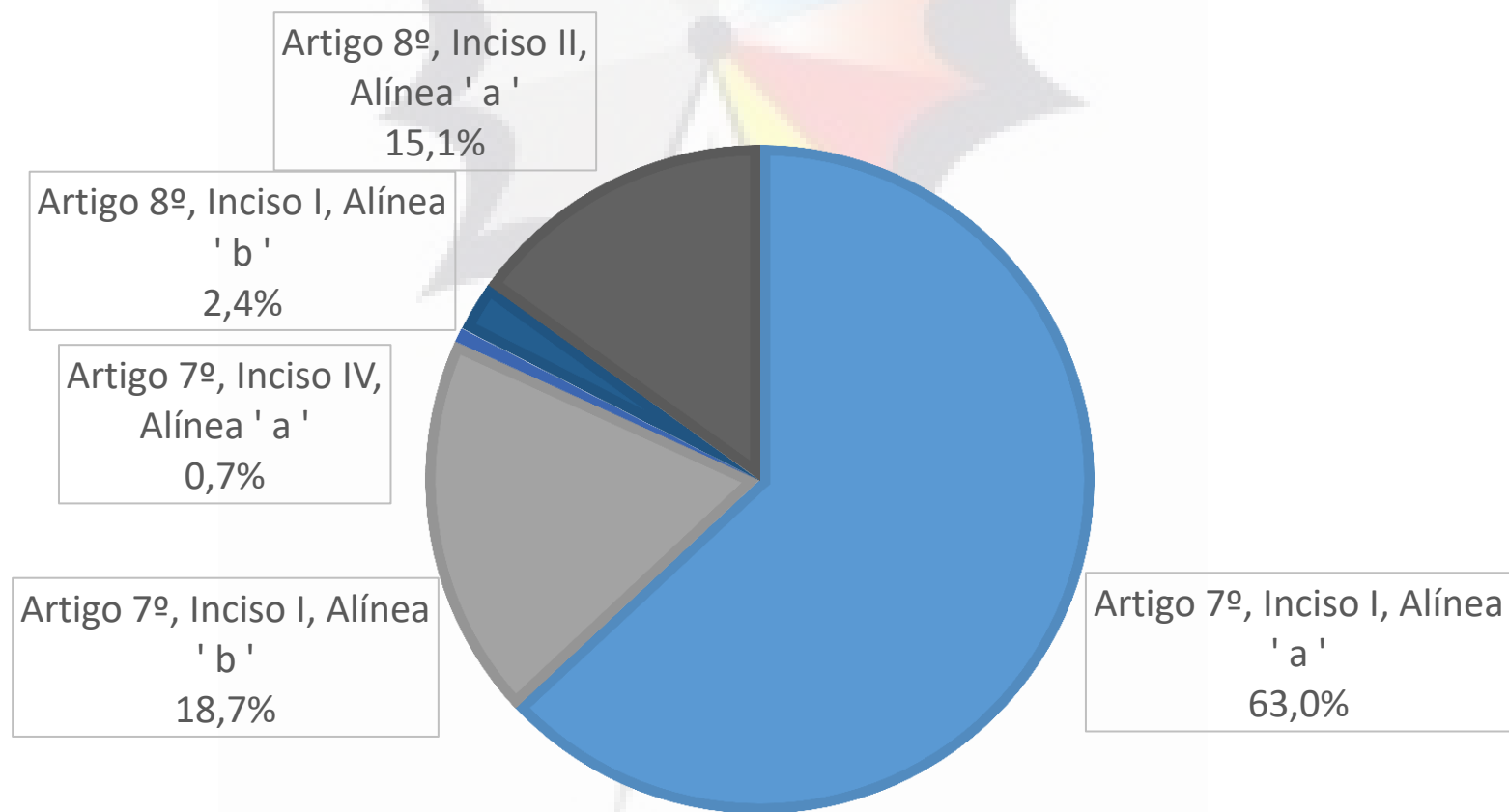
Fundos de Renda fixa	Valor atual	PL do fundo	Participação Previmpa no fundo	Enquadramento resolução 3922	Limite do enquadramento 3922	Limite da política de investimentos	Alvo da política de investimentos	Valor por Carteira	% Carteira
Caixa FI Brasil Idka IPCA 2a RF LP	380.650.191,66	12.042.628.715,86	3,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100%	100%	6%	582.980.291,91	18,73%
FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	17.287.834,36	11.707.172.620,84	0,15%						
BB Prev RF Idka 2 FI	185.042.265,89	10.405.647.705,91	1,78%						
Banrisul Foco Idka IPCA 2a FI RF	0,00	1.239.062.081,84	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40%	40%	1%	21.150.785,77	0,68%
Caixa FIC Brasil Disponibilidades RF	156.060,45	570.379.498,92	0,03%						
BB Prev RF Fluxo Fc FI	3.721.517,34	2.238.891.886,28	0,17%						
Banrisul Automatico FI RF CP	17.273.207,98	941.591.674,79	1,83%						

## Enquadramento Renda Variável

Fundos de Renda Variável	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	% Carteira
Ishares Bova Ci	29.532.500,00	12.748.517.941,09	0,23%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30%	30%	6%	76.230.114,14	2,45%
It Now Ibov	46.697.614,14	7.576.579.931,80	0,62%						
It Now Idiv	44.548.664,81	372.445.677,98	11,96%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20%	20%	4%	469.500.166,47	15,09%
Ishares Smal Ci	38.189.958,66	1.689.265.080,55	2,26%						
It Now Ifnc Fundo de Indice	46.480.000,00	316.650.608,69	14,68%						
Caixa FIA Infraestrutura	19.020.077,41	459.189.655,43	4,14%						
Caixa FIC FIA Acoes Multigestor	79.127.441,10	1.084.997.968,28	7,29%						
BB Acoes Retorno Total Fc	20.160.456,91	1.880.249.134,37	1,07%						
BB Acoes Tecnologia Bdr Nivel I FI	24.627.370,44	1.107.587.533,90	2,22%						
BB Acoes Exportacao Fc FI	29.663.387,75	376.661.087,86	7,88%						
BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	71.889.363,90	2.947.905.302,72	2,44%						
Banestes FICFI Acoes BTG Absol. Inst	22.982.852,42	241.795.177,26	9,51%						
Itau Asgard Institucional Acoes FI	70.147.217,94	640.879.611,84	10,95%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20%	20%	4%	469.500.166,47	15,09%
Austro Institucional Pipe Bancos FIC FIA	2.663.375,13	21.324.247,66	12,49%						

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

## Distribuição por enquadramento

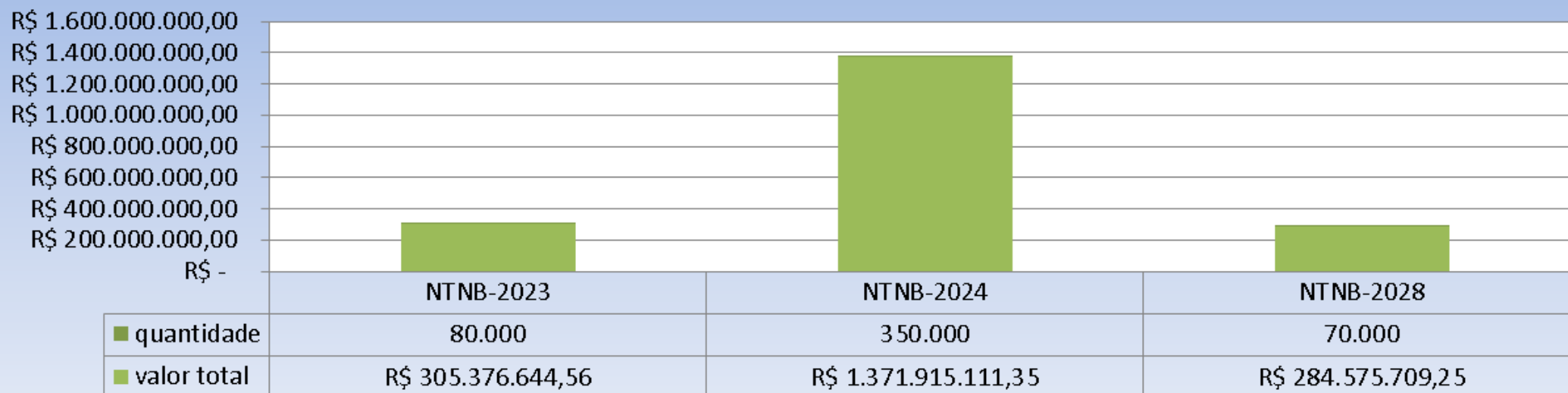


# Carteira de Títulos públicos

Cód. Papel	Vencimento	Data Compra	Qtde. Bloq.	Qtde. Total	PU Compra	Preço Unitário	Taxa %	Valor Total à Mercado	Valor Total na Curva	%PL
Títulos Públicos										
NTN-PÓS										
NTNB20230515 - 760199	15/05/2023	14/04/2021	0	80.000	3.860,87637900	3.817,20805700	2,259018	305.376.644,56	309.219.554,56	15,57%
NTNB20240815 - 760199	15/08/2024	17/12/2020	0	40.000	3.987,99033100	3.919,75746100	1,629008	156.790.298,44	165.732.675,40	7,99%
NTNB20240815 - 760199	15/08/2024	14/04/2021	20.000	160.000	3.836,63293600	3.919,75746100	3,315875	627.161.193,76	633.445.988,64	31,97%
NTNB20240815 - 760199	15/08/2024	29/04/2021	0	40.000	3.916,92915700	3.919,75746100	2,709981	156.790.298,44	160.954.169,00	7,99%
NTNB20240815 - 760199	15/08/2024	14/05/2021	0	60.000	3.919,10708500	3.919,75746100	2,790000	235.185.447,66	240.912.331,38	11,99%
NTNB20240815 - 760199	15/08/2024	14/05/2021	0	20.000	3.919,21988300	3.919,75746100	2,789006	78.395.149,22	80.306.264,56	4,00%
NTNB20240815 - 760199	15/08/2024	14/05/2021	0	30.000	3.919,21988300	3.919,75746100	2,789006	117.592.723,83	120.459.396,84	5,99%
NTNB20280815 - 760199	15/08/2028	06/06/2019	0	20.000	3.820,89142600	4.065,36727500	3,819000	81.307.345,50	82.690.032,54	4,14%
NTNB20280815 - 760199	15/08/2028	06/06/2019	0	30.000	3.820,89142600	4.065,36727500	3,819000	121.961.018,25	124.035.048,81	6,22%
NTNB20280815 - 760199	15/08/2028	06/06/2019	0	20.000	3.820,89142600	4.065,36727500	3,819000	81.307.345,50	82.690.032,54	4,14%
<b>Total NTN-PÓS:</b>			20.000	500.000				1.961.867.465,16	2.000.445.494,27	100,00%
<b>Total Títulos Públicos:</b>				500.000				<b>R\$ 1.961.867.465,16</b>	<b>R\$ 2.000.445.494,27</b>	<b>100,0%</b>



## 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
3,03	2,92	2,92%	-R\$ 57.204.783,46	-R\$ 5.720,48	20,99 anos

## Conceitos de Avaliação de Risco

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

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

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

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

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

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

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

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

## Rentabilidade e Risco Renda Fixa

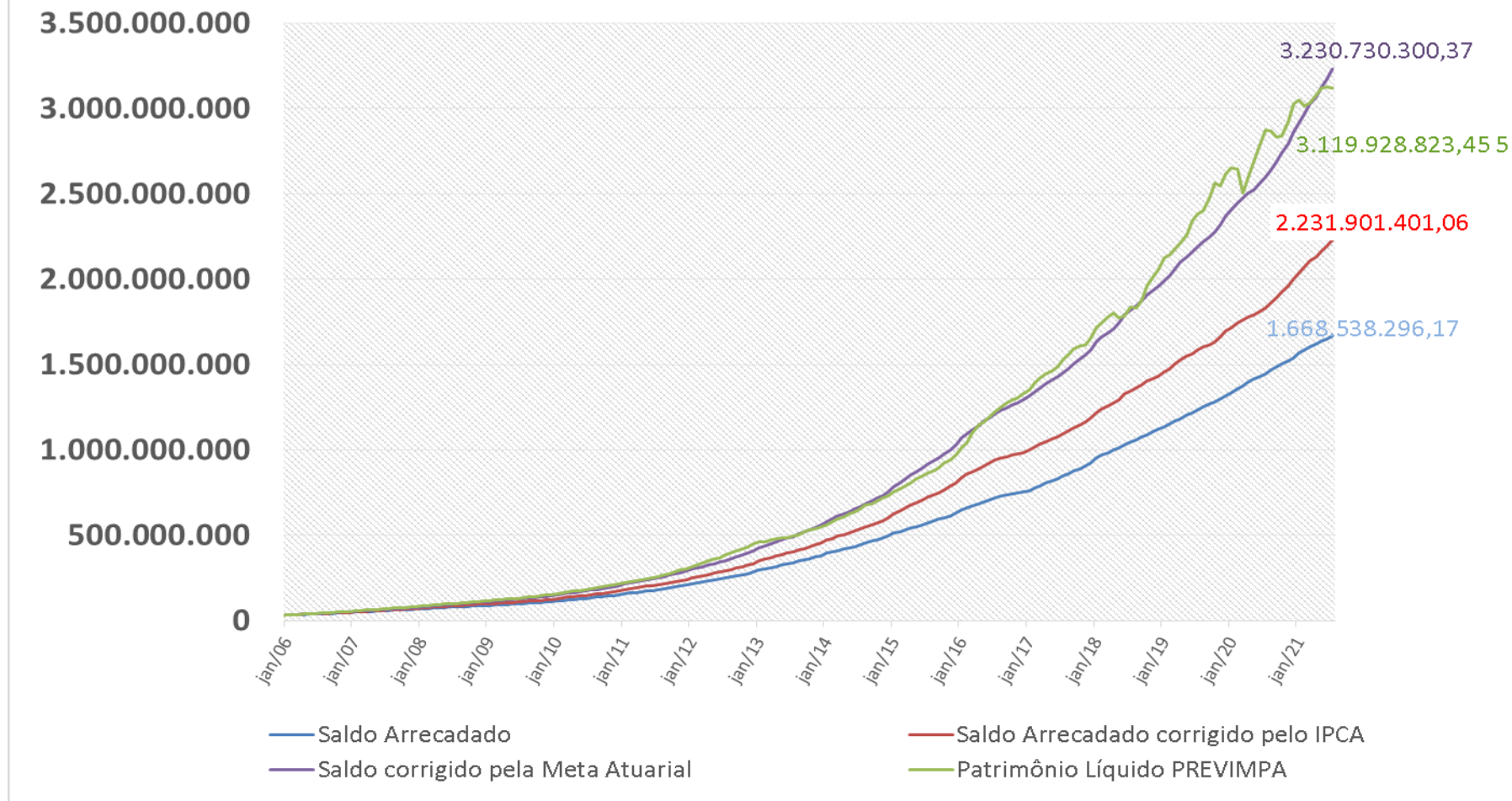
Títulos Públicos	1 mês	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	No ano
<b>BENCHMARK IMA EX-G</b>	-0,10	0,72	0,00	0,96	8,10	-0,44
Títulos Públicos da carteira Previmpa	-0,2097	0,2222	-1,9094	-2,1511	9,0333	-3,1227

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>0,36</b>	<b>0,94</b>	<b>1,49</b>	<b>2,44</b>	<b>6,76</b>	<b>1,64</b>					
Caixa FIC Brasil Disponibilidades RF	0,26	0,69	1,03	1,56	4,95	1,11	0,00%	0,05%	-1605,49%	-120,40	0,00
BB Prev RF Fluxo Fc FI	0,25	0,66	0,93	1,30	4,47	1,01	0,00%	0,15%	-940,81%	-7,82	0,00
Banrisul Automatico FI RF CP	0,17	0,47	0,62	0,74	1,51	0,64	0,00%	0,05%	-1602,12%	-136,42	0,00
<b>BENCHMARK IMA B 5</b>	<b>0,03</b>	<b>0,59</b>	<b>1,21</b>	<b>5,06</b>	<b>14,34</b>	<b>1,31</b>					
FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	0,01	0,53	1,08	4,77	13,71	1,17	0,21%	2,56%	131,19%	0,91	0,09
<b>BENCHMARK IDKA 2A</b>	<b>-0,18</b>	<b>0,38</b>	<b>1,54</b>	<b>5,88</b>	<b>15,07</b>	<b>1,68</b>					
Caixa FI Brasil Idka IPCA 2a RF LP	-0,06	0,50	1,36	5,46	14,00	1,50	0,20%	2,49%	171,69%	1,17	0,08
BB Prev RF Idka 2 FI	0,08	0,66	1,32	5,61	14,05	1,50	0,19%	2,34%	198,39%	1,33	0,07
Banrisul Foco Idka IPCA 2a FI RF	-0,07	0,46	1,08	4,77	13,34	1,16	0,20%	2,44%	135,22%	0,93	0,08

## Rentabilidade e Risco Renda Variável

Código	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
IBOV	<b>BENCHMARK IBOVESPA</b>	<b>-3,94</b>	<b>2,44</b>	<b>5,85</b>	<b>18,35</b>	<b>19,63</b>	<b>2,34</b>					
bov11	It Now Ibov	-3,94	2,64	6,07	18,31	19,81	2,43	1,93%	21,56%	105,79%	0,75	1,01
bovA11	Ishares Bova Ci	-3,86	2,37	5,92	17,95	19,52	2,15	2,02%	21,77%	103,44%	0,73	1,00
divo11	It Now Idiv	-2,16	0,78	5,68	14,29	18,31	0,12	1,50%	18,75%	98,32%	0,68	0,99
smal11	Ishares Smal Ci	-5,47	0,93	9,08	20,17	28,62	4,80	1,94%	23,72%	107,79%	0,76	0,99
FIND11	It Now Ifnc Fundo de Indice	-3,81	2,50	2,07	8,15	-1,26	-4,12	1,79%	26,24%	38,38%	0,26	1,26
537969	Itau Asgard Institucional Acoes FI	-5,02	-0,77	-1,38	24,36	N.A	0,48	1,62%	18,40%	176,28%	1,18	0,65
500909	Caixa FIC FIA Acoes Multigestor	-4,81	1,63	5,36	11,43	21,62	2,64	1,64%	18,53%	72,70%	0,52	0,84
252311	BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	-4,57	0,17	0,31	8,25	22,05	-0,31	1,92%	20,43%	44,10%	0,30	0,56
350095	Banestes FICFI Acoes BTG Absol. Inst	-4,56	0,17	0,30	8,18	21,89	-0,31	1,91%	20,34%	43,68%	0,30	0,56
195766	BB Acoes Retorno Total Fc	-4,45	-2,22	11,50	18,84	30,73	7,96	1,86%	20,24%	115,37%	0,81	0,82
250007	BB Acoes Tecnologia Bdr Nivel I FI	1,95	3,44	8,43	30,16	72,03	14,28	1,41%	18,01%	238,04%	1,67	0,16
104213	BB Acoes Exportacao Fc FI	-2,57	0,49	19,99	49,63	59,80	18,88	1,95%	20,11%	351,75%	2,32	0,57
246700	Caixa FIA Infraestrutura	-3,09	1,11	3,61	9,76	17,76	-0,66	1,88%	21,87%	65,49%	0,46	0,96
462934	Austro Institucional Pipe Bancos FIC FIA	-6,17	-0,88	-7,82	-24,54	-71,91	-22,30	13,53%	28,89%	-121,53%	-0,89	0,51

### Patrimônio Financeiro Líquido Regime Capitalizado (Janeiro de 2006 a Julho 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 Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Brasil Disponibilidades RF	14.508.643/0001-55	0,80%	Não há	D+0	D+0	Não há	18:00
			Caixa IMAB 5 RF LP	11.060.913/0001-10	0,20%	Não há	D+0	D+0	Não há	16:00
			Caixa IRFM-1 RF LP	10.740.670/0001-06	0,20%	Não há	D+0	D+0	Não há	17:00
			Caixa IDKA IPCA RF LP	14.386.926/0001-71	0,20%	Não há	D+0	D+0	Não há	16:00
BB Gestão de Recursos DTVM	BB Gestão de Recursos DTVM	Banco do Brasil	BB RPPS RF Fluxo	13.077.415/0001-05	1,00%	Não há	D+0 Abertura	D+0	Não há	23:00
			BB PREV IRFM-1	11.328.882/0001-35	0,30%	Não há	D+0	D+0	Não há	15:00
			BB PREV IDKA 2A	13.322.205/0001-35	0,20%	Não há	D+0	D+1	Não há	15:00
Banco do Estado do Rio Grande do Sul	Banrisul Corretora	Banrisul Corretora	Banrisul Foco IDKA 2A	21.007.180/0001-03	0,20%	Não há	D+0	D+1	Não há	15:00
			Banrisul Automático FI RF CP	01.353.260/0001-03	1,60%	Não há	D+0	D+0	Não há	17:30
<b>Renda Variável</b>										
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	Caixa Institucional BDR I	17.502.937/0001-68	0,70%	Não há	D+1	D+1	Não há	17:00
			Caixa FI Ações Infraestrutura	10.551.382/0001-03	2,00%	Não há	D+1	D+3	Não há	17:00
			Caixa FIC FIA Ações Multigestor	30.068.224/0001-04	1,50%	Não há	D+1	D+3	Não há	13:00
BB Gestão de Recursos DTVM	BB Gestão de	Banco do Brasil	BB Ações Retorno Total	09.005.805/0001-00	1,00%	Não há	D+1	D+3	Não há	17:00
			BB Acoes Exportacao Fc FI	05.100.213/0001-09	2,00%	Não há	D+1	D+3	Não há	17:00
			BB Acoes Energia FI	02.020.528/0001-58	2,00%	Não há	D+1	D+3	Não há	17:00
			BB Ações Tecnologia	01.578.474/0001-88	2,00%	Não há	D+1	D+3	Não há	17:00
ITAÚ UNIBANCO S.A.	ITAÚ UNIBANCO S.A.	ITAÚ UNIBANCO S.A.	Itaú Ações Asgard Instit. FICFIA	35.495.250/0001-24	2,00%	Não há	D+0	D+23	Não há	16:00
BFL INVESTIMENTOS DE RECURSOS LTDA	Austro Capital	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	Austro Pipe Bancos	28.319.463/0001-30	0,40%	6,00% do que exceder (IPCA + 6,00% a.a.)	D+1	D+30	30/04/2021	13:00
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS S.A.	BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM	Banco BTG PACTUAL	BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	11.977.794/0001-64	3,00%	Não há	D+1	D+32	Não há	15:30
ITAÚ UNIBANCO S.A.	ITAÚ UNIBANCO S.A.	Banrisul Corretora	ETF FIND 11	11.961.094/0001-81	0,60%	Não há	D+2	D+2	Não há	17:00
			ETF DIVO 11	13.416.245/0001-46	0,50%	Não há	D+2	D+2	Não há	17:00
			ETF BOVV 11	21.407.758/0001-19	0,30%	Não há	D+2	D+2	Não há	17:00
BNB Paribas	Black Rock	Banrisul Corretora	ETF BOVA 11	10.406.511/0001-61	0,30%	Não há	D+2	D+2	Não há	17:00
			ETF SMAL 11	10.406.600/0001-08	0,69%	Não há	D+2	D+2	Não há	17:00
BANCO SANTANDER BRASIL S.A.	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS	SANTANDER CACEIS BRASIL DISTRIBUIDORA	Santander Global Equities Dolar	17.804.792/0001-50	1,00%	Não há	D+1	D+8	Não há	12:00
BANESTES SA BANCO DO ESTADO DO ESPIRITO SANTO	BANESTES DTVM SA	BANESTES SA BANCO DO ESTADO DO ESPIRITO SANTO	Banestes BTG Absoluto FIC FIA	08.018.849/0001-02	3,00%	Não há	D+1	D+30	Não há	15:00