

Relatório de Resultados dos Investimentos do PREVIMPA

Competência: Setembro/2020



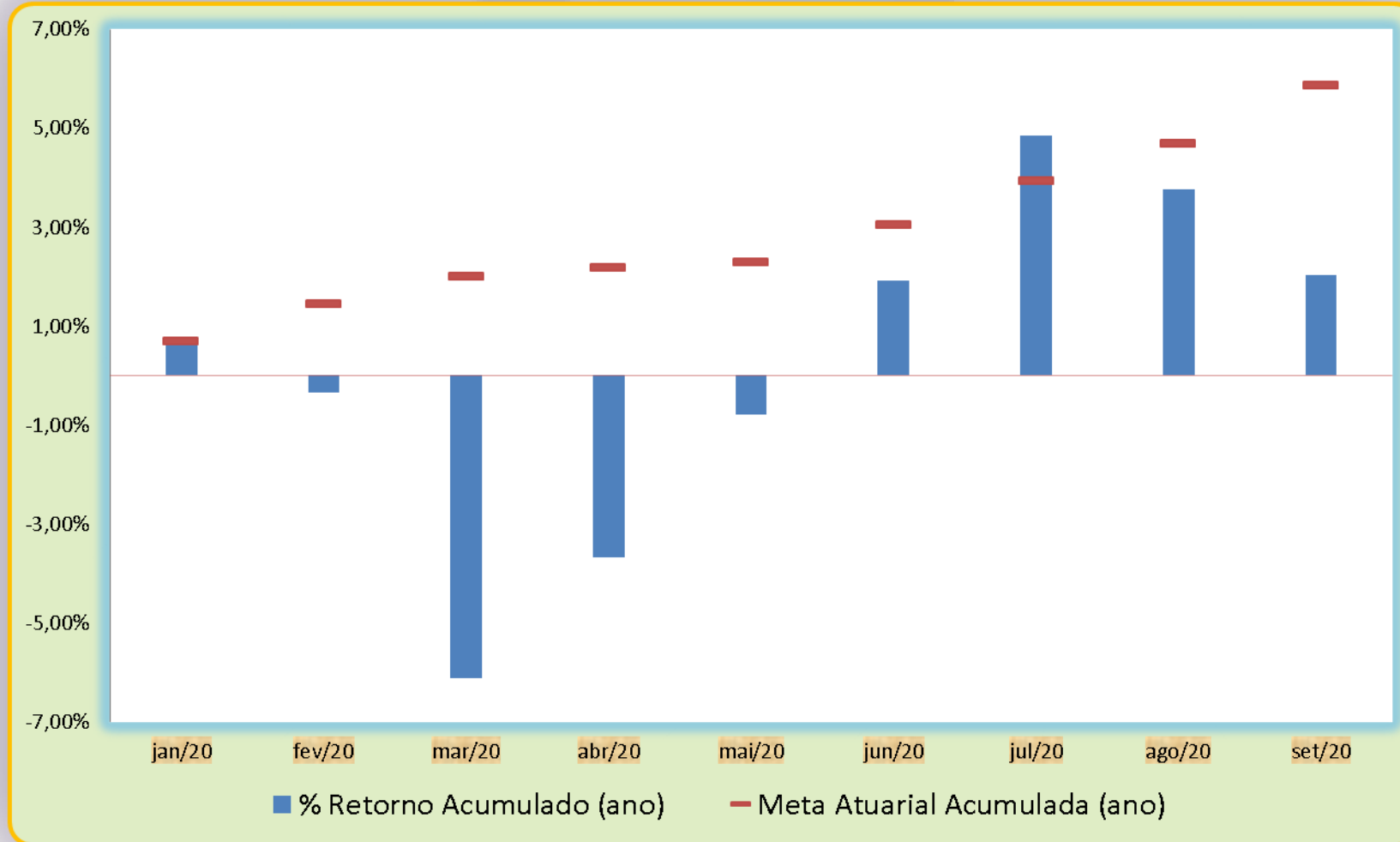
Performance do Fundo Previmpa Capitalizado

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	% Retorno Acumulado (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	R\$ 2.879.701.254,54	R\$ 30.863.142,10	R\$ 8.050.158,79	R\$ 22.812.983,31	R\$ 150.922.354,46	R\$ 2.873.645.681,77	-R\$ 28.868.556,08	R\$ 101.374.911,15	-0,9985%	3,76%
set/20	R\$ 2.873.645.681,77	R\$ 63.017.881,21	R\$ 46.773.257,37	R\$ 16.244.623,84	R\$ 167.166.978,30	R\$ 2.843.627.836,37	-R\$ 46.262.469,24	R\$ 55.112.441,91	-1,6054%	2,04%
out/20										
nov/20										
dez/20										
TOTAL ANO	R\$ 2.621.348.416,16	R\$ 1.636.395.771,54	R\$ 1.469.228.793,24	R\$ 167.166.978,30		R\$ 2.843.627.836,37	R\$ 55.112.441,91			2,04%

Indicadores de Performance do Fundo Capitalizado: 2020

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%
0,24%	0,70%	0,73%	4,69%	ago/20	9,93%	8,57%	115,83%
0,64%	1,34%	1,13%	5,87%	set/20	5,47%	9,31%	58,75%
				out/20			
				nov/20			
				dez/20			
	1,34%		4,69%				





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	Meta Anual	IPCA
2020	R\$ 2.621.348.416,16	R\$ 1.636.395.771,54	R\$ 1.469.228.793,24	R\$ 167.166.978,30	R\$ 2.843.627.836,37	R\$ 55.112.441,91	2,04%	5,87%	1,34%
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



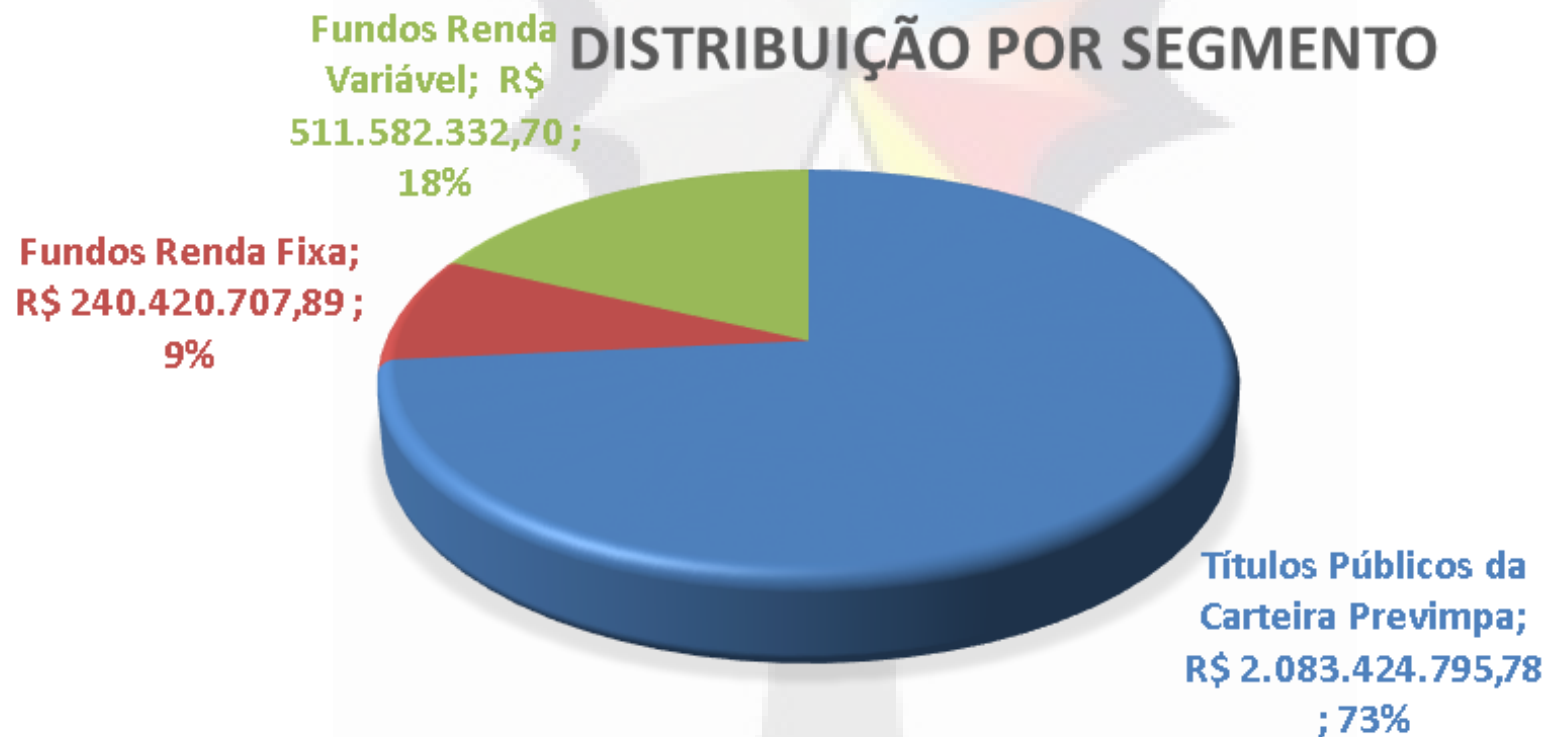
Conta	Títulos Públicos da Carteira Previmpa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
	Títulos Públicos Federais	2.106.450.487,67			2.083.424.795,78	-R\$ 23.025.691,89	-1,09%
Conta	Fundos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
702-5	Caixa FI Brasil Disponibilidades RF	R\$ 50.551,70		R\$ 8.126,00	R\$ 42.464,24	R\$ 38,54	0,08%
702-5	Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF	R\$ 3.030.078,27			R\$ 3.014.832,17	-R\$ 15.246,10	-0,50%
702-5	Caixa FI Brasil Idka IPCA 2a RF LP	R\$ 92.434.961,65	17.769.299,09	R\$ 1.000.000,00	R\$ 109.166.194,64	-R\$ 38.066,10	-0,04%
73.339-3	BB Prev RF Fluxo Fc FI	R\$ 52.797,65	R\$ 1.934.953,15	R\$ 451.502,40	R\$ 1.536.199,09	-R\$ 49,31	-0,01%
73.339-3	BB Prev RF Idka 2 FI	R\$ 59.531.588,13		R\$ 2.000.000,00	R\$ 57.601.671,41	R\$ 70.083,28	0,12%
95756.0-2	Banrisul Foco Idka IPCA 2a FI RF	R\$ 18.749.146,21	R\$ 40.313.628,97	R\$ 3.000.000,00	R\$ 55.876.354,48	-R\$ 186.420,70	-0,50%
40957560-2	Mirae Fixa	R\$ 13.353.030,45			R\$ 13.182.991,86	-R\$ 170.038,59	-1,27%
TOTAL DOS FUNDO DE RENDA FIXA		R\$ 187.202.154,06	R\$ 60.017.881,21	R\$ 6.459.628,40	R\$ 240.420.707,89	-R\$ 339.698,98	-0,16%
TOTAL DA RENDA FIXA		R\$ 2.293.652.641,73	R\$ 60.017.881,21	R\$ 6.459.628,40	R\$ 2.323.845.503,67	-R\$ 23.365.390,87	-1,01%



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\$ 11.763.693,53			R\$ 11.711.136,89	-R\$ 52.556,64	-0,45%
702-5	Caixa FIA Institucional Bdr Nivel I	R\$ 143.308.152,75			R\$ 140.450.179,90	-R\$ 2.857.972,85	-1,99%
702-5	Caixa FIA Infraestrutura	R\$ 16.695.916,11			R\$ 15.830.824,18	-R\$ 865.091,93	-5,18%
702-5	Caixa FIC FIA Acoes Multigestor	R\$ 68.561.783,78			R\$ 64.874.741,53	-R\$ 3.687.042,25	-5,38%
73.339-3	BB Acoes Alocao FIA	R\$ 25.403.270,88			R\$ 24.291.039,71	-R\$ 1.112.231,17	-4,38%
73.339-3	BB Acoes Retorno Total Fc	R\$ 16.398.279,91			R\$ 15.512.656,45	-R\$ 885.623,46	-5,40%
73.339-3	BB Acoes Tecnologia Bdr Nivel I FI	R\$ 20.705.231,95			R\$ 19.511.764,59	-R\$ 1.193.467,36	-5,76%
	Austro Institucional Pipe Bancos FIC FIA	R\$ 3.490.546,24			R\$ 3.748.184,38	R\$ 257.638,14	7,38%
40957560-2	It Now Ibov	R\$ 65.474.500,00			R\$ 61.873.500,00	-R\$ 3.601.000,00	-5,50%
40957560-2	It Now Idiv	R\$ 29.315.901,80		R\$ 12.673.150,55	R\$ 15.561.098,40	-R\$ 1.081.652,85	-4,71%
40957560-2	Ishares Smal Ci	R\$ 50.964.593,40		R\$ 27.640.478,42	R\$ 21.981.387,00	-R\$ 1.342.727,98	-3,61%
40957560-2	Ishares Bova Ci	R\$ 101.535.000,00			R\$ 95.707.500,00	-R\$ 5.827.500,00	-5,74%
29.921.251	Banestes FICFI Acoes BTG Absol. Inst	R\$ 18.176.169,69	R\$ 3.000.000,00		R\$ 20.528.319,67	-R\$ 647.850,02	-3,29%
TOTAL RENDA VARIÁVEL		R\$ 571.793.040,04	R\$ 3.000.000,00	R\$ 40.313.628,97	R\$ 511.582.332,70	-R\$ 22.897.078,37	-4,14%
RENTABILIDADE FINANCEIRA DO REGIME CAPITALIZADO		R\$ 2.865.445.681,77	R\$ 63.017.881,21	R\$ 46.773.257,37	R\$ 2.835.427.836,37	-R\$ 46.262.469,24	-1,61%
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\$ 2.873.645.681,77	R\$ 63.017.881,21	R\$ 46.773.257,37	R\$ 2.843.627.836,37	-R\$ 46.262.469,24	-1,61%





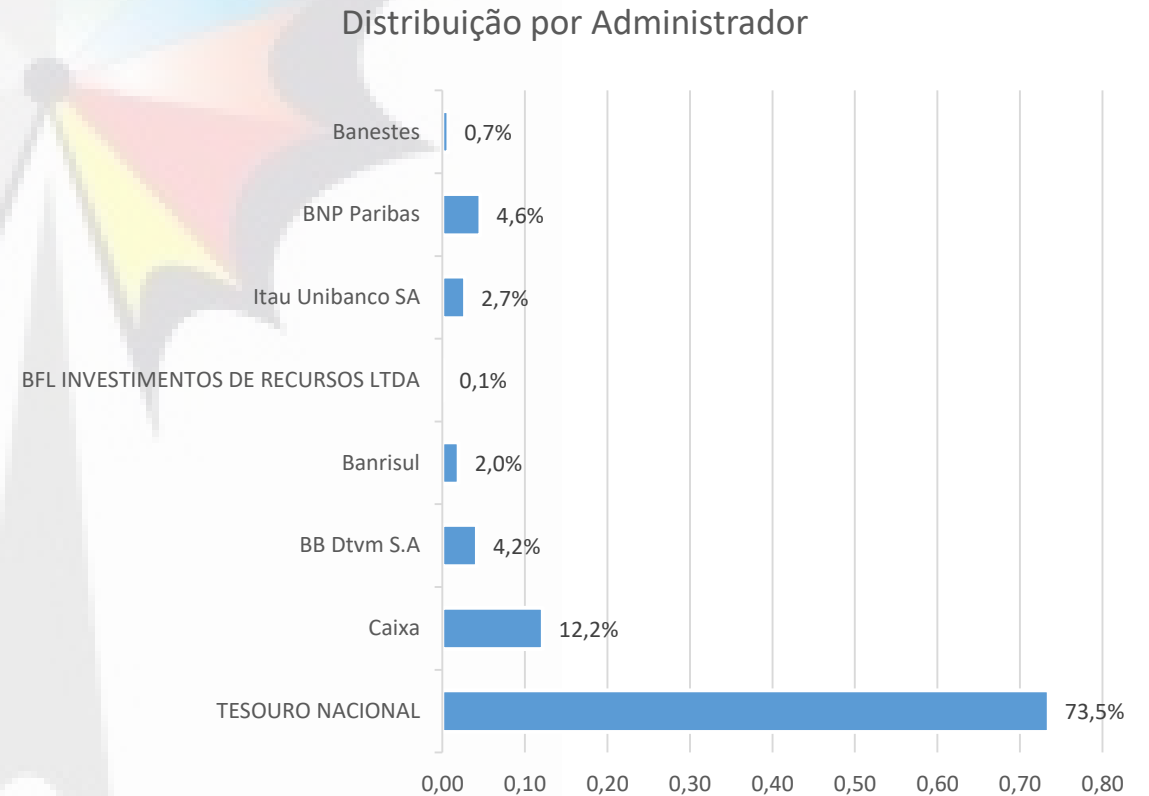
Movimentações: Outras Contas



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\$ 5.887.557,89		R\$ 1.485.154,67	R\$ 4.404.708,76	R\$ 2.305,54	0,04%
73.342-3	COMPREV - BB Prev RF IDKA2	R\$ 2.152.471,77	R\$ 1.097.867,29		R\$ 3.250.433,28	R\$ 94,22	0,00%
73.334-2	FUNDO PREVIDENCIA - BB Previd RF Fluxo	R\$ 205.219,63	R\$ 7.530,84	R\$ 36.237,05	R\$ 176.513,67	R\$ 0,25	0,00%
703-3	REPARTIÇÃO SIMPLES - Caixa Disponibilidades RF	R\$ 8.942.857,11	R\$ 3.990.771,41	R\$ 3.624.780,00	R\$ 9.316.166,38	R\$ 7.317,86	0,08%
704-1	GRATIFICACAO NAT - Caixa IRFM-1	R\$ 491.896,83	R\$ 71.620,00		R\$ 564.253,91	R\$ 737,08	0,14%
704-1	TAXA ADM - Caixa Disponibilidades	R\$ 13.057,71		R\$ 3.407,91	R\$ 9.660,99	R\$ 11,19	0,10%
73.360-1	TAXA ADM - BB Prev RF IRFM-1	R\$ 7.962.114,29			R\$ 7.965.518,24	R\$ 3.403,95	0,04%
73.360-1	TAXA ADM - BB Previd RF Fluxo	R\$ 7.862.593,04	R\$ 2.234.935,37	R\$ 834.942,17	R\$ 9.262.477,69	-R\$ 108,55	0,00%
73.360-1	TAXA ADM - BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 3.612.391,88			R\$ 3.616.514,00	R\$ 4.122,12	0,11%
73.400-4	FRAP - BB Previd RF Fluxo	R\$ 764.433,52	R\$ 36.878,48	R\$ 7.299,15	R\$ 794.006,20	-R\$ 6,65	0,00%
420.000-4	ADIANTAMENTO - BB Previd RF Fluxo	R\$ 5,44	R\$ 1.000,00	R\$ 132,02	R\$ 873,25	-R\$ 0,17	-0,04%
	Conta Corrente	R\$ 2.726,19	R\$ 11.649,19		R\$ 14.375,38		0,00%
TOTAL TAXA ADM E REPARTIÇÃO SIMPLES		R\$ 37.897.325,30	R\$ 7.452.252,58	R\$ 5.991.952,97	R\$ 39.375.501,75	R\$ 17.876,84	0,05%
RENTABILIDADE CONSOLIDADA DO PREVIMPA		R\$ 2.911.543.007,07	R\$ 70.470.133,79	R\$ 52.765.210,34	R\$ 2.883.003.338,12	-R\$ 46.244.592,40	-1,58%

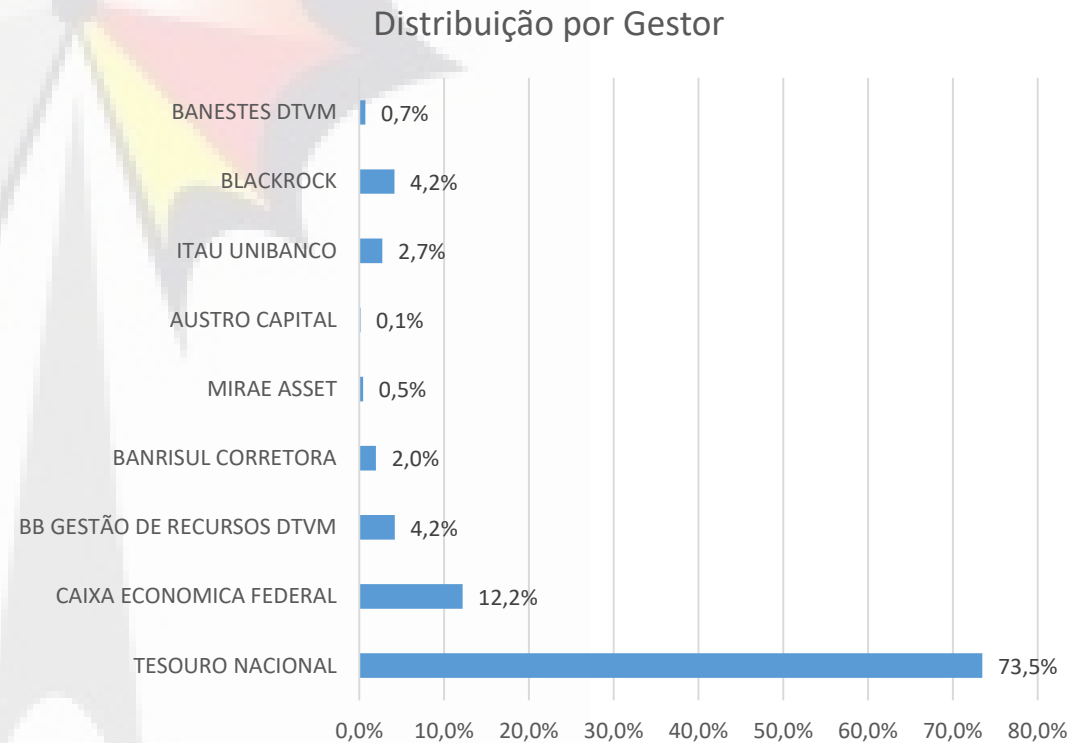
Distribuição por Administrador

Administrador	Valor por Adm	Distribuição por Administrador
TESOURO NACIONAL	R\$ 2.083.424.795,78	73,5%
Caixa	R\$ 345.090.373,55	12,2%
BB Dtvn S.A	R\$ 118.453.331,25	4,2%
Banrisul	R\$ 55.876.354,48	2,0%
BFL INVESTIMENTOS DE RECURSOS LTDA	R\$ 3.748.184,38	0,1%
Itau Unibanco SA	R\$ 77.434.598,40	2,7%
BNP Paribas	R\$ 130.871.878,86	4,6%
Banestes	R\$ 20.528.319,67	0,7%



Distribuição por Gestor

Gestor	Valor por Gestor	Distribuição por Gestor
TESOURO NACIONAL	2.083.424.795,78	73,5%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	345.090.373,55	12,2%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	118.453.331,25	4,2%
BANRISUL CORRETORA	55.876.354,48	2,0%
MIRAE ASSET	13.182.991,86	0,5%
AUSTRO CAPITAL	3.748.184,38	0,1%
ITAU UNIBANCO	77.434.598,40	2,7%
BLACKROCK	117.688.887,00	4,2%
BANESTES DTVM	20.528.319,67	0,7%





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	2.083.424.795,78			Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100%	100%	70%	2.083.424.795,78	73,48%

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	3.014.832,17	13.535.810.678,86	0,02%						
Caixa FI Brasil Idka IPCA 2a RF LP	109.166.194,64	9.208.011.978,56	1,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100%	100%	2%	225.659.052,70	7,96%
BB Prev RF Idka 2 FI	57.601.671,41	7.070.754.781,93	0,81%						
Banrisul Foco Idka IPCA 2a FI RF	55.876.354,48	949.554.776,68	5,88%						
Mirae Fixa	13.182.991,86	172.290.552,30	7,65%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'b'	40%	40%	0%	13.182.991,86	0,46%
Caixa FI Brasil Disponibilidades RF	42.464,24	480.823.075,37	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40%	40%	1%	1.578.663,33	0,06%
BB Prev RF Fluxo Fc FI	1.536.199,09	1.878.414.583,86	0,08%						



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	61.873.500,00	4.443.777.862,86	1,39%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30%	30%	6%	179.562.387,00	6,33%
Ishares Smal Ci	21.981.387,00	1.525.605.306,65	1,44%						
Ishares Bova Ci	95.707.500,00	11.654.084.408,50	0,82%						
Caixa FIA Infraestrutura	15.830.824,18	496.563.544,01	3,19%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20%	20%	6%	164.297.530,51	5,79%
Caixa FIC FIA Acoes Multigestor	64.874.741,53	829.848.817,55	7,82%						
BB Acoes Alocao FIA	24.291.039,71	406.655.961,35	5,97%						
BB Acoes Retorno Total Fc	15.512.656,45	1.166.738.485,17	1,33%						
BB Acoes Tecnologia Bdr Nivel I FI	19.511.764,59	629.107.276,18	3,10%						
Banestes FICFI Acoes BTG Absol. Inst	20.528.319,67	157.034.448,33	13,07%						
Austro Institucional Pipe Bancos FIC FIA	3.748.184,38	30.009.746,39	12,49%						
It Now Idiv	15.561.098,40	276.232.255,33	5,63%						
Caixa FIC Cap Prot Bolsa de Valores Mult	11.711.136,89	505.717.833,93	2,32%	Artigo 8º, Inciso III	10%	10%	2%	11.711.136,89	0,41%
Caixa FIA Institucional Bdr Nivel I	140.450.179,90	1.671.279.124,17	8,40%	Artigo 9º - A, Inciso III	10%	10%	1%	140.450.179,90	4,95%

*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. 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	962,51545800	8,799000	77.001.236,64	71.996.081,04	3,70%
LTN20220101 - 100000	01/01/2022	09/04/2018	200.000	732,97834600	962,51545800	8,694000	192.503.091,60	180.207.570,40	9,24%
LTN20220401 - 100000	01/04/2022	07/02/2020	160.000	898,51867100	949,42456700	5,140000	151.907.930,72	148.441.182,08	7,29%
LTN20220701 - 100000	01/07/2022	26/06/2019	120.000	825,38325200	935,28347100	6,579000	112.234.016,52	107.392.880,16	5,39%
LTN20230701 - 100000	01/07/2023	14/06/2019	190.000	753,63622400	867,15722100	7,260000	164.759.871,98	156.823.818,80	7,91%
LTN20240101 - 100000	01/01/2024	03/01/2020	200.000	787,45838900	829,63409200	6,200000	165.926.818,40	164.641.756,60	7,96%
Total LTN:			950.000				864.332.965,86	829.503.289,08	41,49%
NTN-PÓS									
NTNB20280815 - 760199	15/08/2028	06/06/2019	20.000	3.820,89142600	4.023,16336400	3,819000	80.463.267,28	76.352.122,40	3,86%
NTNB20280815 - 760199	15/08/2028	06/06/2019	20.000	3.820,89142600	4.023,16336400	3,819000	80.463.267,28	76.352.122,40	3,86%
NTNB20280815 - 760199	15/08/2028	06/06/2019	30.000	3.820,89142600	4.023,16336400	3,819000	120.694.900,92	114.528.183,60	5,79%
Total NTN-PÓS:			70.000				281.621.435,48	267.232.428,40	13,52%



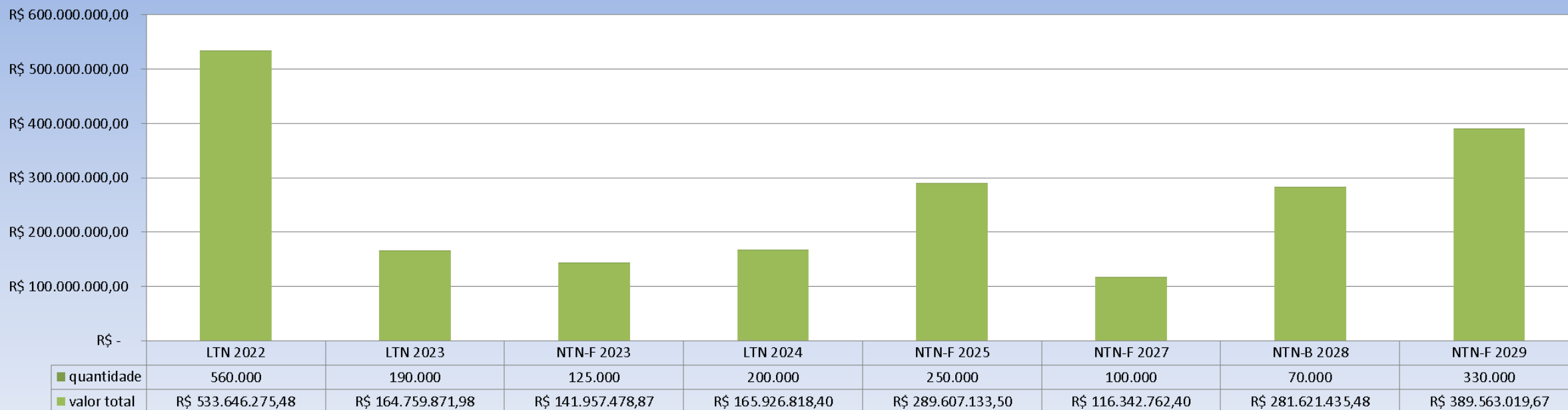
Carteira de Títulos Públicos



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	1.135,65983100	9,429000	28.391.495,77	25.853.722,75	1,36%
NTNF20230101 - 950199	01/01/2023	13/10/2017	50.000	1.052,64080900	1.135,65983100	9,400000	56.782.991,55	51.732.057,55	2,73%
NTNF20230101 - 950199	01/01/2023	17/10/2017	50.000	1.051,66190700	1.135,65983100	9,444000	56.782.991,55	51.695.389,80	2,73%
NTNF20250101 - 950199	01/01/2025	13/10/2017	60.000	1.049,13298400	1.158,42853400	9,604000	69.505.712,04	62.195.901,18	3,34%
NTNF20250101 - 950199	01/01/2025	14/11/2018	140.000	1.038,99625800	1.158,42853400	9,959000	162.179.994,76	143.654.775,46	7,78%
NTNF20250101 - 950199	01/01/2025	14/11/2018	50.000	1.037,69901300	1.158,42853400	9,989000	57.921.426,70	51.260.319,95	2,78%
NTNF20270101 - 950199	01/01/2027	20/05/2019	100.000	1.092,53252800	1.163,42762400	8,949000	116.342.762,40	106.921.117,20	5,58%
NTNF20290101 - 950199	01/01/2029	20/05/2019	50.000	1.094,98101100	1.180,49399900	9,069000	59.024.699,95	53.670.569,95	2,83%
NTNF20290101 - 950199	01/01/2029	01/08/2019	60.000	1.192,01765100	1.180,49399900	7,199000	70.829.639,94	2.657.069,16	3,40%
NTNF20290101 - 950199	01/01/2029	08/11/2019	140.000	1.257,99416700	1.180,49399900	6,619000	165.269.159,86	172.285.184,68	7,93%
NTNF20290101 - 950199	01/01/2029	12/11/2019	10.000	1.254,15538900	1.180,49399900	6,679000	11.804.939,99	12.264.969,30	0,57%
NTNF20290101 - 950199	01/01/2029	08/07/2020	20000	1.218,63214500	1.180,49399900	6,529000	23.609.879,98	24.736.234,56	1,13%
NTNF20290101 - 950199	01/01/2029	08/07/2020	50000	1.218,63214500	1.180,49399900	6,529000	59.024.699,95	61.840.586,40	2,83%
Total NTN-PRÉ:			805.000				937.470.394,44	820.767.897,94	45,00%
Total Títulos Públicos:			1.825.000				R\$ 2.083.424.795,78	R\$ 1.917.503.615,42	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)
3,71	3,51	3,51%	-R\$ 73.202.901,06	-R\$ 7.320,29

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



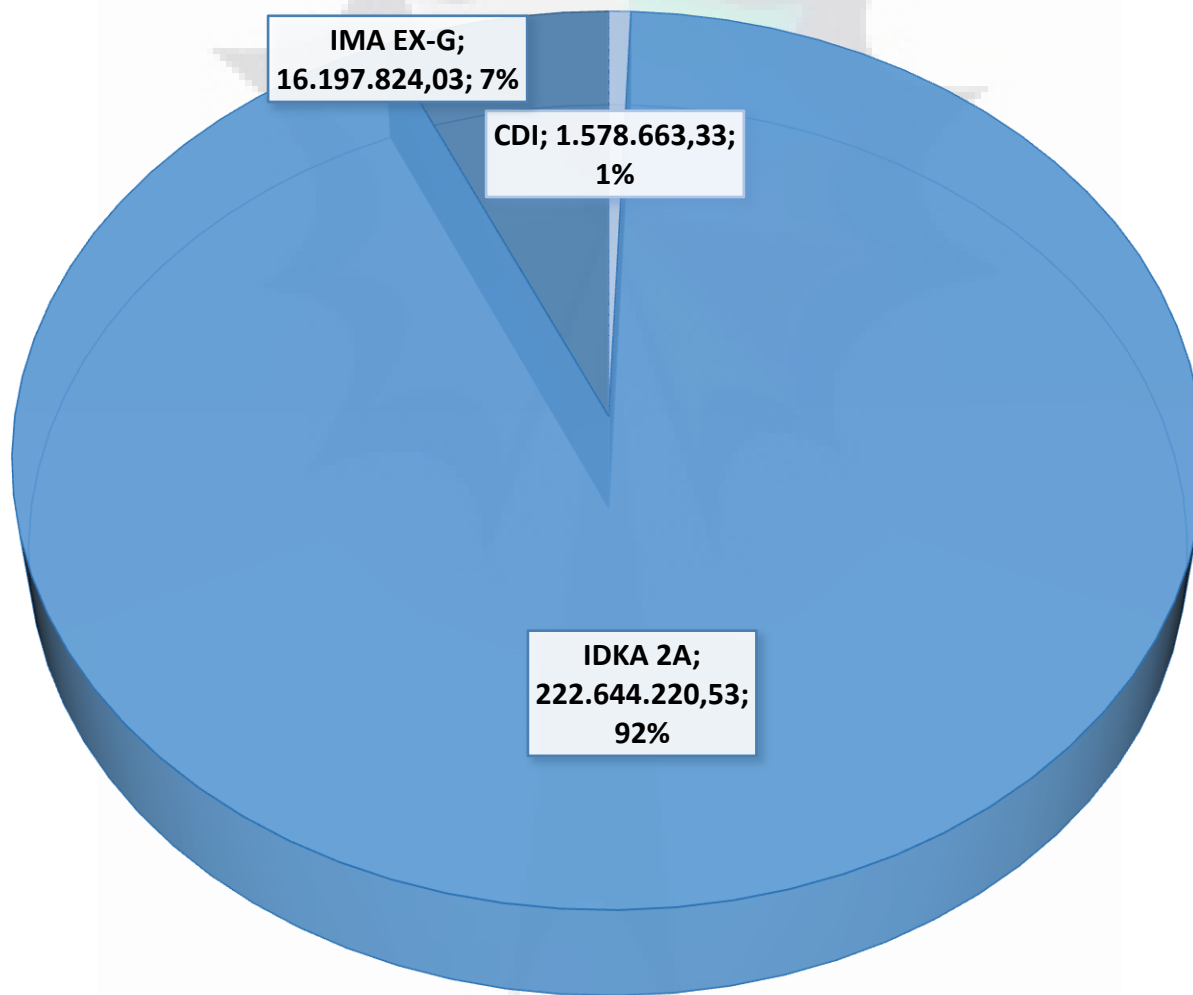
Fundos de Renda fixa	1 mês	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	No ano	VaR 95% 1 M	Volatilid ade	Sortino 12M	Sharpe 12M	Beta 12M
BENCHMARK CDI	0,16	0,51	1,25	3,54	10,04	2,28					
Caixa FI Brasil Disponibilidades RF	0,09	0,29	0,83	2,68	8,21	1,64	0,00%	0,07%	-1627,67%	-150,34	0,00
BB Prev RF Fluxo Fc FI	0,00	0,18	0,66	2,40	7,66	1,42	0,01%	0,08%	-1538,18%	-43,94	0,00
BENCHMARK IDKA 2A	0,02	1,99	5,41	8,00	21,88	5,41					
Caixa FI Brasil Idka IPCA 2a RF LP	0,04	1,66	5,27	7,35	20,53	4,84	0,29%	4,07%	114,48%	0,93	0,06
BB Prev RF Idka 2 FI	0,11	1,61	5,24	7,28	20,27	4,55	0,29%	4,16%	110,18%	0,89	0,06
Banrisul Foco Idka IPCA 2a FI RF	-0,05	1,48	5,06	7,15	20,53	4,74	0,30%	4,32%	102,38%	0,83	0,06
BENCHMARK IMA EX-G	-0,71	0,25	2,99	3,90	21,11	1,96					
Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF	-0,50	-0,09	3,18	6,41	25,88	4,53	0,36%	5,94%	66,27%	0,50	0,03
Mirae Fixa	-1,27	-0,98	3,37	8,12	N.A.	5,86	0,57%	8,63%	78,98%	0,57	0,03



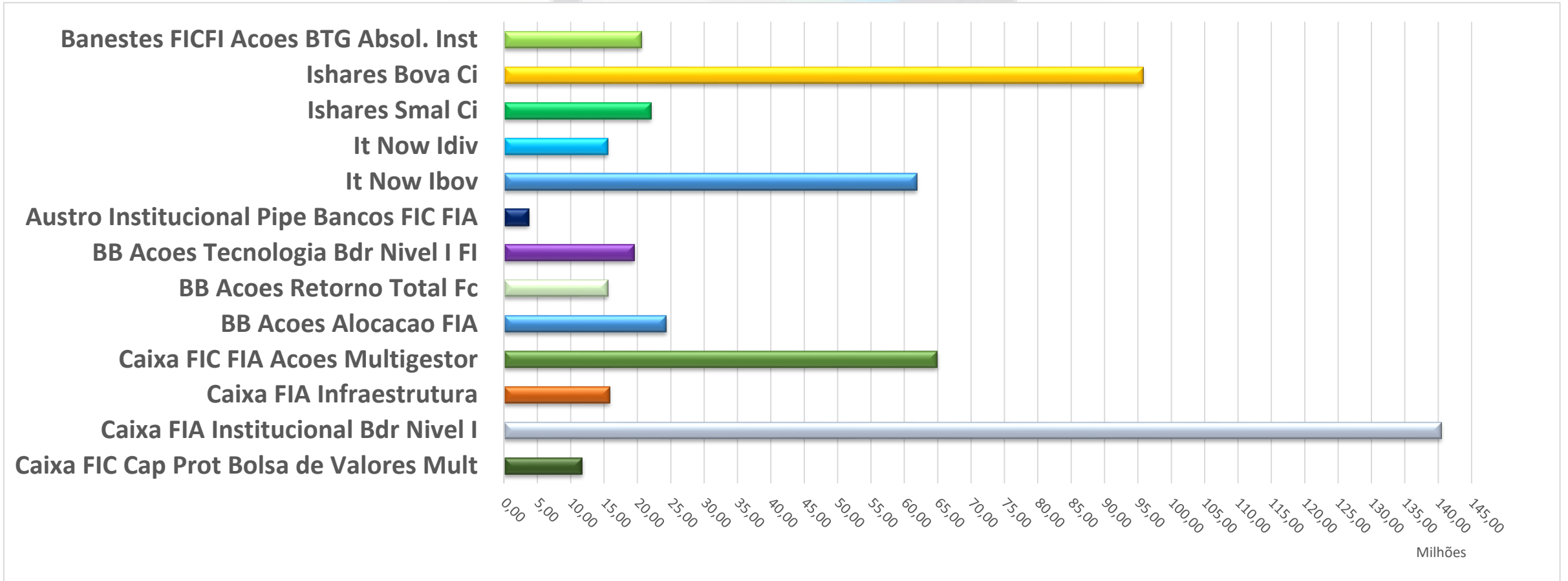
Rentabilidade e Risco Renda Variável

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
BENCHMARK IBOVESPA	-4,80	-0,48	29,56	-9,68	19,23	-18,20					
Caixa FIC Cap Prot Bolsa de Valores Mult	-0,45	-0,37	0,25	2,97	N.A.	1,41	0,04%	1,73%	-38,11%	-0,31	-0,01
Caixa FIA Infraestrutura	-5,18	-0,85	30,77	-5,21	60,72	-16,85	2,37%	46,88%	5,85%	0,04	1,05
Caixa FIC FIA Acoes Multigestor	-5,38	-0,22	32,92	-2,46	N.A.	-14,85	2,03%	44,47%	11,49%	0,09	1,09
BB Acoes Alocao FIA	-4,38	-0,62	27,14	-12,24	12,08	-21,59	2,10%	42,78%	-22,88%	-0,17	1,04
BB Acoes Retorno Total Fc	-5,40	-1,39	22,19	-6,82	28,89	-19,80	2,47%	40,17%	-8,49%	-0,07	0,97
BB Acoes Tecnologia Bdr Nivel I FI	-5,76	12,21	39,12	27,65	101,56	2,67	2,59%	36,08%	119,92%	0,89	0,84
Austro Institucional Pipe Bancos FIC FIA	7,37	-15,45	-39,84	-59,84	-44,05	-58,83	4,07%	38,72%	-198,85%	-1,51	0,33
It Now Ibov	-4,82	-0,60	29,86	-9,60	19,44	-18,23	2,31%	44,64%	-11,61%	-0,09	1,01
It Now Idiv	-4,85	-3,35	15,87	-9,41	38,01	-21,01	2,25%	35,87%	-25,87%	-0,19	0,82
Ishares Smal Ci	-4,87	2,37	40,20	-2,17	52,21	-19,12	2,69%	50,51%	18,79%	0,14	1,29
Ishares Bova Ci	-4,86	-0,62	31,29	-9,86	18,85	-18,14	2,26%	43,86%	-13,68%	-0,10	1,04
Banestes FICFI Acoes BTG Absol. Inst	-2,96	4,70	48,11	5,50	60,57	-4,05	2,42%	45,15%	38,67%	0,29	1,08
BENCHMARK BDR	-1,97	14,34	43,02	60,30	70,28	51,44					
Caixa FIA Institucional Bdr Nivel I	-1,99	14,98	43,04	61,21	70,33	52,76	3,30%	28,39%	340,14%	2,19	0,02

Distribuição dos Fundos Renda Fixa

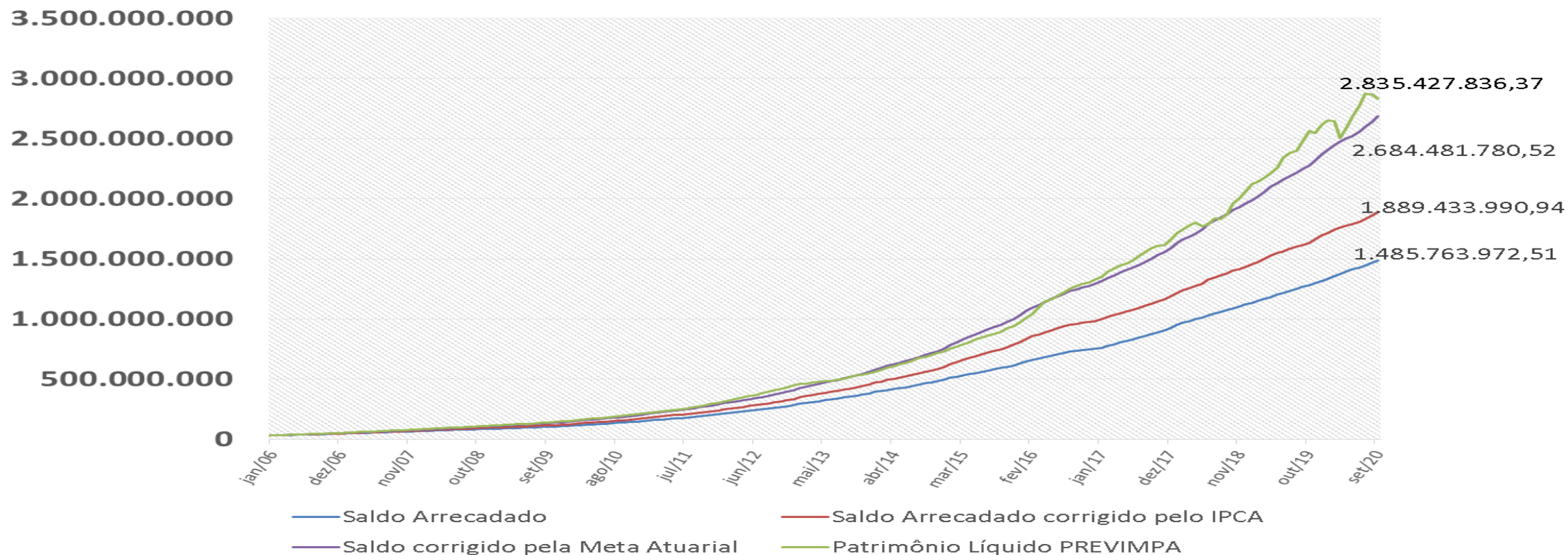


Distribuição dos Fundos Renda Variável





Patrimônio Financeiro Líquido Regime Capitalizado (Janeiro de 2006 a Setembro 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
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 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
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 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