



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

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

COMITÊ DE INVESTIMENTOS DO PREVIMPA

ATA Nº 17/2020

Reunião Ordinária 17/2020 - Comitê de Investimentos - PREVIMPA

Data e Hora	Local
17/09/2020 - 14 horas	Videoconferência Google Meet
Participantes	
Rodrigo Machado Costa - Diretor Administrativo-Financeiro - Previmpa; Renan da Silva Aguiar - Diretor-Geral - Previmpa; Dalvin Gabriel José de Souza - Chefe da Unidade de Investimentos - Previmpa; Rogério de Oliveira - Economistas, Unidade de Investimentos - Previmpa; Giordana Zimmermann Besen - Atuário, Assessoria de Planejamento - Previmpa; Isabela Belém Meneghelli, chefe da Unidade de Gestão de Ativos Imobiliários - Previmpa; Cárin Cecília da Rosa Carvalh, Administradora - Assepla - Previmpa; Roger Sotoriva Piccini, convidado.	
Ausências Justificadas: Carlos Fabretti Patrício e Christian Fourchard Justin	
Pauta:	
1 – Apresentação Resultados de Agosto/2020	
2 - Parecer ao Conselho Fiscal	
Resumo da Reunião	
Reunião inicia sem informes, passando diretamente para a apresentação dos resultados de Agosto/2020, conforme documento anexo a presente Ata 11562013, pelo senhor Dalvin. Destaque para o rendimento da carteira -0,9985% e acumulado no exercício de 3,76%, frente a meta atuarial mensal de 0,73% e no exercício de 4,69%. Após análise da apresentação e do conjunto dos investimentos, foi aprovado por unanimidade o Parecer 01/2020, do Comitê de Investimentos, constante no processo sei 20.13.000004349-1, documento 1154480.	
Encaminhamentos	
Aprovação do Parecer 01/2020 - Comitê de Investimentos	
Pendências	



Documento assinado eletronicamente por **Rodrigo Machado Costa, Diretor Administrativo-Financeiro**, em 01/10/2020, às 11:29, conforme o art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006, e o Decreto Municipal 18.916/2015.



Documento assinado eletronicamente por **Rogério de Oliveira, Economista**, em 20/10/2020, às 12:09, conforme o art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006, e o Decreto Municipal 18.916/2015.



Documento assinado eletronicamente por **Isabela Belém Meneghelli, Chefe de Unidade**, em 03/11/2020, às 16:24, conforme o art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006, e o Decreto Municipal 18.916/2015.



Documento assinado eletronicamente por **Carin Cecília da Rosa Carvalho, Administrador(a)**, em 09/11/2020, às 11:46, conforme o art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006, e o Decreto Municipal 18.916/2015.



Documento assinado eletronicamente por **Giordana Zimmermann Besen, Atuário**, em 18/11/2020, às 10:21, conforme o art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006, e o Decreto Municipal 18.916/2015.



A autenticidade do documento pode ser conferida no site <http://sei.proempa.com.br/autenticidade/seipmpa> informando o código verificador **11558536** e o código CRC **05A5532C**.

Relatório de Resultados dos Investimentos do PREVIMPA

Competência: Agosto/2020



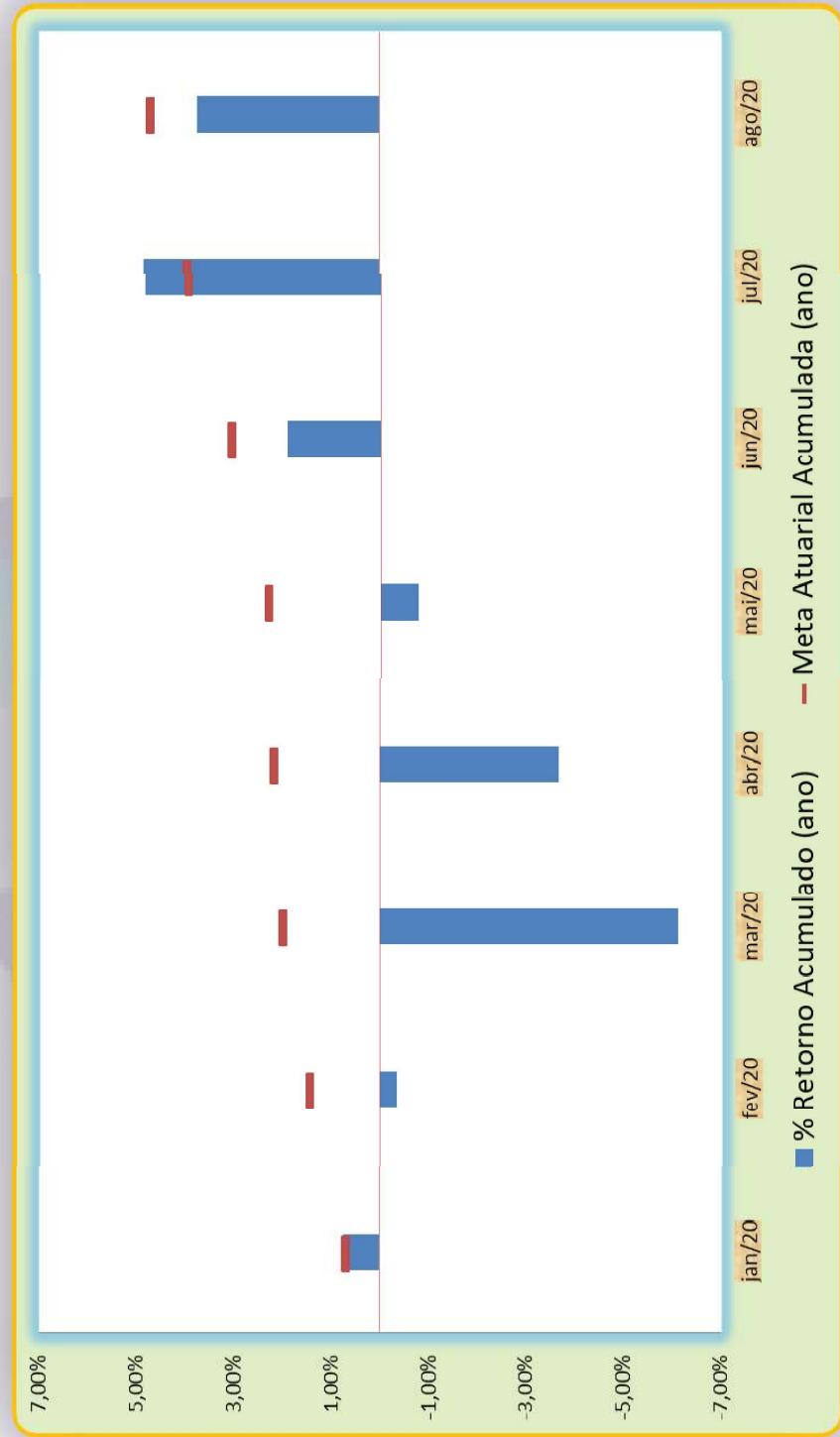
Patrimônio Líquido, Fluxo de Caixa, Retorno, Inflação e Meta Atuarial

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\$ 2.656.707.119,14	R\$ 19.539.439,46	R\$ 19.539.439,46	R\$ 19.539.439,46	0,74%	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	-R\$ -1.072,7%	-R\$ -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	R\$ -5.823,38%	R\$ -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	R\$ 2.783,1%	R\$ -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	R\$ 2.784,0%	R\$ -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	R\$ 2.669,6%	R\$ 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	R\$ 2.826,4%	R\$ 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\$ 2.873.545.681,77	R\$ 28.868.556,08	R\$ 101.374.911,15	R\$ -0,9985%	R\$ 3,76%
set/20										
out/20										
nov/20										
dez/20										
TOTAL ANO	R\$ 2.621.348.416,16	R\$ 1.573.377.890,33	R\$ 1.422.455.535,87	R\$ 150.922.354,46		R\$ 2.873.645.681,77	R\$ 101.374.911,15			3,76%

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%
				set/20			
				out/20			
				nov/20			
				dez/20			
		0,70%		4,69%			





Prefeitura de
Porto Alegre

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\$ 1.573.377.890,33	R\$ 1.422.455.535,87	R\$ 150.922.354,46	R\$ 2.873.645.681,77	R\$ 101.374.911,15	3,76%	4,69%	0,70%
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%



**Prefeitura de
Porto Alegre**

Movimentações : Regime Capitalizado



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

Conta	Títulos Públicos da Carteira Previmpa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
	Títulos Públicos Federais	R\$ 2.145.209.225,31			2.106.450.487,67 -R\$ 38.758.737,64		-1,81%

Conta	Fundos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
702-5	Caixa Fl Brasil Disponibilidades RF	R\$ 57.523,87	R\$ 6.850.897,18	R\$ 6.858.201,97	R\$ 50.551,70	R\$ 332,62	0,62%
702-5	Caixa FlC Brasil Gestao Estrategica RF	R\$ 3.047.055,18			R\$ 3.030.078,27 -R\$ 16.976,91		-0,56%
702-5	Caixa Fl Brasil Idka IPCA 2a RF LP	R\$ 68.567.464,27	23.279.348,49		R\$ 92.434.961,65	R\$ 588.148,89	0,73%
73.339-3	BB Prev RF Fluxo Fc Fl	R\$ 511.359,25	R\$ 732.896,43	R\$ 1.191.956,82	R\$ 52.797,65	R\$ 498,79	0,18%
73.339-3	BB Prev RF Idka 2 Fl	R\$ 59.125.910,88			R\$ 59.531.588,13	R\$ 405.677,25	0,69%
95756.0-2	Banrisul Foco Idka IPCA 2a Fl RF	R\$ 18.626.019,69			R\$ 18.749.146,21	R\$ 123.126,52	0,66%
40957560-2	Mirae Fixa	R\$ 13.503.064,50			R\$ 13.353.030,45 -R\$ 150.034,05		-1,11%
TOTAL DOS FUNDOS DE RENDA FIXA		R\$ 163.438.397,64	R\$ 30.863.142,10	R\$ 8.050.158,79	R\$ 187.202.154,06	R\$ 950.773,11	0,54%
TOTAL DA RENDA FIXA		R\$ 2.308.647.622,95	R\$ 30.863.142,10	R\$ 8.050.158,79	R\$ 2.293.652.641,73 -R\$ 37.807.964,53		-1,63%



Prefeitura de
Porto Alegre

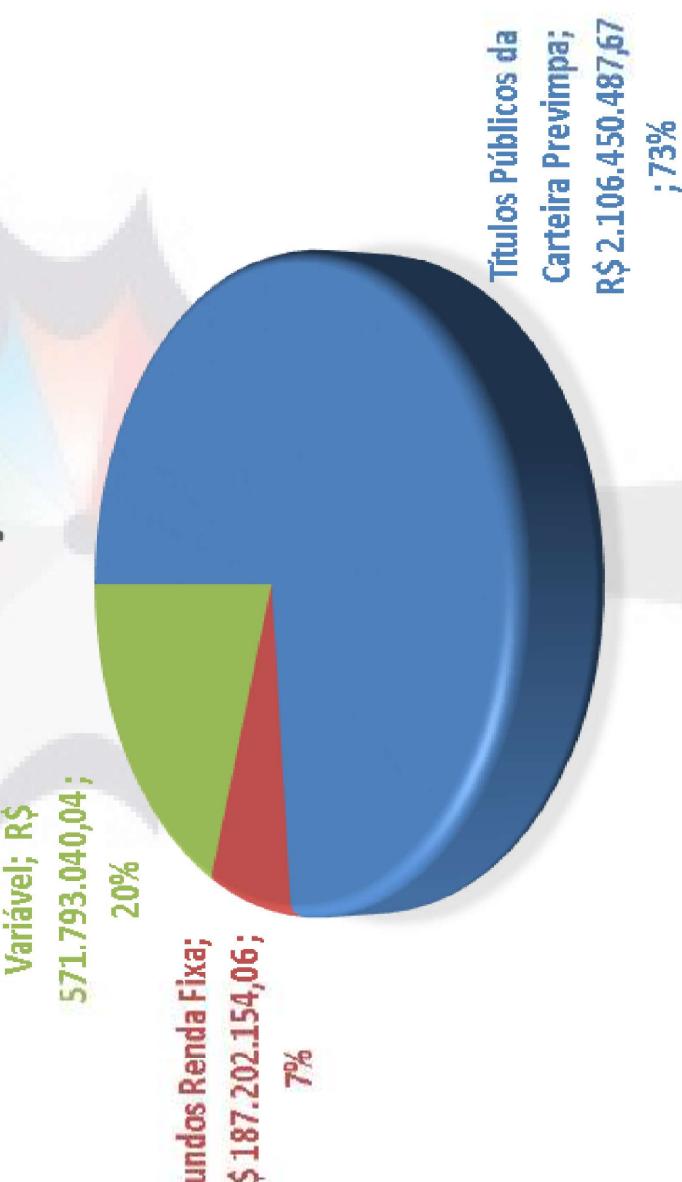
Movimentações: Regime Capitalizado

Conta	Fundos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
702-5	Caixa FIC Cap Prot Bolsa de Valores Mult	R\$ 11.761.021,59			R\$ 11.763.693,53	R\$ 2.671,94	0,02%
702-5	Caixa FIA Institucional Bdr Nivel I	R\$ 124.439.649,17			R\$ 143.308.152,75	R\$ 18.868.503,58	15,16%
702-5	Caixa FIA Infraestrutura	R\$ 17.329.338,10			R\$ 16.695.916,11	-R\$ 633.421,99	-3,66%
702-5	Caixa FIC FIA Acoes Multigestor	R\$ 71.013.481,90			R\$ 68.561.783,78	-R\$ 2.451.698,12	-3,45%
73.339-3	BB Acoes Alocação FA	R\$ 26.265.893,47			R\$ 25.403.270,88	-R\$ 862.622,59	-3,28%
73.339-3	BB Acoes Retorno Total Fc	R\$ 16.964.113,11			R\$ 16.398.279,91	-R\$ 565.833,20	-3,34%
73.339-3	BB Acoes Tecnologia Bdr Nivel I FI	R\$ 18.920.428,42			R\$ 20.705.231,95	R\$ 1.784.803,53	9,43%
40957560-2 It Now Ibov	Astro Institucional Pipe Bancos FICFIA	R\$ 3.529.462,44			R\$ 3.490.546,24	-R\$ 38.916,20	-1,10%
40957560-2 It Now Ibov	R\$ 67.671.500,00				R\$ 65.474.500,00	-R\$ 2.197.000,00	-3,25%
40957560-2 It Now Idiv	R\$ 30.530.229,80				R\$ 29.315.901,80	-R\$ 1.214.328,00	-3,98%
40957560-2 Ishares Smal Ci	R\$ 51.656.656,80				R\$ 50.964.593,40	-R\$ 692.063,40	-1,34%
40957560-2 Ishares Bova Ci	R\$ 104.517.000,00				R\$ 101.535.000,00	-R\$ 2.982.000,00	-2,85%
29.921.251 Banestes FICFI Acoes BTG Absol. Inst	R\$ 18.254.856,79				R\$ 18.176.169,69	-R\$ 78.687,10	-0,43%
TOTAL RENDA VARIÁVEL		R\$ 562.853.631,59	R\$ -	R\$ -	R\$ 571.793.040,04	R\$ 8.939.408,45	1,59%
RENTABILIDADE FINANCEIRA DO REGIME CAPITALIZADO							
702-5	IMÓVEL - ESTACIONAMENTO	R\$ 8.200.000,00			R\$ 8.200.000,00	R\$ -	0,00%
RENTABILIDADE TOTAL DO REGIME CAPITALIZADO		R\$ 2.879.701.254,54	R\$ 30.863.142,10	R\$ 8.050.158,79	R\$ 2.865.445.681,77	-R\$ 28.868.556,08	-1,00%



Prefeitura de
Porto Alegre

Fundos Renda DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO





Prefeitura de
Porto Alegre

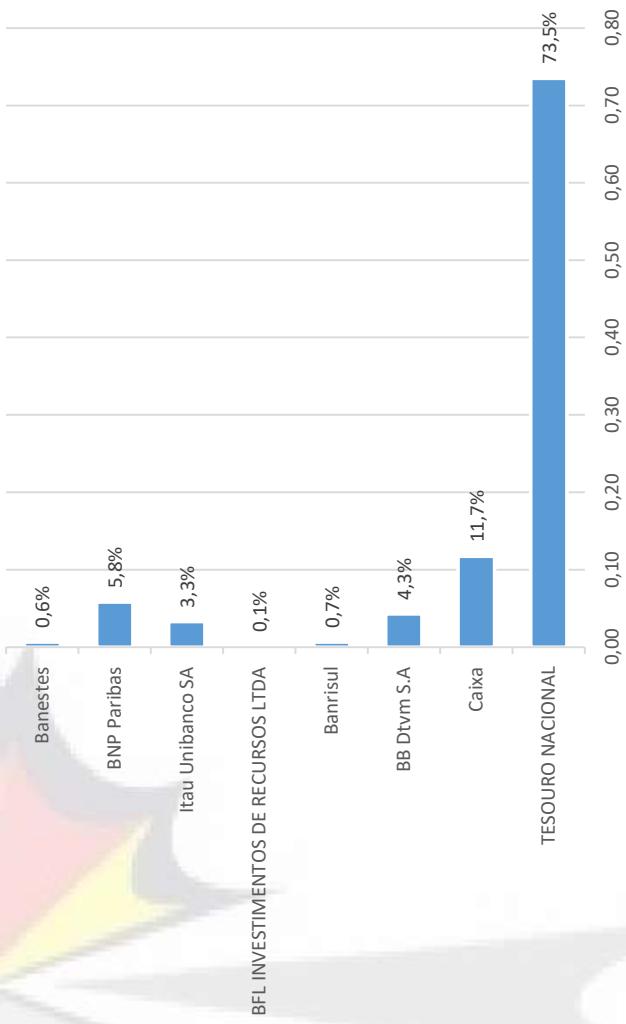
Movimentações: Outras Contas

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\$ 8.077.448,94		R\$ 2.197.076,60	R\$ 5.887.557,89	R\$ 7.185,55	0,10%
73.342-3	COMPREV - BB Prev RF IDKA2	R\$ 1.042.867,46	R\$ 1.099.487,96		R\$ 2.152.471,77	R\$ 10.116,35	0,64%
73.334-2	FUNDO PREVIDÊNCIA - BB Previd RF Fluxo	R\$ 218.255,51	R\$ 7.529,34	R\$ 20.731,29	R\$ 205.219,63	R\$ 166,07	0,08%
703-3	REPARTIÇÃO SIMPLES - Caixa Disponibilidades RF	R\$ 9.832.839,78	R\$ 4.032.015,04	R\$ 4.930.054,23	R\$ 8.942.857,11	R\$ 8.056,52	0,09%
704-1	GRATIFICACAO NAT - Caixa IRFM-1	R\$ 420.020,96	R\$ 71.410,00		R\$ 491.896,83	R\$ 465,87	0,10%
704-1	TAXA ADM - Caixa Disponibilidades	R\$ 1.453,52	R\$ 14.994,88	R\$ 3.402,40	R\$ 13.057,71	R\$ 11,71	0,16%
73.360-1	TAXA ADM - BB Prev RF IRFM-1	R\$ 7.955.092,01			R\$ 7.962.114,29	R\$ 7.022,28	0,09%
73.360-1	TAXA ADM - BB Previd RF Fluxo	R\$ 7.187.990,57	R\$ 2.240.315,39	R\$ 1.570.940,81	R\$ 7.862.593,04	R\$ 5.227,89	0,07%
73.360-1	TAXA ADM - BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 3.587.775,28			R\$ 3.612.391,88	R\$ 24.616,60	0,69%
73.400-4	FRAP - BB Previd RF Fluxo	R\$ 714.687,33	R\$ 53.077,09	R\$ 3.895,83	R\$ 764.433,52	R\$ 564,93	0,08%
420.000-4	ADIANTAMENTO - BB Previd RF Fluxo	R\$ 5,44			R\$ 5,44	R\$ -	0,00%
	Conta Corrente	R\$ 1.257,75			R\$ 2.726,19		0,00%
TOTAL TAXA ADM E REPARTIÇÃO SIMPLES		R\$ 39.039.694,55	R\$ 7.518.829,70	R\$ 8.726.101,16	R\$ 37.897.325,30	R\$ 64.902,21	0,17%
RENTABILIDADE CONSOLIDADA DO PREVIMPA							
		R\$ 2.918.740,949,09	R\$ 38.381.971,80	R\$ 16.776.259,95	R\$ 2.911.543,007,07	-R\$ 28.803.653,87	-0,98%

Distribuição por Administrador

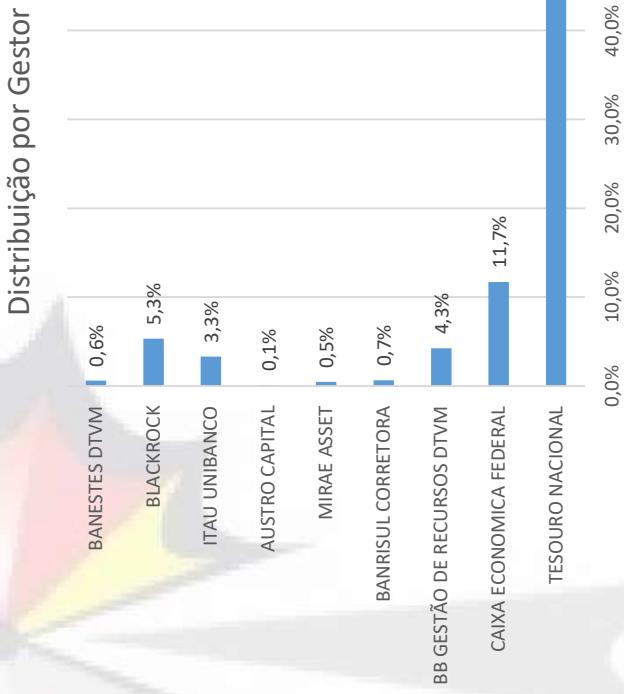
Administrador	Valor por Adm	Distribuição por Administrador
TESOURO NACIONAL	R\$ 2.106.450.487,67	73,5%
Caixa	R\$ 335.845.137,79	11,7%
BB DtvM S.A	R\$ 122.091.168,52	4,3%
Banrisul	R\$ 18.749.146,21	0,7%
BEL INVESTIMENTOS DE RECURSOS LTDA	R\$ 3.490.546,24	0,1%
Itau Unibanco SA	R\$ 94.790.401,80	3,3%
BNP Paribas	R\$ 165.852.623,85	5,8%
Banestes	R\$ 18.176.169,69	0,6%

Distribuição por Administrador



Distribuição por Gestor

Gestor	Valor por Adm	Distribuição por Gestor
TESOURO NACIONAL	2.145.209.225,31	74,9%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	335.845.137,79	11,7%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	122.091.168,52	4,3%
BANRISUL CORRETORA	18.749.146,21	0,7%
MIRAE ASSET	13.353.030,45	0,5%
AUSTRO CAPITAL	3.490.546,24	0,1%
ITAU UNIBANCO	94.790.401,80	3,3%
BLACKROCK	152.499.593,40	5,3%
BANESTES DTVM	18.176.169,69	0,6%
		0,6%





Enquadramento Renda Fixa

Títulos públicos	Valor atual	PL do fundo	Participação Previmpa no fundo	Enquadramento resolução 3922	limite do enquadramento enquadramento	investimento	Limites da política de investimento	Alvo da política de investimento	% Alocado para carteira
Títulos da carteira Previmpa	2.106.450.487,67			Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100%	100%	100%	70%	2.106.450.487,67
					0\$	0\$	0\$	0\$	73,51%

Renda fixa	Valor atual	PL do fundo	Participação Previmpa no fundo	Enquadramento resolução 3922	limite do enquadramento enquadramento	investimento	Limites da política de investimento	Alvo da política de investimento	% Carteira
Caixa FIC Brasil Gestão Estratégica RF	3.030.078,27	13.462.808.031,45	0,02%	Artigo 7º, Inciso I,	100%	100%	100%	2%	173.745.774,26
Caixa FI Brasil Idka IPCA 2a RF LP	92.424.961,65	8.901.363.723,20	1,04%	Alínea 'b'	100%	100%	100%	2%	6,06%
BB Prev RF Idka 2 FI	59.531.588,13	6.452.433.505,43	0,92%						
Banrisul Foco Idka IPCA 2a FI RF	18.749.146,21	857.619.081,73	2,19%						
Mirae Fixa	13.353.030,45	171.087.700,88	7,80%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100%	100%	100%	0%	13.353.030,45
Caixa FI Brasil Disponibilidades RF	50.555,70	496.713.163,83	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40%	40%	40%	1%	103.349,35
BB Prev RF Fluxo Fc FI	52.797,65	1.775.186.405,18	0,00%						0,00%



Enquadramento Renda Variável

Renda Variável	Valor atual	PL do fundo	Participação Previmpa no fundo	Enquadramento resolução 3922	limite do enquadramento	limite da política de investimento	Alvo da política de investimento	Valor por carteira % Carteira
					os	os	os	os
It Now Ibov	65.474.500,00	4.222.717.167,96	1,55%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	30%	30%	6%	217.974.093,40 7,61%
Ishares Smal Ci	50.964.553,40	1.636.560.120,98	3,11%					
Ishares Bova Ci	101.555.000,00	11.982.384.656,28	0,85%					
Caixa FIA Infraestrutura	16.695.916,11	523.396.542,73	3,19%					
Caixa FIC FIA Acoes Multigestor	68.561.783,78	869.683.651,69	7,88%					
BB Acoes Alocacao FIA	25.403.270,88	418.780.536,55	6,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20%	20%	6%	165.940.652,32 5,79%
BB Acoes Retorno Total Fc	16.398.279,91	1.223.610.129,09	1,34%					
BB Acoes Tecnologia Bdr Nivel I FI	20.705.231,95	670.807.737,43	3,09%					
Banestes FICFI Acoes BTG Absol. Inst	18.176.169,69	157.969.354,10	11,51%					
It Now Idiv	29.315.901,80	283.967.099,73	10,32%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	20%	20%	2%	29.315.901,80 1,02%
Caixa FIC Cap Prot Bolsa de Valores Mult	11.763.693,53	507.987.368,29	2,32%	Artigo 8º, Inciso III	10%	10%	2%	11.763.693,53 0,41%
Caixa FIA Institucional Bdr Nivel I	143.308.152,75	1.583.297.843,04	9,05%	Artigo 9º - A, Inciso III	10%	10%	1%	143.308.152,75 5,00%
Astro Institucional Pipe Bancos FICFIA	3.490.546,24	27.948.605,13	12,49%	Desenquadrado - RV	N. A.	N. A.	N. A.	3.490.546,24 0,12%

Carteira de Títulos públicos

Cód. Papel	Vencimento	Data Compra	Qtd. 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	76.961.779,60	71.491.890,56	3,65%
LTN20220101 - 100000	01/01/2022	09/04/2018	200.000	732,97834600	962,49592000	8,694000	192.404.449,00	178.959.970,80	9,13%
LTN20220401 - 100000	01/04/2022	07/02/2020	160.000	898,51867100	951,63522300	5,140000	152.048.884,80	147.822.453,60	7,22%
LTN20220701 - 100000	01/07/2022	26/06/2019	120.000	825,38325200	940,30962000	6,579000	112.497.667,96	106.824.168,24	5,34%
LTN20230701 - 100000	01/07/2023	14/06/2019	190.000	753,63622400	885,84022200	7,260000	166.548,053,00	155.910.564,03	7,91%
LTN20240101 - 100000	01/01/2024	03/01/2020	200.000	787,45838900	853,97150100	6,200000	168.504.336,40	163.818.501,00	8,00%
Total LTN:			950.000				868.965.190,76	824.827.548,23	41,25%
NTN-PÓS									
NTNB20280815 - 760199	15/08/2019	06/06/2019	20.000	3.820,89142600	4.243,66814200	3,819000	81.495.065,02	75.828.454,80	3,87%
NTNB20280815 - 760199	15/08/2019	06/06/2019	20.000	3.820,89142600	4.243,66814200	3,819000	81.495.065,02	75.828.454,80	3,87%
NTNB20280815 - 760199	15/08/2019	06/06/2019	30.000	3.820,89142600	4.243,66814200	3,819000	122.242.597,53	113.742.682,20	5,80%
Total NTN-PÓS:			70.000				285.232.727,57	265.399.591,80	13,54%

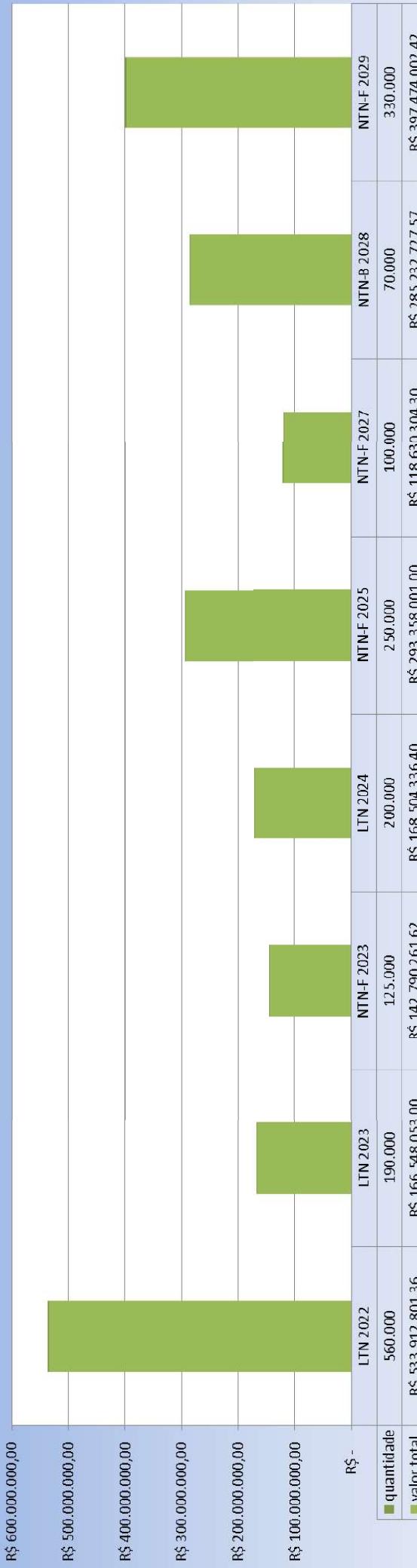


Prefeitura de
Porto Alegre

Carteira de Títulos Públicos

Cód. Papel	Vencimento	Data Compra	Qtdc. 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	28.558,052,32	25.660,973,30	1,36%
NTNF20230101 - 950199	01/01/2023	13/10/2017	50.000	1.052,64080900	1.147,97791200	9,400000	57.116,104,65	51.347,481,95	2,71%
NTNF20230101 - 950199	01/01/2023	17/10/2017	50.000	1.051,66190700	1.147,97791200	9,444000	57.116,104,65	51.309,438,90	2,71%
NTNF20250101 - 950199	01/01/2025	13/10/2017	60.000	1.049,13298400	1.196,66037100	9,604000	70.405,920,24	61.725,246,48	3,34%
NTNF20250101 - 950199	01/01/2025	14/11/2018	140.000	1.038,99625800	1.196,66037100	9,959000	164.280,480,56	142.527,500,08	7,80%
NTNF20250101 - 950199	01/01/2025	14/11/2018	50.000	1.037,69901300	1.196,66037100	9,989000	58.671,600,20	50.856,836,70	2,79%
NTNF20270101 - 950199	01/01/2027	20/05/2019	100.000	1.092,53252800	1.219,02127300	8,949000	118.630,304,30	106.173,383,10	5,63%
NTNF20290101 - 950199	01/01/2029	20/05/2019	50.000	1.094,98101100	1.242,08001900	9,069000	60.223,333,70	53.291,431,85	2,86%
NTNF20290101 - 950199	01/01/2029	01/08/2019	60.000	1.192,01765100	1.242,08001900	7,199000	72.268,000,44	2.229,749,76	3,43%
NTNF20290101 - 950199	01/01/2029	08/11/2019	140.000	1.257,99416700	1.242,08001900	6,619000	168.625,334,36	171.367,468,86	8,01%
NTNF20290101 - 950199	01/01/2029	12/11/2019	10.000	1.254,15538900	1.242,08001900	6,679000	12.044,666,74	12.199,065,25	0,57%
NTNF20290101 - 950199	01/01/2029	08/07/2020	20000	1.218,63214500	1.242,08001900	6,529000	24.089,333,48	24.606,203,02	1,14%
NTNF20290101 - 950199	01/01/2029	08/07/2020	50000	1.218,63214500	1.242,08001900	6,529000	60.223,333,70	61.515,507,55	2,86%
Total NTN-PRÉ:			805.000				952.252.569,34	814.810.286,80	45,21%
Total Títulos Públicos:			1.825.000				R\$ 2.106.450,487,67	R\$ 1.905.037.426,83	100,0%

Distribuição dos Títulos Públicos em Carteira



Duration de MACAULAY (anos)	Variação % Preço (100 PB)	Variação em MOEDA (100 PB)	Variação em MOEDA (1 PB)
3,82	3,65	3,65%	-R\$ 76.786.147,17 R\$ 7.678,61

UINV/DAF
Estimados Agosto 2020 (11562013)

SEI 20.13.0000000126-8 / pg. 18

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 dor 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%	Volatilid	Sortino	Sharpe 12M	Beta 12M
							1M	ade	12M			
BENCHMARK CDI		0,16	0,57	1,43	3,86	10,38	2,12					
Caixa FI Brasil Disponibilidades RF		0,09	0,35	1,01	3,00	8,56	1,55	0,00%	0,07%	-1631,68%	-142,79	0,00
BB Prev RF Fluxo Fc Ff		0,08	0,31	0,91	2,78	8,08	1,42	0,00%	0,07%	-1623,05%	-109,13	0,00
BENCHMARK IDKA 2A		1,03	2,99	4,11	9,71	23,52	5,39					
Caixa FI Brasil Idka IPCA 2a RF LP		0,79	2,82	3,70	8,84	21,88	4,80	0,18%	4,02%	151,51%	1,22	0,06
BB Prev RF Idka 2 Ff		0,69	2,73	3,38	8,67	21,54	4,43	0,17%	4,11%	143,30%	1,15	0,06
Banrisul Foco Idka IPCA 2a Fl RF		0,66	2,60	3,57	8,77	21,89	4,79	0,17%	4,27%	140,54%	1,13	0,06
BENCHMARK IMA EX-G		-0,68	1,88	1,72	6,16	22,72	2,69					
Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF		-0,56	1,17	3,57	9,21	27,35	5,06	0,30%	5,92%	121,94%	0,91	0,03
Mirae Fixa		-1,11	1,29	4,95	11,81 N.A.	7,23	0,39%	8,51%	134,80%	0,97	0,03	

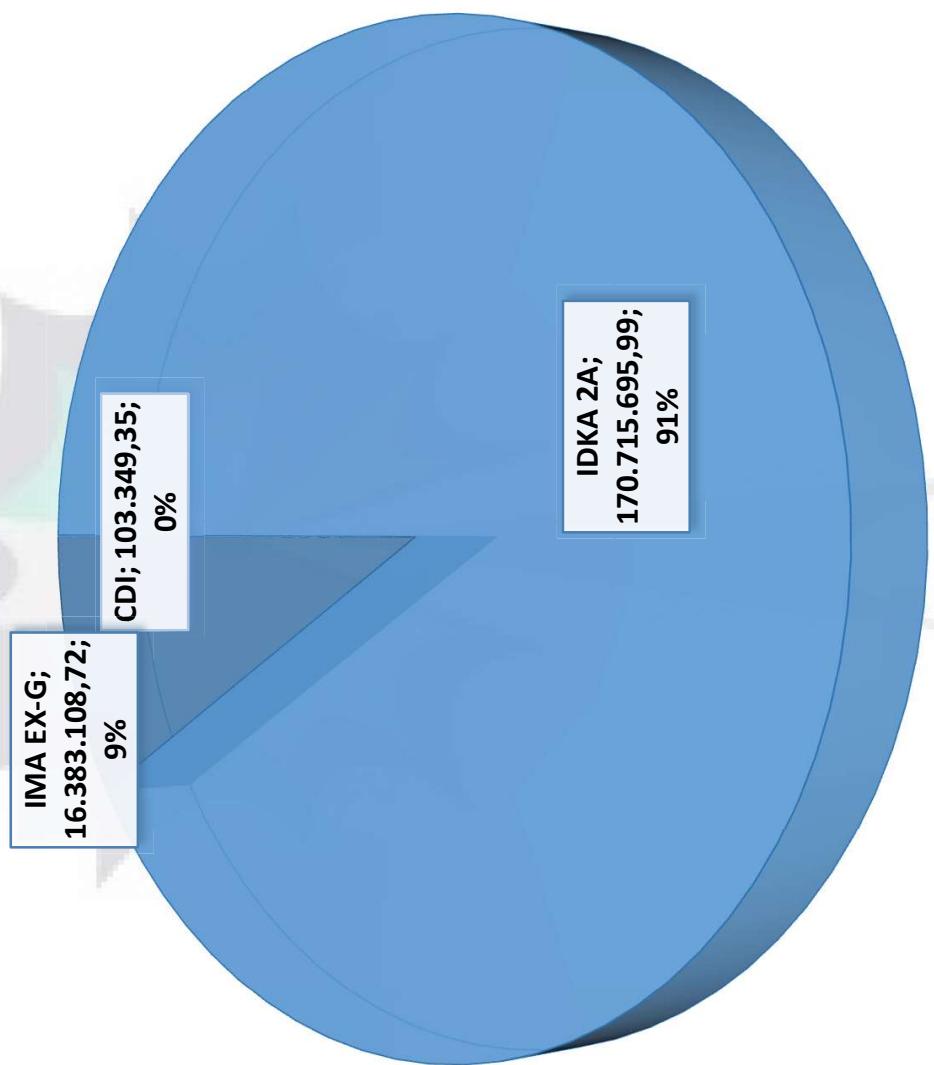


Rentabilidade e Risco Renda Variável

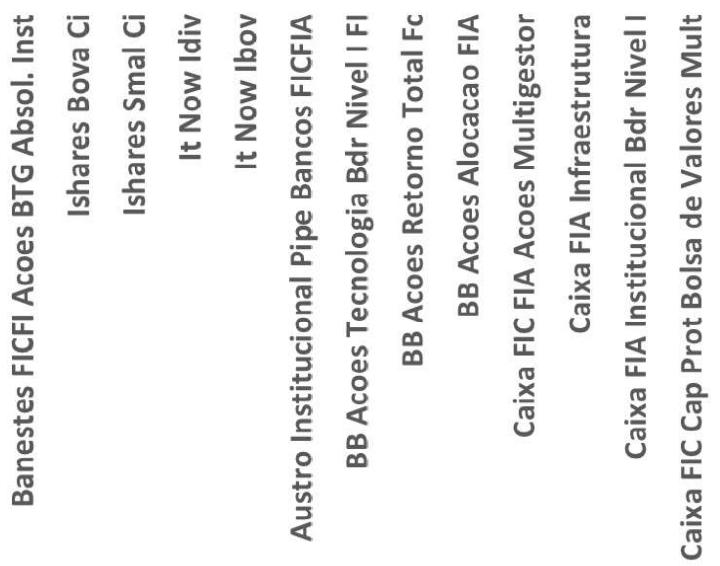
Fundos Renda Variável	1 mês	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	No ano	1M	Var 95%	Volatilid	Sortino	Sharpe	Beta 12M
BENCHMARCKIBOVESPA	-3,44	13,69	-4,61	-1,75	29,59	-14,07						
Caixa FIC Cap Prot Bolsa de Valores Mult	0,02	0,19	1,28	4,31	N.A.	1,87	0,00%	1,74%	31,89%	0,26		-0,01
Caixa FIA Infraestrutura	-3,66	12,41	-4,54	1,69	69,26	-12,31	2,42%	46,58%	26,39%	0,20		1,04
Caixa FIC FIA Acoes Multigestor	-3,45	15,87	-4,39	6,16	N.A.	-10,02	2,09%	44,20%	38,16%	0,29		1,09
BB Acoes Alocação FIA	-3,28	13,36	-9,15	-5,61	21,51	-18,00	2,03%	42,46%	-2,18%	-0,02		1,04
BB Acoes Retorno Total FC	-3,34	11,04	-8,97	1,22	41,81	-15,23	2,15%	39,68%	17,93%	0,14		0,97
BB Acoes Tecnologia Bdr Nivel I FI	9,43	28,17	11,52	34,14	107,71	8,95	1,50%	35,82%	145,62%	1,07		0,81
Austro Institucional Pipe Bancos FICFIA	-1,10	-24,26	-59,23	-62,84	-47,25	-61,66	3,40%	37,27%	-215,23%	-1,66		0,39
It Now Ibov	-3,52	13,86	-4,64	-1,74	29,87	-14,09	2,15%	44,27%	13,06%	0,10		1,01
It Now Idiv	-4,15	10,24	-9,28	-3,29	45,71	-16,98	2,04%	35,52%	-3,52%	-0,03		0,82
Ishares Smal Ci	-1,69	22,56	-7,86	4,04	57,18	-14,98	2,64%	50,15%	36,10%	0,27		1,28
Ishares Bova Ci	-3,62	13,73	-4,87	-1,96	29,11	-13,96	2,22%	43,50%	11,47%	0,08		1,04
Banestes FICFI Acoes BTG Absol. Inst	-0,43	18,93	4,33	10,07	69,06	-1,13	2,10%	44,76%	52,49%	0,39		1,08
BENCHMARCKBDR	14,62	21,89	53,88	67,96	72,96	54,49						
Caixa FIA Institucional Bdr Nivel I	15,16	22,45	55,15	68,87	72,76	55,87	2,44%	27,02%	404,81%	2,54		0,00



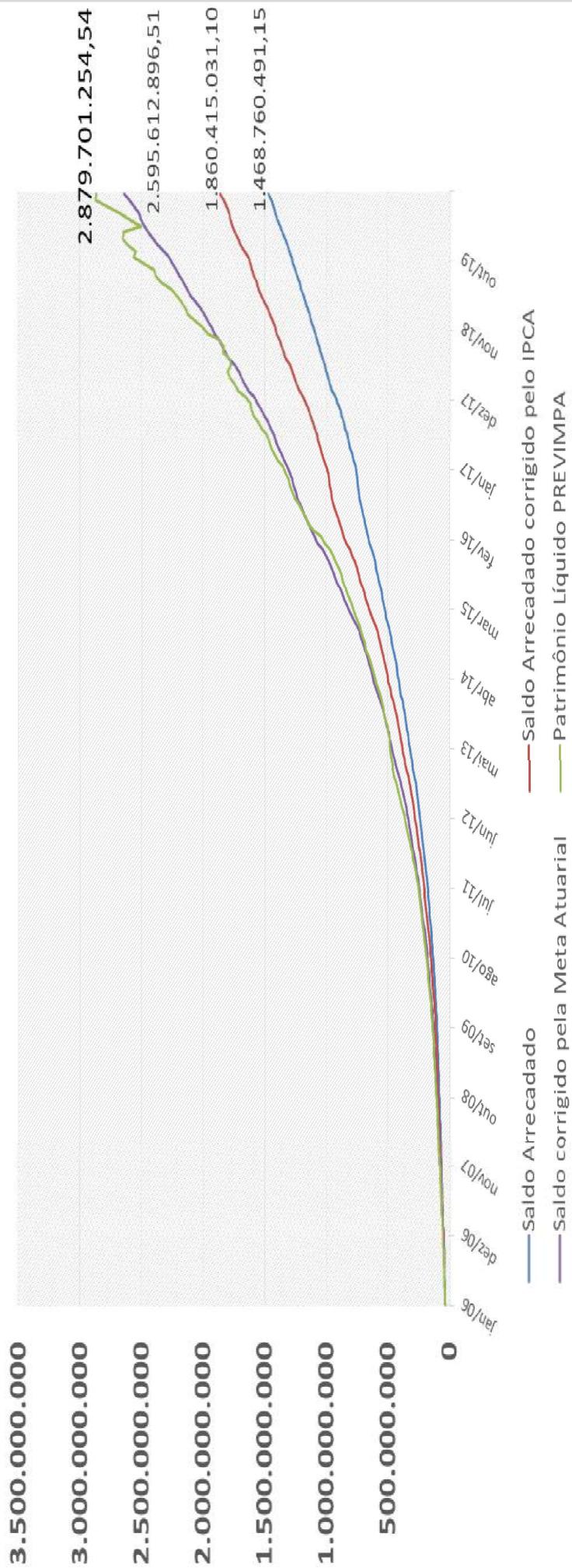
Distribuição dos Fundos Renda Fixa



Distribuição dos Fundos Renda Variável



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



UINV/DAF

Apresentação Resultados dos Investimentos Agosto 2020 (11562013)

SEI 20.13.000000126-8 / pg. 24



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										
Renda Variável										
Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Brasil Disponibilidades RF	14.508.643/0001-55	0,80%	Não há	D+0	Não há	18:00	
BB Gestão de Recursos DTVM	BB Gestão de Recursos DTVM	Banco do Brasil	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRAT.	23.215.097/0001-55	0,40%	Não há	D+0	Não há	16:00	
Banco do Estado do Rio Grande do Sul	BB Gestão de Recursos DTVM	Banrisul Corretora	Caixa IDKA IPCA RF LP	14.386.926/0001-71	0,20%	Não há	D+0	Não há	16:00	
BNB Paribas	BNB Paribas	Mirae Asset	BB RPPS RF Fluxo	13.077.415/0001-05	1,00%	Não há	D+0 Abertura	D+0	Não há	23:00
BB Gestão de Recursos DTVM	BB Gestão de Recursos DTVM	BB PREV/IDKA 2A	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	Banco do Estado do Rio Grande do Sul	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	BNB Paribas	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
BB Gestão de Recursos DTVM	BB Gestão de Recursos DTVM	Banco do Brasil	Caixa Institucional BDR I	17.502.937/0001-08	0,70%	Não há	D+1	Não há		17:00
BFL INVESTIMENTOS DE RECURSOS LTDA	Austro Capital	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	Caixa FI Ações Infraestrutura	10.551.382/0001-03	2,00%	Não há	D+1	D+3	Não há	17:00
BNB Paribas	BNB Paribas	Black Rock	Caixa FIC FIA Ações Multigestor	30.068.224/0001-04	1,50%	Não há	D+1	D+3	Não há	13:00
BANESTES SA BANCO DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO	BANESTES SA BANCO DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO	Banestes BTG Absoluto FIC FIA	BB Previd Ações Alocação	18.270.783/0001-99	1,00%	Não há	D+1	D+3	Não há	13:00
ITAUÚ UNIBANCO S.A.	ITAUÚ UNIBANCO S.A.	ITAUÚ UNIBANCO S.A.	BB Ações Retorno Total	09.005.805/0001-00	1,00%	Não há	D+1	D+3	Não há	17:00
ITAUÚ UNIBANCO S.A.	ITAUÚ UNIBANCO S.A.	ITAUÚ UNIBANCO S.A.	BB Ações Tecnologia	01.578.474/0001-88	2,00%	Não há	D+1	D+3	Não há	17:00
ITAUÚ UNIBANCO S.A.	ITAUÚ UNIBANCO S.A.	ITAUÚ UNIBANCO S.A.	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
ITAUÚ UNIBANCO S.A.	ITAUÚ UNIBANCO S.A.	ITAUÚ UNIBANCO S.A.	ETF BOVV 11	21.407.758/0001-19	0,30%	Não há	D+2	Não há		17:00
ITAUÚ UNIBANCO S.A.	ITAUÚ UNIBANCO S.A.	ITAUÚ UNIBANCO S.A.	ETF DIVO 11	13.446.245/0001-46	0,50%	Não há	D+2	Não há		17:00
ITAUÚ UNIBANCO S.A.	ITAUÚ UNIBANCO S.A.	ITAUÚ UNIBANCO S.A.	ETF SMAI 11	10.406.600/0001-08	0,69%	Não há	D+2	Não há		17:00
ITAUÚ UNIBANCO S.A.	ITAUÚ UNIBANCO S.A.	ITAUÚ UNIBANCO S.A.	ETF BOVA 11	10.406.511/0001-61	0,30%	Não há	D+2	Não há		17:00
ITAUÚ UNIBANCO S.A.	ITAUÚ UNIBANCO S.A.	ITAUÚ UNIBANCO S.A.	Banestes BTG Absoluto FIC FIA	08.018.849/0001-02	3,00%	Não há	D+1	D+30	Não há	15:00