

# Relatório de Resultados dos Investimentos do PREVIMPA

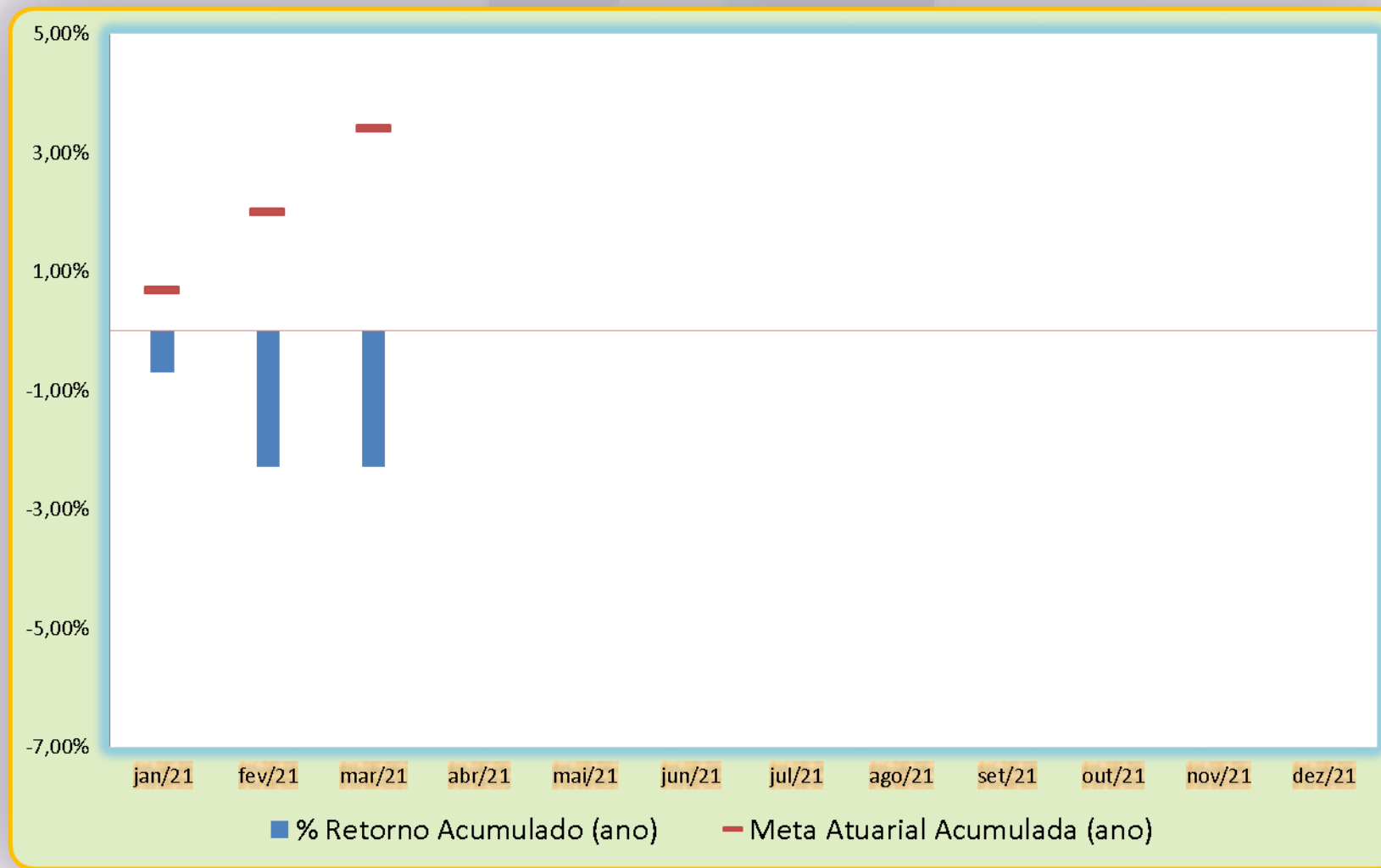
Competência: Março/2021



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										
mai/21										
jun/21										
jul/21										
ago/21										
set/21										
out/21										
nov/21										
dez/21										
<b>TOTAL ANO</b>	<b>R\$ 3.035.629.264,65</b>	<b>R\$ 394.203.849,56</b>	<b>R\$ 329.389.568,70</b>	<b>R\$ 64.814.280,86</b>		<b>R\$ 3.030.110.587,07</b>	<b>-R\$ 70.332.958,44</b>			<b>-2,29%</b>

## Indicadores de Performance do Fundo Capitalizado: 2021

Meta Atuarial ( mês)	Meta Atuarial Acumulada (ano)	Competência	Retorno Acumulado (12 meses)	Meta Atuarial Acumulada (12 meses)	% Atingido da Meta Atuarial (12 meses)
0,69%	0,69%	jan/21	5,61%	10,78%	51,98%
1,31%	2,01%	fev/21	4,90%	11,41%	42,92%
1,38%	3,41%	mar/21	11,03%	12,32%	89,58%
		abr/21			
		mai/21			
		jun/21			
		jul/21			
		ago/21			
		set/21			
		out/21			
		nov/21			
		dez/21			
	3,41%				





## 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\$ 394.203.849,56	R\$ 329.389.568,70	R\$ 64.814.280,86	R\$ 3.030.110.587,07	-R\$ 70.332.958,44	-2,29%	3,41%	2,05%
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%



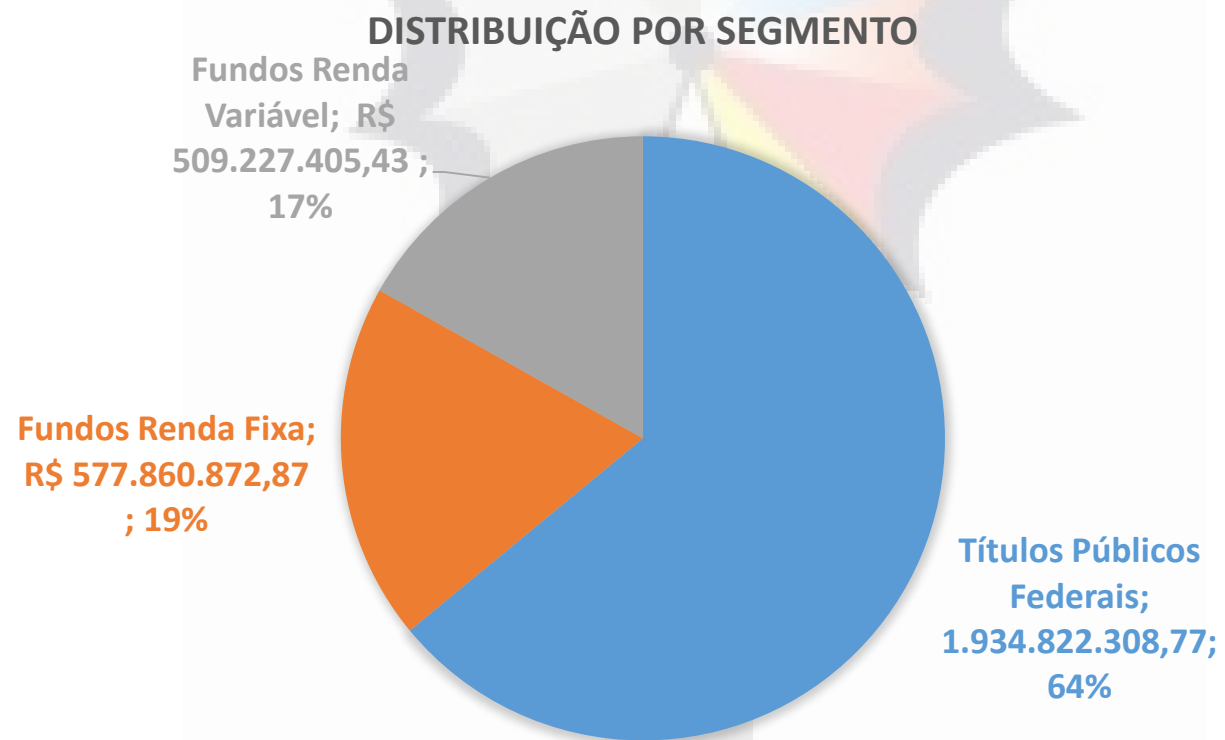
## Movimentações : Regime Capitalizado

Conta	Títulos Públicos da Carteira Previmpa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
	Títulos Públicos Federais	1.958.438.873,76			1.934.822.308,77 -R\$	23.616.564,99	-1,21%
Conta	Fundos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
702-5	Caixa FIC Brasil Disponibilidades RF	R\$ 656.209,04		R\$ 332.101,08	R\$ 324.519,46	R\$ 411,50	0,08%
702-5	Caixa FI Brasil Idka IPCA 2a RF LP	R\$ 347.360.655,50	17.050.324,51	R\$ 25.000.000,00	R\$ 340.555.214,04	R\$ 1.144.234,03	0,33%
73.339-3	BB Prev RF Fluxo Fc FI	R\$ 721.552,24	R\$ 791.752,72	R\$ 1.229.383,42	R\$ 284.691,34	R\$ 769,80	0,15%
73.339-3	BB Prev RF Idka 2 FI	R\$ 136.322.677,39			R\$ 136.827.105,37	R\$ 504.427,98	0,37%
95756.0-2	Banrisul Foco Idka IPCA 2a FI RF	R\$ 98.505.001,64	R\$ 21.993.576,00	R\$ 20.885.032,00	R\$ 99.868.096,18	R\$ 254.550,54	0,26%
95756.0-2	Banrisul Automatico FI RF CP	R\$ -	R\$ 21.994.575,00	R\$ 21.993.575,00	R\$ 1.246,48	R\$ 246,48	0,00%
TOTAL DOS FUNDO DE RENDA FIXA		R\$ 583.566.095,81	R\$ 61.830.228,23	R\$ 69.440.091,50	R\$ 577.860.872,87	R\$ 1.904.640,33	0,33%
TOTAL DA RENDA FIXA		R\$ 2.542.004.969,57	R\$ 61.830.228,23	R\$ 69.440.091,50	R\$ 2.512.683.181,64	-R\$ 21.711.924,66	-0,86%



## Movimentações: Regime Capitalizado

Conta	Fundos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
702-5	Caixa FIA Institucional Bdr Nivel I	R\$ 89.246.486,50			R\$ 92.305.652,11	R\$ 3.059.165,61	3,43%
702-5	Caixa FIA Infraestrutura	R\$ 17.397.805,66			R\$ 18.475.888,38	R\$ 1.078.082,72	6,20%
702-5	Caixa FIC FIA Acoes Multigestor	R\$ 73.011.328,56			R\$ 75.332.932,05	R\$ 2.321.603,49	3,18%
73.339-3	BB Acoes Retorno Total Fc	R\$ 17.836.324,27			R\$ 19.098.819,57	R\$ 1.262.495,30	7,08%
73.339-3	BB Acoes Tecnologia Bdr Nivel I FI	R\$ 22.868.760,76			R\$ 22.530.580,85	-R\$ 338.179,91	-1,48%
	Austro Institucional Pipe Bancos FIC FIA	R\$ 2.690.216,67			R\$ 2.695.859,49	R\$ 5.642,82	0,21%
40957560-2	It Now Ibov	R\$ 56.050.000,00			R\$ 58.515.000,00	R\$ 2.465.000,00	4,40%
40957560-2	Ishares S&P 500	R\$ 57.770.000,00			R\$ 61.085.000,00	R\$ 3.315.000,00	5,74%
40957560-2	Ishares Bova Ci	R\$ -	R\$ 20.885.032,00	R\$ 21.993.576,00	R\$ -	R\$ 1.108.544,00	5,31%
29.921.251	Banestes FICFI Acoes BTG Absol. Inst	R\$ 22.336.109,40			R\$ 22.631.267,32	R\$ 295.157,92	1,32%
73.339-3	BB Acoes Exportacao Fc FI	R\$ 13.026.898,04			R\$ 14.052.663,24	R\$ 1.025.765,20	7,87%
73.339-3	BB Acoes Energia FI	R\$ 44.988.130,63			R\$ 48.964.938,52	R\$ 3.976.807,89	8,84%
73.339-3	Itau Asgard Institucional Acoes FI	R\$ -	R\$ 25.000.000,00		R\$ 25.814.049,03	R\$ 814.049,03	3,26%
	BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	R\$ 46.915.194,57			R\$ 47.724.754,87	R\$ 809.560,30	1,73%
<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b>		<b>R\$ 464.137.255,06</b>	<b>R\$ 45.885.032,00</b>	<b>R\$ 21.993.576,00</b>	<b>R\$ 509.227.405,43</b>	<b>R\$ 21.198.694,37</b>	<b>4,45%</b>
<b>RENTABILIDADE FINANCEIRA DO REGIME CAPITALIZADO</b>		<b>R\$ 3.006.142.224,63</b>	<b>R\$ 107.715.260,23</b>	<b>R\$ 91.433.667,50</b>	<b>R\$ 3.021.910.587,07</b>	<b>-R\$ 513.230,29</b>	<b>-0,02%</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\$ 3.014.342.224,63</b>	<b>R\$ 107.715.260,23</b>	<b>R\$ 91.433.667,50</b>	<b>R\$ 3.030.110.587,07</b>	<b>-R\$ 513.230,29</b>	<b>-0,02%</b>







## 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\$ 969.966,01			R\$ 970.129,11	R\$ 163,10	0,02%
73.342-3	COMPREV - BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 1.300.305,45	R\$ 1.046.552,62		R\$ 2.346.188,36	-R\$ 669,71	-0,04%
73.342-3	COMPREV - BB Previd RF Fluxo	R\$ 2.522.166,99			R\$ 2.524.800,46	R\$ 2.633,47	0,10%
73.334-2	FUNDO PREVIDENCIA - BB Previd RF Fluxo	R\$ 156.448,82	R\$ 7.535,20	R\$ 27.366,20	R\$ 136.782,90	R\$ 165,08	0,11%
703-3	REPARTIÇÃO SIMPLES - Caixa Disponibilidades RF	R\$ 11.748.586,24	R\$ 3.969.598,77	R\$ 3.712.224,51	R\$ 12.019.436,66	R\$ 13.476,16	0,11%
704-1	TAXA ADM - Caixa IDKA2	R\$ 66.179,31	R\$ 68.240,00		R\$ 135.010,34	R\$ 591,03	0,59%
704-1	TAXA ADM - Caixa Disponibilidades	R\$ 799.893,76		R\$ 6.741,20	R\$ 794.125,11	R\$ 972,55	0,12%
73.360-1	TAXA ADM - BB Prev RF IRFM-1	R\$ 7.897.744,81			R\$ 7.899.072,86	R\$ 1.328,05	0,02%
73.360-1	TAXA ADM - BB Previd RF Fluxo	R\$ 5.073.408,78	R\$ 6.042.029,34	R\$ 705.769,95	R\$ 10.417.900,26	R\$ 8.232,09	0,11%
73.360-1	TAXA ADM - BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 3.719.221,88		R\$ 3.742.917,27	R\$ -	R\$ 23.695,39	0,64%
73.400-4	FRAP - BB Previd RF Fluxo	R\$ 930.025,74		R\$ 1.150,78	R\$ 929.845,18	R\$ 970,22	0,10%
420.000-4	ADIANTAMENTO - BB Previd RF Fluxo	R\$ 0,74	R\$ 1.000,00		R\$ 1.000,85	R\$ 0,11	0,02%
	Conta Corrente	R\$ 14.047,91			R\$ 131.475,71		0,00%
<b>TOTAL TAXA ADM E REPARTIÇÃO SIMPLES</b>		<b>R\$ 35.197.996,44</b>	<b>R\$ 11.134.955,93</b>	<b>R\$ 8.196.169,91</b>	<b>R\$ 38.305.767,80</b>	<b>R\$ 168.985,34</b>	<b>0,46%</b>
<b>RENTABILIDADE CONSOLIDADA DO PREVIMPA</b>		<b>R\$ 3.049.540.221,07</b>	<b>R\$ 118.850.216,16</b>	<b>R\$ 99.629.837,41</b>	<b>R\$ 3.068.416.354,87</b>	<b>-R\$ 344.244,95</b>	<b>-0,01%</b>

## Distribuição por Administrador

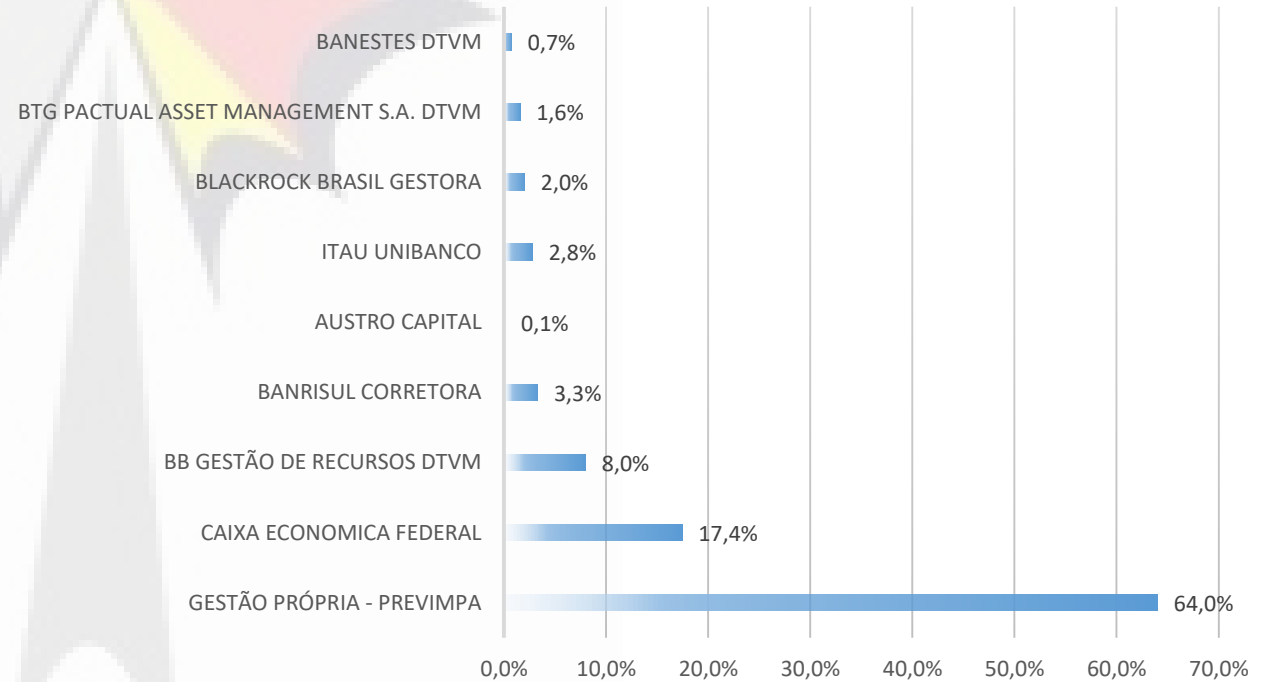
Administrador	Valor por Adm	Distribuição por Administrador
TESOURO NACIONAL	R\$ 1.934.822.308,77	64,0%
Caixa	R\$ 526.994.206,04	17,4%
BB DtvM S.A	R\$ 241.758.798,89	8,0%
Banrisul Corretora	R\$ 99.869.342,66	3,3%
BFL INVESTIMENTOS DE RECURSOS LTDA	R\$ 2.695.859,49	0,1%
Itau Unibanco SA	R\$ 84.329.049,03	2,8%
Banco BNP Paribas Brasil	R\$ 61.085.000,00	2,0%
BTG Pactual Servicos Financeiros SA DtvM	R\$ 47.724.754,87	1,6%
Banestes	R\$ 22.631.267,32	0,7%



## Distribuição por Gestor

Gestor	Valor por Gestor	Distribuição por Gestor
GESTÃO PRÓPRIA - PREVIMPA	1.934.822.308,77	64,0%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	526.994.206,04	17,4%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	241.758.798,89	8,0%
BANRISUL CORRETORA	99.869.342,66	3,3%
AUSTRO CAPITAL	2.695.859,49	0,1%
ITAU UNIBANCO	84.329.049,03	2,8%
BLACKROCK BRASIL GESTORA	61.085.000,00	2,0%
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S.A. D	47.724.754,87	1,6%
BANESTES DTVM	22.631.267,32	0,7%

### 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	1.934.822.308,77			Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100%	100%	70%	1.934.822.308,77	64,03%

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	340.555.214,04	10.861.361.928,63	3,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100%	100%	6%	577.250.415,59	19,10%
BB Prev RF Idka 2 FI	136.827.105,37	8.957.703.037,59	1,53%						
Banrisul Foco Idka IPCA 2a FI RF	99.868.096,18	1.224.778.692,77	8,15%						
Caixa FIC Brasil Disponibilidades RF	324.519,46	578.878.506,99	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40%	40%	1%	610.457,28	0,02%
BB Prev RF Fluxo Fc FI	284.691,34	2.383.075.266,03	0,01%						
Banrisul Automatico FI RF CP	1.246,48	825.628.271,18	0,00%						



## Enquadramento Renda Variável

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
It Now Ibov	58.515.000,00	7.839.867.666,52	0,75%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30%	30%	6%	119.600.000,00	3,96%
Ishares S&P 500	61.085.000,00	4.099.343.060,14	1,49%						
Caixa FIA Infraestrutura	18.475.888,38	516.318.796,70	3,58%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20%	20%	4%	297.321.753,32	9,84%
Caixa FIC FIA Acoes Multigestor	75.332.932,05	1.025.557.184,19	7,35%						
BB Acoes Retorno Total Fc	19.098.819,57	1.426.940.800,09	1,34%						
BB Acoes Tecnologia Bdr Nivel I FI	22.530.580,85	829.359.648,73	2,72%						
BB Acoes Exportacao Fc FI	14.052.663,24	188.365.713,55	7,46%						
BB Acoes Energia FI	48.964.938,52	468.515.870,91	10,45%						
BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	47.724.754,87	2.831.568.584,73	1,69%						
Banestes FICFI Acoes BTG Absol. Inst	22.631.267,32	228.677.604,87	9,90%						
Itau Asgard Institucional Acoes FI	25.814.049,03	377.870.733,24	6,83%						
Austro Institucional Pipe Bancos FIC FIA	2.695.859,49	21.584.332,75	12,49%						
Caixa FIA Institucional Bdr Nivel I	92.305.652,11	2.719.540.696,03	3,39%	Artigo 9º - A, Inciso III	10%	10%	5%	92.305.652,11	3,05%

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

# Carteira de Títulos públicos

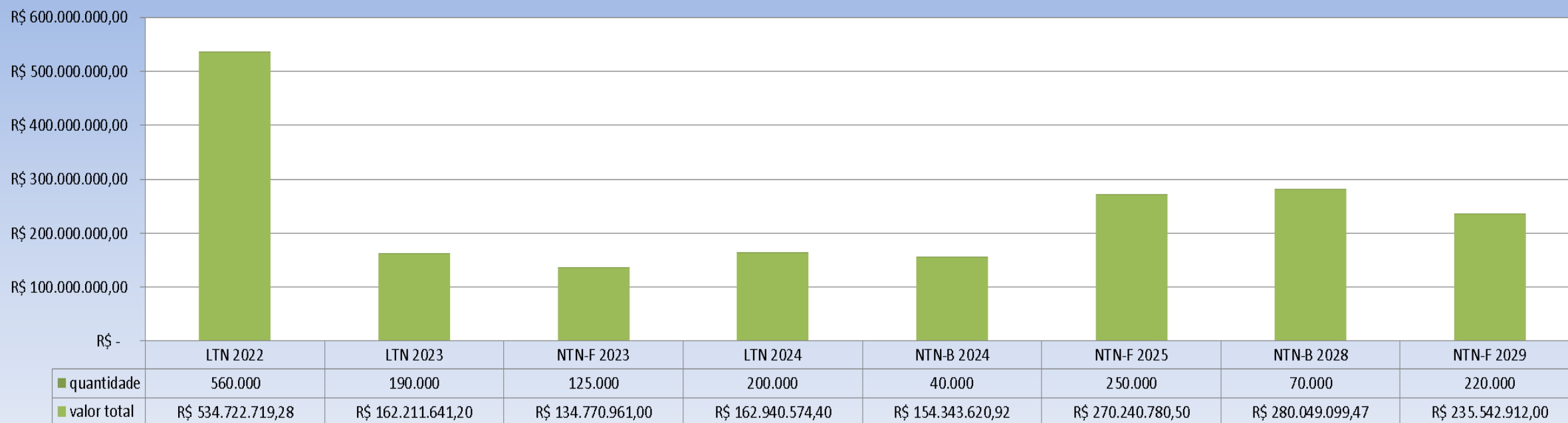
Cód. Papel	Vencimento	Data Compra	Qtde. Total	PU Compra	Preço Unitário	Taxa %	Valor Total à Mercado	Valor Total na Curva	%PL
Títulos Públicos									
LTN									
LTN20220101 - 100000	01/01/2022	21/03/2018	80.000	727,41891400	966,58131300	8,799000	77.326.505,04	75.046.533,28	4,00%
LTN20220101 - 100000	01/01/2022	09/04/2018	200.000	732,97834600	966,58131300	8,694000	193.316.262,60	187.753.685,60	9,99%
LTN20220401 - 100000	01/04/2022	07/02/2020	160.000	898,51867100	950,84737700	5,140000	152.135.580,32	152.147.783,20	7,86%
LTN20220701 - 100000	01/07/2022	26/06/2019	120.000	825,38325200	932,86976100	6,579000	111.944.371,32	110.813.250,48	5,79%
LTN20230701 - 100000	01/07/2023	14/06/2019	190.000	753,63622400	853,74548000	7,260000	162.211.641,20	162.326.472,82	8,38%
LTN20240101 - 100000	01/01/2024	03/01/2020	200.000	787,45838900	814,70287200	6,200000	162.940.574,40	169.587.919,40	8,42%
Total LTN:			950.000				859.874.934,88	857.675.644,78	44,44%
NTN-PÓS									
NTNB20240815 - 760199	15/08/2024	17/12/2020	40.000	3.987,99033100	3.858,59052300	1,629008	154.343.620,92	160.790.071,88	7,98%
NTNB20280815 - 760199	15/08/2028	06/06/2019	20.000	3.820,89142600	4.000,70142100	3,819000	80.014.028,42	79.729.181,14	4,14%
NTNB20280815 - 760199	15/08/2028	06/06/2019	20.000	3.820,89142600	4.000,70142100	3,819000	80.014.028,42	79.729.181,14	4,14%
NTNB20280815 - 760199	15/08/2028	06/06/2019	30.000	3.820,89142600	4.000,70142100	3,819000	120.021.042,63	119.593.771,71	6,20%
Total NTN-PÓS:			110.000				434.392.720,39	439.842.205,87	22,45%

# 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	1.078,16768800	9,429000	26.954.192,20	25.797.248,90	1,39%
NTNF20230101 - 950199	01/01/2023	13/10/2017	50.000	1.052,64080900	1.078,16768800	9,400000	53.908.384,40	51.613.673,20	2,79%
NTNF20230101 - 950199	01/01/2023	17/10/2017	50.000	1.051,66190700	1.078,16768800	9,444000	53.908.384,40	51.585.104,40	2,79%
NTNF20250101 - 950199	01/01/2025	13/10/2017	60.000	1.049,13298400	1.080,96312200	9,604000	64.857.787,32	62.107.828,38	3,35%
NTNF20250101 - 950199	01/01/2025	14/11/2018	140.000	1.038,99625800	1.080,96312200	9,959000	151.334.837,08	143.620.813,14	7,82%
NTNF20250101 - 950199	01/01/2025	14/11/2018	50.000	1.037,69901300	1.080,96312200	9,989000	54.048.156,10	51.253.414,30	2,79%
NTNF20290101 - 950199	01/01/2029	08/11/2019	140.000	1.257,99416700	1.070,64960000	6,619000	149.890.944,00	170.866.832,64	7,75%
NTNF20290101 - 950199	01/01/2029	12/11/2019	10.000	1.254,15538900	1.070,64960000	6,679000	10.706.496,00	12.165.779,33	0,55%
NTNF20290101 - 950199	01/01/2029	08/07/2020	50.000	1.218,63214500	1.070,64960000	6,529000	53.532.480,00	61.317.952,80	2,77%
NTNF20290101 - 950199	01/01/2029	08/07/2020	20.000	1.218,63214500	1.070,64960000	6,529000	21.412.992,00	24.527.181,12	1,11%
Total NTN-PRÉ:			595.000				640.554.653,50	654.855.828,21	33,11%
<b>Total Títulos Públicos:</b>			<b>1.655.000</b>				<b>R\$ 1.934.822.308,77</b>	<b>R\$ 1.952.373.678,86</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
3,12	2,93	2,93%	-R\$ 56.714.399,46	-R\$ 5.671,44	20,94 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>	-0,38	-1,64	1,15	4,18	12,86	-1,64
Títulos Públicos da carteira Previmpa	-1,21	-4,2464	-0,3968	4,7041	15,9512	-4,2464

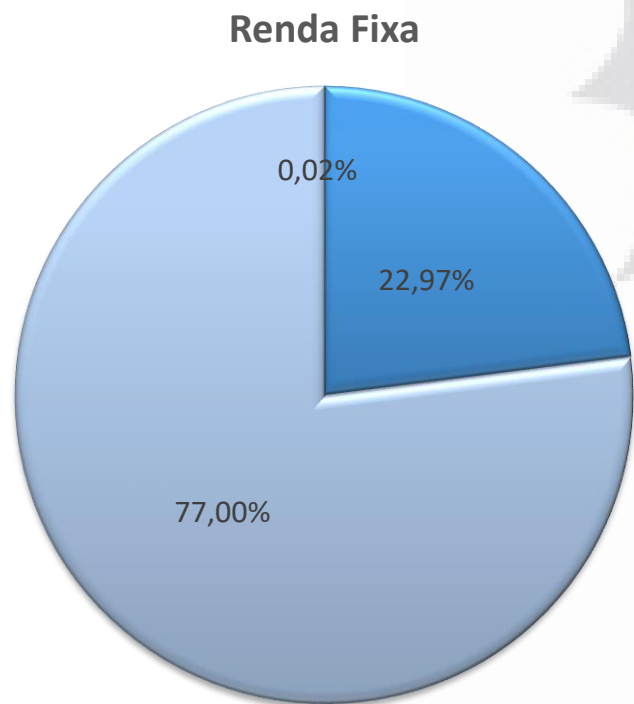
Fundos de Renda fixa	1 mês	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	No ano	VaR 95% 1 M	Volatilid ade	Sortino 12M	Sharpe 12M	Beta 12M
<b>BENCHMARK CDI</b>	<b>0,20</b>	<b>0,49</b>	<b>0,96</b>	<b>2,22</b>	<b>7,78</b>	<b>0,49</b>					
Caixa FIC Brasil Disponibilidades RF	0,12	0,28	0,54	1,37	5,99	0,28	0,00%	0,03%	-1608,61%	-163,55	0,00
BB Prev RF Fluxo Fc FI	0,10	0,23	0,45	1,12	5,47	0,23	0,00%	0,15%	-923,36%	-7,61	0,00
Banrisul Automatico FI RF CP	0,05	0,09	0,15	0,31	1,19	0,09	0,00%	0,01%	-1562,55%	-65,05	0,00
<b>BENCHMARK IDKA 2A</b>	<b>0,29</b>	<b>-0,05</b>	<b>3,00</b>	<b>8,57</b>	<b>18,47</b>	<b>-0,05</b>					
Caixa FI Brasil Idka IPCA 2a RF LP	0,37	-0,02	3,02	8,45	17,15	-0,02	0,37%	2,73%	314,75%	2,26	0,07
BB Prev RF Idka 2 FI	0,37	0,00	3,22	8,63	17,08	0,00	0,36%	2,62%	343,85%	2,43	0,07
Banrisul Foco Idka IPCA 2a FI RF	0,28	-0,20	2,73	7,93	16,74	-0,20	0,36%	2,75%	284,04%	2,06	0,08



## Rentabilidade e Risco Renda Variável

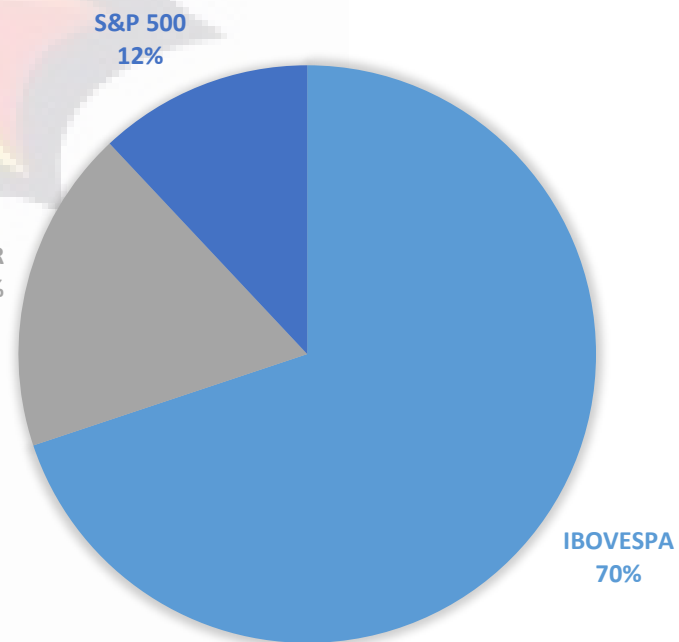
Fundos Renda Variável	1 mês	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	No ano	VaR 95% 1M	Volatilid ade 12M	Sortino 12M	Sharpe	Beta 12M
<b>BENCHMARK IBOVESPA</b>	<b>6,00</b>	<b>-2,00</b>	<b>23,29</b>	<b>59,73</b>	<b>22,24</b>	<b>-2,00</b>					
Caixa FIA Infraestrutura	6,20	-3,50	16,71	52,62	33,08	-3,50	3,04%	28,42%	304,48%	1,97	1,02
Caixa FIC FIA Acoes Multigestor	3,18	-2,28	16,12	54,35	N.A.	-2,28	2,48%	25,14%	353,18%	2,24	0,93
BB Acoes Retorno Total Fc	7,08	2,28	23,12	50,44	35,35	2,28	2,08%	23,64%	333,37%	2,19	0,82
BB Acoes Tecnologia Bdr Nivel I FI	-1,48	4,55	15,47	60,65	71,88	4,55	2,24%	22,86%	410,16%	2,71	0,37
BB Acoes Exportacao Fc FI	7,87	10,63	35,41	90,70	54,14	10,63	2,05%	22,81%	672,28%	4,04	0,58
BB Acoes Energia FI	8,84	-3,26	16,78	34,43	28,72	-3,26	2,53%	24,44%	227,03%	1,46	0,90
Itau Asgard Institucional Acoes FI	1,70	-3,02	21,78	N.A	N.A	-3,02	2,15%	N.A	N.A	N.A	N.A
Austro Institucional Pipe Bancos FIC FIA	0,21	-21,35	-28,08	-56,73	-72,27	-21,35	2,67%	35,16%	-198,44%	-1,58	-0,05
It Now Ibov	6,19	-2,09	23,14	59,92	22,17	-2,09	2,58%	27,15%	366,78%	2,35	1,01
BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	1,73	-1,46	10,75	64,29	42,15	-1,46	2,84%	26,38%	414,64%	2,53	0,76
Banestes FICFI Acoes BTG Absol. Inst	1,72	-1,46	10,67	63,92	41,93	-1,46	2,83%	26,27%	413,70%	2,53	0,76
<b>BENCHMARK BDR</b>	<b>3,08</b>	<b>13,67</b>	<b>15,61</b>	<b>65,34</b>	<b>109,56</b>	<b>13,67</b>					
Caixa FIA Institucional Bdr Nivel I	3,43	13,29	14,78	64,18	108,61	13,29	2,28%	24,13%	425,06%	2,73	0,02
Ishares S&P 500	5,28	15,79	19,23	68,16	105,84	15,79	2,73%	23,78%	486,15%	2,98	0,06

## Distribuição dos Fundos por Benchmarck



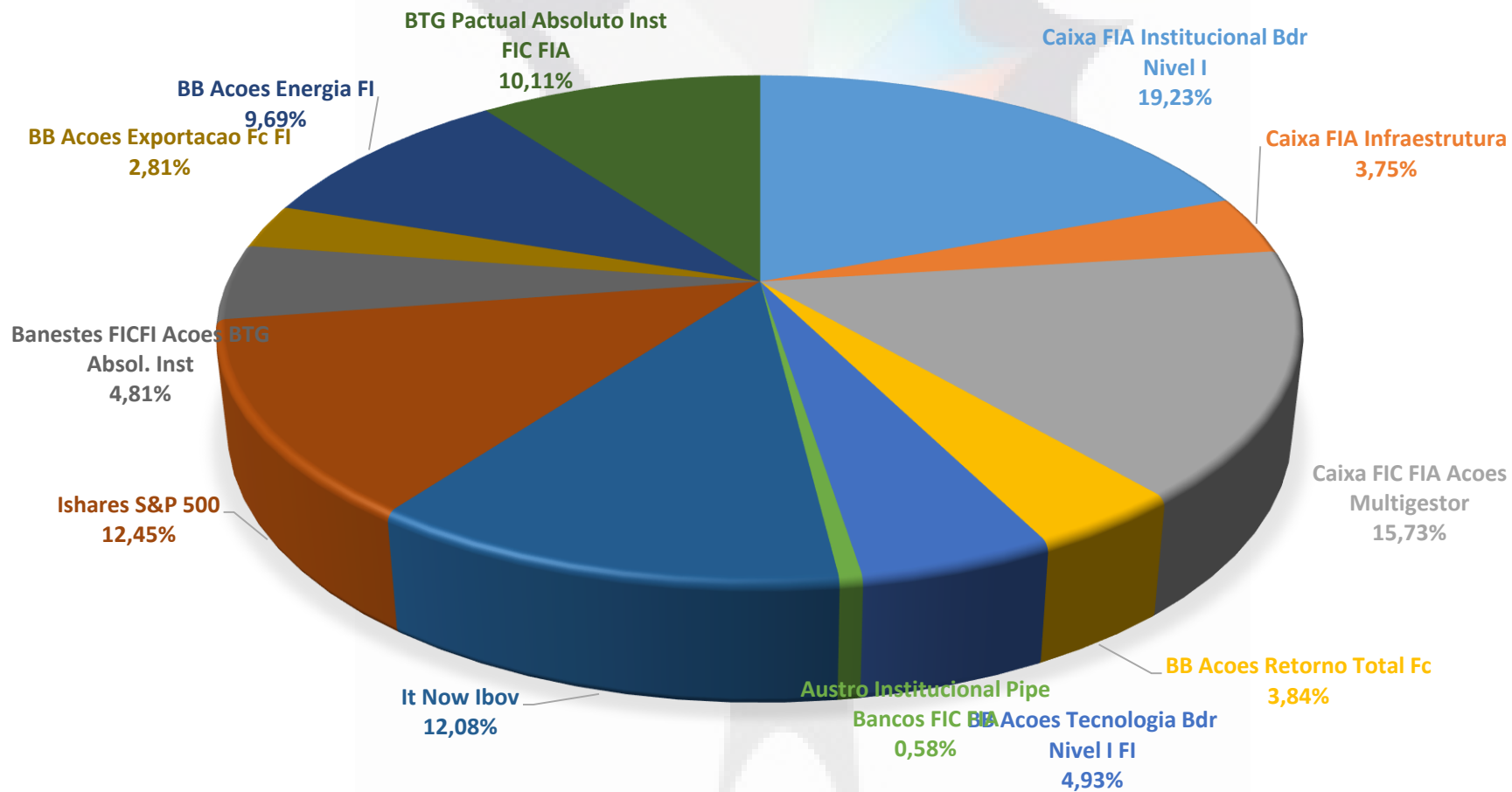
■ CDI ■ IDKA 2A ■ TÍTULOS

### DISTRIBUIÇÃO DO FUNDO DE RENDA VARIÁVEL

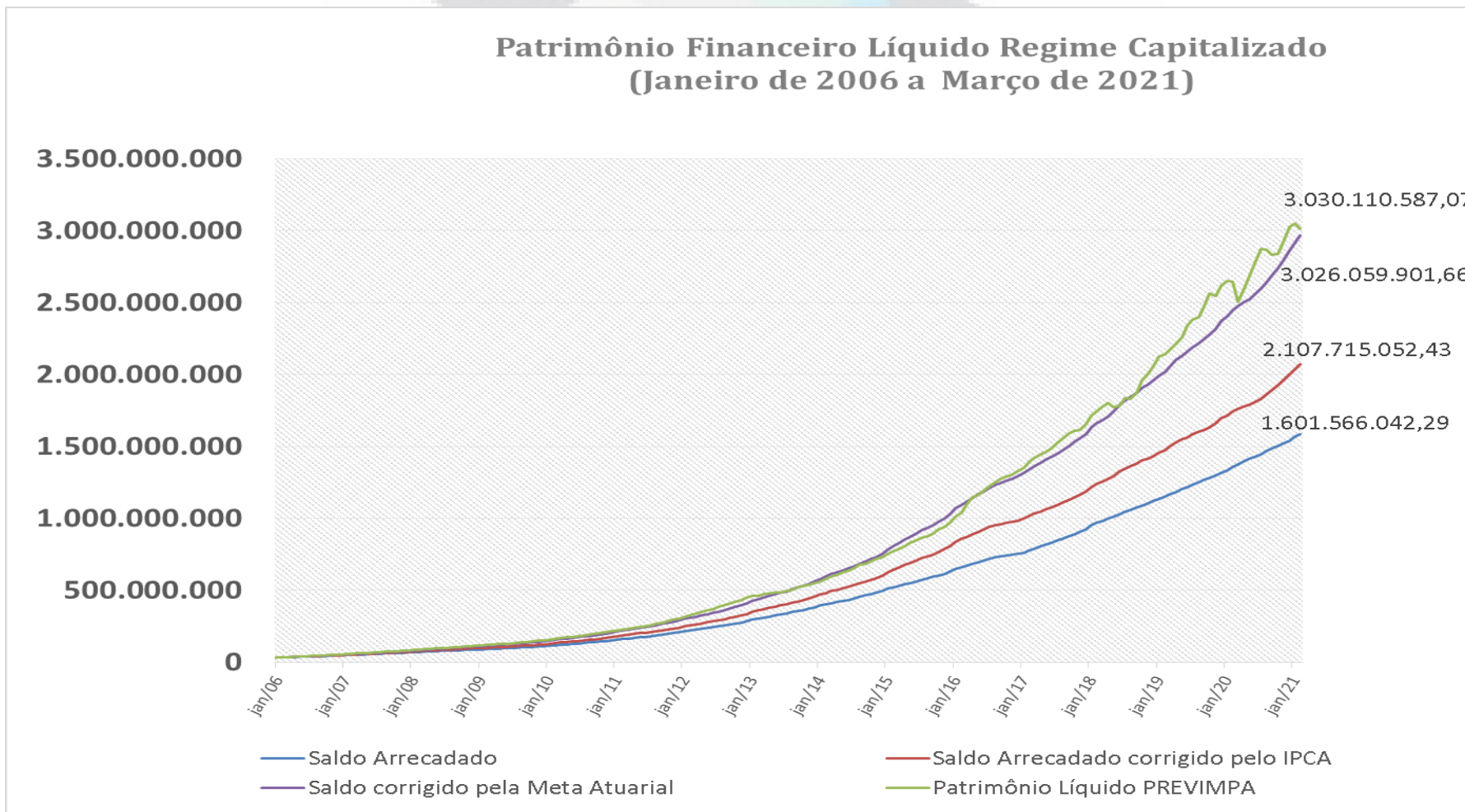


UINV/DAF

## Distribuição dos Fundos Renda Variável



### Patrimônio Financeiro Líquido Regime Capitalizado (Janeiro de 2006 a Março 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 IRFM-1	10.740.670/0001-06	0,20%	Não há	D+0	D+0	Não há	17:00
			Caixa IDKA IPCA RF LP	14.386.926/0001-71	0,20%	Não há	D+0	D+0	Não há	16:00
BB Gestão de Recursos DTVM	BB Gestão de Recursos DTVM	Banco do Brasil	BB RPPS RF Fluxo	13.077.415/0001-05	1,00%	Não há	D+0 Abertura	D+0	Não há	23:00
			BB 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 Recursos DTVM	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
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
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
BNB Paribas	Black Rock	Banrisul Corretora	ETF IVVB 11	19.909.560/0001-91	0,24%	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