

# Relatório de Acompanhamento de Resultados e Riscos da Carteira de Investimentos do PREVIMPA

Competência: Setembro/2022





# Demonstrativo do Desempenho Mensal da Carteira

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\$)
jan/22	R\$ 3.154.964.155,75	R\$ 69.471.980,88	R\$ 36.144.899,96	R\$ 33.327.080,92	R\$ 33.327.080,92	R\$ 3.230.683.656,04	R\$ 42.392.419,37	R\$ 42.392.419,37
fev/22	R\$ 3.230.683.656,04	R\$ 87.002.804,30	R\$ 71.310.594,01	R\$ 15.692.210,29	R\$ 49.019.291,21	R\$ 3.265.299.333,13	R\$ 18.923.466,80	R\$ 61.315.886,17
mar/22	R\$ 3.265.299.333,13	R\$ 103.392.793,57	R\$ 87.144.067,77	R\$ 16.248.725,80	R\$ 65.268.017,01	R\$ 3.353.916.867,26	R\$ 72.368.808,33	R\$ 133.684.694,50
abr/22	R\$ 3.353.916.867,26	R\$ 65.477.387,21	R\$ 49.441.585,35	R\$ 16.035.801,86	R\$ 81.303.818,87	R\$ 3.364.693.633,27	-R\$ 5.259.035,85	R\$ 128.425.658,65
mai/22	R\$ 3.364.693.633,27	R\$ 1.954.927.861,17	R\$ 1.943.046.703,64	R\$ 11.881.157,53	R\$ 93.184.976,40	R\$ 3.401.909.276,81	R\$ 25.334.486,01	R\$ 153.760.144,66
jun/22	R\$ 3.401.909.276,81	R\$ 72.987.267,99	R\$ 66.371.218,72	R\$ 6.616.049,27	R\$ 99.801.025,67	R\$ 3.369.708.517,17	-R\$ 38.816.808,91	R\$ 114.943.335,75
jul/22	R\$ 3.369.708.517,17	R\$ 1.561.152.577,75	R\$ 1.559.115.451,79	R\$ 2.037.125,96	R\$ 101.838.151,63	R\$ 3.395.161.719,04	R\$ 23.416.075,91	R\$ 138.359.411,66
ago/22	R\$ 3.395.161.719,04	R\$ 956.562.940,49	R\$ 948.218.937,47	R\$ 8.344.003,02	R\$ 110.182.154,65	R\$ 3.453.639.667,26	R\$ 50.133.945,20	R\$ 188.493.356,86
set/22	R\$ 3.453.639.667,26	R\$ 611.212.293,38	R\$ 602.748.028,93	R\$ 8.464.264,45	R\$ 118.646.419,10	R\$ 3.482.957.464,01	R\$ 20.853.532,30	R\$ 209.346.889,16
out/22								
nov/22								
dez/22								
TOTAL ANO	R\$ 3.154.964.155,75	R\$ 5.482.187.906,74	R\$ 5.363.541.487,64	R\$ 118.646.419,10		R\$ 3.482.957.464,01	R\$ 209.346.889,16	



# Indicadores Performance do Fundo do Regime Capitalizado: 2022

Competência	% Retorno Mensal	% Retorno Acumulado (ano)	IPCA (mês)	IPCA (ano)	Meta Atuarial ( mês)	Meta Atuarial Acumulada (ano)
jan/22	1,34%	1,34%	0,54%	0,54%	0,94%	0,94%
fev/22	0,58%	1,93%	1,01%	1,56%	1,42%	2,37%
mar/22	2,21%	4,19%	1,62%	3,20%	2,03%	4,45%
abr/22	-0,16%	4,02%	1,06%	4,29%	1,47%	5,98%
mai/22	0,75%	4,80%	0,47%	4,78%	0,87%	6,90%
jun/22	-1,14%	3,59%	0,67%	5,49%	1,07%	8,05%
jul/22	0,69%	4,32%	-0,68%	4,77%	-0,28%	7,75%
ago/22	1,47%	5,87%	-0,36%	4,39%	0,04%	7,79%
set/22	0,60%	6,51%	-0,29%	4,09%	0,11%	7,91%
out/22						
nov/22						
dez/22						
		6,51%		4,09%		7,91%

Meta Atuarial de 2022: IPCA+4,92%





# Rentabilidade X Meta







# Performance do Fundo do Regime Capitalizado – 2010 à 2022

ANO	Pat	rimônio Líquido Inicial (R\$)		Aplicação (R\$)		Resgate (R\$)	Flu	xo de Caixa (R\$)	Pa	trimônio Líquido Final (R\$)	Ret	orno Acumulado Anual (R\$)	% Retorno Anual	Meta Anual	IPCA
2022	R\$	3.154.964.155,75	R\$	5.482.187.906,74	R\$	5.363.541.487,64	R\$	118.646.419,10	R\$	3.482.957.464,01	R\$	209.346.889,16	6,51%	7,91%	4,09%
2021	R\$	3.035.629.264,65	R\$	9.249.817.083,32	R\$	9.031.266.713,14	R\$	218.550.370,18	R\$	3.154.964.155,75	-R\$	99.215.479,08	-3,15%	16,05%	10,06%
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%

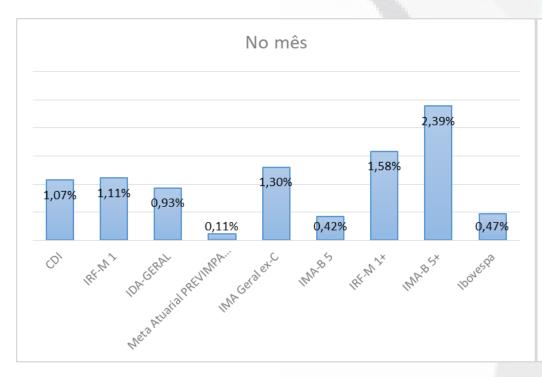


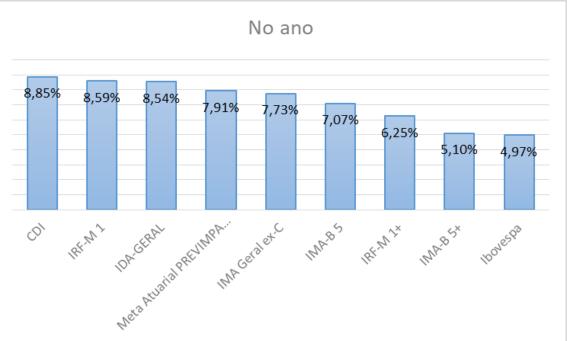


# Performance do Fundo do Regime Capitalizado – 2010 à 2022



# Benchmark







### Composição da Carteira e Movimentações : Fundo do Regime Capitalizado

Títulos Públicos da Carteira Previmpa	Saldo Anterior		Aplicações		Resgates		Saldo Atual		Retorno	Retorno(%)
Títulos Públicos Federais	R\$ 2.285.817.798,22	R\$	582.799.956,03	R\$	577.373.575,61	R\$	2.307.382.911,12	R\$	16.138.732,48	0,71%

Fundos Renda Fixa	S	aldo Anterior		Aplicações		Resgates		Saldo Atual		Retorno	Retorno(%)
Caixa FIC Brasil Disponibilidades RF	R\$	902.967,98	R\$	5.426.380,42	R\$	5.435.652,63	R\$	902.067,10	R\$	8.371,33	0,93%
Caixa FI Brasil RF Ref DI LP	R\$	203.210.033,63	R\$	14.846.129,99	R\$	18.379.753,61	R\$	202.022.127,89	R\$	2.345.717,88	1,16%
BB Prev Fluxo RF Simples Fc FI	R\$	1.212.917,79	R\$	3.051.159,35	R\$	974.598,24	R\$	3.305.647,53	R\$	16.168,63	0,72%
BB Prev Fluxo RF Simples Fc FI	R\$	445.872,17			R\$	449.154,44	R\$	-	R\$	3.282,27	1,48%
BB Prev RF Ref DI LP Perfil Fc	R\$	181.038.102,52					R\$	183.016.214,13	R\$	1.978.111,61	1,09%
Banrisul Automatico FI RF CP	R\$	329.591,60	R\$	135.294,40	R\$	115.221,18	R\$	352.555,07	R\$	2.890,25	0,85%
Banrisul Absoluto	R\$	137.359.244,23					R\$	138.857.694,89	R\$	1.498.450,66	1,09%
Itau Institucional RF Ref DI FI	R\$	31.239.133,04					R\$	31.588.530,14	R\$	349.397,10	1,12%
Itau Institucional Optimus RF LP Fc	R\$	23.932.888,15					R\$	24.217.980,19	R\$	285.092,04	1,19%
BTG Pact Cre Cor I FICFI RF Cred Priv	R\$	61.718.567,18					R\$	62.495.816,64	R\$	777.249,46	1,26%
Sant RF Cred Priv Crescimento Inst FI LP	R\$	100.880.675,33					R\$	102.050.106,67	R\$	1.169.431,34	1,16%
TOTAL DOS FUNDO DE RENDA FIXA	R\$	742.269.993,62	R\$	23.458.964,16	R\$	25.354.380,10	R\$	748.808.740,25	R\$	8.434.162,57	1,14%
TOTAL DA RENDA FIXA	R\$	3.028.087.791,84	R\$	606.258.920,19	R\$	602.727.955,71	R\$	3.056.191.651,37	R\$	24.572.895,05	0,81%





### Composição da Carteira e Movimentações: Fundo do Regime Capitalizado

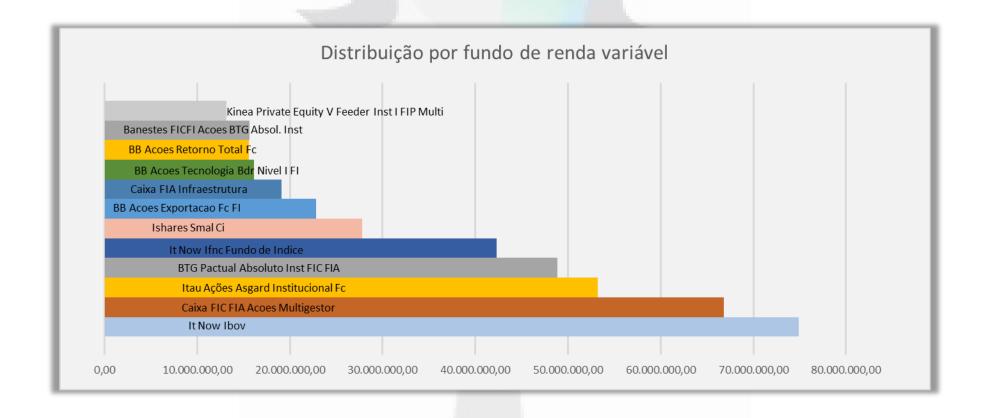
Fundos Renda Variável	Sa	aldo Anterior	А	plicações	R	esgates		Saldo Atual		Retorno	Retorno(%)
It Now Ifnc Fundo de Indice	R\$	40.976.000,00					R\$	42.320.000,00	R\$	1.344.000,00	3,28%
It Now Ibov	R\$	75.392.917,16					R\$	74.925.605,69	-R\$	467.311,47	-0,62%
Ishares Smal Ci	R\$	28.503.347,10					R\$	27.771.126,60	-R\$	732.220,50	-2,57%
BB Acoes Retorno Total Fc	R\$	16.026.348,59					R\$	15.567.960,59	-R\$	458.388,00	-2,86%
BB Acoes Tecnologia Bdr Nivel I FI	R\$	16.508.172,62					R\$	16.136.036,72	-R\$	372.135,90	-2,25%
BB Acoes Exportacao Fc FI	R\$	24.012.384,70					R\$	22.811.915,33	-R\$	1.200.469,37	-5,00%
Caixa FIC FIA Acoes Multigestor	R\$	67.294.430,21					R\$	66.827.809,73	-R\$	466.620,48	-0,69%
Caixa FIA Infraestrutura	R\$	19.840.136,00					R\$	19.074.741,04	-R\$	765.394,96	-3,86%
Banestes FICFI Acoes BTG Absol. Inst	R\$	15.693.739,70					R\$	15.646.132,92	-R\$	47.606,78	-0,30%
BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	R\$	48.980.211,73					R\$	48.826.352,04	-R\$	153.859,69	-0,31%
Itau Ações Asgard Institucional Fc	R\$	53.589.352,70					R\$	53.240.027,50	-R\$	349.325,20	-0,65%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$	406.817.040,51	R\$	-	R\$	-	R\$	403.147.708,16	-R\$	3.669.332,35	-0,90%

RENTABILIDADE DO REGIME CAPITALIZADO	R\$ 3.434.904.832,35	R\$	606.258.920,19	Rς	602.727.955,71	RŚ	3.459.339.359,53	R¢	20.903.562,70	0,61%
RENTABLIDADE DO REGIME CAFTTALIZADO	117 3.434.304.632,33	ריו	000.238.320,13	רְי	002.727.933,71	?	3.433.333.333,33	ריו	20.903.302,70	0,0170

OUTROS ATIVOS	S	aldo Atual	Aplicações		Resgates		Saldo Atual		Retorno	Retorno(%)
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INST I FIP MULTI	R\$	8.309.210,97	4.953.373,19			R\$	13.159.163,46	-R\$	103.420,70	-0,96%
TERRENO	R\$	8.240.000,00				R\$	8.240.000,00	R\$	-	0,00%
113.982 AÇÕES BANRISUL ON N1	R\$	1.414.516,62		R\$	12.539,38	R\$	1.422.495,36	R\$	20.518,12	1,46%
68.482 AÇÕES BANRISUL PNB N1	R\$	771.107,32		R\$	7.533,84	R\$	796.445,66	R\$	32.872,18	4,28%



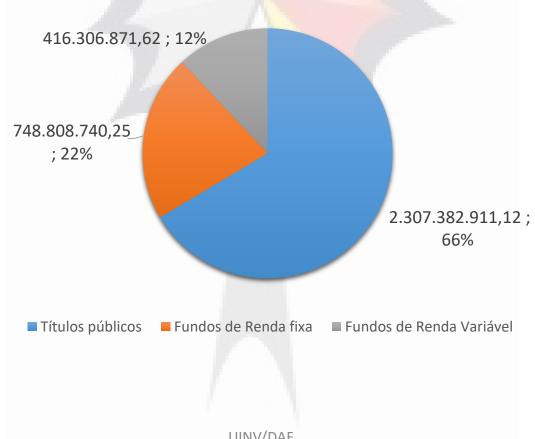








# Distribuição da Carteira do Fundo Capitalizado por Segmento de Ativo





#### 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)



# Ativos de Renda Fixa: Acompanhamento Risco X Retorno

Títulos Públicos	1 mês	3 meses	6 meses	12 meses	36 meses	No ano	VaR 95%	Volatilid	Beta CDI	Sortino	Sharpe 12M
							1 M	ade 12M	12M	12M	
BENCHMARCK IMA EX-C	1,30%	3,31%	4,79%	9,15%	15,75%	7,66%					
NTN-B 760199 20240815	0,50%	0,33%	2,05%	8,57%	23,19%	6,34%	1,46%	3,21%	-0,24	-0,92	-0,65
LFT 210100 20270301	1,14%	3,25%	6,40%	11,83%		9,52%	0,02%	0,22%	0,81	9,10	3,76
LFT 210100 20270901	1,12%	3,22%	6,41%	12,09%		9,66%	0,02%	0,26%	0,69	8,74	4,05
LFT 210100 20280901	1,10%	3,16%					0,04%				

Fundos de Renda fixa	1 mês	3 meses	6 meses	12 meses	36 meses	No ano	VaR 95% 1 M	Volatilid ade	Beta CDI 12M	Sortino 12M	Sharpe 12M
BENCHMARCK CDI	1,07%	3,21%	6,27%	10,90%	18,30%	8,89%					
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,93%	2,80%	5,42%	9,21%	14,44%	7,61%	0,00%	0,13%	0,96	-15,80	-11,72
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,99%	2,96%	5,73%	9,78%	14,55%	8,07%	0,00%	0,14%	1,01	-15,49	-7,30
BANRISUL AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,89%	2,64%	5,11%	8,57%	10,72%	7,14%	0,08%	0,14%	0,96	-14,60	-14,63
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,12%	3,30%	6,52%	11,70%	19,29%	9,49%	0,01%	0,17%	0,93	13,77	4,27
BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	1,09%	3,23%	6,22%	11,10%	17,83%	9,03%	0,01%	0,14%	0,93	4,40	1,30
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,09%	3,25%	6,30%	11,18%	18,21%	9,08%	0,02%	0,14%	0,96	8,32	1,82
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,11%	3,23%	6,35%	11,18%	18,22%	9,12%	0,03%	0,16%	0,97	5,47	1,61
SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA CRÉDITO	1,16%	3,45%	6,83%	12,04%	19,92%	9,77%	0,01%	0,21%	0,97	13,23	4,85
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RENDA FIXA CRÉDITO P	1,26%	3,57%	7,12%	12,89%	19,41%	10,38%	0,05%	0,26%	0,85	16,10	6,79
BENCHMARCK IMA-B 5	0,42%	0,72%	2,78%	9,25%	24,15%	7,07%					
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	1,19%	3,19%	6,56%	12,89%	N.A.	9,83%	0,36%	0,91%	0,03	3,56	1,96



# Ativos de Renda Variável: Acompanhamento Risco X Retorno

Fundos Renda Variável	1 mês	3 meses	6 meses	12 meses	36 meses	No ano	VaR 95%	Volatilid	Beta IBOV	Sortino	Sharpe
							1M	ade 12M	12M	12M	
BENCHMARCK IBOVESPA	0,47%	11,59%	-9,4 <mark>9%</mark>	-0,85%	4,72%	4,97%		19,94%			
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	-3,86%	9,80%	-5,72 <mark>%</mark>	4,03%	15,21%	8,48%	10,84%	22,44%	0,98	0,73	0,24
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-0,69%	11,62%	-8,01%	-8,05%	0,34%	2,56%	10,03%	20,20%	0,92	-1,23	-0,37
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-2,86%	10,39%	-9,13%	-13,85%	-6,35%	-4,12%	9,19%	19,64%	0,94	-3,00	-0,72
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-2,25%	13,85%	-12,18%	-28,37%	5,05%	-21,11%	8,82%	25,82%	0,76	-1,98	-1,21
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	-5,00%	0,09%	-19,43%	-21,43%	20,12%	-18,57%	11,20%	20,51%	0,90	-2,91	-1,13
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-0,31%	13,64%	-11,36%	-20,04%	-19,68%	-0,74%	9,85%	24,62%	1,03	-2,01	-0,83
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-0,30%	13,58%	-11,22%	-19,91%	-19,59%	-0,71%	9,78%	24,46%	1,02	-2,01	-0,83
ITAÚ ASGARD INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-0,65%	14,87%	-6,49%	-13,28%	N.A.	-1,99%	8,69%	21,21%	1,00	-2,39	-0,62
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	0,48%	11,69%	-9,28%	-0,41%	5,27%	5,31%	11,17%	19,95%	1,00	20,24	0,02
ISHARES BM&FBOVESPA SMALL CAP FUNDO DE ÍNDICE - SMAL11	-1,83%	14,51%	-15,61%	-18,12%	-6,63%	-7,85%	12,15%	28,22%	1,17	-1,49	-0,61
IT NOW IFNC FUNDO DE ÍNDICE - FIND11	3,07%	17,78%	-4,97%	5,75%	-11,58%	18,99%	11,66%	23,98%	1,00	0,81	0,31

Risco da carteira total Previmpa VAR 95% 1 M da carteira do PREVIMPA: 1,42%





# Composição da Carteira Taxa Administração e Repartição Simples: Movimentações

Taxa de Admistração e Repartição Simples		Saldo Atual		Aplicações		Resgates		Saldo Atual		Retorno	Retorno(%)
COMPREV - BB Previd RF Fluxo	R\$	3.320.171,33	R\$	167,63			R\$	3.353.351,39	R\$	33.012,43	0,99%
COMPREV - BB Previd RF Perfil	R\$	5.125.902,59	R\$	1.085.826,74			R\$	6.276.789,22	R\$	65.059,89	1,15%
FUNDO PREVIDENCIA - BB Previd RF Fluxo	R\$	274.393,68	R\$	9.433,51	R\$	4.491,47	R\$	282.106,17	R\$	2.770,45	1,00%
REPARTIÇÃO SIMPLES - Caixa Disponibilidades RF	R\$	4.909.584,12	R\$	3.767.112,80	R\$	4.989.742,32	R\$	3.714.299,15	R\$	27.344,55	0,64%
REPARTIÇÃO SIMPLES - Caixa Brasil DI	R\$	11.073.702,32	R\$	1.900.000,00			R\$	13.115.092,74	R\$	141.390,42	1,18%
TAXA ADM - Caixa Disponibilidades	R\$	20.691,37			R\$	3.694,16	R\$	17.187,09	R\$	189,88	1,01%
TAXA ADM - Caixa Brasil DI	R\$	78.409,40	R\$	73.590,00			R\$	153.640,46	R\$	1.641,06	1,42%
TAXA ADM - BB Previd RF Fluxo	R\$	3.002.106,01	R\$	1.348.217,81	R\$	969.628,49	R\$	3.412.608,52	R\$	31.913,19	1,00%
TAXA ADM - BB Previd RF Perfil	R\$	12.866.411,16					R\$	13.006.995,92	R\$	140.584,76	1,09%
FRAP - BB Previd RF Fluxo	R\$	1.854.908,34	R\$	181.406,84	R\$	1.364,46	R\$	2.054.847,10	R\$	19.896,38	1,02%
ADIANTAMENTO - BB Previd RF Fluxo	R\$	35,54	R\$	1.000,00	R\$	140,00	R\$	905,29	R\$	9,75	2,09%
Conta Corrente	R\$	14.966,20					R\$	667,74			
TOTAL TAXA ADM E REPARTIÇÃO SIMPLES	R\$	42.541.282,06	R\$	8.366.755,33	R\$	5.969.060,90	R\$	45.388.490,79	R\$	449.514,30	1,03%





# Gestor e Administrador

Admistrador	Gestor		Valor	Distribuição	
Tesouro Nacional	Gestão Própria - PREVIMPA	R\$	2.307.382.911,12	66,4%	
Caixa Econômica Federal	Caixa DTVM	R\$	288.826.745,76	8,3%	
BB Gestão de Recursos DTVM	BB Gestão de Recursos DTVM	R\$	240.837.774,30	6,9%	
Itaú Unibanco S.A.	Itaú DTVM	R\$	226.292.143,52	6,5%	
Banco do Estado do Rio Grande do Sul	Banrisul Corretora	R\$	139.210.249,96	4,0%	
BTG Pactual Serviços Financeiros S.A.	BTG Pactual Asset Management S.A. DTVM	R\$	111.322.168,68	3,2%	
Banco Santander S.A.	Santander Brasil Gestão de Recursos LTDA	R\$	102.050.106,67	2,9%	
BNP Paribas	Blackrock Brasil Gestora	R\$	27.771.126,60	0,8%	
Banestes S.A	Banestes DTVM	R\$	15.646.132,92	0,5%	
Intrag DTVM	Kinea Private Equity Investimentos	R\$	13.159.163,46	0,4%	





# Enquadramento dos Ativos de Renda Fixa

	Enguadramento			Participação	Limite por		% Alocado	Limite do	Limite da	Alvo da política
Títulos públicos	Enquadramento resolução CMN 4963	Valor atual	PL do fundo	Previmpa no fundo conf.		Valor por Carteira	% Alocado Carteira	enquadramento	política de	de
	resolução Civily 4905			fundo	Resolução		Carteria	4963	investimentos	investimentos
Títulos da carteira Previmpa	Artigo 7º, Inciso I, Alínea¹a'	2.307.382.911,12	N. A.	N. A.	N. A.	2.307.382.911,12	66,45%	100%	100%	65%

	Enquadramento			Participação	Limite por			Limite do	Limite da	Alvo da política
Fundos de Renda fixa	resolução CMN 4963	Valor atual	PL do fundo	Previmpa no	fundo conf.	Valor por Carteira	% Carteira	enquadramento	política de	de
	resolução Civily 4505			fundo	Resolução			4963	investimentos	investimentos
Banrisul Absoluto	Artico 70 Incico I	138.857.694,89	3.671.232.871,68	3,78%						
Banrisul Automatico FI RF CP	Artigo 7º, Inciso I,	352.555,07	1.576.420.343,66	0,02%	100%	140.112.317,06	4,03%	100%	100%	5%
Caixa FIC Brasil Disponibilidades RF	Alínea'b'	902.067,10	772.946.064,25	0,12%						
BB Prev Fluxo RF Simples Fc FI		3.305.647,53	3.459.949.589,95	0,10%				60%	60%	
Itau Institucional Optimus RF LP Fc	Artico 70 Incico III	24.217.980,19	1.266.201.042,12	1,91%		444.150.499,88	12,79%			
Caixa FI Brasil RF Ref DI LP	Artigo 7º, Inciso III,	202.022.127,89	13.954.428.357,23	1,45%	15%					0,5%
BB Prev RF Ref DI LP Perfil Fc	Alínea ' a '	183.016.214,13	11.894.605.297,71	1,54%						
Itau Institucional RF Ref DI FI		31.588.530,14	3.261.035.114,64	0,97%						
BTG Pact Cre Cor I FICFI RF Cred Priv	Artigo 7º, Inciso V,	62.495.816,64	2.430.442.114,42	2,57%	5%	164.545.923,31	1 7/10/	5%	5%	Ε0/
Sant RF Cred Priv Crescimento Inst FI LP	Alínea'b'	102.050.106,67	2.601.407.696,69	3,92%	5%	104.545.925,51	4,74%			5%





# Enquadramento dos Ativos de Renda Variável

Fundos de Renda Variável	Enquadramento resolução CMN 4963	Valor atual	PL do fundo	•	fundo conf.	Valor por Carteira	% Carteira	Limite do enquadramento	•	Alvo da política de
	•			fundo	Resolução			4963	investimentos	investimentos
Caixa FIA Infraestrutura		19.074.741,04	227.353.961,82	8,39%						
Caixa FIC FIA Acoes Multigestor		66.827.809,73	678.381.558,66	9,85%				35%	35%	1,5%
BB Acoes Retorno Total Fc		15.567.960,59	1.013.771.799,24	1,54%			11,61%			
BB Acoes Tecnologia Bdr Nivel I FI	Artigo 8º, Inciso I	16.136.036,72	465.470.710,98	3,47%	15%	258.130.975,87				
BB Acoes Exportacao Fc FI	Artigo o-, inciso i	22.811.915,33	193.304.214,88	11,80%	15/6	236.130.373,67				
BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA		48.826.352,04	1.434.568.432,69	3,40%						
Banestes FICFI Acoes BTG Absol. Inst		15.646.132,92	153.393.900,60	10,20%						
Itau Ações Asgard Institucional Fc		53.240.027,50	312.881.728,60	17,02%						
It Now Ibov		74.925.605,69	3.527.014.906,74	2,12%						
Ishares Smal Ci	Artigo 8º, Inciso II	27.771.126,60	2.257.985.364,93	1,23%	15%	145.016.732,29				1,5%
It Now Ifnc Fundo de Indice		42.320.000,00	460.206.166,35	9,20%						
Kinea Private Equity V Feeder Inst I FIP Mu	Artigo 10º, Inciso II	13.159.163,46	339.022.155,64	3,88%	15%	13.159.163,46	0,38%	5%	5%	1%

<sup>\*</sup>No Fundo Itaú Ações Asgard Institucional Fc ocorreu desenquadramento passivo pelo 60º dia, tendo prazo para adequação de 180 dias conforme artigo 27, da resolução 4963/21.



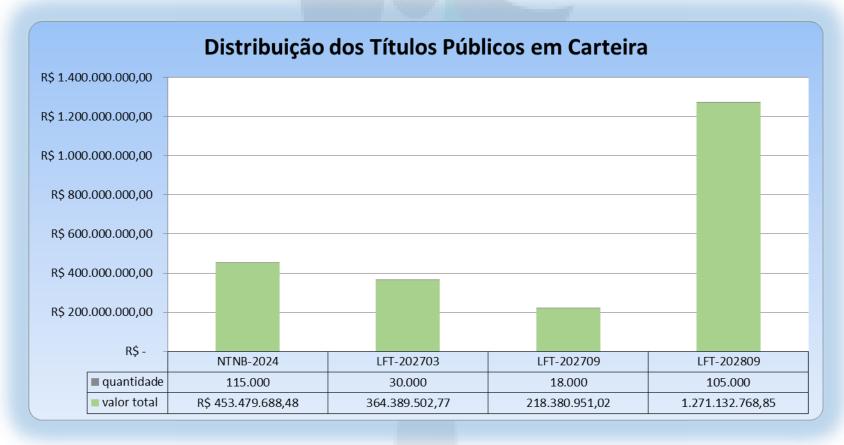


## Carteira de Títulos Públicos

Cód. Papel	Vencimento	Data Compra	Qtde. Bloq.	Qtde. Total	PU Compra	Preço Unitário	Taxa %	Valor Total à Mercado	%PL
Títulos Públicos									
LFT									
LFT20270301 - 210100	01/03/2027	30/09/2022	0	30.000	12.146,90386800	12.146,31675900	0,158000	364.389.502,77	15,79%
LFT20270901 - 210100	01/09/2027	30/09/2022	0	18.000	12.132,93555500	12.132,27505700	0,165000	218.380.951,02	9,46%
LFT20280901 - 210100	01/09/2028	20/07/2022	0	20.000	11.796,60324900	12.106,02637000	0,172000	242.120.527,40	10,49%
LFT20280901 - 210100	01/09/2028	20/07/2022	0	50.000	11.796,60324900	12.106,02637000	0,172000	605.301.318,50	26,23%
LFT20280901 - 210100	01/09/2028	17/08/2022	0	10.000	11.914,18458400	12.106,02637000	0,175000	121.060.263,70	5,25%
LFT20280901 - 210100	01/09/2028	17/08/2022	0	5.000	11.913,47419900	12.106,02637000	0,176000	60.530.131,85	2,62%
LFT20280901 - 210100	01/09/2028	17/08/2022	0	20.000	11.913,47419900	12.106,02637000	0,176000	242.120.527,40	10,49%
Total LFT:				153.000				1.853.903.222,64	80%
NTN-PÓS									
NTNB20240815 - 760199	15/08/2024	11/05/2022	20.000	115.000	4.033,098863	3.943,30163900	5,569991	453.479.688,48	19,65%
Total NTN-PÓS:			20.000	115.000				453.479.688,48	20%
Total Títulos Públicos:				268.000				R\$ 2.307.382.911,12	100,0%







Duration de MACAULAY (anos)	Duration Modificada	Variação % Preço (100 PB)	Variação em MOEDA (100 PB)	Variação em MOEDA (1 PB)	Duration do Passivo Atuarial
0,35	0,33	0,33%	-R\$ 7.669.949,15	-R\$ 766,99	20,99 anos





# 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	Caixa DTVM	Caixa Econômica	Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	0,80%	Não há	D+0	D+0	Não há	18:00
Federal	Caixa Di Vivi	Federal	Caixa FI Brasil RE ref DI LP	03.737.206/0001-97	0,20%	Não há	D+0	D+0	Não há	17:00
BB Gestão de	BB Gestão de	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
Recursos DTVM	Recursos DTVM	Dalico do Diasii	BB Perfil DI	13.077.418/0001-49	0,20%	Não há	D+0	D+0	Não há	17:00
Banco do Estado do	Banrisul Corretora	Banrisul Corretora	Banrisul Absoluto FI RF	21.743.480/0001-50	0,15%	Não há	D+0	D+0	Não há	15:00
Rio Grande do Sul	Ddillisul Collectora	Dailiisui Corretora	Banrisul Automático FI RF CP	01.353.260/0001-03	1,60%	Não há	D+0	D+0	Não há	17:30
Itaú Unibanco S.A.	Itaú Unibanco S.A.	Itaú Unibanco S.A.	Itaú Institucional Optimus RF LP F	40.635.061/0001-40	0,90%	20% q exceder CDI	D+0	D+1	Não há	15:00
			Itaú Institucional RF Ref DI FI	00.832.435/0001-00	0,18%	Não há	D+0	D+0	Não há	17:00
BTG Pactual Serviços Financeiros S.A.	BTG Pactual Asset Management S.A. DTVM	Banco BTG Pactual	BTG Pact Cre Cor I FICFI RF Cred Priv	14.171.644/0001-57	0,50%	20% q exceder CDI	D+0	D+31	Não há	15:30
Banco Santander S.A.	Santander Brasil Gestão de recursos	Santander Caceis Brasil Distribuidora	Sant RF Cred priv Crescimento Inst FI LP	17.138.474/0001-05	0,30%	Não há	D+0	D+1	Não há	16:00
Renda Variável										
Caixa Econômica	Coive DTI/A4	Caixa Econômica	Caixa FIA Infraestrutura	10.551.382/0001-03	2,00%	Não há	D+1	D+3	Não há	17:00
Federal	Caixa DTVM	Federal	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	BB Gestão de		BB Ações Retorno Total	09.005.805/0001-00	1,00%	Não há	D+1	D+3	Não há	17:00
Recursos DTVM	Recursos DTVM	Banco do Brasil	BB Acoes Exportacao Fc FI	05.100.213/0001-09	2,00%	Não há	D+1	D+3	Não há	17:00
Necuisos Di VIVI	Necuisos Di VIVI		BB Ações Tecnologia	01.578.474/0001-88	2,00%	Não há	D+1	D+3	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
		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
Itaú Unibanco S.A.	Itaú Unibanco S.A.	Banrisul Corretora	ETF DIVO 11	13.416.245/0001-46	0,50%	Não há	D+2	D+2	Não há	17:00
		Danii Sur Corretora	ETF BOVV 11	21.407.758/0001-19	0,30%	Não há	D+2	D+2	Não há	17:00
Intrag DTVM	Kinea Private Equity Investimentos	Itaú Unibanco S.A.	Kinea Private Equity V Feeder Inst. I FIP	41.745.796/0001-99	2,00%	20% o que exceder IPCA+6%	N.A	N.A	10 anos	N.A
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
Banestes S.A	Banestes DTVM SA	Banestes S.A	Banestes BTG Absoluto FIC FIA	08.018.849/0001-02	3,00%	Não há	D+1	D+30	Não há	15:00