

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

Competência: Dezembro/2023

Resumo do Resultado

Rendimento de Dezembro/2023

2,60%

Meta

0,99%

Rendimento de 2023

13,98%

Meta

10,11%

Patrimônio do regime Capitalizado:
R\$ 4.275.991.069,32

Demonstrativo do Desempenho Mensal da Carteira

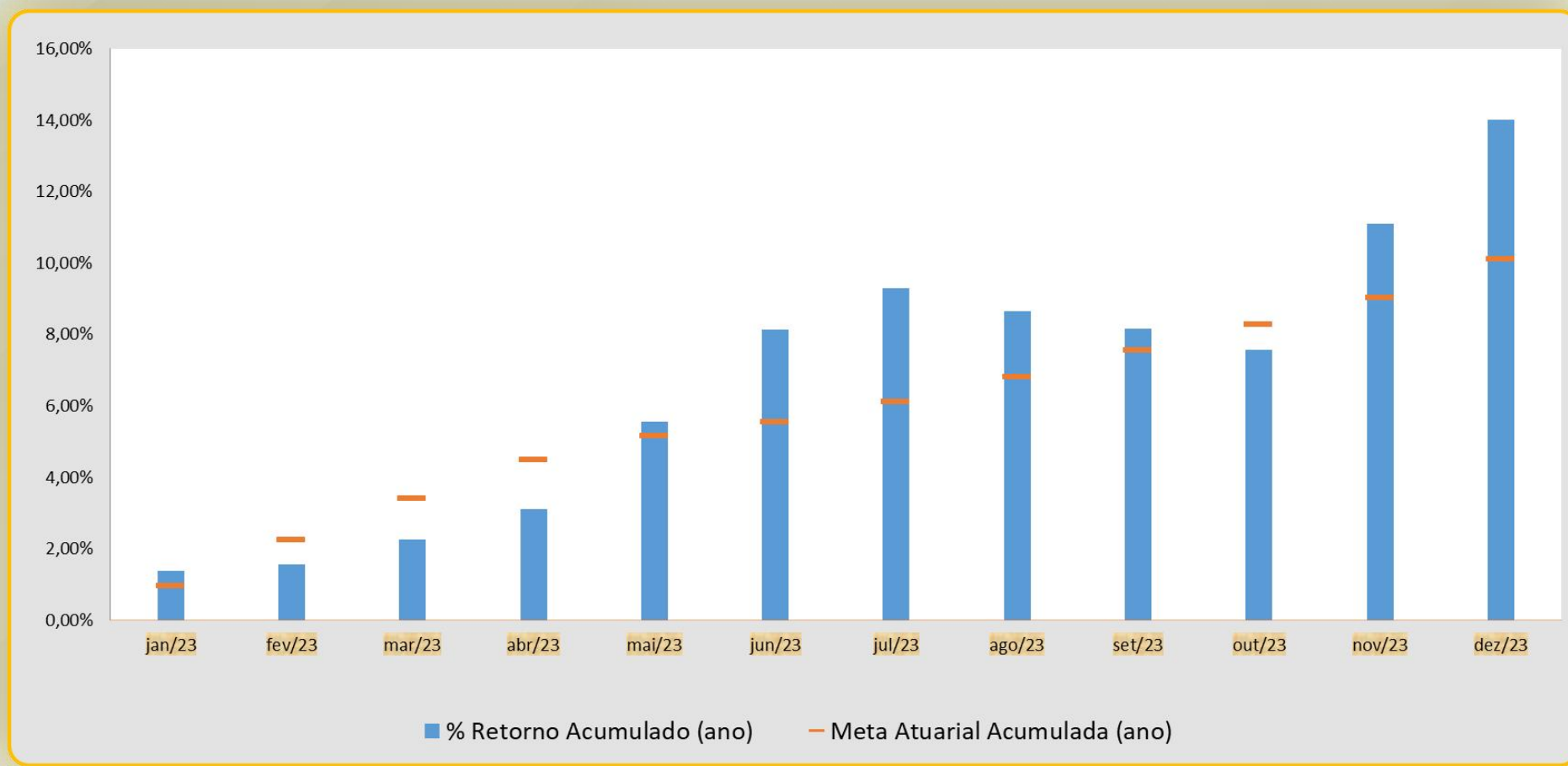
Competência	Patrimônio Líquido Inicial (R\$)	Aplicação (R\$)	Resgate (R\$)	Fluxo de Caixa (R\$)	Fluxo de Caixa Acumulado Anual (R\$)	Patrimônio Líquido Final (R\$)	Retorno Mensal (R\$)	Retorno Acumulado Anual (R\$)
jan/23	R\$ 3.607.228.682,83	R\$ 50.585.355,60	R\$ 25.620.839,48	R\$ 24.964.516,12	R\$ 24.964.516,12	R\$ 3.682.203.879,67	R\$ 50.010.680,72	R\$ 50.010.680,72
fev/23	R\$ 3.682.203.879,67	R\$ 98.845.614,68	R\$ 89.935.507,53	R\$ 8.910.107,15	R\$ 33.874.623,27	R\$ 3.697.356.280,59	R\$ 6.242.293,77	R\$ 56.252.974,49
mar/23	R\$ 3.697.356.280,59	R\$ 51.007.356,80	R\$ 42.037.652,94	R\$ 8.969.703,86	R\$ 42.844.327,13	R\$ 3.732.411.256,08	R\$ 26.085.271,63	R\$ 82.338.246,12
abr/23	R\$ 3.732.411.256,08	R\$ 3.882.482.408,82	R\$ 3.873.355.085,49	R\$ 9.127.323,33	R\$ 51.971.650,46	R\$ 3.772.688.300,37	R\$ 31.149.720,96	R\$ 113.487.967,08
mai/23	R\$ 3.772.688.300,37	R\$ 2.506.240.501,26	R\$ 2.497.709.971,99	R\$ 8.530.529,27	R\$ 60.502.179,73	R\$ 3.870.429.298,49	R\$ 89.210.468,85	R\$ 202.698.435,93
jun/23	R\$ 3.870.429.298,49	R\$ 19.992.132,62	R\$ 12.607.368,49	R\$ 7.384.764,13	R\$ 67.886.943,86	R\$ 3.972.509.857,75	R\$ 94.695.795,13	R\$ 297.394.231,06
jul/23	R\$ 3.972.509.857,75	R\$ 18.990.854,33	R\$ 14.231.545,00	R\$ 4.759.309,33	R\$ 72.646.253,19	R\$ 4.019.814.617,89	R\$ 42.545.450,81	R\$ 339.939.681,87
ago/23	R\$ 4.019.814.617,89	R\$ 768.619.581,63	R\$ 759.350.839,48	R\$ 9.268.742,15	R\$ 81.914.995,34	R\$ 4.005.632.096,50	-R\$ 23.451.263,54	R\$ 316.488.418,33
set/23	R\$ 4.005.632.096,50	R\$ 81.769.141,94	R\$ 72.844.933,08	R\$ 8.924.208,86	R\$ 90.839.204,20	R\$ 3.996.130.603,34	-R\$ 18.425.702,02	R\$ 298.062.716,31
out/23	R\$ 3.996.130.603,34	R\$ 121.650.533,91	R\$ 111.650.088,10	R\$ 10.000.445,81	R\$ 100.839.650,01	R\$ 3.984.212.392,48	-R\$ 21.918.656,67	R\$ 276.144.059,64
nov/23	R\$ 3.984.212.392,48	R\$ 281.181.743,68	R\$ 270.939.221,48	R\$ 10.242.522,20	R\$ 111.082.172,21	R\$ 4.125.360.235,65	R\$ 130.905.320,97	R\$ 407.049.380,61
dez/23	R\$ 4.125.360.235,65	R\$ 188.665.531,55	R\$ 145.763.234,43	R\$ 42.902.297,12	R\$ 153.984.469,33	R\$ 4.275.991.069,32	R\$ 107.728.536,55	R\$ 514.777.917,16
TOTAL ANO	R\$ 3.607.228.682,83	R\$ 8.070.030.756,82	R\$ 7.916.046.287,49	R\$ 153.984.469,33		R\$ 4.275.991.069,32		R\$ 514.777.917,16

Indicadores Performance do Fundo do Regime Capitalizado: 2023

Competência	% Retorno Mensal	% Retorno Acumulado (ano)	IPCA (mês)	IPCA (ano)	Meta Atuarial (mês)	Meta Atuarial Acumulada (ano)
jan/23	1,38%	1,38%	0,53%	0,53%	0,96%	0,96%
fev/23	0,17%	1,55%	0,84%	1,37%	1,27%	2,24%
mar/23	0,70%	2,27%	0,71%	2,09%	1,14%	3,41%
abr/23	0,83%	3,12%	0,61%	2,72%	1,04%	4,48%
mai/23	2,36%	5,56%	0,23%	2,95%	0,66%	5,17%
jun/23	2,44%	8,14%	-0,08%	2,87%	0,35%	5,54%
jul/23	1,07%	9,29%	0,12%	2,99%	0,55%	6,11%
ago/23	-0,58%	8,66%	0,23%	3,23%	0,66%	6,81%
set/23	-0,46%	8,16%	0,26%	3,50%	0,69%	7,55%
out/23	-0,55%	7,57%	0,24%	3,75%	0,67%	8,27%
nov/23	3,28%	11,10%	0,28%	4,04%	0,71%	9,03%
dez/23	2,60%	13,98%	0,56%	4,62%	0,99%	10,11%
		13,98%		4,62%		10,11%

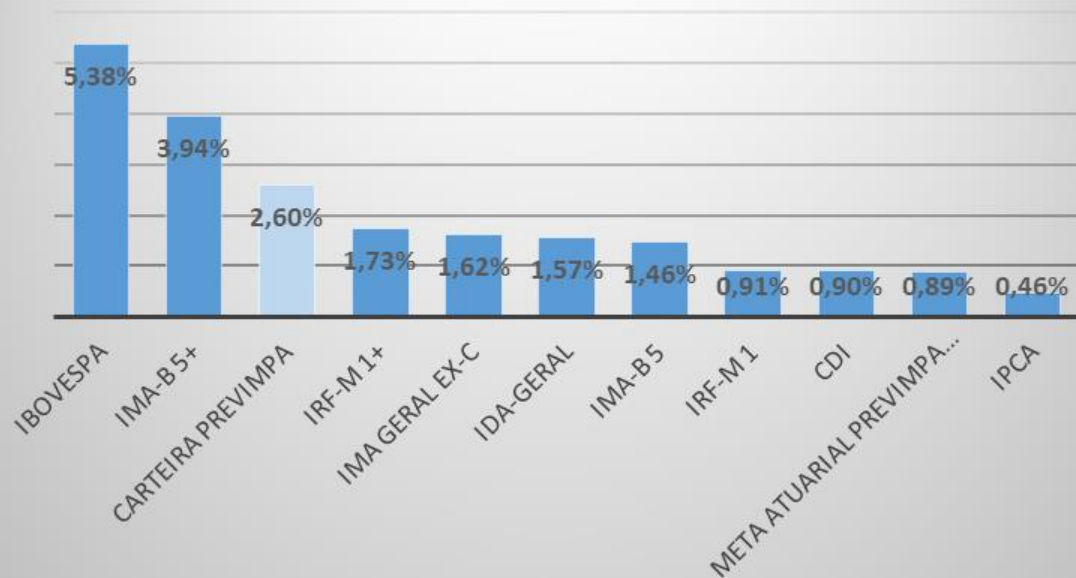
*A meta atuarial foi atualizada para o percentual de IPCA+5,25% e corrigido os meses anteriores

Rentabilidade X Meta

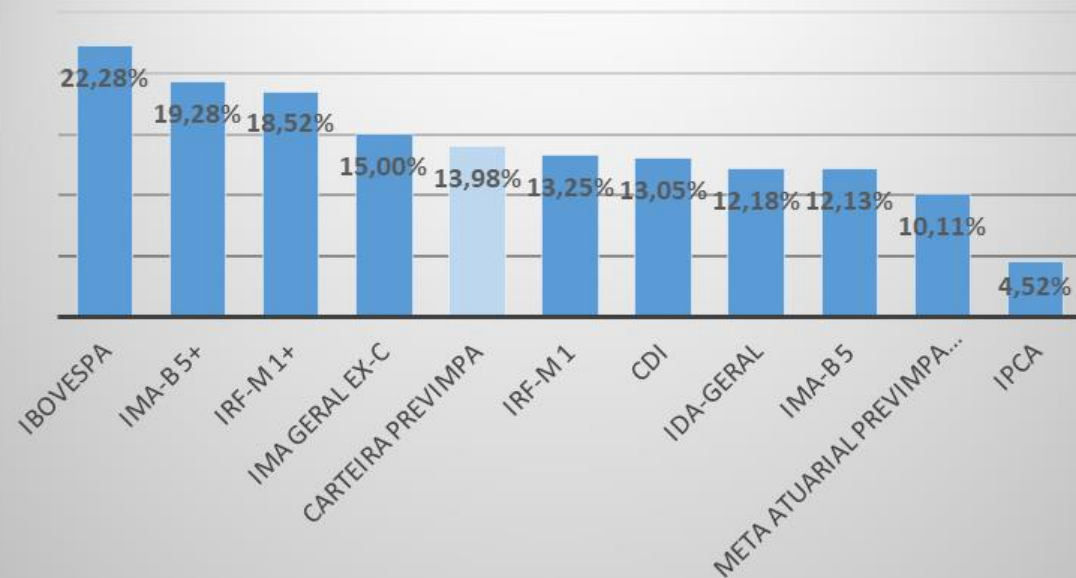


Benchmark

Retorno Mensal (Dezembro/2023)



Retorno Anual (2023)



Composição da Carteira e Movimentações : Fundo do Regime Capitalizado

	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)	Participação no PL
Títulos Públicos - marcados a mercado	R\$ 1.481.081.388,13	R\$ -	R\$ -	R\$ 1.535.205.296,89	R\$ 54.123.908,76	3,65%	35,90%
Títulos Públicos - marcados na curva	R\$ 1.155.916.364,37	R\$ -	R\$ -	R\$ 1.167.666.314,33	R\$ 11.749.949,96	1,02%	27,31%
Fundos de Renda Fixa	R\$ 962.488.799,57	R\$ 175.451.773,55	R\$ 93.738.239,09	R\$ 1.058.646.601,30	R\$ 14.444.267,27	1,44%	24,76%
Fundos de Renda Variável	R\$ 490.132.499,28	R\$ -	R\$ 52.024.995,34	R\$ 466.334.494,54	R\$ 28.226.990,60	6,08%	10,91%
Outros ativos	R\$ 35.741.184,30	R\$ 13.213.758,00	R\$ -	R\$ 48.138.362,26	-R\$ 816.580,04	-1,93%	1,13%
RENTABILIDADE TOTAL DO REGIME CAPITALIZADO	R\$ 4.125.360.235,65	R\$ 188.665.531,55	R\$ 145.763.234,43	R\$ 4.275.991.069,32	R\$ 107.728.536,55	2,60%	100%

Composição da Carteira e Movimentações : Títulos Públicos

Títulos Públicos - marcados a mercado	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates/ Cupom	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
NTN B-2040	R\$ 437.388.358,10			R\$ 456.213.617,90	R\$ 18.825.259,80	4,30%
NTN B-2045	R\$ 665.965.793,89			R\$ 691.976.646,61	R\$ 26.010.852,72	3,91%
NTN F-2029	R\$ 377.727.236,14			R\$ 387.015.032,38	R\$ 9.287.796,24	2,46%

Títulos Públicos - marcados na curva	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates/ Cupom	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
Títulos marcação na curva	R\$ 1.155.916.364,37			R\$ 1.167.666.314,33	R\$ 11.749.949,96	1,02%

TOTAL DE TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.636.997.752,50	-	-	R\$ 2.702.871.611,22	R\$ 65.873.858,72	2,50%
----------------------------------	-----------------------------	----------	----------	-----------------------------	--------------------------	--------------

Composição da Carteira e Movimentações : Fundos de Renda Fixa

Fundos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
Caixa FIC Brasil Disponibilidades RF	R\$ 271.411,94	R\$ 1.466.175,21	R\$ 1.539.267,21	R\$ 201.536,03	R\$ 3.216,09	1,18%
Caixa FI Brasil RF Ref DI LP	R\$ 349.317.726,93	R\$ 55.145.788,04	R\$ 24.601.323,08	R\$ 383.139.097,70	R\$ 3.276.905,81	0,90%
Caixa FIC Brasil Disponibilidades RF	R\$ 1.476.538,35	R\$ 1.234.879,04	R\$ 1.892.584,10	R\$ 824.957,34	R\$ 6.124,05	0,41%
Saldo em conta corrente	R\$ 14.770,08			R\$ -	R\$ -	0,00% *
BB Prev Fluxo RF Simples Fc FI	R\$ 1.420.381,02	R\$ 341.162,57	R\$ 299.934,70	R\$ 1.474.277,49	R\$ 12.668,60	0,88%
BB Prev Fluxo RF Simples Fc FI	R\$ 901,47			R\$ 908,87	R\$ 7,40	0,82%
BB Prev RF Ref DI LP Perfil Fc	R\$ 122.798.289,78			R\$ 123.906.150,57	R\$ 1.107.860,79	0,90%
Banrisul Automatico FI RF CP	R\$ 152.372,35	R\$ 52.024.995,34	R\$ 52.143.408,07	R\$ 54.587,92	R\$ 20.628,30	22,14%
Banrisul Absoluto	R\$ 253.217.443,51	R\$ 52.024.995,34	R\$ 47.963,92	R\$ 307.636.533,03	R\$ 2.442.058,10	0,87%
Itau Institucional RF Ref DI FI	R\$ 53.481.711,89	R\$ 13.213.778,01	R\$ 13.213.758,01	R\$ 53.997.196,50	R\$ 515.464,61	0,96%
BTG Pactual Tesouro IPCA Longo FI RF REF	R\$ 68.368.580,19			R\$ 71.051.221,21	R\$ 2.682.641,02	3,92%
Sant IMA-B 5+ Premium	R\$ 111.968.672,06			R\$ 116.360.134,64	R\$ 4.391.462,58	3,92%
TOTAL DOS FUNDO DE RENDA FIXA	R\$ 962.488.799,57	R\$ 175.451.773,55	R\$ 93.738.239,09	R\$ 1.058.646.601,30	R\$ 14.444.267,27	1,44%

TOTAL DA RENDA FIXA	R\$ 3.599.486.552,07	R\$ 175.451.773,55	R\$ 93.738.239,09	R\$ 3.761.518.212,52	R\$ 80.318.125,99	2,21%
----------------------------	-----------------------------	---------------------------	--------------------------	-----------------------------	--------------------------	--------------

* Este valor em conta corrente referia-se a bloqueio judicial ocorrido em 31/08/2023.

Composição da Carteira e Movimentações : Fundos de Renda Variável

Fundos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
It Now Ifnc Fundo de Indice	R\$ 49.348.000,00		R\$ 52.024.995,34	R\$ -	R\$ 2.676.995,34	5,42%
Ishares Smal Ci	R\$ 28.154.543,88			R\$ 30.154.171,50	R\$ 1.999.627,62	7,10%
BB Acoes Retorno Total Fc	R\$ 16.177.229,09			R\$ 17.083.321,65	R\$ 906.092,56	5,60%
BB Acoes Tecnologia Bdr Nivel I FI	R\$ 20.344.354,71			R\$ 21.093.786,73	R\$ 749.432,02	3,68%
BB Acoes Exportacao Fc FI	R\$ 25.103.407,94			R\$ 26.324.877,13	R\$ 1.221.469,19	4,87%
BB Acoes Constr Civil	R\$ 26.052.127,23			R\$ 28.253.058,37	R\$ 2.200.931,14	8,45%
Caixa FIC FIA Acoes Multigestor	R\$ 71.124.648,08			R\$ 74.967.742,23	R\$ 3.843.094,15	5,40%
Caixa FIA Infraestrutura	R\$ 23.241.525,73			R\$ 24.340.664,94	R\$ 1.099.139,21	4,73%
Caixa FIA Ações Construção Civil	R\$ 29.085.883,82			R\$ 31.531.955,31	R\$ 2.446.071,49	8,41%
Caixa FIA Small	R\$ 38.687.820,50			R\$ 41.368.118,28	R\$ 2.680.297,78	6,93%
Banestes FICFI Acoes BTG Absol. Inst	R\$ 16.601.151,18			R\$ 17.398.455,64	R\$ 797.304,46	4,80%
BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	R\$ 51.804.158,61			R\$ 54.306.876,12	R\$ 2.502.717,51	4,83%
Itau Ações Asgard Institucional Fc	R\$ 46.417.086,51			R\$ 49.321.343,36	R\$ 2.904.256,85	6,26%
Trigono Flagship Small Caps Institucional FIC FIA	R\$ 47.990.562,00			R\$ 50.190.123,28	R\$ 2.199.561,28	4,58%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 490.132.499,28	R\$ -	R\$ 52.024.995,34	R\$ 466.334.494,54	R\$ 28.226.990,60	6,08%

Composição da Carteira e Movimentações : Outros Ativos

OUTROS ATIVOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INST I FIP MULTI	R\$ 21.208.605,66			R\$ 21.101.149,00	-R\$ 107.456,66	-0,51%
BTG PACTUAL CLA ECONOMIA R II FIP MULT	R\$ 3.878.429,50			R\$ 3.758.740,70	-R\$ 119.688,80	-3,09%
TERRENO	R\$ 8.380.000,00			R\$ 8.380.000,00	R\$ -	0,00%
Kinea Desenvolvimento Logístico FII (KLOG11)	R\$ -	R\$ 13.213.758,00		R\$ 12.415.170,00	-R\$ 798.588,00	-6,04%
113.982 AÇÕES BANRISUL ON N1	R\$ 1.447.571,40			R\$ 1.575.231,24	R\$ 127.659,84	8,82%
68.482 AÇÕES BANRISUL PNB N1	R\$ 826.577,74			R\$ 908.071,32	R\$ 81.493,58	9,86%
TOTAL DE OUTROS ATIVOS	R\$ 35.741.184,30	R\$ 13.213.758,00	R\$ -	R\$ 48.138.362,26	-R\$ 816.580,04	-1,93%
RENTABILIDADE TOTAL DO REGIME CAPITALIZADO	R\$ 4.125.360.235,65	R\$ 188.665.531,55	R\$ 145.763.234,43	R\$ 4.275.991.069,32	R\$ 107.728.536,55	2,60%

Enquadramento dos Ativos de Renda Fixa

Títulos públicos	Enquadramento resolução CMN 4963	Valor atual	PL do fundo	Participação Previmpa no fundo	Limite por fundo conf. Resolução	Valor por Carteira	% Alocado Carteira	Limite do enquadramento 4963	Limite da política de investimentos	Alvo da política de investimentos
Títulos da carteira Previmpa	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	2.702.871.611,22	N. A.	N. A.	N. A.	2.702.871.611,22	63,37%	100%	100%	65%

Fundos de Renda fixa	Enquadramento resolução CMN 4963	Valor atual	PL do fundo	Participação Previmpa no fundo	Limite por fundo conf. Resolução	Valor por Carteira	% Carteira	Limite do enquadramento 4963	Limite da política de investimentos	Alvo da política de investimentos
Banrisul Absoluto	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	307.636.533,03	3.621.394.647,54	8,49%	100%	496.128.970,17	11,63%	100%	100%	5%
Banrisul Automatico FI RF CP		54.587,92	1.680.867.995,11	0,00%						
BTG Pactual Tesouro IPCA Longo FI RF REF		71.051.221,21	958.608.041,41	7,41%						
Sant IMA-B 5+ Premium		116.360.134,64	383.340.845,14	30,35%						
Caixa FIC Brasil Disponibilidades RF		1.026.493,37	13.767.306.251,09	0,01%						
BB Prev Fluxo RF Simples Fc FI	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	1.475.186,36	80.481.534.511,63	0,00%	15%	562.517.631,13	13,19%	60%	60%	0,5%
Caixa FI Brasil RF Ref DI LP		383.139.097,70	13.988.008.512,08	2,74%						
BB Prev RF Ref DI LP Perfil Fc		123.906.150,57	29.029.952.995,76	0,43%						
Itau Institucional RF Ref DI FI		53.997.196,50	5.862.946.011,56	0,92%						

Enquadramento dos Ativos de Renda Variável

Fundos de Renda Variável	Enquadramento resolução CMN 4963	Valor atual	PL do fundo	Participação Previmpa no fundo	Limite por fundo conf. Resolução	Valor por Carteira	% Carteira	Limite do enquadramento 4963	Limite da política de investimentos	Alvo da política de investimentos
Caixa FIA Infraestrutura	Artigo 8º, Inciso I	24.340.664,94	224.155.330,01	10,86%	15%	436.180.323,04	10,93%	35%	35%	1,5%
Caixa FIA Ações Construção Civil		31.531.955,31	233.700.687,62	13,49%						
Caixa FIA Small		41.368.118,28	702.099.612,74	5,89%						
Caixa FIC FIA Acoes Multigestor		74.967.742,23	662.205.543,66	11,32%						
BB Acoes Retorno Total Fc		17.083.321,65	874.361.422,01	1,95%						
BB Acoes Construção Civil		28.253.058,37	215.349.251,13	13,12%						
BB Acoes Tecnologia Bdr Nivel I FI		21.093.786,73	467.994.930,21	4,51%						
BB Acoes Exportacao Fc FI		26.324.877,13	167.266.682,85	15,74%						
BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA		54.306.876,12	1.435.613.851,41	3,78%						
Banestes FICFI Acoes BTG Absol. Inst		17.398.455,64	1.435.426.948,17	1,21%						
Itau Ações Asgard Institucional Fc		49.321.343,36	238.163.499,61	20,71%						
Trigono Flagship Small Caps Institucional FIC F	50.190.123,28	1.064.320.609,05	4,72%							
Ishares Smal Ci	Artigo 8º, Inciso II	30.154.171,50	6.775.464.149,72	0,45%	15%	30.154.171,50				1,5%
BTG PACTUAL CLA ECONOMIA R II FIP MULT	Artigo 10, Inciso II	3.758.740,70	121.486.735,32	3,09%	15%	24.859.889,70	0,58%	5%	5%	1%
Kinea Private Equity V Feeder Inst I FIP Multi		21.101.149,00	525.494.221,76	4,02%						
Kinea Desenvolvimento Logístico FII (KLOG11)	Artigo 11	12.415.170,00	182.275.238,09	6,81%	15%	12.415.170,00	0,29%	10%	5%	0,5%

Obs.: O fundo Itaú Ações Asgard está desenquadrados passivamente, no entanto será mantido em carteira conforme artigo 152 da Portaria MTP Nº 1.467/22.

Obs².: O fundo BB ações exportação desenquadrado passivamente, tendo prazo de 180 dias para readequação.

Carteira Própria de Títulos Públicos – Título para Negociação

Renda Fixa | Definitiva | Títulos para Negociação

Cód. Papel	Vencimento	Data Compra	Qtde. Total	PU Compra	Preço Unitário	Taxa %	Valor Total	%PL
Títulos Públicos								
NTN-PÓS								
NTNB20400815 - 760199	15/08/2040	03/05/2023	40.000	4.163,768985	4.562,14	6,00	182.485.447,16	6,75
NTNB20400815 - 760199	15/08/2040	09/05/2023	10.000	4.198,525500	4.562,14	5,94	45.621.361,79	1,68
NTNB20400815 - 760199	15/08/2040	09/05/2023	30.000	4.198,525500	4.562,14	5,94	136.864.085,37	5,06
NTNB20400815 - 760199	15/08/2040	09/05/2023	20.000	4.198,525500	4.562,14	5,94	91.242.723,58	3,37
NTNB20450515 - 760199	15/05/2045	03/05/2023	40.000	4.222,273143	4.496,63	6,01	179.865.004,84	6,65
NTNB20450515 - 760199	15/05/2045	03/05/2023	10.000	4.224,708079	4.496,63	6,01	44.966.251,21	1,66
NTNB20450515 - 760199	15/05/2045	03/05/2023	40.000	4.227,147121	4.496,63	6,00	179.865.004,84	6,65
NTNB20450515 - 760199	15/05/2045	04/05/2023	10.000	4.229,412963	4.496,63	6,00	44.966.251,21	1,66
NTNB20450515 - 760199	15/05/2045	04/05/2023	41.888	4.229,412963	4.496,63	6,00	188.354.633,06	6,96
NTNB20450515 - 760199	15/05/2045	04/05/2023	10.000	4.229,412963	4.496,63	6,00	44.966.251,21	1,66
NTNB20450515 - 760199	15/05/2045	04/05/2023	2.000	4.229,412963	4.496,63	6,00	8.993.250,24	0,33
Total NTN-PÓS:			253.888				1.148.190.264,51	42,43
NTN-PRÉ								
NTNF20290101 - 950199	01/01/2029	17/08/2023	220.000	984,960174	1.045,99	10,75	230.117.046,28	8,51
NTNF20290101 - 950199	01/01/2029	17/08/2023	150.000	984,960174	1.045,99	10,75	156.897.986,10	5,80
Total NTN-PRÉ:			370.000				387.015.032,38	14,31
Total Títulos Públicos:			623.888				1.535.205.296,89	56,74
Total:			623.888				1.535.205.296,89	56,74

Carteira Própria de Títulos Públicos – Títulos mantidos até o vencimento

Renda Fixa | Definitiva | Mantidos até o Vencimento

Cód. Papel	Vencimento	Data Compra	Qtde. Total	PU Compra	Preço Unitário	Taxa %	Valor Curva	%PL
Títulos Públicos								
NTN-PÓS								
NTNB20240815 - 760199	15/08/2024	19/05/2023	15.000	4.117,78276900	4.237,72117400	7,460005	63.565.817,61	2,35
NTNB20240815 - 760199	15/08/2024	19/05/2023	20.000	4.117,78276900	4.237,72117400	7,460005	84.754.423,48	3,13
NTNB20330515 - 760199	15/05/2033	19/04/2023	10.000	4.203,24750300	4.219,84958000	6,005000	42.198.495,80	1,56
NTNB20400815 - 760199	15/08/2040	19/04/2023	10.000	4.137,28145700	4.278,55738900	6,020000	42.785.573,89	1,58
NTNB20400815 - 760199	15/08/2040	19/04/2023	50.000	4.133,01752300	4.274,31319900	6,030000	213.715.659,95	7,90
NTNB20400815 - 760199	15/08/2040	19/04/2023	10.000	4.133,01752300	4.274,31319900	6,030000	42.743.131,99	1,58
NTNB20400815 - 760199	15/08/2040	19/04/2023	10.000	4.133,01752300	4.274,31319900	6,030000	42.743.131,99	1,58
NTNB20400815 - 760199	15/08/2040	19/04/2023	50.000	4.133,44350700	4.274,73970900	6,029000	213.736.985,45	7,90
NTNB20400815 - 760199	15/08/2040	19/04/2023	10.000	4.133,01752300	4.274,31319900	6,030000	42.743.131,99	1,58
NTNB20400815 - 760199	15/08/2040	19/04/2023	10.000	4.133,01752300	4.274,31319900	6,030000	42.743.131,99	1,58
NTNB20450515 - 760199	15/05/2045	17/04/2023	10.000	4.161,08081900	4.185,27302200	6,090000	41.852.730,22	1,54
NTNB20450515 - 760199	15/05/2045	17/04/2023	10.000	4.156,29126200	4.180,46015300	6,100000	41.804.601,53	1,54
NTNB20450515 - 760199	15/05/2045	19/04/2023	20.000	4.189,50952600	4.209,47117700	6,040000	84.189.423,54	3,11
NTNB20450515 - 760199	15/05/2045	20/04/2023	10.000	4.153,73983400	4.171,33200800	6,119000	41.713.320,08	1,54
NTNB20450515 - 760199	15/05/2045	20/04/2023	10.000	4.153,26046400	4.170,85114000	6,120006	41.708.511,40	1,54
NTNB20500815 - 760199	15/08/2050	13/04/2023	10.000	4.044,73256300	4.196,28282700	6,180000	41.962.828,27	1,55
NTNB20500815 - 760199	15/08/2050	19/04/2023	10.000	4.126,98002300	4.270,54151500	6,040000	42.705.415,15	1,58
Total NTN-PÓS:			275.000				1.167.666.314,33	43,14
Total Títulos Públicos:			275.000				1.167.666.314,33	43,14
Total:			275.000				1.167.666.314,33	43,14

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)

Ativos de Renda Fixa: Acompanhamento Risco X Retorno

Títulos Públicos - MARCAÇÃO A MERCADO	1 mês	3 meses	6 meses	12 meses	36 meses	No ano	VaR 95% 1 M	Volatilidad e 12M	Duration (anos)	Sortino 12M	Sharpe 12M
BENCHMARK IMA EX-C	1,62%	4,32%	5,96%	15,52%	27,41%	15,00%					
NTN-B 760199 20400815	4,30%	8,38%	5,17%	21,51%	16,79%	20,10%	2,37%	7,21%	10,76	1,44	1,02
NTN-B 760199 20450515	3,91%	8,58%	5,43%	22,11%	16,39%	20,66%	2,70%	7,85%	12,58	1,42	1,00
NTN-F 950199 20290101	2,46%	8,26%	7,72%	24,54%	12,75%	22,72%	1,71%	7,13%	3,87	1,99	1,37

Títulos Públicos - MARCAÇÃO NA CURVA	1mês	3 meses	6 meses	12 meses	36 meses	Total	VaR 95% 1 M	Volatilidad e 12M	Duration (anos)	Taxa % Comprado	% Carteira
BENCHMARK IMA EX-C	1,62%	4,32%	5,96%								
Carteira Marcação na Curva - Papel (data da compra e taxa)	0,86%	2,43%	4,44%			6,28%					
NTN-B 760199 20240815 (20230519 7,460005%)	0,95%	2,72%	5,05%			6,00%	0,11%	0,23%	0,57	7,46	12,70%
NTN-B 760199 20330515 (20230419 6,005000%)	0,84%	2,37%	4,33%			6,28%	0,11%	0,23%	6,90	6,01	3,61%
NTN-B 760199 20400815 (20230419 6,030000%)	0,84%	2,38%	4,35%			6,30%	0,11%	0,23%	10,15	6,03	32,95%
NTN-B 760199 20400815 (20230419 6,020000%)	0,84%	2,38%	4,34%			6,29%	0,11%	0,23%	10,15	6,03	3,66%
NTN-B 760199 20400815 (20230419 6,029999%)	0,84%	2,38%	4,35%			6,30%	0,11%	0,23%	10,15	6,02	18,30%
NTN-B 760199 20450515 (20230417 6,090000%)	0,85%	2,39%	4,38%			6,45%	0,11%	0,23%	11,86	6,09	3,58%
NTN-B 760199 20450515 (20230417 6,100000%)	0,85%	2,40%	4,38%			6,46%	0,11%	0,23%	11,86	6,10	3,58%
NTN-B 760199 20450515 (20230419 6,040000%)	0,84%	2,38%	4,35%			6,31%	0,11%	0,23%	11,86	6,04	7,21%
NTN-B 760199 20450515 (20230420 6,120006%)	0,85%	2,40%	4,39%			6,31%	0,11%	0,23%	11,85	6,12	3,57%
NTN-B 760199 20450515 (20230420 6,119000%)	0,85%	2,40%	4,39%			6,31%	0,11%	0,23%	11,85	6,12	3,57%
NTN-B 760199 20500815 (20230413 6,180000%)	0,85%	2,42%	4,42%			6,63%	0,11%	0,23%	13,05	6,18	3,59%
NTN-B 760199 20500815 (20230419 6,040000%)	0,84%	2,38%	4,35%			6,31%	0,11%	0,23%	13,07	6,04	3,66%

Ativos de Renda Fixa: Acompanhamento Risco X Retorno

Fundos de Renda fixa	1 mês	3 meses	6 meses	12 meses	36 meses	No ano	VaR 95% 1 M	Volatilidad e	Beta CDI 12M	Sortino 12M	Sharpe 12M
BENCHMARK CDI	0,90%	2,94%	6,20%	13,22%	32,67%	13,05%					
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,81%	2,68%	5,68%	11,73%	27,47%	11,58%	0,01%	0,03%	0,57	-15,16	-46,51
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,82%	2,67%	5,66%	12,09%	28,63%	11,93%	0,01%	0,04%	1,02	-15,13	-25,09
BANRISUL AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,73%	2,40%	5,10%	10,82%	24,80%	10,68%	0,03%	0,06%	0,93	-15,01	-38,52
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,95%	3,14%	6,74%	13,75%	35,02%	13,57%	0,02%	0,10%	0,45	5,96	4,47
BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	0,90%	2,89%	6,15%	13,17%	32,82%	13,00%	0,02%	0,06%	1,08	-1,36	-0,70
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,90%	2,93%	6,20%	13,15%	33,14%	12,98%	0,01%	0,08%	0,93	-0,82	-0,72
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,92%	3,04%	6,53%	13,52%	33,61%	13,32%	0,02%	0,07%	0,73	6,43	3,75
BENCHMARK IMA-B 5+	3,94%	8,19%	4,97%	20,52%	16,58%	19,28%	2,39%	7,03%	0,17	1,30	0,92
BTG PACTUAL TESOURO LONGO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA	3,92%	8,12%	4,84%	20,17%	15,56%	18,83%	2,39%	7,03%	0,12	1,24	0,88
SANTANDER IMA-B 5+ PREMIUM FIC RENDA FIXA	3,92%	8,11%	4,83%	20,06%	N.A	18,83%	2,39%	6,96%	0,01	1,24	0,88

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% 1M	Volatilidade e 12M	Beta IBOV 12M	Sortino 12M	Sharpe
BENCHMARK IBOVESPA	5,38%	17,37%	13,35%	23,58%	13,90%	22,28%		17,14%			
IT NOW IFNC FUNDO DE ÍNDICE - FIND11	7,52%	24,30%	13,23%	37,47%	13,42%	34,77%	7,18%	21,56%	1,11	1,68	0,53
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	5,50%	17,60%	13,70%	24,35%	15,37%	23,03%	6,19%	17,15%	1,00	14,14	0,04
ISHARES BM&FBOVESPA SMALL CAP FUNDO DE ÍNDICE - SMAL11	7,03%	14,74%	4,68%	19,63%	-14,63%	17,32%	7,68%	22,31%	1,13	-0,28	-0,10
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	5,60%	15,87%	13,29%	17,96%	-7,69%	17,09%	6,53%	17,29%	0,99	-1,65	-0,27
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,68%	14,29%	14,82%	49,81%	-0,06%	46,02%	4,94%	16,49%	0,37	1,59	1,16
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	4,87%	10,72%	14,74%	19,54%	16,69%	17,47%	5,50%	15,10%	0,75	-0,56	-0,24
BB AÇÕES CONSTRUÇÃO CIVIL	8,45%	21,37%	11,38%	55,87%	-6,71%	50,67%	9,54%	27,61%	1,25	2,17	0,93
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	5,40%	12,75%	9,15%	19,13%	-1,39%	17,14%	6,16%	16,61%	0,91	-0,90	-0,23
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	8,41%	21,05%	11,16%	53,29%	-8,87%	48,14%	9,46%	27,33%	1,24	2,06	0,87
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	6,93%	14,23%	4,14%	18,63%	-16,72%	16,46%	7,62%	22,17%	1,12	-0,39	-0,14
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	4,73%	13,79%	11,08%	33,27%	30,18%	30,95%	6,10%	17,92%	0,95	1,62	0,43
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4,80%	15,02%	9,30%	17,72%	-23,17%	15,71%	6,73%	17,34%	0,89	-0,81	-0,28
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4,83%	15,16%	9,39%	17,84%	-23,31%	15,82%	6,78%	17,46%	0,90	-0,78	-0,27
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4,58%	-0,54%	5,80%	10,91%	75,07%	10,97%	5,50%	19,35%	0,70	-0,89	-0,54
ITAÚ ASGARD INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6,26%	17,19%	11,42%	15,86%	-5,84%	15,07%	6,95%	15,87%	0,86	-1,48	-0,42

Risco da carteira total Previmpa:

VAR 95% 1 M da carteira do PREVIMPA:

1,75%

Volatilidade:

5,22%

Composição da Carteira Taxa Administração e Repartição Simples: Movimentações

Taxa de Administração e Repartição Simples	Saldo Atual	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
COMPREV - BB Previd RF Fluxo	R\$ 417.063,38	R\$ 4.970.572,35	R\$ 4.892.068,68	R\$ 521.770,75	R\$ 26.203,70	5,74%
COMPREV - BB Previd RF Perfil	R\$ 3.855.476,69			R\$ 3.890.260,01	R\$ 34.783,32	0,90%
FUNDO PREVIDENCIA - BB Previd RF Fluxo	R\$ 571.764,44	R\$ 11.054,66	R\$ 132,30	R\$ 587.437,40	R\$ 4.750,60	0,82%
REPARTIÇÃO SIMPLES - Caixa Disponibilidades RF	R\$ 4.822.391,60	R\$ 7.141.114,12	R\$ 6.919.195,24	R\$ 5.072.426,05	R\$ 28.115,57	0,57%
REPARTIÇÃO SIMPLES - Caixa Brasil DI	R\$ 20.736.748,43		R\$ 1.000.000,00	R\$ 19.926.674,80	R\$ 189.926,37	0,94%
TAXA ADM - Caixa Disponibilidades	R\$ 95.691,44	R\$ 577.253,67	R\$ 349.533,27	R\$ 325.639,29	R\$ 2.227,45	1,06%
TAXA ADM - Caixa Brasil DI	R\$ 356.988,26		R\$ 358.354,51	R\$ -	R\$ 1.366,25	0,77%
TAXA ADM - BB Previd RF Fluxo	R\$ 2.838.414,96	R\$ 2.492.777,06	R\$ 1.920.923,61	R\$ 3.435.586,63	R\$ 25.318,22	0,81%
TAXA ADM - BB Previd RF Perfil	R\$ 10.897.730,19			R\$ 10.996.047,26	R\$ 98.317,07	0,90%
ADIANTAMENTO - BB Previd RF Fluxo	R\$ 38,36	R\$ 2.000,00	R\$ 2.042,31	R\$ -	R\$ 3,95	22,96%
Conta Corrente	R\$ 3.405.914,44			R\$ -		
TOTAL TAXA ADM E REPARTIÇÃO SIMPLES	R\$ 44.592.307,75	R\$ 15.194.771,86	R\$ 15.442.249,92	R\$ 44.755.842,19	R\$ 411.012,50	0,92%

Gestor e Administrador

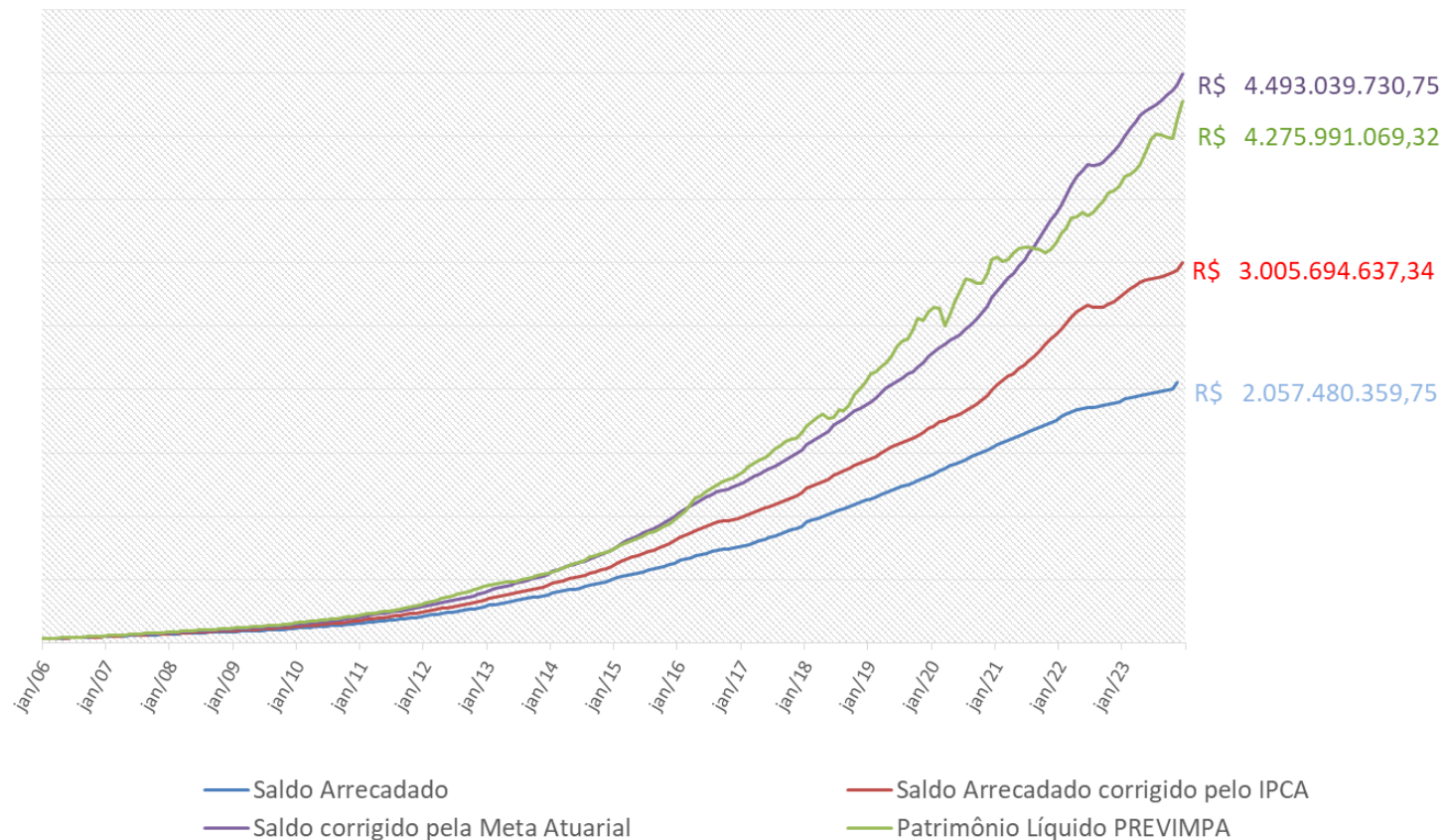
Administrador	Gestor	Valor	Distribuição
Tesouro Nacional	Gestão Própria - PREVIMPA	R\$ 2.702.871.611,22	63,4%
Caixa Econômica Federal	Caixa DTVM	R\$ 556.374.071,83	13,0%
Banco do Estado do Rio Grande do Sul	Banrisul Corretora	R\$ 307.691.120,95	7,2%
BB Gestão de Recursos DTVM	BB Gestão de Recursos DTVM	R\$ 218.136.380,81	5,1%
BTG Pactual Serviços Financeiros S.A.	BTG Pactual Asset Management S.A. DTVM	R\$ 129.116.838,03	3,0%
Banco Santander S.A.	Santander Brasil Gestão de Recursos LTDA	R\$ 116.360.134,64	2,7%
Itaú Unibanco S.A.	Itaú DTVM	R\$ 103.318.539,86	2,4%
BEM DTVM	Trigono Capital	R\$ 50.190.123,28	1,2%
BNP Paribas	Blackrock Brasil Gestora	R\$ 30.154.171,50	0,7%
Intrag DTVM	Kinea Private Equity Investimentos	R\$ 21.101.149,00	0,5%
Banestes S.A	Banestes DTVM	R\$ 17.398.455,64	0,4%
Intrag DTVM	Kinea Investimentos	R\$ 12.415.170,00	0,3%

Performance do Fundo do Regime Capitalizado – 2010 à 2023

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
2023	R\$ 3.607.228.682,83	R\$ 8.070.030.756,82	R\$ 7.916.046.287,49	R\$ 153.984.469,33	R\$ 4.275.991.069,32	R\$ 514.777.917,16	13,98%	10,11%	4,62%
2022	R\$ 3.154.964.155,75	R\$ 6.077.150.146,61	R\$ 5.928.960.847,79	R\$ 148.189.298,82	R\$ 3.607.228.682,83	R\$ 304.075.228,26	9,42%	10,99%	5,79%
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 desde 2006

Patrimônio Financeiro Líquido Regime Capitalizado
(Janeiro de 2006 a Dezembro de 2023)



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 DTVM	Caixa Econômica Federal	Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	0,80%	Não há	D+0	D+0	Não há	18:00
			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 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 Perfil DI	13.077.418/0001-49	0,20%	Não há	D+0	D+0	Não há	17:00
Banrisul Corretora	Banrisul Corretora	Banco do Estado do Rio Grande do Sul	Banrisul Absoluto FI RF	21.743.480/0001-50	0,15%	Não há	D+0	D+0	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
Itaú Unibanco S.A.	Itaú Asset	Itaú Unibanco S.A.	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	BTG Pactual Asset	Banco BTG Pactual	BTG PACTUAL TESOURO IPCA LON	20.374.752/0001-20	0,20%	Não há	D+0	D+2	Não há	15:30
Santander DTVM. S.A.	Santander Brasil Gestão de recursos	Santander Caceis Brasil Distribuidora	Santander IMA-B 5+ Premium RF	37.242.345/0001-61	0,20%	Não há	D+0	D+1	Não há	15:00
Renda Variável										
Caixa Econômica Federal	Caixa DTVM	Caixa Econômica Federal	Caixa FIA Infraestrutura	10.551.382/0001-03	2,00%	Não há	D+1	D+3	Não há	17:00
			Caixa FIA Ações Construção Civil	10.551.375/0001-01	2,00%	Não há	D+1	D+3	Não há	17:00
			Caixa FIA Small	15.154.220/0001-47	1,50%	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+25	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 Ações Construção Civil	09.648.050/0001-54	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 Ações Tecnologia	01.578.474/0001-88	1,90%	20% o que exceder o Ibovespa	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 ECONOMIA REAL II FIP - MULTIESTRATÉGIA	44.172.951/0001-13	2,10%	20% o que exceder IPCA+8%	N.A	N.A	10 anos	N.A
			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 Asset Management	Itaú Ações Asgard Instit. FICFIA	35.495.250/0001-24	2,00%	20% o que exceder o Ibovespa	D+0	D+23	Não há	16:00	
		Banrisul Corretora	ETF FIND 11	11.961.094/0001-81	0,60%	Não há	D+2	D+2	Não há	17:00
BEM DTVM	Trígono Capital	Banco Bradesco	Trigono Flagship Small Caps Inst	36.671.926/0001-56	2,00%	20% o que exceder o Small	D+1	D+32	Não há	14:30
Intrag DTVM	Kinea Investimentos LTDA	Itaú Unibanco S.A.	Kinea Desenvolvimento Logístico FII (KLOG11)	51.734.924/0001-52	1,25%	20% q exceder IPCA+6,5%	N.A	N.A	4 anos	N.A
	Kinea Private Equity Investimentos		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	0,50%	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+35	Não há	15:00



PREFEITURA

Mais **cidade**. Mais **vida**.

