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

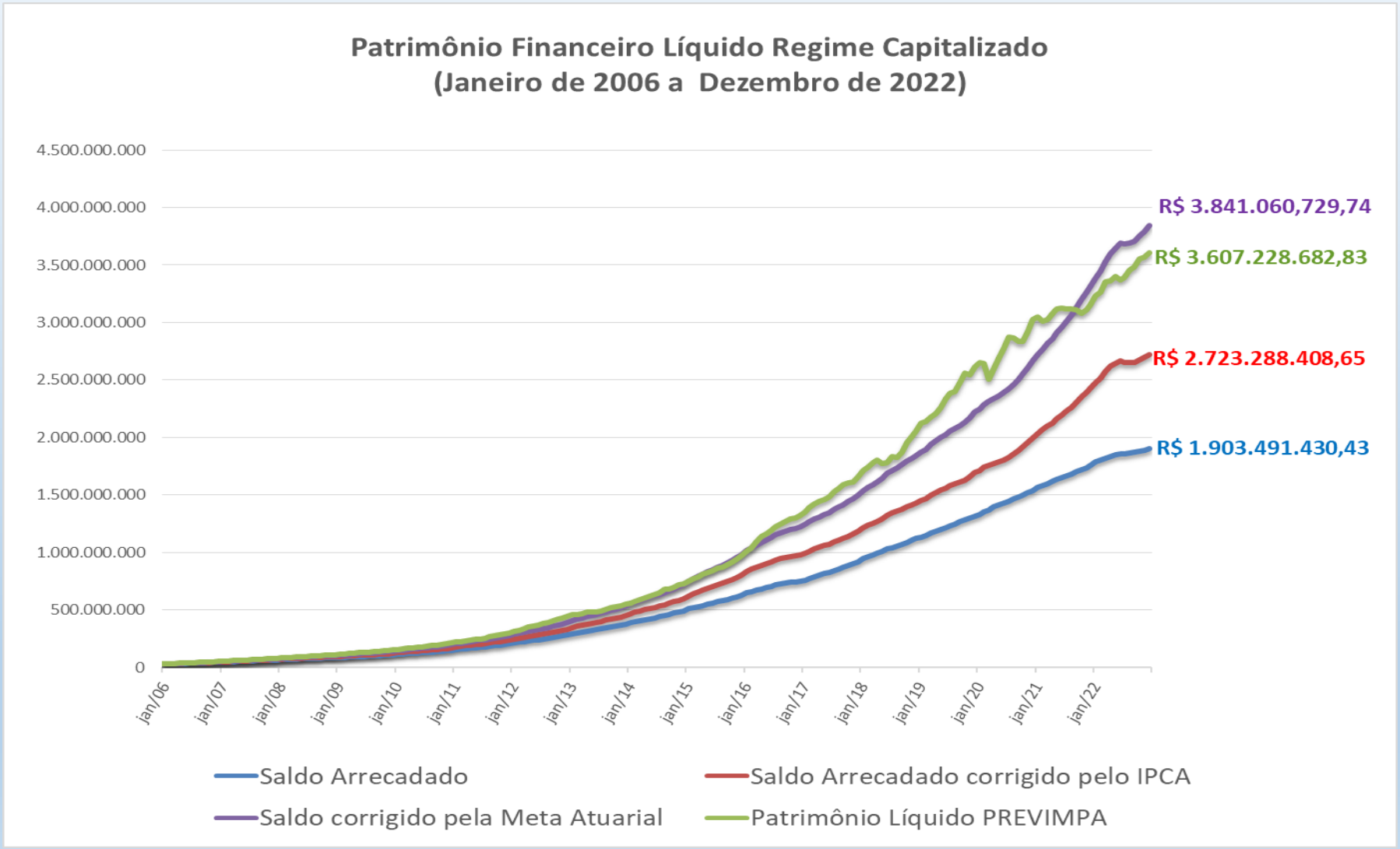
Competência: Dezembro/2022

Demonstrativo do Desempenho Mensal da Carteira

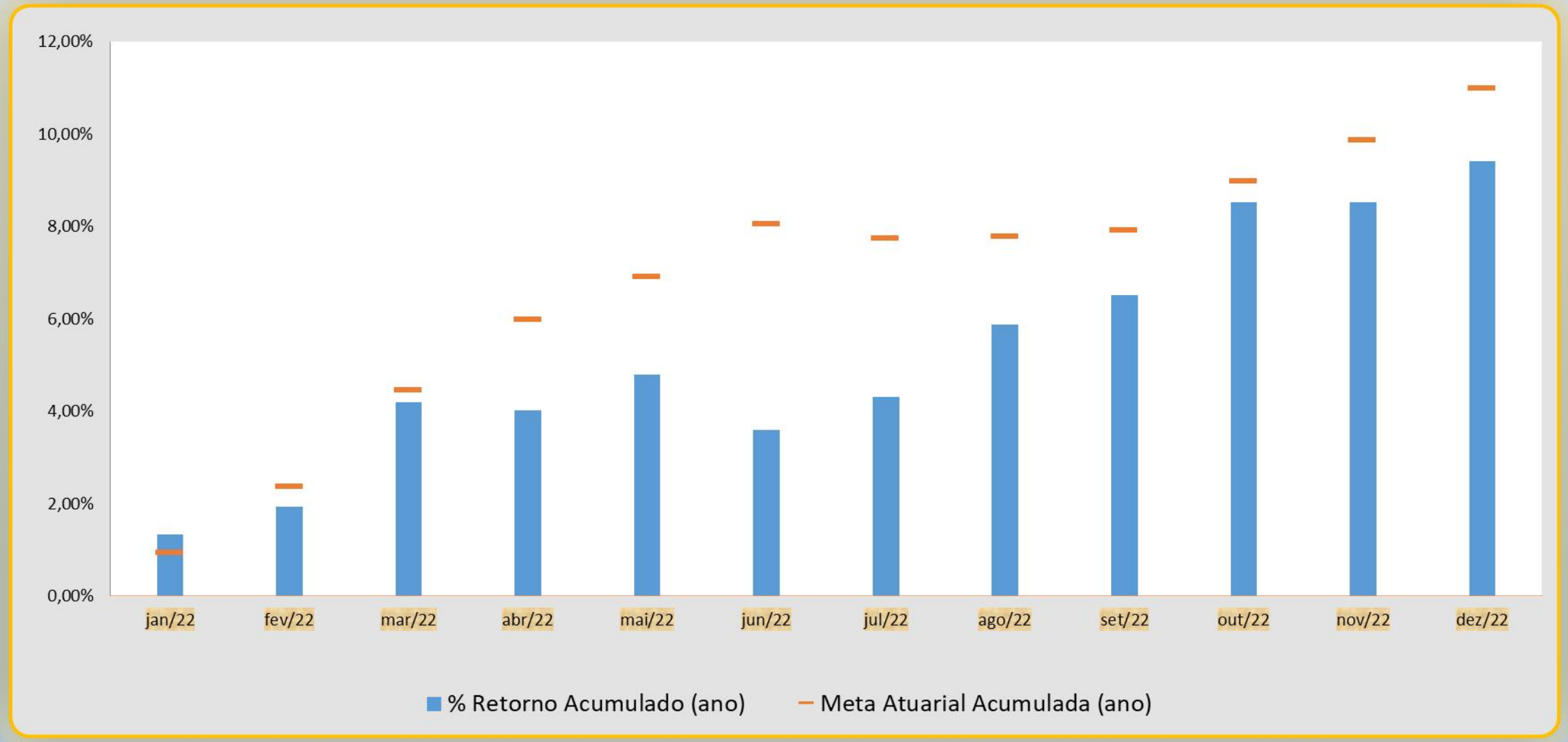
Competência	Patrimônio Líquido Inicial (R$)	Aplicação (R$)	Resgate (R$)	Fluxo de Caixa (R$)	Fluxo de Caixa Acumulado Anual (R$)	Patrimônio Líquido Final (R$)	Retorno Mensal (R$)	Retorno Acumulado Anual (R$)
jan/22	R$ 3.154.964.155,75	R$ 69.471.980,88	R$ 36.144.899,96	R$ 33.327.080,92	R$ 33.327.080,92	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	R$ 3.482.957.464,01	R$ 209.426.202,02	R$ 200.791.820,73	R$ 8.634.381,29	R$ 127.280.800,39	R$ 3.556.360.007,68	R$ 64.768.162,38	R$ 274.115.051,54
nov/22	R$ 3.556.360.007,68	R$ 262.672.195,53	R$ 253.731.809,79	R$ 8.940.385,74	R$ 136.221.186,13	R$ 3.566.178.367,42	R$ 877.974,00	R$ 274.993.025,54
dez/22	R$ 3.566.178.367,42	R$ 122.863.842,32	R$ 110.895.729,63	R$ 11.968.112,69	R$ 148.189.298,82	R$ 3.607.228.682,83	R$ 29.082.202,72	R$ 304.075.228,26
TOTAL ANO	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

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	1,86%	8,52%	0,59%	4,70%	0,99%	8,98%
nov/22	0,02%	8,53%	0,41%	5,13%	0,81%	9,86%
dez/22	0,81%	9,42%	0,62%	5,79%	1,02%	10,99%
		9,42%		5,79%		10,99%


Patrimônio Financeiro Líquido Regime Capitalizado
(Janeiro de 2006 a Dezembro de 2022)
4.500.000.000
4.000.000.000
3.500.000.000
3.000.000.000
2.500.000.000
2.000.000.000
1.500.000.000
1.000.000.000
500.000.000
0
jan/06
jan/07
jan/08
jan/09
jan/10
jan/11
jan/12
jan/13
jan/14
jan/15
jan/16
jan/17
jan/18
jan/19
jan/20
jan/21
jan/22
R$ 3.841.060,729,74
R$ 3.607.228.682,83
R$ 2.723.288.408,65
R$ 1.903.491.430,43
Saldo Arrecadado
Saldo Arrecadado corrigido pelo IPCA
Saldo corrigido pela Meta Atuarial
Patrimônio Líquido PREVIMPA

Rentabilidade X Meta

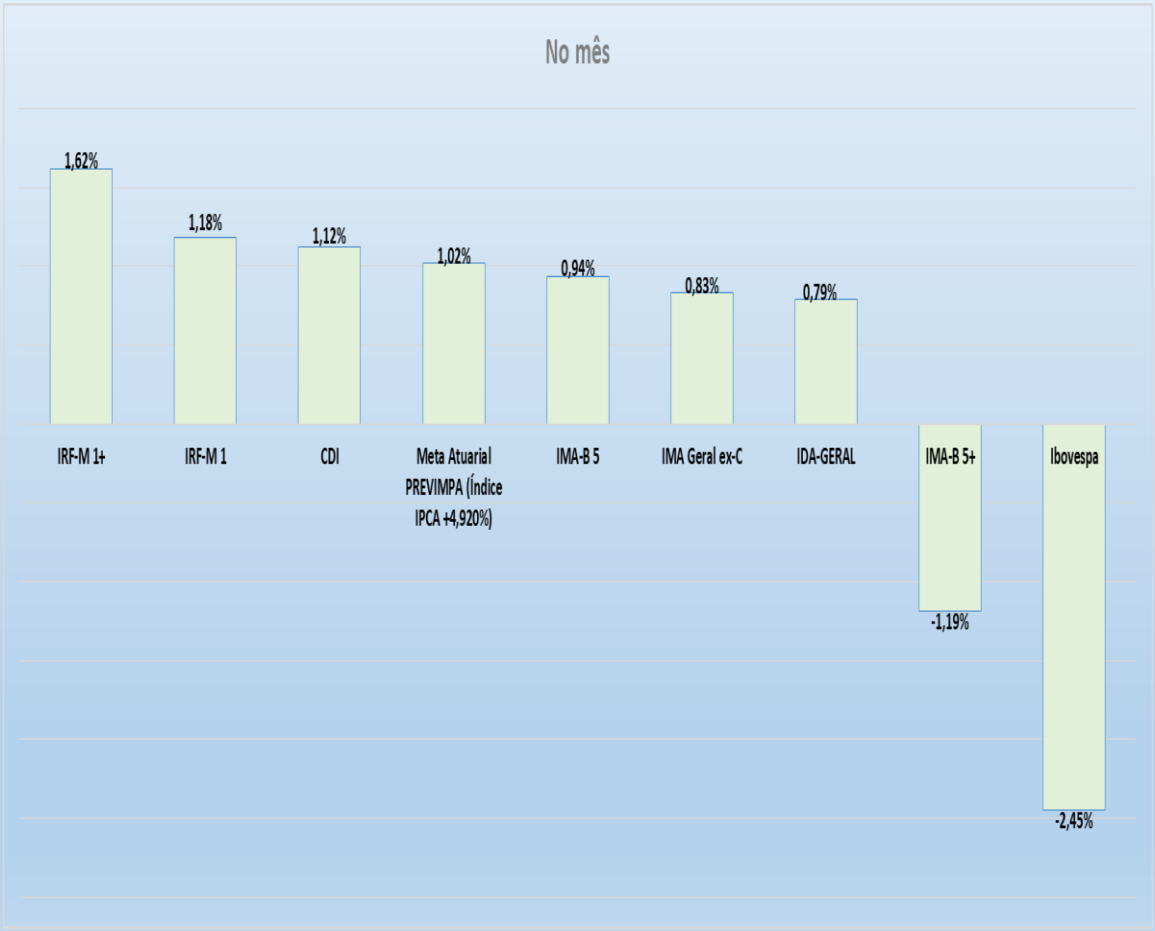


Performance do Fundo do Regime Capitalizado – 2010 à 2022

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
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%

Benchmark

No ano
12,37%
12,02%
10,99%
10,64%
9,78%
9,73%
7,41%
4,69%
3,30%
CDI
IRF-M 1
Meta Atuarial PREVIMPA (Índice IPCA +4,920%)
IDA-GERAL
IMA-B 5
IMA Geral ex-C
IRF-M 1+
Ibovespa
IMA-B 5+


No mês
1,62%
1,18%
1,12%
1,02%
0,94%
0,83%
0,79%
-1,19%
-2,45%
IRF-M 1+
IRF-M 1
CDI
Meta Atuarial PREVIMPA (Índice IPCA +4,920%)
IMA-B 5
IMA Geral ex-C
IDA-GERAL
IMA-B 5+
Ibovespa

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$ 2.353.287.918,15			R$ 2.379.532.215,84	R$ 26.244.297,69	1,12%

Fundos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
Caixa FIC Brasil Disponibilidades RF	R$ 645.635,69	R$ 21.618,38	R$ 9.778,80	R$ 663.641,30	R$ 6.166,03	0,95%
Caixa FI Brasil RF Ref DI LP	R$ 224.322.779,91	R$ 15.446.498,65	R$ 6.700.000,00	R$ 235.763.609,40	R$ 2.694.330,84	1,18%
Caixa FIC Brasil Disponibilidades RF	R$ 2.186.373,28	R$ 4.345.843,33	R$ 1.193.066,81	R$ 5.370.320,05	R$ 31.170,25	0,83%
BB Prev Fluxo RF Simples Fc FI	R$ 1.240.258,51	R$ 58.776,99	R$ 1.779,05	R$ 1.310.281,67	R$ 13.025,22	1,03%
BB Prev RF Ref DI LP Perfil Fc	R$ 186.808.120,61			R$ 188.904.877,22	R$ 2.096.756,61	1,12%
Banrisul Automatico FI RF CP	R$ 3.049,45	R$ 4.459,99		R$ 7.541,57	R$ 32,13	0,61%
Banrisul Absoluto	R$ 146.216.201,13	R$ 51.840.349,07	R$ 51.146.295,91	R$ 148.336.538,80	R$ 1.426.284,51	0,97%
Itau Institucional RF Ref DI FI	R$ 32.274.241,78			R$ 32.638.315,55	R$ 364.073,77	1,13%
Itau Institucional Optimus RF LP Fc	R$ 24.626.737,58			R$ 24.941.734,65	R$ 314.997,07	1,28%
BTG Pact Cre Cor I FICFI RF Cred Priv	R$ 63.914.129,38			R$ 64.678.275,45	R$ 764.146,07	1,20%
Sant RF Cred Priv Crescimento Inst FI LP	R$ 104.291.829,65			R$ 105.522.800,39	R$ 1.230.970,74	1,18%
TOTAL DOS FUNDO DE RENDA FIXA	R$ 786.529.356,97	R$ 71.717.546,41	R$ 59.050.920,57	R$ 808.137.936,05	R$ 8.941.953,24	1,13%
TOTAL DA RENDA FIXA	R$ 3.139.817.275,12	R$ 71.717.546,41	R$ 59.050.920,57	R$ 3.187.670.151,89	R$ 35.186.250,93	1,12%

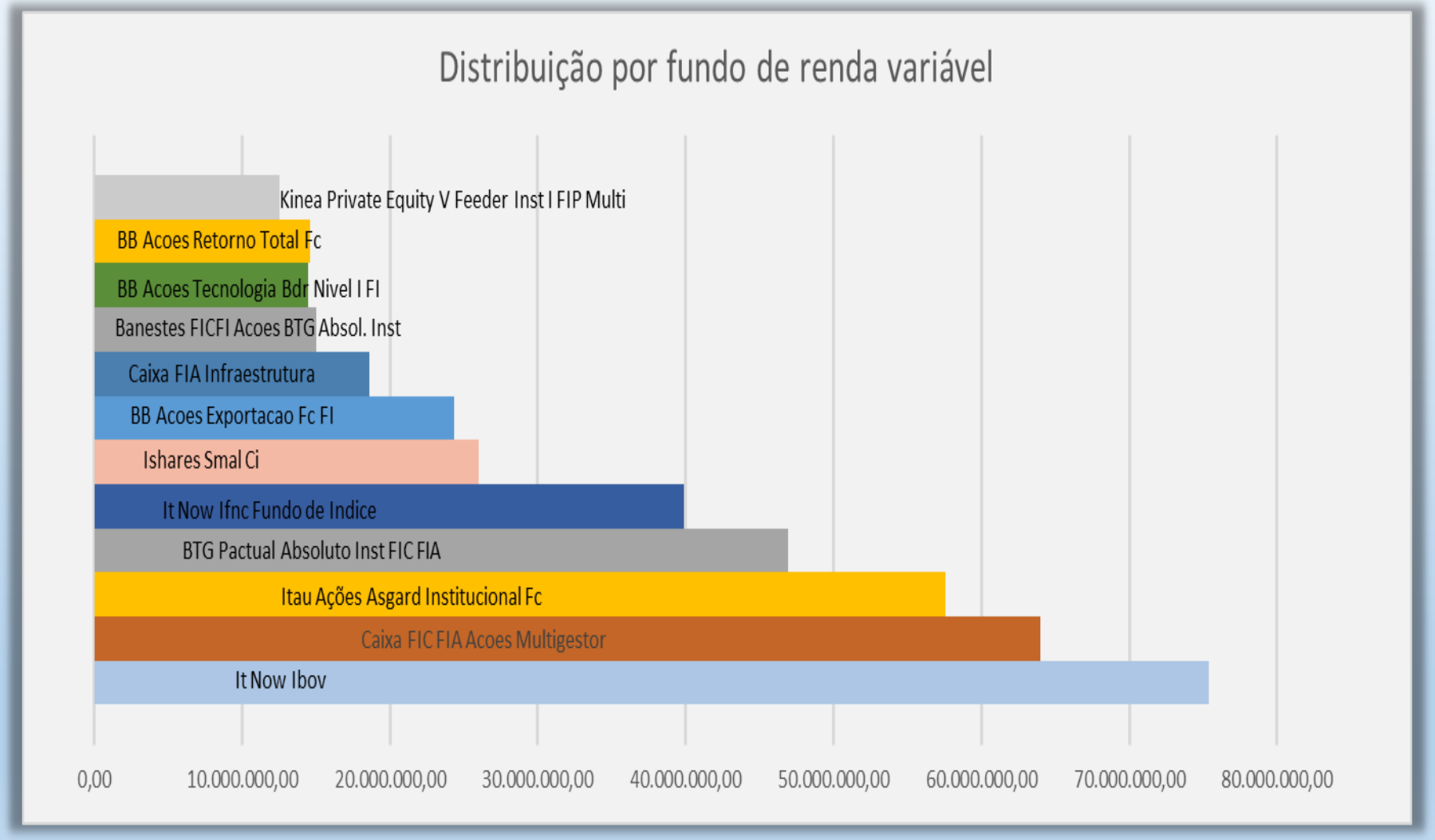
Composição da Carteira e Movimentações : Fundo do Regime Capitalizado

Fundos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
Ishares Ibovespa	R$ -	R$ 51.146.295,91	R$ 51.840.349,07	R$ -	R$ 694.053,16	1,36%
It Now Ifnc Fundo de Indice	R$ 39.244.000,00			R$ 39.912.000,00	R$ 668.000,00	1,70%
It Now Ibov	R$ 76.490.083,22			R$ 75.399.689,79	-R$ 1.090.393,43	-1,43%
Ishares Smal Ci	R$ 26.184.205,08			R$ 26.000.484,30	-R$ 183.720,78	-0,70%
BB Acoes Retorno Total Fc	R$ 15.020.045,16			R$ 14.590.183,39	-R$ 429.861,77	-2,86%
BB Acoes Tecnologia Bdr Nivel I FI	R$ 15.593.275,35			R$ 14.446.020,88	-R$ 1.147.254,47	-7,36%
BB Acoes Exportacao Fc FI	R$ 24.750.685,66			R$ 24.359.224,03	-R$ 391.461,63	-1,58%
Caixa FIC FIA Acoes Multigestor	R$ 66.420.956,33			R$ 63.995.955,35	-R$ 2.425.000,98	-3,65%
Caixa FIA Infraestrutura	R$ 19.502.135,24			R$ 18.587.303,42	-R$ 914.831,82	-4,69%
Banestes FICFI Acoes BTG Absol. Inst	R$ 15.506.206,39			R$ 15.036.382,51	-R$ 469.823,88	-3,03%
BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	R$ 48.371.513,39			R$ 46.889.585,78	-R$ 1.481.927,61	-3,06%
Itau Ações Asgard Institucional Fc	R$ 56.407.360,22			R$ 57.547.366,52	R$ 1.140.006,30	2,02%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R$ 403.490.466,04	R$ 51.146.295,91	R$ 51.840.349,07	R$ 396.764.195,97	-R$ 6.032.216,91	-1,50%

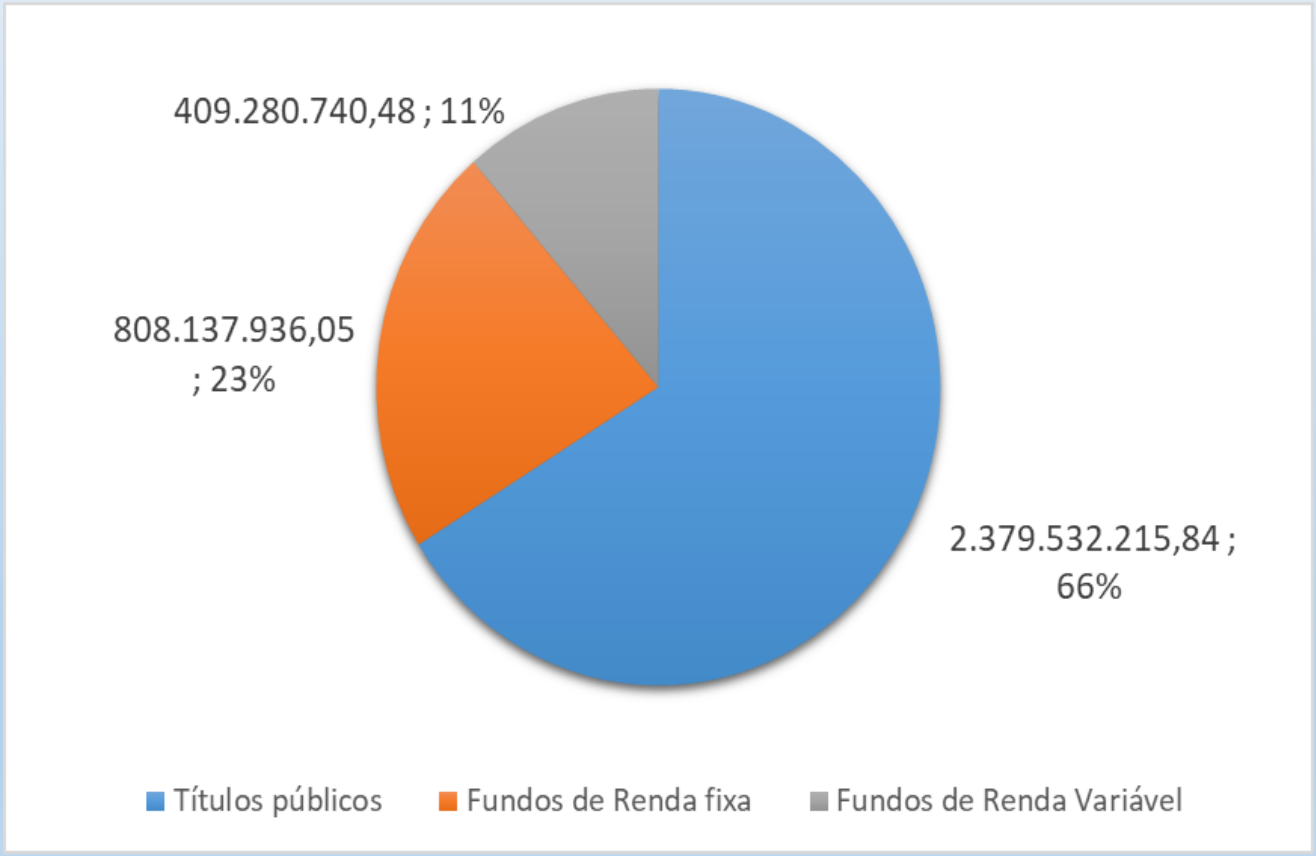
RENTABILIDADE DO REGIME CAPITALIZADO	R$ 3.543.307.741,16	R$ 122.863.842,32	R$ 110.891.269,64	R$ 3.584.434.347,86	R$ 29.154.034,02	0,82%

OUTROS ATIVOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INST I FIP I	R$ 12.696.572,82			R$ 12.516.544,51	-R$ 180.028,31	-1,42%
TERRENO	R$ 8.240.000,00			R$ 8.380.000,00	R$ 140.000,00	1,70%
113.982 AÇÕES BANRISUL ON N1	R$ 1.256.081,64		R$ 2.786,08	R$ 1.232.145,42	-R$ 21.150,14	-1,69%
68.482 AÇÕES BANRISUL PNB N1	R$ 677.971,80		R$ 1.673,91	R$ 665.645,04	-R$ 10.652,85	-1,57%

RENTABILIDADE TOTAL DO REGIME CAPITAL	R$ 3.566.178.367,42	R$ 122.863.842,32	R$ 110.895.729,63	R$ 3.607.228.682,83	R$ 29.082.202,72	0,81%


Distribuição por fundo de renda variável
Kinea Private Equity V Feeder Inst I FIP Multi
BB Acoes Retorno Total Fc
BB Acoes Tecnologia Bdr Nivel I FI
Banestes FICFI Acoes BTG Absol. Inst
Caixa FIA Infraestrutura
BB Acoes Exportacao Fc FI
Ishares Smal Ci
It Now Ifnc Fundo de Indice
BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA
Itau Ações Asgard Institucional Fc
Caixa FIC FIA Acoes Multigestor
It Now Ibov
0,00
10.000.000,00
20.000.000,00
30.000.000,00
40.000.000,00
50.000.000,00
60.000.000,00
70.000.000,00
80.000.000,00

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 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	1 mês	3 meses	6 meses	12 meses	36 meses	No ano	VaR 95% 1 M	Volatilidade 12M	Beta CDI 12M	Sortino 12M	Sharpe 12M
BENCHMARCK IMA EX-C	0,83%	2,19%	5,23%	9,78%	16,11%	9,73%					
NTN-B 760199 20240815	1,34%	2,88%	3,02%	9,33%	23,48%	9,28%	0,99%	2,91%	-2,42	-1,32	-0,94
LFT 210100 20270301	1,06%	3,24%	6,60%	13,06%		13,02%	0,03%	0,19%	0,55	6,02	2,95
LFT 210100 20270901	1,03%	3,25%	6,57%	13,21%		13,16%	0,03%	0,23%	0,36	5,78	3,07
LFT 210100 20280901	1,07%	3,28%	6,55%				0,03%				

Fundos de Renda fixa	1 mês	3 meses	6 meses	12 meses	36 meses	No ano	VaR 95% 1 M	Volatilidade	Beta CDI 12M	Sortino 12M	Sharpe 12M
BENCHMARCK CDI	1,12%	3,25%	6,56%	12,41%	20,62%	12,37%					
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,96%	2,80%	5,68%	10,61%	16,43%	10,58%	0,00%	0,08%	0,95	-15,81	-20,38
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,03%	3,00%	6,04%	11,29%	16,83%	11,26%	0,00%	0,09%	1,01	-15,45	-11,67
BANRISUL AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,93%	2,69%	5,41%	10,00%	13,31%	9,98%	0,02%	0,10%	0,98	-14,63	-21,07
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,13%	3,38%	6,78%	13,16%	21,90%	13,13%	0,01%	0,13%	0,80	12,50	5,13
BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	1,11%	3,24%	6,58%	12,55%	20,19%	12,51%	0,01%	0,10%	0,86	2,80	1,26
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,12%	3,27%	6,62%	12,63%	20,68%	12,59%	0,01%	0,09%	0,90	8,51	2,22
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,15%	3,31%	6,65%	12,71%	20,75%	12,67%	0,03%	0,10%	0,91	8,76	2,60
SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV	1,18%	3,47%	7,03%	13,56%	22,83%	13,52%	0,01%	0,14%	0,95	18,11	7,46
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD	1,20%	3,55%	7,24%	14,28%	22,94%	14,24%	0,04%	0,17%	0,79	21,10	9,50

BENCHMARCK IMA-B 5	0,94%	2,66%	3,17%	9,83%	24,40%	9,78%					
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	1,28%	3,03%	6,32%	13,15%	N.A.	13,11%	0,24%	0,67%	0,24	1,48	0,98

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 12M	Beta IBOV 12M	Sortino 12M	Sharpe
BENCHMARCK IBOVESPA	-2,45%	1,92%	10,89%	4,69%	-6,37%	4,69%		20,95%			
IT NOW IFNC FUNDO DE ÍNDICE - FIND11	0,07%	-5,29%	9,13%	11,39%	-23,70%	11,39%	14,57%	25,18%	1,01	0,72	0,29
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	-2,34%	2,11%	11,19%	5,21%	-5,72%	5,21%	9,74%	20,96%	1,00	20,43	0,02
ISHARES BM&FBOVESPA SMALL CAP FUNDO DE ÍNDICE - SMAL11	-2,99%	-5,43%	5,14%	-14,75%	-29,33%	-14,73%	13,98%	28,27%	1,13	-1,62	-0,66
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-2,86%	-5,01%	2,96%	-10,15%	-25,37%	-10,15%	10,30%	21,74%	0,97	-2,37	-0,70
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-7,36%	-9,69%	0,82%	-29,38%	-24,96%	-29,37%	10,58%	25,99%	0,70	-2,34	-1,47
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	-1,58%	8,67%	6,91%	-13,06%	8,46%	-13,05%	7,66%	21,61%	0,90	-2,29	-0,85
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-3,65%	-2,54%	6,22%	-1,80%	-15,63%	-1,79%	10,35%	21,11%	0,93	-1,05	-0,30
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	-4,69%	-0,87%	6,06%	5,70%	N.A.	5,71%	12,64%	23,58%	0,99	0,20	0,07
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,03%	-2,45%	8,81%	-4,58%	-30,46%	-4,57%	9,06%	23,33%	0,95	-1,01	-0,37
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,06%	-2,51%	8,79%	-4,68%	-30,59%	-4,67%	9,14%	23,51%	0,96	-1,01	-0,37
ITAÚ ASGARD INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,02%	-2,51%	8,79%	-4,68%	-30,59%	5,94%	8,90%	20,54%	0,92	0,23	0,05

Risco da carteira total Previmpa	VAR 95% 1 M da carteira do PREVIMPA:	1,31%

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$ 3.417.207,04	R$ 212.406,64	R$ 3.443.698,45	R$ 218.340,82	R$ 32.425,59	1,80%
COMPREV - BB Previd RF Perfil	R$ 735.086,50	R$ 2.886.970,56	R$ 200.000,00	R$ 3.443.380,23	R$ 21.323,17	1,03%
FUNDO PREVIDENCIA - BB Previd RF Fluxo	R$ 307.351,03	R$ 9.239,89	R$ 3.079,75	R$ 316.732,41	R$ 3.221,24	1,04%
REPARTIÇÃO SIMPLES - Caixa Disponibilidad	R$ 6.362.347,00	R$ 7.914.362,21	R$ 3.724.036,45	R$ 10.617.733,90	R$ 65.061,14	0,77%
REPARTIÇÃO SIMPLES - Caixa Brasil DI	R$ 13.388.016,21			R$ 13.541.937,59	R$ 153.921,38	1,15%
TAXA ADM - Caixa Disponibilidades	R$ 10.301,02	R$ 439.270,53	R$ 294.535,53	R$ 155.878,28	R$ 842,26	1,02%
TAXA ADM - Caixa Brasil DI	R$ 303.759,81	R$ 73.510,00	R$ 379.525,43	R$ -	R$ 2.255,62	1,50%
TAXA ADM - BB Previd RF Fluxo	R$ 4.204.361,48	R$ 1.233.581,63	R$ 981.604,06	R$ 4.501.919,37	R$ 45.580,32	1,05%
TAXA ADM - BB Previd RF Perfil	R$ 13.276.487,41		R$ 8.000.000,00	R$ 5.388.424,08	R$ 111.936,67	1,21%
FRAP - BB Previd RF Fluxo	R$ 2.428.686,32	R$ 172.761,51	R$ 10.444,00	R$ 2.617.365,99	R$ 26.362,16	1,05%
ADIANTAMENTO - BB Previd RF Fluxo	R$ 1.055,85		R$ 1.059,73	R$ -	R$ 3,88	0,74%
Conta Corrente	R$ 29,92			R$ 5.310,84		
TOTAL TAXA ADM E REPARTIÇÃO SIMPLES	R$ 44.434.689,59	R$ 12.942.102,97	R$ 17.037.983,40	R$ 40.807.023,51	R$ 468.214,35	1,10%

Gestor e Administrador

Admistrador	Gestor	Valor	Distribuição
Tesouro Nacional	Gestão Própria - PREVIMPA	R$ 2.379.532.215,84	66,2%
Caixa Econômica Federal	Caixa DTVM	R$ 324.380.829,52	9,0%
BB Gestão de Recursos DTVM	BB Gestão de Recursos DTVM	R$ 243.610.587,19	6,8%
Itaú Unibanco S.A.	Itaú DTVM	R$ 230.439.106,51	6,4%
Banco do Estado do Rio Grande do Sul	Banrisul Corretora	R$ 148.344.080,37	4,1%
BTG Pactual Serviços Financeiros S.A.	BTG Pactual Asset Management S.A. DTVM	R$ 111.567.861,23	3,1%
Banco Santander S.A.	Santander Brasil Gestão de Recursos LTDA	R$ 105.522.800,39	2,9%
BNP Paribas	Blackrock Brasil Gestora	R$ 26.000.484,30	0,7%
Banestes S.A	Banestes DTVM	R$ 15.036.382,51	0,4%
Intrag DTVM	Kinea Private Equity Investimentos	R$ 12.516.544,51	0,3%

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 '	2.379.532.215,84	N. A.	N. A.	N. A.	2.379.532.215,84	66,15%	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 '	148.336.538,80	3.684.304.773,41	4,03%	100%	154.378.041,72	4,29%	100%	100%	5%
Banrisul Automatico FI RF CP		7.541,57	1.699.887.266,11	0,00%						
Caixa FIC Brasil Disponibilidades RF		6.033.961,35	918.894.770,10	0,66%						
BB Prev Fluxo RF Simples Fc FI	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	1.310.281,67	3.841.990.026,28	0,03%	15%	483.558.818,49	13,44%	60%	60%	0,5%
Itau Institucional Optimus RF LP Fc		24.941.734,65	1.243.933.380,82	2,01%						
Caixa FI Brasil RF Ref DI LP		235.763.609,40	13.943.633.561,86	1,69%						
BB Prev RF Ref DI LP Perfil Fc		188.904.877,22	12.858.761.791,29	1,47%						
Itau Institucional RF Ref DI FI		32.638.315,55	3.683.074.421,99	0,89%						
BTG Pact Cre Cor I FICFI RF Cred Priv	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	64.678.275,45	2.933.751.992,33	2,20%	5%	170.201.075,84	4,73%	5%	5%	5%
Sant RF Cred Priv Crescimento Inst FI LP		105.522.800,39	2.684.723.806,11	3,93%						

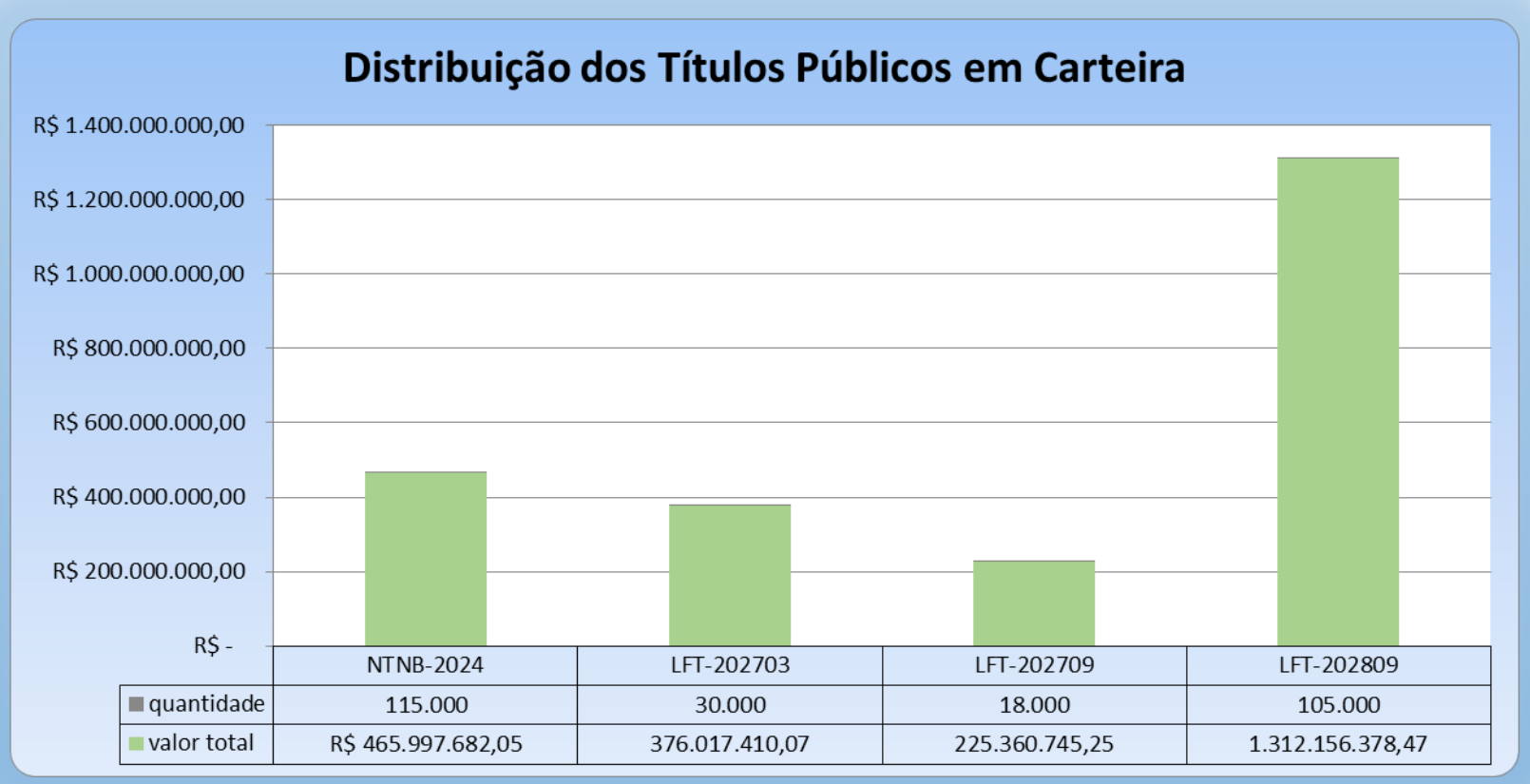
Enquadramento dos Ativos de Renda Variável

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	18.587.303,42	205.336.411,74	9,05%	15%	255.452.021,88	11,03%	35%	35%	1,5%
Caixa FIC FIA Acoes Multigestor		63.995.955,35	638.491.745,31	10,02%						
BB Acoes Retorno Total Fc		14.590.183,39	903.866.328,17	1,61%						
BB Acoes Tecnologia Bdr Nivel I FI		14.446.020,88	387.097.710,98	3,73%						
BB Acoes Exportacao Fc FI		24.359.224,03	177.657.151,63	13,71%						
BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA		46.889.585,78	1.373.628.350,10	3,41%						
Banestes FICFI Acoes BTG Absol. Inst		15.036.382,51	142.932.888,12	10,52%						
Itau Ações Asgard Institucional Fc		57.547.366,52	316.645.785,61	18,17%						
It Now Ibov	Artigo 8º, Inciso II	75.399.689,79	4.472.614.461,73	1,69%	15%	141.312.174,09				1,5%
Ishares Smal Ci		26.000.484,30	2.408.682.105,73	1,08%						
It Now Ifnc Fundo de Indice		39.912.000,00	683.370.916,18	5,84%						
Kinea Private Equity V Feeder Inst I FIP Mu	Artigo 10º, Inciso II	12.516.544,51	333.428.176,63	3,75%	15%	12.516.544,51	0,35%	5%	5%	1%

*No Fundo Itaú Ações Asgard Institucional Fc ocorreu desenquadramento passivo pelo 150º dia, tendo prazo para adequação de 180 dias conforme artigo 27, da resolução 4963/21.

Carteira Própria de Títulos Públicos

Cód. Papel	Vencimento	Data Compra	Qtde. Bloq.	Qtde. Total	PU Compra	Preço Unitário	Taxa %	Valor Curva	Valor Total à Mercado	%PL
Títulos Públicos										
LFT										
LFT20270301 - 210100	01/03/2027	30/09/2022	0	30.000	12.146,90386800	12.533,91366900	0,158000	376.207.506,81	376.017.410,07	15,80%
LFT20270901 - 210100	01/09/2027	30/09/2022	0	18.000	12.132,93555500	12.520,04140300	0,165000	225.468.668,70	225.360.745,25	9,47%
LFT20280901 - 210100	01/09/2028	20/07/2022	0	20.000	11.796,60324900	12.496,72741400	0,172000	250.009.274,22	249.934.548,28	10,50%
LFT20280901 - 210100	01/09/2028	20/07/2022	0	50.000	11.796,60324900	12.496,72741400	0,172000	625.023.185,55	624.836.370,70	26,26%
LFT20280901 - 210100	01/09/2028	17/08/2022	0	10.000	11.914,18458400	12.496,72741400	0,175000	124.983.431,10	124.967.274,14	5,25%
LFT20280901 - 210100	01/09/2028	17/08/2022	0	5.000	11.913,47419900	12.496,72741400	0,176000	249.952.724,86	62.483.637,07	2,63%
LFT20280901 - 210100	01/09/2028	17/08/2022	0	20.000	11.913,47419900	12.496,72741400	0,176000	62.488.181,21	249.934.548,28	10,50%
Total LFT:				**153.000**				**1.914.132.972,45**	**1.913.534.533,79**	**80%**
NTN-PÓS										
NTNB20240815 - 760199	15/08/2024	11/05/2022	20.000	115.000	4.033,098863	4.052,15375700	5,569991	472.591.663,95	465.997.682,05	19,58%
Total NTN-PÓS:			**20.000**	**115.000**				**472.591.663,95**	**465.997.682,05**	**20%**
Total Títulos Públicos:				**268.000**					**R$ 2.379.532.215,84**	**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
0,30	**0,29**	**0,29%**	**-R$ 6.784.006,64**	**-R$ 678,40**	**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 Federal	Caixa DTVM	Caixa Econômica Federal	Caixa FIC Brasil Disponibilidades I	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
Banco do Estado do Rio Grande do Sul	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
			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 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 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 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 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
		Banrisul Corretora	ETF DIVO 11	13.416.245/0001-46	0,50%	Não há	D+2	D+2	Não há	17:00
			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