

REGIME PRÓPRIO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE

SORRISO / PREVISÓ

RELATÓRIO SEMESTRAL
DE
INVESTIMENTOS

2º SEMESTRE

2021

02 de fevereiro de 2022

ÍNDICE

1 – INTRODUÇÃO	3
2 – POLÍTICA DE INVESTIMENTOS e MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA	4
3 – RESUMO DO REGULAMENTO DOS INVESTIMENTO	5
4 – MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA - RENDA FIXA	9
5 – RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS	16
5.1 - Melhor Desempenho Trimestral dos Investimentos	18
5.2 - Pior Desempenho Trimestral dos Investimentos	20
6 – ANÁLISE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO	22
7 – CONCLUSÃO	23
7.1 - Rentabilidade da Carteira Semestral	23
7.2 - Meta Atuarial	24
7.3 - Perfil de Risco do Investidor	25
7.4 - Avaliação de Desempenho no 1º Semestre	26

1 - INTRODUÇÃO

Atendendo a necessidade do Instituto Previdenciário quanto a Política anual de Investimentos e a Meta Atuarial, enviamos o Relatório Semestral dos investimentos, referente ao 2º SEMESTRE, sobre o desempenho das rentabilidades e os riscos das aplicações financeiras do PREVISÃO.

Este relatório vem atender o **Inciso III, do Art. 3º da Portaria MPS 519/2011**, que exige a elaboração de **Relatórios Semestrais**, para acompanhamento dos riscos e desempenho das aplicações financeiras.

Art. 3. III – realizar avaliação do desempenho das aplicações efetuadas por entidade autorizada e credenciada, no mínimo semestralmente, adotando, de imediato, medidas cabíveis no caso da constatação de performance insatisfatória.

2.1-POLÍTICA DE INVESTIMENTOS 2021 - LIMITE DE SEGMENTO - PREVISO

Nº	Segmentos da Resolução CMN 4.695/2018	Dispositivo Legal Resolução CMN 4.695/2018	Limites do PAI			Carteira de Investimentos		ORIENTAÇÃO EM CASO DE DESENQUADRAMENTO DA CARTEIRA JUNTO A POLÍTICA DE INVESTIMENTO
			Mínimo	Estratégia Alvo	Máximo	Atualmente (%)	Atualmente (R\$)	
RENDA FIXA								
1	Títulos Públicos	Art. 7º, I, a (100%)	0,0%	0,0%	10,0%		-	-
2	F.I. Refer. 100% em Títulos Públicos	Art. 7º, I, b (100%)	0,0%	79,2%	100,0%	84,9%	206.735.500,00	-
3	F.I. índice Mercado 100% em Títulos Público	Art. 7º, I, c (100%)	0,0%	0,0%	100,0%		-	-
4	Operações Compromissadas	Art. 7º, II (5%)	0,0%	0,0%	0,0%		-	-
5	F.I. refer. em Indicadores RF	Art. 7º, III, a (60%)	0,0%	0,0%	40,0%		-	-
6	F.I. em índices de RF	Art. 7º, III, b (60%)	0,0%	0,0%	40,0%		-	-
7	F.I. referenciado em Indicadores RF	Art. 7º, IV, a (40%)	0,0%	16,8%	40,0%	10,4%	25.273.823,54	-
8	F.I. em índices de RF	Art. 7º, IV, b (40%)	0,0%	0,0%	40,0%		-	-
9	LIG - Letras Imobiliárias Garantidas	Art. 7º, V, b (20%)	0,0%	0,0%	0,0%		-	-
10	CDB	Art. 7º, VI, a (15%)	0,0%	0,0%	13,0%		-	-
11	Poupança	Art. 7º, VI, b (15%)	0,0%	0,0%	2,0%		-	-
12	FIDC - Cota Sênior	Art. 7º, VII, a (5%)	0,0%	0,0%	0,0%		-	-
13	F.I. em Crédito Privado	Art. 7º, VII, b (5%)	0,0%	0,0%	0,0%		-	-
14	F.I. em Debêntures	Art. 7º, VII, c (5%)	0,0%	0,0%	0,0%		-	-
15	TOTAL - RENDA FIXA					95,2%	232.009.323,54	
RENDA VARIÁVEL								
16	F.I. em índices de RV (mín. 50 ações)	Art. 8º, I, a (30%)	0,0%	1,0%	385,0%	1,1%	2.753.620,47	-
17	F.I. em índices de Mercado RV (m. 50 ações)	Art. 8º, I, b (30%)	0,0%	0,0%	5,0%		-	-
18	F.I. em ações	Art. 8º, II, a (20%)	0,0%	1,0%	5,0%	1,4%	3.319.167,61	-
19	F.I. em índices de Mercado RV	Art. 8º, II, b (20%)	0,0%	0,0%	5,0%		-	-
20	F.I. Multimercados	Art. 8º, III (10%)	0,0%	1,0%	5,0%	1,1%	2.575.240,11	-
21	F.I. em Participações	Art. 8º, IV, a (5%)	0,0%	0,0%	10,0%		-	-
22	F.I. Imobiliário negociado em bolsa	Art. 8º, IV, b (5%)	0,0%	0,0%	5,0%		-	-
23	F.I.C Ações - Mercado de Acesso	Art. 8º, IV, c (5%)	0,0%	0,0%	5,0%		-	-
24	TOTAL - RENDA VARIÁVEL	Art. 8º, § 1 (30%)				3,5%	8.648.028,19	
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR								
25	F.I.C em Dívida Externa	Art. 9º A, I (10%)	0,0%	0,0%	45,0%		-	-
26	F.I.C em Investimento no Exterior	Art. 9º A, II (10%)	0,0%	0,0%	5,0%		-	-
27	F.I. Ações - BDR Nível I	Art. 9º A, III (10%)	0,0%	1,0%	5,0%	0,5%	1.313.438,91	-
28	TOTAL - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Art. 9º A (10%)				0,5%	1.313.438,91	
29	DESENQUADRADO	-		100,0%		0,0%	-	-
30	CONTA CORRENTE	-				0,7%	1.640.878,00	
31	PATRIMÔNIO TOTAL					100,0%	243.611.668,64	4

3-RESUMO DO REGULAMENTO DOS INVESTIMENTOS

INFORMAÇÕES	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI
CNPJ	13.077.418/0001-49	11.328.882/0001-35	13.322.205/0001-35	07.111.384/0001-69
SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa
CLASSIFICAÇÃO	Renda Fixa	Renda Fixa índices	Previdência Renda Fixa	Renda Fixa índices
ÍNDICE	CDI	IRF – M 1	IDKA 2	IRF – M
PÚBLICO ALVO	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social
ADMINISTRADOR	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
GESTOR	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
CUSTODIANTE	Banco do Brasil S.A.	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
DISTRIBUIDOR	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.
AUDITORIA	KPMG Auditores independentes	Deloitte Touche Tohmatsu Auditores independentes	Deloitte Touche Tohmatsu Auditores independentes	Deloitte Touche Tohmatsu Auditores independentes
DATA DE INÍCIO	28/04/2011	08/12/2009	28/04/2011	08/12/2004
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,20% a.a.	0,10% a.a.	0,20% a.a.	0,20% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	1.000,00	1.000,00	10.000,00	10.000,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	0,01	Qualquer valor	Qualquer valor	Qualquer valor
RESGATE MÍNIMO	0,01	Qualquer valor	Qualquer valor	Qualquer valor
SALDO MÍNIMO	0,01	Qualquer valor	Qualquer valor	Qualquer valor
CARÊNCIA	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)
RISCO DE MERCADO*	2 - Baixo	2 - Baixo	1 - Muito baixo	4 - Alto
ENQUADRAMENTO LEGAL	FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, a (40% e 20% por fundo)	FI Refer. 100% Títulos TN - Art. 7º, I, b (100%) (exc. Tx. de 1 dia)	FI Refer. 100% Títulos TN - Art. 7º, I, b (100%) (exc. Tx. de 1 dia)	FI Refer. 100% Títulos TN - Art. 7º, I, b (100%) (exc. Tx. de 1 dia)

* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

INFORMAÇÕES	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 A TP RF LP
CNPJ	07.442.078/0001-05	07.861.554/0001-22	03.737.206/0001-97	14.386.926/0001-71
SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa
CLASSIFICAÇÃO	Renda Fixa índices	Renda Fixa índices	Referenciado – DI	Renda Fixa índices
ÍNDICE	IMA – B	IMA – B	CDI	IDKA 2
PÚBLICO ALVO	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprio de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social
ADMINISTRADOR	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
GESTOR	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	VITER-Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
CUSTODIANTE	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
DISTRIBUIDOR	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
AUDITORIA	Deloitte Touche Tohmatsu Auditores independentes	Deloitte Touche Tohmatsu Auditores independentes	Ernst & Young Terco Auditores Independentes	kPMG Auditores independentes
DATA DE INÍCIO	24/07/2005	09/03/2006	05/07/2006	16/08/2012
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,20% a.a.	0,30% a.a.	0,20% a.a.	0,20% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	10.000,00	10.000,00	50.000,00	1.000,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	Qualquer valor	Qualquer valor	1.000,00	0,00
RESGATE MÍNIMO	Qualquer valor	Qualquer valor	1.000,00	0,00
SALDO MÍNIMO	Qualquer valor	Qualquer valor	1.000,00	0,00
CARÊNCIA	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+2 (Dois dias úteis após a solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)
RISCO DE MERCADO*	5 - Muito Alto	5 - Muito Alto	2 - Baixo	3 - Médio
ENQUADRAMENTO LEGAL	FI Refer. 100% Títulos TN - Art. 7º, I, b (100%) (exc. Tx. de 1 dia)	FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, a (40% e 20% por fundo)	FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, a (40% e 20% por fundo)	FI Refer. 100% Títulos TN - Art. 7º, I, b (100%) (exc. Tx. de 1 dia)

* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

INFORMAÇÕES	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP	FI CAIXA BRASIL IRF - M TP RF LP	FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP	FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP
CNPJ	11.060.913/0001-10	14.508.605/0001-00	10.740.658/0001-93	30.036.235/0001-02
SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Variável
CLASSIFICAÇÃO	Renda Fixa Índices	Renda Fixa Índices	Renda Fixa Índices	Multimercados Dinâmico
ÍNDICE	IMA - B 5	IRF – M	IMA – B	S&P500
PÚBLICO ALVO	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social
ADMINISTRADOR	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
GESTOR	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
CUSTODIANTE	Caixa Econômica Federal	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
DISTRIBUIDOR	Caixa Econômica Federal	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
AUDITORIA	kPMG Auditores independentes	Ernst & Young Terco Auditores Independentes S/S	kPMG Auditores independentes	KPMG Auditores Independentes
DATA DE INÍCIO	09/07/2010	16/08/2012	08/03/2010	16/10/2018
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,20% a.a.	0,20% a.a.	0,20% a.a.	0,80% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	1.000,00	1.000,00	1.000,00	10.000,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	0,00	Qualquer valor	0,00	1.000,00
RESGATE MÍNIMO	0,00	Qualquer valor	0,00	1.000,00
SALDO MÍNIMO	0,00	Qualquer valor	0,00	5.000,00
CARÊNCIA	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)
RISCO DE MERCADO*	2 - Baixo	3 - Médio	3 - Médio	4 - Alto
ENQUADRAMENTO LEGAL	FI Refer. 100% Títulos TN - Art. 7º, I, b (100%) (exc. Tx. de 1 dia)	FI Refer. 100% Títulos TN - Art. 7º, I, b (100%) (exc. Tx. de 1 dia)	FI Refer. 100% Títulos TN - Art. 7º, I, b (100%) (exc. Tx. de 1 dia)	FI Multimercado - aberto - Art. 8º, III (10%)

* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

INFORMAÇÕES	CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	FI AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO	FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	CAIXA INDEXA SETOR FINANCEIRO FI AÇÕES
CNPJ	13.058.816/0001-18	15.154.220/0001-47	17.502.937/0001-68	40.209.029/0001-00
SEGMENTO	Renda Variável	Renda Variável	Investimento no Exterior	Renda Variável
CLASSIFICAÇÃO	AÇÕES INDEXADOS	AÇÕES SMALL CAPS	Ações Livre	Fundo de Ações
ÍNDICE	IBOV	SMLL	BDR	IFNC
PÚBLICO ALVO	Regimes Próprios de Previdência Social	Pessoas físicas, jurídicas e Regimes Próprio de Previdência Social	Pessoas físicas, jurídicas e Regimes Próprio de Previdência Social	Pessoas físicas, jurídicas e Regimes Próprio de Previdência Social
ADMINISTRADOR	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
GESTOR	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
CUSTODIANTE	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
DISTRIBUIDOR	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
AUDITORIA	KPMG Auditores Independentes	PricewaterhouseCoopers Auditores Independentes	KPMG Auditores Independentes	KPMG Auditores Independentes
DATA DE INÍCIO	29/07/2011	01/11/2012	24/06/2013	26/01/2021
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,50% a.a.	1,50% a.a.	0,70% a.a.	0,80% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	1.000,00	1.000,00	1.000,00	100,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	100,00	100,00	100,00	100,00
RESGATE MÍNIMO	100,00	100,00	100,00	100,00
SALDO MÍNIMO	500,00	500,00	500,00	50,00
CARÊNCIA	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)
RISCO DE MERCADO*	4 - Alto	5 - Muito Alto	4 - Alto	4 - Alto
ENQUADRAMENTO LEGAL	FI em índices de RV - Art. 8º, I, a (30%, 20% por fundo)	FI em Ações - Art. 8º, II, a (20%)	Fundo de Ações BDR Nível 1 - Art. 9º A, III	FI em Ações - Art. 8º, II, a (20%)

* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

4.1 - MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA - RF - CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

FI CAIXA BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO						
1	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	6.038.314,83	-	-	27.277,70	6.065.592,53	0,450%
AGOSTO	6.065.592,53	-	-	29.772,74	6.095.365,27	0,488%
SETEMBRO	6.095.365,27	-	-	32.290,10	6.127.655,37	0,527%
OUTUBRO	6.127.655,37	-	-	30.811,93	6.158.467,30	0,500%
NOVEMBRO	6.158.467,30	-	-	38.327,33	6.196.794,63	0,619%
DEZEMBRO	6.196.794,63	-	-	46.754,25	6.243.548,88	0,749%

FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 A TP RF LP						
2	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	16.659.302,28	-	-	10.818,17	16.648.484,11	-0,065%
AGOSTO	16.648.484,11	-	-	32.351,88	16.680.835,99	0,194%
SETEMBRO	16.680.835,99	1.100.000,00	-	179.871,80	17.960.707,79	1,001%
OUTUBRO	17.960.707,79	1.000.000,00	-	232.097,27	18.728.610,52	-1,239%
NOVEMBRO	18.728.610,52	-	-	452.516,14	19.181.126,66	2,359%
DEZEMBRO	19.181.126,66	-	-	138.048,72	19.319.175,38	0,715%

FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP						
3	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	41.146.629,18	-	-	5.719,50	41.152.348,68	0,014%
AGOSTO	41.152.348,68	-	-	55.078,72	41.207.427,40	0,134%
SETEMBRO	41.207.427,40	-	-	404.271,64	41.611.699,04	0,972%
OUTUBRO	41.611.699,04	-	-	517.666,76	41.094.032,28	-1,260%
NOVEMBRO	41.094.032,28	-	-	1.014.118,44	42.108.150,72	2,408%
DEZEMBRO	42.108.150,72	1.000.000,00	-	327.541,51	43.435.692,23	0,754%

FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP						
4	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	15.229.377,12	-	-	60.710,55	15.168.666,57	-0,400%
AGOSTO	15.168.666,57	-	-	172.486,48	14.996.180,09	-1,150%
SETEMBRO	14.996.180,09	-	-	23.360,45	14.972.819,64	-0,156%
OUTUBRO	14.972.819,64	-	-	383.549,50	14.589.270,14	-2,629%
NOVEMBRO	14.589.270,14	-	-	501.765,25	15.091.035,39	3,325%
DEZEMBRO	15.091.035,39	2.000.000,00	-	17.585,67	17.108.621,06	0,103%

FI CAIXA BRASIL IRF - M TP RF LP						
5	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	21.442.231,15	-	-	100.541,02	21.341.690,13	-0,471%
AGOSTO	21.341.690,13	-	-	135.156,70	21.206.533,43	-0,637%
SETEMBRO	21.206.533,43	-	-	78.278,82	21.128.254,61	-0,370%
OUTUBRO	21.128.254,61	-	-	557.943,86	20.570.310,75	-2,712%
NOVEMBRO	20.570.310,75	-	-	371.317,43	20.941.628,18	1,773%
DEZEMBRO	20.941.628,18	-	-	391.866,41	21.333.494,59	1,837%

FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP						
6	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	5.032.315,99	-	-	20.060,86	5.012.255,13	-0,400%
AGOSTO	5.012.255,13	-	-	56.995,54	4.955.259,59	-1,150%
SETEMBRO	4.955.259,59	-	-	7.719,10	4.947.540,49	-0,156%
OUTUBRO	4.947.540,49	-	-	126.738,11	4.820.802,38	-2,629%
NOVEMBRO	4.820.802,38	-	-	165.800,70	4.986.603,08	3,325%
DEZEMBRO	4.986.603,08	-	-	10.439,13	4.997.042,21	0,209%

4.2 - MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA - RF - BANCO DO BRASIL

BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI						
7	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	10.787.297,27	372.213,65	-	9.003,03	11.168.513,95	0,081%
AGOSTO	11.168.513,95	-	-	19.932,19	11.188.446,14	0,178%
SETEMBRO	11.188.446,14	744.427,30	-	119.361,42	12.052.234,86	0,990%
OUTUBRO	12.052.234,86	372.213,65	-	150.985,47	12.273.463,04	-1,230%
NOVEMBRO	12.273.463,04	372.213,65	-	298.144,65	12.943.821,34	2,303%
DEZEMBRO	12.943.821,34	737.313,50	-	93.775,55	13.774.910,39	0,681%

BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI						
8	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	850.859,70	-	-	3.282,71	847.576,99	-0,387%
AGOSTO	847.576,99	-	-	9.442,66	838.134,33	-1,127%
SETEMBRO	838.134,33	-	-	1.091,02	837.043,31	-0,130%
OUTUBRO	837.043,31	-	-	21.681,65	815.361,66	-2,659%
NOVEMBRO	815.361,66	-	-	28.214,48	843.576,14	3,345%
DEZEMBRO	843.576,14	-	-	1.745,55	845.321,69	0,206%

BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI						
9	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	20.126.959,65	-	-	100.379,80	20.026.579,85	-0,501%
AGOSTO	20.026.579,85	-	-	129.270,09	19.897.309,76	-0,650%
SETEMBRO	19.897.309,76	1.000.000,00	-	78.510,47	20.818.799,29	-0,377%
OUTUBRO	20.818.799,29	-	-	557.511,07	20.261.288,22	-2,752%
NOVEMBRO	20.261.288,22	-	-	365.006,07	20.626.294,29	1,770%
DEZEMBRO	20.626.294,29	-	-	387.095,99	21.013.390,28	1,842%

BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI						
10	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	24.002.894,83	-	-	92.060,85	23.910.833,98	-0,385%
AGOSTO	23.910.833,98	-	-	270.184,62	23.640.649,36	-1,143%
SETEMBRO	23.640.649,36	-	-	36.301,11	23.604.348,25	-0,154%
OUTUBRO	23.604.348,25	-	-	609.512,93	22.994.835,32	-2,651%
NOVEMBRO	22.994.835,32	-	-	791.102,65	23.785.937,97	3,326%
DEZEMBRO	23.785.937,97	1.650.000,00	-	45.453,32	25.481.391,29	0,178%

BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI						
11	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	10.609.679,29	-	-	17.436,19	10.627.115,48	0,164%
AGOSTO	10.627.115,48	-	-	35.543,47	10.662.658,95	0,333%
SETEMBRO	10.662.658,95	-	-	39.059,07	10.701.718,02	0,365%
OUTUBRO	10.701.718,02	-	-	55.514,35	10.646.203,67	-0,521%
NOVEMBRO	10.646.203,67	-	-	82.277,45	10.728.481,12	0,767%
DEZEMBRO	10.728.481,12	-	-	90.590,88	10.819.072,00	0,837%

BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI						
12	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	27.345.243,01	1.200.000,00	-	22.822,24	28.568.065,25	0,080%
AGOSTO	28.568.065,25	-	-	50.984,77	28.619.050,02	0,178%
SETEMBRO	28.619.050,02	-	-	295.762,56	28.914.812,58	1,023%
OUTUBRO	28.914.812,58	-	-	362.232,96	28.552.579,62	-1,269%
NOVEMBRO	28.552.579,62	-	-	693.593,89	29.246.173,51	2,372%
DEZEMBRO	29.246.173,51	-	-	206.537,06	29.452.710,57	0,701%

BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI

13	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	17.610.726,48	-	-	69.239,35	17.679.965,83	0,392%
AGOSTO	17.679.965,83	-	-	79.051,97	17.759.017,80	0,445%
SETEMBRO	17.759.017,80	-	-	81.538,29	17.840.556,09	0,457%
OUTUBRO	17.840.556,09	-	-	87.221,92	17.927.778,01	0,487%
NOVEMBRO	17.927.778,01	-	-	113.051,04	18.040.829,05	0,627%
DEZEMBRO	18.040.829,05	-	-	144.123,92	18.184.952,97	0,793%

4.7 - MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA - RF - RENDA VARIÁVEL

FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP

14	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	2.251.941,28	-	-	59.187,24	2.311.128,52	2,628%
AGOSTO	2.311.128,52	-	-	77.164,61	2.388.293,13	3,339%
SETEMBRO	2.388.293,13	-	-	110.776,33	2.277.516,80	-4,638%
OUTUBRO	2.277.516,80	-	-	174.058,80	2.451.575,60	7,642%
NOVEMBRO	2.451.575,60	-	-	12.012,09	2.439.563,51	-0,490%
DEZEMBRO	2.439.563,51	-	-	135.676,60	2.575.240,11	5,562%

FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I

15	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	1.090.529,50	-	-	59.110,78	1.149.640,28	5,420%
AGOSTO	1.149.640,28	-	-	27.998,32	1.177.638,60	2,435%
SETEMBRO	1.177.638,60	-	-	2.945,22	1.174.693,38	-0,250%
OUTUBRO	1.174.693,38	-	-	128.380,39	1.303.073,77	10,929%
NOVEMBRO	1.303.073,77	-	-	11.624,25	1.291.449,52	-0,892%
DEZEMBRO	1.291.449,52	-	-	21.989,39	1.313.438,91	1,703%

FI AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO

16	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	2.234.983,80	-	-	117.375,34	2.117.608,46	-5,252%
AGOSTO	2.117.608,46	-	-	106.170,17	2.011.438,29	-5,014%
SETEMBRO	2.011.438,29	-	-	131.241,82	1.880.196,47	-6,525%
OUTUBRO	1.880.196,47	-	-	232.563,66	1.647.632,81	-12,369%
NOVEMBRO	1.647.632,81	-	-	53.452,16	1.594.180,65	-3,244%
DEZEMBRO	1.594.180,65	-	-	67.666,13	1.661.846,78	4,245%

CAIXA INDEXA SETOR FINANCEIRO FI AÇÕES

17	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	2.192.116,01	-	-	85.677,91	2.106.438,10	-3,908%
AGOSTO	2.106.438,10	-	-	48.834,17	2.057.603,93	-2,318%
SETEMBRO	2.057.603,93	-	-	193.299,00	1.864.304,93	-9,394%
OUTUBRO	1.864.304,93	-	-	106.990,62	1.757.314,31	-5,739%
NOVEMBRO	1.757.314,31	-	-	36.975,21	1.720.339,10	-2,104%
DEZEMBRO	1.720.339,10	-	-	63.018,27	1.657.320,83	-3,663%

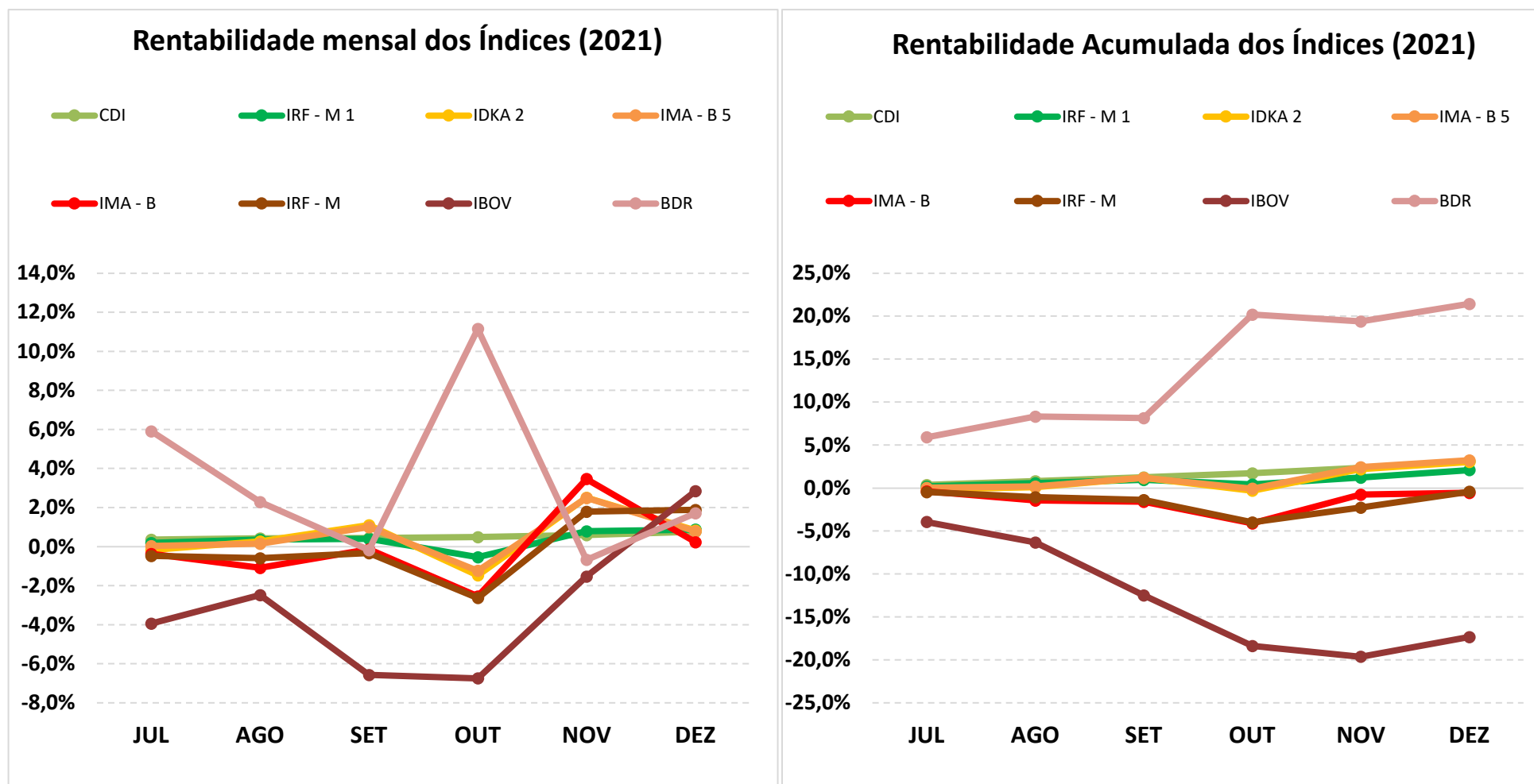
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES

18	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	3.331.162,56	-	-	129.795,39	3.201.367,17	-3,896%
AGOSTO	3.201.367,17	-	-	80.017,10	3.121.350,07	-2,499%
SETEMBRO	3.121.350,07	-	-	204.631,32	2.916.718,75	-6,556%
OUTUBRO	2.916.718,75	-	-	197.981,43	2.718.737,32	-6,788%
NOVEMBRO	2.718.737,32	-	-	41.786,35	2.676.950,97	-1,537%
DEZEMBRO	2.676.950,97	-	-	76.669,50	2.753.620,47	2,864%

5-TABELA DE RENTABILIDADE

INVESTIMENTOS	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ACUMULADO
BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,39%	0,45%	0,46%	0,49%	0,63%	0,80%	3,26%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	0,16%	0,33%	0,37%	-0,52%	0,77%	0,84%	1,96%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	0,08%	0,18%	1,03%	-1,25%	2,43%	0,71%	3,19%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	-0,50%	-0,65%	-0,38%	-2,68%	1,80%	1,88%	-0,59%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	-0,38%	-1,13%	-0,15%	-2,58%	3,44%	0,20%	-0,70%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI	-0,39%	-1,11%	-0,13%	-2,59%	3,46%	0,21%	-0,65%
FI CAIXA BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO	0,45%	0,49%	0,53%	0,50%	0,62%	0,75%	3,39%
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 A TP RF LP	-0,06%	0,19%	1,08%	-1,29%	2,42%	0,72%	3,06%
FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP	0,01%	0,13%	0,98%	-1,24%	2,47%	0,77%	3,13%
FI CAIXA BRASIL IRF - M TP RF LP	-0,47%	-0,63%	-0,37%	-2,64%	1,81%	1,87%	-0,50%
FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP	-0,40%	-1,14%	-0,16%	-2,56%	3,44%	0,21%	-0,70%
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP	2,63%	3,34%	-4,64%	7,64%	-0,49%	5,56%	14,35%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	-3,90%	-2,50%	-6,56%	-6,79%	-1,54%	2,86%	-17,35%
FI AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-5,25%	5,01%	-6,52%	-12,37%	-3,24%	4,24%	-17,79%
FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	5,42%	2,44%	-0,25%	10,93%	-0,89%	1,70%	20,45%
CAIXA INDEXA SETOR FINANCEIRO FI AÇÕES	-3,91%	-2,32%	-9,39%	-5,74%	-2,10%	-3,66%	-24,39%
CDI	0,36%	0,43%	0,44%	0,49%	0,59%	0,77%	3,12%
IRF - M 1	0,19%	0,37%	0,40%	-0,54%	0,79%	0,88%	2,10%
IDKA 2	-0,18%	0,26%	1,10%	-1,47%	2,51%	0,83%	3,05%
IMA - B 5	0,03%	0,15%	1,00%	-1,24%	2,50%	0,79%	3,24%
IMA - B	-0,37%	-1,09%	-0,13%	-2,54%	3,47%	0,22%	-0,55%
IRF - M	-0,47%	-0,60%	-0,33%	-2,63%	1,79%	1,89%	-0,42%
IBOV	-3,94%	-2,48%	-6,57%	-6,74%	-1,53%	2,85%	-17,33%
BDR	5,91%	2,28%	-0,17%	11,15%	-0,67%	1,71%	21,43%

GRÁFICO COMPARATIVO DE RENTABILIDADE DOS ÍNDICES

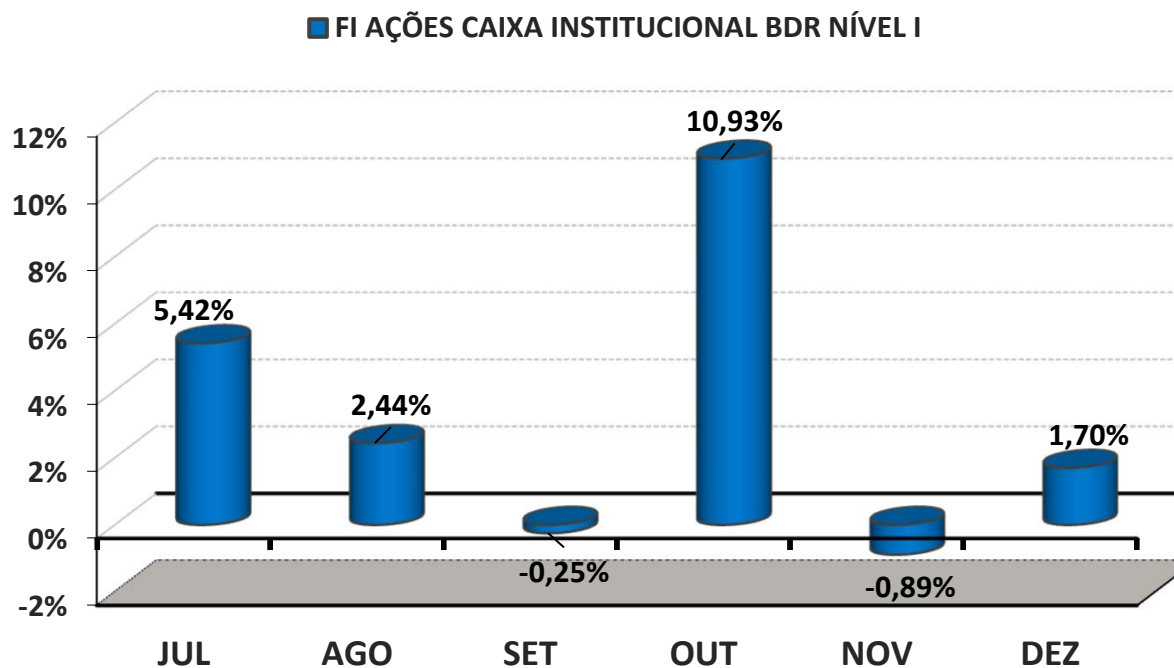


5.1-MELHOR DESEMPENHO SEMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

COMPORTAMENTO MENSAL

FUNDO DE INVESTIMENTO	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ
FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	5,42%	2,44%	-0,25%	10,93%	-0,89%	1,70%

Comportamento MENSAL no Semestre

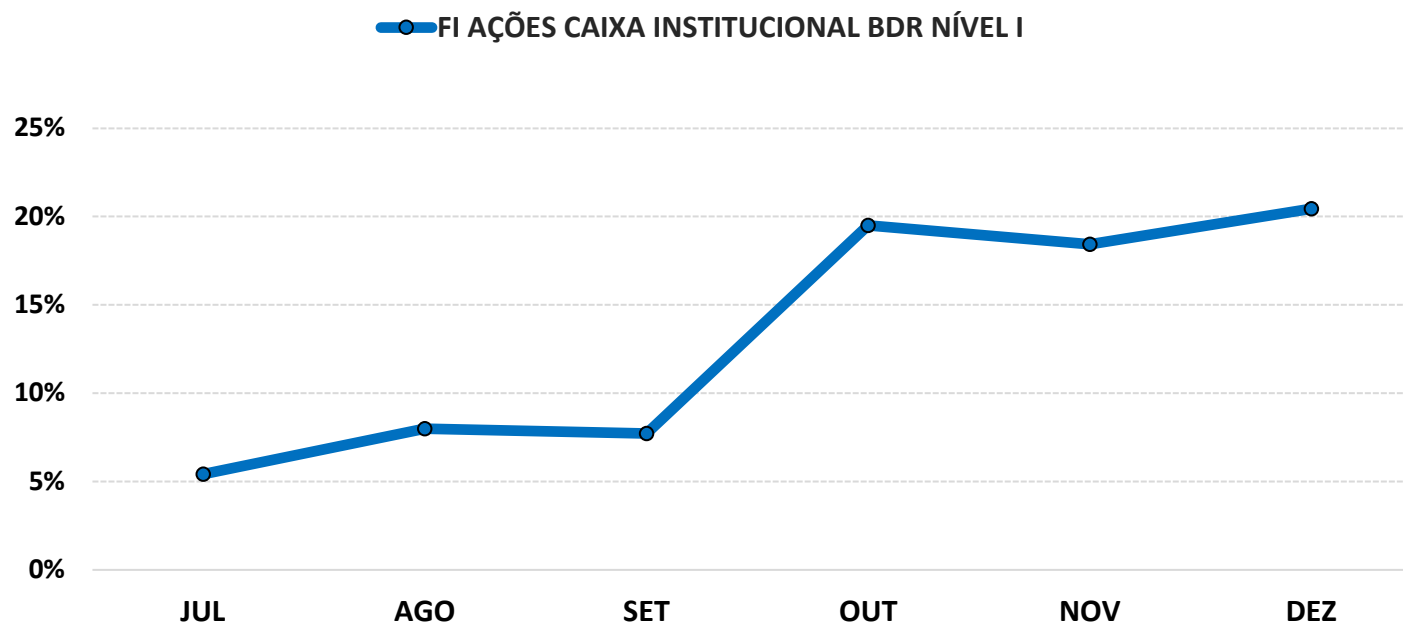


5.1-MELHOR DESEMPENHO ACUMULADO SEMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

COMPORTAMENTO ACUMULADO

FUNDO DE INVESTIMENTO	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ
FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	5,42%	7,99%	7,72%	19,50%	18,43%	20,45%

Comportamento ACUMULADO no Semestre

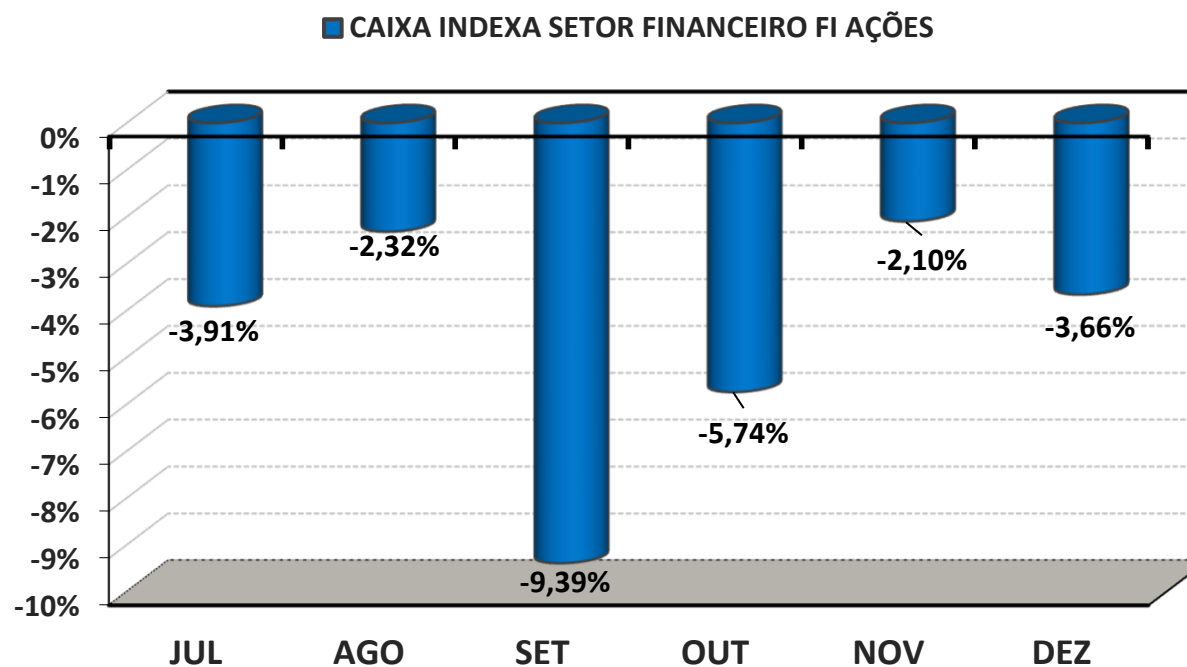


5.2-PIOR DESEMPENHO SEMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

COMPORTAMENTO MENSAL

FUNDO DE INVESTIMENTO	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ
CAIXA INDEXA SETOR FINANCEIRO FI AÇÕES	-3,91%	-2,32%	-9,39%	-5,74%	-2,10%	-3,66%

Comportamento MENSAL no Semestre

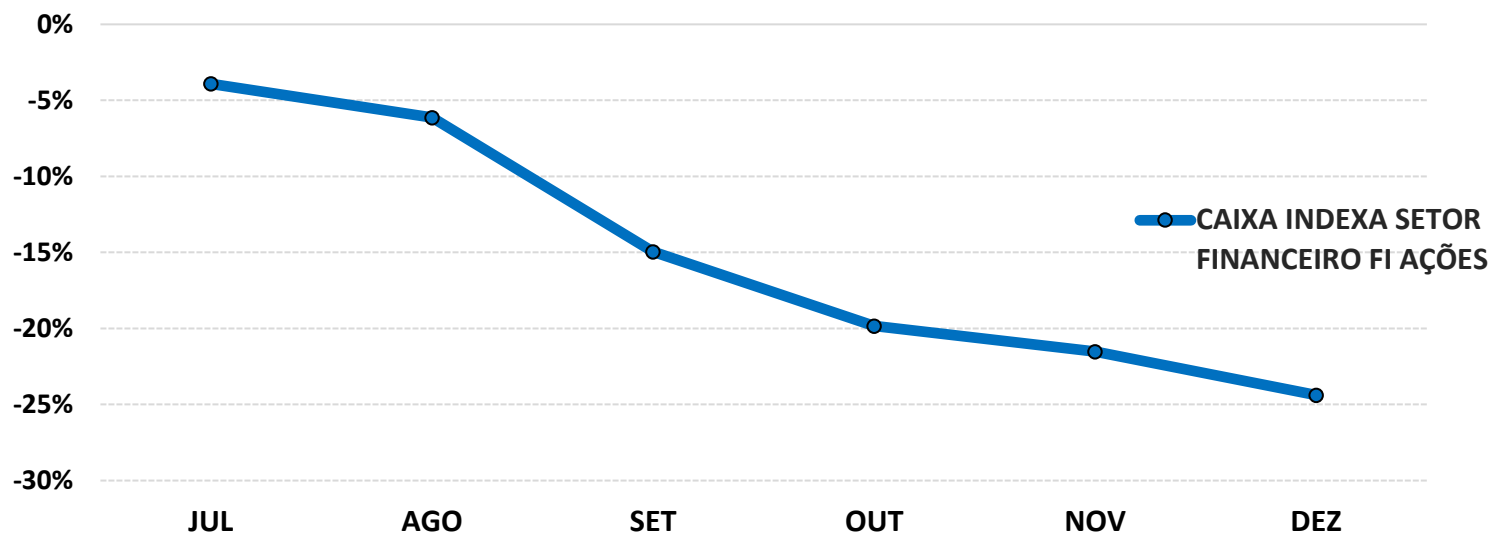


5.2-PIOR DESEMPENHO SEMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

COMPORTAMENTO ACUMULADO

FUNDO DE INVESTIMENTO	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ
CAIXA INDEXA SETOR FINANCEIRO FI AÇÕES	-3,91%	-6,14%	-14,95%	-19,83%	-21,52%	-24,39%

Comportamento ACUMULADO no Semestre



6-ANÁLISE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO - 2º SEMESTRE - 2021

	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ
MENSAL	-0,20%	-0,26%	0,12%	-1,59%	2,08%	0,91%
CDI	0,36%	0,43%	0,44%	0,49%	0,59%	0,77%
IBOVESPA	-3,94%	-2,48%	-6,57%	-6,74%	-1,53%	2,85%
META ATUARIAL	1,40%	1,31%	1,60%	1,69%	1,39%	1,17%

	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ
ACUMULADO DO SEMESTRE	-0,20%	-0,46%	-0,34%	-1,92%	0,11%	1,03%
CDI	0,36%	0,79%	1,24%	1,73%	2,33%	3,12%
IBOVESPA	-3,94%	-6,32%	-12,48%	-18,38%	-19,62%	-17,33%
META ATUARIAL	1,40%	2,73%	4,38%	6,15%	7,62%	8,89%

RENTABILIDADE ACUMULADA DO SEMESTRE DO PREVISÓ: R\$ **2.439.844,96**

META ATUARIAL ACUMULADA DO SEMESTRE: R\$ **19.727.307,54**

DEFASAGEM PARA O CUMPRIMENTO DA META ATUARIAL: R\$ **(17.287.462,58)**

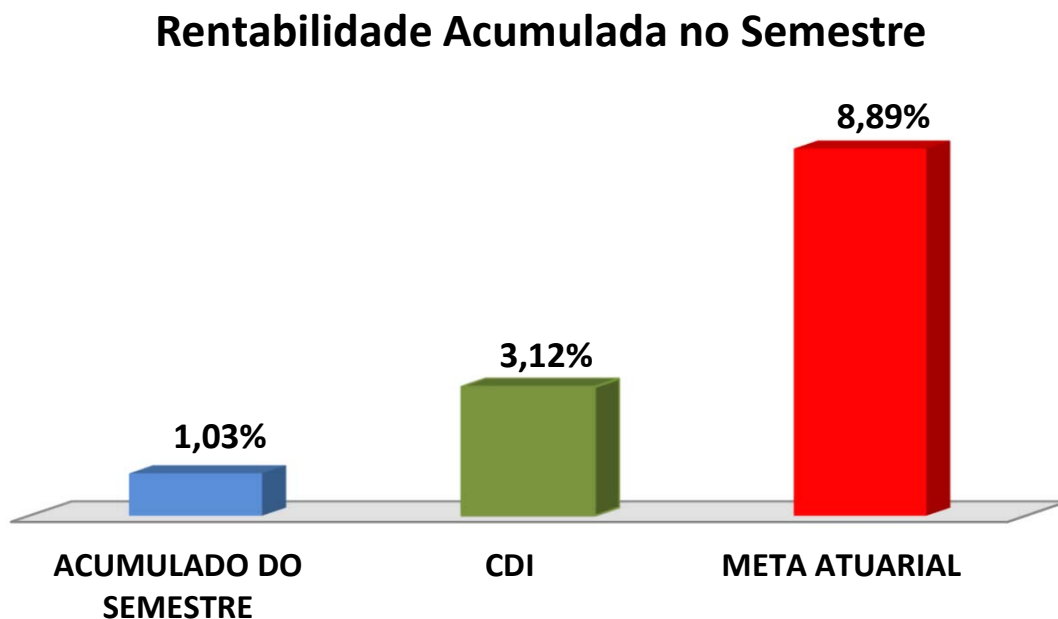
7-CONCLUSÃO

Atendendo o Art. 3, III, da Portaria MPS 519, detalhado na página 3 deste relatório, segue uma análise do desempenho da Carteira de Investimento do PREVISÓ, no 2º Semestre/2021, analisando rentabilidade, risco das operações e aderência ao PAI/2021.

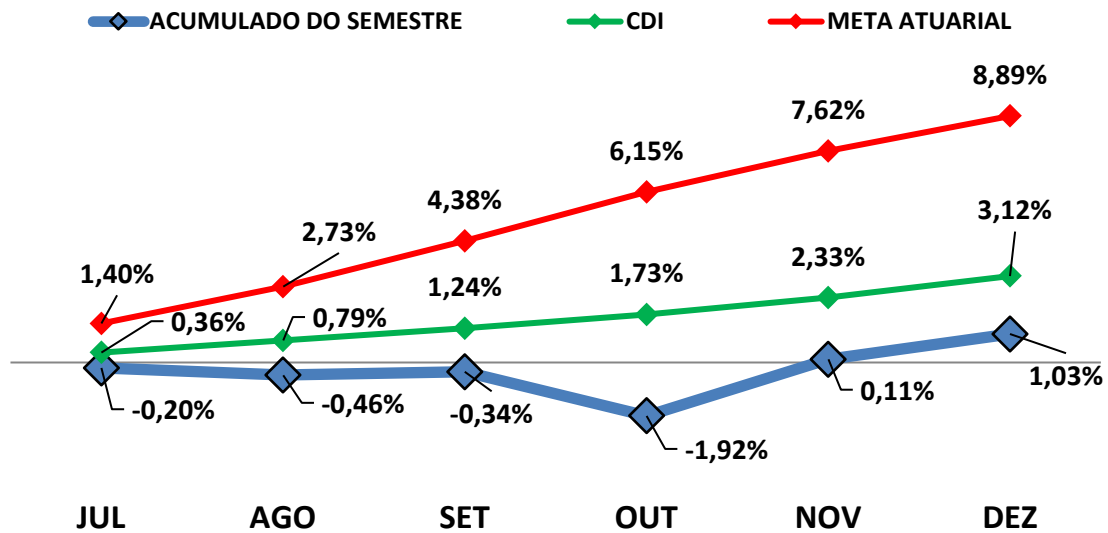
7.1.-RENTABILIDADE DA CARTEIRA SEMESTRAL

A Carteira de Investimentos do PREVISÓ, apresenta-se com uma rentabilidade acumulada no semestre de 1,03% a.a., enquanto o indicador de desempenho do mercado (CDI), obteve um rendimento acumulado no semestre de 3,12% a.a., ou seja, uma carteira que alcançou no período, uma rentabilidade de 32,86% sobre o índice de referência do mercado.

GRÁFICO DA RENTABILIDADE DA CARTEIRA X META ATUARIAL



Rentabilidade Acumulada no Semestre

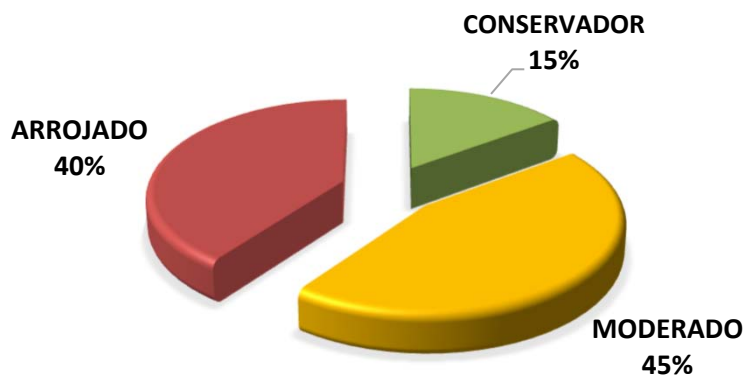


7.2-META ATUARIAL

Enquanto a rentabilidade acumulada no semestre do PREVISÓ é de 1,03% a.a., a Meta Atuarial acumulada no mesmo período é de 8,89%, representando 11,54% sobre a Meta Atuarial.

7.3-PERFIL DE RISCO DO INVESTIDOR

PERFIL DOS INVESTIMENTOS



PERFIL 7
ARROJADO COM
TENDÊNCIA
CONSERVADORA

Descrição do Perfil de Investidor

Objetivo do perfil

Perfil que tem o objetivo de buscar ganhos acima da inflação, mas protegendo uma pequena parte da carteira, das oscilações de mercado. A carteira possui uma grande concentração de ativos moderados e arrojados. Para investidores que possuem obrigações de longo prazo (como Planos de Previdência) é um perfil indicado.

Comportamento da carteira

A carteira com perfil ARROJADO COM TENDÊNCIA CONSERVADORA, busca investimentos que rentabilizam acima da inflação, mas que podem apresentar rentabilidades negativas no curto prazo. Para proteção de parte dos recursos, investe também em ativos conservadores. Apesar de possuir ativos que podem rentabilizar negativo em um mês, esses mesmos ativos podem oferecer ganhos mais vultuosos no médio e longo prazo. Esse tipo de perfil busca o cumprimento da Meta Atuarial, mas protegendo parte dos recursos das oscilações de mercado.

Classificação de Perfil de Investidor - Metodologia Atuarial Consultoria

CONSERVADOR	1	EXTREMAMENTE CONSERVADOR
	2	CONSERVADOR
	3	CONSERVADOR COM TENDÊNCIA MODERADA
MODERADO	4	MODERADO COM TENDÊNCIA CONSERVADORA
	5	MODERADO
	6	MODERADO COM TENDÊNCIA ARROJADA
ARROJADO	7	ARROJADO COM TENDÊNCIA CONSERVADORA
	8	ARROJADO COM TENDÊNCIA MODERADA
	9	ARROJADO
	10	EXTREMAMENTE ARROJADO

7.4-AVALIAÇÃO DE DESEMPENHO NO 2º SEMESTRE

No 2º Semestre, o RPPS optou por uma carteira com Perfil 7 - Arrojado com Tendência Conservadora. O 2º semestre/2021 não foi nada fácil para a carteira dos RPPS. Entre os fatores que derrubaram o desempenho do mercado financeiro, destacamos a elevação do risco fiscal (precatórios estimados em R\$ 95 Bilhões para 2022 e a remodelação do Bolsa Família), a instabilidade política entre os poderes, os impactos da crise hídrica e da aceleração da inflação e a crise sanitária que continuou prejudicando a recuperação da economia.

As orientações e análises efetuadas seguem as disposições estabelecidas na **Resolução CMN 3.922/10**, alterada pela **Resolução CMN 4.695/2018**, tendo presente as condições de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, motivação, adequação as obrigações previdenciárias e transparência.

É o Relatório.



Igor França Garcia
Atuário MIBA/RJ 1.659

Certificação de Especialista em Investimento - CEA
Consultor de Investimentos credenciado pela CVM