**PREVIBARRAS**

**Regime Próprio de Previdência do Munícipio de Quatro Barras - PR**

**Data de Referência:**
**31/08/2020**

## RISCO DE MERCADO DA CARTEIRA

| | Carteira | Indexador |
|---|---|---|
| Retorno[1] (%) | 2,27% | 3,86% |
| Vol (%) | 10,54% | 0,07% |
| Beta | 2,81 | 1,00 |

| | Global | Fundos |
|---|---|---|
| VaR da Carteira | R$ 1.003.988,74 | R$ 1.185.106,79 |
| VaR (% sobre PL) | 1,5444% | 1,8230% |

| Fundos de Investimentos[3] | Index. | Risco: Vol 12m | Risco: VaR | Risco: Beta | Posição da Carteira: PL | Posição da Carteira: Peso | CNPJ Fundo |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **Nome do Fundo** | | | | | | | |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RENDA FIXA LP | IMA-B | 12,52% | R$ 79.746 | - 0,950 | 4.345,99 | 6,69% | 10.740.658/0001-93 |
| FIC-FI EM RENDA FIXA LP IMAB 1000 | IMA-B | 51,57% | R$ 148.728 | 93,889 | 1.967,81 | 3,03% | 12.402.646/0001-84 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FI | IMA-B | 12,46% | R$ 90.625 | - 0,958 | 4.963,52 | 7,64% | 07.861.554/0001-22 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI | IRF-M | 5,89% | R$ 27.174 | 1,299 | 3.148,28 | 4,84% | 07.111.384/0001-69 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP FIC I | IRF-M 1 | 0,54% | R$ 8.065 | 1,201 | 10.230,19 | 15,74% | 11.328.882/0001-35 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP IPCA IV FI | IPCA | 4,36% | R$ 6.066 | - 0,263 | 949,30 | 1,46% | 19.515.015/0001-10 |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDEN | CDI | 6,09% | R$ 83.925 | 0,517 | 9.404,37 | 14,47% | 25.078.994/0001-90 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B5+ TP FI | IMA-B 5+ | 19,24% | R$ 270.416 | - 1,291 | 9.593,18 | 14,76% | 13.327.340/0001-73 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TP FI | IDkA 2 | 4,09% | R$ 40.992 | - 0,754 | 6.833,02 | 10,51% | 13.322.205/0001-35 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC-FI | CDI | 0,07% | R$ 179 | 0,978 | 1.684,15 | 2,59% | 13.077.415/0001-05 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP XI FI | CDI | 4,91% | R$ 4.362 | - 0,439 | 606,07 | 0,93% | 24.117.278/0001-01 |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | CDI | 0,16% | R$ 581 | 0,781 | 2.405,64 | 3,70% | 13.077.418/0001-49 |
| AUSTRO MULTIPAR FI EM COTA DE FI MULTIMEI | IPCA | 13,51% | R$ 31.877 | 2,621 | 1.609,91 | 2,48% | 18.366.002/0001-64 |
| BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FI | Ibovespa | 43,21% | R$ 136.733 | - 19,170 | 2.159,12 | 3,32% | 10.418.335/0001-88 |
| CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI DE AÇÕES | Ibovespa | 40,49% | R$ 253.703 | - 13,069 | 4.275,95 | 6,58% | 14.550.994/0001-24 |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI | IPCA | 1,59% | R$ 1.936 | - 1,690 | 832,99 | 1,28% | 35.292.588/0001-89 |
| **PL TOTAL** | | | | | **R$ 65.009,50** | | |

[1] Retorno e Risco nos últimos 12 meses

[2] Com base na posição do PREVIBARRAS em 31/07/2020. Sujeito a ausência de posições em novos fundos nos quais tenham sido efetuadas aplicações / resgates ao longo do mês.

[3] Não considera fundos de investimentos que não estejam no âmbito da ICVM nº 555, como FIDC, FII, FIP

[4] Em milhares de reais (R$ mil)

| | |
|---|---|
| Grau de Confiança | **99%** |
| Indexador | **CDI** |