



PREVIBARRAS
Regime Próprio de Previdência do Município de Quatro Barras - PR

Data de Referência:
30/09/2020

RISCO DE MERCADO DA CARTEIRA

	Carteira	Indexador
Retorno ¹ (%)	0,07%	3,54%
Vol (%)	10,04%	0,07%
Beta	2,66	1,00

	Global	Fundos
VaR da Carteira	R\$ 943.117,78	R\$ 1.093.499,71
VaR (% sobre PL)	1,4712%	1,7058%

Fundos de Investimentos ³	Index.	Risco			Posição da Carteira		CNPJ Fundo
		Vol 12m	VaR	Beta	PL	Peso	

Nome do Fundo

Nome do Fundo	Index.	Vol 12m	VaR	Beta	PL	Peso	CNPJ Fundo
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RENDA FIXA LP	IMA-B	12,70%	R\$ 79.416 -	1,942	4.266,44	6,66%	10.740.658/0001-93
FIC-FI EM RENDA FIXA LP IMAB 1000	IMA-B	55,05%	R\$ 78.888 -	99,628	977,90	1,53%	12.402.646/0001-84
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FI	IMA-B	12,64%	R\$ 90.310 -	1,877	4.874,50	7,60%	07.861.554/0001-22
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI	IRF-M	5,97%	R\$ 27.316 -	1,865	3.122,99	4,87%	07.111.384/0001-69
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP FIC	IRF-M 1	0,54%	R\$ 8.136 -	1,313	10.239,22	15,97%	11.328.882/0001-35
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP IPCA IV FI	IPCA	4,37%	R\$ 5.208 -	1,124	812,98	1,27%	19.515.015/0001-10
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDEN	CDI	6,19%	R\$ 84.508 -	0,536	9.320,79	14,54%	25.078.994/0001-90
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B5+ TP FI	IMA-B 5+	19,52%	R\$ 264.294 -	2,360	9.239,37	14,41%	13.327.340/0001-73
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TP FI	IDKa 2	4,14%	R\$ 41.701 -	1,207	6.879,90	10,73%	13.322.205/0001-35
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC-FI	CDI	0,08%	R\$ 334 -	1,070	2.816,18	4,39%	13.077.415/0001-05
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP XI FI	CDI	4,91%	R\$ 4.291 -	1,376	596,07	0,93%	24.117.278/0001-01
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	CDI	0,17%	R\$ 608 -	0,857	2.410,00	3,76%	13.077.418/0001-49
AUSTRO MULTIPAR FI EM COTA DE FI MULTIMEI	IPCA	13,51%	R\$ 31.776 -	0,600	1.604,91	2,50%	18.366.002/0001-64
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FI	Ibovespa	43,57%	R\$ 183.363 -	16,855	2.088,62	3,26%	10.418.335/0001-88
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI DE AÇÕES	Ibovespa	40,78%	R\$ 240.800 -	9,447	4.029,20	6,29%	14.550.994/0001-24
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	IPCA	2,11%	R\$ 2.552 -	0,270	824,26	1,29%	35.292.588/0001-89
PL TOTAL					R\$ 64.103,34		

¹ Retorno e Risco nos últimos 12 meses

² Com base na posição do PREVIBARRAS em 31/08/2020. 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