

# INSTITUTO DE PREVIDENCIA DO MUNICIPIO DE BARRETOS

Relatório Competência

01/2020



## VISÃO GERAL

FUNDO	DISP. DE RESGATE	SALDO R\$	PARTICIPAÇÃO	QTDE. COTISTAS	% SOBRE PL DO FUNDO	PL DO FUNDO R\$	RESOLUÇÃO	GRAU DE RISCO	TAXA ADM.	TIPO
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	D + 0	1.865.534,86	5,31 %	737	0,12 %	1.500.776.659,75	Art 7º , IV "a"	Baixo	1,00 %	Fundo de Investimento
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 0	3.993,24	0,01 %	888	0,00 %	6.900.045.813,02	Art 7º , I, "b"	Baixo	0,20 %	Fundo de Investimento
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D + 0	161.769,14	0,46 %	1213	0,00 %	7.374.284.212,96	Art 7º , I, "b"	Baixo	0,10 %	Fundo de Investimento
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	D + 0	4.319.141,26	12,29 %	651	0,15 %	2.903.514.199,57	Art 7º , IV "a"	Baixo	0,20 %	Fundo de Investimento
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 0	4.943.730,51	14,06 %	51	1,44 %	342.438.909,73	Art 7º , I, "b"	Médio	0,15 %	Fundo de Investimento
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 V TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	0,00	0,00 %		0,00 %	0,00	Art 7º , I, "b"	Médio	0,20 %	Fundo de Investimento
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA	D + 0	2.008.971,40	5,71 %	324	0,41 %	487.819.881,57	Art 7º , IV "a"	Baixo	0,80 %	Fundo de Investimento
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	14.919,24	0,04 %	1361	0,00 %	10.529.932.746,92	Art 7º , I, "b"	Baixo	0,20 %	Fundo de Investimento
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	D + 0	11.451,39	0,03 %	684	0,00 %	5.345.385.558,02	Art 7º , IV "a"	Baixo	0,20 %	Fundo de Investimento
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 730	300.990,64	0,86 %	0	0,40 %	75.188.225,18	Art 7º , IV "a"	Médio	1,25 %	Fundo de Investimento
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	D + 4	0,00	0,00 %		0,00 %	0,00	Art 8º , II, "a"	Alto	3,00 %	Fundo de Investimento
SAFRA EXECUTIVE 2 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	D + 1	0,00	0,00 %	16	0,00 %	315.989.419,77	Art 7º , IV "a"	Médio	0,20 %	Fundo de Investimento
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	D + 1260	557.858,79	1,59 %	71	0,73 %	76.198.443,05	Art 7º , VII, "a"	Alto	1,50 %	Fundo de Investimento
NTN-B20450515	D + 360	9.503.019,28	27,03 %	1	0,00 %	0,00	Art 7º , I, "a"	Alto	0,20 %	Fundo de Investimento
NTN-C 20310101	D + 192	11.465.306,24	32,61 %	1	0,00 %	0,00	Art 7º , I, "a"	Alto	0,20 %	Fundo de Investimento

**TOTAL SALDO: R\$ 35.156.685,99**

Relatório competência: 01/2020



## ENQUADRAMENTO

RENDA FIXA - ARTIGOS	LIMITE DA RESOLUÇÃO	LIMITE PL FUNDO	LIMITE POR PARTICIPAÇÃO	LIMITE POLÍTICA	TOTAL	% CARTEIRA
TÍTULOS PÚBLICOS DE EMISSÃO DO TN (SELIC) - Art 7º, I, "a"	100% ENQUADRADO	100% ENQUADRADO	20% DESENQUADRADO	100%	20.968.325,52	59,64 %
FI 100 TÍTULOS TN - Art 7º, I, "b"	100% ENQUADRADO	15% ENQUADRADO	20% ENQUADRADO	100%	5.124.412,13	14,58 %
FI RENDA FIXA GERAL - Art 7º, IV "a"	40% ENQUADRADO	15% ENQUADRADO	20% ENQUADRADO	40%	8.506.089,55	24,19 %
FI EM DIREITOS CREDITÓRIOS / COTA SENIOR - Art 7º, VII, "a"	5% ENQUADRADO	5% ENQUADRADO	20% ENQUADRADO	5%	557.858,79	1,59 %
<b>Valor total Renda Fixa: R\$ 35.156.685,99</b>						

RENDA VARIÁVEL - ARTIGOS	LIMITE DA RESOLUÇÃO	LIMITE PL FUNDO	LIMITE POR PARTICIPAÇÃO	LIMITE POLÍTICA	TOTAL	% CARTEIRA
FI DE AÇÕES GERAL - Art 8º, II, "a"	20% ENQUADRADO	15% ENQUADRADO	20% ENQUADRADO	20%	0,00	0,00
<b>Valor total Renda Variável: R\$ 0,00</b>						

EXTERIOR - ARTIGOS	LIMITE DA RESOLUÇÃO	LIMITE PL FUNDO	LIMITE POR PARTICIPAÇÃO	LIMITE POLÍTICA	TOTAL	% CARTEIRA
<b>Valor total Exterior: R\$ 0,00</b>						

DISTRIBUIÇÃO POR PARÂMETRO DE RENTABILIDADE	TOTAL	% CARTEIRA
AÇÕES	0,00	0,00
CDI	8.205.098,91	23,34
FIDC	557.858,79	1,59
IDKA 2	3.993,24	0,01
IMA-B	300.990,64	0,86
IPCA	4.943.730,51	14,06
IRF-M1	176.688,38	0,50
NTN-B	9.503.019,28	27,03
NTN-C	11.465.306,24	32,61
	<b>R\$ 35.156.685,99</b>	

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	TOTAL	% CARTEIRA
CNPJ:	20.968.325,52	59,64
SAFRA SERVIÇOS DE ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA LTDA   CNPJ: 06947853000111	0,00	0,00
INTRADER DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA   CNPJ: 15489568000195	300.990,64	0,86
GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A   CNPJ: 27652684000162	0,00	0,00
BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A   CNPJ: 30822936000169	11.294.169,01	32,13
CAIXA ECONOMICA FEDERAL   CNPJ: 360305000104	2.035.342,03	5,79
ORLA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S/A   CNPJ: 92904564000177	557.858,79	1,59
	<b>R\$ 35.156.685,99</b>	



## RETORNOS

FUNDO	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO R\$	RETORNO %	EFETIVO %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 1.886.215,61	R\$ 10.126,27	R\$ 36.155,56	R\$ 1.865.534,86	R\$ 5.348,54	0,28561 %	0,28561 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 3.977,93	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 3.993,24	R\$ 15,31	0,38499 %	0,38499 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 10.087,45	R\$ 151.222,73	R\$ 0,00	R\$ 161.769,14	R\$ 458,96	0,41936 %	0,41936 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	R\$ 4.983.212,02	R\$ 611.105,28	R\$ 1.290.291,37	R\$ 4.319.141,26	R\$ 15.115,33	0,34980 %	0,34980 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 4.910.988,22	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 4.943.730,51	R\$ 32.742,29	0,66671 %	0,66671 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 V TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	-	-
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA	R\$ 1.432.132,82	R\$ 850.019,34	R\$ 278.836,79	R\$ 2.008.971,40	R\$ 5.656,03	0,30246 %	0,30246 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	R\$ 14.856,46	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 14.919,24	R\$ 62,78	0,42257 %	0,42257 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	R\$ 11.409,09	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 11.451,39	R\$ 42,30	0,37081 %	0,37081 %
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 302.009,49	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 300.990,64	R\$ -1.018,85	-0,33736 %	-0,33736 %
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	-	-
SAFRA EXECUTIVE 2 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	0,41686 %	0,41686 %
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS	R\$ 558.458,46	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 557.858,79	R\$ -599,67	-0,10738 %	-0,10738 %
NTN-B20450515	R\$ 9.517.726,08	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 9.503.019,28	R\$ -14.706,80	-0,15452 %	-0,15452 %
NTN-C 20310101	R\$ 11.441.217,57	R\$ 0,00	R\$ 359.120,66	R\$ 11.465.306,24	R\$ 383.209,33	3,34938 %	3,34938 %
TOTAIS	R\$ 35.072.291,20	R\$ 1.622.473,62	R\$ 1.964.404,38	R\$ 35.156.685,99	R\$ 426.325,55	1,2174 %	1,2174 %



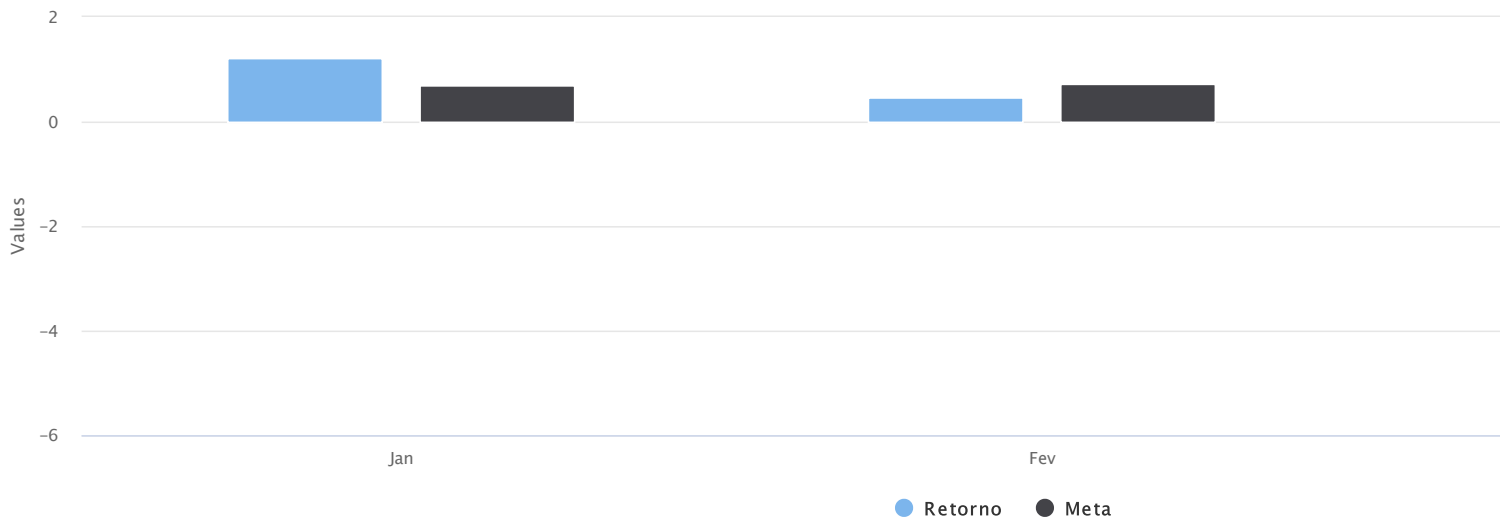
## RETORNOS ACUMULADO

MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO R\$	RETORNO %	META %	ATINGIMENTO %
JANEIRO	R\$ 35.072.291,20	R\$ 1.622.473,62	R\$ 1.964.404,38	R\$ 35.156.685,99	R\$ 426.325,55	1,2174 %	0,69 %	176,67 %
TOTAIS		R\$ 1.622.473,62	R\$ 1.964.404,38		R\$ 426.325,55	1,22	0,69	176,67

Relatório competência: 01/2020



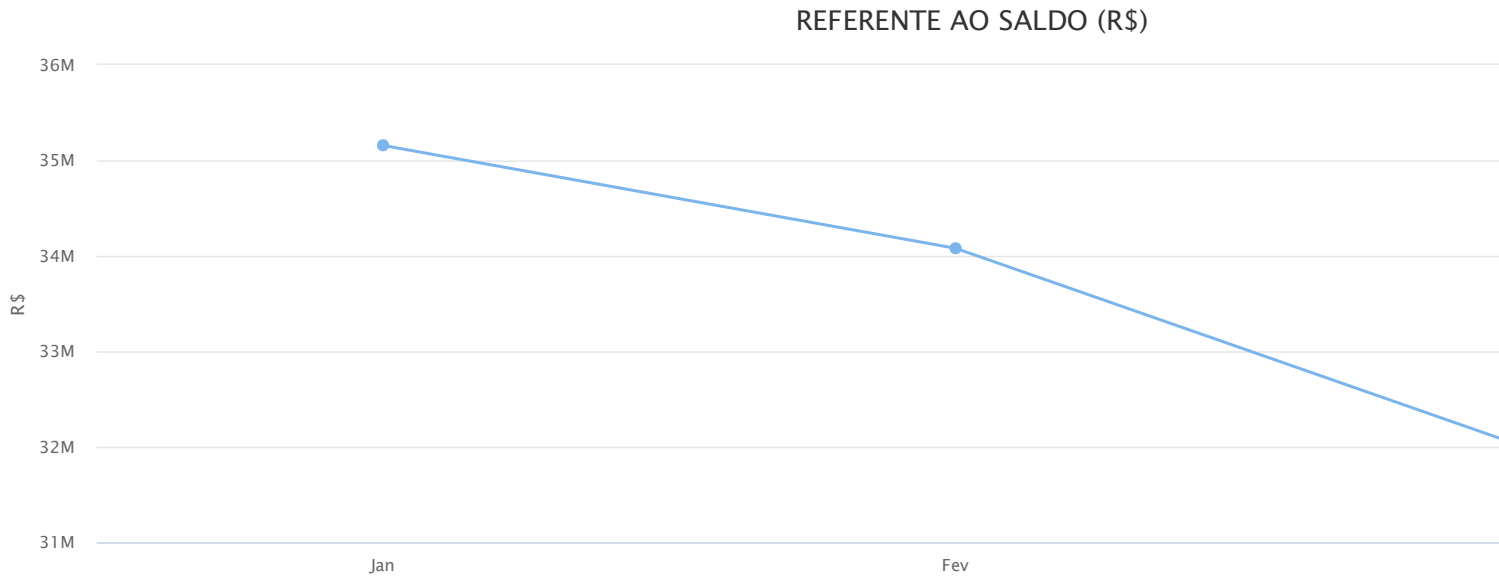
Gráfico – Retorno acumulado no ano





## EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO X RENTABILIDADE MONETÁRIA

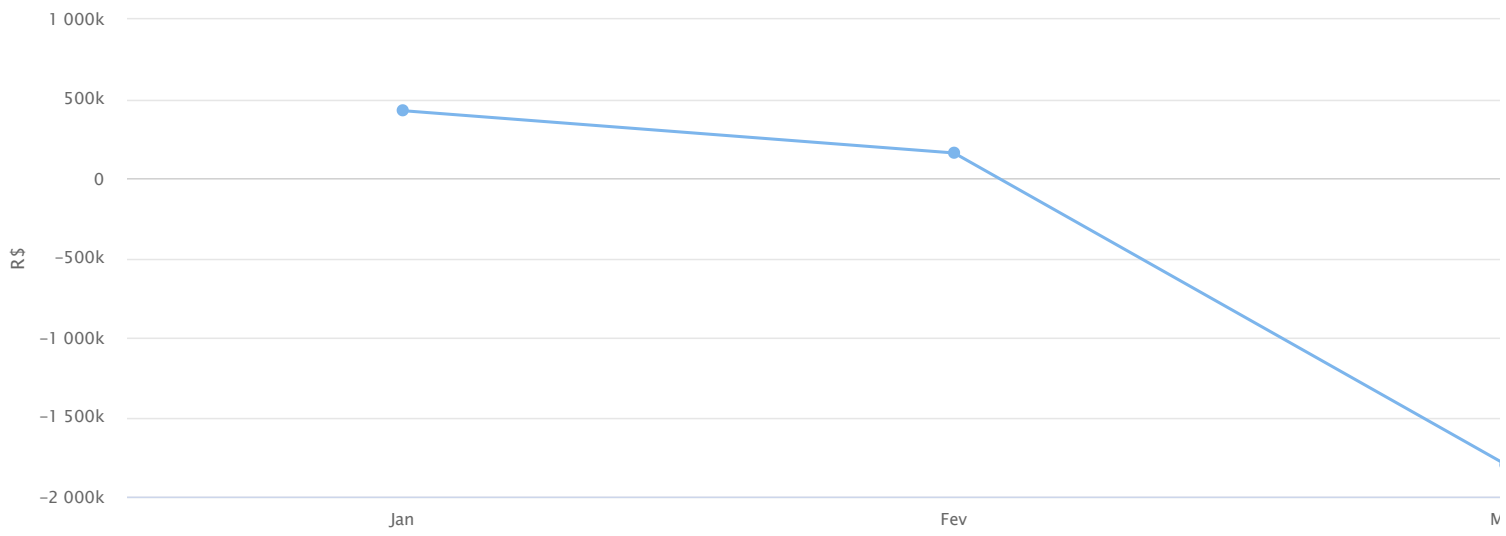
MESES	JANEIRO	FEVEREIRO	MARÇO	ABRIL	MAIO	JUNHO	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO
SALDO (R\$)	35.156.685,99	34.079.288,51	31.984.630,58	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
RETORNO (R\$)	426.325,55	160.293,30	-1.796.653,28	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00



Relatório competência: 01/2020



### REFERENTE AO RETORNO (R\$)



Relatório competência: 01/2020





## MEDIDA DE RISCO

**GESTÃO DE RISCO - MERCADO:** O valor dos ativos que compõem a carteira do fundo pode aumentar ou diminuir de acordo com flutuações de preços e cotações de mercado, mudanças no cenário político e econômico, alterações nas taxas de juros e, ainda, com os resultados das empresas emissoras de valores mobiliários (ações, debêntures, notas promissórias, entre outros).

**Índice Sharpe:** O índice de Sharpe é uma medida que permite a classificação do fundo em termos de desempenho global, sendo considerados melhores os fundos com maior índice. Vale lembrar ainda que o índice varia se o resultado for calculado com base em rentabilidades semanais, mensais ou anuais.

**VaR - Value at Risk:** *Value-at-risk* ou Valor sob Risco pode ser definido como perda máxima, num determinado período, sob condições normais de mercado, com determinado grau de confiança.

FUNDO	BENCHMARK	VAR 12 MESES	SHARPE	VOLATILIDADE 3 MESES	VOLATILIDADE 6 MESES	VOLATILIDADE 12 MESES
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	CDI	0,62 %	-3,77 %	0,12 %	0,20 %	0,29%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	IDKA 2	6,33 %	0,77 %	4,36 %	3,66 %	2,91%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	IRF-M1	0,94 %	2,12 %	0,44 %	0,43 %	0,43%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	CDI	1,20 %	-1,08 %	0,70 %	0,57 %	0,55%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	IPCA	9,59 %	1,25 %	5,22 %	4,99 %	4,41%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 V TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IMA-B	0,00 %	0,00 %	0,00 %	0,00 %	0,00%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA	CDI	0,64 %	-2,89 %	0,12 %	0,20 %	0,29%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IRF-M1	0,93 %	2,27 %	0,40 %	0,42 %	0,43%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	CDI	0,91 %	-1,02 %	0,40 %	0,36 %	0,42%
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	87,59 %	-0,61 %	88,18 %	58,41 %	40,25%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	AÇÕES	6,25 %	-0,10 %	15,60 %	13,17 %	17,09%
SAFRA EXECUTIVE 2 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	IRF-M1	1,11 %	1,40 %	0,11 %	0,41 %	0,51%
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	FIDC	3,25 %	-0,72 %	9,77 %	25,48 %	32,51%
NTN-B20450515	NTN-B	0,00 %	0,00 %	0,00 %	0,00 %	0,00%
NTN-C 20310101	NTN-C	0,00 %	0,00 %	0,00 %	0,00 %	0,00%

Relatório competência: 01/2020



## PROVISÃO DE RISCO - INDICATIVO

FUNDO	CNPJ	BENCHMARK	SALDO (R\$)	VAR 12 MESES	VOLATILIDADE 12 MESES	VAR% BASE 1 DIA CONFIANÇA 95% 252 DU* (R\$)
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	13.077.415/0001-05	CDI	1.865.534,86	0,02 %	0,04 %	373,11
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	13.322.205/0001-35	IDKA 2	3.993,24	0,74 %	1,49 %	29,55
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	11.328.882/0001-35	IRF-M1	161.769,14	0,13 %	0,26 %	210,30
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	13.077.418/0001-49	CDI	4.319.141,26	0,02 %	0,05 %	863,83
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	15.486.093/0001-83	IPCA	4.943.730,51	1,19 %	2,80 %	58.830,39
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 V TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	21.922.168/0001-24	IMA-B	0,00	0,00 %	0,00 %	0,00
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA	14.508.643/0001-55	CDI	2.008.971,40	0,25 %	0,11 %	5.022,43
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	IRF-M1	14.919,24	0,13 %	0,25 %	19,40
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	CDI	11.451,39	0,98 %	0,45 %	112,22
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	11.902.276/0001-81	IMA-B	300.990,64	87,59 %	40,25 %	263.637,70
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	11.898.349/0001-09	AÇÕES	0,00	6,25 %	17,09 %	0,00
SAFRA EXECUTIVE 2 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	10.787.647/0001-69	IRF-M1	0,00	1,74 %	0,80 %	0,00
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	12.440.789/0001-80	FIDC	557.858,79	3,25 %	32,51 %	18.130,41
NTN-B20450515	66.998.014/0001-54	NTN-B	9.503.019,28	0,00 %	0,00 %	0,00
NTN-C 20310101	66.998.014/0001-54	NTN-C	11.465.306,24	0,00 %	0,00 %	0,00

RISCO DE MERCADO	
<b>Saldo Total:</b>	R\$ 35.156.685,99
<b>Provisão para perda e Investimentos:</b>	R\$ 347.229,34
<b>% Provisão de Perda:</b>	0,988%

Relatório competência: 01/2020



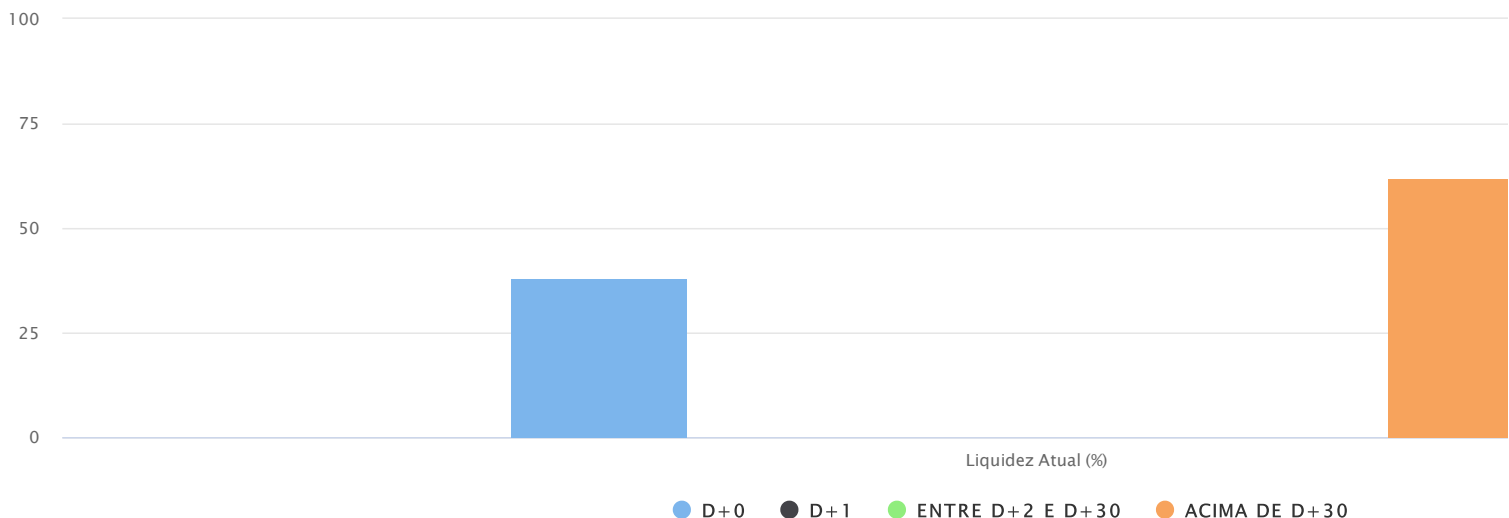
## RISCO DE LIQUIDEZ

FUNDO	DISP. DE RESGATE	SALDO R\$	PARTICIPAÇÃO	QTDE. COTISTAS	% SOBRE PL DO FUNDO	PL DO FUNDO R\$	RESOLUÇÃO	GRAU DE RISCO
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	D + 0	1.865.534,86	5,31 %	737	0,12 %	1.500.776.659,75	Art 7º , IV "a"	Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 0	3.993,24	0,01 %	888	0,00 %	6.900.045.813,02	Art 7º , I, "b"	Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D + 0	161.769,14	0,46 %	1213	0,00 %	7.374.284.212,96	Art 7º , I, "b"	Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	D + 0	4.319.141,26	12,29 %	651	0,15 %	2.903.514.199,57	Art 7º , IV "a"	Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 0	4.943.730,51	14,06 %	51	1,44 %	342.438.909,73	Art 7º , I, "b"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA	D + 0	2.008.971,40	5,71 %	324	0,41 %	487.819.881,57	Art 7º , IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	14.919,24	0,04 %	1361	0,00 %	10.529.932.746,92	Art 7º , I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	D + 0	11.451,39	0,03 %	684	0,00 %	5.345.385.558,02	Art 7º , IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 730	300.990,64	0,86 %	0	0,40 %	75.188.225,18	Art 7º , IV "a"	Médio
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	D + 1260	557.858,79	1,59 %	71	0,73 %	76.198.443,05	Art 7º , VII, "a"	Alto
NTN-B20450515	D + 360	9.503.019,28	27,03 %	1	0,00 %	0,00	Art 7º , I, "a"	Alto
NTN-C 20310101	D + 192	11.465.306,24	32,61 %	1	0,00 %	0,00	Art 7º , I, "a"	Alto

**TOTAL SALDO: R\$ 35.156.685,99**

PRAZO DE RESGATE	QUANTIDADE DE FUNDOS	LIQUIDEZ ATUAL
D+0	9	38%
D+1	1	0%
ENTRE D+2 E D+30	1	0%
ACIMA DE D+30	4	62%

### Gráfico





## RISCO DE CRÉDITO

RENDA FIXA - ARTIGOS	LIMITE DA RESOLUÇÃO	LIMITE POLÍTICA	TOTAL	% CARTEIRA
Art 7º, I, "a"	100 %	100 %	20.968.325,52	59,64
Art 7º, I, "b"	100 %	100 %	5.124.412,13	14,58
Art 7º, IV "a"	40 %	40 %	8.506.089,55	24,19
Art 7º, VII, "a"	5 %	5 %	557.858,79	1,59
			35.156.685,99	

RISCO DE CRÉDITO	% CARTEIRA
100% Títulos Públicos e 0% Títulos Privados	86,32%
50% Títulos Públicos e 50% Títulos Privados	12,10%
0% Títulos Públicos e 100% Títulos Privados	1,59%

Relatório competência: 01/2020



## CAPITAL PROTEGIDO

TIPO DE PRODUTO E PERCENTUAL DO CAPITAL INVESTIDO PROTEGIDO	
TIPO DE PRODUTO	PERCENTUAL DO CAPITAL INVESTIDO PROTEGIDO
INVESTIDO PROTEGIDO	INVESTIDO PROTEGIDO (Até)
Títulos Públicos Federais/ Carteira Própria	100%
Fundos de Investimento Referenciado e Renda Fixa 100% Títulos Públicos Federais (previsto no regulamento do fundo)	100%
Fundos de Investimento Referenciado e Renda Fixa (50% de títulos públicos federais)	50%
Fundos de Investimentos Crédito Privado	0%
FIDC	0%
Fundos de Ações	0%
Fundos de Índices - ETF	0%
Fundos Multimercados	0%
Fundos Imobiliários	0%
Fundos de Participação	0%

PERCENTUAL MÍNIMO DE ALOCAÇÃO DA CARTEIRA TOTAL DO RPPS EM PRODUTOS COM CAPITAL INVESTIDO PROTEGIDO: 80% do Patrimônio Líquido do RPPS, apurado concomitantemente na data de fechamento dos dados para envio do DAIR ao Ministério da Previdência Social - MPS.

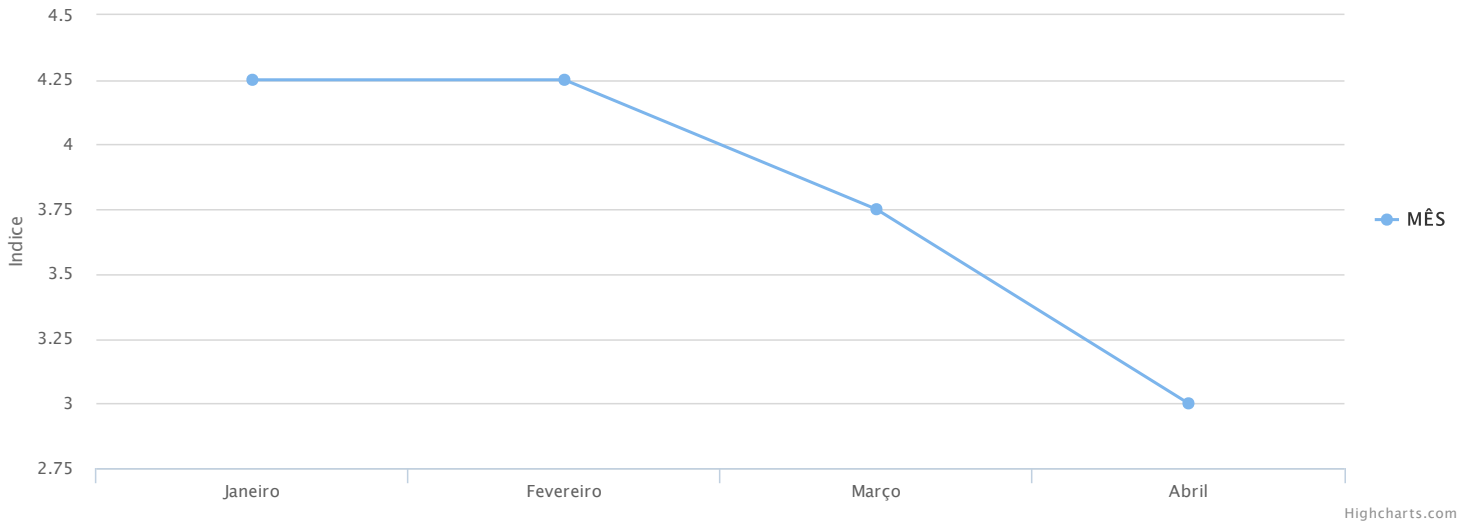
Relatório competência: 01/2020







SELIC  
2020



Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Maió	Junho	Julho	Agosto	Setembro	Outubro	Novembro	Dezembro
4.25	4.25	3.75	3.00								





## CADPREV

<b>Renda Fixa</b>		Tipo de Fundo: CDI
Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	CNPJ: 13.077.415/0001-05	Saldo em 01/2020: R\$ 1.865.534,86
Administrador: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	CNPJ: 30.822.936/0001-69	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: FI RENDA FIXA GERAL Art 7º, IV "a"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/10/2015
Valor da Cota: R\$ 2,086017000	Quantidade de Cotas: 894.304,7252	PL do Fundo: R\$ 1.500.776.659,75
% do PL do Fundo: 0,12%	Limite Cumulativo: 5,31%	Limite do Fundo: 40%
<b>Renda Fixa</b>		Tipo de Fundo: IDKA 2
Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	CNPJ: 13.322.205/0001-35	Saldo em 01/2020: R\$ 3.993,24
Administrador: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	CNPJ: 30.822.936/0001-69	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: FI 100 TÍTULOS TN Art 7º, I, "b"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/10/2015
Valor da Cota: R\$ 2,689514747	Quantidade de Cotas: 1.484,7437	PL do Fundo: R\$ 6.900.045.813,02
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,01%	Limite do Fundo: 100%
<b>Renda Fixa</b>		Tipo de Fundo: IRF-M1
Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	CNPJ: 11.328.882/0001-35	Saldo em 01/2020: R\$ 161.769,14
Administrador: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	CNPJ: 30.822.936/0001-69	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: FI 100 TÍTULOS TN Art 7º, I, "b"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/10/2015
Valor da Cota: R\$ 2,644833000	Quantidade de Cotas: 61.164,2172	PL do Fundo: R\$ 7.374.284.212,96
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,46%	Limite do Fundo: 100%
<b>Renda Fixa</b>		Tipo de Fundo: CDI
Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	CNPJ: 13.077.418/0001-49	Saldo em 01/2020: R\$ 4.319.141,26
Administrador: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	CNPJ: 30.822.936/0001-69	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: FI RENDA FIXA GERAL Art 7º, IV "a"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/10/2015
Valor da Cota: R\$ 2,255695000	Quantidade de Cotas: 1.914.771,8375	PL do Fundo: R\$ 2.903.514.199,57
% do PL do Fundo: 0,15%	Limite Cumulativo: 12,29%	Limite do Fundo: 40%
<b>Renda Fixa</b>		Tipo de Fundo: IPCA
Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	CNPJ: 15.486.093/0001-83	Saldo em 01/2020: R\$ 4.943.730,51
Administrador: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	CNPJ: 30.822.936/0001-69	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: FI 100 TÍTULOS TN Art 7º, I, "b"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/10/2015
Valor da Cota: R\$ 2,290858175	Quantidade de Cotas: 2.158.025,5661	PL do Fundo: R\$ 342.438.909,73
% do PL do Fundo: 1,44%	Limite Cumulativo: 14,06%	Limite do Fundo: 100%
<b>Renda Fixa</b>		Tipo de Fundo: IMA-B
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 V TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	CNPJ: 21.922.168/0001-24	Saldo em 01/2020: R\$ 0,00
Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: FI 100 TÍTULOS TN Art 7º, I, "b"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/10/2015
Valor da Cota: R\$ 0,000000000	Quantidade de Cotas: 0,0000	PL do Fundo: R\$ 0,00
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,00%	Limite do Fundo: 100%
<b>Renda Fixa</b>		Tipo de Fundo: CDI
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA	CNPJ: 14.508.643/0001-55	Saldo em 01/2020: R\$ 2.008.971,40
Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: FI RENDA FIXA GERAL Art 7º, IV "a"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/10/2015
Valor da Cota: R\$ 1,852086000	Quantidade de Cotas: 1.084.707,4056	PL do Fundo: R\$ 487.819.881,57
% do PL do Fundo: 0,41%	Limite Cumulativo: 5,71%	Limite do Fundo: 40%
<b>Renda Fixa</b>		Tipo de Fundo: IRF-M1
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	CNPJ: 10.740.670/0001-06	Saldo em 01/2020: R\$ 14.919,24
Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: FI 100 TÍTULOS TN Art 7º, I, "b"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/10/2015
Valor da Cota: R\$ 2,532115000	Quantidade de Cotas: 5.892,0073	PL do Fundo: R\$ 10.529.932.746,92
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,04%	Limite do Fundo: 100%
<b>Renda Fixa</b>		Tipo de Fundo: CDI

Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	CNPJ: 37.372.060/0019-7	Saldo em 01/2020: R\$ 11.451,39
Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: FI RENDA FIXA GERAL Art 7º , IV "a"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/10/2015
Valor da Cota: R\$ 3,664761000	Quantidade de Cotas: 3.124,7304	PL do Fundo: R\$ 5.345.385.558,02
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,03%	Limite do Fundo: 40%

<b>Renda Fixa</b>		Tipo de Fundo: IMA-B
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	CNPJ: 11.902.276/0001-81	Saldo em 01/2020: R\$ 300.990,64
Administrador: INTRADER DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA	CNPJ: 15.489.568/0001-95	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: FI RENDA FIXA GERAL Art 7º , IV "a"	Disponibilidade: D + 730	Adesão: 01/10/2015
Valor da Cota: R\$ 0,567508000	Quantidade de Cotas: 530.372,5058	PL do Fundo: R\$ 75.188.225,18
% do PL do Fundo: 0,40%	Limite Cumulativo: 0,86%	Limite do Fundo: 40%

<b>Renda Variável</b>		Tipo de Fundo: AÇÕES
Fundo: GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	CNPJ: 11.898.349/0001-09	Saldo em 01/2020: R\$ 0,00
Administrador: GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A	CNPJ: 27.652.684/0001-62	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: FI DE AÇÕES GERAL Art 8º , II, "a"	Disponibilidade: D + 4	Adesão: 01/10/2015
Valor da Cota: R\$ 0,000000000	Quantidade de Cotas: 0,0000	PL do Fundo: R\$ 0,00
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,00%	Limite do Fundo: 20%

<b>Renda Fixa</b>		Tipo de Fundo: IRF-M1
Fundo: SAFRA EXECUTIVE 2 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	CNPJ: 10.787.647/0001-69	Saldo em 01/2020: R\$ 0,00
Administrador: SAFRA SERVIÇOS DE ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA LTDA	CNPJ: 06.947.853/0001-11	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: FI RENDA FIXA GERAL Art 7º , IV "a"	Disponibilidade: D + 1	Adesão: 01/10/2015
Valor da Cota: R\$ 277,292904000	Quantidade de Cotas: 0,0000	PL do Fundo: R\$ 315.989.419,77
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,00%	Limite do Fundo: 40%

<b>Renda Fixa</b>		Tipo de Fundo: FIDC
Fundo: LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	CNPJ: 12.440.789/0001-80	Saldo em 01/2020: R\$ 557.858,79
Administrador: ORLA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S/A	CNPJ: 92.904.564/0001-77	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: FI EM DIREITOS CREDITÓRIOS / COTA SENIOR Art 7º , VII, "a"	Disponibilidade: D + 1260	Adesão: 01/10/2015
Valor da Cota: R\$ 0,390329700	Quantidade de Cotas: 1.429.198,9311	PL do Fundo: R\$ 76.198.443,05
% do PL do Fundo: 0,73%	Limite Cumulativo: 1,59%	Limite do Fundo: 5%

<b>Renda Fixa</b>		Tipo de Fundo: NTN-B
Fundo: NTN-B20450515	CNPJ: 66.998.014/0001-54	Saldo em 01/2020: R\$ 9.503.019,28
Administrador:	CNPJ: 00..-/-	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: TÍTULOS PÚBLICOS DE EMISSÃO DO TN (SELIC) Art 7º , I, "a"	Disponibilidade: D + 360	Adesão: 01/10/2015
Valor da Cota: R\$ 4.658,342786000	Quantidade de Cotas: 2.040,0000	PL do Fundo: R\$ 0,00
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 27,03%	Limite do Fundo: 100%

<b>Renda Fixa</b>		Tipo de Fundo: NTN-C
Fundo: NTN-C 20310101	CNPJ: 66.998.014/0001-54	Saldo em 01/2020: R\$ 11.465.306,24
Administrador:	CNPJ: 00..-/-	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: TÍTULOS PÚBLICOS DE EMISSÃO DO TN (SELIC) Art 7º , I, "a"	Disponibilidade: D + 192	Adesão: 01/10/2015
Valor da Cota: R\$ 4.658,342786000	Quantidade de Cotas: 2.461,2414	PL do Fundo: R\$ 0,00
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 32,61%	Limite do Fundo: 100%

**TOTAL: R\$ 35.156.685,99**

Relatório competência: 01/2020



## CARTEIRA SUGERIDA ESTRATEGIA PRÓXIMO MÊS - PERFIL CONSERVADOR

INDICE	CARTEIRA ATUAL		MOVIMENTAÇÕES	CARTEIRA SUGERIDA	
	SALDO ATUAL	% CAPITAL	APLICAR / RESGATAR	SALDO FINAL	% CAPITAL
FIDC	557.858,79	3,93	-256,22	557.602,57	3,93
CRED PRIVADO	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
MULTIMERCADO	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
GERAL	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IPCA	4.943.730,51	34,84	-505,72	4.943.224,79	34,84
IMA-B	300.990,64	2,12	483.625,69	784.616,33	5,53
IMA-B 5	0,00	0,00	709.418,02	709.418,02	5,00
IMA-B 5+	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IDKA 2	3.993,24	0,03	1.414.842,81	1.418.836,05	10,00
IDKA 20	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IRF-M	0,00	0,00	1.780.639,24	1.780.639,24	12,55
IRF-M1	176.688,38	1,25	1.242.147,67	1.418.836,05	10,00
IRF-M1+	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
AÇÕES	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
POUPANÇA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FIP	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
SELIC/CDI	8.205.098,91	57,83	-7.446.021,62	759.077,29	5,35
ALOCAÇÃO ATIVA	0,00	0,00	1.816.110,14	1.816.110,14	12,80
TOTAL:	14.188.360,47	100,00		14.188.360,47	100,00

MOVIMENTAÇÕES ACIMA SÃO SUGESTÕES PARA O SEGMENTO DE RENDA FIXA, EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS COMPOSTOS EXCLUSIVAMENTE POR TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS, PARA ALOCAÇÃO EM INSTITUIÇÕES RECONHECIDAMENTE DE PRIMEIRA LINHA, EM PRODUTOS QUE JÁ INTEGRAM A CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RPPS.

Relatório competência: 01/2020



## ESTRATEGIA PRÓXIMO MÊS - PERFIL MODERADO

CARTEIRA ATUAL			MOVIMENTAÇÕES	CARTEIRA SUGERIDA	
ÍNDICE	SALDO ATUAL	% CAPITAL	APLICAR / RESGATAR	SALDO FINAL	% CAPITAL
FIDC	557.858,79	3,93	-256,22	557.602,57	3,93
CRED PRIVADO	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
MULTIMERCADO	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
GERAL	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IPCA	4.943.730,51	34,84	-505,72	4.943.224,79	34,84
IMA-B	300.990,64	2,12	408.427,38	709.418,02	5,00
IMA-B 5	0,00	0,00	709.418,02	709.418,02	5,00
IMA-B 5+	0,00	0,00	784.616,33	784.616,33	5,53
IDKA 2	3.993,24	0,03	705.424,78	709.418,02	5,00
IDKA 20	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IRF-M	0,00	0,00	1.780.639,24	1.780.639,24	12,55
IRF-M1	176.688,38	1,25	1.242.147,67	1.418.836,05	10,00
IRF-M1+	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
AÇÕES	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
POUPANÇA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FIP	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
SELIC/CDI	8.205.098,91	57,83	-7.446.021,62	759.077,29	5,35
ALOCÇÃO ATIVA	0,00	0,00	1.816.110,14	1.816.110,14	12,80
TOTAL:	14.188.360,47	100,00		14.188.360,47	100,00

MOVIMENTAÇÕES ACIMA SÃO SUGESTÕES PARA O SEGMENTO DE RENDA FIXA, EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS COMPOSTOS EXCLUSIVAMENTE POR TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS, PARA ALOCAÇÃO EM INSTITUIÇÕES RECONHECIDAMENTE DE PRIMEIRA LINHA, EM PRODUTOS QUE JÁ INTEGRAM A CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RPPS.

DI BLASI CONSULTORIA FINANCEIRA LTDA  
CNPJ 03.866.812/0001-02  
CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS HABILITADA PELA COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS - CVM

Relatório competência: 01/2020