

INSTITUTO DE PREVIDENCIA DO MUNICIPIO DE BARRETOS

Relatório Competência

02/2020



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	1.791.147,96	5,26 %	740	0,13 %	1.376.949.540,95	Art 7º , IV "a"	Baixo	1,00 %	Fundo de Investimento
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 0	4.018,32	0,01 %	888	0,00 %	6.830.764.502,36	Art 7º , I, "b"	Baixo	0,20 %	Fundo de Investimento
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D + 0	324.038,72	0,95 %	1214	0,00 %	7.492.585.716,79	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	2.488.686,62	7,30 %	644	0,09 %	2.774.667.818,45	Art 7º , IV "a"	Baixo	0,20 %	Fundo de Investimento
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 0	4.981.824,08	14,62 %	51	1,44 %	345.077.548,96	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	2.532.676,90	7,43 %	321	0,56 %	455.022.894,33	Art 7º , IV "a"	Baixo	0,80 %	Fundo de Investimento
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	14.973,43	0,04 %	1359	0,00 %	10.513.960.188,40	Art 7º , I, "b"	Baixo	0,20 %	Fundo de Investimento
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	D + 0	11.482,76	0,03 %	684	0,00 %	5.421.482.050,58	Art 7º , IV "a"	Baixo	0,20 %	Fundo de Investimento
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 730	302.090,10	0,89 %	0	0,40 %	75.462.854,83	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 %	317.289.718,61	Art 7º , IV "a"	Médio	0,20 %	Fundo de Investimento
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	D + 1260	554.030,52	1,63 %	71	0,73 %	75.675.537,05	Art 7º , VII, "a"	Alto	1,50 %	Fundo de Investimento
NTN-B20450515	D + 360	9.511.636,03	27,91 %	1	0,00 %	0,00	Art 7º , I, "a"	Alto	0,20 %	Fundo de Investimento
NTN-C 20310101	D + 192	11.562.683,07	33,93 %	1	0,00 %	0,00	Art 7º , I, "a"	Alto	0,20 %	Fundo de Investimento

TOTAL SALDO: R\$ 34.079.288,51

Relatório competência: 02/2020



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%	21.074.319,10	61,84 %
FI 100 TÍTULOS TN - Art 7º, I, "b"	100% ENQUADRADO	15% ENQUADRADO	20% ENQUADRADO	100%	5.324.854,55	15,62 %
FI RENDA FIXA GERAL - Art 7º, IV "a"	40% ENQUADRADO	15% ENQUADRADO	20% ENQUADRADO	40%	7.126.084,34	20,91 %
FI EM DIREITOS CREDITÓRIOS / COTA SENIOR - Art 7º, VII, "a"	5% ENQUADRADO	5% ENQUADRADO	20% ENQUADRADO	5%	554.030,52	1,63 %
Valor total Renda Fixa: R\$ 34.079.288,51						

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
Valor total Renda Variável: R\$ 0,00						

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

DISTRIBUIÇÃO POR PARÂMETRO DE RENTABILIDADE	TOTAL	% CARTEIRA
AÇÕES	0,00	0,00
CDI	6.823.994,24	20,02
FIDC	554.030,52	1,63
IDKA 2	4.018,32	0,01
IMA-B	302.090,10	0,89
IPCA	4.981.824,08	14,62
IRF-M1	339.012,15	0,99
NTN-B	9.511.636,03	27,91
NTN-C	11.562.683,07	33,93
	R\$ 34.079.288,51	

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	TOTAL	% CARTEIRA
CNPJ:	21.074.319,10	61,84
SAFRA SERVIÇOS DE ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA LTDA CNPJ: 06947853000111	0,00	0,00
INTRADER DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA CNPJ: 15489568000195	302.090,10	0,89
GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A CNPJ: 27652684000162	0,00	0,00
BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A CNPJ: 30822936000169	9.589.715,70	28,14
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CNPJ: 360305000104	2.559.133,09	7,51
ORLA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S/A CNPJ: 92904564000177	554.030,52	1,63
	R\$ 34.079.288,51	



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\$ 1.865.534,86	R\$ 22.520,37	R\$ 100.854,86	R\$ 1.791.147,96	R\$ 3.947,59	0,21644 %	0,21644 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 3.993,24	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 4.018,32	R\$ 25,08	0,62817 %	0,62817 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 161.769,14	R\$ 161.339,05	R\$ 0,00	R\$ 324.038,72	R\$ 930,53	0,35295 %	0,35295 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	R\$ 4.319.141,26	R\$ 12.410,63	R\$ 1.851.683,09	R\$ 2.488.686,62	R\$ 8.817,82	0,27313 %	0,27313 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 4.943.730,51	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 4.981.824,08	R\$ 38.093,57	0,77054 %	0,77054 %
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\$ 2.008.971,40	R\$ 761.221,99	R\$ 242.644,87	R\$ 2.532.676,90	R\$ 5.128,38	0,23060 %	0,23060 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	R\$ 14.919,24	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 14.973,43	R\$ 54,19	0,36325 %	0,36325 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	R\$ 11.451,39	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 11.482,76	R\$ 31,37	0,27388 %	0,27388 %
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 300.990,64	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 302.090,10	R\$ 1.099,46	0,36528 %	0,36528 %
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	0,35775 %	0,35775 %
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	R\$ 557.858,79	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 554.030,52	R\$ -3.828,27	-0,68624 %	-0,68624 %
NTN-B20450515	R\$ 9.503.019,28	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 9.511.636,03	R\$ 8.616,75	0,09067 %	0,09067 %
NTN-C 20310101	R\$ 11.465.306,24	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 11.562.683,07	R\$ 97.376,83	0,84932 %	0,84932 %
TOTAIS	R\$ 35.156.685,99	R\$ 957.492,04	R\$ 2.195.182,82	R\$ 34.079.288,51	R\$ 160.293,30	0,4703 %	0,4703 %



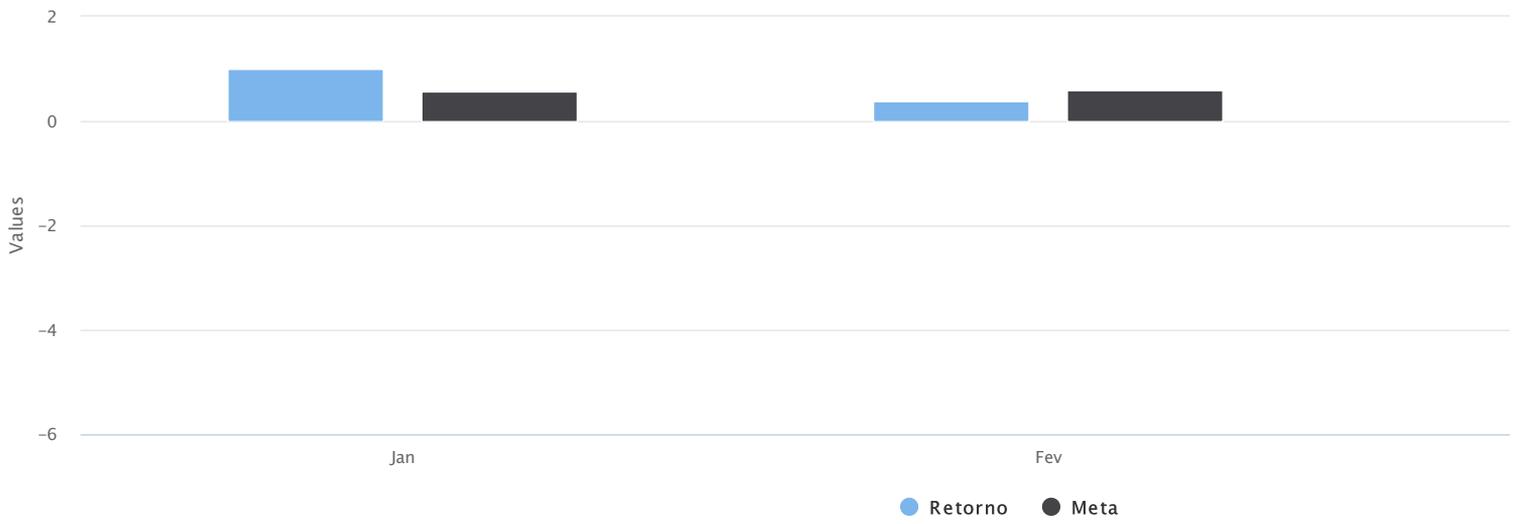
RETORNOS ACUMULADO

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 %
FEVEREIRO	R\$ 35.156.685,99	R\$ 957.492,04	R\$ 2.195.182,82	R\$ 34.079.288,51	R\$ 160.293,30	0,4703 %	0,73 %	64,49 %
TOTAIS		R\$ 2.579.965,66	R\$ 4.159.587,20		R\$ 586.618,85	1,69	1,42	118,97

Relatório competência: 02/2020



Gráfico – Retorno acumulado no ano





EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO X RENTABILIDADE MONETÁRIA

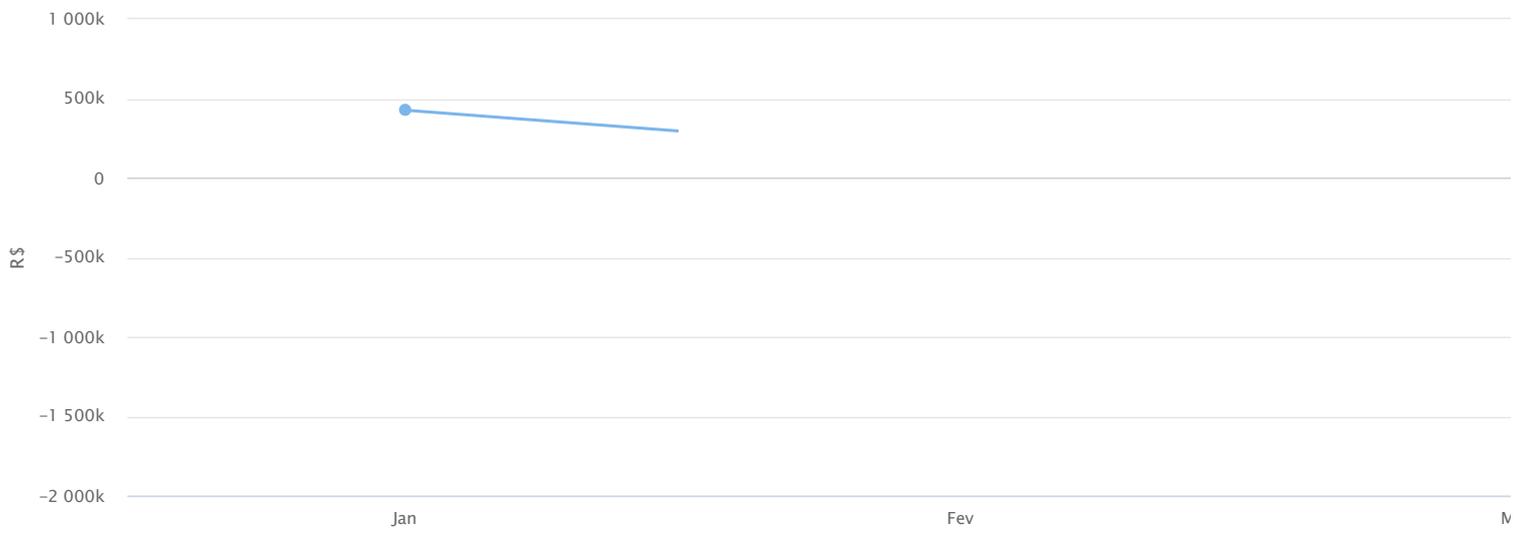
MESES	JANEIRO	FEVEREIRO	MARÇO	ABRIL	MAIO	JUNHO	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO
SALDO (R\$)	35.156.685,99	34.079.288,51	31.984.630,58	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
RETORNO (R\$)	426.325,55	160.293,30	-1.796.653,28	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00



Relatório competência: 02/2020



REFERENTE AO RETORNO (R\$)



Relatório competência: 02/2020



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 emissores 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: 02/2020



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	1.791.147,96	0,02 %	0,04 %	358,23
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	13.322.205/0001-35	IDKA 2	4.018,32	0,74 %	1,49 %	29,74
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	11.328.882/0001-35	IRF-M1	324.038,72	0,13 %	0,26 %	421,25
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	13.077.418/0001-49	CDI	2.488.686,62	0,02 %	0,05 %	497,74
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	15.486.093/0001-83	IPCA	4.981.824,08	1,19 %	2,80 %	59.283,71
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	2.532.676,90	0,25 %	0,11 %	6.331,69
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	IRF-M1	14.973,43	0,13 %	0,25 %	19,47
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	CDI	11.482,76	0,98 %	0,45 %	112,53
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	11.902.276/0001-81	IMA-B	302.090,10	87,59 %	40,25 %	264.600,72
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	554.030,52	3,25 %	32,51 %	18.005,99
NTN-B20450515	66.998.014/0001-54	NTN-B	9.511.636,03	0,00 %	0,00 %	0,00
NTN-C 20310101	66.998.014/0001-54	NTN-C	11.562.683,07	0,00 %	0,00 %	0,00

RISCO DE MERCADO	
Saldo Total:	R\$ 34.079.288,51
Provisão para perda e Investimentos:	R\$ 349.661,06
% Provisão de Perda:	1,026%

Relatório competência: 02/2020



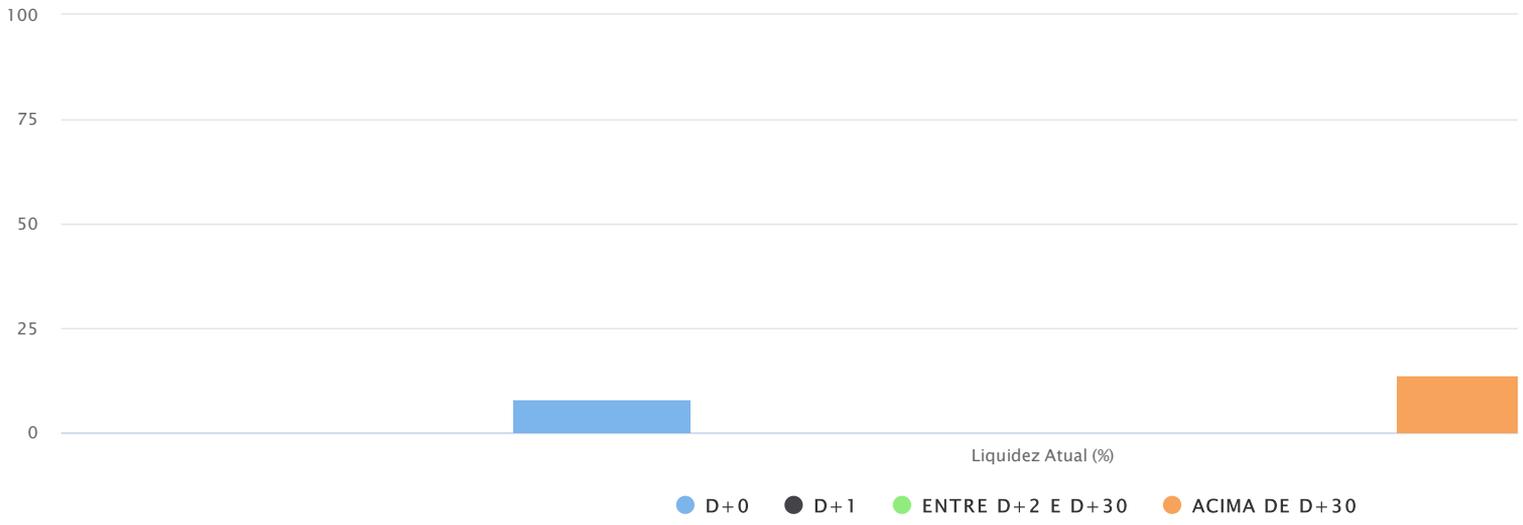
RISCO DE LIQUIDEZ

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	1.791.147,96	5,26 %	740	0,13 %	1.376.949.540,95	Art 7º , IV "a"	Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 0	4.018,32	0,01 %	888	0,00 %	6.830.764.502,36	Art 7º , I, "b"	Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D + 0	324.038,72	0,95 %	1214	0,00 %	7.492.585.716,79	Art 7º , I, "b"	Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	D + 0	2.488.686,62	7,30 %	644	0,09 %	2.774.667.818,45	Art 7º , IV "a"	Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 0	4.981.824,08	14,62 %	51	1,44 %	345.077.548,96	Art 7º , I, "b"	Médio
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
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA	D + 0	2.532.676,90	7,43 %	321	0,56 %	455.022.894,33	Art 7º , IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	14.973,43	0,04 %	1359	0,00 %	10.513.960.188,40	Art 7º , I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	D + 0	11.482,76	0,03 %	684	0,00 %	5.421.482.050,58	Art 7º , IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 730	302.090,10	0,89 %	0	0,40 %	75.462.854,83	Art 7º , IV "a"	Médio
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	D + 4	0,00	0,00 %		0,00 %	0,00	Art 8º , II, "a"	Alto
SAFRA EXECUTIVE 2 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	D + 1	0,00	0,00 %	16	0,00 %	317.289.718,61	Art 7º , IV "a"	Médio
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	D + 1260	554.030,52	1,63 %	71	0,73 %	75.675.537,05	Art 7º , VII, "a"	Alto
NTN-B20450515	D + 360	9.511.636,03	27,91 %	1	0,00 %	0,00	Art 7º , I, "a"	Alto
NTN-C 20310101	D + 192	11.562.683,07	33,93 %	1	0,00 %	0,00	Art 7º , I, "a"	Alto

TOTAL SALDO: R\$ 34.079.288,51

PRAZO DE RESGATE	QUANTIDADE DE FUNDOS	LIQUIDEZ ATUAL
D+0	9	36%
D+1	1	0%
ENTRE D+2 E D+30	1	0%
ACIMA DE D+30	4	64%

Gráfico



Relatório competência: 02/2020



RISCO DE CRÉDITO

RENDA FIXA - ARTIGOS	LIMITE DA RESOLUÇÃO	LIMITE POLÍTICA	TOTAL	% CARTEIRA
Art 7º, I, "a"	100 %	100 %	21.074.319,10	61,84
Art 7º, I, "b"	100 %	100 %	5.324.854,55	15,62
Art 7º, IV "a"	40 %	40 %	7.126.084,34	20,91
Art 7º, VII, "a"	5 %	5 %	554.030,52	1,63
			34.079.288,51	

RISCO DE CRÉDITO	% CARTEIRA
100% Títulos Públicos e 0% Títulos Privados	87,92%
50% Títulos Públicos e 50% Títulos Privados	10,46%
0% Títulos Públicos e 100% Títulos Privados	1,63%

Relatório competência: 02/2020



CAPITAL PROTEGIDO

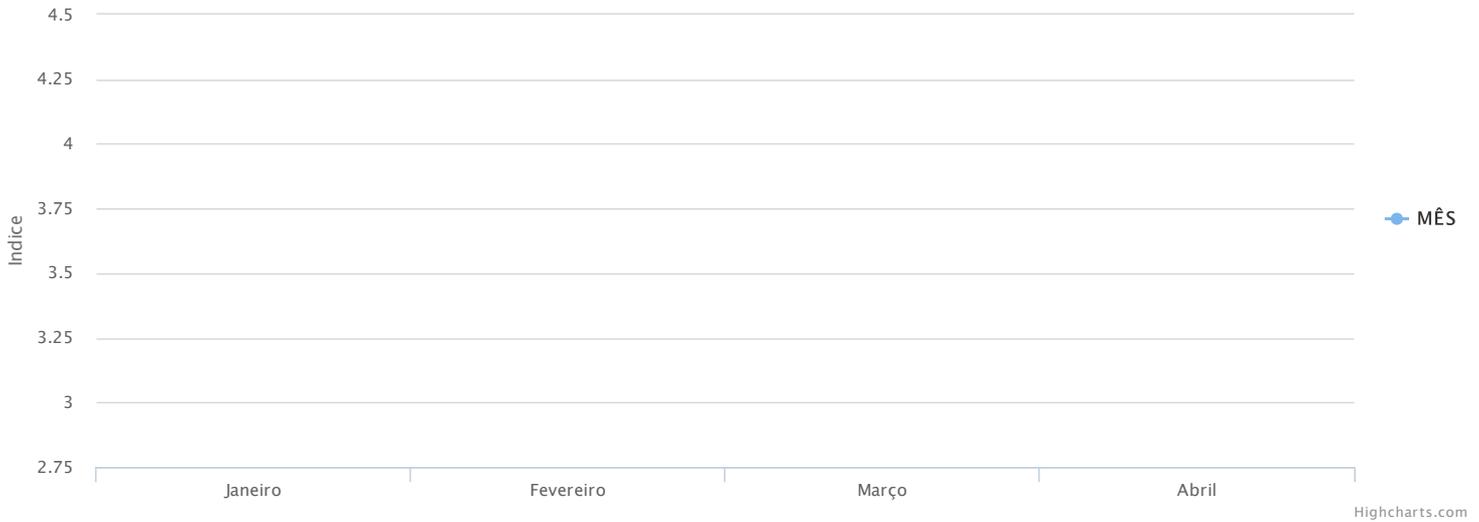
TIPO DE PRODUTO E PERCENTUAL DO CAPITAL INVESTIDO PROTEGIDO	
TIPO DE PRODUTO	PERCENTUAL DO CAPITAL INVESTIDO PROTEGIDO
INVESTIDO PROTEGIDO	INVESTIDO PROTEGIDO (Até)
Títulos Públicos Federais/ Carteira Própria	100%
Fundos de Investimento Referenciado e Renda Fixa 100% Títulos Públicos Federais (previsto 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: 02/2020



SELIC
2020



Highcharts.com

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



CADPREV

Renda Fixa		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 02/2020: R\$ 1.791.147,96
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\$ 2,090532000	Quantidade de Cotas: 856.790,5012	PL do Fundo: R\$ 1.376.949.540,95
% do PL do Fundo: 0,13%	Limite Cumulativo: 5,26%	Limite do Fundo: 40%

Renda Fixa		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 02/2020: R\$ 4.018,32
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\$ 2,706409441	Quantidade de Cotas: 1.484,7421	PL do Fundo: R\$ 6.830.764.502,36
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,01%	Limite do Fundo: 100%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: IRF-M1
Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	CNPJ: 11.328.882/0001-35	Saldo em 02/2020: R\$ 324.038,72
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\$ 2,654168000	Quantidade de Cotas: 122.086,7406	PL do Fundo: R\$ 7.492.585.716,79
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,95%	Limite do Fundo: 100%

Renda Fixa		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 02/2020: R\$ 2.488.686,62
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\$ 2,261856000	Quantidade de Cotas: 1.100.285,1729	PL do Fundo: R\$ 2.774.667.818,45
% do PL do Fundo: 0,09%	Limite Cumulativo: 7,30%	Limite do Fundo: 40%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: IPCA
Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	CNPJ: 15.486.093/0001-83	Saldo em 02/2020: R\$ 4.981.824,08
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\$ 2,308510223	Quantidade de Cotas: 2.158.025,5657	PL do Fundo: R\$ 345.077.548,96
% do PL do Fundo: 1,44%	Limite Cumulativo: 14,62%	Limite do Fundo: 100%

Renda Fixa		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 02/2020: 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%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: CDI
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA	CNPJ: 14.508.643/0001-55	Saldo em 02/2020: R\$ 2.532.676,90
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\$ 1,856357000	Quantidade de Cotas: 1.364.326,4200	PL do Fundo: R\$ 455.022.894,33
% do PL do Fundo: 0,56%	Limite Cumulativo: 7,43%	Limite do Fundo: 40%

Renda Fixa		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 02/2020: R\$ 14.973,43
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\$ 2,541313000	Quantidade de Cotas: 5.892,0054	PL do Fundo: R\$ 10.513.960.188,40
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,04%	Limite do Fundo: 100%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: CDI
-------------------	--	--------------------

Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	CNPJ: 37.372.060/0019-7	Saldo em 02/2020: R\$ 11.482,76
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\$ 3,674798000	Quantidade de Cotas: 3.124,7323	PL do Fundo: R\$ 5.421.482.050,58
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,03%	Limite do Fundo: 40%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: IMA-B
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	CNPJ: 11.902.276/0001-81	Saldo em 02/2020: R\$ 302.090,10
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\$ 0,569581000	Quantidade de Cotas: 530.372,5019	PL do Fundo: R\$ 75.462.854,83
% do PL do Fundo: 0,40%	Limite Cumulativo: 0,89%	Limite do Fundo: 40%

Renda Variável		Tipo de Fundo: AÇÕES
Fundo: GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	CNPJ: 11.898.349/0001-09	Saldo em 02/2020: 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%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: IRF-M1
Fundo: SAFRA EXECUTIVE 2 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	CNPJ: 10.787.647/0001-69	Saldo em 02/2020: 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\$ 278,284906000	Quantidade de Cotas: 0,0000	PL do Fundo: R\$ 317.289.718,61
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,00%	Limite do Fundo: 40%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: FIDC
Fundo: LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS	CNPJ: 12.440.789/0001-80	Saldo em 02/2020: R\$ 554.030,52
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\$ 0,387651090	Quantidade de Cotas: 1.429.198,9222	PL do Fundo: R\$ 75.675.537,05
% do PL do Fundo: 0,73%	Limite Cumulativo: 1,63%	Limite do Fundo: 5%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: NTN-B
Fundo: NTN-B20450515	CNPJ: 66.998.014/0001-54	Saldo em 02/2020: R\$ 9.511.636,03
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\$ 4.662,566687000	Quantidade de Cotas: 2.040,0000	PL do Fundo: R\$ 0,00
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 27,91%	Limite do Fundo: 100%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: NTN-C
Fundo: NTN-C 20310101	CNPJ: 66.998.014/0001-54	Saldo em 02/2020: R\$ 11.562.683,07
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\$ 4.662,566687000	Quantidade de Cotas: 2.479,8966	PL do Fundo: R\$ 0,00
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 33,93%	Limite do Fundo: 100%

TOTAL: R\$ 34.079.288,51

Relatório competência: 02/2020



CARTEIRA SUGERIDA ESTRATEGIA PRÓXIMO MÊS - PERFIL CONSERVADOR

ÍNDICE	CARTEIRA ATUAL		MOVIMENTAÇÕES	CARTEIRA SUGERIDA	
	SALDO ATUAL	% CAPITAL	APLICAR / RESGATAR	SALDO FINAL	% CAPITAL
FIDC	554.030,52	4,26	-18,82	554.011,70	4,26
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	4.981.824,08	38,31	379,70	4.982.203,78	38,31
IMA-B	302.090,10	2,32	417.084,71	719.174,81	5,53
IMA-B 5	0,00	0,00	650.248,47	650.248,47	5,00
IMA-B 5+	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IDKA 2	4.018,32	0,03	1.296.478,62	1.300.496,94	10,00
IDKA 20	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IRF-M	0,00	0,00	1.632.123,66	1.632.123,66	12,55
IRF-M1	339.012,15	2,61	961.484,79	1.300.496,94	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	6.823.994,24	52,47	-6.128.228,38	695.765,86	5,35
ALOCAÇÃO ATIVA	0,00	0,00	1.170.447,25	1.170.447,25	9,00
TOTAL:	13.004.969,41	100,00		13.004.969,41	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: 02/2020



ESTRATEGIA PRÓXIMO MÊS - PERFIL MODERADO

CARTEIRA ATUAL			MOVIMENTAÇÕES	CARTEIRA SUGERIDA	
INDICE	SALDO ATUAL	% CAPITAL	APLICAR / RESGATAR	SALDO FINAL	% CAPITAL
FIDC	554.030,52	4,26	-18,82	554.011,70	4,26
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	4.981.824,08	38,31	379,70	4.982.203,78	38,31
IMA-B	302.090,10	2,32	348.158,37	650.248,47	5,00
IMA-B 5	0,00	0,00	650.248,47	650.248,47	5,00
IMA-B 5+	0,00	0,00	719.174,81	719.174,81	5,53
IDKA 2	4.018,32	0,03	646.230,15	650.248,47	5,00
IDKA 20	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IRF-M	0,00	0,00	1.632.123,66	1.632.123,66	12,55
IRF-M1	339.012,15	2,61	961.484,79	1.300.496,94	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	6.823.994,24	52,47	-6.128.228,38	695.765,86	5,35
ALOCÇÃO ATIVA	0,00	0,00	1.170.447,25	1.170.447,25	9,00
TOTAL:	13.004.969,41	100,00		13.004.969,41	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: 02/2020