

INSTITUTO DE PREVIDENCIA DO MUNICIPIO DE BARRETOS

Relatório Competência

03/2020

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	1.714.751,78	5,36 %	744	0,11 %	1.561.401.900,27	Art 7º , IV "a"	Baixo	1,00 %	Fundo de Investimento
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 0	3.951,51	0,01 %	882	0,00 %	6.723.745.548,10	Art 7º , I, "b"	Baixo	0,20 %	Fundo de Investimento
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D + 0	535.143,46	1,67 %	1227	0,01 %	6.969.533.398,64	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	1.530.947,54	4,79 %	637	0,06 %	2.725.355.805,79	Art 7º , IV "a"	Baixo	0,20 %	Fundo de Investimento
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 0	4.887.753,20	15,28 %	51	1,44 %	338.561.511,94	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	3.072.506,79	9,61 %	319	0,53 %	579.404.055,27	Art 7º , IV "a"	Baixo	0,80 %	Fundo de Investimento
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	15.061,45	0,05 %	1357	0,00 %	10.517.651.272,61	Art 7º , I, "b"	Baixo	0,20 %	Fundo de Investimento
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	D + 0	11.499,09	0,04 %	689	0,00 %	5.503.080.783,31	Art 7º , IV "a"	Baixo	0,20 %	Fundo de Investimento
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 730	333.125,91	1,04 %	19	0,40 %	82.723.426,19	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 %	15	0,00 %	302.701.478,69	Art 7º , IV "a"	Médio	0,20 %	Fundo de Investimento
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	D + 1260	546.898,14	1,71 %	71	0,73 %	74.701.319,41	Art 7º , VII, "a"	Alto	1,50 %	Fundo de Investimento
NTN-B20450515	D + 360	8.352.542,53	26,11 %	1	0,00 %	0,00	Art 7º , I, "a"	Alto	0,20 %	Fundo de Investimento
NTN-C 20310101	D + 192	10.980.449,18	34,33 %	1	0,00 %	0,00	Art 7º , I, "a"	Alto	0,20 %	Fundo de Investimento

TOTAL SALDO: R\$ 31.984.630,58

Relatório competência: 03/2020



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%	19.332.991,71	60,44 %
FI 100 TÍTULOS TN - Art 7º, I, "b"	100% ENQUADRADO	15% ENQUADRADO	20% ENQUADRADO	100%	5.441.909,62	17,01 %
FI RENDA FIXA GERAL - Art 7º, IV "a"	40% ENQUADRADO	15% ENQUADRADO	20% ENQUADRADO	40%	6.662.831,11	20,83 %
FI EM DIREITOS CREDITÓRIOS / COTA SENIOR - Art 7º, VII, "a"	5% ENQUADRADO	5% ENQUADRADO	20% ENQUADRADO	5%	546.898,14	1,71 %
Valor total Renda Fixa: R\$ 31.984.630,58						

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	6.329.705,20	19,79
FIDC	546.898,14	1,71
IDKA 2	3.951,51	0,01
IMA-B	333.125,91	1,04
IPCA	4.887.753,20	15,28
IRF-M1	550.204,91	1,72
NTN-B	8.352.542,53	26,11
NTN-C	10.980.449,18	34,33
	R\$ 31.984.630,58	

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	TOTAL	% CARTEIRA
CNPJ:	19.332.991,71	60,44
SAFRA SERVIÇOS DE ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA LTDA CNPJ: 06947853000111	0,00	0,00
INTRADER DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA CNPJ: 15489568000195	333.125,91	1,04
GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A CNPJ: 27652684000162	0,00	0,00
BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A CNPJ: 30822936000169	8.672.547,49	27,11
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CNPJ: 360305000104	3.099.067,33	9,69
ORLA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S/A CNPJ: 92904564000177	546.898,14	1,71
	R\$ 31.984.630,58	



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\$ 1.791.147,96	R\$ 11.569,88	R\$ 92.303,54	R\$ 1.714.751,78	R\$ 4.337,48	0,24888 %	0,24888 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 4.018,32	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 3.951,51	R\$ -66,81	-1,66265 %	-1,66265 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 324.038,72	R\$ 208.145,23	R\$ 0,00	R\$ 535.143,46	R\$ 2.959,51	0,59759 %	0,59759 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	R\$ 2.488.686,62	R\$ 0,00	R\$ 957.819,61	R\$ 1.530.947,54	R\$ 80,53	-0,03307 %	-0,03307 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 4.981.824,08	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 4.887.753,20	R\$ -94.070,88	-1,88828 %	-1,88828 %
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\$ 2.532.676,90	R\$ 781.139,94	R\$ 248.736,55	R\$ 3.072.506,79	R\$ 7.426,50	0,26471 %	0,26471 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	R\$ 14.973,43	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 15.061,45	R\$ 88,02	0,58781 %	0,58781 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	R\$ 11.482,76	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 11.499,09	R\$ 16,33	0,14224 %	0,14224 %
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 302.090,10	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 333.125,91	R\$ 31.035,81	10,27369 %	10,27369 %
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	0,40369 %	0,40369 %
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	R\$ 554.030,52	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 546.898,14	R\$ -7.132,38	-1,28736 %	-1,28736 %
NTN-B20450515	R\$ 9.511.636,03	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 8.352.542,53	R\$ -1.159.093,50	-12,18606 %	-12,18606 %
NTN-C 20310101	R\$ 11.562.683,07	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 10.980.449,18	R\$ -582.233,89	-5,03546 %	-5,03546 %
TOTAIS	R\$ 34.079.288,51	R\$ 1.000.855,05	R\$ 1.298.859,70	R\$ 31.984.630,58	R\$ -1.796.653,28	-5,0672 %	-5,0672 %



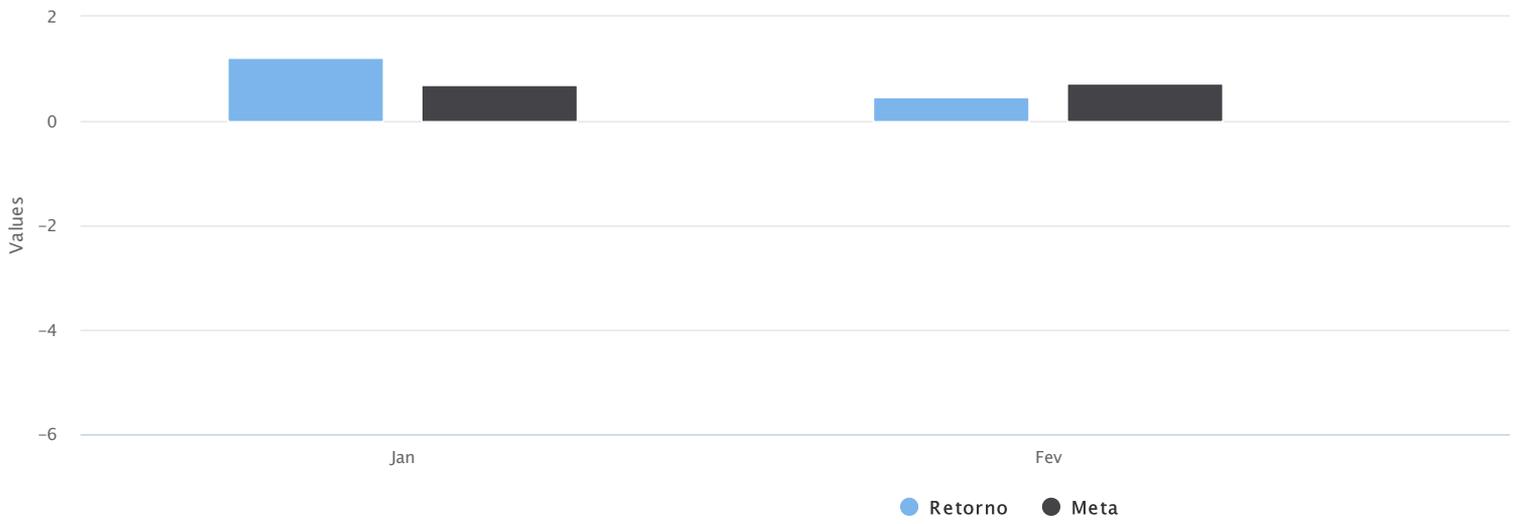
RETORNOS ACUMULADO

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 %
MARÇO	R\$ 34.079.288,51	R\$ 1.000.855,05	R\$ 1.298.859,70	R\$ 31.984.630,58	R\$ -1.796.653,28	-5,0672 %	0,55 %	-924,00 %
TOTAIS		R\$ 3.580.820,71	R\$ 5.458.446,90		R\$ -1.210.034,43	-3,46	1,98	-174,76

Relatório competência: 03/2020



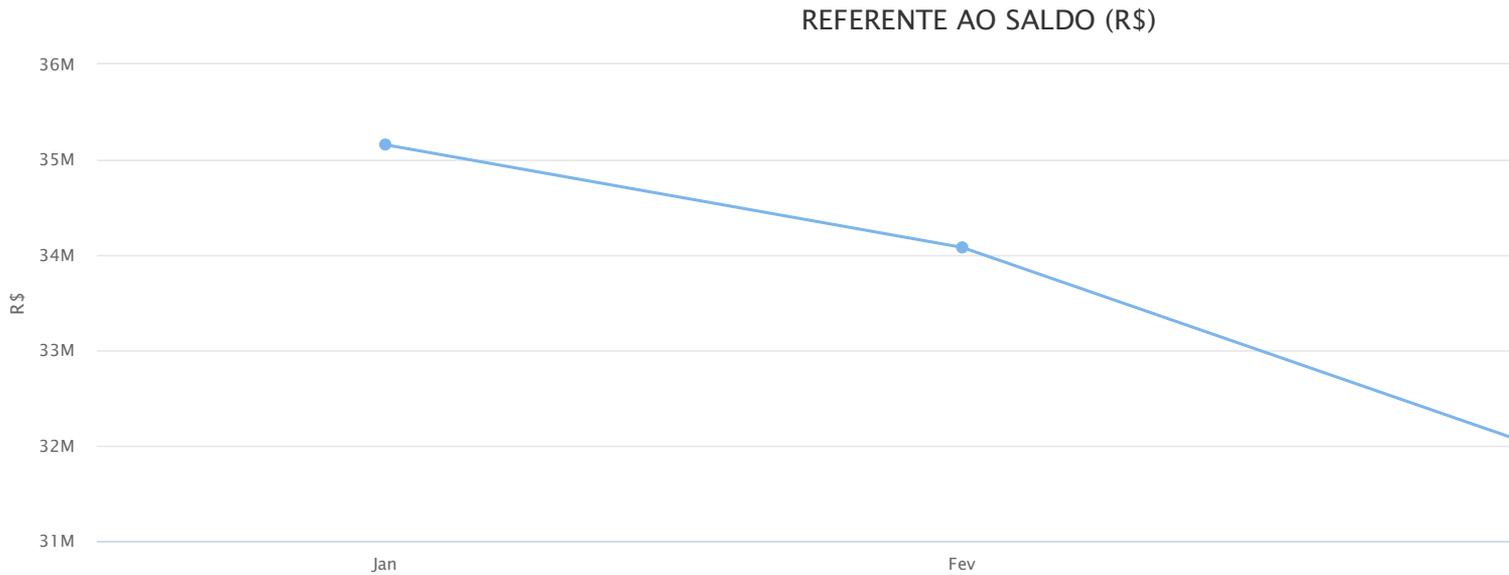
Gráfico – Retorno acumulado no ano





EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO X RENTABILIDADE MONETÁRIA

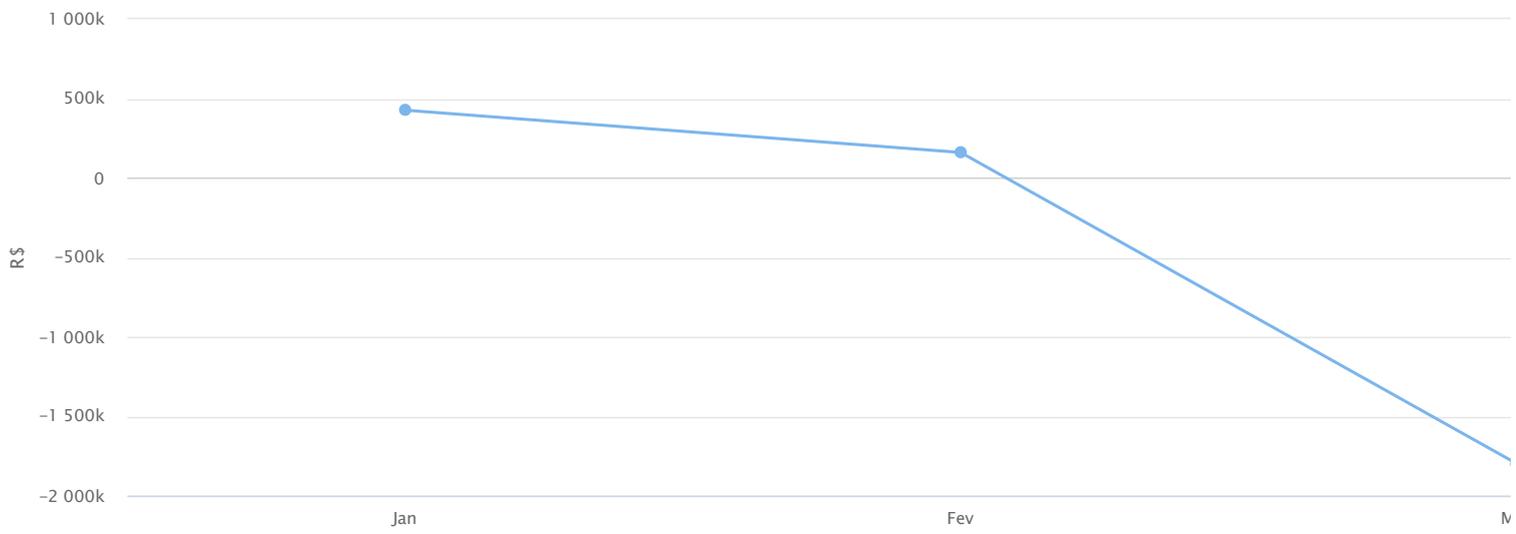
MESES	JANEIRO	FEVEREIRO	MARÇO	ABRIL	MAIO	JUNHO	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO
SALDO (R\$)	35.156.685,99	34.079.288,51	31.984.630,58	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
RETORNO (R\$)	426.325,55	160.293,30	-1.796.653,28	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00



Relatório competência: 03/2020



REFERENTE AO RETORNO (R\$)



Relatório competência: 03/2020



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: 03/2020



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	1.714.751,78	0,62 %	0,29 %	10.631,46
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	13.322.205/0001-35	IDKA 2	3.951,51	6,33 %	2,91 %	250,13
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	11.328.882/0001-35	IRF-M1	535.143,46	0,94 %	0,43 %	5.030,35
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	13.077.418/0001-49	CDI	1.530.947,54	1,20 %	0,55 %	18.371,37
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	15.486.093/0001-83	IPCA	4.887.753,20	9,59 %	4,41 %	468.735,53
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	3.072.506,79	0,64 %	0,29 %	19.664,04
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	IRF-M1	15.061,45	0,93 %	0,43 %	140,07
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	CDI	11.499,09	0,91 %	0,42 %	104,64
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	11.902.276/0001-81	IMA-B	333.125,91	87,59 %	40,25 %	291.784,98
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	1,11 %	0,51 %	0,00
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	12.440.789/0001-80	FIDC	546.898,14	3,25 %	32,51 %	17.774,19
NTN-B20450515	66.998.014/0001-54	NTN-B	8.352.542,53	0,00 %	0,00 %	0,00
NTN-C 20310101	66.998.014/0001-54	NTN-C	10.980.449,18	0,00 %	0,00 %	0,00

RISCO DE MERCADO	
Saldo Total:	R\$ 31.984.630,58
Provisão para perda e Investimentos:	R\$ 832.486,77
% Provisão de Perda:	2,603%

Relatório competência: 03/2020



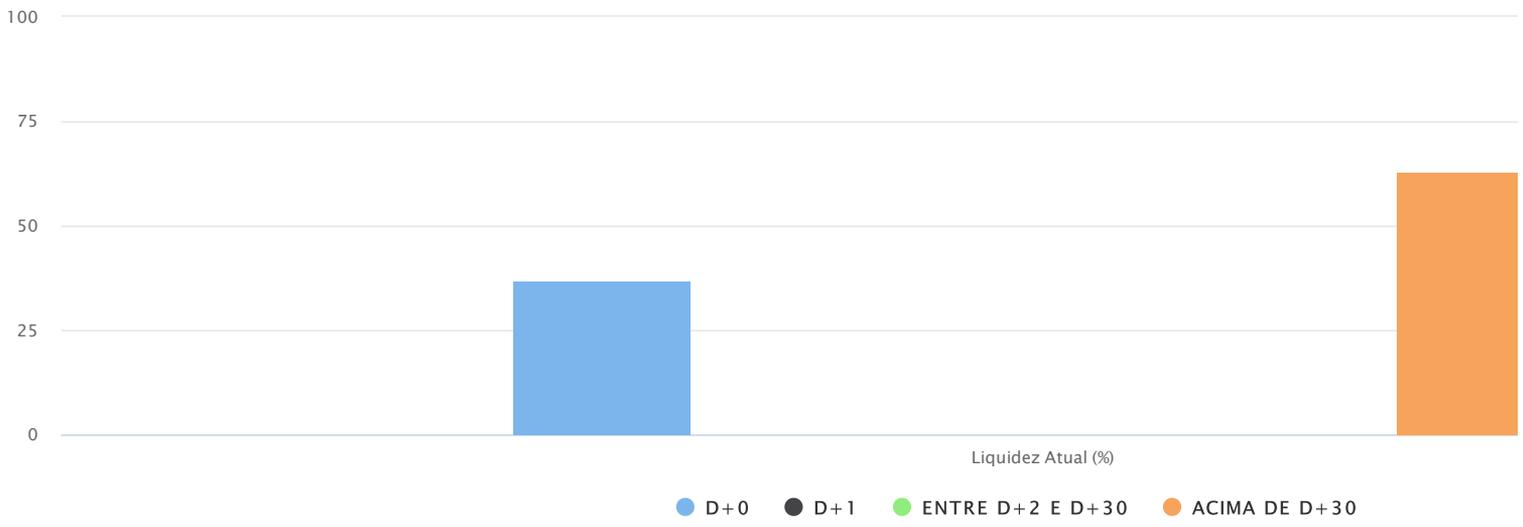
RISCO DE LIQUIDEZ

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	1.714.751,78	5,36 %	744	0,11 %	1.561.401.900,27	Art 7º , IV "a"	Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 0	3.951,51	0,01 %	882	0,00 %	6.723.745.548,10	Art 7º , I, "b"	Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D + 0	535.143,46	1,67 %	1227	0,01 %	6.969.533.398,64	Art 7º , I, "b"	Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	D + 0	1.530.947,54	4,79 %	637	0,06 %	2.725.355.805,79	Art 7º , IV "a"	Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 0	4.887.753,20	15,28 %	51	1,44 %	338.561.511,94	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	3.072.506,79	9,61 %	319	0,53 %	579.404.055,27	Art 7º , IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	15.061,45	0,05 %	1357	0,00 %	10.517.651.272,61	Art 7º , I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	D + 0	11.499,09	0,04 %	689	0,00 %	5.503.080.783,31	Art 7º , IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 730	333.125,91	1,04 %	19	0,40 %	82.723.426,19	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 %	15	0,00 %	302.701.478,69	Art 7º , IV "a"	Médio
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	D + 1260	546.898,14	1,71 %	71	0,73 %	74.701.319,41	Art 7º , VII, "a"	Alto
NTN-B20450515	D + 360	8.352.542,53	26,11 %	1	0,00 %	0,00	Art 7º , I, "a"	Alto
NTN-C 20310101	D + 192	10.980.449,18	34,33 %	1	0,00 %	0,00	Art 7º , I, "a"	Alto

TOTAL SALDO: R\$ 31.984.630,58

PRAZO DE RESGATE	QUANTIDADE DE FUNDOS	LIQUIDEZ ATUAL
D+0	9	37%
D+1	1	0%
ENTRE D+2 E D+30	1	0%
ACIMA DE D+30	4	63%

Gráfico



Relatório competência: 03/2020



RISCO DE CRÉDITO

RENDA FIXA - ARTIGOS	LIMITE DA RESOLUÇÃO	LIMITE POLÍTICA	TOTAL	% CARTEIRA
Art 7º, I, "a"	100 %	100 %	19.332.991,71	60,44
Art 7º, I, "b"	100 %	100 %	5.441.909,62	17,01
Art 7º, IV "a"	40 %	40 %	6.662.831,11	20,83
Art 7º, VII, "a"	5 %	5 %	546.898,14	1,71
			31.984.630,58	

RISCO DE CRÉDITO	% CARTEIRA
100% Títulos Públicos e 0% Títulos Privados	87,87%
50% Títulos Públicos e 50% Títulos Privados	10,42%
0% Títulos Públicos e 100% Títulos Privados	1,71%

Relatório competência: 03/2020



CAPITAL PROTEGIDO

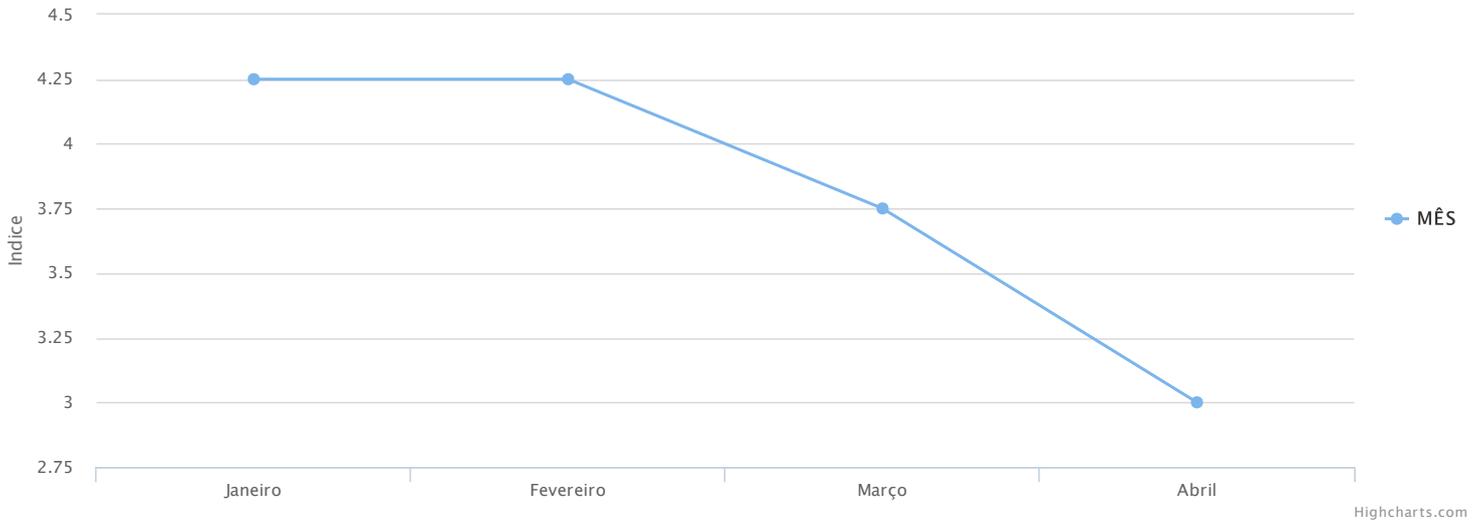
TIPO DE PRODUTO E PERCENTUAL DO CAPITAL INVESTIDO PROTEGIDO	
TIPO DE PRODUTO	PERCENTUAL DO CAPITAL INVESTIDO PROTEGIDO
INVESTIDO PROTEGIDO	INVESTIDO PROTEGIDO (Até)
Títulos Públicos Federais/ Carteira Própria	100%
Fundos de Investimento Referenciado e Renda Fixa 100% Títulos Públicos Federais (previsto 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: 03/2020



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 03/2020: R\$ 1.714.751,78
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\$ 2,095735000	Quantidade de Cotas: 818.210,2126	PL do Fundo: R\$ 1.561.401.900,27
% do PL do Fundo: 0,11%	Limite Cumulativo: 5,36%	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 03/2020: R\$ 3.951,51
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\$ 2,661411421	Quantidade de Cotas: 1.484,7423	PL do Fundo: R\$ 6.723.745.548,10
% 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 03/2020: R\$ 535.143,46
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\$ 2,670029000	Quantidade de Cotas: 200.426,0853	PL do Fundo: R\$ 6.969.533.398,64
% do PL do Fundo: 0,01%	Limite Cumulativo: 1,67%	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 03/2020: R\$ 1.530.947,54
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\$ 2,261108000	Quantidade de Cotas: 677.078,4677	PL do Fundo: R\$ 2.725.355.805,79
% do PL do Fundo: 0,06%	Limite Cumulativo: 4,79%	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 03/2020: R\$ 4.887.753,20
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\$ 2,264919042	Quantidade de Cotas: 2.158.025,5671	PL do Fundo: R\$ 338.561.511,94
% do PL do Fundo: 1,44%	Limite Cumulativo: 15,28%	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 03/2020: 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 03/2020: R\$ 3.072.506,79
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\$ 1,861271000	Quantidade de Cotas: 1.650.757,3534	PL do Fundo: R\$ 579.404.055,27
% do PL do Fundo: 0,53%	Limite Cumulativo: 9,61%	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 03/2020: R\$ 15.061,45
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\$ 2,556251000	Quantidade de Cotas: 5.892,0075	PL do Fundo: R\$ 10.517.651.272,61
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,05%	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 03/2020: R\$ 11.499,09
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\$ 3,680025000	Quantidade de Cotas: 3.124,7315	PL do Fundo: R\$ 5.503.080.783,31
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,04%	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 03/2020: R\$ 333.125,91
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\$ 0,628098000	Quantidade de Cotas: 530.372,5056	PL do Fundo: R\$ 82.723.426,19
% do PL do Fundo: 0,40%	Limite Cumulativo: 1,04%	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 03/2020: 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 03/2020: 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\$ 279,408313000	Quantidade de Cotas: 0,0000	PL do Fundo: R\$ 302.701.478,69
% 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 CREDITORIOS	CNPJ: 12.440.789/0001-80	Saldo em 03/2020: R\$ 546.898,14
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\$ 0,382660620	Quantidade de Cotas: 1.429.198,9074	PL do Fundo: R\$ 74.701.319,41
% do PL do Fundo: 0,73%	Limite Cumulativo: 1,71%	Limite do Fundo: 5%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: NTN-B
Fundo: NTN-B20450515	CNPJ: 66.998.014/0001-54	Saldo em 03/2020: R\$ 8.352.542,53
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\$ 4.094,383595000	Quantidade de Cotas: 2.040,0000	PL do Fundo: R\$ 0,00
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 26,11%	Limite do Fundo: 100%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: NTN-C
Fundo: NTN-C 20310101	CNPJ: 66.998.014/0001-54	Saldo em 03/2020: R\$ 10.980.449,18
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\$ 4.094,383595000	Quantidade de Cotas: 2.681,8321	PL do Fundo: R\$ 0,00
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 34,33%	Limite do Fundo: 100%

TOTAL: R\$ 31.984.630,58

Relatório competência: 03/2020



CARTEIRA SUGERIDA ESTRATEGIA PRÓXIMO MÊS - PERFIL CONSERVADOR

ÍNDICE	CARTEIRA ATUAL		MOVIMENTAÇÕES	CARTEIRA SUGERIDA	
	SALDO ATUAL	% CAPITAL	APLICAR / RESGATAR	SALDO FINAL	% CAPITAL
FIDC	546.898,14	4,32	-546.898,14	0,00	0,00
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	4.887.753,20	38,63	-4.887.753,20	0,00	0,00
IMA-B	333.125,91	2,63	-333.125,91	0,00	0,00
IMA-B 5	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IMA-B 5+	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IDKA 2	3.951,51	0,03	-3.951,51	0,00	0,00
IDKA 20	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IRF-M	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IRF-M1	550.204,91	4,35	-550.204,91	0,00	0,00
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	6.329.705,20	50,03	-6.329.705,20	0,00	0,00
ALOCAÇÃO ATIVA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
TOTAL:	12.651.638,87	100,00		0,00	0,00

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: 03/2020



ESTRATEGIA PRÓXIMO MÊS - PERFIL MODERADO

CARTEIRA ATUAL			MOVIMENTAÇÕES	CARTEIRA SUGERIDA	
ÍNDICE	SALDO ATUAL	% CAPITAL	APLICAR / RESGATAR	SALDO FINAL	% CAPITAL
FIDC	546.898,14	4,32	-546.898,14	0,00	0,00
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	4.887.753,20	38,63	-4.887.753,20	0,00	0,00
IMA-B	333.125,91	2,63	-333.125,91	0,00	0,00
IMA-B 5	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IMA-B 5+	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IDKA 2	3.951,51	0,03	-3.951,51	0,00	0,00
IDKA 20	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IRF-M	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IRF-M1	550.204,91	4,35	-550.204,91	0,00	0,00
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	6.329.705,20	50,03	-6.329.705,20	0,00	0,00
ALOCÇÃO ATIVA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
TOTAL:	12.651.638,87	100,00		0,00	0,00

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: 03/2020