

INSTITUTO DE PREVIDENCIA DO MUNICIPIO DE BARRETOS

Relatório Competência

04/2020



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	1.629.307,00	5,08 %	746	0,10 %	1.637.982.393,12	Art 7º , IV "a"	Baixo	1,00 %	Fundo de Investimento
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 0	3.964,30	0,01 %	883	0,00 %	6.681.370.754,80	Art 7º , I, "b"	Baixo	0,20 %	Fundo de Investimento
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D + 0	736.408,17	2,29 %	1251	0,01 %	7.168.032.689,23	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	778.636,85	2,43 %	631	0,03 %	2.594.654.169,89	Art 7º , IV "a"	Baixo	0,20 %	Fundo de Investimento
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 0	4.927.845,77	15,35 %	51	1,44 %	341.338.616,41	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	3.430.657,60	10,69 %	317	0,59 %	577.158.987,32	Art 7º , IV "a"	Baixo	0,80 %	Fundo de Investimento
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	15.126,70	0,05 %	1370	0,00 %	10.765.141.210,50	Art 7º , I, "b"	Baixo	0,20 %	Fundo de Investimento
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	D + 0	11.499,49	0,04 %	677	0,00 %	4.876.604.207,95	Art 7º , IV "a"	Baixo	0,20 %	Fundo de Investimento
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 730	334.132,56	1,04 %	19	0,40 %	83.568.409,70	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 %	304.195.788,23	Art 7º , IV "a"	Médio	0,20 %	Fundo de Investimento
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	D + 1260	545.477,29	1,70 %	71	0,73 %	74.507.244,57	Art 7º , VII, "a"	Alto	1,50 %	Fundo de Investimento
NTN-B20450515	D + 360	8.529.755,73	26,58 %	1	0,00 %	0,00	Art 7º , I, "a"	Alto	0,20 %	Fundo de Investimento
NTN-C 20310101	D + 192	11.153.628,26	34,75 %	1	0,00 %	0,00	Art 7º , I, "a"	Alto	0,20 %	Fundo de Investimento

TOTAL SALDO: R\$ 32.096.439,72

Relatório competência: 04/2020



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%	19.683.383,99	61,33 %
FI 100 TÍTULOS TN - Art 7º, I, "b"	100% ENQUADRADO	15% ENQUADRADO	20% ENQUADRADO	100%	5.683.344,94	17,71 %
FI RENDA FIXA GERAL - Art 7º, IV "a"	40% ENQUADRADO	15% ENQUADRADO	20% ENQUADRADO	40%	6.184.233,50	19,27 %
FI EM DIREITOS CREDITÓRIOS / COTA SENIOR - Art 7º, VII, "a"	5% ENQUADRADO	5% ENQUADRADO	20% ENQUADRADO	5%	545.477,29	1,70 %
Valor total Renda Fixa: R\$ 32.096.439,72						

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	5.850.100,94	18,23
FIDC	545.477,29	1,70
IDKA 2	3.964,30	0,01
IMA-B	334.132,56	1,04
IPCA	4.927.845,77	15,35
IRF-M1	751.534,87	2,34
NTN-B	8.529.755,73	26,58
NTN-C	11.153.628,26	34,75
	R\$ 32.096.439,72	

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	TOTAL	% CARTEIRA
CNPJ:	19.683.383,99	61,33
SAFRA SERVIÇOS DE ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA LTDA CNPJ: 06947853000111	0,00	0,00
INTRADER DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA CNPJ: 15489568000195	334.132,56	1,04
GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A CNPJ: 27652684000162	0,00	0,00
BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A CNPJ: 30822936000169	8.076.162,09	25,16
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CNPJ: 360305000104	3.457.283,79	10,77
ORLA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S/A CNPJ: 92904564000177	545.477,29	1,70
	R\$ 32.096.439,72	



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\$ 1.714.751,78	R\$ 113.975,49	R\$ 202.728,46	R\$ 1.629.307,00	R\$ 3.308,19	0,19883 %	0,19883 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 3.951,51	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 3.964,30	R\$ 12,79	0,32370 %	0,32370 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 535.143,46	R\$ 198.591,82	R\$ 0,00	R\$ 736.408,17	R\$ 2.672,89	0,41232 %	0,41232 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	R\$ 1.530.947,54	R\$ 200.000,00	R\$ 955.309,11	R\$ 778.636,85	R\$ 2.998,42	0,25819 %	0,25819 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 4.887.753,20	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 4.927.845,77	R\$ 40.092,57	0,82027 %	0,82027 %
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\$ 3.072.506,79	R\$ 602.043,14	R\$ 250.848,79	R\$ 3.430.657,60	R\$ 6.956,46	0,21818 %	0,21818 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	R\$ 15.061,45	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 15.126,70	R\$ 65,25	0,43325 %	0,43325 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	R\$ 11.499,09	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 11.499,49	R\$ 0,40	0,00348 %	0,00348 %
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 333.125,91	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 334.132,56	R\$ 1.006,65	0,30218 %	0,30218 %
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	0,36252 %	0,36252 %
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS	R\$ 546.898,14	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 545.477,29	R\$ -1.420,85	-0,25980 %	-0,25980 %
NTN-B20450515	R\$ 8.352.542,53	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 8.529.755,73	R\$ 177.213,20	2,12167 %	2,12167 %
NTN-C 20310101	R\$ 10.980.449,18	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 11.153.628,26	R\$ 173.179,08	1,57716 %	1,57716 %
TOTAIS	R\$ 31.984.630,58	R\$ 1.114.610,45	R\$ 1.408.886,36	R\$ 32.096.439,72	R\$ 406.085,05	1,2860 %	1,2860 %



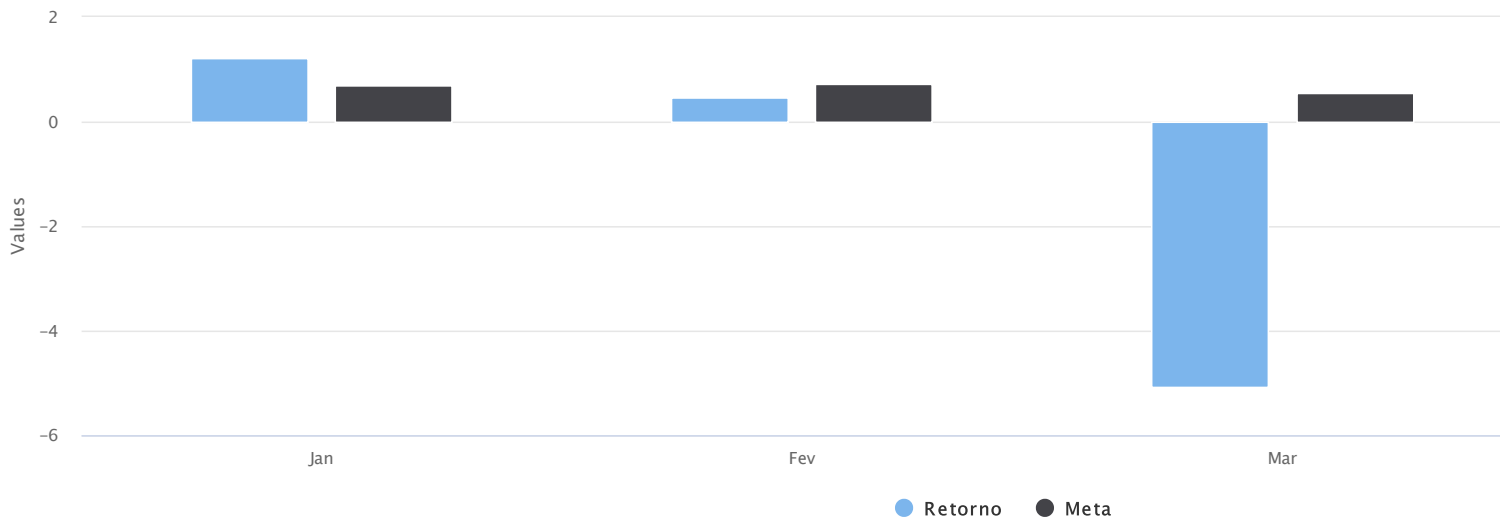
RETORNOS ACUMULADO

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 %
ABRIL	R\$ 31.984.630,58	R\$ 1.114.610,45	R\$ 1.408.886,36	R\$ 32.096.439,72	R\$ 406.085,05	1,2860 %	0,17 %	771,91 %
TOTAIS		R\$ 4.695.431,16	R\$ 6.867.333,26		R\$ -803.949,38	-2,22	2,15	-103,19

Relatório competência: 04/2020



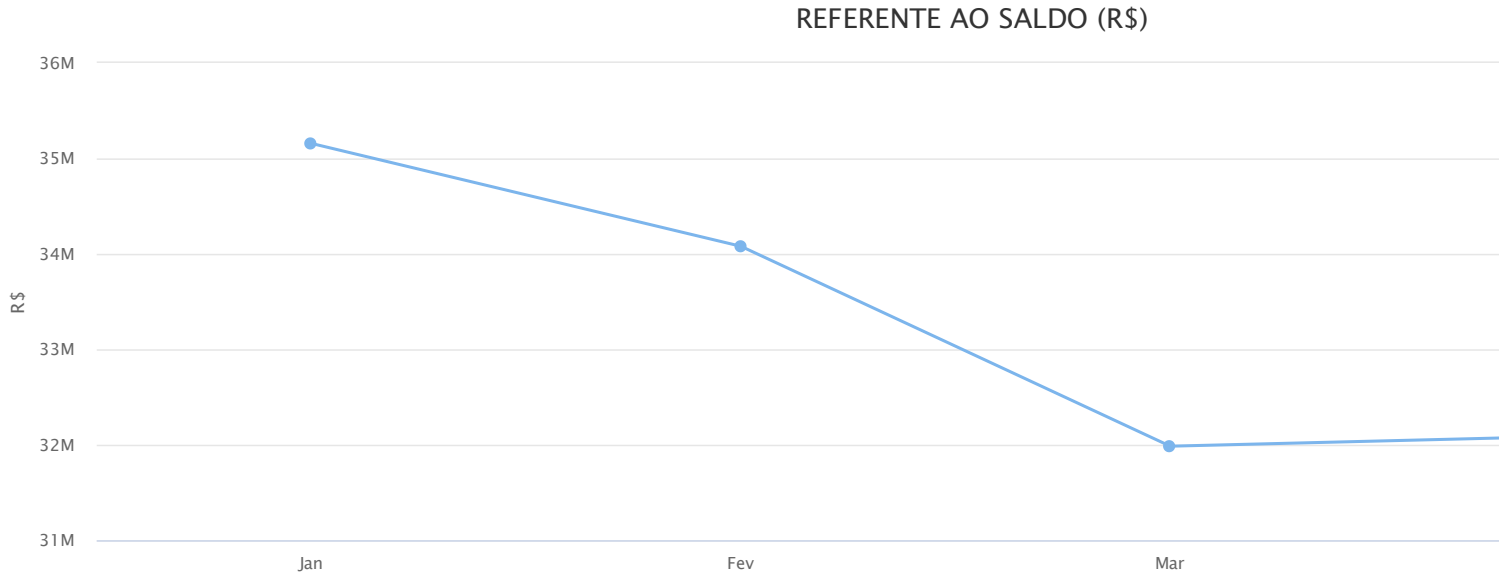
Gráfico – Retorno acumulado no ano





EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO X RENTABILIDADE MONETÁRIA

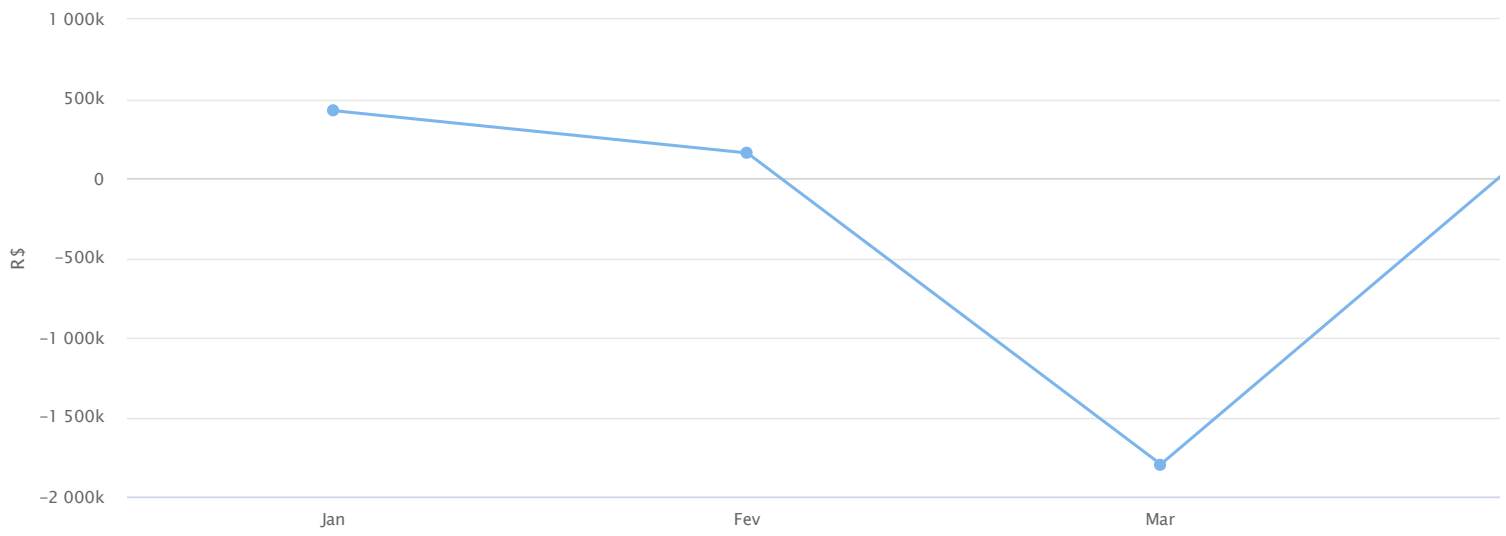
MESES	JANEIRO	FEVEREIRO	MARÇO	ABRIL	MAIO	JUNHO	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO
SALDO (R\$)	35.156.685,99	34.079.288,51	31.984.630,58	32.096.439,72	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
RETORNO (R\$)	426.325,55	160.293,30	-1.796.653,28	406.085,05	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00



Relatório competência: 04/2020



REFERENTE AO RETORNO (R\$)



Relatório competência: 04/2020



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: 04/2020



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	1.629.307,00	0,62 %	0,29 %	10.101,70
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	13.322.205/0001-35	IDKA 2	3.964,30	6,33 %	2,91 %	250,94
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	11.328.882/0001-35	IRF-M1	736.408,17	0,94 %	0,43 %	6.922,24
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	13.077.418/0001-49	CDI	778.636,85	1,20 %	0,55 %	9.343,64
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	15.486.093/0001-83	IPCA	4.927.845,77	9,59 %	4,41 %	472.580,41
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	3.430.657,60	0,64 %	0,29 %	21.956,21
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	IRF-M1	15.126,70	0,93 %	0,43 %	140,68
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	CDI	11.499,49	0,91 %	0,42 %	104,65
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	11.902.276/0001-81	IMA-B	334.132,56	87,59 %	40,25 %	292.666,71
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	545.477,29	3,25 %	32,51 %	17.728,01
NTN-B20450515	66.998.014/0001-54	NTN-B	8.529.755,73	0,00 %	0,00 %	0,00
NTN-C 20310101	66.998.014/0001-54	NTN-C	11.153.628,26	0,00 %	0,00 %	0,00

RISCO DE MERCADO	
Saldo Total:	R\$ 32.096.439,72
Provisão para perda e Investimentos:	R\$ 831.795,19
% Provisão de Perda:	2,592%

Relatório competência: 04/2020



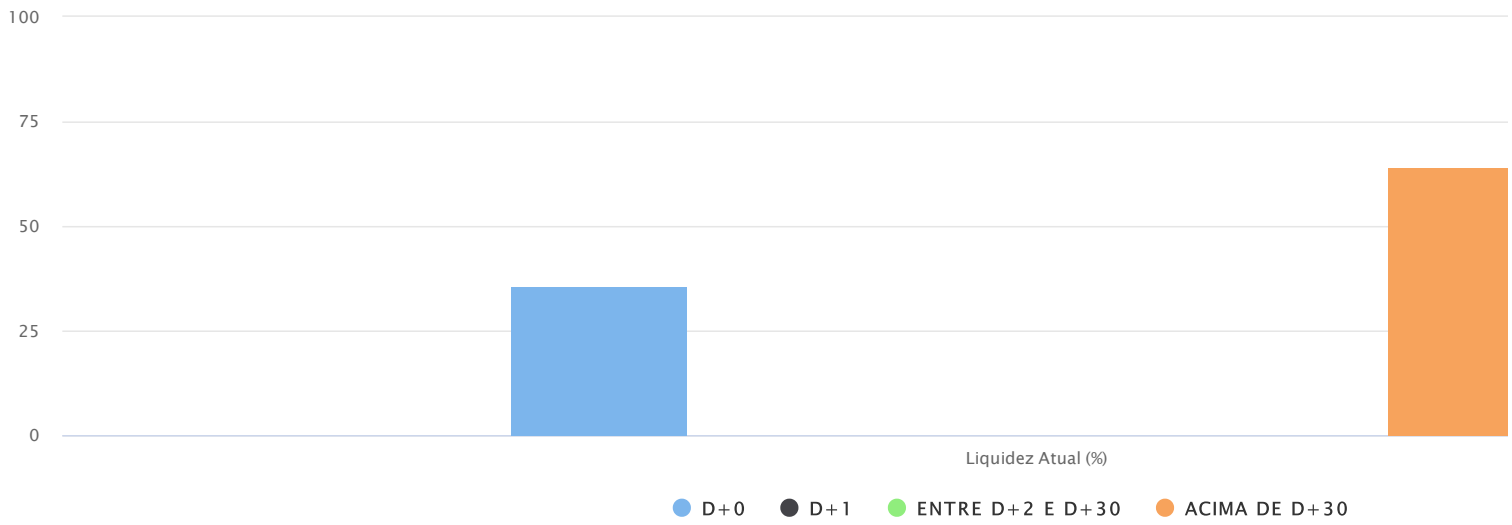
RISCO DE LIQUIDEZ

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	1.629.307,00	5,08 %	746	0,10 %	1.637.982.393,12	Art 7º , IV "a"	Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 0	3.964,30	0,01 %	883	0,00 %	6.681.370.754,80	Art 7º , I, "b"	Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D + 0	736.408,17	2,29 %	1251	0,01 %	7.168.032.689,23	Art 7º , I, "b"	Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	D + 0	778.636,85	2,43 %	631	0,03 %	2.594.654.169,89	Art 7º , IV "a"	Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 0	4.927.845,77	15,35 %	51	1,44 %	341.338.616,41	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	3.430.657,60	10,69 %	317	0,59 %	577.158.987,32	Art 7º , IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	15.126,70	0,05 %	1370	0,00 %	10.765.141.210,50	Art 7º , I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	D + 0	11.499,49	0,04 %	677	0,00 %	4.876.604.207,95	Art 7º , IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 730	334.132,56	1,04 %	19	0,40 %	83.568.409,70	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 %	304.195.788,23	Art 7º , IV "a"	Médio
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	D + 1260	545.477,29	1,70 %	71	0,73 %	74.507.244,57	Art 7º , VII, "a"	Alto
NTN-B20450515	D + 360	8.529.755,73	26,58 %	1	0,00 %	0,00	Art 7º , I, "a"	Alto
NTN-C 20310101	D + 192	11.153.628,26	34,75 %	1	0,00 %	0,00	Art 7º , I, "a"	Alto

TOTAL SALDO: R\$ 32.096.439,72

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: 04/2020



RISCO DE CRÉDITO

RENDA FIXA - ARTIGOS	LIMITE DA RESOLUÇÃO	LIMITE POLÍTICA	TOTAL	% CARTEIRA
Art 7º, I, "a"	100 %	100 %	19.683.383,99	61,33
Art 7º, I, "b"	100 %	100 %	5.683.344,94	17,71
Art 7º, IV "a"	40 %	40 %	6.184.233,50	19,27
Art 7º, VII, "a"	5 %	5 %	545.477,29	1,70
			32.096.439,72	

RISCO DE CRÉDITO	% CARTEIRA
100% Títulos Públicos e 0% Títulos Privados	88,67%
50% Títulos Públicos e 50% Títulos Privados	9,63%
0% Títulos Públicos e 100% Títulos Privados	1,70%

Relatório competência: 04/2020



CAPITAL PROTEGIDO

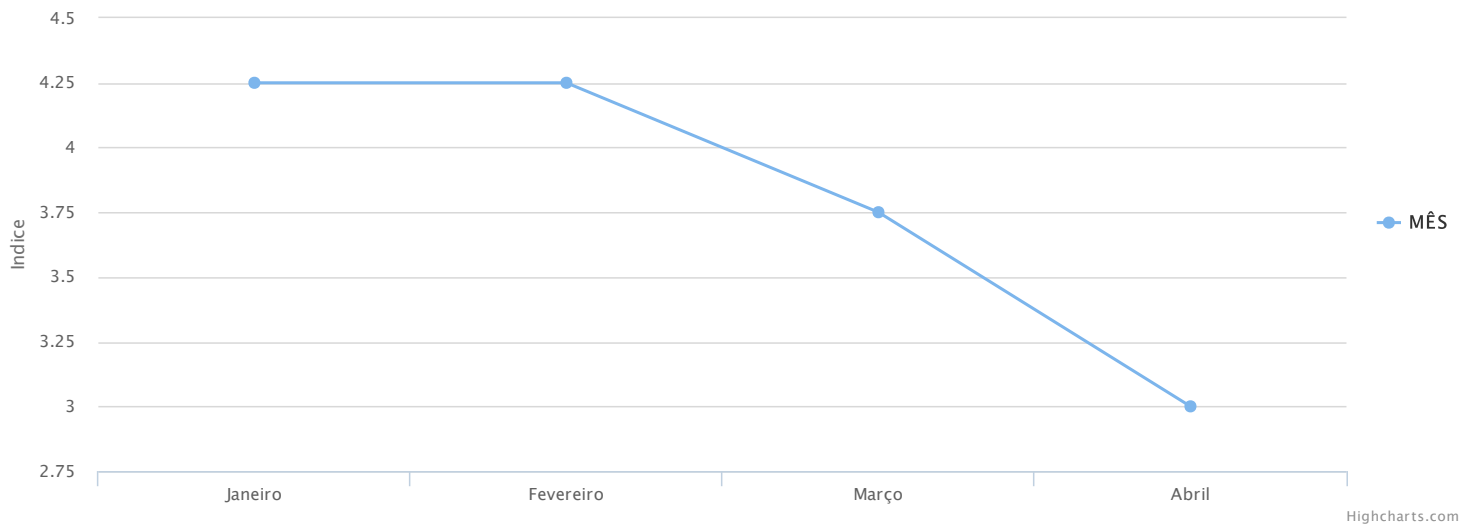
TIPO DE PRODUTO E PERCENTUAL DO CAPITAL INVESTIDO PROTEGIDO	
TIPO DE PRODUTO	PERCENTUAL DO CAPITAL
INVESTIDO PROTEGIDO	INVESTIDO PROTEGIDO (Até)
Títulos Públicos Federais/ Carteira Própria	100%
Fundos de Investimento Referenciado e Renda Fixa 100% Títulos Públicos Federais (previsto no regulamento do 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: 04/2020



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 04/2020: R\$ 1.629.307,00
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\$ 2,099902000	Quantidade de Cotas: 775.896,6847	PL do Fundo: R\$ 1.637.982.393,12
% do PL do Fundo: 0,10%	Limite Cumulativo: 5,08%	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 04/2020: R\$ 3.964,30
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\$ 2,670026506	Quantidade de Cotas: 1.484,7418	PL do Fundo: R\$ 6.681.370.754,80
% 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 04/2020: R\$ 736.408,17
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\$ 2,681038000	Quantidade de Cotas: 274.672,7835	PL do Fundo: R\$ 7.168.032.689,23
% do PL do Fundo: 0,01%	Limite Cumulativo: 2,29%	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 04/2020: R\$ 778.636,85
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\$ 2,266946000	Quantidade de Cotas: 343.473,9292	PL do Fundo: R\$ 2.594.654.169,89
% do PL do Fundo: 0,03%	Limite Cumulativo: 2,43%	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 04/2020: R\$ 4.927.845,77
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\$ 2,283497399	Quantidade de Cotas: 2.158.025,5673	PL do Fundo: R\$ 341.338.616,41
% do PL do Fundo: 1,44%	Limite Cumulativo: 15,35%	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 04/2020: 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 04/2020: R\$ 3.430.657,60
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\$ 1,865332000	Quantidade de Cotas: 1.839.167,2903	PL do Fundo: R\$ 577.158.987,32
% do PL do Fundo: 0,59%	Limite Cumulativo: 10,69%	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 04/2020: R\$ 15.126,70
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\$ 2,567326000	Quantidade de Cotas: 5.892,0059	PL do Fundo: R\$ 10.765.141.210,50
% 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 04/2020: R\$ 11.499,49
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\$ 3,680153000	Quantidade de Cotas: 3.124,7315	PL do Fundo: R\$ 4.876.604.207,95
% 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 04/2020: R\$ 334.132,56
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\$ 0,629996000	Quantidade de Cotas: 530.372,5103	PL do Fundo: R\$ 83.568.409,70
% 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 04/2020: 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 04/2020: 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\$ 280,421220000	Quantidade de Cotas: 0,0000	PL do Fundo: R\$ 304.195.788,23
% 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 04/2020: R\$ 545.477,29
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\$ 0,381666460	Quantidade de Cotas: 1.429.198,9136	PL do Fundo: R\$ 74.507.244,57
% do PL do Fundo: 0,73%	Limite Cumulativo: 1,70%	Limite do Fundo: 5%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: NTN-B
Fundo: NTN-B20450515	CNPJ: 66.998.014/0001-54	Saldo em 04/2020: R\$ 8.529.755,73
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\$ 7.480,635995000	Quantidade de Cotas: 1.140,2447	PL do Fundo: R\$ 0,00
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 26,58%	Limite do Fundo: 100%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: NTN-C
Fundo: NTN-C 20310101	CNPJ: 66.998.014/0001-54	Saldo em 04/2020: R\$ 11.153.628,26
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\$ 7.480,635995000	Quantidade de Cotas: 1.491,0000	PL do Fundo: R\$ 0,00
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 34,75%	Limite do Fundo: 100%

TOTAL: R\$ 32.096.439,72

Relatório competência: 04/2020



CARTEIRA SUGERIDA ESTRATEGIA PRÓXIMO MÊS - PERFIL CONSERVADOR

ÍNDICE	CARTEIRA ATUAL		MOVIMENTAÇÕES	CARTEIRA SUGERIDA	
	SALDO ATUAL	% CAPITAL	APLICAR / RESGATAR	SALDO FINAL	% CAPITAL
FIDC	545.477,29	4,39	-545.477,29	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	4.927.845,77	39,70	-4.927.845,77	0,00	0,00
IMA-B	334.132,56	2,69	-334.132,56	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	3.964,30	0,03	-3.964,30	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	751.534,87	6,05	-751.534,87	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	5.850.100,94	47,13	-5.850.100,94	0,00	0,00
ALOCAÇÃO ATIVA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
TOTAL:	12.413.055,73	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: 04/2020



ESTRATEGIA PRÓXIMO MÊS - PERFIL MODERADO

CARTEIRA ATUAL			MOVIMENTAÇÕES	CARTEIRA SUGERIDA	
ÍNDICE	SALDO ATUAL	% CAPITAL	APLICAR / RESGATAR	SALDO FINAL	% CAPITAL
FIDC	545.477,29	4,39	-545.477,29	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	4.927.845,77	39,70	-4.927.845,77	0,00	0,00
IMA-B	334.132,56	2,69	-334.132,56	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	3.964,30	0,03	-3.964,30	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	751.534,87	6,05	-751.534,87	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	5.850.100,94	47,13	-5.850.100,94	0,00	0,00
ALOCÇÃO ATIVA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
TOTAL:	12.413.055,73	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: 04/2020