

INSTITUTO DE PREVIDENCIA DO MUNICIPIO DE BARRETOS

Relatório Competência

06/2020

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 | 1.478.065,44 | 4,66 % | 742 | 0,08 % | 1.768.065.678,44 | Art 7º , IV "a" | Baixo | 1,00 % | Fundo de Investimento |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO | D + 0 | 4.092,66 | 0,01 % | 884 | 0,00 % | 6.212.458.601,64 | Art 7º , I, "b" | Baixo | 0,20 % | Fundo de Investimento |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | D + 0 | 2.967.684,87 | 9,35 % | 1262 | 0,04 % | 7.792.694.548,07 | 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 | 42.314,79 | 0,13 % | 608 | 0,00 % | 2.439.958.346,20 | Art 7º , IV "a" | Baixo | 0,20 % | Fundo de Investimento |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO | D + 0 | 4.981.503,36 | 15,70 % | 51 | 1,44 % | 345.055.333,30 | 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 | 751.074,50 | 2,37 % | 318 | 0,15 % | 517.750.287,34 | Art 7º , IV "a" | Baixo | 0,80 % | Fundo de Investimento |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | D + 0 | 15.225,52 | 0,05 % | 1364 | 0,00 % | 11.257.382.974,77 | Art 7º , I, "b" | Baixo | 0,20 % | Fundo de Investimento |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO | D + 0 | 11.565,25 | 0,04 % | 678 | 0,00 % | 5.172.945.706,81 | Art 7º , IV "a" | Baixo | 0,20 % | Fundo de Investimento |
| FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO | D + 730 | 335.814,90 | 1,06 % | 19 | 0,40 % | 83.775.984,75 | 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 % | 1019 | 0,00 % | 538.888.484,55 | Art 7º , IV "a" | Médio | 0,20 % | Fundo de Investimento |
| LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS | D + 1260 | 541.941,75 | 1,71 % | 71 | 0,73 % | 74.024.321,09 | Art 7º , VII, "a" | Alto | 1,50 % | Fundo de Investimento |
| NTN-B20450515 | D + 360 | 8.609.686,15 | 27,13 % | 1 | 0,00 % | 0,00 | Art 7º , I, "a" | Alto | 0,20 % | Fundo de Investimento |
| NTN-C 20310101 | D + 192 | 11.994.454,67 | 37,80 % | 1 | 0,00 % | 0,00 | Art 7º , I, "a" | Alto | 0,20 % | Fundo de Investimento |

TOTAL SALDO: R\$ 31.733.423,86

Relatório competência: 06/2020



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% | 20.604.140,82 | 64,93 % |
| FI 100 TÍTULOS TN - Art 7º, I, "b" | 100% ENQUADRADO | 15% ENQUADRADO | 20% ENQUADRADO | 100% | 7.968.506,41 | 25,11 % |
| FI RENDA FIXA GERAL - Art 7º, IV "a" | 40% ENQUADRADO | 15% ENQUADRADO | 20% ENQUADRADO | 40% | 2.618.834,88 | 8,25 % |
| FI EM DIREITOS CREDITÓRIOS / COTA SENIOR - Art 7º, VII, "a" | 5% ENQUADRADO | 5% ENQUADRADO | 20% ENQUADRADO | 5% | 541.941,75 | 1,71 % |
| Valor total Renda Fixa: R\$ 31.733.423,86 | | | | | | |

| 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 | 2.283.019,98 | 7,19 |
| FIDC | 541.941,75 | 1,71 |
| IDKA 2 | 4.092,66 | 0,01 |
| IMA-B | 335.814,90 | 1,06 |
| IPCA | 4.981.503,36 | 15,70 |
| IRF-M1 | 2.982.910,39 | 9,40 |
| NTN-B | 8.609.686,15 | 27,13 |
| NTN-C | 11.994.454,67 | 37,80 |
| | R\$ 31.733.423,86 | |

| DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA | TOTAL | % CARTEIRA |
|---|--------------------------|------------|
| CNPJ: | 20.604.140,82 | 64,93 |
| SAFRA SERVIÇOS DE ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA LTDA CNPJ: 06947853000111 | 0,00 | 0,00 |
| INTRADER DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA CNPJ: 15489568000195 | 335.814,90 | 1,06 |
| GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A CNPJ: 27652684000162 | 0,00 | 0,00 |
| BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A CNPJ: 30822936000169 | 9.473.661,12 | 29,85 |
| CAIXA ECONOMICA FEDERAL CNPJ: 360305000104 | 777.865,27 | 2,45 |
| ORLA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S/A CNPJ: 92904564000177 | 541.941,75 | 1,71 |
| | R\$ 31.733.423,86 | |



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\$ 1.560.158,33 | R\$ 19.664,80 | R\$ 103.713,14 | R\$ 1.478.065,44 | R\$ 1.955,45 | 0,12916 % | 0,13247 % |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO | R\$ 4.043,61 | R\$ 0,00 | R\$ 0,00 | R\$ 4.092,66 | R\$ 49,05 | 1,21301 % | 1,21301 % |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | R\$ 4.342.645,24 | R\$ 156.573,34 | R\$ 1.541.413,99 | R\$ 2.967.684,87 | R\$ 9.880,28 | 0,25672 % | 0,25672 % |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI | R\$ 186.203,92 | R\$ 0,00 | R\$ 144.029,65 | R\$ 42.314,79 | R\$ 140,52 | 0,26007 % | 0,26007 % |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO | R\$ 4.925.188,68 | R\$ 0,00 | R\$ 0,00 | R\$ 4.981.503,36 | R\$ 56.314,68 | 1,14340 % | 1,14340 % |
| 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\$ 378.083,81 | R\$ 855.887,98 | R\$ 483.484,87 | R\$ 751.074,50 | R\$ 587,58 | 0,14455 % | 0,14455 % |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | R\$ 15.186,15 | R\$ 0,00 | R\$ 0,00 | R\$ 15.225,52 | R\$ 39,37 | 0,25921 % | 0,25921 % |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO | R\$ 11.537,24 | R\$ 0,00 | R\$ 0,00 | R\$ 11.565,25 | R\$ 28,01 | 0,24275 % | 0,24275 % |
| FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO | R\$ 334.737,71 | R\$ 0,00 | R\$ 0,00 | R\$ 335.814,90 | R\$ 1.077,19 | 0,32180 % | 0,32180 % |
| 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 | 0,24172 % | 0,24172 % |
| LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS | R\$ 543.109,02 | R\$ 0,00 | R\$ 0,00 | R\$ 541.941,75 | R\$ -1.167,27 | -0,21492 % | -0,21492 % |
| NTN-B20450515 | R\$ 8.376.310,56 | R\$ 0,00 | R\$ 0,00 | R\$ 8.609.686,15 | R\$ 233.375,59 | 2,78614 % | 2,78614 % |
| NTN-C 20310101 | R\$ 11.502.549,81 | R\$ 0,00 | R\$ 0,00 | R\$ 11.994.454,67 | R\$ 491.904,86 | 4,27649 % | 4,27649 % |
| TOTAIS | R\$ 32.179.754,08 | R\$ 1.032.126,12 | R\$ 2.272.641,65 | R\$ 31.733.423,86 | R\$ 794.185,31 | 2,5859 % | 2,5859 % |



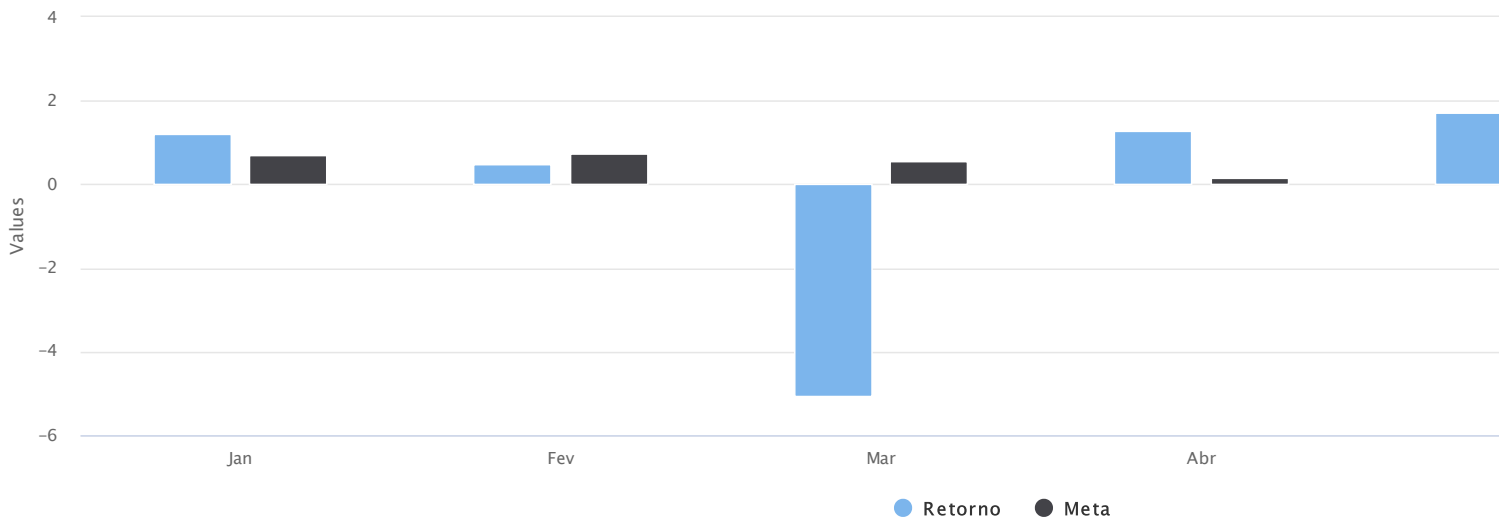
RETORNOS ACUMULADO

| 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 % |
| MAIO | R\$ 32.096.439,72 | R\$ 4.443.679,51 | R\$ 4.891.795,48 | R\$ 32.179.754,08 | R\$ 531.430,33 | 1,6993 % | 0,10 % | 1.764,60 % |
| JUNHO | R\$ 32.179.754,08 | R\$ 1.032.126,12 | R\$ 2.272.641,65 | R\$ 31.733.423,86 | R\$ 794.185,31 | 2,5859 % | 0,74 % | 349,78 % |
| TOTAIS | | R\$ 10.171.236,79 | R\$ 14.031.770,39 | | R\$ 521.666,26 | 2,02 | 3,00 | 67,09 |

Relatório competência: 06/2020



Gráfico – Retorno acumulado no ano

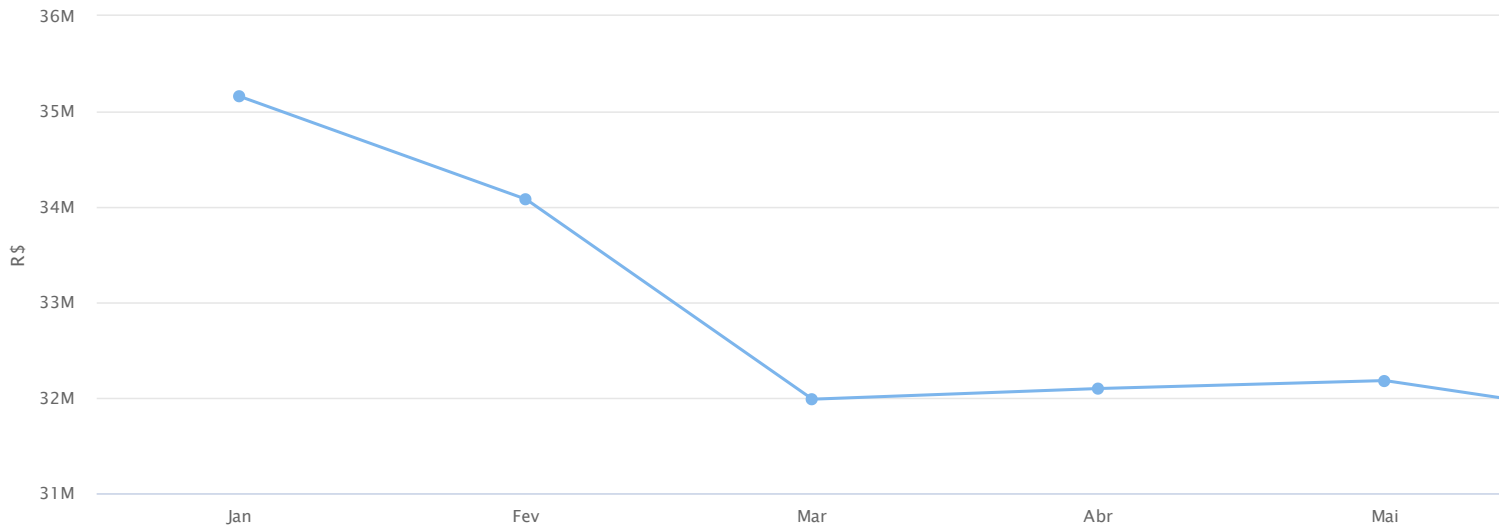




EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO X RENTABILIDADE MONETÁRIA

| 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 | 32.179.754,08 | 31.733.423,86 | 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 | 531.430,33 | 794.185,31 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |

REFERENTE AO SALDO (R\$)



Relatório competência: 06/2020



REFERENTE AO RETORNO (R\$)



Relatório competência: 06/2020



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: 06/2020



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 | 1.478.065,44 | 0,62 % | 0,29 % | 9.164,01 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO | 13.322.205/0001-35 | IDKA 2 | 4.092,66 | 6,33 % | 2,91 % | 259,07 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | 11.328.882/0001-35 | IRF-M1 | 2.967.684,87 | 0,94 % | 0,43 % | 27.896,24 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI | 13.077.418/0001-49 | CDI | 42.314,79 | 1,20 % | 0,55 % | 507,78 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO | 15.486.093/0001-83 | IPCA | 4.981.503,36 | 9,59 % | 4,41 % | 477.726,17 |
| 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 | 751.074,50 | 0,64 % | 0,29 % | 4.806,88 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | 10.740.670/0001-06 | IRF-M1 | 15.225,52 | 0,93 % | 0,43 % | 141,60 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO | 03.737.206/0001-97 | CDI | 11.565,25 | 0,91 % | 0,42 % | 105,24 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO | 11.902.276/0001-81 | IMA-B | 335.814,90 | 87,59 % | 40,25 % | 294.140,27 |
| 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 | 541.941,75 | 3,25 % | 32,51 % | 17.613,11 |
| NTN-B20450515 | 66.998.014/0001-54 | NTN-B | 8.609.686,15 | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 |
| NTN-C 20310101 | 66.998.014/0001-54 | NTN-C | 11.994.454,67 | 0,00 % | 0,00 % | 0,00 |

| RISCO DE MERCADO | |
|---|-------------------|
| Saldo Total: | R\$ 31.733.423,86 |
| Provisão para perda e Investimentos: | R\$ 832.360,35 |
| % Provisão de Perda: | 2,623% |

Relatório competência: 06/2020



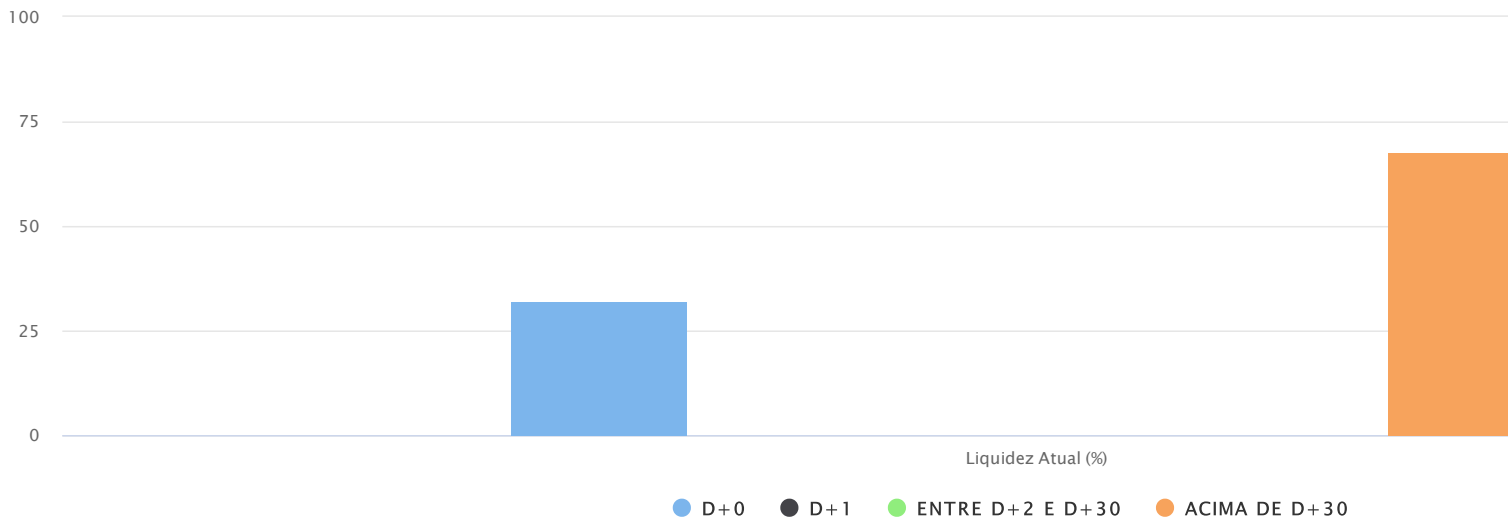
RISCO DE LIQUIDEZ

| 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 | 1.478.065,44 | 4,66 % | 742 | 0,08 % | 1.768.065.678,44 | Art 7º , IV "a" | Baixo |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO | D + 0 | 4.092,66 | 0,01 % | 884 | 0,00 % | 6.212.458.601,64 | Art 7º , I, "b" | Baixo |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | D + 0 | 2.967.684,87 | 9,35 % | 1262 | 0,04 % | 7.792.694.548,07 | Art 7º , I, "b" | Baixo |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI | D + 0 | 42.314,79 | 0,13 % | 608 | 0,00 % | 2.439.958.346,20 | Art 7º , IV "a" | Baixo |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO | D + 0 | 4.981.503,36 | 15,70 % | 51 | 1,44 % | 345.055.333,30 | 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 | 751.074,50 | 2,37 % | 318 | 0,15 % | 517.750.287,34 | Art 7º , IV "a" | Baixo |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | D + 0 | 15.225,52 | 0,05 % | 1364 | 0,00 % | 11.257.382.974,77 | Art 7º , I, "b" | Baixo |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO | D + 0 | 11.565,25 | 0,04 % | 678 | 0,00 % | 5.172.945.706,81 | Art 7º , IV "a" | Baixo |
| FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO | D + 730 | 335.814,90 | 1,06 % | 19 | 0,40 % | 83.775.984,75 | 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 % | 1019 | 0,00 % | 538.888.484,55 | Art 7º , IV "a" | Médio |
| LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS | D + 1260 | 541.941,75 | 1,71 % | 71 | 0,73 % | 74.024.321,09 | Art 7º , VII, "a" | Alto |
| NTN-B20450515 | D + 360 | 8.609.686,15 | 27,13 % | 1 | 0,00 % | 0,00 | Art 7º , I, "a" | Alto |
| NTN-C 20310101 | D + 192 | 11.994.454,67 | 37,80 % | 1 | 0,00 % | 0,00 | Art 7º , I, "a" | Alto |

TOTAL SALDO: R\$ 31.733.423,86

| PRAZO DE RESGATE | QUANTIDADE DE FUNDOS | LIQUIDEZ ATUAL |
|------------------|----------------------|----------------|
| D+0 | 9 | 32% |
| D+1 | 1 | 0% |
| ENTRE D+2 E D+30 | 1 | 0% |
| ACIMA DE D+30 | 4 | 68% |

Gráfico



Relatório competência: 06/2020



RISCO DE CRÉDITO

| RENDA FIXA - ARTIGOS | LIMITE DA RESOLUÇÃO | LIMITE POLÍTICA | TOTAL | % CARTEIRA |
|----------------------|---------------------|-----------------|---------------|------------|
| Art 7º, I, "a" | 100 % | 100 % | 20.604.140,82 | 64,93 |
| Art 7º, I, "b" | 100 % | 100 % | 7.968.506,41 | 25,11 |
| Art 7º, IV "a" | 40 % | 40 % | 2.618.834,88 | 8,25 |
| Art 7º, VII, "a" | 5 % | 5 % | 541.941,75 | 1,71 |
| | | | 31.733.423,86 | |

| RISCO DE CRÉDITO | % CARTEIRA |
|---|------------|
| 100% Títulos Públicos e 0% Títulos Privados | 94,17% |
| 50% Títulos Públicos e 50% Títulos Privados | 4,13% |
| 0% Títulos Públicos e 100% Títulos Privados | 1,71% |

Relatório competência: 06/2020



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% |

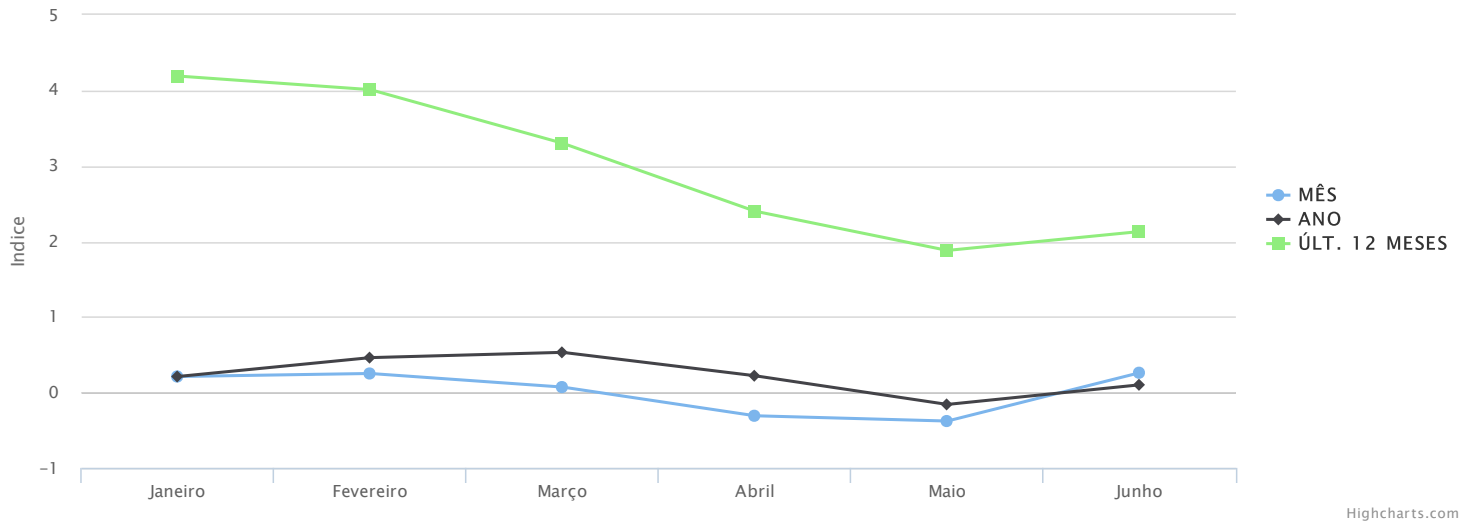
PERCENTUAL MÍNIMO DE ALOCAÇÃO DA CARTEIRA TOTAL DO RPPS EM PRODUTOS COM CAPITAL INVESTIDO PROTEGIDO: 80% do Patrimônio Líquido do RPPS, apurado concomitantemente na data de fechamento dos dados para envio do DAIR ao Ministério da Previdência Social - MPS.

Relatório competência: 06/2020



ÍNDICES ECONÔMICOS

IPCA
2020

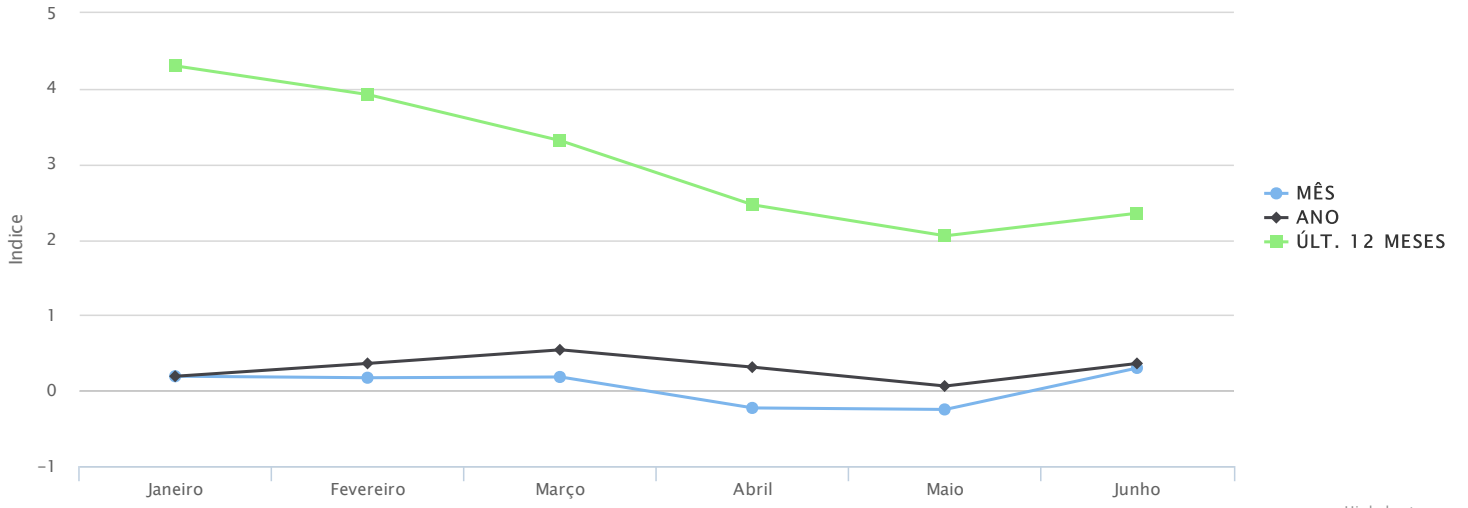


Highcharts.com

| 2020 | Janeiro | Fevereiro | Março | Abril | Mai | Junho | Julho | Agosto | Setembro | Outubro | Novembro | Dezembro |
|-----------|---------|-----------|--------|---------|---------|--------|-------|--------|----------|---------|----------|----------|
| MÊS | 0.2100 | 0.2500 | 0.0700 | -0.3100 | -0.3800 | 0.2600 | | | | | | |
| ANO | 0.2100 | 0.4600 | 0.5300 | 0.2200 | -0.1600 | 0.1000 | | | | | | |
| ULT. 12 M | 4.1900 | 4.0100 | 3.3000 | 2.4000 | 1.8800 | 2.1300 | | | | | | |



INPC 2020

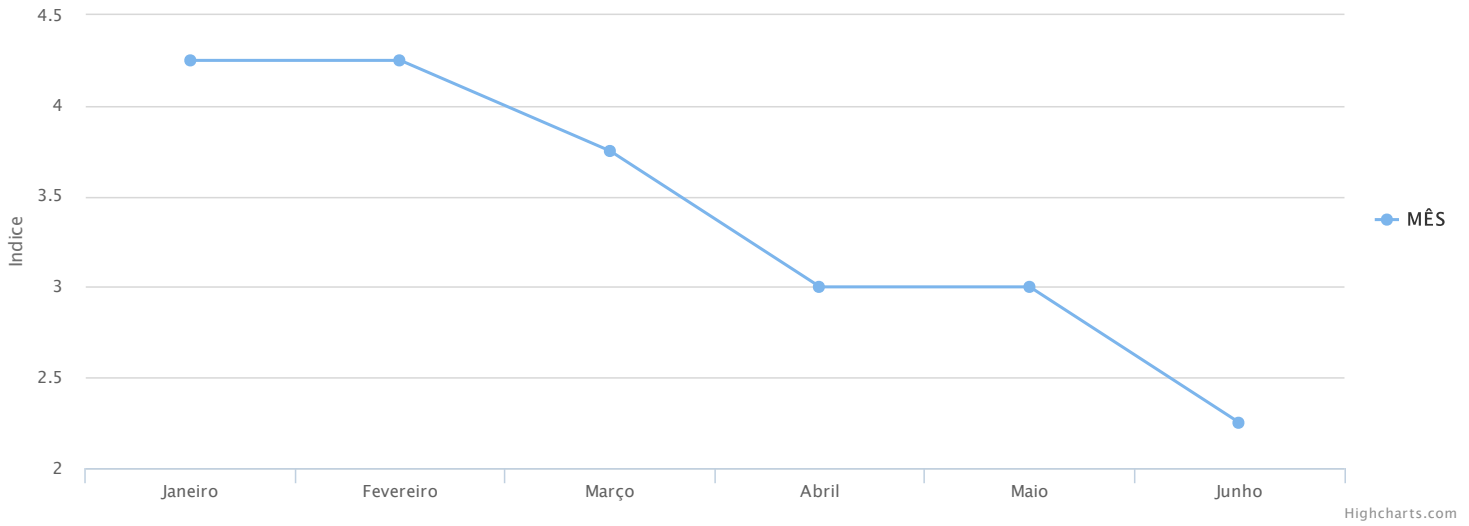


Highcharts.com

| 2020 | Janeiro | Fevereiro | Março | Abril | Maio | Junho | Julho | Agosto | Setembro | Outubro | Novembro | Dezembro |
|-----------|---------|-----------|--------|---------|---------|--------|-------|--------|----------|---------|----------|----------|
| MÊS | 0.1900 | 0.1700 | 0.1800 | -0.2300 | -0.2500 | 0.3000 | | | | | | |
| ANO | 0.1900 | 0.3600 | 0.5400 | 0.3100 | 0.0600 | 0.3600 | | | | | | |
| ULT. 12 M | 4.3000 | 3.9200 | 3.3100 | 2.4600 | 2.0500 | 2.3500 | | | | | | |



SELIC 2020



Highcharts.com

| Janeiro | Fevereiro | Março | Abril | Maio | Junho | Julho | Agosto | Setembro | Outubro | Novembro | Dezembro |
|---------|-----------|-------|-------|------|-------|-------|--------|----------|---------|----------|----------|
| 4.25 | 4.25 | 3.75 | 3.00 | 3.00 | 2.25 | | | | | | |



CADPREV

| | | |
|---|-------------------------------------|------------------------------------|
| Renda Fixa | Tipo: Fundo de Investimento | Benchmark: CDI |
| Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | CNPJ: 13.077.415/0001-05 | Saldo em 06/2020: R\$ 1.478.065,44 |
| 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\$ 2,105926537 | Quantidade de Cotas: 701.859,9244 | PL do Fundo: R\$ 1.768.065.678,44 |
| % do PL do Fundo: 0,08% | Limite Cumulativo: 4,66% | Limite do Fundo: 40% |
| Renda Fixa | Tipo: Fundo de Investimento | Benchmark: IDKA 2 |
| Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO | CNPJ: 13.322.205/0001-35 | Saldo em 06/2020: R\$ 4.092,66 |
| 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\$ 2,756478820 | Quantidade de Cotas: 1.484,7420 | PL do Fundo: R\$ 6.212.458.601,64 |
| % do PL do Fundo: 0,00% | Limite Cumulativo: 0,01% | Limite do Fundo: 100% |
| Renda Fixa | Tipo: Fundo de Investimento | Benchmark: IRF-M1 |
| Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | CNPJ: 11.328.882/0001-35 | Saldo em 06/2020: R\$ 2.967.684,87 |
| 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\$ 2,698369569 | Quantidade de Cotas: 1.099.806,6774 | PL do Fundo: R\$ 7.792.694.548,07 |
| % do PL do Fundo: 0,04% | Limite Cumulativo: 9,35% | Limite do Fundo: 100% |
| Renda Fixa | Tipo: Fundo de Investimento | Benchmark: 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 06/2020: R\$ 42.314,79 |
| 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\$ 2,278654661 | Quantidade de Cotas: 18.570,0759 | PL do Fundo: R\$ 2.439.958.346,20 |
| % do PL do Fundo: 0,00% | Limite Cumulativo: 0,13% | Limite do Fundo: 40% |
| Renda Fixa | Tipo: Fundo de Investimento | Benchmark: IPCA |
| Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO | CNPJ: 15.486.093/0001-83 | Saldo em 06/2020: R\$ 4.981.503,36 |
| 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\$ 2,367379823 | Quantidade de Cotas: 2.104.226,5004 | PL do Fundo: R\$ 345.055.333,30 |
| % do PL do Fundo: 1,44% | Limite Cumulativo: 15,70% | Limite do Fundo: 100% |
| Renda Fixa | Tipo: Fundo de Investimento | Benchmark: IMA-B |
| Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 V TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | CNPJ: 21.922.168/0001-24 | Saldo em 06/2020: 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: Fundo de Investimento | Benchmark: CDI |
| Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA | CNPJ: 14.508.643/0001-55 | Saldo em 06/2020: R\$ 751.074,50 |
| 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\$ 1,871236000 | Quantidade de Cotas: 401.378,8213 | PL do Fundo: R\$ 517.750.287,34 |
| % do PL do Fundo: 0,15% | Limite Cumulativo: 2,37% | Limite do Fundo: 40% |
| Renda Fixa | Tipo: Fundo de Investimento | Benchmark: IRF-M1 |
| Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | CNPJ: 10.740.670/0001-06 | Saldo em 06/2020: R\$ 15.225,52 |
| 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\$ 2,584097000 | Quantidade de Cotas: 5.892,0079 | PL do Fundo: R\$ 11.257.382.974,77 |
| % do PL do Fundo: 0,00% | Limite Cumulativo: 0,05% | Limite do Fundo: 100% |
| Renda Fixa | Tipo: Fundo de Investimento | Benchmark: CDI |
| Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO | CNPJ: 37.372.060/0019-7 | Saldo em 06/2020: R\$ 11.565,25 |
| 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\$ 3,701199000 | Quantidade de Cotas: 3.124,7307 | PL do Fundo: R\$ 5.172.945.706,81 |
| % do PL do Fundo: 0,00% | Limite Cumulativo: 0,04% | Limite do Fundo: 40% |
| Renda Fixa | Tipo: Fundo de Investimento | Benchmark: IMA-B |
| Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO | CNPJ: 11.902.276/0001-81 | Saldo em 06/2020: R\$ 335.814,90 |
| 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\$ 0,633168000 | Quantidade de Cotas: 530.372,5078 | PL do Fundo: R\$ 83.775.984,75 |
| % do PL do Fundo: 0,40% | Limite Cumulativo: 1,06% | Limite do Fundo: 40% |

| | | |
|---|-----------------------------|----------------------------|
| Renda Variável | Tipo: Fundo de Investimento | Benchmark: AÇÕES |
| Fundo: GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES | CNPJ: 11.898.349/0001-09 | Saldo em 06/2020: 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: Fundo de Investimento | Benchmark: IRF-M1 |
| Fundo: SAFRA EXECUTIVE 2 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA | CNPJ: 10.787.647/0001-69 | Saldo em 06/2020: 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\$ 282,257402000 | Quantidade de Cotas: 0,0000 | PL do Fundo: R\$ 538.888.484,55 |
| % do PL do Fundo: 0,00% | Limite Cumulativo: 0,00% | Limite do Fundo: 40% |

| | | |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|
| Renda Fixa | Tipo: Fundo de Investimento | Benchmark: FIDC |
| Fundo: LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS | CNPJ: 12.440.789/0001-80 | Saldo em 06/2020: R\$ 541.941,75 |
| 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\$ 0,379192670 | Quantidade de Cotas: 1.429.198,9083 | PL do Fundo: R\$ 74.024.321,09 |
| % do PL do Fundo: 0,73% | Limite Cumulativo: 1,71% | Limite do Fundo: 5% |

| | | |
|--|---------------------------------|------------------------------------|
| Renda Fixa | Tipo: Fundo de Investimento | Benchmark: NTN-B |
| Fundo: NTN-B20450515 | CNPJ: 66.998.014/0001-54 | Saldo em 06/2020: R\$ 8.609.686,15 |
| 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\$ 4.220,434391000 | Quantidade de Cotas: 2.040,0000 | PL do Fundo: R\$ 0,00 |
| % do PL do Fundo: 0,00% | Limite Cumulativo: 27,13% | Limite do Fundo: 100% |

| | | |
|--|---------------------------------|-------------------------------------|
| Renda Fixa | Tipo: Fundo de Investimento | Benchmark: NTN-C |
| Fundo: NTN-C 20310101 | CNPJ: 66.998.014/0001-54 | Saldo em 06/2020: R\$ 11.994.454,67 |
| 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\$ 4.220,434391000 | Quantidade de Cotas: 2.841,9953 | PL do Fundo: R\$ 0,00 |
| % do PL do Fundo: 0,00% | Limite Cumulativo: 37,80% | Limite do Fundo: 100% |

TOTAL: R\$ 31.733.423,86

Relatório competência: 06/2020



CARTEIRA SUGERIDA ESTRATEGIA PRÓXIMO MÊS - PERFIL CONSERVADOR

| INDICE | CARTEIRA ATUAL | | MOVIMENTAÇÕES | CARTEIRA SUGERIDA | |
|----------------|----------------|-----------|--------------------|-------------------|-----------|
| | SALDO ATUAL | % CAPITAL | APLICAR / RESGATAR | SALDO FINAL | % CAPITAL |
| FIDC | 541.941,75 | 4,87 | 54,33 | 541.996,08 | 4,87 |
| 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 | 4.981.503,36 | 44,76 | -36,27 | 4.981.467,09 | 44,76 |
| IMA-B | 335.814,90 | 3,02 | 777.113,40 | 1.112.928,30 | 10,00 |
| IMA-B 5 | 0,00 | 0,00 | 556.464,15 | 556.464,15 | 5,00 |
| IMA-B 5+ | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| IDKA 2 | 4.092,66 | 0,04 | 1.108.835,64 | 1.112.928,30 | 10,00 |
| IDKA 20 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| | | | | | |
| IRF-M | 0,00 | 0,00 | 1.224.221,13 | 1.224.221,13 | 11,00 |
| IRF-M1 | 2.982.910,39 | 26,80 | -1.869.982,09 | 1.112.928,30 | 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 | 2.283.019,98 | 20,51 | -1.796.670,31 | 486.349,67 | 4,37 |
| ALOCAÇÃO ATIVA | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| | | | | | |
| TOTAL: | 11.129.283,04 | 100,00 | | 11.129.283,04 | 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: 06/2020



ESTRATEGIA PRÓXIMO MÊS - PERFIL MODERADO

| CARTEIRA ATUAL | | | MOVIMENTAÇÕES | CARTEIRA SUGERIDA | |
|----------------|---------------|-----------|--------------------|-------------------|-----------|
| INDICE | SALDO ATUAL | % CAPITAL | APLICAR / RESGATAR | SALDO FINAL | % CAPITAL |
| FIDC | 541.941,75 | 4,87 | 54,33 | 541.996,08 | 4,87 |
| 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 | 4.981.503,36 | 44,76 | -36,27 | 4.981.467,09 | 44,76 |
| IMA-B | 335.814,90 | 3,02 | 777.113,40 | 1.112.928,30 | 10,00 |
| IMA-B 5 | 0,00 | 0,00 | 556.464,15 | 556.464,15 | 5,00 |
| IMA-B 5+ | 0,00 | 0,00 | 556.464,15 | 556.464,15 | 5,00 |
| IDKA 2 | 4.092,66 | 0,04 | 552.371,49 | 556.464,15 | 5,00 |
| IDKA 20 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| IRF-M | 0,00 | 0,00 | 1.224.221,13 | 1.224.221,13 | 11,00 |
| IRF-M1 | 2.982.910,39 | 26,80 | -1.869.982,09 | 1.112.928,30 | 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 | 2.283.019,98 | 20,51 | -1.796.670,31 | 486.349,67 | 4,37 |
| ALOCÇÃO ATIVA | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| TOTAL: | 11.129.283,04 | 100,00 | | 11.129.283,04 | 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: 06/2020