

INSTITUTO DE PREVIDENCIA DO MUNICIPIO DE BARRETOS

Relatório Competência

07/2020

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	1.385.615,20	4,26 %	751	0,08 %	1.725.378.039,09	Art 7º , IV "a"	Baixo	1,00 %	Fundo de Investimento
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 0	24.188,81	0,07 %	885	0,00 %	6.099.396.938,17	Art 7º , I, "b"	Baixo	0,20 %	Fundo de Investimento
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D + 0	3.142.239,92	9,65 %	1251	0,04 %	7.835.713.656,67	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	42.414,68	0,13 %	600	0,00 %	2.412.408.451,26	Art 7º , IV "a"	Baixo	0,20 %	Fundo de Investimento
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 0	5.037.279,91	15,47 %	51	1,44 %	348.918.824,86	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	512.821,18	1,58 %	319	0,10 %	506.083.614,11	Art 7º , IV "a"	Baixo	0,80 %	Fundo de Investimento
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	15.262,22	0,05 %	1366	0,00 %	10.907.406.871,77	Art 7º , I, "b"	Baixo	0,20 %	Fundo de Investimento
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	D + 0	11.593,99	0,04 %	707	0,00 %	4.665.137.027,34	Art 7º , IV "a"	Baixo	0,20 %	Fundo de Investimento
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 730	317.537,73	0,98 %	19	0,39 %	80.825.315,71	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 %	1487	0,00 %	641.515.876,63	Art 7º , IV "a"	Médio	0,20 %	Fundo de Investimento
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	D + 1260	539.698,71	1,66 %	71	0,73 %	73.717.943,19	Art 7º , VII, "a"	Alto	1,50 %	Fundo de Investimento
NTN-B20450515	D + 360	9.310.525,73	28,60 %	1	0,00 %	0,00	Art 7º , I, "a"	Alto	0,20 %	Fundo de Investimento
NTN-C 20310101	D + 192	12.218.571,32	37,53 %	1	0,00 %	0,00	Art 7º , I, "a"	Alto	0,20 %	Fundo de Investimento

TOTAL SALDO: R\$ 32.557.749,40

Relatório competência: 07/2020



ENQUADRAMENTO

RENDA FIXA - ARTIGOS	LIMITE DA RESOLUÇÃO	LIMITE PL FUNDO	LIMITE POR PARTICIPAÇÃO	LIMITE POLÍTICA	TOTAL	% CARTEIRA
TÍTULOS PÚBLICOS DE EMISSÃO DO TN (SELIC) - Art 7º, I, "a"	100% ENQUADRADO	100% ENQUADRADO	20% DESENQUADRADO	100%	21.529.097,05	66,13 %
FI 100 TÍTULOS TN - Art 7º, I, "b"	100% ENQUADRADO	15% ENQUADRADO	20% ENQUADRADO	100%	8.218.970,86	25,24 %
FI RENDA FIXA GERAL - Art 7º, IV "a"	40% ENQUADRADO	15% ENQUADRADO	20% ENQUADRADO	40%	2.269.982,78	6,97 %
FI EM DIREITOS CREDITÓRIOS / COTA SENIOR - Art 7º, VII, "a"	5% ENQUADRADO	5% ENQUADRADO	20% ENQUADRADO	5%	539.698,71	1,66 %
Valor total Renda Fixa: R\$ 32.557.749,40						

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	1.952.445,05	6,00
FIDC	539.698,71	1,66
IDKA 2	24.188,81	0,07
IMA-B	317.537,73	0,98
IPCA	5.037.279,91	15,47
IRF-M1	3.157.502,14	9,70
NTN-B	9.310.525,73	28,60
NTN-C	12.218.571,32	37,53
	R\$ 32.557.749,40	

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	TOTAL	% CARTEIRA
CNPJ: 21.529.097,05	21.529.097,05	66,13
SAFRA SERVIÇOS DE ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA LTDA CNPJ: 06947853000111	0,00	0,00
INTRADER DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA CNPJ: 15489568000195	317.537,73	0,98
GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A CNPJ: 27652684000162	0,00	0,00
BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A CNPJ: 30822936000169	9.631.738,52	29,58
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CNPJ: 360305000104	539.677,39	1,66
ORLA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S/A CNPJ: 92904564000177	539.698,71	1,66
	R\$ 32.557.749,40	



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\$ 1.478.065,44	R\$ 23.497,87	R\$ 117.393,64	R\$ 1.385.615,20	R\$ 1.445,53	0,10195 %	0,10195 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 4.092,66	R\$ 20.015,82	R\$ 0,00	R\$ 24.188,81	R\$ 80,33	0,80665 %	0,80665 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 2.967.684,87	R\$ 177.268,81	R\$ 10.000,00	R\$ 3.142.239,92	R\$ 7.286,24	0,23292 %	0,23292 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	R\$ 42.314,79	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 42.414,68	R\$ 99,89	0,23605 %	0,23605 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 4.981.503,36	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 5.037.279,91	R\$ 55.776,55	1,11967 %	1,11967 %
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\$ 751.074,50	R\$ 1.035.889,65	R\$ 1.275.183,15	R\$ 512.821,18	R\$ 1.040,18	0,11639 %	0,11639 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	R\$ 15.225,52	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 15.262,22	R\$ 36,70	0,24105 %	0,24105 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	R\$ 11.565,25	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 11.593,99	R\$ 28,74	0,24846 %	0,24846 %
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 335.814,90	R\$ 0,00	R\$ 20.015,82	R\$ 317.537,73	R\$ 1.738,65	0,51774 %	0,51774 %
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	0,25010 %	0,25010 %
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	R\$ 541.941,75	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 539.698,71	R\$ -2.243,04	-0,41389 %	-0,41389 %
NTN-B20450515	R\$ 8.609.686,15	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 9.310.525,73	R\$ 700.839,58	8,14013 %	8,14013 %
NTN-C 20310101	R\$ 11.994.454,67	R\$ 0,00	R\$ 374.882,27	R\$ 12.218.571,32	R\$ 598.998,92	4,99397 %	4,99397 %
TOTAIS	R\$ 31.733.423,86	R\$ 1.256.672,15	R\$ 1.797.474,88	R\$ 32.557.749,40	R\$ 1.365.128,27	4,4032 %	4,4032 %



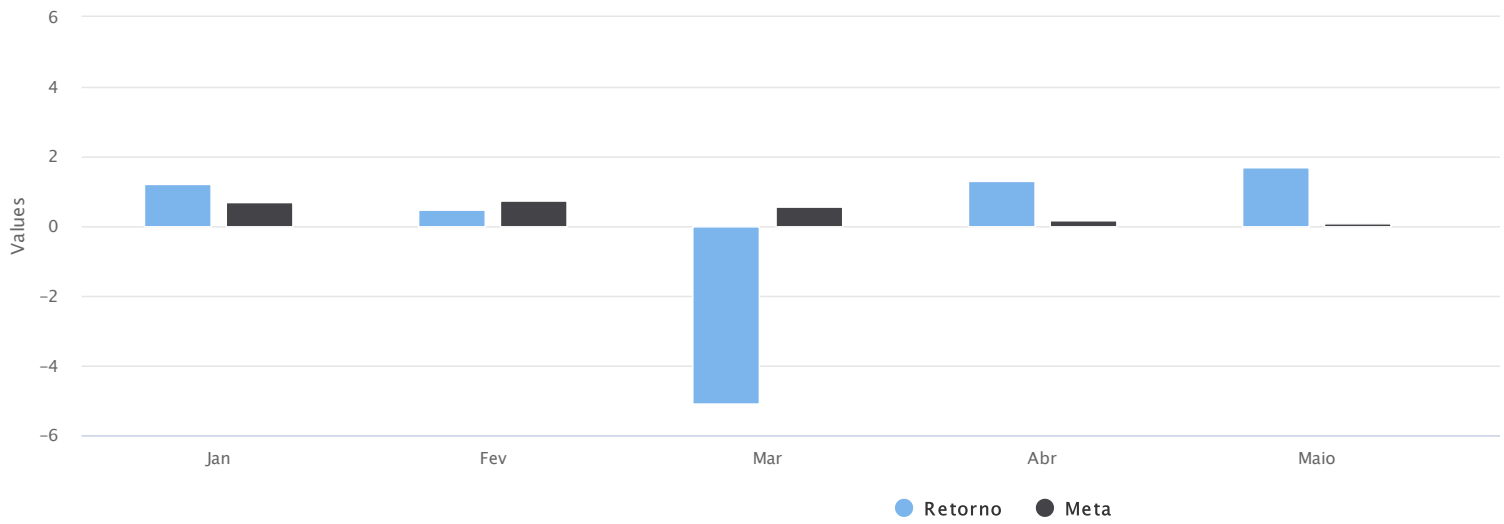
RETORNOS ACUMULADO

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 %
JULHO	R\$ 31.733.423,86	R\$ 1.256.672,15	R\$ 1.797.474,88	R\$ 32.557.749,40	R\$ 1.365.128,27	4,4032 %	0,84 %	524,32 %
TOTAIS		R\$ 11.427.908,94	R\$ 15.829.245,27		R\$ 1.886.794,53	6,51	3,87	168,19

Relatório competência: 07/2020



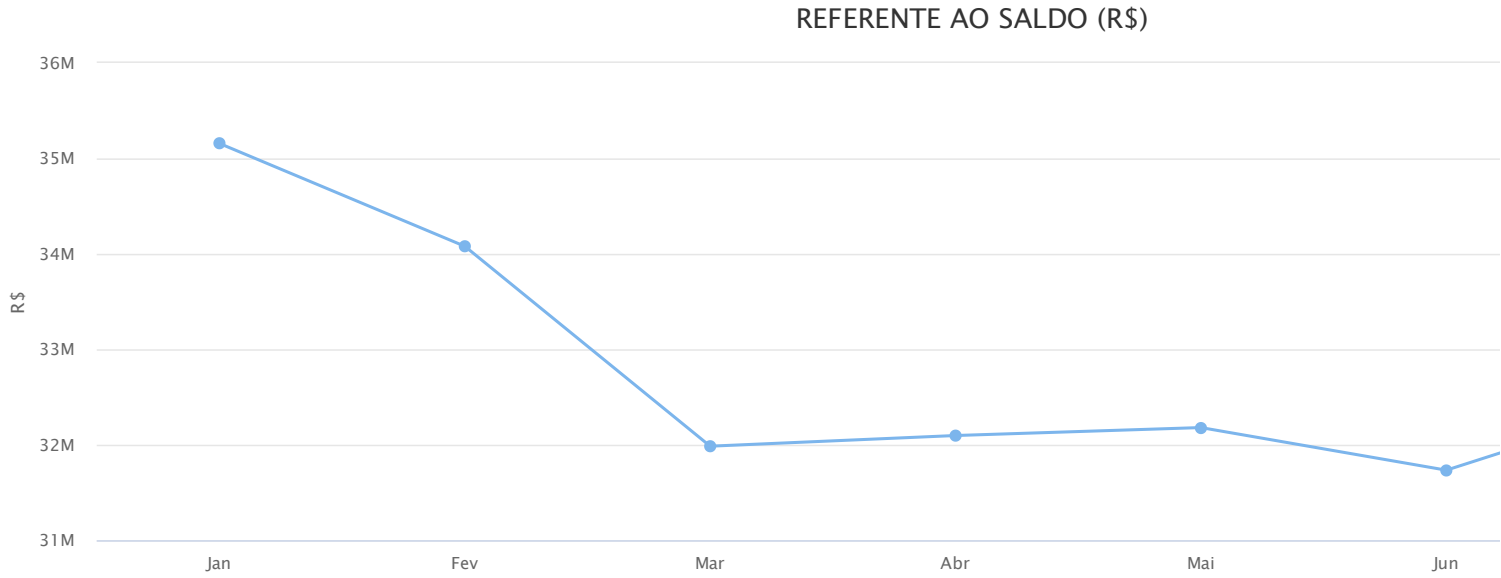
Gráfico – Retorno acumulado no ano





EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO X RENTABILIDADE MONETÁRIA

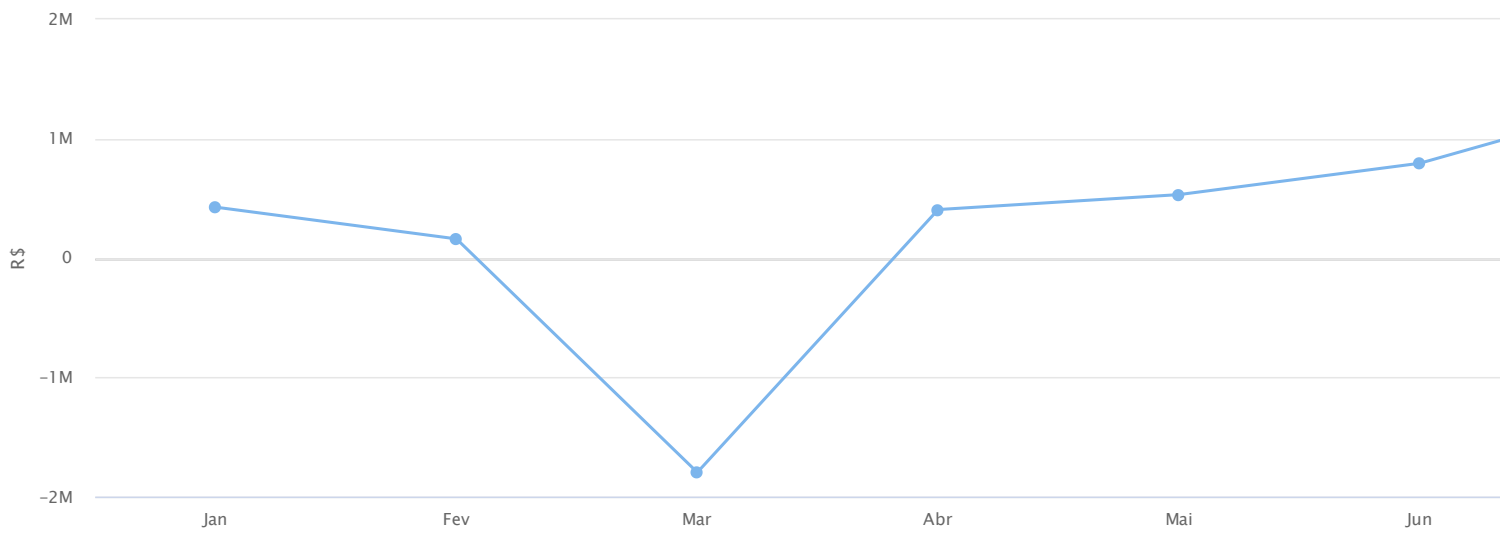
MESES	JANEIRO	FEVEREIRO	MARÇO	ABRIL	MAIO	JUNHO	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO
SALDO (R\$)	35.156.685,99	34.079.288,51	31.984.630,58	32.096.439,72	32.179.754,08	31.733.423,86	32.557.749,40	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
RETORNO (R\$)	426.325,55	160.293,30	-1.796.653,28	406.085,05	531.430,33	794.185,31	1.365.128,27	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00



Relatório competência: 07/2020



REFERENTE AO RETORNO (R\$)



Relatório competência: 07/2020



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: 07/2020



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	1.385.615,20	0,62 %	0,29 %	8.590,81
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	13.322.205/0001-35	IDKA 2	24.188,81	6,33 %	2,91 %	1.531,15
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	11.328.882/0001-35	IRF-M1	3.142.239,92	0,94 %	0,43 %	29.537,06
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	13.077.418/0001-49	CDI	42.414,68	1,20 %	0,55 %	508,98
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	15.486.093/0001-83	IPCA	5.037.279,91	9,59 %	4,41 %	483.075,14
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	512.821,18	0,64 %	0,29 %	3.282,06
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	IRF-M1	15.262,22	0,93 %	0,43 %	141,94
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	CDI	11.593,99	0,91 %	0,42 %	105,51
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	11.902.276/0001-81	IMA-B	317.537,73	87,59 %	40,25 %	278.131,30
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	539.698,71	3,25 %	32,51 %	17.540,21
NTN-B20450515	66.998.014/0001-54	NTN-B	9.310.525,73	0,00 %	0,00 %	0,00
NTN-C 20310101	66.998.014/0001-54	NTN-C	12.218.571,32	0,00 %	0,00 %	0,00

RISCO DE MERCADO	
Saldo Total:	R\$ 32.557.749,40
Provisão para perda e Investimentos:	R\$ 822.444,15
% Provisão de Perda:	2,526%

Relatório competência: 07/2020



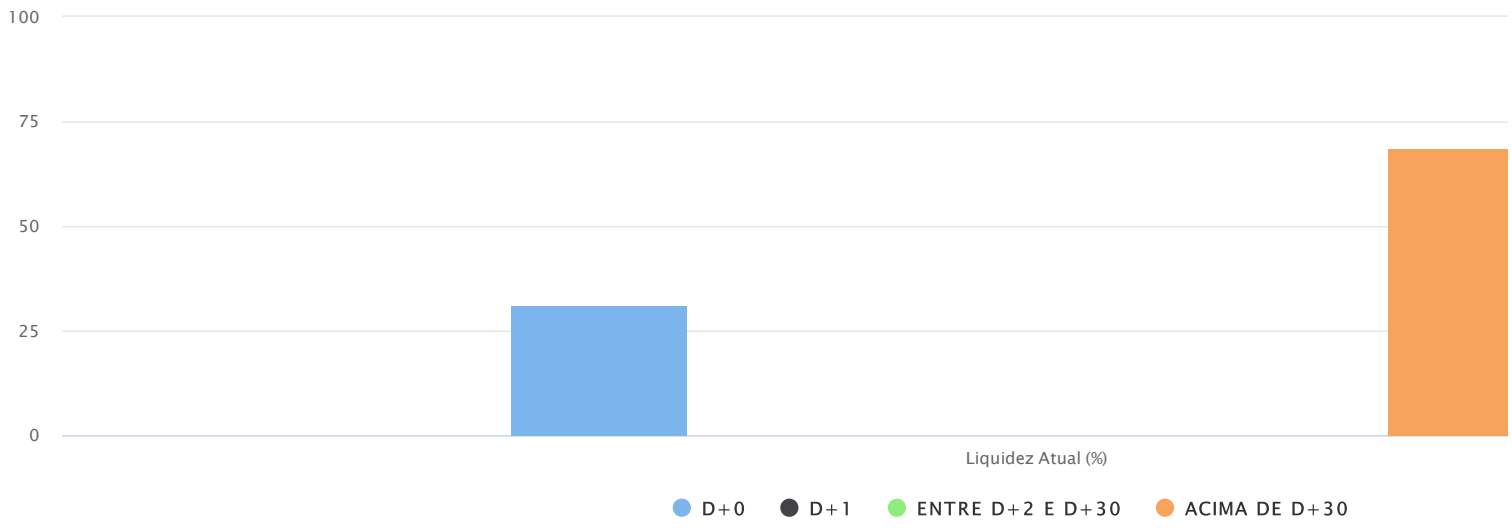
RISCO DE LIQUIDEZ

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	1.385.615,20	4,26 %	751	0,08 %	1.725.378.039,09	Art 7º , IV "a"	Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 0	24.188,81	0,07 %	885	0,00 %	6.099.396.938,17	Art 7º , I, "b"	Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D + 0	3.142.239,92	9,65 %	1251	0,04 %	7.835.713.656,67	Art 7º , I, "b"	Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	D + 0	42.414,68	0,13 %	600	0,00 %	2.412.408.451,26	Art 7º , IV "a"	Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 0	5.037.279,91	15,47 %	51	1,44 %	348.918.824,86	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	512.821,18	1,58 %	319	0,10 %	506.083.614,11	Art 7º , IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	15.262,22	0,05 %	1366	0,00 %	10.907.406.871,77	Art 7º , I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	D + 0	11.593,99	0,04 %	707	0,00 %	4.665.137.027,34	Art 7º , IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 730	317.537,73	0,98 %	19	0,39 %	80.825.315,71	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 %	1487	0,00 %	641.515.876,63	Art 7º , IV "a"	Médio
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	D + 1260	539.698,71	1,66 %	71	0,73 %	73.717.943,19	Art 7º , VII, "a"	Alto
NTN-B20450515	D + 360	9.310.525,73	28,60 %	1	0,00 %	0,00	Art 7º , I, "a"	Alto
NTN-C 20310101	D + 192	12.218.571,32	37,53 %	1	0,00 %	0,00	Art 7º , I, "a"	Alto

TOTAL SALDO: R\$ 32.557.749,40

PRAZO DE RESGATE	QUANTIDADE DE FUNDOS	LIQUIDEZ ATUAL
D+0	9	31%
D+1	1	0%
ENTRE D+2 E D+30	1	0%
ACIMA DE D+30	4	69%

Gráfico



Relatório competência: 07/2020



RISCO DE CRÉDITO

RENDA FIXA - ARTIGOS	LIMITE DA RESOLUÇÃO	LIMITE POLÍTICA	TOTAL	% CARTEIRA
Art 7º, I, "a"	100 %	100 %	21.529.097,05	66,13
Art 7º, I, "b"	100 %	100 %	8.218.970,86	25,24
Art 7º, IV "a"	40 %	40 %	2.269.982,78	6,97
Art 7º, VII, "a"	5 %	5 %	539.698,71	1,66
			32.557.749,40	

RISCO DE CRÉDITO	% CARTEIRA
100% Títulos Públicos e 0% Títulos Privados	94,86%
50% Títulos Públicos e 50% Títulos Privados	3,49%
0% Títulos Públicos e 100% Títulos Privados	1,66%

Relatório competência: 07/2020



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%

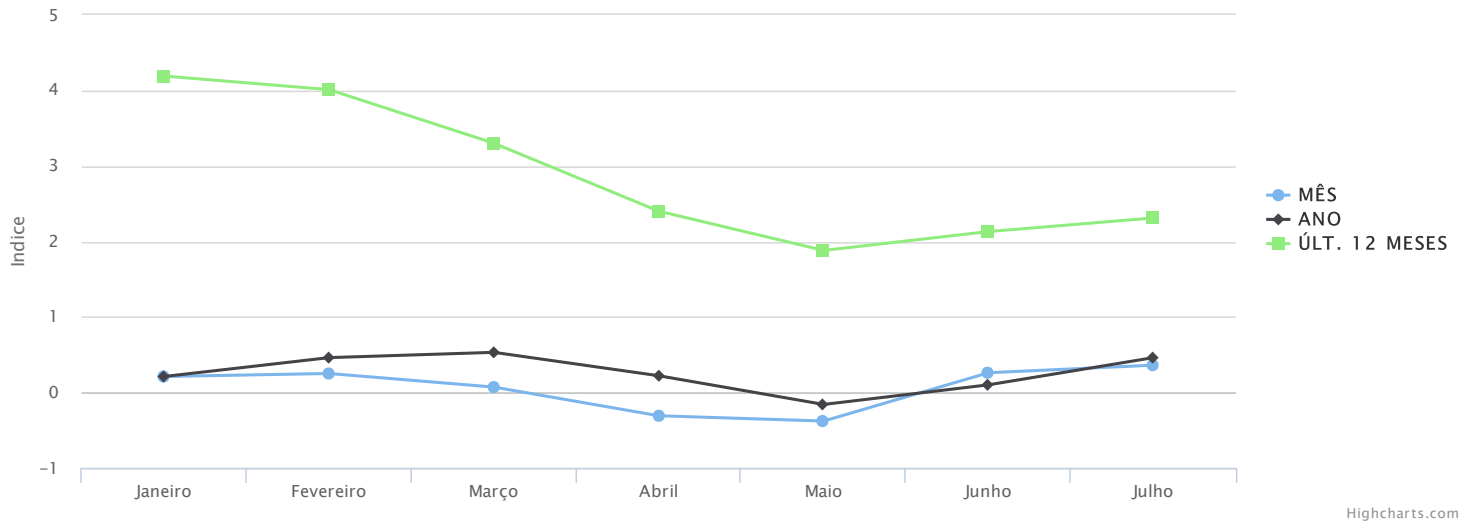
PERCENTUAL MÍNIMO DE ALOCAÇÃO DA CARTEIRA TOTAL DO RPPS EM PRODUTOS COM CAPITAL INVESTIDO PROTEGIDO: 80% do Patrimônio Líquido do RPPS, apurado concomitantemente na data de fechamento dos dados para envio do DAIR ao Ministério da Previdência Social - MPS.

Relatório competência: 07/2020



ÍNDICES ECONÔMICOS

IPCA
2020

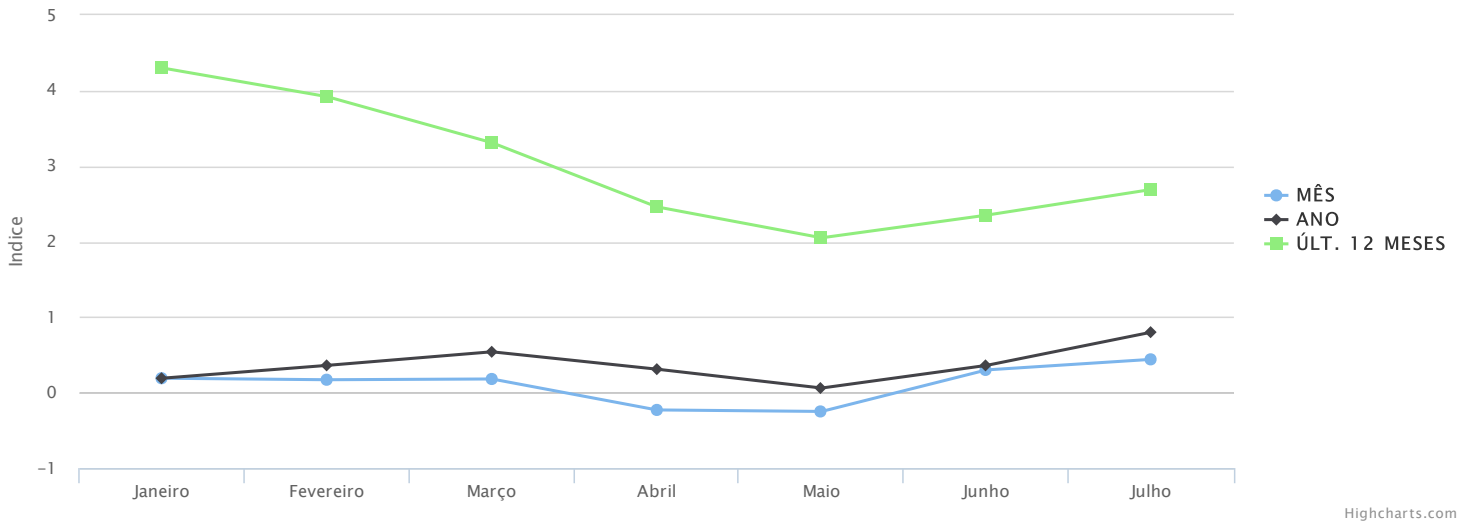


Highcharts.com

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	0.3600					
ANO	0.2100	0.4600	0.5300	0.2200	-0.1600	0.1000	0.4600					
ULT. 12 M	4.1900	4.0100	3.3000	2.4000	1.8800	2.1300	2.3100					



INPC 2020

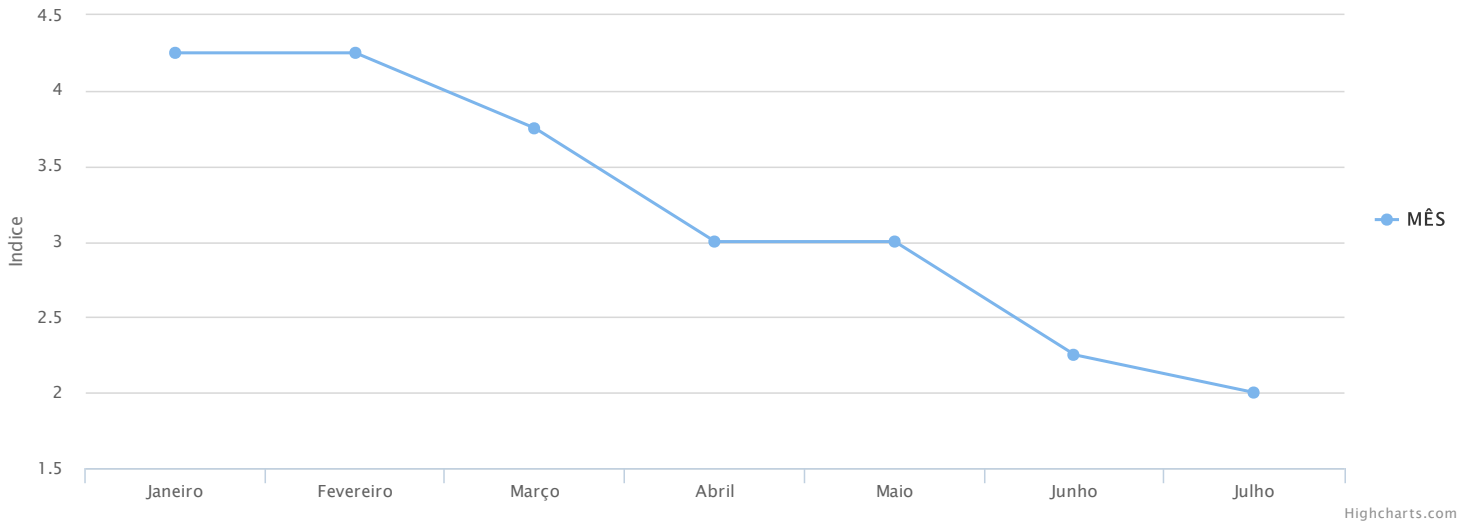


Highcharts.com

2020	Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Mai	Junho	Julho	Agosto	Setembro	Outubro	Novembro	Dezembro
MÊS	0.1900	0.1700	0.1800	-0.2300	-0.2500	0.3000	0.4400					
ANO	0.1900	0.3600	0.5400	0.3100	0.0600	0.3600	0.8000					
ULT. 12 M	4.3000	3.9200	3.3100	2.4600	2.0500	2.3500	2.6900					



SELIC 2020



Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Maio	Junho	Julho	Agosto	Setembro	Outubro	Novembro	Dezembro
4.25	4.25	3.75	3.00	3.00	2.25	2.00					



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 07/2020: R\$ 1.385.615,20
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\$ 2,108073458	Quantidade de Cotas: 657.289,8087	PL do Fundo: R\$ 1.725.378.039,09
% do PL do Fundo: 0,08%	Limite Cumulativo: 4,26%	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 07/2020: R\$ 24.188,81
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\$ 2,778713925	Quantidade de Cotas: 8.705,0379	PL do Fundo: R\$ 6.099.396.938,17
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,07%	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 07/2020: R\$ 3.142.239,92
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\$ 2,704654635	Quantidade de Cotas: 1.161.789,7085	PL do Fundo: R\$ 7.835.713.656,67
% do PL do Fundo: 0,04%	Limite Cumulativo: 9,65%	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 07/2020: R\$ 42.414,68
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\$ 2,284033381	Quantidade de Cotas: 18.570,0789	PL do Fundo: R\$ 2.412.408.451,26
% 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 07/2020: R\$ 5.037.279,91
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\$ 2,393886737	Quantidade de Cotas: 2.104.226,5000	PL do Fundo: R\$ 348.918.824,86
% do PL do Fundo: 1,44%	Limite Cumulativo: 15,47%	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 07/2020: 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 07/2020: R\$ 512.821,18
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\$ 1,873414000	Quantidade de Cotas: 273.736,1736	PL do Fundo: R\$ 506.083.614,11
% do PL do Fundo: 0,10%	Limite Cumulativo: 1,58%	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 07/2020: R\$ 15.262,22
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\$ 2,590326000	Quantidade de Cotas: 5.892,0074	PL do Fundo: R\$ 10.907.406.871,77
% 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 07/2020: R\$ 11.593,99
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\$ 3,710395000	Quantidade de Cotas: 3.124,7320	PL do Fundo: R\$ 4.665.137.027,34
% 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 07/2020: R\$ 317.537,73
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\$ 0,598273000	Quantidade de Cotas: 530.757,2463	PL do Fundo: R\$ 80.825.315,71
% do PL do Fundo: 0,39%	Limite Cumulativo: 0,98%	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 07/2020: 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 07/2020: 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\$ 282,963322000	Quantidade de Cotas: 0,0000	PL do Fundo: R\$ 641.515.876,63
% 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 07/2020: R\$ 539.698,71
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\$ 0,377623230	Quantidade de Cotas: 1.429.198,9134	PL do Fundo: R\$ 73.717.943,19
% do PL do Fundo: 0,73%	Limite Cumulativo: 1,66%	Limite do Fundo: 5%

Renda Fixa	Tipo: Fundo de Investimento	Benchmark: NTN-B
Fundo: NTN-B20450515	CNPJ: 66.998.014/0001-54	Saldo em 07/2020: R\$ 9.310.525,73
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\$ 4.563,983204000	Quantidade de Cotas: 2.040,0000	PL do Fundo: R\$ 0,00
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 28,60%	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 07/2020: R\$ 12.218.571,32
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\$ 4.563,983204000	Quantidade de Cotas: 2.677,1727	PL do Fundo: R\$ 0,00
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 37,53%	Limite do Fundo: 100%

TOTAL: R\$ 32.557.749,40

Relatório competência: 07/2020



CARTEIRA SUGERIDA ESTRATEGIA PRÓXIMO MÊS - PERFIL CONSERVADOR

INDICE	CARTEIRA ATUAL		MOVIMENTAÇÕES	CARTEIRA SUGERIDA	
	SALDO ATUAL	% CAPITAL	APLICAR / RESGATAR	SALDO FINAL	% CAPITAL
FIDC	539.698,71	4,89	-397,61	539.301,10	4,89
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	5.037.279,91	45,67	-494,38	5.036.785,53	45,67
IMA-B	317.537,73	2,88	785.327,51	1.102.865,24	10,00
IMA-B 5	0,00	0,00	551.432,62	551.432,62	5,00
IMA-B 5+	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IDKA 2	24.188,81	0,22	1.078.676,43	1.102.865,24	10,00
IDKA 20	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IRF-M	0,00	0,00	1.213.151,76	1.213.151,76	11,00
IRF-M1	3.157.502,14	28,63	-2.054.636,91	1.102.865,24	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	1.952.445,05	17,70	-1.573.059,41	379.385,64	3,44
ALOCAÇÃO ATIVA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
TOTAL:	11.028.652,35	100,00		11.028.652,35	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: 07/2020



ESTRATEGIA PRÓXIMO MÊS - PERFIL MODERADO

CARTEIRA ATUAL			MOVIMENTAÇÕES	CARTEIRA SUGERIDA	
ÍNDICE	SALDO ATUAL	% CAPITAL	APLICAR / RESGATAR	SALDO FINAL	% CAPITAL
FIDC	539.698,71	4,89	-397,61	539.301,10	4,89
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	5.037.279,91	45,67	-494,38	5.036.785,53	45,67
IMA-B	317.537,73	2,88	785.327,51	1.102.865,24	10,00
IMA-B 5	0,00	0,00	551.432,62	551.432,62	5,00
IMA-B 5+	0,00	0,00	551.432,62	551.432,62	5,00
IDKA 2	24.188,81	0,22	527.243,81	551.432,62	5,00
IDKA 20	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IRF-M	0,00	0,00	1.213.151,76	1.213.151,76	11,00
IRF-M1	3.157.502,14	28,63	-2.054.636,91	1.102.865,24	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	1.952.445,05	17,70	-1.573.059,41	379.385,64	3,44
ALOCÇÃO ATIVA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
TOTAL:	11.028.652,35	100,00		11.028.652,35	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: 07/2020