

# INSTITUTO DE PREVIDENCIA DO MUNICIPIO DE BARRETOS

Relatório Competência

08/2020



## 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            | 1.296.391,47  | 3,98 %       | 755            | 0,07 %              | 1.775.186.405,18  | Art 7º , IV "a"   | Baixo         | 1,00 %    | Fundo de Investimento |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO                           | D + 0            | 713.035,59    | 2,19 %       | 892            | 0,01 %              | 6.452.433.505,43  | Art 7º , I, "b"   | Médio         | 0,20 %    | Fundo de Investimento |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI  | D + 0            | 3.005.896,75  | 9,23 %       | 1244           | 0,04 %              | 7.749.783.927,00  | 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            | 42.491,53     | 0,13 %       | 590            | 0,00 %              | 2.572.617.697,19  | Art 7º , IV "a"   | Baixo         | 0,20 %    | Fundo de Investimento |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO                             | D + 0            | 5.070.543,82  | 15,56 %      | 51             | 1,44 %              | 351.222.926,25    | 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            | 208.702,77    | 0,64 %       | 316            | 0,04 %              | 496.713.163,83    | Art 7º , IV "a"   | Baixo         | 0,80 %    | Fundo de Investimento |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA                               | D + 0            | 15.276,94     | 0,05 %       | 1359           | 0,00 %              | 10.245.504.415,29 | Art 7º , I, "b"   | Baixo         | 0,20 %    | Fundo de Investimento |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO                                       | D + 0            | 11.610,79     | 0,04 %       | 696            | 0,00 %              | 4.687.255.346,64  | Art 7º , IV "a"   | Baixo         | 0,20 %    | Fundo de Investimento |
| FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO                                      | D + 730          | 317.278,38    | 0,97 %       | 19             | 0,40 %              | 79.256.983,60     | 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 %       | 1803           | 0,00 %              | 702.235.168,33    | Art 7º , IV "a"   | Médio         | 0,20 %    | Fundo de Investimento |
| LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS                             | D + 1260         | 538.554,17    | 1,65 %       | 71             | 0,73 %              | 73.561.608,23     | Art 7º , VII, "a" | Alto          | 1,50 %    | Fundo de Investimento |
| NTN-B20450515  | D + 360          | 8.928.698,54  | 27,40 %      | 1              | 0,00 %              | 0,00              | Art 7º , I, "a"   | Alto          | 0,20 %    | Fundo de Investimento |
| NTN-C 20310101   | D + 192          | 12.434.930,89 | 38,16 %      | 1              | 0,00 %              | 0,00              | Art 7º , I, "a"   | Alto          | 0,20 %    | Fundo de Investimento |

**TOTAL SALDO: R\$ 32.583.411,64**

Relatório competência: 08/2020



## 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%<br>ENQUADRADO  | 100%<br>ENQUADRADO | 20%<br>DESENQUADRADO    | 100%            | 21.363.629,43 | 65,57 %    |
| FI 100 TÍTULOS TN - Art 7º, I, "b"                          | 100%<br>ENQUADRADO  | 15%<br>ENQUADRADO  | 20%<br>ENQUADRADO       | 100%            | 8.804.753,10  | 27,02 %    |
| FI RENDA FIXA GERAL - Art 7º, IV "a"                        | 40%<br>ENQUADRADO   | 15%<br>ENQUADRADO  | 20%<br>ENQUADRADO       | 40%             | 1.876.474,94  | 5,76 %     |
| FI EM DIREITOS CREDITÓRIOS / COTA SENIOR - Art 7º, VII, "a" | 5%<br>ENQUADRADO    | 5%<br>ENQUADRADO   | 20%<br>ENQUADRADO       | 5%              | 538.554,17    | 1,65 %     |
| <b>Valor total Renda Fixa: R\$ 32.583.411,64</b>            |                     |                    |                         |                 |               |            |

| 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%<br>ENQUADRADO   | 15%<br>ENQUADRADO | 20%<br>ENQUADRADO       | 20%             | 0,00  | 0,00       |
| <b>Valor total Renda Variável: R\$ 0,00</b> |                     |                   |                         |                 |       |            |

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

| DISTRIBUIÇÃO POR PARÂMETRO DE RENTABILIDADE | TOTAL                    | % CARTEIRA |
|---|--------------------------|------------|
| AÇÕES                                       | 0,00                     | 0,00       |
| CDI   | 1.559.196,56             | 4,79       |
| FIDC  | 538.554,17               | 1,65       |
| IDKA 2                                      | 713.035,59               | 2,19       |
| IMA-B                                       | 317.278,38               | 0,97       |
| IPCA  | 5.070.543,82             | 15,56      |
| IRF-M1                                      | 3.021.173,69             | 9,27       |
| NTN-B                                       | 8.928.698,54             | 27,40      |
| NTN-C                                       | 12.434.930,89            | 38,16      |
|   | <b>R\$ 32.583.411,64</b> |            |

| DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA   | TOTAL                    | % CARTEIRA |
|---|--------------------------|------------|
| CNPJ: 21.363.629,43   | 21.363.629,43            | 65,57      |
| SAFRA SERVIÇOS DE ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA LTDA   CNPJ: 06947853000111              | 0,00                     | 0,00       |
| INTRADER DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA   CNPJ: 15489568000195 | 317.278,38               | 0,97       |
| GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A   CNPJ: 27652684000162                      | 0,00                     | 0,00       |
| BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A   CNPJ: 30822936000169                               | 10.128.359,16            | 31,08      |
| CAIXA ECONOMICA FEDERAL   CNPJ: 360305000104  | 235.590,50               | 0,72       |
| ORLA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S/A   CNPJ: 92904564000177      | 538.554,17               | 1,65       |
|   | <b>R\$ 32.583.411,64</b> |            |



## 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\$ 1.385.615,20  | R\$ 24.015,28    | R\$ 114.238,30   | R\$ 1.296.391,47  | R\$ 999,29      | 0,07519 %  | 0,07519 %  |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO                           | R\$ 24.188,81     | R\$ 688.382,98   | R\$ 0,00         | R\$ 713.035,59    | R\$ 463,80      | 0,68612 %  | 0,68612 %  |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI  | R\$ 3.142.239,92  | R\$ 156.710,85   | R\$ 295.821,12   | R\$ 3.005.896,75  | R\$ 2.767,10    | 0,08827 %  | 0,08827 %  |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI | R\$ 42.414,68     | R\$ 0,00         | R\$ 0,00         | R\$ 42.491,53     | R\$ 76,85       | 0,18121 %  | 0,18121 %  |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO                             | R\$ 5.037.279,91  | R\$ 0,00         | R\$ 0,00         | R\$ 5.070.543,82  | R\$ 33.263,91   | 0,66035 %  | 0,66035 %  |
| 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\$ 512.821,18    | R\$ 896.592,74   | R\$ 1.201.007,33 | R\$ 208.702,77    | R\$ 296,18      | 0,09053 %  | 0,09053 %  |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA                               | R\$ 15.262,22     | R\$ 0,00         | R\$ 0,00         | R\$ 15.276,94     | R\$ 14,72       | 0,09647 %  | 0,09647 %  |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO                                       | R\$ 11.593,99     | R\$ 0,00         | R\$ 0,00         | R\$ 11.610,79     | R\$ 16,80       | 0,14497 %  | 0,14497 %  |
| FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO                                      | R\$ 317.537,73    | R\$ 0,00         | R\$ 0,00         | R\$ 317.278,38    | R\$ -259,35     | -0,00919 % | -0,00919 % |
| 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        | 0,08385 %  | 0,08385 %  |
| LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS                             | R\$ 539.698,71    | R\$ 0,00         | R\$ 0,00         | R\$ 538.554,17    | R\$ -1.144,54   | -0,21207 % | -0,21207 % |
| NTN-B20450515  | R\$ 9.310.525,73  | R\$ 0,00         | R\$ 0,00         | R\$ 8.928.698,54  | R\$ -381.827,19 | -4,10103 % | -4,10103 % |
| NTN-C 20310101   | R\$ 12.218.571,32 | R\$ 0,00         | R\$ 0,00         | R\$ 12.434.930,89 | R\$ 216.359,57  | 1,77074 %  | 1,77074 %  |
| TOTAIS   | R\$ 32.557.749,40 | R\$ 1.765.701,85 | R\$ 1.611.066,75 | R\$ 32.583.411,64 | R\$ -128.972,86 | -0,3218 %  | -0,3218 %  |



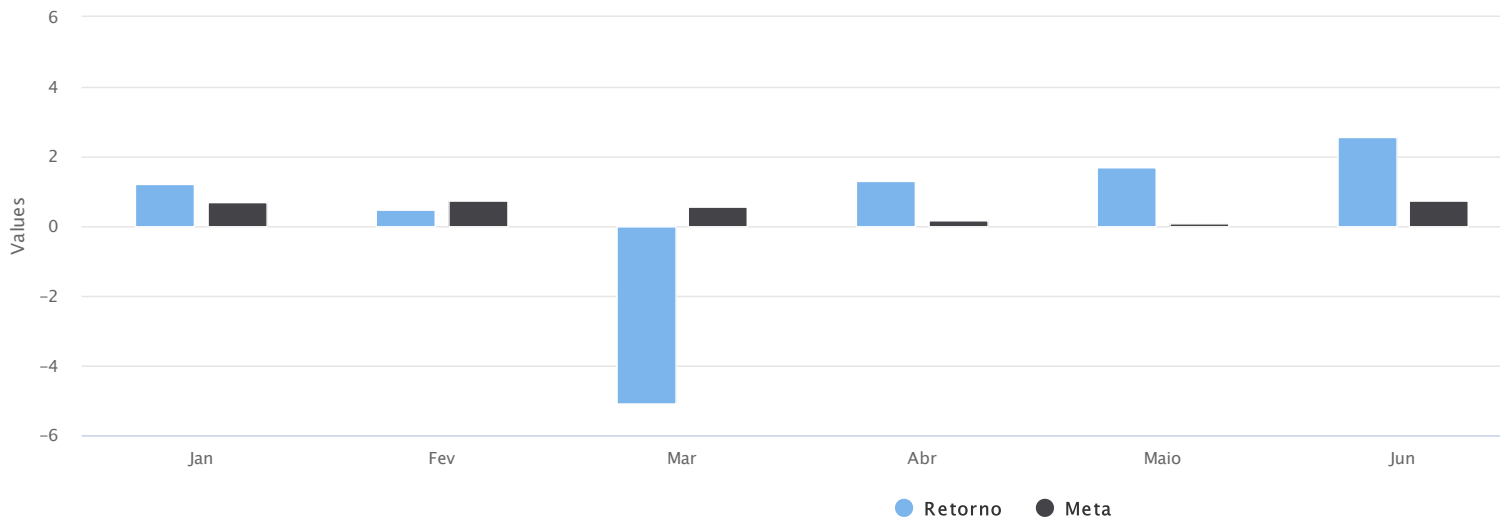
## RETORNOS ACUMULADO

| 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 %      |
| AGOSTO    | R\$ 32.557.749,40 | R\$ 1.765.701,85  | R\$ 1.611.066,75  | R\$ 32.583.411,64 | R\$ -128.972,86   | -0,3218 % | 0,72 % | -44,75 %      |
| TOTAIS    |                   | R\$ 13.193.610,79 | R\$ 17.440.312,02 |                   | R\$ 1.757.821,67  | 6,16      | 4,62   | 133,55        |

Relatório competência: 08/2020



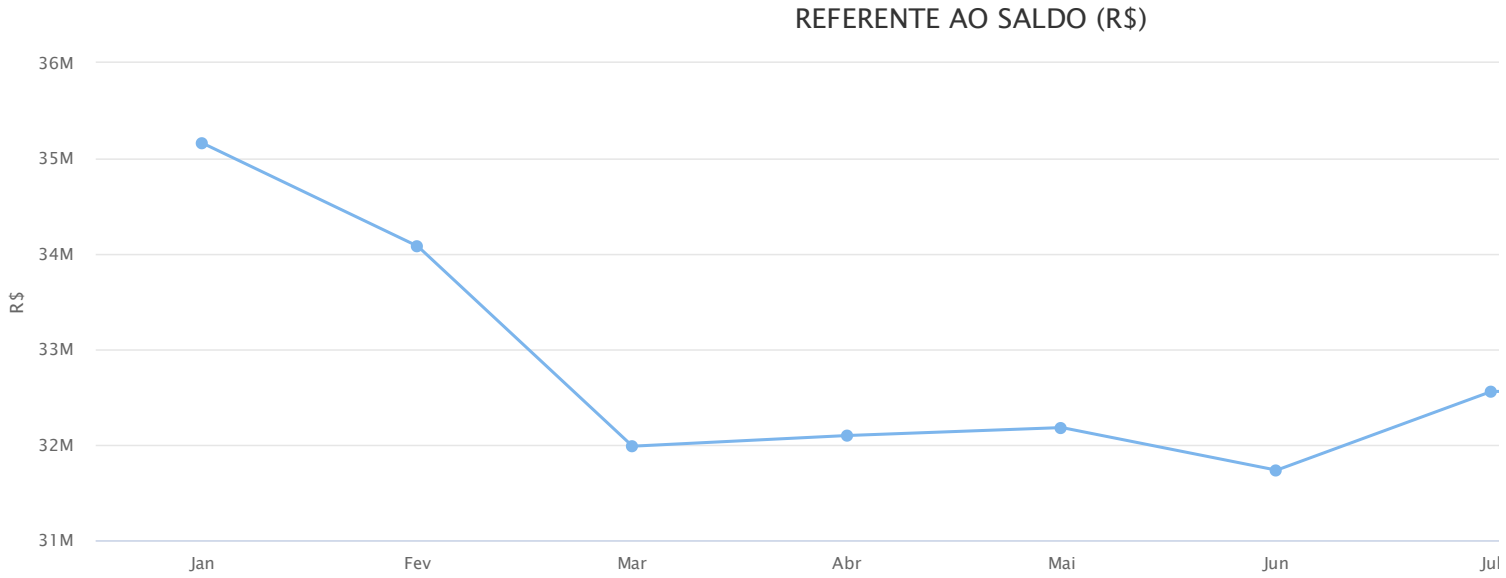
Gráfico – Retorno acumulado no ano





## EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO X RENTABILIDADE MONETÁRIA

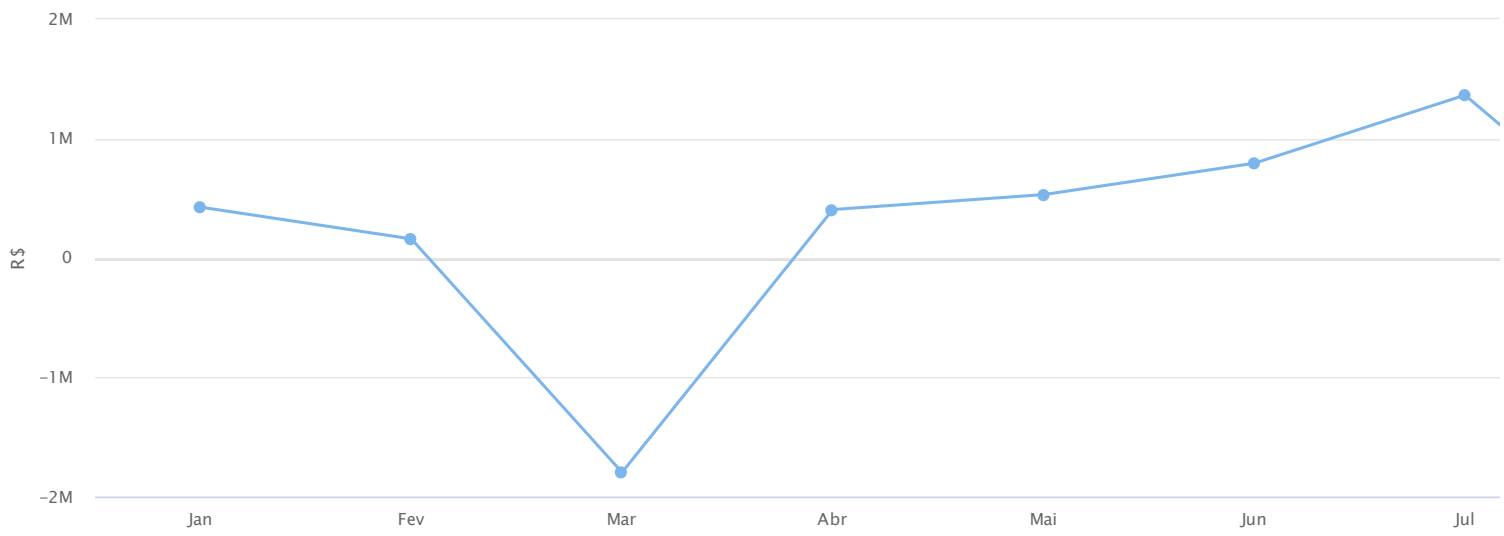
| MESES         | JANEIRO       | FEVEREIRO     | MARÇO         | ABRIL         | MAIO          | JUNHO         | JULHO         | AGOSTO        | SETEMBRO | OUTUBRO | NOVEMBRO | DEZEMBRO |
|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|----------|---------|----------|----------|
| 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 | 32.583.411,64 | 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  | -128.972,86   | 0,00     | 0,00    | 0,00     | 0,00     |



Relatório competência: 08/2020



REFERENTE AO RETORNO (R\$)



Relatório competência: 08/2020





## 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: 08/2020



## 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       | 1.296.391,47  | 0,62 %       | 0,29 %                | 8.037,63                                    |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO                           | 13.322.205/0001-35 | IDKA 2    | 713.035,59    | 6,33 %       | 2,91 %                | 45.135,15                                   |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI  | 11.328.882/0001-35 | IRF-M1    | 3.005.896,75  | 0,94 %       | 0,43 %                | 28.255,43                                   |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI | 13.077.418/0001-49 | CDI       | 42.491,53     | 1,20 %       | 0,55 %                | 509,90                                      |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO                             | 15.486.093/0001-83 | IPCA      | 5.070.543,82  | 9,59 %       | 4,41 %                | 486.265,15                                  |
| 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       | 208.702,77    | 0,64 %       | 0,29 %                | 1.335,70                                    |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA                               | 10.740.670/0001-06 | IRF-M1    | 15.276,94     | 0,93 %       | 0,43 %                | 142,08                                      |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO                                       | 03.737.206/0001-97 | CDI       | 11.610,79     | 0,91 %       | 0,42 %                | 105,66                                      |
| FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO                                      | 11.902.276/0001-81 | IMA-B     | 317.278,38    | 87,59 %      | 40,25 %               | 277.904,13                                  |
| 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      | 538.554,17    | 3,25 %       | 32,51 %               | 17.503,01                                   |
| NTN-B20450515  | 66.998.014/0001-54 | NTN-B     | 8.928.698,54  | 0,00 %       | 0,00 %                | 0,00  |
| NTN-C 20310101   | 66.998.014/0001-54 | NTN-C     | 12.434.930,89 | 0,00 %       | 0,00 %                | 0,00  |

| RISCO DE MERCADO                            |                   |
|---|-------------------|
| <b>Saldo Total:</b>                         | R\$ 32.583.411,64 |
| <b>Provisão para perda e Investimentos:</b> | R\$ 865.193,84    |
| <b>% Provisão de Perda:</b>                 | 2,655%            |

Relatório competência: 08/2020



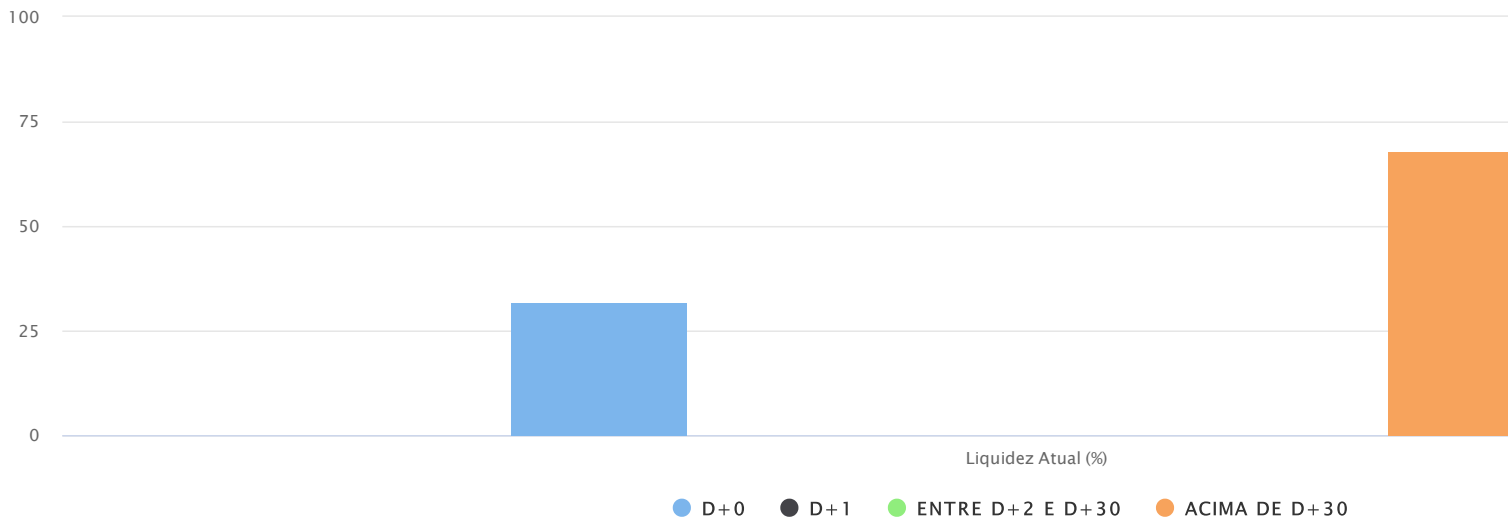
## RISCO DE LIQUIDEZ

| 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            | 1.296.391,47  | 3,98 %       | 755            | 0,07 %              | 1.775.186.405,18  | Art 7º, IV "a"   | Baixo         |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO                           | D + 0            | 713.035,59    | 2,19 %       | 892            | 0,01 %              | 6.452.433.505,43  | Art 7º, I, "b"   | Médio         |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI  | D + 0            | 3.005.896,75  | 9,23 %       | 1244           | 0,04 %              | 7.749.783.927,00  | Art 7º, I, "b"   | Baixo         |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI | D + 0            | 42.491,53     | 0,13 %       | 590            | 0,00 %              | 2.572.617.697,19  | Art 7º, IV "a"   | Baixo         |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO                             | D + 0            | 5.070.543,82  | 15,56 %      | 51             | 1,44 %              | 351.222.926,25    | 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            | 208.702,77    | 0,64 %       | 316            | 0,04 %              | 496.713.163,83    | Art 7º, IV "a"   | Baixo         |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA                               | D + 0            | 15.276,94     | 0,05 %       | 1359           | 0,00 %              | 10.245.504.415,29 | Art 7º, I, "b"   | Baixo         |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO                                       | D + 0            | 11.610,79     | 0,04 %       | 696            | 0,00 %              | 4.687.255.346,64  | Art 7º, IV "a"   | Baixo         |
| FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA FIXA LONGO PRAZO                                      | D + 730          | 317.278,38    | 0,97 %       | 19             | 0,40 %              | 79.256.983,60     | 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 %       | 1803           | 0,00 %              | 702.235.168,33    | Art 7º, IV "a"   | Médio         |
| LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS                             | D + 1260         | 538.554,17    | 1,65 %       | 71             | 0,73 %              | 73.561.608,23     | Art 7º, VII, "a" | Alto          |
| NTN-B20450515  | D + 360          | 8.928.698,54  | 27,40 %      | 1              | 0,00 %              | 0,00              | Art 7º, I, "a"   | Alto          |
| NTN-C 20310101   | D + 192          | 12.434.930,89 | 38,16 %      | 1              | 0,00 %              | 0,00              | Art 7º, I, "a"   | Alto          |

**TOTAL SALDO:** R\$ 32.583.411,64

| 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: 08/2020



## RISCO DE CRÉDITO

| RENDA FIXA - ARTIGOS | LIMITE DA RESOLUÇÃO | LIMITE POLÍTICA | TOTAL         | % CARTEIRA |
|----------------------|---------------------|-----------------|---------------|------------|
| Art 7º, I, "a"       | 100 %               | 100 %           | 21.363.629,43 | 65,57      |
| Art 7º, I, "b"       | 100 %               | 100 %           | 8.804.753,10  | 27,02      |
| Art 7º, IV "a"       | 40 %                | 40 %            | 1.876.474,94  | 5,76       |
| Art 7º, VII, "a"     | 5 %                 | 5 %             | 538.554,17    | 1,65       |
|                      |                     |                 | 32.583.411,64 |            |

| RISCO DE CRÉDITO                            | % CARTEIRA |
|---|------------|
| 100% Títulos Públicos e 0% Títulos Privados | 95,47%     |
| 50% Títulos Públicos e 50% Títulos Privados | 2,88%      |
| 0% Títulos Públicos e 100% Títulos Privados | 1,65%      |

Relatório competência: 08/2020



## CAPITAL PROTEGIDO

| TIPO DE PRODUTO E PERCENTUAL DO CAPITAL INVESTIDO PROTEGIDO  |   |
|--|---|
| TIPO DE PRODUTO  | PERCENTUAL DO CAPITAL INVESTIDO PROTEGIDO |
| INVESTIDO PROTEGIDO  | INVESTIDO PROTEGIDO (Até)                 |
| Títulos Públicos Federais/ Carteira Própria  | 100%                                      |
| Fundos de Investimento Referenciado e Renda Fixa 100% Títulos Públicos Federais (previsto no regulamento do fundo) | 100%                                      |
| Fundos de Investimento Referenciado e Renda Fixa (50% de títulos públicos federais)                                | 50%                                       |
| Fundos de Investimentos Crédito Privado  | 0%  |
| FIDC   | 0%  |
| Fundos de Ações  | 0%  |
| Fundos de Índices - ETF  | 0%  |
| Fundos Multimercados   | 0%  |
| Fundos Imobiliários  | 0%  |
| Fundos de Participação   | 0%  |

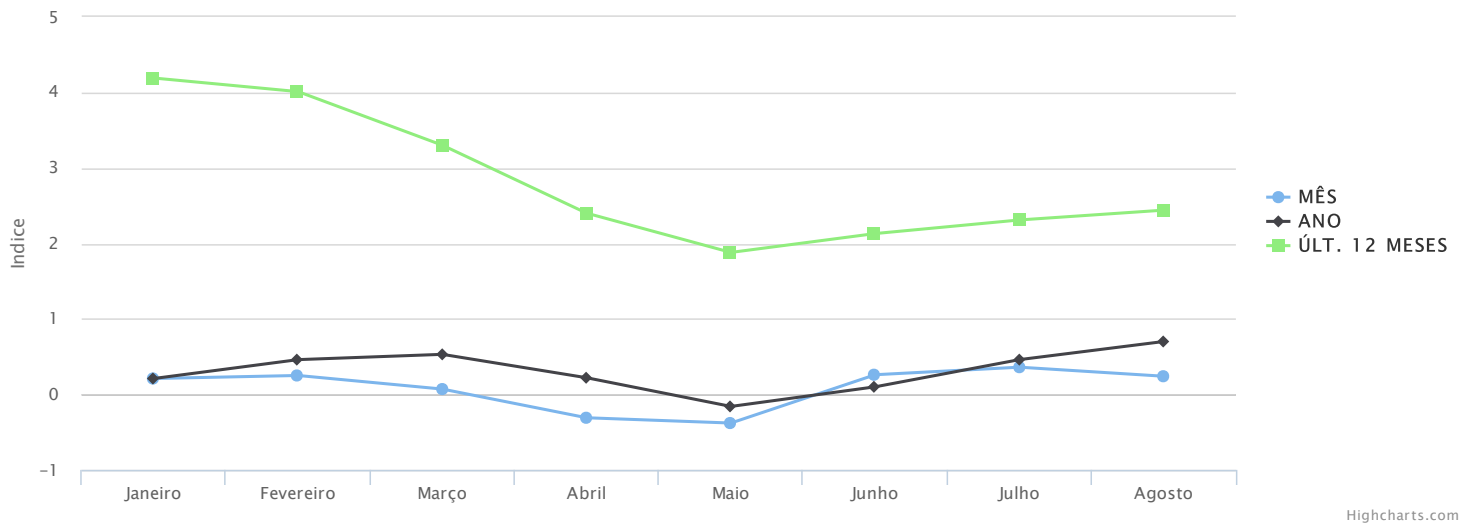
PERCENTUAL MÍNIMO DE ALOCAÇÃO DA CARTEIRA TOTAL DO RPPS EM PRODUTOS COM CAPITAL INVESTIDO PROTEGIDO: 80% do Patrimônio Líquido do RPPS, apurado concomitantemente na data de fechamento dos dados para envio do DAIR ao Ministério da Previdência Social - MPS.

Relatório competência: 08/2020



# ÍNDICES ECONÔMICOS

IPCA  
2020

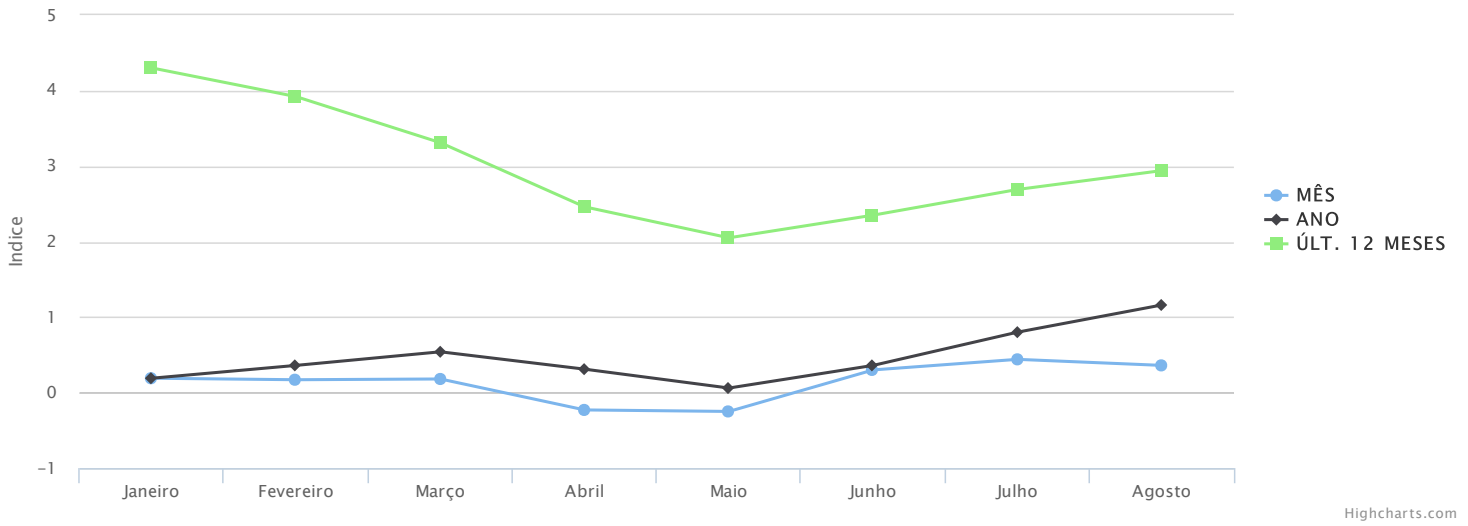


Highcharts.com

| 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 | 0.2400 |          |         |          |          |
| ANO       | 0.2100  | 0.4600    | 0.5300 | 0.2200  | -0.1600 | 0.1000 | 0.4600 | 0.7000 |          |         |          |          |
| ULT. 12 M | 4.1900  | 4.0100    | 3.3000 | 2.4000  | 1.8800  | 2.1300 | 2.3100 | 2.4400 |          |         |          |          |



### INPC 2020



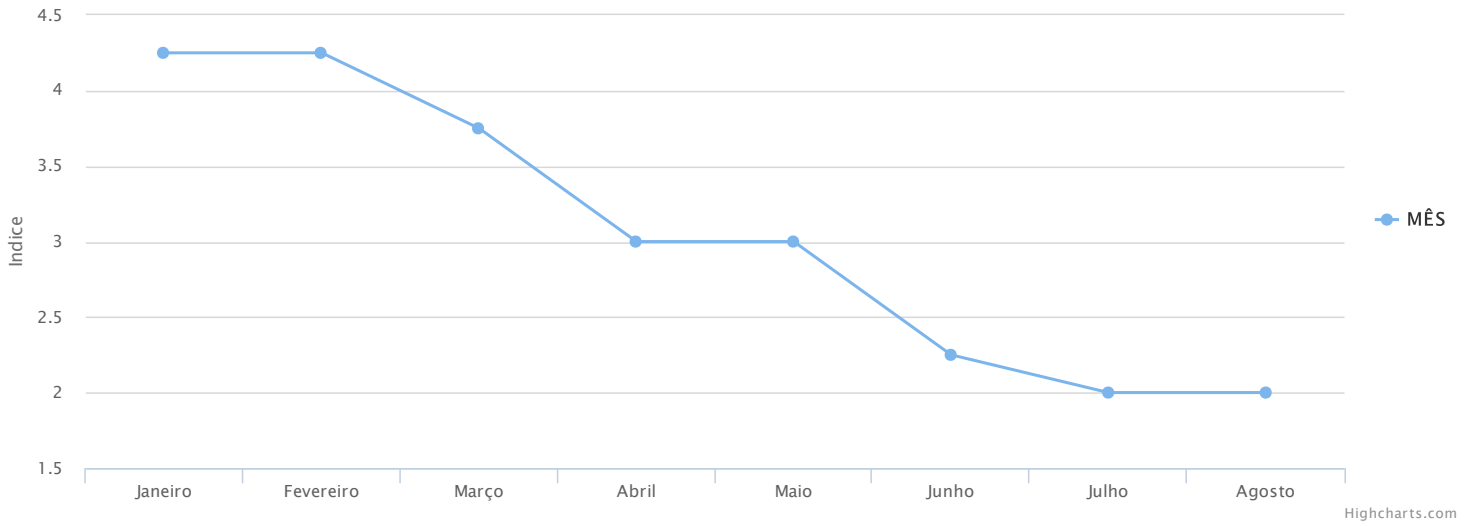
Highcharts.com

| 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 | 0.4400 | 0.3600 |          |         |          |          |
| ANO       | 0.1900  | 0.3600    | 0.5400 | 0.3100  | 0.0600  | 0.3600 | 0.8000 | 1.1600 |          |         |          |          |
| ULT. 12 M | 4.3000  | 3.9200    | 3.3100 | 2.4600  | 2.0500  | 2.3500 | 2.6900 | 2.9400 |          |         |          |          |





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  | 2.00   |          |         |          |          |



## CADPREV

|   |                                     |                                    |
|---|-------------------------------------|------------------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>   | 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 08/2020: R\$ 1.296.391,47 |
| 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\$ 2,109658552  | Quantidade de Cotas: 614.502,9814   | PL do Fundo: R\$ 1.775.186.405,18  |
| % do PL do Fundo: 0,07%   | Limite Cumulativo: 3,98%            | Limite do Fundo: 40%               |
| <b>Renda Fixa</b>   | 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 08/2020: R\$ 713.035,59   |
| 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\$ 2,797779357  | Quantidade de Cotas: 254.857,6921   | PL do Fundo: R\$ 6.452.433.505,43  |
| % do PL do Fundo: 0,01%   | Limite Cumulativo: 2,19%            | Limite do Fundo: 100%              |
| <b>Renda Fixa</b>   | 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 08/2020: R\$ 3.005.896,75 |
| 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\$ 2,707042142  | Quantidade de Cotas: 1.110.398,9492 | PL do Fundo: R\$ 7.749.783.927,00  |
| % do PL do Fundo: 0,04%   | Limite Cumulativo: 9,23%            | Limite do Fundo: 100%              |
| <b>Renda Fixa</b>   | 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 08/2020: R\$ 42.491,53    |
| 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\$ 2,288172258  | Quantidade de Cotas: 18.570,0748    | PL do Fundo: R\$ 2.572.617.697,19  |
| % do PL do Fundo: 0,00%   | Limite Cumulativo: 0,13%            | Limite do Fundo: 40%               |
| <b>Renda Fixa</b>   | 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 08/2020: R\$ 5.070.543,82 |
| 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\$ 2,409694877  | Quantidade de Cotas: 2.104.226,5012 | PL do Fundo: R\$ 351.222.926,25    |
| % do PL do Fundo: 1,44%   | Limite Cumulativo: 15,56%           | Limite do Fundo: 100%              |
| <b>Renda Fixa</b>   | 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 08/2020: 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%              |
| <b>Renda Fixa</b>   | Tipo: Fundo de Investimento         | Benchmark: CDI                     |
| Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA                                       | CNPJ: 14.508.643/0001-55            | Saldo em 08/2020: R\$ 208.702,77   |
| 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\$ 1,875110000  | Quantidade de Cotas: 111.301,6143   | PL do Fundo: R\$ 496.713.163,83    |
| % do PL do Fundo: 0,04%   | Limite Cumulativo: 0,64%            | Limite do Fundo: 40%               |
| <b>Renda Fixa</b>   | 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 08/2020: R\$ 15.276,94    |
| 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\$ 2,592825000  | Quantidade de Cotas: 5.892,0058     | PL do Fundo: R\$ 10.245.504.415,29 |
| % do PL do Fundo: 0,00%   | Limite Cumulativo: 0,05%            | Limite do Fundo: 100%              |
| <b>Renda Fixa</b>   | Tipo: Fundo de Investimento         | Benchmark: CDI                     |
| Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO                                       | CNPJ: 37.372.060/0019-7             | Saldo em 08/2020: R\$ 11.610,79    |
| Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL  | CNPJ: 00.360.305/0001-04            | Performance: 0,00%                 |
| Resolução 3.922/2010: FI RENDA FIXA GERAL Art 7º, IV "a"  | Disponibilidade: D + 0              | Adesão: 01/10/2015                 |
| Valor da Cota: R\$ 3,715774000  | Quantidade de Cotas: 3.124,7299     | PL do Fundo: R\$ 4.687.255.346,64  |
| % do PL do Fundo: 0,00%   | Limite Cumulativo: 0,04%            | Limite do Fundo: 40%               |
| <b>Renda Fixa</b>   | 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 08/2020: R\$ 317.278,38   |
| 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\$ 0,598218000 | Quantidade de Cotas: 530.372,5063 | PL do Fundo: R\$ 79.256.983,60 |
| % do PL do Fundo: 0,40%        | Limite Cumulativo: 0,97%          | Limite do Fundo: 40%           |

|   |                             |                            |
|---|-----------------------------|----------------------------|
| <b>Renda Variável</b>   | Tipo: Fundo de Investimento | Benchmark: AÇÕES           |
| Fundo: GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES | CNPJ: 11.898.349/0001-09    | Saldo em 08/2020: 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%       |

|  |                             |                                 |
|--|-----------------------------|---------------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>  | Tipo: Fundo de Investimento | Benchmark: IRF-M1               |
| Fundo: SAFRA EXECUTIVE 2 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA      | CNPJ: 10.787.647/0001-69    | Saldo em 08/2020: 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\$ 283,200589000                               | Quantidade de Cotas: 0,0000 | PL do Fundo: R\$ 702.235.168,33 |
| % do PL do Fundo: 0,00%  | Limite Cumulativo: 0,00%    | Limite do Fundo: 40%            |

|   |                                     |                                  |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>   | Tipo: Fundo de Investimento         | Benchmark: FIDC                  |
| Fundo: LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS | CNPJ: 12.440.789/0001-80            | Saldo em 08/2020: R\$ 538.554,17 |
| 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\$ 0,376822400  | Quantidade de Cotas: 1.429.198,9277 | PL do Fundo: R\$ 73.561.608,23   |
| % do PL do Fundo: 0,73%   | Limite Cumulativo: 1,65%            | Limite do Fundo: 5%              |

|  |                                 |                                    |
|--|---------------------------------|------------------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>  | Tipo: Fundo de Investimento     | Benchmark: NTN-B                   |
| Fundo: NTN-B20450515   | CNPJ: 66.998.014/0001-54        | Saldo em 08/2020: R\$ 8.928.698,54 |
| 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\$ 4.376,813011000   | Quantidade de Cotas: 2.040,0000 | PL do Fundo: R\$ 0,00              |
| % do PL do Fundo: 0,00%  | Limite Cumulativo: 27,40%       | Limite do Fundo: 100%              |

|  |                                 |                                     |
|--|---------------------------------|-------------------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>  | Tipo: Fundo de Investimento     | Benchmark: NTN-C                    |
| Fundo: NTN-C 20310101  | CNPJ: 66.998.014/0001-54        | Saldo em 08/2020: R\$ 12.434.930,89 |
| 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\$ 4.376,813011000   | Quantidade de Cotas: 2.841,0926 | PL do Fundo: R\$ 0,00               |
| % do PL do Fundo: 0,00%  | Limite Cumulativo: 38,16%       | Limite do Fundo: 100%               |

**TOTAL: R\$ 32.583.411,64**

Relatório competência: 08/2020



## CARTEIRA SUGERIDA ESTRATEGIA PRÓXIMO MÊS - PERFIL CONSERVADOR

| INDICE         | CARTEIRA ATUAL |           | MOVIMENTAÇÕES      | CARTEIRA SUGERIDA |           |
|----------------|----------------|-----------|--------------------|-------------------|-----------|
|                | SALDO ATUAL    | % CAPITAL | APLICAR / RESGATAR | SALDO FINAL       | % CAPITAL |
| FIDC           | 538.554,17     | 4,80      | -4,62              | 538.549,55        | 4,80      |
| 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           | 5.070.543,82   | 45,19     | -324,24            | 5.070.219,58      | 45,19     |
| IMA-B          | 317.278,38     | 2,83      | 243.710,73         | 560.989,11        | 5,00      |
| IMA-B 5        | 0,00           | 0,00      | 560.989,11         | 560.989,11        | 5,00      |
| IMA-B 5+       | 0,00           | 0,00      | 0,00               | 0,00              | 0,00      |
| IDKA 2         | 713.035,59     | 6,36      | 408.942,63         | 1.121.978,22      | 10,00     |
| IDKA 20        | 0,00           | 0,00      | 0,00               | 0,00              | 0,00      |
| IRF-M          | 0,00           | 0,00      | 1.346.373,87       | 1.346.373,87      | 12,00     |
| IRF-M1         | 3.021.173,69   | 26,93     | -1.386.451,42      | 1.634.722,27      | 14,57     |
| 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      | 1.559.196,56   | 13,90     | -1.173.236,05      | 385.960,51        | 3,44      |
| ALOCAÇÃO ATIVA | 0,00           | 0,00      | 0,00               | 0,00              | 0,00      |
| TOTAL:         | 11.219.782,21  | 100,00    |                    | 11.219.782,21     | 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: 08/2020



## ESTRATEGIA PRÓXIMO MÊS - PERFIL MODERADO

| CARTEIRA ATUAL |               |           | MOVIMENTAÇÕES      | CARTEIRA SUGERIDA |           |
|----------------|---------------|-----------|--------------------|-------------------|-----------|
| INDICE         | SALDO ATUAL   | % CAPITAL | APLICAR / RESGATAR | SALDO FINAL       | % CAPITAL |
| FIDC           | 538.554,17    | 4,80      | -4,62              | 538.549,55        | 4,80      |
| 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           | 5.070.543,82  | 45,19     | -324,24            | 5.070.219,58      | 45,19     |
| IMA-B          | 317.278,38    | 2,83      | 804.699,84         | 1.121.978,22      | 10,00     |
| IMA-B 5        | 0,00          | 0,00      | 560.989,11         | 560.989,11        | 5,00      |
| IMA-B 5+       | 0,00          | 0,00      | 560.989,11         | 560.989,11        | 5,00      |
| IDKA 2         | 713.035,59    | 6,36      | -152.046,48        | 560.989,11        | 5,00      |
| IDKA 20        | 0,00          | 0,00      | 0,00               | 0,00              | 0,00      |
| IRF-M          | 0,00          | 0,00      | 1.234.176,04       | 1.234.176,04      | 11,00     |
| IRF-M1         | 3.021.173,69  | 26,93     | -1.835.242,71      | 1.185.930,98      | 10,57     |
| 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      | 1.559.196,56  | 13,90     | -1.173.236,05      | 385.960,51        | 3,44      |
| ALOCÇÃO ATIVA  | 0,00          | 0,00      | 0,00               | 0,00              | 0,00      |
| TOTAL:         | 11.219.782,21 | 100,00    |                    | 11.219.782,21     | 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: 08/2020