

ATA Nº 01/2021 COMITÊ DE INVESTIMENTO

Ata da Reunião Ordinária do Comitê de Investimentos realizada no dia 13 de Janeiro de 2021, às 10h:12min, na sede do Instituto de Previdência Social dos Servidores Público do Município de Monte Negro – IPREMON, situado a Avenida Governador Jorge Teixeira nº 2499.

Deu inicio a reunião ordinária do Comitê de Investimento, onde estiveram presentes os seguintes membros: Vinícius José de Oliveira Peres Almeida, Gestor do Comitê de Investimento, Marcio Juliano Borges Costa e Juliano Souza Guedes ambos pertencentes como membro do Comitê de Investimento, todos devidamente nomeados conforme portaria nº 468/GAB/2018 de 2018 de 13 de Junho de 2018. A convocação foi realizada mediante correspondência eletrônica enviada aos membros do Comitê de Investimento. Assumiu a presidência dos trabalhos o Sr. Vinícius José de Oliveira Peres Almeida, Gestor do Comitê de Investimento, trazendo como pauta dessa reunião o estudo da aplicação monetária do Instituto de Previdência Social dos Servidores Público do município de Monte Negro – IPREMON.

O mês de dezembro trouxe retornos positivos em quase todas as classes de ativos. As incertezas fiscais e a trajetória da dívida pública ainda preocupam os investidores, mas notícias acerca das vacinas que trazem esperança de algum controle da pandemia no futuro continuaram animando os mercados. No cenário doméstico, taxa de juro Selic a 2% ao ano. No ano, houve valorização do Ibovespa em 2,92%. A inflação medida pelo IPCA alcançou 4,52%, enquanto o INPC acumulado foi de 5,45%. No cenário externo, o destaque foi a vitória do candidato democrata Joe Biden nas eleições norte-americanas. O Dólar teve alta acumulada de 29,33%. A moeda brasileira registrou o segundo pior desempenho global no ano em meio à pandemia de covid-19, com juros locais extremamente baixos e incertezas fiscais domésticas. Para 2021 as projeções econômicas apontam para a continuação da recuperação das economias emergentes. O PIB tem estimativa de crescimento acima de 3% para 2021, com apostas num cenário de superação da Covid-19. Em relação as expectativas de mercado para 2021, vide abaixo algumas estimativas:

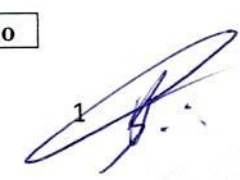
ESTIMATIVAS DO RELATÓRIO FOCUS

PREVISÃO	2021
Produto Interno Bruto (PIB)	3,41%
Inflação	3,74%
Taxa básica de juros (Selic)	3,00%
Dólar	R\$ 5,21
Balança comercial (saldo)	US\$ 55 bilhões
Investimento estrangeiro direto	US\$ 60 bilhões

Fonte: Banco Central

Índice de Referência (IPCA + 5,89% aa *) – Fechamento 2020	10,67% ao ano
Taxa de juro real máxima	

Índice de Referência (INPC + 4,00% aa) – Fechamento 2020	9,67% ao ano
--	--------------



A composição da dívida pública, incluindo os seus prazos de vencimento, a moeda que é emitida e os indexadores utilizados constituem fatores que contribuem para explicar a remuneração oferecida pelos títulos públicos federais.

O quadro a seguir captura o cenário de juros e indica que as taxas reais (descontada a inflação) estão acima de 3% ao ano nos títulos NTN-B (fundos IMA-B) nos vencimentos mais longos (vide terceira coluna da esquerda para a direita). A inflação projetada para o ano de 2021 está em 3,74%:

Prazo de Vencimento	Tipo de Fundo de Investimento	Taxa de juro REAL ao ano	Inflação projetada IPCA	Rentabilidade Total NOMINAL ao ano
15/05/2023	IMA-B	1,10%	3,74%	4,88%
15/08/2024	IMA-B 5	1,92%	3,74%	5,73%
15/08/2030	IMA-B 5+	3,24%	3,74%	7,10%
15/05/2055	IMA-B 5+	4,02%	3,74%	7,91%

Fonte: ANBIMA

De acordo com o quadro abaixo, os fundos da família IRF-M (Pré-Fixados) operam abaixo do índice de referência (meta atuarial) nos vencimentos para 2022 a 2024.

Vencimento	Tipo de Fundo de Investimento	Rentabilidade Total ao ano
2021	IRF-M 1	3,52%
2023	IRF-M	5,93%
2024	IRF-M 1 +	6,40%

Fonte: ANBIMA

Neste cenário, a alocação dos recursos está com o seguinte indicativo:

a) RENDA FIXA: deve estar centrada **TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS**. Fundos da família IRF-M estão com taxas de juros médias aproximadas entre 3,26% e 6,54% ao ano. Fundos da família IRF-M, IRF-M 1+ e IMA-B 5+ capturam taxas de juro mais elevadas, apesar de estarem sujeitos a oscilações. Os fundos CDI (referenciados) e IRF-M1 (hum) estão rodando bem abaixo do índice de referência, apesar de apresentarem estabilidade de retornos.

b) RENDA VARIÁVEL (AÇÕES): o mercado de renda variável pode apresentar uma janela de oportunidades para compras de ações, desde que efetuadas de forma ordenada, com estratégias distintas, formando diversificação de carteira. Importante manter posição no segmento, pois a taxa de juros SELIC deve se manter em patamar baixo ao longo do próximo ano. Fundos Multimercados (com renda variável) também surgem como boa alternativa. As expectativas, doravante, ficam por conta do controle da pandemia e da retomada da atividade econômica.

c) EXTERIOR: Em cenário de taxa de câmbio elevada, aplicações no segmento "Exterior" podem funcionar como mecanismo de diversificação da carteira, com menor correlação com o mercado doméstico. Importante avaliar as diferentes estratégias dos produtos oferecidos para o correto entendimento dos mecanismos de geração de valor para a carteira de investimentos.

S. Pires

2



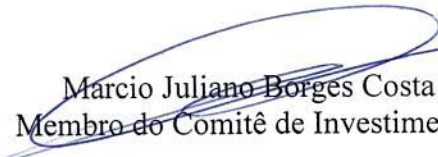
RELATÓRIO DE MERCADO

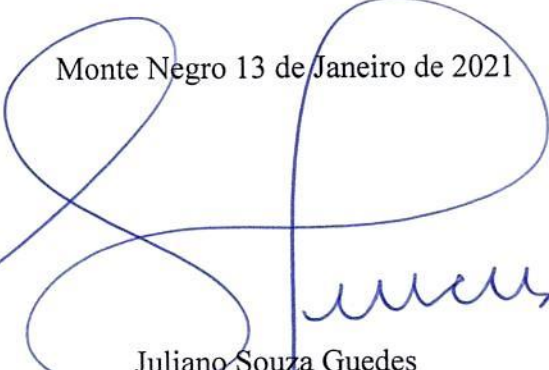
- Relatório da DI BLASI Consultoria Financeira conforme fonte:
<https://www.liasys.com.br/sisweb/relatorio.php> (Anexo)

CONSIDERAÇÕES FINAIS

Finalizando a reunião, foi dada a oportunidade para quaisquer outros esclarecimentos, e não havendo mais nada a tratar, o Gestor do Comitê de Investimento agradeceu a todos pela presença e declarou encerrada a reunião do Comitê de Investimento do Instituto de Previdência Social dos Servidores Públicos do Município de Monte Negro – IPREMON. Para constar eu, Vinícius José de Oliveira Peres Almeida, lavrei a presente ata, e depois de lida e aprovada será assinada por todos os presentes.

Monte Negro 13 de Janeiro de 2021


Marcio Juliano Borges Costa
Membro do Comitê de Investimento


Juliano Souza Guedes
Membro do Comitê de Investimento


Vinícius José de Oliveira Peres Almeida
Gestor do Comitê de Investimento



RELATÓRIO DE COMPETÊNCIA (ANEXO)



DI BLASI
Consultoria Financeira



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE MONTE NEGRO

Relatório Competência

12/2020



DI BLASI
Consultoria Financeira



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 DE INVESTIMENTO
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	D + 0	2.097,96	0,01 %	743	0,00 %	2.452.222.466,54	Art 7º, IV "a"	Baixo	1,00 %	Fundo de Investimento
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	D + 0	0,00	0,00 %	743	0,00 %	2.452.222.466,54	Art 7º, IV "a"	Baixo	1,00 %	Fundo de Investimento
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 0	3.480.939,97	16,06 %	701	0,04 %	8.554.614.280,00	Art 7º, I, "b"	Médio	0,20 %	Fundo de Investimento
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D + 0	3.167.136,09	14,61 %	1225	0,04 %	8.522.749.810,66	Art 7º, I, "b"	Baixo	0,10 %	Fundo de Investimento
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS	D + 0	1.623.173,06	7,49 %	265	0,19 %	842.553.482,20	Art 7º, I, "b"	Baixo	0,20 %	Fundo de Investimento
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPKA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	3.476.970,47	16,04 %	1005	0,03 %	10.655.087.063,09	Art 7º, I, "b"	Baixo	0,20 %	Fundo de Investimento
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	1.232.913,39	5,69 %	322	0,07 %	1.733.830.686,04	Art 7º, I, "b"	Médio	0,20 %	Fundo de Investimento
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	1.169.046,55	5,39 %	976	0,01 %	20.761.505.098,56	Art 7º, I, "b"	Médio	0,20 %	Fundo de Investimento
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	1.108.047,82	5,11 %	899	0,02 %	6.193.173.925,17	Art 7º, I, "b"	Médio	0,20 %	Fundo de Investimento
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	3.201.078,38	14,77 %	1361	0,02 %	16.753.976.831,37	Art 7º, I, "b"	Baixo	0,20 %	Fundo de Investimento
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	766.737,94	3,54 %	375	0,03 %	2.814.559.159,07	Art 7º, I, "b"	Médio	0,20 %	Fundo de Investimento
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA	D + 0	1.193.606,69	5,51 %	885	0,01 %	14.722.139.597,34	Art 7º, I, "b"	Baixo	0,20 %	Fundo de Investimento
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IDKA PRÉ 2	D + 1	1.249.640,80	5,77 %	123	0,19 %	647.244.636,29	Art 7º, I, "b"	Alto	0,20 %	Fundo de Investimento

TOTAL SALDO: R\$ 21.671.389,12

Relatório competência: 12/2020



ENQUADRAMENTO

RENDA FIXA - ARTIGOS	LIMITE DA RESOLUÇÃO	LIMITE PL FUNDO	LIMITE POR PARTICIPAÇÃO	LIMITE POLÍTICA	TOTAL	% CARTEIRA
FI 100 TÍTULOS TN - Art 7º, I, "b"	100% ENQUADRADO	15% ENQUADRADO	20% ENQUADRADO	100%	21.669.281,15	99,99 %
FI RENDA FIXA GERAL - Art 7º, IV "a"	40% ENQUADRADO	15% ENQUADRADO	20% ENQUADRADO	40%	2.097.96	0,01 %
Valor total Renda Fixa: R\$ 21.671.389,12						

RENDA VARIÁVEL - ARTIGOS	LIMITE DA RESOLUÇÃO	LIMITE PL FUNDO	LIMITE POR PARTICIPAÇÃO	LIMITE POLÍTICA	TOTAL	% CARTEIRA
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
CDI	2.097,96	0,01
IDKA 2	4.726.611,27	21,81
IMA-B	1.108.047,82	5,11
IMA-B 5	1.169.046,55	5,39
IMA-B 5+	1.232.913,39	5,69
IPCA	1.193.606,69	5,51
IRF-M	3.480.939,97	16,06
IRF-M1	7.991.387,53	36,88
IRF-M1+	766.737,94	3,54
	R\$ 21.671.389,12	

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	TOTAL	% CARTEIRA
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CNPJ: 00360305000104	7.502.384,22	34,62
BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A CNPJ: 30822936000169	6.650.174,02	30,69
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CNPJ: 360305000104	4.646.017,02	21,44
BANCO BRADESCO S.A CNPJ: 60746948000112	2.872.813,86	13,26
	R\$ 21.671.389,12	



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\$ 5.629,15	R\$ 57.747,23	R\$ 61.303,10	R\$ 2.097,96	R\$ 24,68	0,10290 %	0,10290 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 312.458,97	R\$ 871.299,94	R\$ 1.183.866,42	R\$ 0,00	R\$ 107,51	0,10290 %	0,10290 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 3.136.546,33	R\$ 282.778,37	R\$ 0,00	R\$ 3.480.939,97	R\$ 61.615,27	1,96443 %	1,96443 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 2.553.707,78	R\$ 754.878,89	R\$ 150.000,00	R\$ 3.167.136,09	R\$ 8.549,42	0,31294 %	0,31294 %
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 1.617.911,17	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 1.623.173,06	R\$ 5.261,89	0,32523 %	0,32523 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 3.420.442,08	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 3.476.970,47	R\$ 56.528,39	1,65266 %	1,65266 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA B 5+ TITULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 1.146.224,65	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 1.232.913,39	R\$ 86.688,74	7,56298 %	7,56298 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 1.148.152,52	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 1.169.046,55	R\$ 20.894,03	1,81980 %	1,81980 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 1.056.889,61	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 1.108.047,82	R\$ 51.158,21	4,84045 %	4,84045 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	R\$ 3.191.989,75	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 3.201.078,38	R\$ 9.088,63	0,28473 %	0,28473 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 744.134,14	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 766.737,94	R\$ 22.603,80	3,03760 %	3,03760 %
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA	R\$ 1.178.048,63	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 1.193.606,69	R\$ 15.558,06	1,32066 %	1,32066 %
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IDKA PRÉ 2	R\$ 1.225.639,64	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 1.249.640,80	R\$ 24.001,16	1,95826 %	1,95826 %
TOTAIS	R\$ 20.737.774,42	R\$ 1.966.704,43	R\$ 1.395.169,52	R\$ 21.671.389,12	R\$ 362.079,79	1,7619 %	1,7619 %



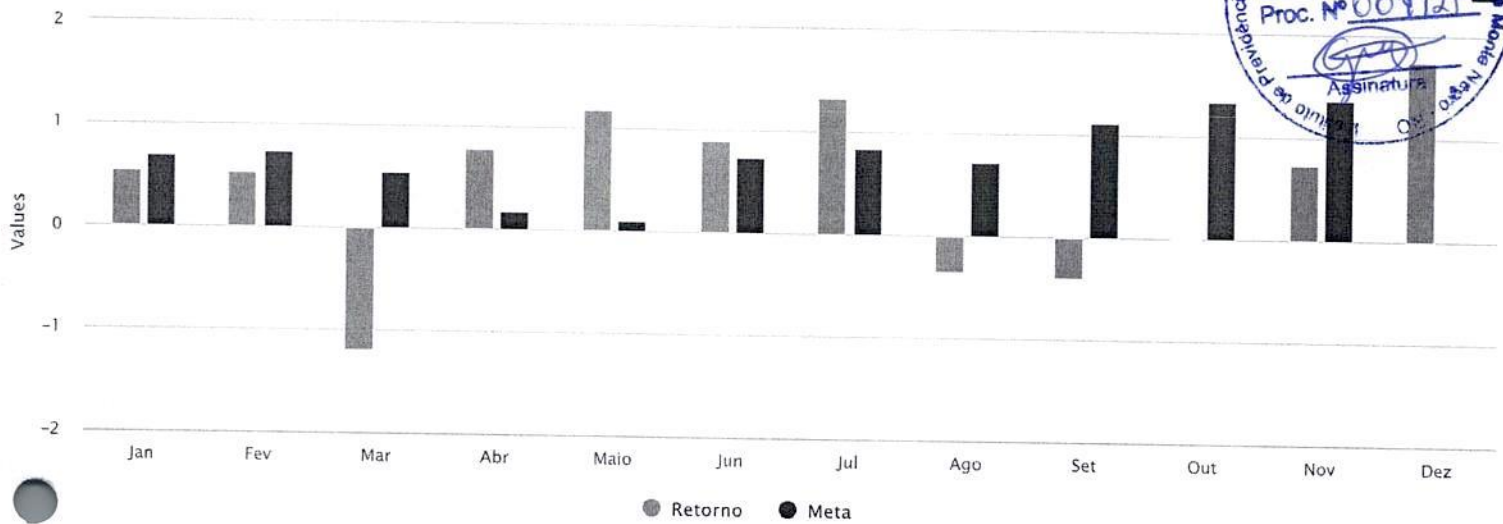
RETORNOS ACUMULADO

MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO R\$	RETORNO %	MÊS	ATINGIMENTO
JANEIRO	R\$ 16.955.332,91	R\$ 366.458,55	R\$ 449.734,10	R\$ 16.962.920,91	R\$ 90.863,55	0,5377 %	ME	8,05 %
FEVEREIRO	R\$ 16.962.920,91	R\$ 2.200.069,61	R\$ 2.209.928,42	R\$ 17.045.374,43	R\$ 92.312,33	0,5242 %	Proc. N°	7,81 %
MARÇO	R\$ 17.045.374,43	R\$ 923.401,98	R\$ 315.654,11	R\$ 17.424.011,84	R\$ -229.110,46	-1,1968 %	Assinatura	470,28 %
ABRIL	R\$ 17.424.011,84	R\$ 167.849,79	R\$ 285.648,71	R\$ 17.441.948,97	R\$ 135.736,05	0,7835 %	Assinatura	1,33 %
MAIO	R\$ 17.441.948,97	R\$ 184.238,50	R\$ 185.684,68	R\$ 17.646.163,18	R\$ 205.660,39	1,1827 %	Assinatura	1,33 %
JUNHO	R\$ 17.646.163,18	R\$ 261.510,36	R\$ 258.007,73	R\$ 17.807.762,71	R\$ 158.096,90	0,9014 %	Assinatura	121,92 %
JULHO	R\$ 17.807.762,71	R\$ 1.796.570,70	R\$ 1.010.127,37	R\$ 18.835.670,06	R\$ 241.464,02	1,3347 %	Assinatura	158,93 %
AGOSTO	R\$ 18.835.670,06	R\$ 909.268,96	R\$ 322.836,03	R\$ 19.352.787,78	R\$ -69.315,21	-0,3592 %	Assinatura	-49,95 %
SETEMBRO	R\$ 19.352.787,78	R\$ 1.109.587,73	R\$ 742.984,44	R\$ 19.636.885,97	R\$ -82.505,10	-0,4122 %	Assinatura	-36,76 %
OUTUBRO	R\$ 19.636.885,97	R\$ 708.051,75	R\$ 422.156,35	R\$ 19.919.272,43	R\$ -3.508,94	-0,0161 %	Assinatura	-1,20 %
NOVEMBRO	R\$ 19.919.272,43	R\$ 1.104.550,26	R\$ 435.148,31	R\$ 20.737.774,42	R\$ 149.100,04	0,7313 %	Assinatura	53,28 %
DEZEMBRO	R\$ 20.737.774,42	R\$ 1.966.704,43	R\$ 1.395.169,52	R\$ 21.671.389,12	R\$ 362.079,79	1,7619 %	Assinatura	0,00 %
TOTAIS		R\$ 11.698.262,62	R\$ 8.033.079,77		R\$ 1.050.873,36	5,89	Assinatura	67,83

Relatório competência: 12/2020



Gráfico - Retorno acumulado no ano



Relatório competência: 12/2020

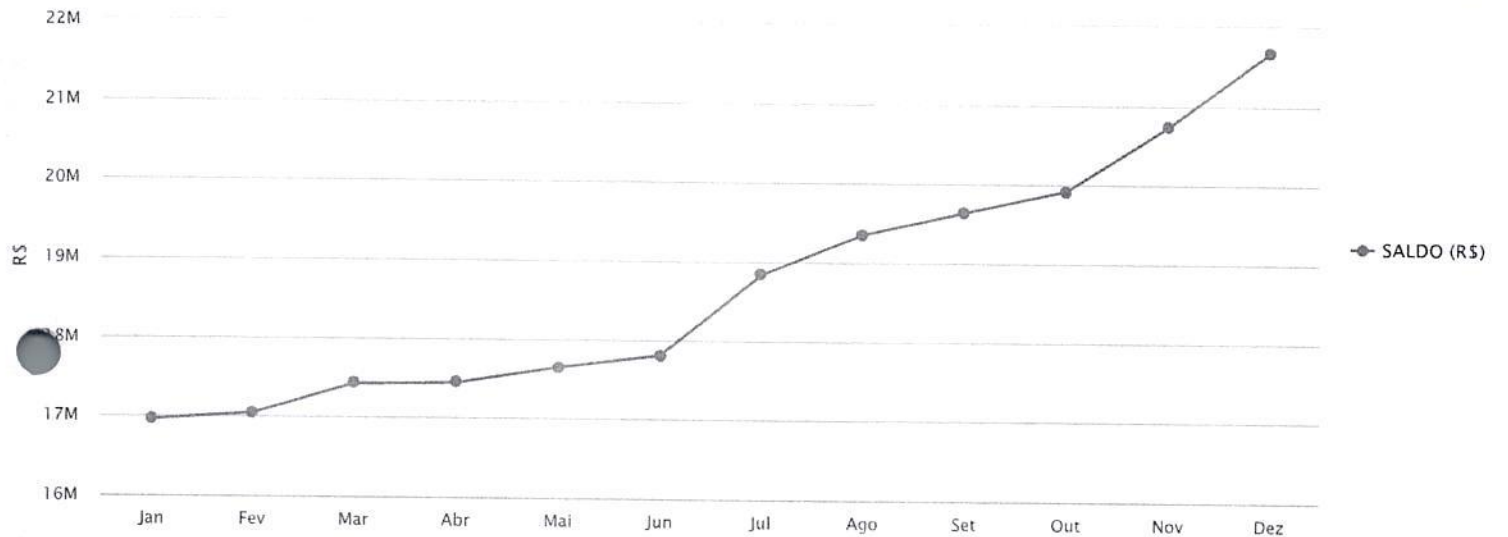


EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO X RENTABILIDADE MONETÁRIA



MESES	JANEIRO	FEVEREIRO	MARÇO	ABRIL	MAIO	JUNHO	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO
SALDO (R\$)	16.962.920,91	17.045.374,43	17.424.011,84	17.441.948,97	17.646.163,18	17.807.762,71	18.835.670,06	19.352.787,78	19.636.885,97	19.919.272,43	20.737.774,42	21.671.389,12
RETORNO (R\$)	90.863,55	92.312,33	-229.110,46	135.736,05	205.660,39	158.096,90	241.464,02	-69.315,21	-82.505,10	-3.508,94	149.100,04	352.079,79

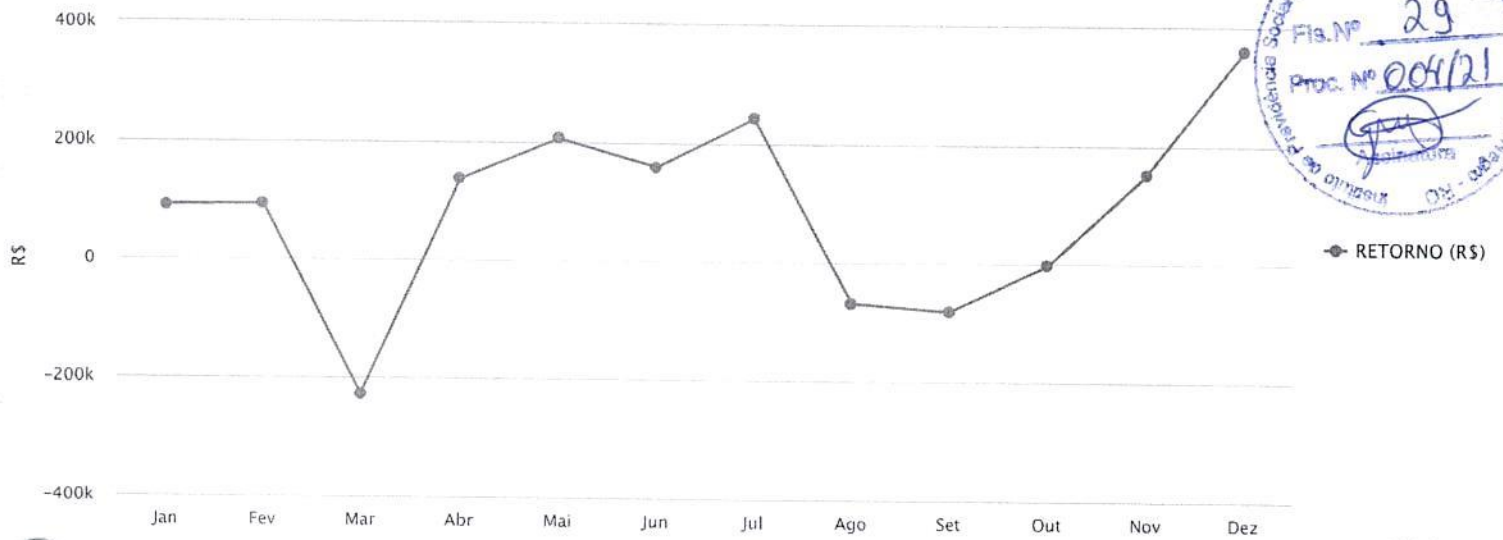
REFERENTE AO SALDO (R\$)



Relatório competência: 12/2020



REFERENTE AO RETORNO (R\$)



Highcharts.com

Relatório competência: 12/2020



MEDIDA DE RISCO

GESTÃO DE RISCO - MERCADO: O valor dos ativos que compõem a carteira do fundo pode aumentar ou diminuir de acordo com flutuações de preços e cotações de mercado, mudanças no cenário político e econômico, alterações nas taxas de juros e, ainda, com os resultados das empresas emissores de valores mobiliários (ações, debêntures, notas promissórias, entre outros).

Índice Sharpe: O índice de Sharpe é uma medida que permite a classificação do fundo em termos de desempenho global, sendo considerados melhores os fundos com maior índice. Vale lembrar ainda que o índice varia se o resultado for calculado com base em rentabilidades semanais, mensais ou anuais.

Var - Value at Risk: Value-at-risk ou Valor sob Risco pode ser definido como perda máxima, num determinado período, sob condições normais de mercado, com determinado grau de confiança.

FUNDO	BENCHMARK	VAR 12 MESES	SHARPE	VOLATILIDADE 3 MESES	VOLATILIDADE 6 MESES	VOLATILIDADE 12 MESES
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	CDI	0,62 %	-3,77 %	0,12 %	0,20 %	0,29%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA 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 IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	IRF-M	5,91 %	1,87 %	1,75 %	2,62 %	2,71%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	IRF-M1	0,94 %	2,12 %	0,44 %	0,43 %	0,43%
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS	IRF-M1	0,93 %	2,05 %	0,40 %	0,42 %	0,43%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IDKA 2	6,06 %	0,89 %	3,97 %	3,42 %	2,79%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B 5+	34,39 %	0,21 %	22,08 %	19,28 %	15,81%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B 5	7,74 %	0,96 %	4,77 %	4,27 %	3,56%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	23,25 %	0,33 %	14,89 %	12,96 %	10,68%
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 IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IRF-M1+	8,26 %	1,79 %	2,79 %	3,82 %	3,79%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA	IPCA	8,15 %	1,99 %	1,73 %	2,68 %	3,74%
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IDKA PRÉ 2	IDKA 2	6,78 %	0,23 %	3,99 %	3,83 %	3,12%

Relatório competência: 12/2020



PROVISÃO DE RISCO - INDICATIVO

FUNDO	CNPJ	BENCHMARK	SALDO (R\$)	VAR 12 MESES	VOLATILIDADE 12 MESES	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	13.077.415/0001-05	CDI	2.097,96	0,62 %	0,29 %	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	13.077.415/0001-05	CDI	0,00	0,62 %	0,29 %	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	07.111.384/0001-69	IRF-M	3.480.939,97	5,91 %	2,71 %	205.723,55
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	11.328.882/0001-35	IRF-M1	3.167.136,09	0,94 %	0,43 %	29.771,08
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS	11.484.558/0001-06	IRF-M1	1.623.173,06	0,93 %	0,43 %	15.095,51
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	14.386.926/0001-71	IDKA 2	3.476.970,47	6,06 %	2,79 %	210.704,41
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	10.577.503/0001-88	IMA-B 5+	1.232.913,39	34,39 %	15,81 %	423.998,91
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	11.060.913/0001-10	IMA-B 5	1.169.046,55	7,74 %	3,56 %	90.484,20
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	10.740.658/0001-93	IMA-B	1.108.047,82	23,25 %	10,68 %	257.621,12
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	IRF-M1	3.201.078,38	0,93 %	0,43 %	29.770,03
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	10.577.519/0001-90	IRF-M1+	766.737,94	8,26 %	3,79 %	63.332,55
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA	23.215.097/0001-55	IPCA	1.193.606,69	8,15 %	3,74 %	97.278,95
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IDKA PRÉ 2	24.022.566/0001-82	IDKA 2	1.249.640,80	6,78 %	3,12 %	84.725,65

RISCO DE MERCADO	
Saldo Total:	R\$ 21.671.389,12
Provisão para perda e Investimentos:	R\$ 1.508.518,97
% Provisão de Perda:	6,961%

Relatório competência: 12/2020



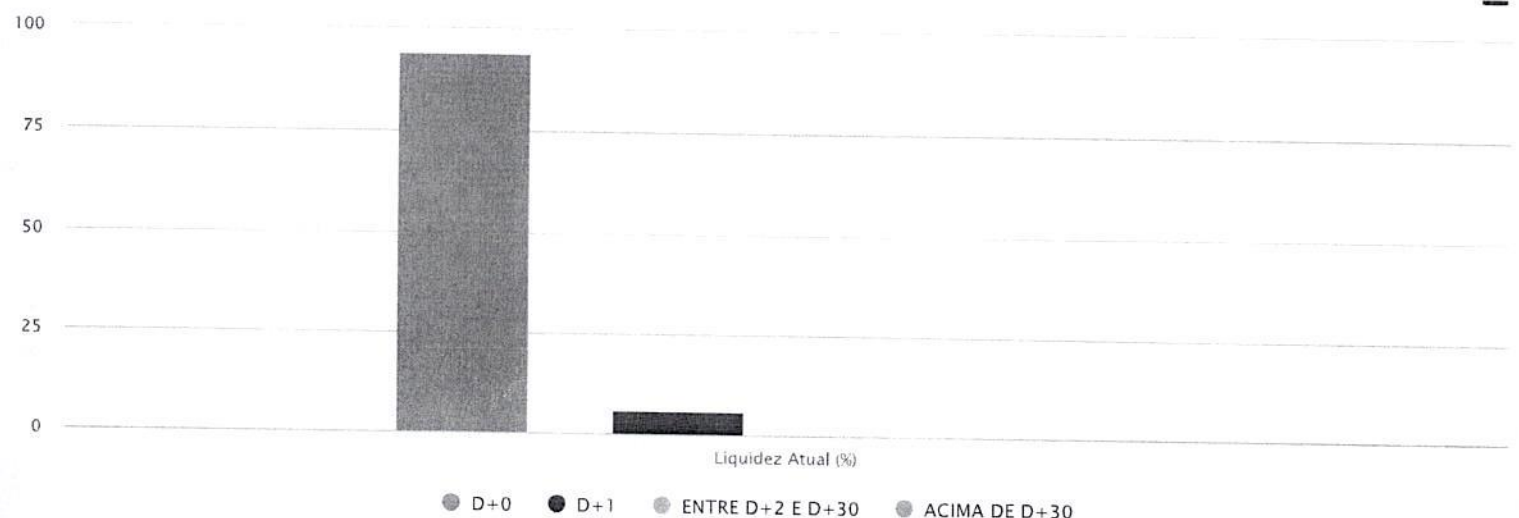
RISCO DE LIQUIDEZ

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	2.097,96	0,01 %	743	0,00 %	2.452.222.466,54	Art 7º, IV "a"	Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	D + 0	0,00	0,00 %	743	0,00 %	2.452.222.466,54	Art 7º, IV "a"	Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 0	3.480.939,97	16,06 %	701	0,04 %	8.554.614.280,00	Art 7º, I, "b"	Médio
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D + 0	3.167.136,09	14,61 %	1225	0,04 %	8.522.749.810,66	Art 7º, I, "b"	Baixo
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS	D + 0	1.623.173,06	7,49 %	265	0,19 %	842.553.482,20	Art 7º, I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	3.476.970,47	16,04 %	1005	0,03 %	10.655.087.063,09	Art 7º, I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	1.232.913,39	5,69 %	322	0,07 %	1.733.830.686,04	Art 7º, I, "b"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	1.169.046,55	5,39 %	976	0,01 %	20.761.505.098,56	Art 7º, I, "b"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	1.108.047,82	5,11 %	899	0,02 %	6.193.173.925,17	Art 7º, I, "b"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	3.201.078,38	14,77 %	1361	0,02 %	16.753.976.831,37	Art 7º, I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	766.737,94	3,54 %	375	0,03 %	2.814.559.159,07	Art 7º, I, "b"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA	D + 0	1.193.606,69	5,51 %	885	0,01 %	14.722.139.597,34	Art 7º, I, "b"	Baixo
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IDKA PRÉ 2	D + 1	1.249.640,80	5,77 %	123	0,19 %	647.244.636,29	Art 7º, I, "b"	Alto

TOTAL SALDO: R\$ 21.671.389,12

PRAZO DE RESGATE	QUANTIDADE DE FUNDOS	LIQUIDEZ ATUAL
D+0	12	94%
D+1	1	6%
ENTRE D+2 E D+30	0	0%
ACIMA DE D+30	0	0%

Gráfico







RISCO DE CRÉDITO

RENDA FIXA - ARTIGOS	LIMITE DA RESOLUÇÃO	LIMITE POLÍTICA	TOTAL	% CARTEIRA
Art 7º, I, "b"	100 %	100 %	21.669.291,16	99,99
Art 7º, IV "a"	40 %	40 %	2.097,96	0,01
			21.671.389,12	

RISCO DE CRÉDITO	% CARTEIRA
100% Títulos Públicos e 0% Títulos Privados	100,00%
50% Títulos Públicos e 50% Títulos Privados	0,00%
0% Títulos Públicos e 100% Títulos Privados	0,00%



Relatório competência: 12/2020



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%

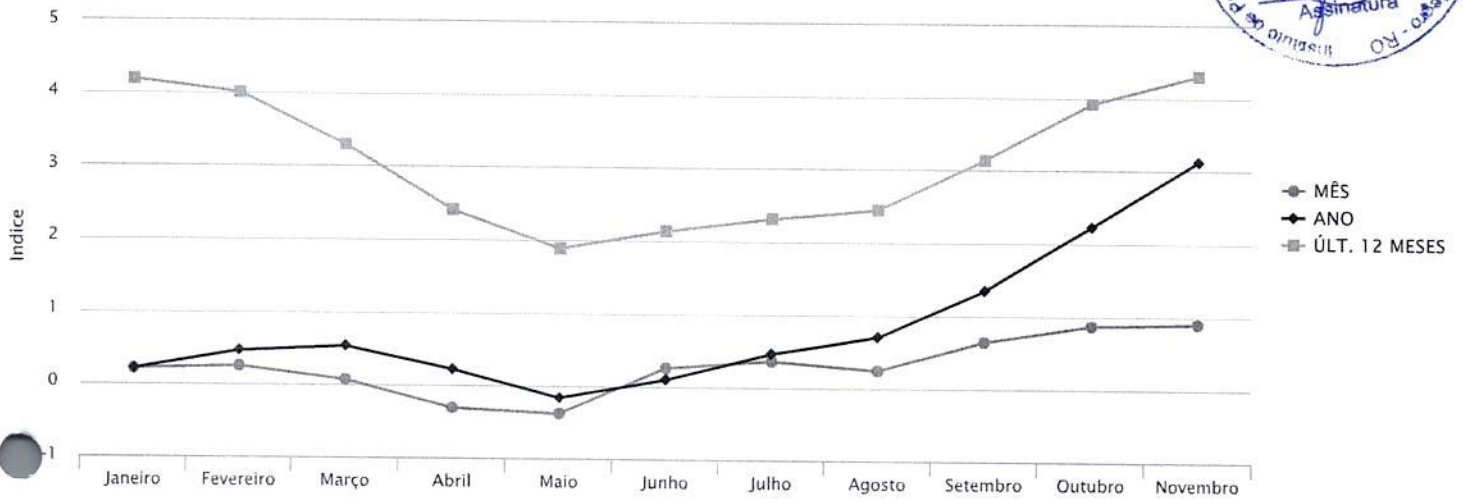
PERCENTUAL MÍNIMO DE ALOCAÇÃO DA CARTEIRA TOTAL DO RPPS EM PRODUTOS COM CAPITAL INVESTIDO PROTEGIDO: 80% do Patrimônio Líquido do RPPS, apurado concomitantemente na data de fechamento dos dados para envio do DAIR ao Ministério da Previdência Social - MPS.

Relatório competência: 12/2020



ÍNDICES ECONÔMICOS

IPCA 2020

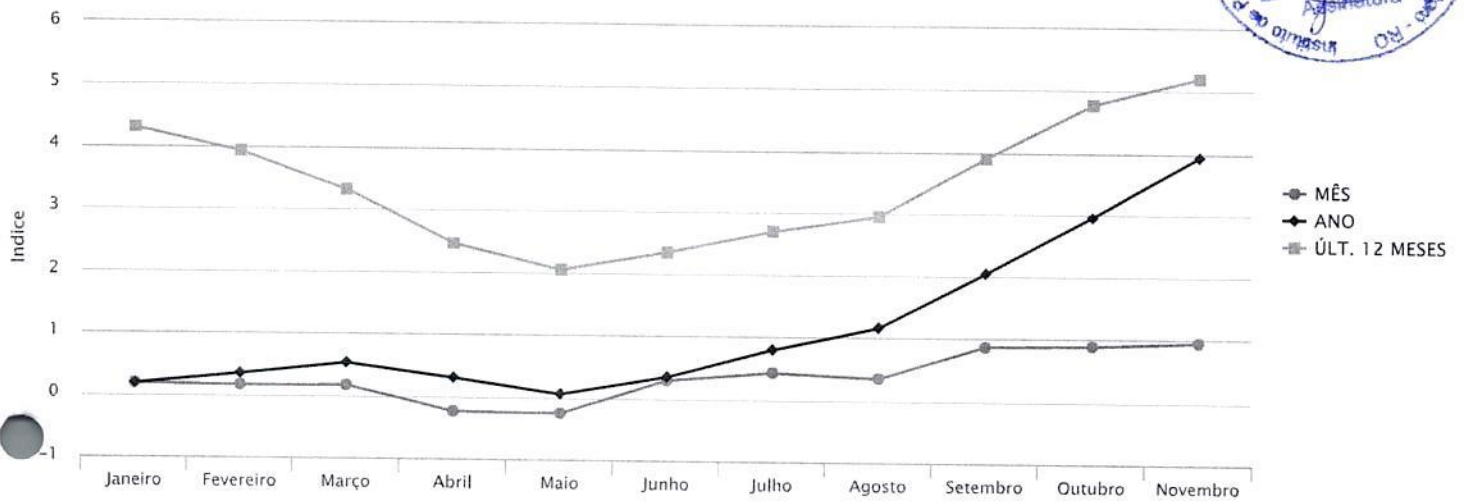


Highcharts.com

2020	Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Maio	Junho	Julho	Agosto	Setembro	Outubro	Novembro	Dezembro
MÊS	0.2100	0.2500	0.0700	-0.3100	-0.3800	0.2600	0.3600	0.2400	0.6400	0.8600	0.8900	
ANO	0.2100	0.4600	0.5300	0.2200	-0.1600	0.1000	0.4600	0.7000	1.3400	2.2200	3.1300	
ULT. 12 M	4.1900	4.0100	3.3000	2.4000	1.8800	2.1300	2.3100	2.4400	3.1400	3.9200	4.3100	



INPC
2020

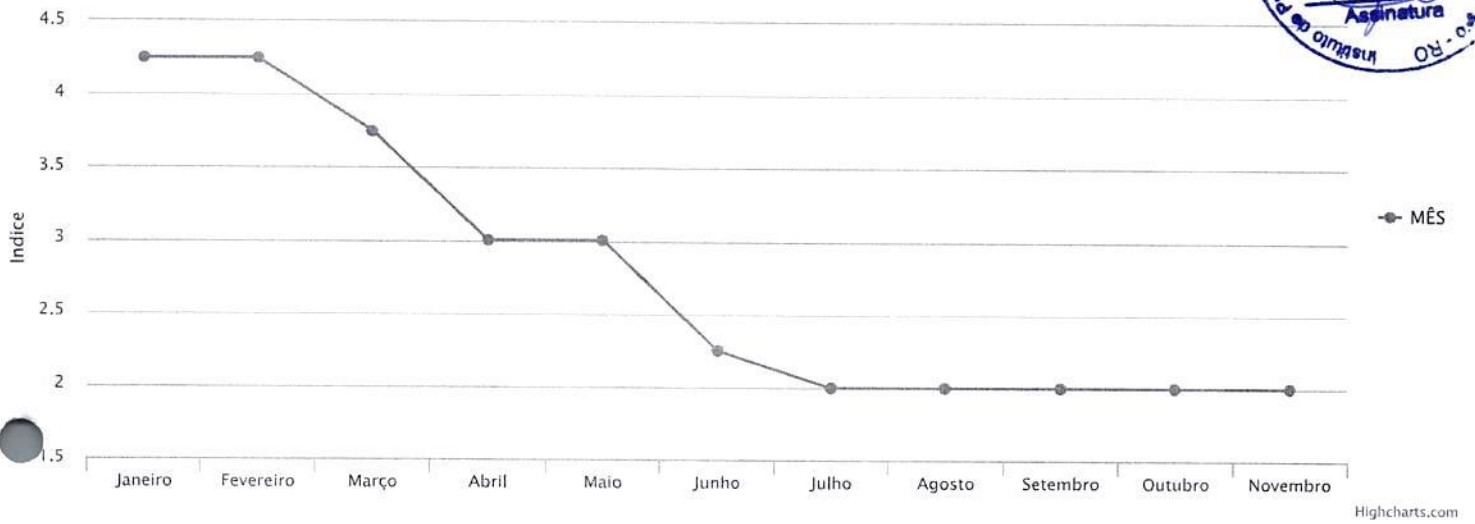


Highcharts.com

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	0.8700	0.8900	0.9500	
ANO	0.1900	0.3600	0.5400	0.3100	0.0600	0.3600	0.8000	1.1600	2.0400	2.9500	3.9300	
ULT. 12 M	4.3000	3.9200	3.3100	2.4600	2.0500	2.3500	2.6900	2.9400	3.8900	4.7700	5.2000	



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	2.00	2.00	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 12/2020: R\$ 2.097,96
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: 01/12/2015
Valor da Cota: R\$ 2,114243124	Quantidade de Cotas: 992,2984	PL do Fundo: R\$ 2.452.222.466,54
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,01%	Limite do Fundo: 40%

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 12/2020: R\$ 0,00
Administrador: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	CNPJ: 30.822.936/0001-69	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: FI RENDA FIXA GERAL Art 7º, IV "a"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/12/2015
Valor da Cota: R\$ 2,114243124	Quantidade de Cotas: 0,0000	PL do Fundo: R\$ 2.452.222.466,54
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,00%	Limite do Fundo: 40%

Renda Fixa	Tipo: Fundo de Investimento	Benchmark: IRF-M
Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	CNPJ: 71.113.840/0016-9	Saldo em 12/2020: R\$ 3.480.939,97
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: 29/03/2018
Valor da Cota: R\$ 6,147950647	Quantidade de Cotas: 566.195,1713	PL do Fundo: R\$ 8.554.614.280,00
% do PL do Fundo: 0,04%	Limite Cumulativo: 16,06%	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 12/2020: R\$ 3.167.136,09
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: 01/12/2015
Valor da Cota: R\$ 2,725126527	Quantidade de Cotas: 1.162.197,8131	PL do Fundo: R\$ 8.522.749.810,66
% do PL do Fundo: 0,04%	Limite Cumulativo: 14,61%	Limite do Fundo: 100%

Renda Fixa	Tipo: Fundo de Investimento	Benchmark: IRF-M1
Fundo: BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS	CNPJ: 11.484.558/0001-06	Saldo em 12/2020: R\$ 1.623.173,06
Administrador: BANCO BRADESCO S.A	CNPJ: 60.746.948/0001-12	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: FI 100 TÍTULOS TN Art 7º, I, "b"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 12/02/2020
Valor da Cota: R\$ 2,575566100	Quantidade de Cotas: 630.219,9194	PL do Fundo: R\$ 842.553.482,20
% do PL do Fundo: 0,19%	Limite Cumulativo: 7,49%	Limite do Fundo: 100%

Renda Fixa	Tipo: Fundo de Investimento	Benchmark: IDKA 2
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CNPJ: 14.386.926/0001-71	Saldo em 12/2020: R\$ 3.476.970,47
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: 01/12/2015
Valor da Cota: R\$ 2,397167000	Quantidade de Cotas: 1.450.449,8310	PL do Fundo: R\$ 10.655.087.063,09
% do PL do Fundo: 0,03%	Limite Cumulativo: 16,04%	Limite do Fundo: 100%

Renda Fixa	Tipo: Fundo de Investimento	Benchmark: IMA-B 5+
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA B 5+ TITULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CNPJ: 10.577.503/0001-88	Saldo em 12/2020: R\$ 1.232.913,39
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: 28/02/2019
Valor da Cota: R\$ 2,811806000	Quantidade de Cotas: 438.477,4021	PL do Fundo: R\$ 1.733.830.686,04
% do PL do Fundo: 0,07%	Limite Cumulativo: 5,69%	Limite do Fundo: 100%

Renda Fixa	Tipo: Fundo de Investimento	Benchmark: IMA-B 5
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CNPJ: 11.060.913/0001-10	Saldo em 12/2020: R\$ 1.169.046,55
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: 28/02/2019
Valor da Cota: R\$ 3,228834000	Quantidade de Cotas: 362.064,6184	PL do Fundo: R\$ 20.761.505.098,56
% do PL do Fundo: 0,01%	Limite Cumulativo: 5,39%	Limite do Fundo: 100%

Renda Fixa	Tipo: Fundo de Investimento	Benchmark: IMA-B
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CNPJ: 10.740.658/0001-93	Saldo em 12/2020: R\$ 1.108.047,82
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: 28/02/2019
Valor da Cota: R\$ 3,694048000	Quantidade de Cotas: 299.954,9058	PL do Fundo: R\$ 6.193.173.925,17
% do PL do Fundo: 0,02%	Limite Cumulativo: 5,11%	Limite do Fundo: 100%

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 12/2020: R\$ 3.201.078,38
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: 00/12/2015

Valor da Cota: R\$ 2,613017000	Quantidade de Cotas: 1.225.050,7287	PL do Fundo: R\$ 16.753.976.831,37
% do PL do Fundo: 0,02%	Limite Cumulativo: 14,77%	Limite do Fundo: 100%
Renda Fixa Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL Resolução 3.922/2010: FI 100 TÍTULOS TN Art 7º, I, "b" Valor da Cota: R\$ 2,589171000 % do PL do Fundo: 0,03%		
	Tipo: Fundo de Investimento	Benchmark: IRF-M 1+
	CNPJ: 10.577.519/0001-90	Saldo em 12/2020: R\$ 766.737,94
	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%
	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 29/03/2019
	Quantidade de Cotas: 296.132,6000	PL do Fundo: R\$ 2.814.359.159,03
	Limite Cumulativo: 3,54%	Limite do Fundo: 100%

Renda Fixa	Tipo: Fundo de Investimento	Benchmark: IPCA
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA	CNPJ: 23.215.097/0001-55	Saldo em 12/2020: R\$ 1.193.606,69
Administrador: CAIXA ECONÔMICA 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: 28/02/2019
Valor da Cota: R\$ 1,514367000	Quantidade de Cotas: 788.188,5237	PL do Fundo: R\$ 14.722.139.597,34
% do PL do Fundo: 0,01%	Limite Cumulativo: 5,51%	Limite do Fundo: 100%

Renda Fixa	Tipo: Fundo de Investimento	Benchmark: IDKA 2
Fundo: BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IDKA PRÉ 2	CNPJ: 24.022.566/0001-82	Saldo em 12/2020: R\$ 1.249.640,80
Administrador: BANCO BRADESCO S.A.	CNPJ: 60.746.948/0001-12	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: FI 100 TÍTULOS TN Art 7º, I, "b"	Disponibilidade: D + 1	Adesão: 12/02/2020
Valor da Cota: R\$ 1,692817700	Quantidade de Cotas: 738.201,6386	PL do Fundo: R\$ 647.244.636,29
% do PL do Fundo: 0,19%	Limite Cumulativo: 5,77%	Limite do Fundo: 100%

TOTAL: R\$ 21.671.389,12

Relatório competência: 12/2020



CARTEIRA SUGERIDA ESTRATEGIA PRÓXIMO MÊS - PERFIL CONSERVADOR

CARTEIRA ATUAL			MOVIMENTAÇÕES	CARTEIRA SUGERIDA	
ÍNDICE	SALDO ATUAL	% CAPITAL	APLICAR / RESGATAR	SALDO FINAL	% CAPITAL
FIDC	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
CRED PRIVADO	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
MULTIMERCADO	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
GERAL	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IPCA	1.193.606,69	5,51	486,85	1.194.093,54	5,51
IMA-B	1.108.047,82	5,11	-24.478,36	1.083.569,46	5,00
IMA-B 5	1.169.046,55	5,39	2.081.661,82	3.250.708,37	15,00
IMA-B 5+	1.232.913,39	5,69	-1.232.913,39	0,00	0,00
IDKA 2	4.726.611,27	21,81	-1.475.902,90	3.250.708,37	15,00
IDKA 20	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IRF-M	3.480.939,97	16,06	-230.231,60	3.250.708,37	15,00
IRF-M1	7.991.387,53	36,88	-4.740.679,16	3.250.708,37	15,00
IRF-M1+	766.737,94	3,54	429,23	767.167,17	3,54
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	2.097,96	0,01	2.165.040,95	2.167.138,91	10,00
ALOCÇÃO ATIVA	0,00	0,00	3.456.586,56	3.456.586,56	15,95
TOTAL:	21.671.389,12	100,00		21.671.389,12	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: 12/2020



ESTRATEGIA PRÓXIMO MÊS - PERFIL MODERADO

ÍNDICE	CARTEIRA ATUAL		MOVIMENTAÇÕES		CARTEIRA SUGERIDA	
	SALDO ATUAL	% CAPITAL	APLICAR / RESGATAR		SALDO FINAL	% CAPITAL
FIDC	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00
CRED PRIVADO	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00
MULTIMERCADO	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00
GERAL	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00
IPCA	1.193.606,69	5,51	486,85		1.194.093,54	5,51
IMA-B	1.108.047,82	5,11	1.059.091,09		2.167.138,91	10,00
IMA-B 5	1.169.046,55	5,39	2.081.661,82		3.250.708,37	15,00
IMA-B 5+	1.232.913,39	5,69	-149.343,93		1.083.569,46	5,00
IDKA 2	4.726.611,27	21,81	-1.475.902,90		3.250.708,37	15,00
IDKA 20	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00
IRF-M	3.480.939,97	16,06	-230.231,60		3.250.708,37	15,00
IRF-M1	7.991.387,53	36,88	-4.740.679,16		3.250.708,37	15,00
IRF-M1+	766.737,94	3,54	429,23		767.167,17	3,54
AÇ	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	2.097,96	0,01	1.081.471,50		1.083.569,46	5,00
ALOCÇÃO ATIVA	0,00	0,00	2.373.017,11		2.373.017,11	10,95
TOTAL:	21.671.389,12	100,00			21.671.389,12	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.

Kauro Fernando de Blasi

DI BLASI CONSULTORIA FINANCEIRA LTDA
CNPJ 03.866.812/0001-02
CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS HABILITADA PELA COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS - CVM

Relatório competência: 12/2020