



COMITÊ DE INVESTIMENTOS

ATA DE REUNIÃO - 06/2020

Ata de número 06/2020 da reunião do Comitê de Investimentos do Instituto de Previdência Social dos Servidores Públicos de Paragominas-COINVEST realizada em 30 de setembro 2020.

Aos trinta dias do mês de setembro de 2020 às 09:00 horas reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos do IPMP – COINVEST - **Ráulison Dias Pereira**, - CGRPPS APIMEC nº 096/2009; **D Anderson Elias Oliveira**, CGRPPS nº 3711/2019, **Danilo dos Santos Ananias**, CGRPPS APIMEC nº 4319/2020, e **Maria da Conceição Vasconcelos da Fonsêca Cordeiro** (Suplente/assistente), todos nomeados pela portaria municipal 024/2020 para o acompanhamento da Política de investimentos executada em 2020, objetivando a análise do cenário econômico e tomada de decisões. O presidente do Comitê Ráulison Dias Pereira disponibilizou para demais membros cópias dos relatórios de investimentos que compõem a carteira de ativos financeiros do IPMP referentes ao mês de agosto de 2020 através do qual está demonstrado o desempenho da carteira no final do período. O Comitê constatou a posição da carteira em 30 de agosto/2020 com um PL investido no valor de R\$ 230.813.019,54 distribuídos em 28 fundos de investimentos, conforme relatório do período em anexo que contém as informações extraídas dos extratos bancários, com indicadores dos resultados obtidos, investimentos estes adequados com as normas específicas do Conselho Monetário Nacional – CMN – (Resolução 3922/2010). No mês de agosto a carteira registrou uma rentabilidade negativa de R\$ --1.991.816,49 cujo resultado consolidado da carteira foi de -0,9667 % correspondentes a -134,41 % da meta atuarial do mês de agosto que foi de 0,72 %. As operações de resgates somaram o valor de R\$ 37.078.280,88 e as aplicações registradas no período foram R\$ 38.501.255,80 – O comentário anexo ao relatório da **DI BLASI CONSULTORIA FINANCEIRA LTDA**, empresa especializada que presta consultoria ao IPMP, sintetizou os acontecimentos do mercado no período em análise.



COMITÊ DE INVESTIMENTOS

COMENTÁRIO AGOSTO 2020:

"Em agosto, os debates dentro da esfera governamental acerca de eventual ruptura do teto de gastos e orçamento de 2021 fizeram com que os mercados colocassem em dúvida a trajetória da dívida pública, com o aumento das incertezas fiscais ocasionando maior volatilidade para os investimentos. No cenário doméstico, mesmo com a taxa de juros Selic a 2% ao ano, a bolsa também sentiu o aumento do risco-país em função das incertezas fiscais, embora ainda apresente potencial de valorização para os próximos meses. No cenário externo, a postura expansionista do FED – Banco Central Norte Americano, voltada à recuperação da atividade econômica com a ampliação do pacote de estímulos fiscais trouxe desempenho bastante positivo para os ativos globais, inclusive com a sinalização de longo período com taxa de juro em patamares baixos. O Real teve desvalorização em agosto, apesar do dólar mais fraco em termos globais. O PIB do 2º trimestre de 2020, divulgado pelo IBGE, recuou 9,7% em relação ao 1º trimestre de 2020. O mercado espera recuperação em ritmo acelerado no 3º trimestre de 2020 em função do relaxamento do isolamento social e do volume de recursos investidos na economia na forma de auxílios emergenciais".

"Produto Interno Bruto (PIB) -5,28% Inflação 1,71% Taxa básica de juros (Selic) 2,00% Dólar R\$ 5,25 Balança comercial (saldo) US\$ 55 bilhões Investimento estrangeiro direto US\$ 55 bilhões Fonte: Banco Central Índice de Referência (IPCA + 5,89% aa) – Expectativa 2020 7,70% ao ano Índice de Referência (INPC + 4,00% aa) – Expectativa 2020 5,78% ao ano".

"Em relação as expectativas de mercado, vide abaixo algumas estimativas:"

ESTIMATIVAS DO RELATÓRIO FOCUS PREVISÃO 2020.	
Produto Interno Bruto (PIB)	-5,28 %
Inflação	1,71% %
Taxa básica de juros (Selic)	2,00 %
Dólar	R\$ 5,25
Balança comercial (saldo)	US\$ 55 bilhões
Investimento estrangeiro direto US\$ 55 bilhões	US\$ 55 bilhões

Fonte: Banco Central

Índice de Referência (IPCA + 5,89% aa) – Expectativa 2020 7,703% ao ano
Índice de Referência (INPC + 4,00% aa) – Expectativa 2020 5,78% 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. Por conta das incertezas fiscais, houve aumento das taxas de juro de longo prazo. 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) no vencimento mais longo somente (vide terceira coluna da esquerda para a direita). A inflação projetada para o ano de 2020 está em 1,71%:"

Prazo de Vencimento	Tipo de Fundo de Investimento	Taxa de juro REAL ao ano	Inflação projetada IPCA	Rentabilidade Total NOMINAL ao ano
15/03/2023	IMA-B 0,29%	0,29%	1,71%	2,00%
15/05/2023	IMA-B	0,31%	1,71	2,02

IPMP – Instituto de Previdência Social dos Servidores Públicos Municipais de Paragominas

CNPJ: 00.978.716/0001-68 – Rua 31 de março – 221 – Centro

Fones: (91) 3729-3685/3193 – CEP: 68.625-170 – Paragominas-PA - e-mail: ipmpgn@gmail.com



COMITÊ DE INVESTIMENTOS

15/08/2024	IMA-B 5	1,30%	1,71%	3,03%
15/08/2030	IMA-B 5+	3,00%	1,71	4,76%
15/05/2055	IMA-B 5	4,02%	1,71%	5,80%

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 2021 a 2024".

Vencimento	Tipo de Fundo de Investimento	Rentabilidade Total ao ano
2021	IRF-M 1	2,64%
2023	IRF-M	4,70%
2024	IRF-M 1+	5,22%

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 2,64% e 5,22% 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. Num ambiente de incerteza, a utilização dos fundos de investimentos "flexíveis" (que permitem mudanças de posição da carteira dentro do próprio fundo de investimento) combina uma estratégia interessante para enfrentar períodos de oscilações nos rendimentos."
- 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 patamares baixos ao longo do 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".

O Comitê constatou ainda que, o IPMP está executando a sua política de investimentos corretamente no decorrer do ano de 2020 devidamente enquadrada com os limites e critérios estabelecidos pela Resolução 3922/10. O desenquadramento observado em agosto no seguimento de renda variável especificamente FI DE AÇÕES GERAL - Art 8º, II, "a", superior a 20% (20,70 %), do PL do Instituto, se verifica devido à forte valorização dos ativos nos períodos; abril, maio, junho e julho/2020. Considerando a recente redução da taxa básica de juros para o nível de 2,00% aa e considerando ainda que a economia brasileira deve registrar recuperação nos próximos meses, em que o cenário atual sugere aos investidores institucionais estratégias de recomposição das carteiras de investimentos em decorrência da crise de alcance mundial causada pela pandemia da COVID 19, o COINVEST decide por

IPMP – Instituto de Previdência Social dos Servidores Públicos Municipais de Paragominas

CNPJ: 00.978.716/0001-68 – Rua 31 de março – 221 – Centro

Fones: (91) 3729-3685/3193 – CEP: 68.625-170 – Paragominas-PA - e-mail: ipmpgn@gmail.com



COMITÊ DE INVESTIMENTOS

recomendar a continuação da estratégia de realocação de recursos em fundos elegíveis tendo em vista o reequilíbrio da carteira de investimentos concluindo por aprovar o relatório mensal de investimentos que apresenta o acompanhamento da rentabilidade e dos riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do RPPS e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política Anual de Investimentos do exercício de 2020. Como não houve mais nada a ser tratado, o presidente do Comitê de Investimentos **Ráulison Dias Pereira**, deu por encerrada a reunião às 16:30 horas do mesmo dia, e eu **Maria da Conceição Vasconcelos da Fonsêca Cordeiro**, lavrei a presente ata que vai assinada por mim e pelos demais membros do Comitê de Investimentos do IPMP (COINVEST) presentes na reunião, a qual, por determinação do presidente será encaminhada ao Conselho Administrativo do IPMP juntamente com os relatório correspondente ao mês de agosto/2020 e o Parecer emitido nesta mesma data. Paragominas – PA, 30 de setembro de 2020.

Ráulison Dias Pereira
Portaria nº 017/2020
CGRPPS APIMEC nº 096/09

D Anderson Elias Oliveira,
CGRPPS nº 3711/2019,
Portaria Municipal 024/2020

Danilo dos Santos Ananias,
CGRPPS APIMEC nº 4319/2020
Portaria Municipal 024/2020

Maria da Conceição Vasconcelos da Fonsêca Cordeiro
Membro Suplente
Portaria Municipal 024/2020



CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - FECHAMENTO EM 30/08/2020

INSTITUIÇÃO	CNPJ DO FUNDO	NOME DO FUNDO DE INVESTIMENTO	valor da cota	Quant Cotas	Financeiro	% PL INST.	PL FUNDO R\$	% PL DO FUNDO	RETORNO NO MÊS %	RETORNO EM REAIS
B. BRASIL	07.861.564/0001-22	BB PREV RENDA FIXA IMA-B	5.506450885	81.263.1238	R\$ 447.471,40	0,19%	R\$ 1.463.118.783,05	0,03	2,03136	R\$ 8.660,34
	11.328.882/0001-35	BB PREV RF IRR-M1 TIT PUB-FIC	1.603609324	4.530.944.9567	R\$ 7.265.865,64	3,16%	R\$ 7.792.694.548,07	0,09	0,25672	R\$ 31.305,12
	13.077.418/0001-49	BB PREV RF PERIL	1.066275683	12.280.151,8102	R\$ 13.094.029,07	5,67%	R\$ 2.439.956.346,20	0,54	0,26007	R\$ 73.131,73
	13.322.205/0001-35	BB PREVID RF IDXA 2 TP	2.797775636	4.165.783.6537	R\$ 11.654.943,51	5,05%	R\$ 6.212.456.601,64	0,19	1,21301	R\$ 137.619,62
C E F	19.303.795/0001-35	BB PREV RF TP IPCA III FI (2024)	1.41489778	426.873.9600	R\$ 602.566,12	0,26%	R\$ 893.476.505,39	0,07	1,08939	R\$ 10.166,44
	13.077.415/0001-05	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	1.496119849	13.367.2100	R\$ 19.944.810,64	0,94%	R\$ 1.768.065.678,44	0,12	0,12916	R\$ 1.354,65
	13.077.415/0001-05	BB PREV RF FLUXO - CC 35.859-2	7.55253409	288.514.9930	R\$ 2.179.019,32	0,00%	R\$ 1.768.065.678,44	0,00	0,12916	R\$ 46,85
	10.740.658/0001-53	CAIXA FI BRASIL IMA-B TIT PUBL RF	3.50181800	1.708.131.2650	R\$ 5.981.564,81	2,59%	R\$ 5.979.262.081,07	0,10	2,02820	R\$ 115.887,91
BRADESCO	10.646.895/0001-90	CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RF LP	3.73025699	2.947.193.2621	R\$ 10.993.788,28	4,76%	R\$ 2.894.677.261,07	0,38	2,02499	R\$ 212.955,36
	14.508.605/0001-00	CAIXA FI BRASIL IRR-M1 TP LP	2.32476800	3.768.159.0685	R\$ 8.755.446,09	3,79%	R\$ 17.164.831.983,68	0,05	0,76151	R\$ 66.480,23
	10.740.670/0001-06	CAIXA FI BRASIL IRR-M1 TP RF	2.559282500	6.676.833.8786	R\$ 17.311.861,80	7,50%	R\$ 11.257.382.974,77	0,15	0,25621	R\$ 45.335,66
	37.372.060/0001-97	CAIXA FI BRASIL RF DI LONGO PRAZO	3.71577400	4.331.528.7019	R\$ 16.094.981,73	6,97%	R\$ 5.172.945.706,81	0,31	0,24275	R\$ 38.823,49
B. SAFRA	23.215.097/0001-55	FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRAT. RF	1.49157700	16.040.096.0673	R\$ 23.925.038,37	10,37%	R\$ 12.211.119.756,17	0,20	0,74961	R\$ 177.275,14
	11.484.558/0001-06	BRADESCO FI RF ALIQUOTA IRR-M1 TP	2.56772996	201.347.0665	R\$ 514.991,43	0,22%	R\$ 980.825.577,34	0,05	0,25668	R\$ 1.329,68
	28.515.874/0001-09	BRADESCO FI RF ALOCAÇÃO DINAMICA	1.26359570	2.040.498.3832	R\$ 2.578.569,03	1,12%	R\$ 1.185.458.143,51	0,22	0,95008	R\$ 24.067,08
	21.287.421/0001-15	BRADESCO FIM MACRO INSTITUCIONAL	1.46418230	1.076.126.7000	R\$ 1.575.645,67	0,68%	R\$ 253.010.092,23	0,62	0,73887	R\$ 11.512,60
B. SICREDI	10.787.647/0001-69	SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	283.20056462	1.813.6774	R\$ 513.654,50	0,22%	R\$ 538.888.484,55	0,10	0,24742	R\$ 1.234,44
	21.595.829/0001-54	SAFRA REAIS S&P REAIS	229.50949825	6.810.3950	R\$ 1.558.283,91	0,68%	R\$ 449.269.476,57	0,35	0,90745	R\$ 12.420,47
	11.087.118/0001-15	SICREDI_FI INST. REF IMA-B LP	11.79747723	1.840.904.5934	R\$ 21.718.018,98	9,41%	R\$ 423.422.954,11	5,13	1,97762	R\$ 128.982,25
	13.081.159/0001-20	SICREDI_FI RF IRR-M1 LP	2.93558012	577.598.0224	R\$ 1.695.685,27	0,73%	R\$ 442.809.798,09	0,38	0,95800	R\$ 16.024,53
W.A - PARIBAS	19.196.599/0001-09	SICREDI FI INSTITUCIONAL RE IRR-M1 LP	0.65622787	12.520.554.5934	R\$ 7.953.405,21	3,45%	R\$ 304.243.514,24	2,61	0,33103	R\$ 76.499,05
	17.517.577/0001-78	W.A IMA-B 5 ATIVO RENDA FIXA	2.36641249	351.329.2140	R\$ 831.389,84	0,36%	R\$ 608.337.847,65	0,14	1,41285	R\$ 11.412,30
	17.453.850/0001-48	W.A US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	3.66006882	1.175.870.2554	R\$ 4.327.301,10	1,87%	R\$ 896.638.662,93	0,48	0,84694	R\$ 32.177,44
	07.899.238/0001-40	META VALOR FIA FUNDO DE AÇÕES	3.47008819	4.858.947.2928	R\$ 16.860.975,63	7,31%	R\$ 236.637.144,44	7,13	10,80990	R\$ 1.191.626,38
QUELUZ - BEM	09.289.072/0001-75	QUELUZ VALOR FIA	2.86995220	4.291.322.2931	R\$ 12.315.889,83	5,34%	R\$ 99.594.425,66	12,37	7,49728	R\$ 807.571,50
BNY MELON	26.956.042/0001-94	OCEANA VALOR 30 FIA	4.31249702	4.312.275.2391	R\$ 18.596.674,13	8,06%	R\$ 256.349.758,34	7,20	8,61447	R\$ 1.469.427,15
BEM (BRAD)	14.115.116/0001-80	MONGERAL AEGON INST. FIM	2.10243349	485.479.9991	R\$ 1.020.889,41	0,44%	R\$ 121.053.956,81	0,84	0,47560	R\$ 4.788,88
	16.488.768/0001-84	MONGERAL AEGON CRED. PRIV.	1.63730340	302.159.5692	R\$ 494.726,89	0,21%	R\$ 93.068.742,14	0,53	0,63594	R\$ 3.076,19
RESUMO (JUNHO / 2020)						9,1%	230.813.019,46		TOTAL	R\$ 4.701.212,18
SALDO ANTERIOR:								RETORNO		
SALDO ATUAL								0,3307%		
RETORNO								-1,5618%		
META ATUARIAL PROJETADA:								5,4742%		
META ATUARIAL ALCANÇADA:								2,8728%		
0,72 %								4,817.631,00		
-0,9667 %								2,3146%		
Atingim. = -134,41 %								4,701.212,18		
								2,3946%		
								2,7402%		
								0,9967%		
RESUMO (JUNHO / 2020)								RETORNO		
SALDO ANTERIOR:								0,3307%		
SALDO ATUAL								-1,5618%		
RETORNO								5,4742%		
META ATUARIAL PROJETADA:								2,8728%		
META ATUARIAL ALCANÇADA:								4,817.631,00		
0,72 %								2,3146%		
-0,9667 %								4,701.212,18		
Atingim. = -134,41 %								2,3946%		
								2,7402%		
								0,9967%		
RESUMO (JUNHO / 2020)								RETORNO		
SALDO ANTERIOR:								0,3307%		
SALDO ATUAL								-1,5618%		
RETORNO								5,4742%		
META ATUARIAL PROJETADA:								2,8728%		
META ATUARIAL ALCANÇADA:								4,817.631,00		
0,72 %								2,3146%		
-0,9667 %								4,701.212,18		
Atingim. = -134,41 %								2,3946%		
								2,7402%		
								0,9967%		
RESUMO (JUNHO / 2020)								RETORNO		
SALDO ANTERIOR:								0,3307%		
SALDO ATUAL								-1,5618%		
RETORNO								5,4742%		
META ATUARIAL PROJETADA:								2,8728%		
META ATUARIAL ALCANÇADA:								4,817.631,00		
0,72 %								2,3146%		
-0,9667 %								4,701.212,18		
Atingim. = -134,41 %								2,3946%		
								2,7402%		
								0,9967%		
RESUMO (JUNHO / 2020)								RETORNO		
SALDO ANTERIOR:								0,3307%		
SALDO ATUAL								-1,5618%		
RETORNO								5,4742%		
META ATUARIAL PROJETADA:								2,8728%		
META ATUARIAL ALCANÇADA:								4,817.631,00		
0,72 %								2,3146%		
-0,9667 %								4,701.212,18		
Atingim. = -134,41 %								2,3946%		
								2,7402%		
								0,9967%		
RESUMO (JUNHO / 2020)								RETORNO		
SALDO ANTERIOR:								0,3307%		
SALDO ATUAL								-1,5618%		
RETORNO								5,4742%		
META ATUARIAL PROJETADA:								2,8728%		
META ATUARIAL ALCANÇADA:								4,817.631,00		
0,72 %								2,3146%		
-0,9667 %								4,701.212,18		
Atingim. = -134,41 %								2,3946%		
								2,7402%		
								0,9967%		
RESUMO (JUNHO / 2020)								RETORNO		
SALDO ANTERIOR:								0,3307%		
SALDO ATUAL								-1,5618%		
RETORNO								5,4742%		
META ATUARIAL PROJETADA:								2,8728%		
META ATUARIAL ALCANÇADA:								4,817.631,00		
0,72 %								2,3146%		
-0,9667 %								4,701.212,18		
Atingim. = -134,41 %								2,3946%		
								2,7402%		
								0,9967%		
RESUMO (JUNHO / 2020)								RETORNO		
SALDO ANTERIOR:								0,3307%		
SALDO ATUAL								-1,5618%		
RETORNO								5,4742%		
META ATUARIAL PROJETADA:								2,8728%		
META ATUARIAL ALCANÇADA:								4,817.631,00		
0,72 %								2,3146%		
-0,9667 %								4,701.212,18		
Atingim. = -134,41 %								2,3946%		
								2,7402%		
								0,9967%		
RESUMO (JUNHO / 2020)								RETORNO		
SALDO ANTERIOR:								0,3307%		
SALDO ATUAL								-1,5618%		
RETORNO								5,4742%		
META ATUARIAL PROJETADA:								2,8728%		
META ATUARIAL ALCANÇADA:								4,817.631,00		
0,72 %								2,3146%		
-0,9667 %								4,701.212,18		
Atingim. = -134,41 %								2,3946%		
								2,7402%		
								0,9967%		
RESUMO (JUNHO / 2020)								RETORNO		
SALDO ANTERIOR:								0,3307%		
SALDO ATUAL								-1,5618%		
RETORNO								5,4742%		
META ATUARIAL PROJETADA:								2,8728%		
META ATUARIAL ALCANÇADA:								4,817.631,00		
0,72 %								2,3146%		
-0,9667 %								4,701.212,18		
Atingim. = -134,41 %								2,3946%		
								2,7402%		
								0,9967%		
RESUMO (JUNHO / 2020)								RETORNO		
SALDO ANTERIOR:								0,3307%		
SALDO ATUAL								-1,5618%		
RETORNO								5,4742%		
META ATUARIAL PROJETADA:								2,8728%		
META ATUARIAL ALCANÇADA:								4,817.631,00		
0,72 %								2,3146%		
-0,9667 %								4,701.212,18		
Atingim. = -134,41 %								2,3946%		
								2,7402%		
								0,9967%		
RESUMO (JUNHO / 2020)								RETORNO		
SALDO ANTERIOR:								0,3307%		
SALDO ATUAL								-1,5618%		
RETORNO								5,4742%		
META ATUARIAL PROJETADA:								2,8728%		
META ATUARIAL ALCANÇADA:								4,817.631,00		
0,72 %								2,3146%		
-0,9667 %								4,701.212,18		
Atingim. = -134,41 %								2,3946%		
								2,7402%		
								0,9967%		
RESUMO (JUNHO / 2020)								RETORNO		
SALDO ANTERIOR:								0,3307%		
SALDO ATUAL								-1,5618%		
RETORNO								5,4742%		
META ATUARIAL PROJETADA:								2,8728%		
META ATUARIAL ALCANÇADA:								4,817.631,00		
0,72 %								2,3146%		
-0,9667 %								4,701.212,18		
Atingim. = -134,41 %								2,3946%		
								2,7402%		
								0,9967%		
RESUMO (JUNHO / 2020)								RETORNO		
SALDO ANTERIOR:								0,3307%		
SALDO ATUAL								-1,5618%		
RETORNO								5,4742%		
META ATUARIAL PROJETADA:								2,8728%		
META ATUARIAL ALCANÇADA:								4,817.631,00		
0,72 %								2,3146%		
-0,9667 %								4,701.212,18		
Atingim. = -134,41 %								2,3946%		
								2,7402%		
								0,9967%		
RESUMO (JUNHO / 2020)								RETORNO		
SALDO ANTERIOR:								0,3307%		
SALDO ATUAL								-1,5618%		
RETORNO								5,4742%		
META ATUARIAL PROJETADA:								2,8728%		
META ATUARIAL ALCANÇADA:								4,817.631,00		
0,72 %								2,3146%		
-0,9667 %								4,701.212,18		
Atingim. = -134,41 %								2,3946%		
								2,7402%		
								0,9967%		
RESUMO (JUNHO / 2020)								RETORNO		
SALDO ANTERIOR:								0,3307%		
SALDO ATUAL								-1,5618%		
RETORNO								5,4742%		
META ATUARIAL PROJETADA:								2,8728%		
META ATUARIAL ALCANÇADA:								4,817.631,00		
0,72 %								2,3146%		
-0,9667 %								4,701.212,18		
Atingim. = -134,41 %								2,3946%		
								2,7402%		
								0,9967%		
RESUMO (JUNHO / 2020)								RETORNO		
SALDO ANTERIOR:								0,3307%		
SALDO ATUAL								-1,5618%		
RETORNO								5,4742%		
META ATUARIAL PROJETADA:								2,8728%		
META ATUARIAL ALCANÇADA:								4,817.631,00		
0,72 %								2,3146%		
-0,9667 %										

Prezados,

Em agosto, os debates dentro da esfera governamental acerca de eventual ruptura do teto de gastos e orçamento de 2021 fizeram com que os mercados colocassem em dúvida a trajetória da dívida pública, com o aumento das incertezas fiscais ocasionando maior volatilidade para os investimentos.

No cenário doméstico, mesmo com a taxa de juros Selic a 2% ao ano, a bolsa também sentiu o aumento do risco-país em função das incertezas fiscais, embora ainda apresente potencial de valorização para os próximos meses.

No cenário externo, a postura expansionista do FED – Banco Central Norte-Americano, voltada à recuperação da atividade econômica com a ampliação do pacote de estímulos fiscais trouxe desempenho bastante positivo para os ativos globais, inclusive com a sinalização de longo período com taxa de juro em patamares baixos. O Real teve desvalorização em agosto, apesar do dólar mais fraco em termos globais.

O PIB do 2º trimestre de 2020, divulgado pelo IBGE, recuou 9,7% em relação ao 1º trimestre de 2020. O mercado espera recuperação em ritmo acelerado no 3º trimestre de 2020 em função do relaxamento do isolamento social e do volume de recursos investidos na economia na forma de auxílios emergenciais.

Em relação as expectativas de mercado, vide abaixo algumas estimativas:

ESTIMATIVAS DO RELATÓRIO FOCUS

PREVISÃO	2020
Produto Interno Bruto (PIB)	-5,28%
Inflação	1,71%
Taxa básica de juros (Selic)	2,00%
Dólar	R\$ 5,25
Balança comercial (saldo)	US\$ 55 bilhões
Investimento estrangeiro direto	US\$ 55 bilhões

Fonte: Banco Central

Índice de Referência (IPCA + 5,89% aa) – Expectativa 2020	7,70% ao ano
Índice de Referência (INPC + 4,00% aa) – Expectativa 2020	5,78% 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. Por conta das incertezas fiscais, houve aumento das taxas de juro de longo prazo.

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) no vencimento mais longo somente (vide terceira coluna da esquerda para a direita). A inflação projetada para o ano de 2020 está em 1,71%:

Prazo de Vencimento	Tipo de Fundo de Investimento	Taxa de juro REAL ao ano	Inflação projetada IPCA	Rentabilidade Total NOMINAL ao ano
15/03/2023	IMA-B	0,29%	1,71%	2,00%
15/05/2023	IMA-B	0,31%	1,71%	2,02%
15/08/2024	IMA-B 5	1,30%	1,71%	3,03%
15/08/2030	IMA-B 5+	3,00%	1,71%	4,76%
15/05/2055	IMA-B 5+	4,02%	1,71%	5,80%

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 2021 a 2024.

Vencimento	Tipo de Fundo de Investimento	Rentabilidade Total ao ano
2021	IRF-M 1	2,64%
2023	IRF-M	4,70%
2024	IRF-M 1+	5,22%

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 2,64% e 5,22% 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. Num ambiente de incerteza, a utilização dos fundos de investimentos “flexíveis” (que permitem mudanças de posição da carteira dentro do próprio fundo de investimento) combina uma estratégia interessante para enfrentar períodos de oscilações nos rendimentos.

DI BLASI CONSULTORIA FINANCEIRA LTDA

CNPJ 03.866.812/0001-02

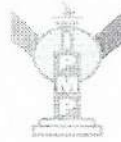
CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS HABILITADA PELA COMISSÃO DE

VALORES MOBILIÁRIOS - CVM

www.diblasiconsultoria.com.br

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 patamares baixos ao longo do 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.



COMITÊ DE INVESTIMENTOS

PARECER

O Comitê de Investimentos, em reunião realizada em 30 de setembro de 2020, analisou e aprovou o relatório mensal de investimentos que apresenta o acompanhamento da rentabilidade e dos riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do RPPS e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política Anual de Investimentos do exercício de 2020.

Paragominas, 30 de setembro de 2020.

Raulison Dias Pereira
Portaria nº 017/2020
CGRPPS APIMEC nº 096/09

1



DI BLASI

INSTITUTO DE PREVIDENCIA DOS SERVIDORES PUBLICOS DE PARAGOMINAS

Relatório Competência

08/2020



VISÃO GERAL

FUNDO	DISP. DE RESGATE	SALDO R\$	PARTICIPAÇÃO	QTD. COTISTAS	% SOBRE PL DO FUNDO	PL DO FUNDO R\$	RESOLUÇÃO	GRAU DE RISCO	TAXA ADM.	TIPO
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA-FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 4	0,00	0,00 %	1633	0,00 %	942.280,344,59	Art 8º, I, "a"	Alto	1,00 %	Fundo de Investimento
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	D + 0	2.179.019,32	0,94 %	755	0,12 %	1.775.186.405,18	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	5.849,95	0,00 %	755	0,00 %	1.775.186.405,18	Art 7º, IV "a"	Baixo	1,00 %	Fundo de Investimento
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDXA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 0	11.654.943,51	5,05 %	892	0,18 %	6.452.433.505,43	Art 7º, I, "b"	Médio	0,20 %	Fundo de Investimento
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 0	447.471,40	0,19 %	271	0,03 %	1.456.021.562,44	Art 7º, IV "b"	Médio	0,30 %	Fundo de Investimento
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D + 0	7.265.865,64	3,15 %	1244	0,09 %	7.749.783.927,00	Art 7º, I, "b"	Baixo	0,10 %	Fundo de Investimento
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DE LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	D + 0	13.054.029,07	5,67 %	590	0,51 %	2.572.617.697,19	Art 7º, IV "a"	Baixo	0,20 %	Fundo de Investimento
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 2705	602.568,12	0,26 %	140	0,11 %	570.737.914,69	Art 7º, I, "b"	Médio	0,20 %	Fundo de Investimento
BRÁDESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS	D + 0	514.991,43	0,22 %	265	0,06 %	891.402.902,10	Art 7º, I, "b"	Baixo	0,20 %	Fundo de Investimento
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 I 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 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 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 425	0,00	0,00 %		0,00 %	0,00	Art 7º, IV "a"	Baixo	0,00 %	Fundo de Investimento
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	5.981.564,81	2,59 %	905	0,10 %	6.019.680.821,86	Art 7º, I, "b"	Médio	0,20 %	Fundo de Investimento
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA VIMULTIMERCADO CREDITO PRIVADO	D + 0	0,00	0,00 %		0,00 %	0,00	Art 8º, III	Alto	0,20 %	Fundo de Investimento
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	17.311.861,80	7,50 %	1359	0,17 %	10.245.504.415,29	Art 7º, I, "b"	Baixo	0,20 %	Fundo de Investimento
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RENDA LONGO PRAZO	D + 0	8.755.446,09	3,79 %	464	0,05 %	16.114.955.012,29	Art 7º, I, "b"	Médio	0,20 %	Fundo de Investimento
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	D + 0	16.094.981,73	6,97 %	696	0,34 %	4.687.255.346,64	Art 7º, IV "a"	Baixo	0,20 %	Fundo de Investimento
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	D + 0	10.993.788,28	4,76 %	305	0,38 %	2.909.854.221,69	Art 7º, III "a"	Médio	0,20 %	Fundo de Investimento
MEIA PLUS FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	D + 1	0,00	0,00 %		0,00 %	0,00	Art 8º, III	Alto	2,50 %	Fundo de Investimento
MEIA VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	D + 4	16.860.975,63	7,31 %	193	6,10 %	276.573.030,89	Art 8º, II, "a"	Alto	3,00 %	Fundo de Investimento
MONSIEUR AEGON CRÉDITO PRIVADO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	494.726,89	0,21 %	114	0,55 %	90.409.333,20	Art 7º, VII, "b"	Médio	0,45 %	Fundo de Investimento
MONSIEUR AEGON INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	D + 4	1.020.689,41	0,44 %	57	0,79 %	129.968.453,68	Art 8º, III	Alto	0,80 %	Fundo de Investimento

OCEANA VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	D + 4	0,00	0,00 %	55	0,00 %	373.453.836,41	Art 8º , II , "a"	Alto	200 %	Fundo de Investimento
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	D + 13	12.315.889,83	5,34 %	104	11,10 %	110.990.792,93	Art 8º , II , "a"	Alto	200 %	Fundo de Investimento
SAFRA EXECUTIVE 2 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	D + 1	513.634,50	0,22 %	1803	0,07 %	702.235.198,33	Art 7º , IV "a"	Médio	0,20 %	Fundo de Investimento
SAFRA S&P REAIS PB FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	D + 4	1.558.283,91	0,68 %	64	0,29 %	537.917.191,45	Art 8º , III	Alto	100 %	Fundo de Investimento
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMAB LP	D + 1	21.718.018,98	9,41 %	458	4,77 %	455.690.811,58	Art 7º , III "a"	Médio	0,20 %	Fundo de Investimento
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRE-M 1	D + 1	7.953.405,29	3,45 %	401	2,54 %	313.054.261,34	Art 7º , III "a"	Médio	0,20 %	Fundo de Investimento
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRE-M LONGO PRAZO	D + 1	1.695.585,27	0,73 %	915	0,30 %	563.491.474,91	Art 7º , III "a"	Médio	0,20 %	Fundo de Investimento
WESTERN ASSET IMAB5 ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	D + 0	831.389,84	0,36 %	1406	0,12 %	665.936.850,13	Art 7º , I , "b"	Médio	0,40 %	Fundo de Investimento
WESTERN ASSET US INDEX 500 FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	D + 1	4.327.301,10	1,87 %	14205	0,43 %	1.014.136.007,41	Art 8º , III	Alto	1,00 %	Fundo de Investimento
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA	D + 0	23.925.038,37	10,37 %	852	0,18 %	13.462.808.031,45	Art 7º , I , "b"	Baixo	0,20 %	Fundo de Investimento
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	D + 4	19.944.810,64	8,64 %	600	0,18 %	10.897.747.304,90	Art 7º , I , "b"	Alto	0,50 %	Fundo de Investimento
OCEANA VALOR 30 FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	D + 30	18.596.674,13	8,06 %	23	7,12 %	261.097.083,44	Art 8º , II , "a"	Alto	200 %	Fundo de Investimento
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	D + 0	2.578.569,03	1,12 %	189	0,19 %	1.372.728.315,02	Art 7º , IV "a"	Baixo	0,40 %	Fundo de Investimento
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO MACRO INSTITUCIONAL	D + 1	1.575.645,67	0,68 %	28	0,55 %	288.179.143,57	Art 8º , III	Alto	1,50 %	Fundo de Investimento

TOTAL SALDO: R\$ 230.813.019,54

Relatório competência: 08/2020

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%	96.783,480,35	47,95 %
FI RENDA FIXA REFERENCIADA - Art 7º, III "a"		60% ENQUADRADO	15% ENQUADRADO	20% ENQUADRADO	60%	42.360,797,82	18,35 %
FI RENDA FIXA GERAL - Art 7º, IV "a"		40% ENQUADRADO	15% ENQUADRADO	20% ENQUADRADO	40%	34.913,554,90	15,13 %
FI RENDA FIXA CREDITO PRIVADO - Art 7º, VII, "b"		5% ENQUADRADO	5% ENQUADRADO	20% ENQUADRADO	5%	494,726,89	0,21 %
Valor total Renda Fixa: R\$ 174.557.559,86							

RENDA VARIÁVEL - ARTIGOS		LIMITE DA RESOLUÇÃO	LIMITE PL FUNDO	LIMITE POR PARTICIPAÇÃO	LIMITE POLÍTICA	TOTAL	% CARTEIRA
FI DE AÇÕES / INDICES COM MIN 50 AÇÕES - Art 8º, I, "a"		30% ENQUADRADO	15% ENQUADRADO	20% ENQUADRADO	30%	0,00	0,00
FI DE AÇÕES GERAL - Art 8º, II, "a"		20% DESENQUADRADO	15% ENQUADRADO	20% ENQUADRADO	20%	47.773.539,59	20,70
FI MULTIMERCADO ABERTO - Art 8º, III		10% ENQUADRADO	5% ENQUADRADO	20% ENQUADRADO	10%	8.481.920,09	3,67
Valor total Renda Variável: R\$ 56.255.459,68							

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		47.773.539,59	20,70
ALOCÇÃO ATIVA		19.944.810,64	8,64
CDI		31.373.879,97	13,59
CREDITO PRIVADO		494.726,89	0,21
IDVA 2		11.654.943,51	5,05
IMAB		39.140.843,47	16,96
IMAB-5		831.389,84	0,36
IPCA		27.106.175,52	11,74
IRF-M		10.451.031,36	4,53
IRF-M1		33.559.758,66	14,54
MULTIMERCADO		8.481.920,09	3,67
		R\$ 230.813.079,54	

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA			
BEM - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA. CNPJ: 00066700000100	TOTAL	13.831.306,13	5,99
BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A. CNPJ: 01181521000155	31.367.009,54	13,59	
BNY MELTON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A. CNPJ: 02201501000161	18.596.674,13	8,06	
SAFRA SERVIÇOS DE ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA LTDA. CNPJ: 06947853000111	2.071.918,41	0,90	
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. CNPJ: 1522368000182	5.158.690,94	2,24	
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A. CNPJ: 30822536000169	59.194.557,55	23,91	
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CNPJ: 360305000104	83.062.681,08	35,99	
BANCO BRADESCO S.A. CNPJ: 60746948000112	4.669.206,13	2,02	
Banco Daycoval S.A. CNPJ: 62232899000190	16.860.975,63	7,31	
	R\$ 230.813.019,54		

RETORNOS

FUNDO	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO R\$	RETORNO %	EFTENTO %
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	-3,26509 %	-3,26509 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 361.194,18	R\$ 3.359.393,17	R\$ 1.562.612,50	R\$ 2.179.019,32	R\$ 1.044,47	0,07519 %	0,07519 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 28.620,92	R\$ 141.862,63	R\$ 164.650,92	R\$ 5.849,85	R\$ 17,22	0,07519 %	0,07519 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDXA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 11.575.521,05	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 11.654.943,51	R\$ 79,422,46	0,68612 %	0,68612 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMAB FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 455.643,39	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 447.471,40	R\$ 8.171,99	-1,79351 %	-1,79351 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRR-M TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 12.254.641,27	R\$ 0,00	R\$ 5.000.000,00	R\$ 7.265.865,64	R\$ 11.224,37	0,08827 %	0,08827 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DE LONGO PRAZO PERFL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	R\$ 28.048.276,66	R\$ 0,00	R\$ 15.000.000,00	R\$ 13.094.029,67	R\$ 45.752,41	0,18121 %	0,18121 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 950.226,60	R\$ 0,00	R\$ 351.017,46	R\$ 602.568,12	R\$ 3.358,98	0,42435 %	0,42435 %
BRABESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IRR-M TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 514.499,93	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 514.991,43	R\$ 491,50	0,09553 %	0,09553 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	-	-
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 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	-	-
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMAB TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 6.093.092,12	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 5.981.564,81	R\$ 111.527,31	-1,83039 %	-1,83039 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA VII MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	-	-
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRR-M TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	R\$ 17.295.176,39	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 17.311.861,80	R\$ 16.685,41	0,09647 %	0,09647 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRR-M TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 8.823.398,90	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 8.755.446,09	R\$ 67.952,81	-0,77014 %	-0,77014 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DE LONGO PRAZO	R\$ 16.071.682,43	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 16.094.981,73	R\$ 23.299,30	0,14497 %	0,14497 %
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMAB RENDA FIXA LP	R\$ 11.201.002,50	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 10.993.788,28	R\$ 207.214,22	-1,84996 %	-1,84996 %
META PLUS FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	-	-
META VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	R\$ 17.204.488,34	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 16.860.975,63	R\$ 343.512,71	-1,99665 %	-1,99665 %
MONGERIAL AEGON CRÉDITO PRIVADO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 491.979,23	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 494.726,89	R\$ 2.747,66	0,55849 %	0,55849 %
MONGERIAL AEGON INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	R\$ 1.019.410,95	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 1.020.689,41	R\$ 1.278,46	0,12541 %	0,12541 %
OCEANA VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	-5,35655 %	-5,35655 %
QUELIZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$ 12.644.878,50	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 12.315.889,83	R\$ 328.988,67	-2,60175 %	-2,60175 %

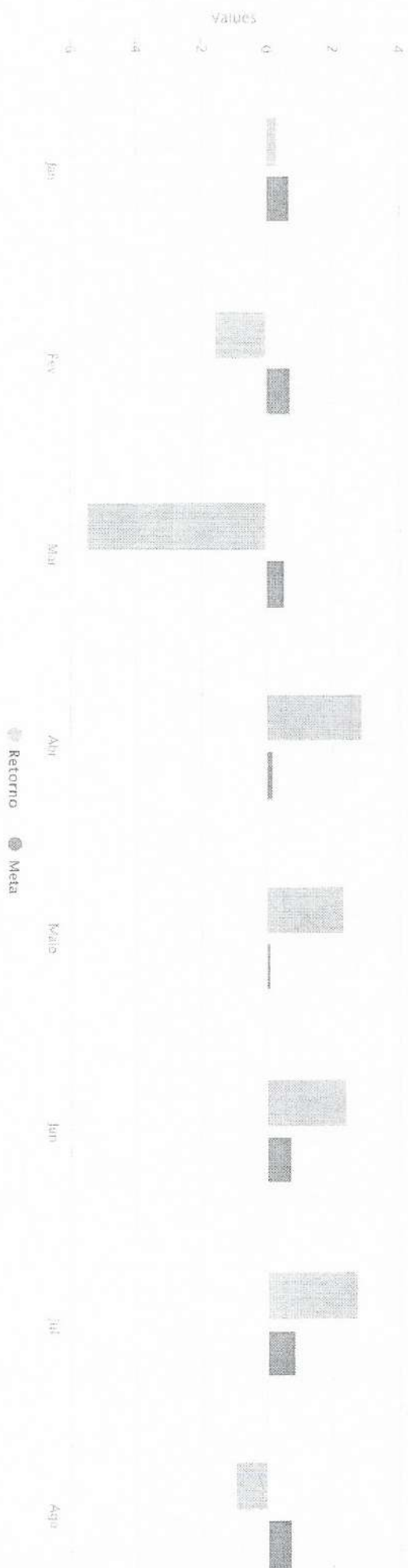
SANRA EXECUTIVE 2 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 513.204,17	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 513.634,50	R\$ 430,33	0,08385 %	0,08385 %
SATRA S&P REALS PB FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	R\$ 1.458.261,89	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 1.558.283,91	R\$ 100,022,02	6,85899 %	6,85899 %
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B LP	R\$ 6.942.368,41	R\$ 15.000.000,00	R\$ 0,00	R\$ 21.718,018,98	R\$ 224.349,43	-1,87942 %	-1,87942 %
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRE-M 1	R\$ 22.933.891,08	R\$ 0,00	R\$ 13.000.000,00	R\$ 7.933.405,29	R\$ 19.514,21	0,08511 %	0,08511 %
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRE-M LONGO PRAZO	R\$ 1.711.189,71	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 1.695.585,27	R\$ 15.604,44	-0,91191 %	-0,91191 %
WESTERN ASSET IMAGS ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 833.870,43	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 831.389,84	R\$ -2.480,59	-0,29748 %	-0,29748 %
WESTERN ASSET US INDEX 500 FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	R\$ 4.047.274,76	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 4.327.301,10	R\$ 280.026,34	6,91889 %	6,91889 %
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA	R\$ 24.059.085,45	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 23.923.038,37	R\$ -134.047,08	-0,55716 %	-0,55716 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 0,00	R\$ 20.000.000,00	R\$ 0,00	R\$ 19.944.810,64	R\$ -55.189,36	-0,08807 %	-0,88875 %
OCEANA VALOR 30 FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	R\$ 19.649.039,25	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 18.596.674,13	R\$ -1.052.365,12	-5,35581 %	-5,35581 %
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 2.600.937,58	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 2.578.569,03	R\$ -22.368,55	-0,86002 %	-0,86002 %
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO MACRO INSTITUCIONAL	R\$ 1.579.005,02	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 1.575.645,67	R\$ -3.359,35	-0,21275 %	-0,21275 %
TOTALS	R\$ 231.381.861,11	R\$ 38.501.255,80	R\$ 37.078.280,88	R\$ 230.813.019,54	R\$ -1.991.816,49	-0,9667 %	-0,9667 %

RETORNOS ACUMULADO

MES	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO R\$	RETORNO %	MÉDIA %	ATINGIMENTO %
JANEIRO	R\$ 228.227.249,13	R\$ 1.301.279,63	R\$ 2.490.039,18	R\$ 227.751.694,93	R\$ 713.205,35	0,3207 %	0,69 %	47,99 %
FEVEREIRO	R\$ 227.751.694,93	R\$ 5.793.568,74	R\$ 5.105.836,45	R\$ 224.469.418,92	R\$ -3.970.008,50	-1,5618 %	0,73 %	-214,15 %
MARÇO	R\$ 224.469.418,92	R\$ 3.805.218,49	R\$ 1.760.507,06	R\$ 210.423.608,50	R\$ -16.090.521,85	-5,4742 %	0,55 %	-998,22 %
ABRIL	R\$ 210.423.608,50	R\$ 2.557.751,38	R\$ 3.252.421,19	R\$ 215.102.301,15	R\$ 5.373.362,46	2,8728 %	0,17 %	1.724,36 %
MAIO	R\$ 215.102.301,15	R\$ 5.724.681,07	R\$ 5.152.411,17	R\$ 220.492.202,05	R\$ 4.817.631,00	2,3109 %	0,10 %	2.399,72 %
JUNHO	R\$ 220.492.202,05	R\$ 6.093.267,96	R\$ 5.634.157,86	R\$ 225.652.523,93	R\$ 4.701.212,18	2,3946 %	0,74 %	323,91 %
JULHO	R\$ 225.652.523,93	R\$ 2.231.716,49	R\$ 2.446.517,11	R\$ 231.381.861,11	R\$ 5.944.137,80	2,7402 %	0,84 %	326,29 %
AGOSTO	R\$ 231.381.861,11	R\$ 38.501.255,80	R\$ 37.078.280,88	R\$ 230.813.019,54	R\$ -1.991.816,49	-0,9667 %	0,72 %	-134,41 %
TOTAIS		R\$ 66.008.739,16	R\$ 62.920.170,90		R\$ -502.797,85	2,37	4,62	51,32



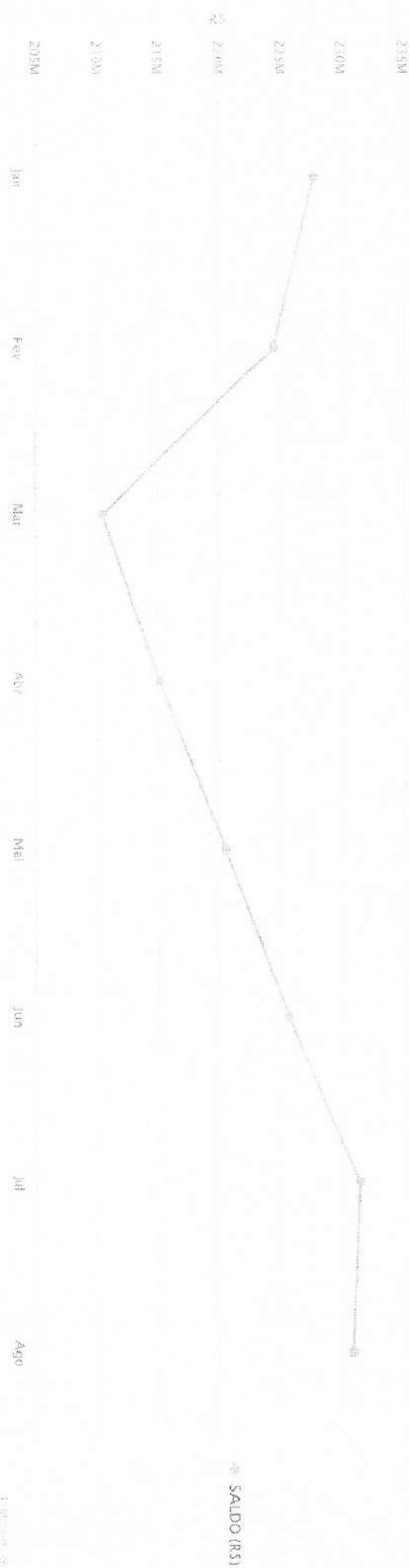
Gráfico - Retorno acumulado no ano



EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO X RENTABILIDADE MONETÁRIA

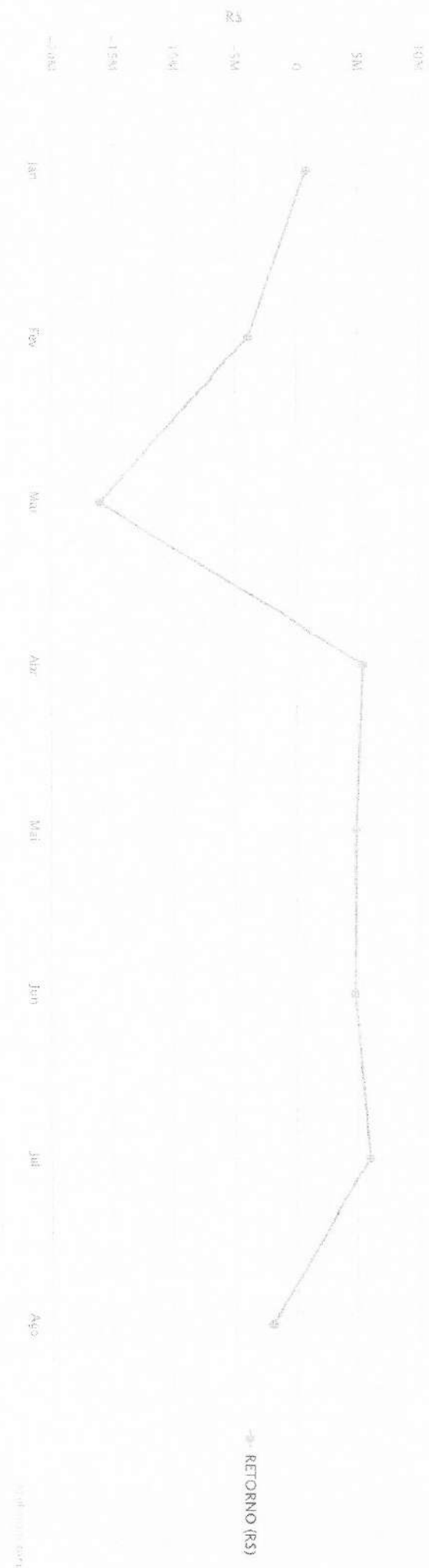
MESES	JANEIRO	FEVEREIRO	MARÇO	ABRIL	MAIO	JUNHO	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO
SALDO (R\$)	227.751.694,93	224.469.418,92	210.423.608,50	215.102.301,15	220.492.202,05	225.652.523,93	231.381.861,11	230.813.019,54	0,00	0,00	0,00	0,00
RETORNO (R\$)	713.205,35	-3.970.008,30	-16.090.521,85	5.373.362,46	4.817.631,00	4.701.212,18	5.944.137,80	-1.991.816,49	0,00	0,00	0,00	0,00

REFERENTE AO SALDO (R\$)



Relatório competência: 08/2020

REFERENTE AO RETORNO (R\$)



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 condições 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, debênturas, 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 AÇÕES GOVERNANÇA FUNDO DE INVESTIMENTO	AÇÕES	74,71 %	-0,68 %	54,05 %	47,59 %	34,34 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	CDI	0,62 %	-3,77 %	0,12 %	0,20 %	0,29 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	CDI	0,62 %	-3,77 %	0,12 %	0,20 %	0,29 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIA IDK 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	IDK 2	6,33 %	0,77 %	4,36 %	3,66 %	2,91 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIA IMAB FUNDO DE INVESTIMENTO	IMAB	23,23 %	0,33 %	14,90 %	12,97 %	10,68 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RC FI	IRF-M1	0,94 %	2,12 %	0,44 %	0,43 %	0,43 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	CDI	1,20 %	-1,08 %	0,70 %	0,57 %	0,55 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO	IPCA	7,05 %	0,95 %	4,39 %	3,85 %	3,24 %
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIA IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS	IRF-M1	0,93 %	2,05 %	0,40 %	0,42 %	0,43 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIA	IMAB-B	0,00 %	0,00 %	0,00 %	0,00 %	0,00 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 V TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIA	IMAB-B	0,00 %	0,00 %	0,00 %	0,00 %	0,00 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2018 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIA	IPCA	7,94 %	-1,21 %	0,11 %	4,07 %	3,65 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMAB TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIA LONGO PRAZO	IMAB-B	23,25 %	0,33 %	14,89 %	12,96 %	10,68 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA VII MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	MULTIMERCADO	0,04 %	1,34 %	0,41 %	0,34 %	0,34 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIA	IRF-M1	0,93 %	2,27 %	0,40 %	0,42 %	0,43 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIA	IRF-M	5,96 %	1,83 %	1,73 %	2,65 %	2,74 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	CDI	0,91 %	-1,02 %	0,40 %	0,36 %	0,42 %
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMAB RENDA FIA LP	IMAB-B	23,02 %	0,34 %	14,67 %	12,84 %	10,58 %
META PLUS FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	MULTIMERCADO	3,92 %	-2,50 %	2,38 %	2,23 %	1,80 %
META VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	AÇÕES	94,10 %	-0,54 %	73,25 %	61,26 %	43,25 %
MONTEVAL AEGON CRÉDITO PRIVADO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIA LONGO PRAZO	CRÉDITO PRIVADO	0,00 %	0,00 %	0,00 %	0,00 %	0,00 %

MONIGERAL AEGON INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	MULTIMERCADO	2,64 %	-1,40 %	0,77 %	1,37 %	1,21 %
OCEANA VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	AÇÕES	71,98 %	-0,66 %	49,19 %	45,61 %	33,08 %
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	AÇÕES	74,39 %	-0,66 %	50,41 %	46,73 %	34,19 %
SAFRA EXECUTIVE 2 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	IRF-M1	1,11 %	1,40 %	0,11 %	0,41 %	0,51 %
SAFRA S&P REAIS PB FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	MULTIMERCADO	19,88 %	1,57 %	7,21 %	9,04 %	9,14 %
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B LP	IMA-B	24,36 %	0,30 %	16,11 %	13,68 %	11,19 %
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1	IRF-M1	1,16 %	2,48 %	0,38 %	0,57 %	0,53 %
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	IRF-M	6,86 %	1,63 %	2,80 %	3,29 %	3,15 %
WESTERN ASSET IMAB5 ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	IMA-B 5	10,70 %	0,56 %	8,03 %	5,63 %	4,92 %
WESTERN ASSET US INDEX 500 FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	MULTIMERCADO	47,07 %	-0,53 %	26,87 %	25,92 %	21,63 %
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 %
EB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	ALOCAÇÃO ATIVA	9,36 %	0,70 %	5,14 %	4,86 %	4,30 %
OCEANA VALOR 30 FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	AÇÕES	41,73 %	1,27 %	3,13 %	16,05 %	19,18 %
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	IPCA	0,89 %	1,10 %	2,38 %	2,17 %	2,00 %
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO MACRO INSTITUCIONAL	MULTIMERCADO	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 DIAS (R\$)
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FUNDO DE INVESTIMENTO	10.418.335/0001-88	AÇÕES	0,00	74,71%	34,34%	0,00
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	13.077.415/0001-05	CDI	2.179.019,32	0,62%	0,29%	13.509,92
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	13.077.415/0001-05	CDI	5.849,85	0,62%	0,29%	36,27
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDXA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	13.322.205/0001-35	IDXA 2	11.654,943,51	6,33%	2,91%	737.757,92
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	07.861.554/0001-22	IMA-B	447.471,40	23,23%	10,68%	103.947,61
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRR-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC F	11.328.882/0001-35	IRR-M1	7.285.865,64	0,94%	0,43%	68.299,14
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	13.077.418/0001-49	CDI	13.094.029,07	1,20%	0,55%	157.128,35
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO	19.303.795/0001-35	IPCA	602.568,12	7,05%	3,24%	42.481,05
BRASESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IRR-M1 TÍTULOS PÚBLICOS	11.484.558/0001-06	IRR-M1	514.091,43	0,93%	0,43%	4.789,42
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	20.139.299/0001-77	IMA-B	0,00	0,00%	0,00%	0,00
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 V TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	21.922.158/0001-24	IMA-B	0,00	0,00%	0,00%	0,00
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2018 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	18.598.256/0001-08	IPCA	0,00	7,94%	3,65%	0,00
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	10.740.658/0001-93	IMA-B	5.981.564,81	23,25%	10,68%	1.390.713,82
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA VII MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	14.120.236/0001-76	MULTIMERCADO	0,00	0,04%	0,34%	0,00
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRR-M1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	IRR-M1	17.311.861,80	0,93%	0,43%	161.000,31
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRR-M TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	14.508.605/0001-00	IRR-M	8.755.446,09	5,96%	2,74%	521.824,59
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	CDI	16.094.981,73	0,91%	0,42%	146.464,33
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	10.646.895/0001-90	IMA-B	10.993.788,28	23,02%	10,58%	2.530.770,06
META PLUS FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	07.967.083/0001-31	MULTIMERCADO	0,00	3,92%	1,80%	0,00
META VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	07.899.238/0001-40	AÇÕES	16.860.975,63	94,10%	43,25%	15.866.178,07
MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	19.488.769/0001-84	CRÉDITO PRIVADO	494.726,89	0,00%	0,00%	0,00
MONGERAL AEGON INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	14.115.119/0001-80	MULTIMERCADO	1.020.689,41	2,64%	1,21%	26.946,20
OCEANA VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	10.309.539/0001-80	AÇÕES	0,00	71,98%	33,08%	0,00

QUELUIZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	09.289.072/0001-75	AÇÕES	12.315.889,83	74,38 %	34,19 %	9.161.790,44
SAPRA EXECUTIVE 2 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	10.287.647/0001-69	IRF-M1	513.634,50	1,11%	0,51 %	5.701,34
SAPRA S&P REAIS PB FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	21.595.829/0001-54	MULTIMERCADO	1.558.283,91	19,88 %	9,14 %	309.786,84
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B LP	11.087.118/0001-15	IMA-B	21.718.018,98	24,36 %	11,19 %	5.290.509,42
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1	19.196.599/0001-09	IRF-M1	7.953.405,29	1,16%	0,53 %	92.259,50
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	13.081.159/0001-20	IRF-M	1.695.585,27	6,86%	3,15 %	116.317,15
WESTERN ASSET IMAGS ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	17.517.577/0001-78	IMA-B-5	831.389,84	10,70 %	4,92 %	88.958,71
WESTERN ASSET US INDEX 500 FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	17.453.850/0001-48	MULTIMERCADO	4.327.301,10	47,07 %	21,63 %	2.036.860,63
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA	23.215.097/0001-55	IPCA	23.925.038,37	8,15%	3,74 %	1.949.890,63
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	25.078.994/0001-90	ALOCAÇÃO ATIVA	19.944.810,64	9,36%	4,30 %	1.866.834,28
OCEANA VALOR 30 FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	26.956.042/0001-94	AÇÕES	18.596.674,13	41,73 %	19,18 %	7.760.392,11
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	28.515.874/0001-09	IPCA	2.578.569,03	0,88%	2,00 %	22.949,26
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO MACRO INSTITUCIONAL	21.287.421/0001-15	MULTIMERCADO	1.575.645,67	0,00%	0,00 %	0,00

Saldo Total:	R\$ 230.873.019,54
Provisão para perda e investimentos:	R\$ 50.474.097,39
% Provisão de Perda:	21,888%



RISCO DE LIQUIDEZ

FUNDO	DISP. DE RESGATE	SALDO R\$	PARTICIPAÇÃO	QTD. COTISTAS	% SOBRE PL DO FUNDO	PL DO FUNDO R\$	RESOLUÇÃO	GRAU DE RISCO
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 4	0,00	0,00 %	1633	0,00 %	942.280.344,59	Art 8º, I, "a"	Alto
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	D + 0	2.179.019,32	0,94 %	755	0,12 %	1.775.186.405,18	Art 7º, IV "a"	Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	D + 0	5.849,85	0,00 %	755	0,00 %	1.775.186.405,18	Art 7º, IV "a"	Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDCA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 0	11.654.943,51	5,05 %	892	0,18 %	6.452.433.505,43	Art 7º, I, "b"	Médio
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA INCA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 0	447.471,40	0,19 %	271	0,03 %	1.456.021.562,44	Art 7º, IV "a"	Médio
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRE-MI TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D + 0	7.265.865,64	3,15 %	1244	0,09 %	7.749.783.927,00	Art 7º, I, "b"	Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DE LONGO PRAZO PERIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	D + 0	13.094.029,07	5,67 %	590	0,51 %	2.572.617.697,19	Art 7º, IV "a"	Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 27/05	602.568,12	0,26 %	140	0,11 %	570.737.914,69	Art 7º, I, "b"	Médio
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IRE-MI TÍTULOS PÚBLICOS	D + 0	514.991,43	0,22 %	265	0,06 %	891.402.902,10	Art 7º, I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	0,00	0,00 %		0,00 %	0,00	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 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 425	0,00	0,00 %		0,00 %	0,00	Art 7º, IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL INCA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	5.981.564,81	2,59 %	905	0,10 %	6.019.680.821,86	Art 7º, I, "b"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA VII MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D + 0	0,00	0,00 %		0,00 %	0,00	Art 8º, III	Alto
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRE-MI TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	17.271.861,80	7,50 %	1359	0,17 %	10.245.504.415,29	Art 7º, I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRE-MI TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	8.755.446,09	3,79 %	464	0,05 %	16.114.955.012,29	Art 7º, I, "b"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DE LONGO PRAZO	D + 0	16.094.981,73	6,97 %	696	0,34 %	4.687.255.346,64	Art 7º, IV "a"	Baixo

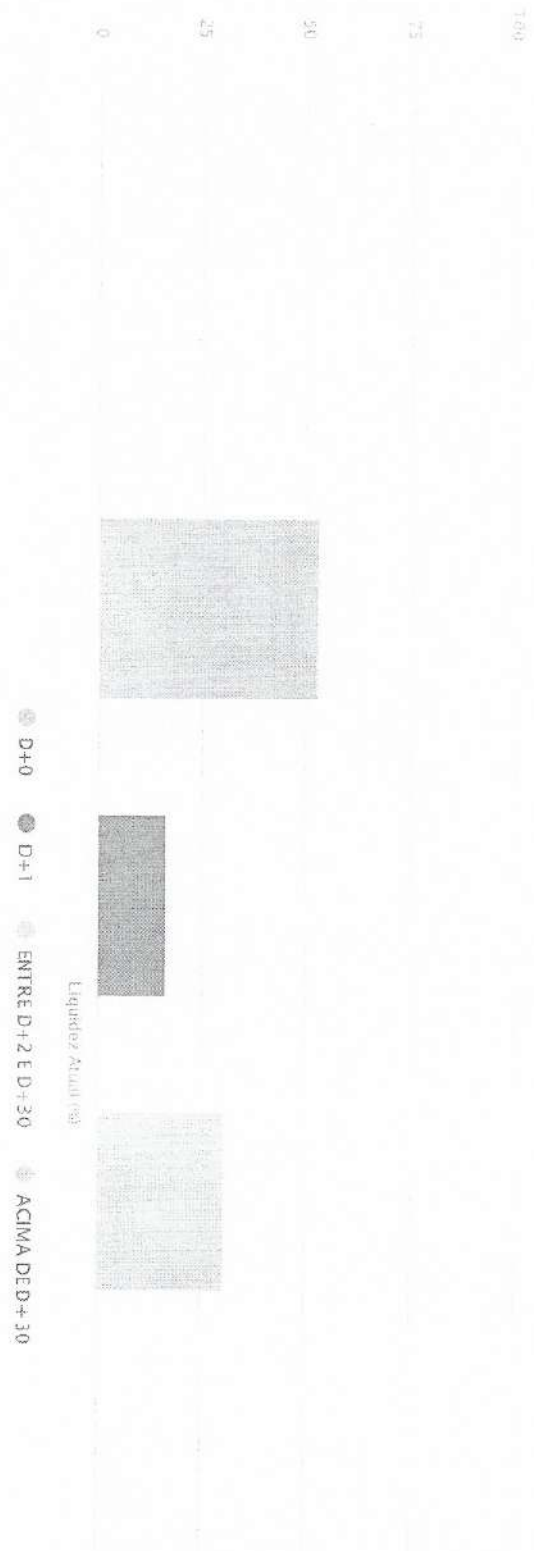
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMAB RENDA FIXA LP	D + 0	10.593.758,28	4,76 %	305	0,38 %	2.909.854,221,69	Art 7º, III "a"	Médio
META PLUS FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	D + 1	0,00	0,00 %		0,00 %	0,00	Art 8º, III	Alto
META VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	D + 4	16.860.975,63	7,31 %	193	6,10 %	276.573,030,89	Art 8º, II, "a"	Alto
MONSIEUR AEGON CRÉDITO PRIVADO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	494.726,89	0,21 %	114	0,55 %	90.409.333,20	Art 7º, VII, "b"	Médio
MONSIEUR AEGON INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	D + 4	1.020.689,41	0,44 %	57	0,79 %	129.968.453,68	Art 8º, III	Alto
OCEANA VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	D + 4	0,00	0,00 %	55	0,00 %	373.453.836,41	Art 8º, II, "a"	Alto
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	D + 13	12.315.889,83	5,34 %	104	11,10 %	110.950.792,93	Art 8º, II, "a"	Alto
SABRA EXECUTIVE 2 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	D + 1	513.634,50	0,22 %	1803	0,07 %	702.235.168,33	Art 7º, IV "a"	Médio
SABRA S&P REAIS PB FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	D + 4	1.558.283,91	0,68 %	64	0,29 %	537.917.191,45	Art 8º, III	Alto
SIGREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMAB LP	D + 1	21.718.018,98	9,41 %	458	4,77 %	455.690.811,58	Art 7º, III "a"	Médio
SIGREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1	D + 1	7.953.405,29	3,45 %	401	2,54 %	313.054.261,34	Art 7º, III "a"	Médio
SIGREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	D + 1	1.695.585,27	0,73 %	915	0,30 %	503.491.474,91	Art 7º, III "a"	Médio
WESTERN ASSET IMAB5 ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	D + 0	831.389,84	0,36 %	1406	0,12 %	665.936.850,13	Art 7º, I, "b"	Médio
WESTERN ASSET US INDEX 500 FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	D + 1	4.327.301,10	1,87 %	14205	0,43 %	1.014.136.007,41	Art 8º, III	Alto
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA	D + 0	23.925.088,37	10,37 %	852	0,18 %	13.462.808.031,45	Art 7º, I, "b"	Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	D + 4	19.944.810,64	8,64 %	600	0,18 %	10.897.747.304,90	Art 7º, I, "b"	Alto
OCEANA VALOR 30 FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	D + 30	18.596.674,13	8,06 %	23	7,12 %	261.097.083,44	Art 8º, II, "a"	Alto
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	D + 0	2.578.569,03	1,12 %	189	0,19 %	1.372.728.315,02	Art 7º, IV "a"	Baixo
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO MACRO INSTITUCIONAL	D + 1	1.575.645,67	0,68 %	28	0,55 %	288.179.143,57	Art 8º, III	Alto

TOTAL SALDO: R\$ 230.813.019,54

PRAZO DE RESGATE D+0	QUANTIDADE DE FUNDOS 19	LÍQUIDEZ ATUAL 53%
--	---	--

D+1	7	16%
ENTRE D+2 E D+30	8	30%
ACIMA DE D+30	2	0%

Gráfico



RISCO DE CRÉDITO

RENTA FIJA - ARTÍCULOS		LÍMITE DA RESOLUÇÃO	LÍMITE POLÍTICA	TOTAL	% CARTERA
Art 7º, I, "b"		100 %	100 %	96.788.480,25	41,93
Art 7º, III "a"		60 %	60 %	42.350.797,82	18,35
Art 7º, IV "a"		40 %	40 %	34.513.554,90	15,13
Art 7º, VII, "b"		5 %	5 %	494.726,89	0,21
				230.813.019,54	
RISCO DE CRÉDITO		% CARTERA			
100% Títulos Públicos e 0% Títulos Privados		49,50%			
50% Títulos Públicos e 50% Títulos Privados		7,56%			
0% Títulos Públicos e 100% Títulos Privados		18,57%			

Relatório competência: 08/2020

CAPITAL PROTEGIDO

INVESTIDO PROTEGIDO	TIPO DE PRODUTO E PERCENTUAL DO CAPITAL INVESTIDO PROTEGIDO	
	TIPO DE PRODUTO	PERCENTUAL DO CAPITAL
Investido Protegido (Acé)		
Títulos Públicos Federais/ Carteira Própria		100%
Fundos de Investimento Referenciado e Renda Fixa 1.00% 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 Multirrecados		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.

ÍNDICES ECONÔMICOS



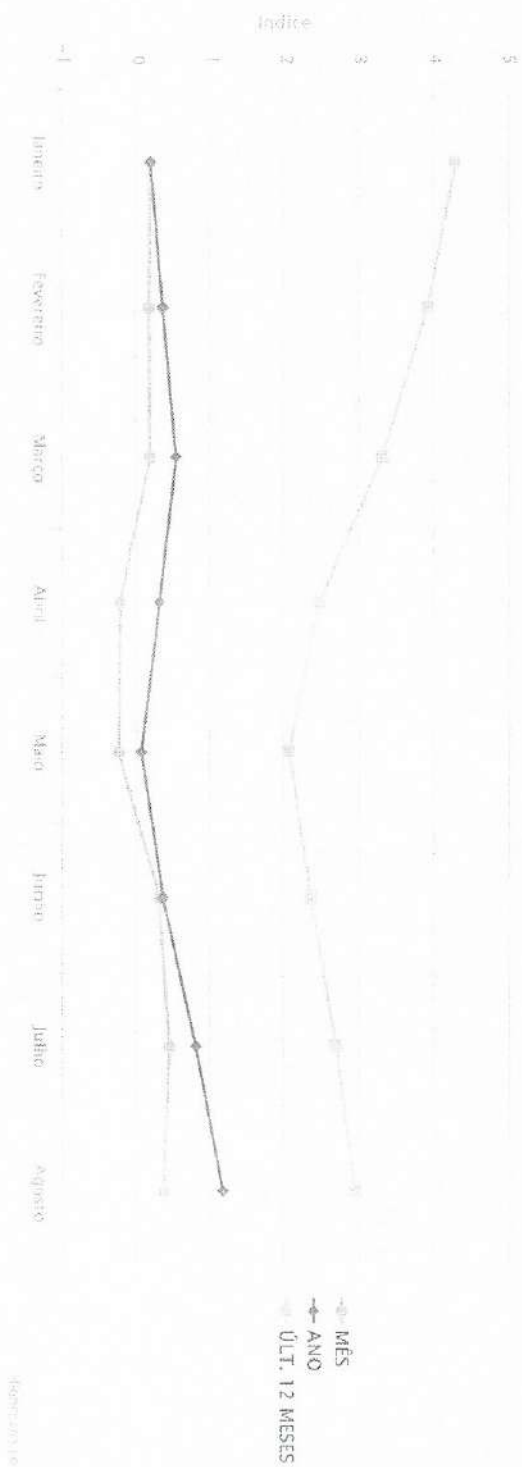
2020	Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Maio	Junho	Julho	Agosto	Setembro	Outubro	Novembro	Dezembro
MÊS	0.2100	0.2500	0.0700	-0.3100	-0.3900	0.2600	0.3600	0.2400				
ANO	0.2100	0.4600	0.5300	0.2200	-0.1600	0.1000	0.4600	0.7000				
ÚLT. 12 M	4.1900	4.0100	3.3000	2.4000	1.8900	2.1300	2.3100	2.4400				



DI BLASI

INPC

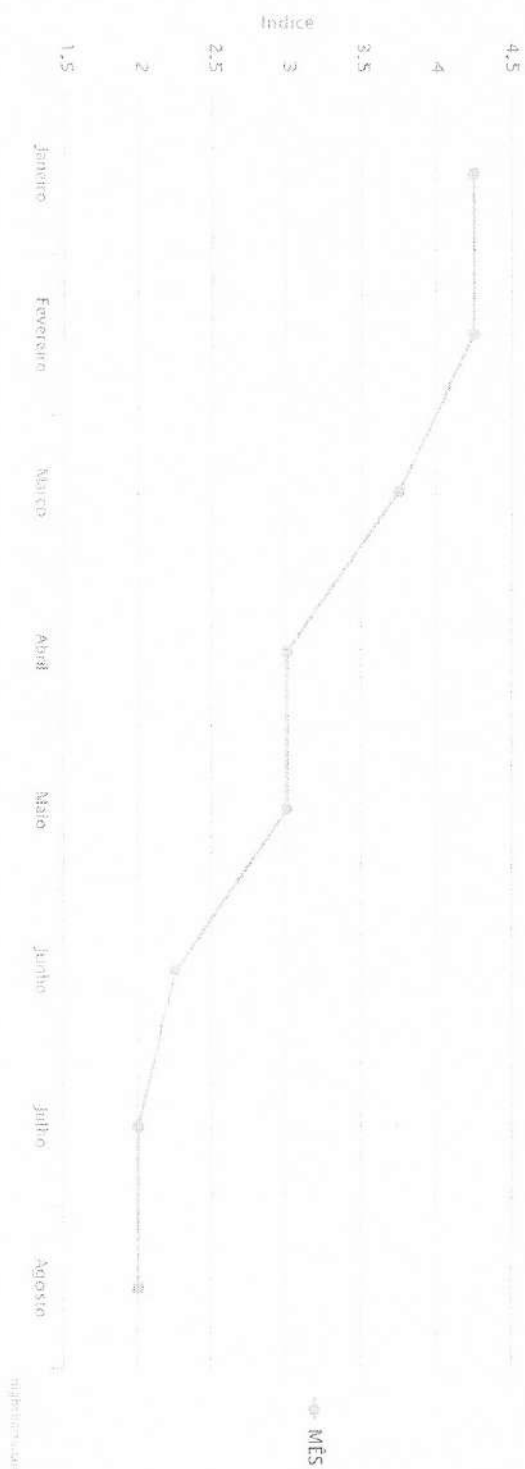
2020



2020	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Agos	Sep	Out	Nov	Dez
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				
ÚLT. 12 M	4.3000	3.9200	3.3100	2.4800	2.0500	2.3500	2.6900	2.9400				

SELIC

2020



Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez
4.25	4.25	3.75	3.00	3.00	2.25	2.00	2.00				

CADPREV

Renda Variável

Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FUNDO DE INVESTIMENTO
 Administrador: BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
 Resolução 3.922/2010-R DE AÇÕES / INDICES COM MIN 50 AÇÕES Art 8º, I, "a"
 Valor da Cota: R\$ 2,663305524
 % do PL do Fundo: 0,00%

Tipo: Fundo de Investimento
 CNPJ: 10.418.335/0001-88
 CNPJ: 30.822.936/0001-69
 Disponibilidade: D + 4
 Quantidade de Cotas: 0,0000
 Limite Cumulativo: 0,00%

Benchmark: AÇÕES
 Saldo em 08/2020: R\$ 0,00
 Performance: 0,00%
 Ações: 01/12/2015
 PL do Fundo: R\$ 942.280.344,59
 Limite do Fundo: 30%

Renda Fixa

Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO
 Administrador: BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
 Resolução 3.922/2010-R RENDA FIXA GERAL Art 7º, IV "a"
 Valor da Cota: R\$ 2,109658552
 % do PL do Fundo: 0,12%

Tipo: Fundo de Investimento
 CNPJ: 13.077.415/0001-05
 CNPJ: 30.822.936/0001-69
 Disponibilidade: D + 0
 Quantidade de Cotas: 1,032.877,7223
 Limite Cumulativo: 0,94%

Benchmark: CDI
 Saldo em 08/2020: R\$ 2.179.019,32
 Performance: 0,00%
 Ações: 31/12/2015
 PL do Fundo: R\$ 1.735.186.405,18
 Limite do Fundo: 40%

Renda Fixa

Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO
 Administrador: BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
 Resolução 3.922/2010-R RENDA FIXA GERAL Art 7º, IV "a"
 Valor da Cota: R\$ 2,109658552
 % do PL do Fundo: 0,00%

Tipo: Fundo de Investimento
 CNPJ: 13.077.415/0001-05
 CNPJ: 30.822.936/0001-69
 Disponibilidade: D + 0
 Quantidade de Cotas: 2.772.8895
 Limite Cumulativo: 0,00%

Benchmark: CDI
 Saldo em 08/2020: R\$ 5.849,85
 Performance: 0,00%
 Ações: 31/12/2015
 PL do Fundo: R\$ 1.735.186.405,18
 Limite do Fundo: 40%

Renda Fixa

Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO
 Administrador: BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
 Resolução 3.922/2010-R TÍTULOS TN Art 7º, I, "b"
 Valor da Cota: R\$ 2,797779357
 % do PL do Fundo: 0,18%

Tipo: Fundo de Investimento
 CNPJ: 13.322.205/0001-35
 CNPJ: 30.822.936/0001-69
 Disponibilidade: D + 0
 Quantidade de Cotas: 4.165.783,6530
 Limite Cumulativo: 5,05%

Benchmark: IDKA 2
 Saldo em 08/2020: R\$ 11.654.943,51
 Performance: 0,00%
 Ações: 01/12/2015
 PL do Fundo: R\$ 6.452.433.505,43
 Limite do Fundo: 100%

Renda Fixa

Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO
 Administrador: BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
 Resolução 3.922/2010-R RENDA FIXA GERAL Art 7º, IV "a"
 Valor da Cota: R\$ 5,506451997
 % do PL do Fundo: 0,03%

Tipo: Fundo de Investimento
 CNPJ: 78.615.540/0012-2
 CNPJ: 30.822.936/0001-69
 Disponibilidade: D + 0
 Quantidade de Cotas: 81.263,1222
 Limite Cumulativo: 0,19%

Benchmark: IMA-B
 Saldo em 08/2020: R\$ 447.471,40
 Performance: 0,00%
 Ações: 31/01/2017
 PL do Fundo: R\$ 1.456.021.562,44
 Limite do Fundo: 40%

Renda Fixa

Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRE-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI
 Administrador: BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
 Resolução 3.922/2010-R TÍTULOS TN Art 7º, I, "b"
 Valor da Cota: R\$ 2,707042142
 % do PL do Fundo: 0,09%

Tipo: Fundo de Investimento
 CNPJ: 11.378.882/0001-35
 CNPJ: 30.822.936/0001-69
 Disponibilidade: D + 0
 Quantidade de Cotas: 2.684.060,7788
 Limite Cumulativo: 3,15%

Benchmark: IRE-M1
 Saldo em 08/2020: R\$ 7.265.865,64
 Performance: 0,00%
 Ações: 01/12/2015
 PL do Fundo: R\$ 7.749.783.927,00
 Limite do Fundo: 100%

Renda Fixa			
Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DE LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COÍAS DE H	Tipo: Fundo de Investimento	Benchmark: CDI	
Administrador: BB GESTÃO DE RECURSOS DTM S.A	CNPJ: 13.077.418/0001-49	Saldo em 08/2020: R\$ 13.004.029,07	
Resolução 3.922/2010: F RENDA FIXA GERAL Art 7º, IV "a"	CNPJ: 30.822.936/0001-69	Performance: 0,00%	
Valor da Cota: R\$ 2,288172258	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/12/2015	
% do PL do Fundo: 0,51%	Quantidade de Cotas: 5.722.483,9713	PL do Fundo: R\$ 2.572.617.697,19	
	Limite Cumulativo: 5,67%	Limite do Fundo: 40%	
Renda Fixa			
Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO	Tipo: Fundo de Investimento	Benchmark: IPCA	
Administrador: BB GESTÃO DE RECURSOS DTM S.A	CNPJ: 19.303.795/0001-35	Saldo em 08/2020: R\$ 602.568,12	
Resolução 3.922/2010: F1 100 TÍTULOS TN Art 7º, I, "b"	CNPJ: 30.822.936/0001-69	Performance: 0,00%	
Valor da Cota: R\$ 2,240707238	Disponibilidade: D + 2705	Adesão: 01/12/2015	
% do PL do Fundo: 0,11%	Quantidade de Cotas: 268.918,7190	PL do Fundo: R\$ 570.737,97469	
	Limite Cumulativo: 0,26%	Limite do Fundo: 100%	
Renda Fixa			
Fundo: BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS	Tipo: Fundo de Investimento	Benchmark: IRF-M1	
Administrador: BANCO BRADESCO S.A	CNPJ: 11.484.558/0001-06	Saldo em 08/2020: R\$ 514.991,43	
Resolução 3.922/2010: F1 100 TÍTULOS TN Art 7º, I, "b"	CNPJ: 60.746.948/0001-12	Performance: 0,00%	
Valor da Cota: R\$ 2,557730000	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/12/2015	
% do PL do Fundo: 0,06%	Quantidade de Cotas: 201.347,0656	PL do Fundo: R\$ 891.402.902,10	
	Limite Cumulativo: 0,22%	Limite do Fundo: 100%	
Renda Fixa			
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	Tipo: Fundo de Investimento	Benchmark: IMA-B	
Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 20.139.299/0001-77	Saldo em 08/2020: R\$ 0,00	
Resolução 3.922/2010: F1 100 TÍTULOS TN Art 7º, I, "b"	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%	
Valor da Cota: R\$ 0,000000000	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/12/2015	
% do PL do Fundo: 0,00%	Quantidade de Cotas: 0,0000	PL do Fundo: R\$ 0,00	
	Limite Cumulativo: 0,00%	Limite do Fundo: 100%	
Renda Fixa			
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	Tipo: Fundo de Investimento	Benchmark: IMA-B	
Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 21.922.168/0001-24	Saldo em 08/2020: R\$ 0,00	
Resolução 3.922/2010: F1 100 TÍTULOS TN Art 7º, I, "b"	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%	
Valor da Cota: R\$ 0,000000000	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/12/2015	
% do PL do Fundo: 0,00%	Quantidade de Cotas: 0,0000	PL do Fundo: R\$ 0,00	
	Limite Cumulativo: 0,00%	Limite do Fundo: 100%	
Renda Fixa			
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2018 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	Tipo: Fundo de Investimento	Benchmark: IPCA	
Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 18.598.256/0001-08	Saldo em 08/2020: R\$ 0,00	
Resolução 3.922/2010: F1 RENDA FIXA GERAL Art 7º, IV "a"	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%	
Valor da Cota: R\$ 0,000000000	Disponibilidade: D + 425	Adesão: 01/12/2015	
% do PL do Fundo: 0,00%	Quantidade de Cotas: 0,0000	PL do Fundo: R\$ 0,00	
	Limite Cumulativo: 0,00%	Limite do Fundo: 40%	
Renda Fixa			
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	Tipo: Fundo de Investimento	Benchmark: IMA-B	
Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 10.740.658/0001-93	Saldo em 08/2020: R\$ 5.581.564,81	
Resolução 3.922/2010: F1 100 TÍTULOS TN Art 7º, I, "b"	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%	
Valor da Cota: R\$ 3,507818000	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/12/2015	
% do PL do Fundo: 0,10%	Quantidade de Cotas: 1.708.131,2650	PL do Fundo: R\$ 6.019.680.821,86	
	Limite Cumulativo: 2,59%	Limite do Fundo: 100%	

Renda Variável	Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA VII MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	Tipo: Fundo de Investimento	Benchmark: MULTIMERCADO
	Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 14.120.236/0001-76	Saldo em 08/2020: R\$ 0,00
	Resolução 3.922/2010- FI MULTIMERCADO ABERTO Art 8º, III	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%
	Valor da Cota: R\$ 0,000000000	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/12/2015
	% do PL do Fundo: 0,00%	Quantidade de Cotas: 0,0000	PL do Fundo: R\$ 0,00
Renda Fixa	Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRE-M I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	Tipo: Fundo de Investimento	Benchmark: IRE-M I
	Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 10.740.670/0001-06	Saldo em 08/2020: R\$ 17.311,861,80
	Resolução 3.922/2010- FI 100 TÍTULOS TN Art 7º, I, "b"	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%
	Valor da Cota: R\$ 2,592825000	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/12/2015
	% do PL do Fundo: 0,17%	Quantidade de Cotas: 6,676.833,8781	PL do Fundo: R\$ 10.245,504.415,29
Renda Fixa	Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRE-M I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	Tipo: Fundo de Investimento	Benchmark: IRE-M I
	Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 14.508.605/0001-00	Saldo em 08/2020: R\$ 8.755.446,09
	Resolução 3.922/2010- FI 100 TÍTULOS TN Art 7º, I, "b"	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%
	Valor da Cota: R\$ 2,324768000	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/12/2015
	% do PL do Fundo: 0,05%	Quantidade de Cotas: 3.766.159,0705	PL do Fundo: R\$ 16.114,955.012,29
Renda Fixa	Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	Tipo: Fundo de Investimento	Benchmark: CDI
	Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 37.372.060/0019-7	Saldo em 08/2020: R\$ 16.094.081,73
	Resolução 3.922/2010- FI RENDA FIXA GERAL Art 7º, IV "a"	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%
	Valor da Cota: R\$ 3,715724000	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/12/2015
	% do PL do Fundo: 0,34%	Quantidade de Cotas: 4.331.528,7017	PL do Fundo: R\$ 4.687.255.346,64
Renda Fixa	Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	Tipo: Fundo de Investimento	Benchmark: IMA-B
	Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 10.646.895/0001-90	Saldo em 08/2020: R\$ 10.993.788,28
	Resolução 3.922/2010- FI RENDA FIXA REFERENCIADA Art 7º, III "a"	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%
	Valor da Cota: R\$ 3,730257000	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/12/2015
	% do PL do Fundo: 0,38%	Quantidade de Cotas: 2.947.193,2577	PL do Fundo: R\$ 2.909.854.221,69
Renda Variável	Fundo: META PLUS FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	Tipo: Fundo de Investimento	Benchmark: MULTIMERCADO
	Administrador: Banco Daycova S.A.	CNPJ: 79.670.830/0013-1	Saldo em 08/2020: R\$ 0,00
	Resolução 3.922/2010- FI MULTIMERCADO ABERTO Art 8º, III	CNPJ: 62.232.889/0001-90	Performance: 0,00%
	Valor da Cota: R\$ 0,000000000	Disponibilidade: D + 1	Adesão: 01/12/2015
	% do PL do Fundo: 0,00%	Quantidade de Cotas: 0,00000	PL do Fundo: R\$ 0,00
Renda Variável	Fundo: META VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	Tipo: Fundo de Investimento	Benchmark: AÇÕES
	Administrador: Banco Daycova S.A.	CNPJ: 78.992.380/0014-0	Saldo em 08/2020: R\$ 16.880.975,63
	Resolução 3.922/2010- FI DE AÇÕES GERAL Art 8º, II, "a"	CNPJ: 62.232.889/0001-90	Performance: 0,00%
	Valor da Cota: R\$ 3,470088190	Disponibilidade: D + 4	Adesão: 01/12/2015
	% do PL do Fundo: 6,10%	Quantidade de Cotas: 4.858.947,2967	PL do Fundo: R\$ 276.573.030,89
Renda Variável	Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRE-M I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	Tipo: Fundo de Investimento	Benchmark: IRE-M I
	Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 10.740.670/0001-06	Saldo em 08/2020: R\$ 17.311,861,80
	Resolução 3.922/2010- FI 100 TÍTULOS TN Art 7º, I, "b"	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%
	Valor da Cota: R\$ 2,592825000	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/12/2015
	% do PL do Fundo: 0,17%	Quantidade de Cotas: 6,676.833,8781	PL do Fundo: R\$ 10.245,504.415,29

Renda Fixa

Fundo: MONGERAL AEGON CRÉDITO PRIVADO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO

Administrador: BEM - Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda

Resolução 3.922/2010: FI RENDA FIXA CREDITO PRIVADO Art 7º, VII, "b"

Valor da Cota: R\$ 1,637303400

% do PL do Fundo: 0,55%

Tipo: Fundo de Investimento

CNPJ: 19.488.788/0001-84

CNPJ: 00.066.670/0001-00

Disponibilidade: D + 0

Quantidade de Cotas: 302,159,5692

Limite Cumulativo: 0,21%

Benchmark: CREDITO PRIVADO

Saldo em 08/2020: R\$ 494,226,89

Performance: 0,00%

Adesão: 30/09/2019

PL do Fundo: R\$ 90.409.333,20

Limite do Fundo: 5%

Renda Variável

Fundo: MONGERAL AEGON INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO

Administrador: BEM - Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda

Resolução 3.922/2010: FI MULTIMERCADO ABERTO Art 8º, III

Valor da Cota: R\$ 2,102433500

% do PL do Fundo: 0,79%

Tipo: Fundo de Investimento

CNPJ: 14.115.116/0001-80

CNPJ: 00.066.670/0001-00

Disponibilidade: D + 4

Quantidade de Cotas: 485.479,9973

Limite Cumulativo: 0,44%

Benchmark: MULTIMERCADO

Saldo em 08/2020: R\$ 1.020,689,41

Performance: 0,00%

Adesão: 30/09/2019

PL do Fundo: R\$ 129.968.453,68

Limite do Fundo: 10%

Renda Variável

Fundo: OCEANA VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES

Administrador: BNY MELLON SERVICOS FINANCIEROS DTVM S.A.

Resolução 3.922/2010: FI DE AÇÕES GERAL Art 8º, II, "a"

Valor da Cota: R\$ 4,325332000

% do PL do Fundo: 0,00%

Tipo: Fundo de Investimento

CNPJ: 10.309.539/0001-80

CNPJ: 02.201.591/0001-61

Disponibilidade: D + 4

Quantidade de Cotas: 0,0000

Limite Cumulativo: 0,00%

Benchmark: AÇÕES

Saldo em 08/2020: R\$ 0,00

Performance: 0,00%

Adesão: 01/12/2015

PL do Fundo: R\$ 373.453.836,41

Limite do Fundo: 20%

Renda Variável

Fundo: QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES

Administrador: BEM - Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda

Resolução 3.922/2010: FI DE AÇÕES GERAL Art 8º, II, "a"

Valor da Cota: R\$ 2,869952200

% do PL do Fundo: 11,10%

Tipo: Fundo de Investimento

CNPJ: 92.890.720/0017-5

CNPJ: 00.066.670/0001-00

Disponibilidade: D + 13

Quantidade de Cotas: 4,291322,2840

Limite Cumulativo: 5,34%

Benchmark: AÇÕES

Saldo em 08/2020: R\$ 1.2315,889,83

Performance: 0,00%

Adesão: 01/12/2015

PL do Fundo: R\$ 110.950.792,93

Limite do Fundo: 20%

Renda Fixa

Fundo: SAFRA EXECUTIVE 2 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA

Administrador: SAFRA SERVIÇOS DE ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA LTDA

Resolução 3.922/2010: FI RENDA FIXA GERAL Art 7º, IV "a"

Valor da Cota: R\$ 283,200589000

% do PL do Fundo: 0,07%

Tipo: Fundo de Investimento

CNPJ: 10.787.647/0001-69

CNPJ: 06.947.853/0001-11

Disponibilidade: D + 1

Quantidade de Cotas: 1,813,6774

Limite Cumulativo: 0,22%

Benchmark: IRE-M1

Saldo em 08/2020: R\$ 513.634,50

Performance: 0,00%

Adesão: 01/12/2015

PL do Fundo: R\$ 702.235.168,33

Limite do Fundo: 40%

Renda Variável

Fundo: SAFRA S&P REAIS PB FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO

Administrador: SAFRA SERVIÇOS DE ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA LTDA

Resolução 3.922/2010: FI MULTIMERCADO ABERTO Art 8º, III

Valor da Cota: R\$ 228,809490000

% do PL do Fundo: 0,29%

Tipo: Fundo de Investimento

CNPJ: 21.595.829/0001-54

CNPJ: 06.947.853/0001-11

Disponibilidade: D + 4

Quantidade de Cotas: 6,810,3989

Limite Cumulativo: 0,68%

Benchmark: MULTIMERCADO

Saldo em 08/2020: R\$ 1.558.283,91

Performance: 0,00%

Adesão: 31/12/2019

PL do Fundo: R\$ 537.917.191,45

Limite do Fundo: 10%

Renda Fixa

Fundo: SIGREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B LP

Administrador: BANCO COOPERATIVO SIGREDI S.A.

Resolução 3.922/2010: FI RENDA FIXA REFERENCIADA Art 7º, III "a"

Valor da Cota: R\$ 3,700296200

% do PL do Fundo: 4,77%

Tipo: Fundo de Investimento

CNPJ: 11.087.118/0001-15

CNPJ: 01.181.521/0001-55

Disponibilidade: D + 1

Quantidade de Cotas: 5,869,265,0010

Limite Cumulativo: 9,41%

Benchmark: IMA-B

Saldo em 08/2020: R\$ 21.718,018,98

Performance: 0,00%

Adesão: 01/12/2015

PL do Fundo: R\$ 455.690.811,58

Limite do Fundo: 60%

Renda Fixa			
Fundo: SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRR-M 1	Tipo: Fundo de investimento	Benchmark: IRR-M 1	
Administrador: BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	CNPJ: 19.196.599/0001-09	Saldo em 08/2020: R\$ 7.953.405,29	
Resolução 3.922/2010: FI RENDA FIXA REFERENCIADA ART 7º, III "a"	CNPJ: 01.181.521/0001-55	Performance: 0,00%	
Valor da Cota: R\$ 1,833258200	Disponibilidade: D + 1	Adesão: 01/12/2015	
% do PL do Fundo: 2,54%	Quantidade de Cotas: 4.338.398,8527	PL do Fundo: R\$ 313.054,261,34	
	Limite Cumulativo: 3,45%	Limite do Fundo: 60%	

Renda Fixa			
Fundo: SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRR-M LONGO PRAZO	Tipo: Fundo de investimento	Benchmark: IRR-M	
Administrador: BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	CNPJ: 13.081.159/0001-20	Saldo em 08/2020: R\$ 1.695.585,27	
Resolução 3.922/2010: FI RENDA FIXA REFERENCIADA ART 7º, III "a"	CNPJ: 01.181.521/0001-55	Performance: 0,00%	
Valor da Cota: R\$ 2,395580100	Disponibilidade: D + 1	Adesão: 29/09/2017	
% do PL do Fundo: 0,30%	Quantidade de Cotas: 577.596,0257	PL do Fundo: R\$ 563.491.474,91	
	Limite Cumulativo: 0,73%	Limite do Fundo: 60%	

Renda Fixa			
Fundo: WESTERN ASSET IMABS ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	Tipo: Fundo de investimento	Benchmark: IMA-B 5	
Administrador: BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	CNPJ: 17.517.577/0001-78	Saldo em 08/2020: R\$ 831.389,84	
Resolução 3.922/2010: FI 100 TÍTULOS TN ART 7º, I, "b"	CNPJ: 15.223.680/0018-2	Performance: 0,00%	
Valor da Cota: R\$ 2,366412500	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/12/2015	
% do PL do Fundo: 0,12%	Quantidade de Cotas: 351.329,2125	PL do Fundo: R\$ 655.956.850,13	
	Limite Cumulativo: 0,36%	Limite do Fundo: 100%	

Renda Variável			
Fundo: WESTERN ASSET US INDEX 500 FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	Tipo: Fundo de investimento	Benchmark: MULTIMERCADO	
Administrador: BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	CNPJ: 17.453.850/0001-48	Saldo em 08/2020: R\$ 4.327.301,10	
Resolução 3.922/2010: FI MULTIMERCADO ABERTO ART 8º, III	CNPJ: 15.223.680/0018-2	Performance: 0,00%	
Valor da Cota: R\$ 3,060083800	Disponibilidade: D + 1	Adesão: 01/12/2015	
% do PL do Fundo: 0,43%	Quantidade de Cotas: 1.173.870,2614	PL do Fundo: R\$ 1,014.136,007,41	
	Limite Cumulativo: 1,87%	Limite do Fundo: 10%	

Renda Fixa			
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA	Tipo: Fundo de investimento	Benchmark: IPCA	
Administrador: CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	CNPJ: 23.215.697/0001-55	Saldo em 08/2020: R\$ 23.925.038,37	
Resolução 3.922/2010: FI 100 TÍTULOS TN ART 7º, I, "b"	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%	
Valor da Cota: R\$ 1,491577900	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 30/09/2019	
% do PL do Fundo: 0,18%	Quantidade de Cotas: 16.040.096,0667	PL do Fundo: R\$ 13.462.808.031,45	
	Limite Cumulativo: 10,37%	Limite do Fundo: 100%	

Renda Fixa			
Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	Tipo: Fundo de investimento	Benchmark: ALOCAÇÃO ATIVA	
Administrador: BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.	CNPJ: 25.078.994/0001-90	Saldo em 08/2020: R\$ 19.944.810,64	
Resolução 3.922/2010: FI 100 TÍTULOS TN ART 7º, I, "b"	CNPJ: 30.822.936/0001-69	Performance: 0,00%	
Valor da Cota: R\$ 1,492069778	Disponibilidade: D + 4	Adesão: 31/07/2020	
% do PL do Fundo: 0,18%	Quantidade de Cotas: 13.367.210,3906	PL do Fundo: R\$ 10.897.747.304,90	
	Limite Cumulativo: 86,4%	Limite do Fundo: 100%	

Renda Variável			
Fundo: OCEANA VALOR 30 FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	Tipo: Fundo de investimento	Benchmark: AÇÕES	
Administrador: BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A.	CNPJ: 26.956.042/0001-54	Saldo em 08/2020: R\$ 18.596.674,13	
Resolução 3.922/2010: FI DE AÇÕES GERAL ART 8º, II, "a"	CNPJ: 02.201.501/0001-61	Performance: 0,00%	
Valor da Cota: R\$ 4,312497020	Disponibilidade: D + 30	Adesão: 31/05/2017	
% do PL do Fundo: 7,12%	Quantidade de Cotas: 4.312.775.2419	PL do Fundo: R\$ 261.097.083,44	
	Limite Cumulativo: 806%	Limite do Fundo: 20%	

Renda Fixa			
Fundo: BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	Tipo: Fundo de Investimento	Benchmark: IPCA	
Administrador: BANCO BRADESCO S.A.	CNPJ: 28.515.874/0001-09	Saldo em 08/2020: R\$ 2.578.569,03	
Resolução 3.922/2010: FI RENDA FIXA GERAL Art 7º, IVº 8º	CNPJ: 60.746.948/0001-12	Performance: 0,00%	
Valor da Cota: R\$ 1,263695700	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 29/11/2019	
% do PL do Fundo: 0,19%	Quantidade de Cotas: 2.040.498,3811	PL do Fundo: R\$ 1.372.728,315,02	
	Limite Cumulativo: 1,12%	Limite do Fundo: 40%	
Renda Variável			
Fundo: BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO MAIOR INSTITUCIONAL	Tipo: Fundo de Investimento	Benchmark: MULTIMERCADO	
Administrador: BANCO BRADESCO S.A.	CNPJ: 21.287.421/0001-15	Saldo em 08/2020: R\$ 1.575.645,67	
Resolução 3.922/2010: FI MULTIMERCADO ABERTO Art 8º, III	CNPJ: 60.746.948/0001-12	Performance: 0,00%	
Valor da Cota: R\$ 1,464182300	Disponibilidade: D + 1	Adesão: 29/11/2019	
% do PL do Fundo: 0,55%	Quantidade de Cotas: 1.076.126,7023	PL do Fundo: R\$ 288.179,143,57	
	Limite Cumulativo: 0,68%	Limite do Fundo: 10%	

TOTAL: R\$ 230.813.019,54

Relatório competência: 08/2020



DI BLASI

CARTEIRA SUGERIDA ESTRATEGIA PRÓXIMO MÊS - PERFIL CONSERVADOR

ÍNDICE	CARTEIRA ATUAL		MOMENTANAÇÕES		CARTEIRA SUGERIDA	
	SALDO ATUAL	% CAPITAL	APLICAR / RESGATAR		SALDO FINAL	% CAPITAL
FIDC	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00
CRED PRIVADO	494.726,89	0,21	-10.019,55		484.707,34	0,21
MULTIMERCADO	8.481.920,09	3,67	-11.082,27		8.470.837,82	3,67
GERAL	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00
IPCA	27.106.175,52	11,74	-8.727,03		27.097.448,49	11,74
IMM-B	39.140.843,47	16,96	-27.600.192,49		11.540.650,98	5,00
IMM-B 5	831.389,84	0,36	22.249.912,11		23.081.301,95	10,00
IMM-B 5+	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00
IDXA 2	11.654.943,51	5,05	22.907.009,42		34.621.952,93	15,00
IDXA 20	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00
IRF-M	10.451.031,36	4,53	24.170.921,57		34.621.952,93	15,00
IRF-M1	33.559.758,66	14,54	-10.478.456,71		23.081.301,95	10,00
IRF-M1+	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00
AÇÕES	47.773.539,59	20,70	4.755,45		47.778.295,04	20,70
POUPANÇA	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00
FIP	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00
SELIC/CDI	31.373.879,97	13,59	-11.339.309,87		20.034.570,10	8,68
ALOCÇÃO ATIVA	19.944.810,64	8,64	-19.944.810,64		0,00	0,00
TOTAL:	230.813.019,54	100,00			230.813.019,54	100,00

MOMENTANAÇÕES 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

ÍNDICE	CARTERA ATUAL		MOMENTAÇÕES		CARTERA SUGERIDA	
	SALDO ATUAL	% CAPITAL	APLICAR / RESGATAR		SALDO FINAL	% CAPITAL
FIDC	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00
CRÉD. PRIVADO	494.726,89	0,21	-10.019,55		484.707,34	0,21
MULTIMERCADO	8.481.920,09	3,67	-11.082,27		8.470.837,82	3,67
GERAL	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00
IPCA	27.106.175,52	11,74	-8.727,03		27.097.448,49	11,74
IMA-B	39.140.843,47	16,96	-16.059,541,52		23.081.301,95	10,00
IMA-B 5	831.389,84	0,36	16.709.261,14		11.540.650,98	5,00
IMA-B 5+	0,00	0,00	23.081.301,95		23.081.301,95	10,00
IDK 2	11.654.943,51	5,05	11.428.358,44		23.081.301,95	10,00
IDK 20	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00
IRF-M	10.451.031,36	4,53	24.170,921,57		34.621.952,93	15,00
IRF-M1	33.559.758,66	14,54	-10.478.456,71		23.081.301,95	10,00
IRF-M1+	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00
AÇÕES	47.773.539,59	20,70	4.755,45		47.778.295,04	20,70
POUPANÇA	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00
FP	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00
SELIC/CDI	31.373.879,97	13,59	-22.879.960,85		8.493.919,12	3,68
ALOC. ATIVA	19.944.810,64	8,64	-19.944.810,64		0,00	0,00
TOTAL	230.813.019,54	100,00			230.813.019,54	100,00

MOMENTAÇÕES 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.

Carlo Fernando de Souza

DI BLASI CONSULTORIA FINANCEIRA LTDA

CNPJ 03.866.812/0001-02

CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS HABILITADA PELA COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS - CVM