

# INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE BREVES - IPMB

Relatório Competência

11/2020



## VISÃO GERAL

| FUNDO   | DISP. DE RESGATE | SALDO R\$ | PARTICIPAÇÃO | QTDE. COTISTAS | % SOBRE PL DO FUNDO | PL DO FUNDO R\$  | RESOLUÇÃO      | GRAU DE RISCO | TAXA ADM. | TIPO                  |
|---|------------------|-----------|--------------|----------------|---------------------|------------------|----------------|---------------|-----------|-----------------------|
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | D + 0            | 59,71     | 0,09 %       | 757            | 0,00 %              | 1.893.436.284,11 | Art 7º, IV "a" | Baixo         | 1,00 %    | Fundo de Investimento |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI                                 | D + 0            | 6.900,00  | 10,04 %      | 1229           | 0,00 %              | 7.844.641.875,20 | Art 7º, I, "b" | Baixo         | 0,10 %    | Fundo de Investimento |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA                              | D + 0            | 61.739,91 | 89,87 %      | 298            | 0,01 %              | 625.949.083,71   | Art 7º, IV "a" | Baixo         | 0,80 %    | Fundo de Investimento |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO                              | D + 0            | 0,00      | 0,00 %       | 651            | 0,00 %              | 4.499.544.566,86 | Art 7º, IV "a" | Baixo         | 0,20 %    | Fundo de Investimento |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO                              | D + 0            | 0,00      | 0,00 %       | 651            | 0,00 %              | 4.499.544.566,86 | Art 7º, IV "a" | Baixo         | 0,20 %    | Fundo de Investimento |

**TOTAL SALDO:** R\$ 68.699,62

Relatório competência: 11/2020



## 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%<br>ENQUADRADO   | 15%<br>ENQUADRADO | 20%<br>ENQUADRADO       | 100%            | 6.900,00  | 10,04 %    |
| FI RENDA FIXA GERAL - Art 7º, IV "a"         | 40%<br>DESENQUADRADO | 15%<br>ENQUADRADO | 20%<br>DESENQUADRADO    | 40%             | 61.799,62 | 89,96 %    |
| <b>Valor total Renda Fixa: R\$ 68.699,62</b> |                      |                   |                         |                 |           |            |

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

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

| DISTRIBUIÇÃO POR PARÂMETRO DE RENTABILIDADE | TOTAL                | % CARTEIRA |
|---|----------------------|------------|
| CDI   | 61.799,62            | 89,96      |
| IRF-M1                                      | 6.900,00             | 10,04      |
|   | <b>R\$ 68.699,62</b> |            |

| DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA               | TOTAL                | % CARTEIRA |
|---|----------------------|------------|
| CAIXA ECONOMICA FEDERAL   CNPJ: 00360305000104        | 0,00                 | 0,00       |
| BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A   CNPJ: 30822936000169 | 6.959,71             | 10,13      |
| CAIXA ECONOMICA FEDERAL   CNPJ: 360305000104          | 61.739,91            | 89,87      |
|   | <b>R\$ 68.699,62</b> |            |



## RETORNOS

| FUNDO   | SALDO ANTERIOR | APLICAÇÕES     | RESGATES       | SALDO ATUAL   | RETORNO R\$ | RETORNO % | EFETIVO % |
|---|----------------|----------------|----------------|---------------|-------------|-----------|-----------|
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | R\$ 8.245,06   | R\$ 718.246,76 | R\$ 726.490,88 | R\$ 59,71     | R\$ 58,77   | 0,05859 % | 0,05859 % |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI                                 | R\$ 0,00       | R\$ 6.900,00   | R\$ 0,00       | R\$ 6.900,00  | R\$ 0,00    | 0,19749 % | 0,19749 % |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA                              | R\$ 2,29       | R\$ 61.781,81  | R\$ 51,28      | R\$ 61.739,91 | R\$ 7,09    | 0,08231 % | 0,08231 % |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO                              | R\$ 0,00       | R\$ 0,00       | R\$ 0,00       | R\$ 0,00      | R\$ 0,00    | 0,15478 % | 0,15478 % |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO                              | R\$ 0,00       | R\$ 0,00       | R\$ 0,00       | R\$ 0,00      | R\$ 0,00    | 0,15478 % | 0,15478 % |
| TOTAIS  | R\$ 8.247,35   | R\$ 786.928,57 | R\$ 726.542,16 | R\$ 68.699,62 | R\$ 65,86   | 0,0939 %  | 0,0939 %  |

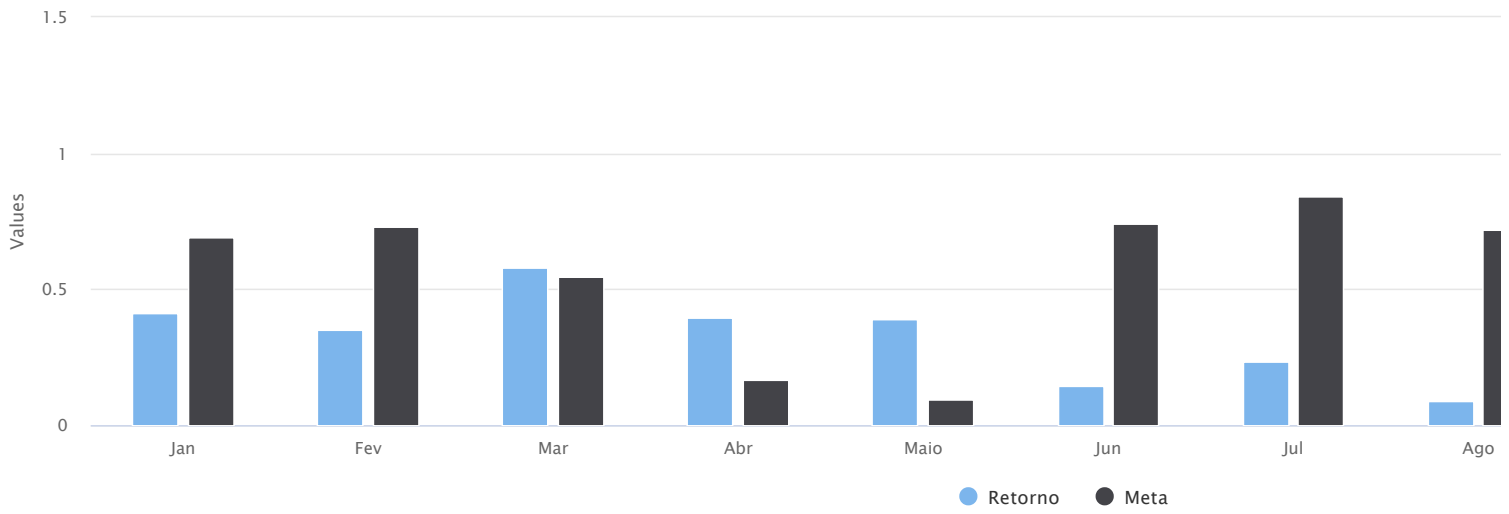


## RETORNOS ACUMULADO

| MÊS       | SALDO ANTERIOR | APLICAÇÕES       | RESGATES         | SALDO ATUAL    | RETORNO R\$  | RETORNO % | META % | ATINGIMENTO % |
|-----------|----------------|------------------|------------------|----------------|--------------|-----------|--------|---------------|
| JANEIRO   | R\$ 67.670,08  | R\$ 1.090.442,27 | R\$ 1.143.100,19 | R\$ 15.375,21  | R\$ 363,05   | 0,4152 %  | 0,69 % | 60,25 %       |
| FEVEREIRO | R\$ 15.375,21  | R\$ 870.096,07   | R\$ 811.036,94   | R\$ 74.661,02  | R\$ 226,68   | 0,3517 %  | 0,73 % | 48,22 %       |
| MARÇO     | R\$ 74.661,02  | R\$ 365.786,30   | R\$ 332.000,91   | R\$ 108.547,48 | R\$ 101,07   | 0,5804 %  | 0,55 % | 105,83 %      |
| ABRIL     | R\$ 108.547,48 | R\$ 158.819,55   | R\$ 258.086,20   | R\$ 9.364,84   | R\$ 84,01    | 0,3964 %  | 0,17 % | 237,94 %      |
| MAIO      | R\$ 9.364,84   | R\$ 1.050.529,92 | R\$ 1.047.785,79 | R\$ 12.243,02  | R\$ 134,05   | 0,3880 %  | 0,10 % | 402,89 %      |
| JUNHO     | R\$ 12.243,02  | R\$ 65.986,72    | R\$ 78.239,20    | R\$ 4,43       | R\$ 13,89    | 0,1446 %  | 0,74 % | 19,55 %       |
| JULHO     | R\$ 4,43       | R\$ 329.557,13   | R\$ 320.343,09   | R\$ 9.239,01   | R\$ 20,54    | 0,2320 %  | 0,84 % | 27,62 %       |
| AGOSTO    | R\$ 9.239,01   | R\$ 257.022,45   | R\$ 266.220,34   | R\$ 55,42      | R\$ 14,30    | 0,0905 %  | 0,72 % | 12,59 %       |
| SETEMBRO  | R\$ 55,42      | R\$ 92.775,45    | R\$ 86.400,78    | R\$ 6.431,26   | R\$ 1,17     | 0,0433 %  | 1,12 % | 3,86 %        |
| OUTUBRO   | R\$ 6.431,26   | R\$ 225.798,00   | R\$ 224.090,94   | R\$ 8.247,35   | R\$ 109,03   | 0,0560 %  | 1,34 % | 4,17 %        |
| NOVEMBRO  | R\$ 8.247,35   | R\$ 786.928,57   | R\$ 726.542,16   | R\$ 68.699,62  | R\$ 65,86    | 0,0939 %  | 1,37 % | 6,84 %        |
| TOTAIS    |                | R\$ 5.293.742,43 | R\$ 5.293.846,54 |                | R\$ 1.133,65 | 2,83      | 8,68   | 32,56         |

Relatório competência: 11/2020

Gráfico - Retorno acumulado no ano



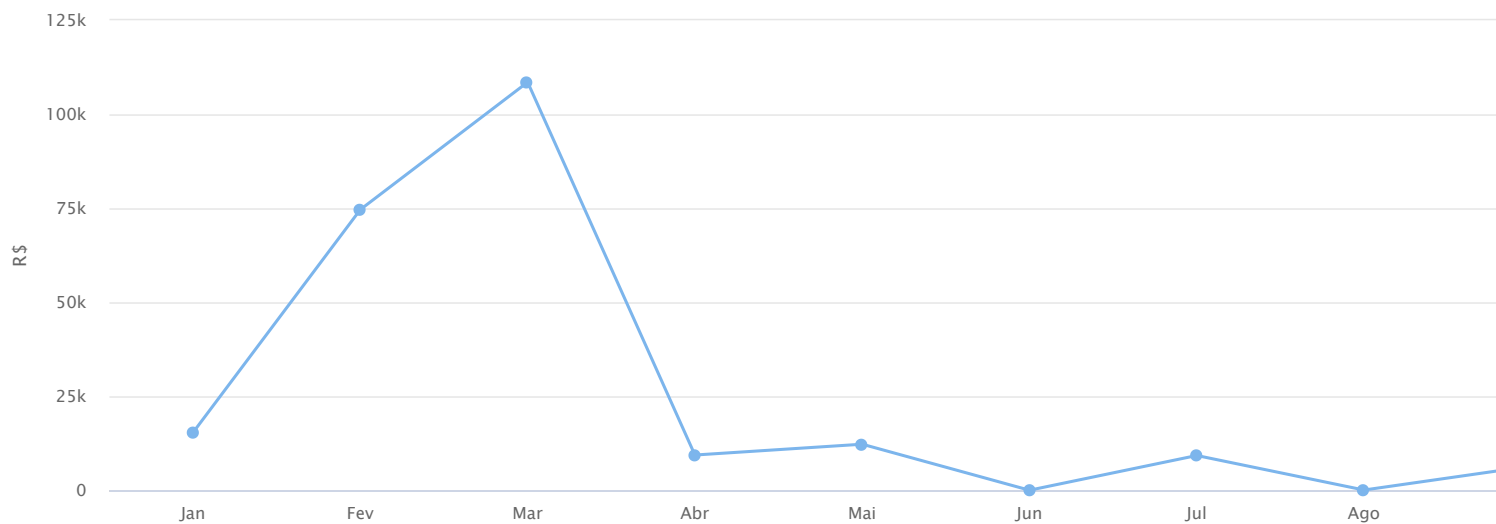
Relatório competência: 11/2020



## EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO X RENTABILIDADE MONETÁRIA

| MESES         | JANEIRO   | FEVEREIRO | MARÇO      | ABRIL    | MAIO      | JUNHO | JULHO    | AGOSTO | SETEMBRO | OUTUBRO  | NOVEMBRO  | DEZEMBRO |
|---------------|-----------|-----------|------------|----------|-----------|-------|----------|--------|----------|----------|-----------|----------|
| SALDO (R\$)   | 15.375,21 | 74.661,02 | 108.547,48 | 9.364,84 | 12.243,02 | 4,43  | 9.239,01 | 55,42  | 6.431,26 | 8.247,35 | 68.699,62 | 0,00     |
| RETORNO (R\$) | 363,05    | 226,68    | 101,07     | 84,01    | 134,05    | 13,89 | 20,54    | 14,30  | 1,17     | 109,03   | 65,86     | 0,00     |

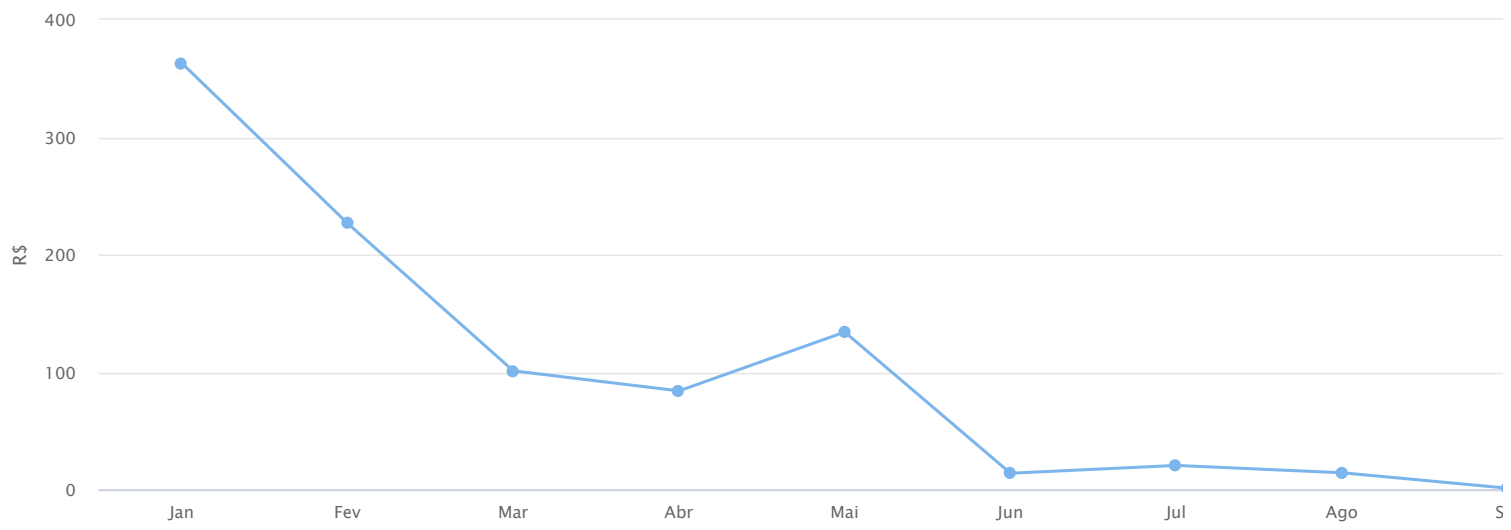
### REFERENTE AO SALDO (R\$)



Relatório competência: 11/2020



REFERENTE AO RETORNO (R\$)



Relatório competência: 11/2020





## 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       | 0,07 %       | -3,63 % | 0,09 %               | 0,13 %               | 0,30%                 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI                                 | IRF-M1    | 0,27 %       | 1,24 %  | 0,35 %               | 0,35 %               | 0,56%                 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA                              | CDI       | 0,64 %       | -2,89 % | 0,12 %               | 0,20 %               | 0,29%                 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO                              | CDI       | 0,91 %       | -1,02 % | 0,40 %               | 0,36 %               | 0,42%                 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO                              | CDI       | 0,91 %       | -1,02 % | 0,40 %               | 0,36 %               | 0,42%                 |

Relatório competência: 11/2020



## PROVISÃO DE RISCO - INDICATIVO

| FUNDO   | CNPJ               | BENCHMARK | SALDO (R\$) | VAR 12 MESES | VOLATILIDADE 12 MESES | VAR% BASE 1 DIA CONFIANÇA 95% 252 DU* (R\$) |
|---|--------------------|-----------|-------------|--------------|-----------------------|---|
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | 13.077.415/0001-05 | CDI       | 59,71       | 0,62 %       | 0,29 %                | 0,37  |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI                                 | 11.328.882/0001-35 | IRF-M1    | 6.900,00    | 0,94 %       | 0,43 %                | 64,86                                       |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA                              | 14.508.643/0001-55 | CDI       | 61.739,91   | 0,64 %       | 0,29 %                | 395,14                                      |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO                              | 03.737.206/0001-97 | CDI       | 0,00        | 0,91 %       | 0,42 %                | 0,00  |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO                              | 03.737.206/0001-97 | CDI       | 0,00        | 0,91 %       | 0,42 %                | 0,00  |

| RISCO DE MERCADO                            |               |
|---|---------------|
| <b>Saldo Total:</b>                         | R\$ 68.699,62 |
| <b>Provisão para perda e Investimentos:</b> | R\$ 460,37    |
| <b>% Provisão de Perda:</b>                 | 0,670%        |

Relatório competência: 11/2020



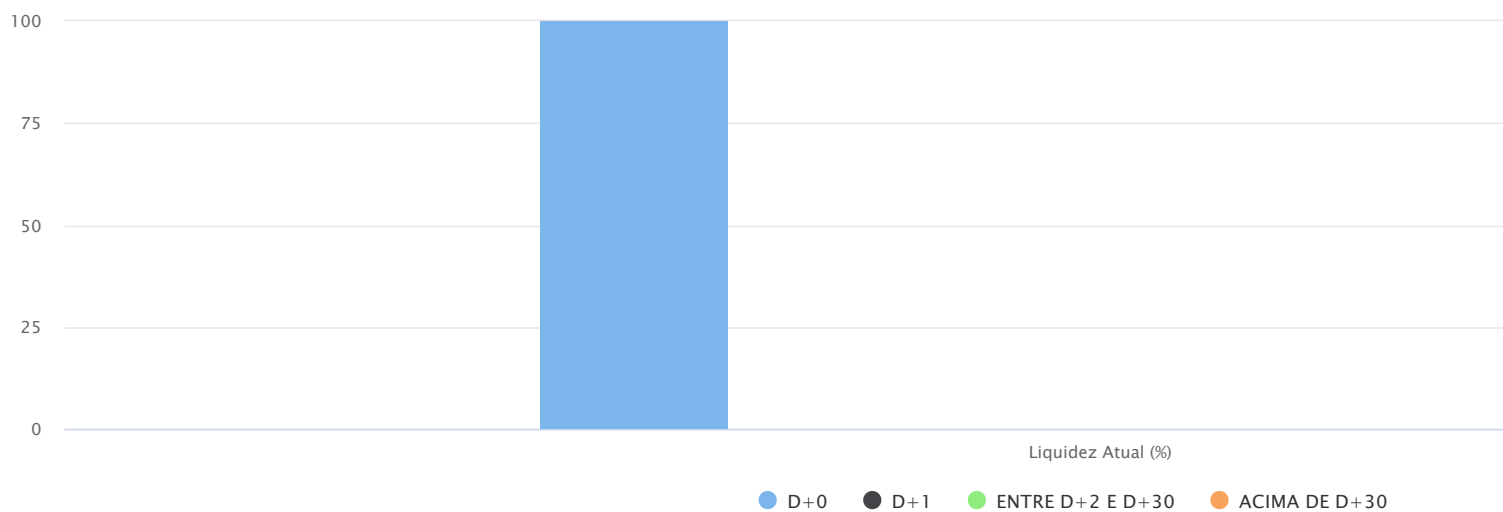
## RISCO DE LIQUIDEZ

| 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            | 59,71     | 0,09 %       | 757            | 0,00 %              | 1.893.436.284,11 | Art 7º, IV "a" | Baixo         |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI                                 | D + 0            | 6.900,00  | 10,04 %      | 1229           | 0,00 %              | 7.844.641.875,20 | Art 7º, I, "b" | Baixo         |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA                              | D + 0            | 61.739,91 | 89,87 %      | 298            | 0,01 %              | 625.949.083,71   | Art 7º, IV "a" | Baixo         |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO                              | D + 0            | 0,00      | 0,00 %       | 651            | 0,00 %              | 4.499.544.566,86 | Art 7º, IV "a" | Baixo         |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO                              | D + 0            | 0,00      | 0,00 %       | 651            | 0,00 %              | 4.499.544.566,86 | Art 7º, IV "a" | Baixo         |

**TOTAL SALDO:** R\$ 68.699,62

| PRAZO DE RESGATE | QUANTIDADE DE FUNDOS | LIQUIDEZ ATUAL |
|------------------|----------------------|----------------|
| D+0              | 5                    | 100%           |
| D+1              | 0                    | 0%             |
| 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 %           | 6.900,00  | 10,04      |
| Art 7º, IV "a"       | 40 %                | 40 %            | 61.799,62 | 89,96      |
|                      |                     |                 | 68.699,62 |            |

| RISCO DE CRÉDITO                            | % CARTEIRA |
|---|------------|
| 100% Títulos Públicos e 0% Títulos Privados | 55,02%     |
| 50% Títulos Públicos e 50% Títulos Privados | 44,98%     |
| 0% Títulos Públicos e 100% Títulos Privados | 0,00%      |

Relatório competência: 11/2020



## 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.

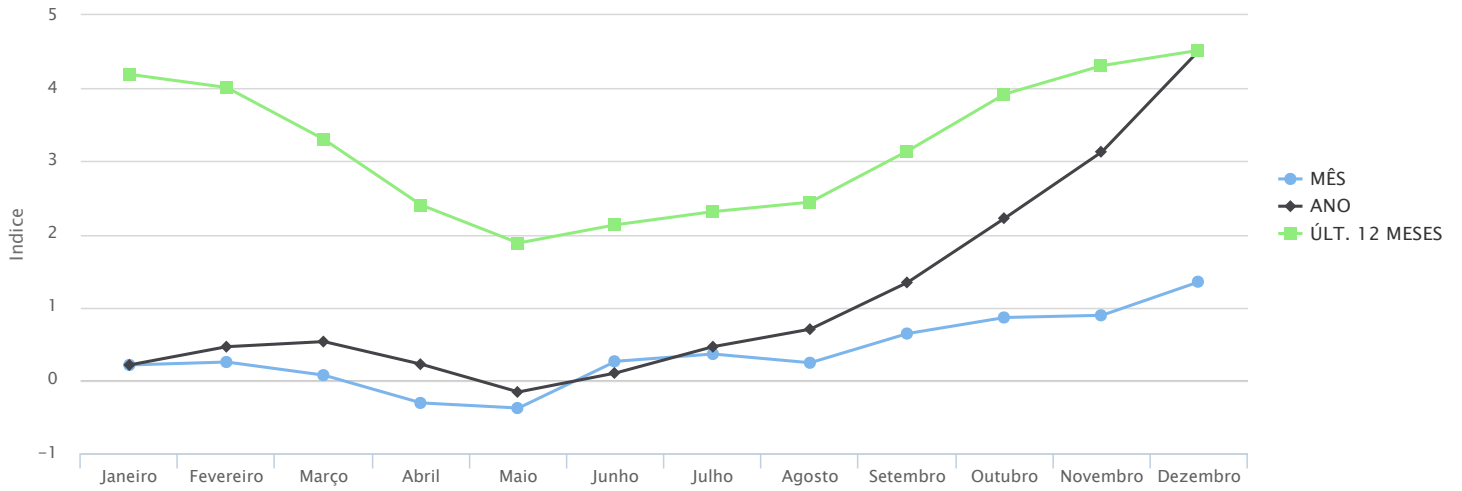
Relatório competência: 11/2020



# ÍNDICES ECONÔMICOS

## IPCA

2020



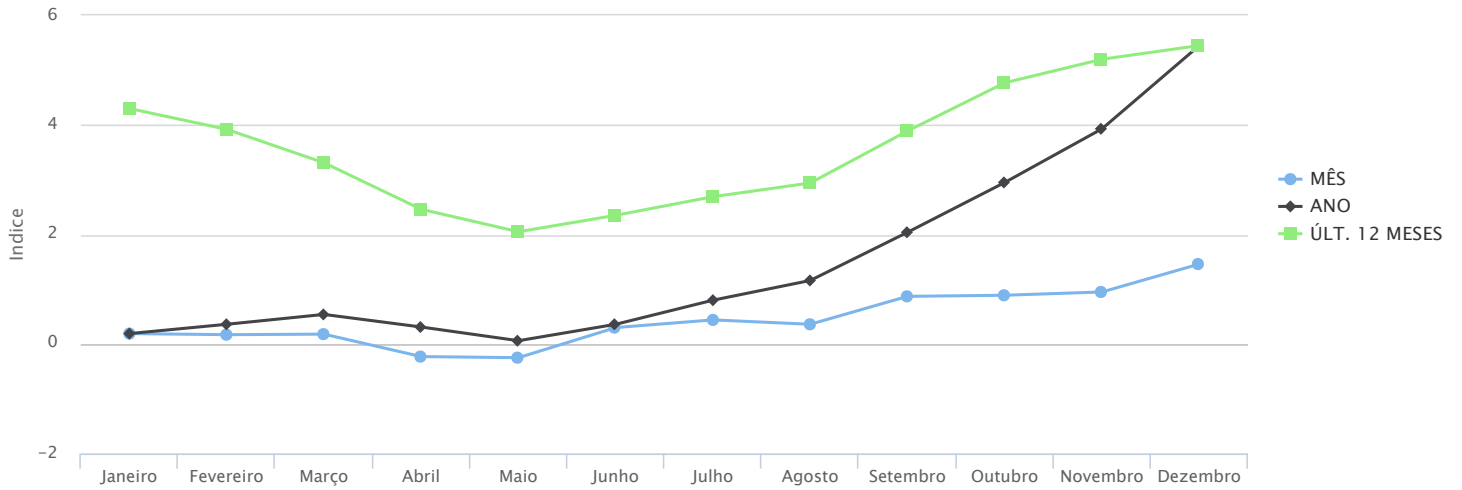
Highcharts.com

| 2020      | Janeiro | Fevereiro | Março  | Abril   | Maior   | 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   | 1.3500   |
| ANO       | 0.2100  | 0.4600    | 0.5300 | 0.2200  | -0.1600 | 0.1000 | 0.4600 | 0.7000 | 1.3400   | 2.2200  | 3.1300   | 4.5200   |
| 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   | 4.5200   |



## INPC

2020



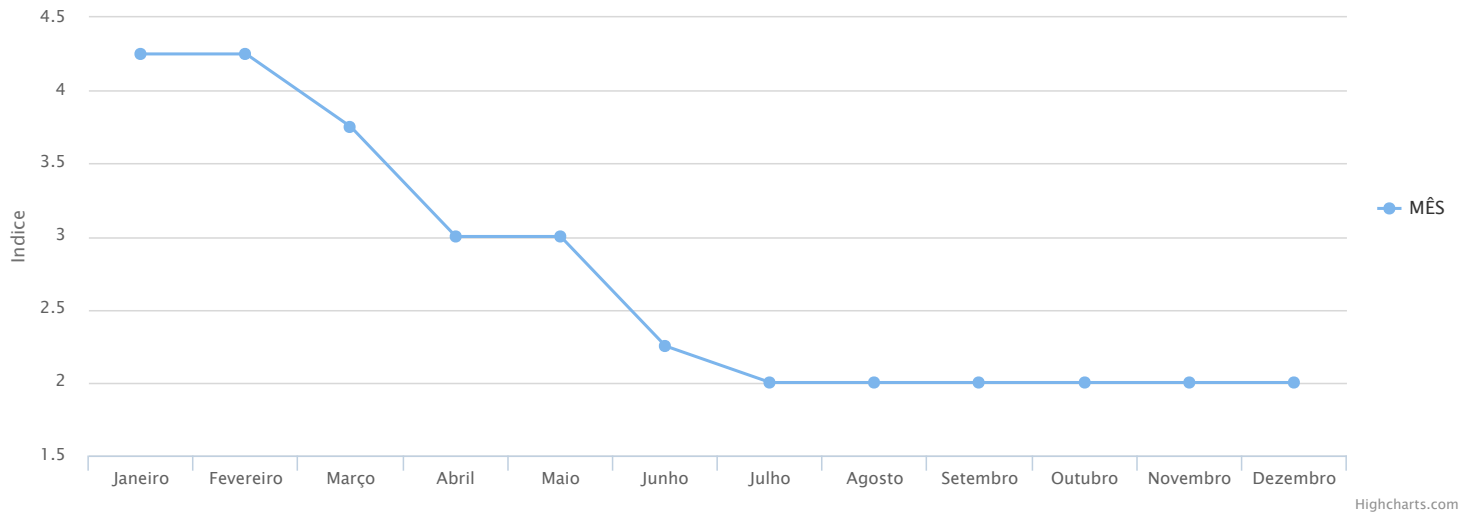
Highcharts.com

| 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   | 1.4600   |
| ANO       | 0.1900  | 0.3600    | 0.5400 | 0.3100  | 0.0600  | 0.3600 | 0.8000 | 1.1600 | 2.0400   | 2.9500  | 3.9300   | 5.4500   |
| 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   | 5.4500   |



### 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     | 2.00     |





## CADPREV

|  |                              |                                   |
|--|------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>  | Tipo: Fundo de Investimento  | Benchmark: CDI                    |
| Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | CNPJ: 13.077.415/0001-05     | Saldo em 11/2020: R\$ 59,71       |
| 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: 31/12/2016                |
| Valor da Cota: R\$ 2,112069840   | Quantidade de Cotas: 28,2708 | PL do Fundo: R\$ 1.893.436.284,11 |
| % do PL do Fundo: 0,00%  | Limite Cumulativo: 0,09%     | Limite do Fundo: 40%              |

|  |                                 |                                   |
|--|---------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>  | Tipo: Fundo de Investimento     | Benchmark: IRF-M1                 |
| Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | CNPJ: 11.328.882/0001-35        | Saldo em 11/2020: R\$ 6.900,00    |
| 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: 31/05/2017                |
| Valor da Cota: R\$ 2,716625009                                     | Quantidade de Cotas: 2.539,9162 | PL do Fundo: R\$ 7.844.641.875,20 |
| % do PL do Fundo: 0,00%  | Limite Cumulativo: 10,04%       | Limite do Fundo: 100%             |

|   |                                  |                                 |
|---|----------------------------------|---------------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>   | Tipo: Fundo de Investimento      | Benchmark: CDI                  |
| Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA | CNPJ: 14.508.643/0001-55         | Saldo em 11/2020: R\$ 61.739,91 |
| Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL                                | CNPJ: 00.360.305/0001-04         | Performance: 0,00%              |
| Resolução 3.922/2010: FI RENDA FIXA GERAL Art 7º, IV "a"              | Disponibilidade: D + 0           | Adesão: 29/09/2017              |
| Valor da Cota: R\$ 1,879916000  | Quantidade de Cotas: 32.841,8451 | PL do Fundo: R\$ 625.949.083,71 |
| % do PL do Fundo: 0,01%   | Limite Cumulativo: 89,87%        | Limite do Fundo: 40%            |

|   |                             |                                   |
|---|-----------------------------|-----------------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>   | Tipo: Fundo de Investimento | Benchmark: CDI                    |
| Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO | CNPJ: 37.372.060/0019-7     | Saldo em 11/2020: R\$ 0,00        |
| Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL                                | CNPJ: 00.360.305/0001-04    | Performance: 0,00%                |
| Resolução 3.922/2010: FI RENDA FIXA GERAL Art 7º, IV "a"              | Disponibilidade: D + 0      | Adesão: 31/12/2016                |
| Valor da Cota: R\$ 3,725903000  | Quantidade de Cotas: 0,0000 | PL do Fundo: R\$ 4.499.544.566,86 |
| % do PL do Fundo: 0,00%   | Limite Cumulativo: 0,00%    | Limite do Fundo: 40%              |

|   |                             |                                   |
|---|-----------------------------|-----------------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>   | Tipo: Fundo de Investimento | Benchmark: CDI                    |
| Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO | CNPJ: 37.372.060/0019-7     | Saldo em 11/2020: R\$ 0,00        |
| Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL                                | CNPJ: 00.360.305/0001-04    | Performance: 0,00%                |
| Resolução 3.922/2010: FI RENDA FIXA GERAL Art 7º, IV "a"              | Disponibilidade: D + 0      | Adesão: 31/08/2017                |
| Valor da Cota: R\$ 3,725903000  | Quantidade de Cotas: 0,0000 | PL do Fundo: R\$ 4.499.544.566,86 |
| % do PL do Fundo: 0,00%   | Limite Cumulativo: 0,00%    | Limite do Fundo: 40%              |

**TOTAL: R\$ 68.699,62**

Relatório competência: 11/2020



## CARTEIRA SUGERIDA ESTRATEGIA PRÓXIMO MÊS - PERFIL CONSERVADOR

| CARTEIRA ATUAL |             |           | MOVIMENTAÇÕES      | CARTEIRA SUGERIDA |           |
|----------------|-------------|-----------|--------------------|-------------------|-----------|
| INDICE         | 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           | 0,00        | 0,00      | 0,00               | 0,00              | 0,00      |
| IMA-B          | 0,00        | 0,00      | 3.434,98           | 3.434,98          | 5,00      |
| IMA-B 5        | 0,00        | 0,00      | 10.304,94          | 10.304,94         | 15,00     |
| IMA-B 5+       | 0,00        | 0,00      | 0,00               | 0,00              | 0,00      |
| IDKA 2         | 0,00        | 0,00      | 10.304,94          | 10.304,94         | 15,00     |
| IDKA 20        | 0,00        | 0,00      | 0,00               | 0,00              | 0,00      |
|                |             |           |                    |                   |           |
| IRF-M          | 0,00        | 0,00      | 10.304,94          | 10.304,94         | 15,00     |
| IRF-M1         | 6.900,00    | 10,04     | 3.404,94           | 10.304,94         | 15,00     |
| IRF-M1+        | 0,00        | 0,00      | 0,00               | 0,00              | 0,00      |
|                |             |           |                    |                   |           |
| AÇÕES          | 0,00        | 0,00      | 0,00               | 0,00              | 0,00      |
| POUPANÇA       | 0,00        | 0,00      | 0,00               | 0,00              | 0,00      |
| FIP            | 0,00        | 0,00      | 0,00               | 0,00              | 0,00      |
| SELIC/CDI      | 61.799,62   | 89,96     | -54.929,66         | 6.869,96          | 10,00     |
| ALOCAÇÃO ATIVA | 0,00        | 0,00      | 17.174,91          | 17.174,91         | 25,00     |
|                |             |           |                    |                   |           |
| TOTAL:         | 68.699,62   | 100,00    |                    | 68.699,62         | 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: 11/2020



## ESTRATEGIA PRÓXIMO MÊS - PERFIL MODERADO

| CARTEIRA ATUAL |             |           | MOVIMENTAÇÕES      | CARTEIRA SUGERIDA |           |
|----------------|-------------|-----------|--------------------|-------------------|-----------|
| INDICE         | 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           | 0,00        | 0,00      | 0,00               | 0,00              | 0,00      |
| IMA-B          | 0,00        | 0,00      | 6.869,96           | 6.869,96          | 10,00     |
| IMA-B 5        | 0,00        | 0,00      | 6.869,96           | 6.869,96          | 10,00     |
| IMA-B 5+       | 0,00        | 0,00      | 6.869,96           | 6.869,96          | 10,00     |
| IDKA 2         | 0,00        | 0,00      | 10.304,94          | 10.304,94         | 15,00     |
| IDKA 20        | 0,00        | 0,00      | 0,00               | 0,00              | 0,00      |
| IRF-M          | 0,00        | 0,00      | 10.304,94          | 10.304,94         | 15,00     |
| IRF-M1         | 6.900,00    | 10,04     | 3.404,94           | 10.304,94         | 15,00     |
| IRF-M1+        | 0,00        | 0,00      | 0,00               | 0,00              | 0,00      |
| AÇÕES          | 0,00        | 0,00      | 0,00               | 0,00              | 0,00      |
| POUPANÇA       | 0,00        | 0,00      | 0,00               | 0,00              | 0,00      |
| FIP            | 0,00        | 0,00      | 0,00               | 0,00              | 0,00      |
| SELIC/CDI      | 61.799,62   | 89,96     | -58.364,64         | 3.434,98          | 5,00      |
| ALOCÇÃO ATIVA  | 0,00        | 0,00      | 13.739,92          | 13.739,92         | 20,00     |
| TOTAL:         | 68.699,62   | 100,00    |                    | 68.699,62         | 100,00    |

MOVIMENTAÇÕES ACIMA SÃO SUGESTÕES PARA O SEGMENTO DE RENDA FIXA, EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS COMPOSTOS EXCLUSIVAMENTE POR TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS, PARA ALOCAÇÃO EM INSTITUIÇÕES RECONHECIDAMENTE DE PRIMEIRA LINHA, EM PRODUTOS QUE JÁ INTEGRAM A CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RPPS.

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

Relatório competência: 11/2020