

# Relatório Analítico dos Investimentos

## em dezembro, 4º trimestre e ano de 2020

Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.



**CRÉDITO  
& MERCADO**

**Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2020)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	11.195.034,20	17,15%	588	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.007.806,68	3,08%	922	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	2.555.394,20	3,91%	685	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	2.848.474,22	4,36%	296	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	872.828,54	1,34%	134	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	7.120.723,73	10,91%	885	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.110.080,98	6,30%	1.005	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.423.528,23	5,24%	976	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	408.766,94	0,63%	322	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMOBILIÁRIO	D+0	Não há	7.247.172,36	11,10%	301	0,24%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PESADA	D+3	Não há	6.273.396,80	9,61%	431	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	1.510.173,13	2,31%	297	0,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	38.891,51	0,06%	412	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	13.879,67	0,02%	15.442	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.167.933,60	3,32%	269	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.870.017,31	4,40%	1.656	0,23%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	871.985,73	1,34%	724	0,18%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.065.202,30	1,63%	2.098	0,09%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.574.826,73	2,41%	18.629	0,27%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	919.685,90	1,41%	1.837	0,04%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '



**CRÉDITO  
& MERCADO**

**Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2020)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	400.258,02	0,61%	2.413	0,04%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	257.133,46	0,39%	8.663	0,05%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAU FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	316.972,17	0,49%	55	0,03%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	2.229.710,41	3,42%	138	0,12%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	1.018.399,38	1,56%	69	1,37%	Artigo 8º, Inciso III
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	1.965.880,51	3,01%	19.035	0,37%	Artigo 9º, Inciso III
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>65.284.156,71</b>				



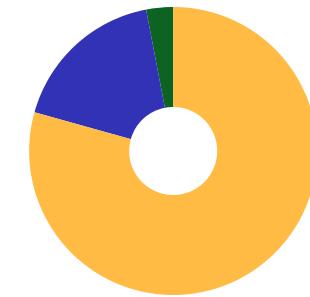
**CRÉDITO  
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/12/2020

**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Dezembro / 2020)**

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	34.542.637,72	52,91%	20,00%	30,00%	90,00%	24.213.103,32
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	7.247.172,36	11,10%	0,00%	10,00%	60,00%	31.923.321,67
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	10.004.274,71	15,32%	5,00%	30,00%	40,00%	16.109.387,97
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	1.305.683,13
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.264.207,84
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.264.207,84
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>51.794.084,79</b>	<b>79,34%</b>	<b>25,00%</b>	<b>70,00%</b>	<b>202,00%</b>	



RENDAS FIXAS 51.794.084,79

RENDAS VARIÁVEIS 11.524.191,41

EXTERIOR 1.965.880,51



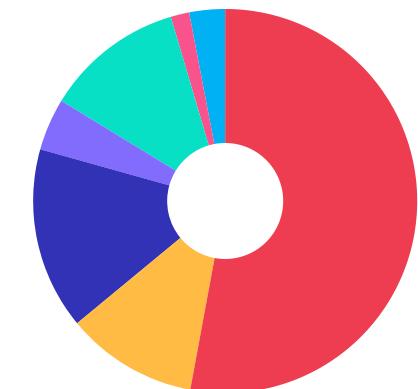
**CRÉDITO  
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/12/2020

**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Dezembro / 2020)**

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	30,00%	2.870.017,31	4,40%	0,00%	2,00%	5,00%	394.190,53
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	3.264.207,84
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	7.635.774,72	11,70%	5,00%	15,00%	20,00%	5.421.056,62
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.018.399,38	1,56%	0,00%	6,00%	10,00%	5.510.016,29
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	3.264.207,84
<b>Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário</b>	<b>30,00%</b>	<b>11.524.191,41</b>	<b>17,65%</b>	<b>5,00%</b>	<b>30,00%</b>	<b>45,00%</b>	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	1.965.880,51	3,01%	0,00%	0,00%	10,00%	4.562.535,16
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>1.965.880,51</b>	<b>3,01%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>10,00%</b>	

■ 7º I b    ■ 7º III a    ■ 7º IV a    ■ 8º I a  
■ 8º II a    ■ 8º III    ■ 9º III



**Enquadramento por Gestores - base (Dezembro / 2020)**

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	35.119.246,60	53,79	0,00
CAIXA DTVM	24.530.608,03	37,58	-
ITAÚ UNIBANCO	2.229.710,41	3,42	0,00
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	2.167.933,60	3,32	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	919.685,90	1,41	0,00
ITAÚ DTVM	316.972,17	0,49	0,00

**Artigo 20º** - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR) - (Resolução 4963)

**Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos**

Artigos	Estratégia de Alocação - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	5,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	0,00	0,00	5,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00



**CRÉDITO  
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/12/2020

**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2020 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,73%	8,62%	3,05%	5,10%	8,62%	21,46%	-	-
IMA Geral (Benchmark)	2,02%	5,34%	2,86%	3,40%	5,34%	18,84%	-	-
IMA-B 5+ (Benchmark)	7,51%	5,50%	10,53%	11,36%	5,50%	37,54%	-	-
IMA-B 5 (Benchmark)	1,83%	8,04%	3,38%	4,72%	8,04%	22,25%	-	-
IMA-B (Benchmark)	4,85%	6,41%	7,18%	8,21%	6,41%	30,83%	-	-
CDI (Benchmark)	0,16%	2,76%	0,47%	0,99%	2,76%	8,88%	-	-
IPCA (Benchmark)	1,35%	4,52%	3,13%	4,42%	4,52%	9,02%	-	-



CRÉDITO  
& MERCADO

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/12/2020

**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2020 - RENDA VARIÁVEL**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,16%	2,76%	0,47%	0,99%	2,76%	8,88%	-	-
Ibovespa (Benchmark)	9,30%	2,92%	25,81%	25,21%	2,92%	35,42%	-	-
SMALL (Benchmark)	7,52%	-0,65%	22,54%	25,33%	-0,65%	57,16%	-	-

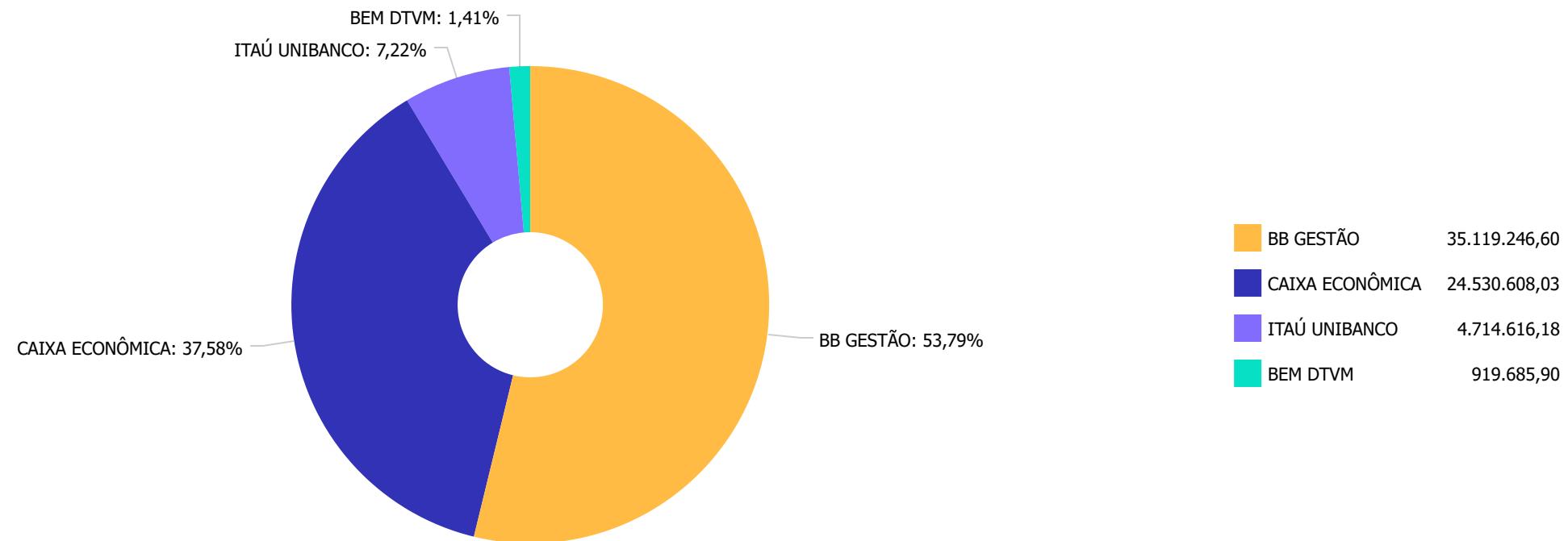


CRÉDITO  
& MERCADO

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/12/2020

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Dezembro / 2020)



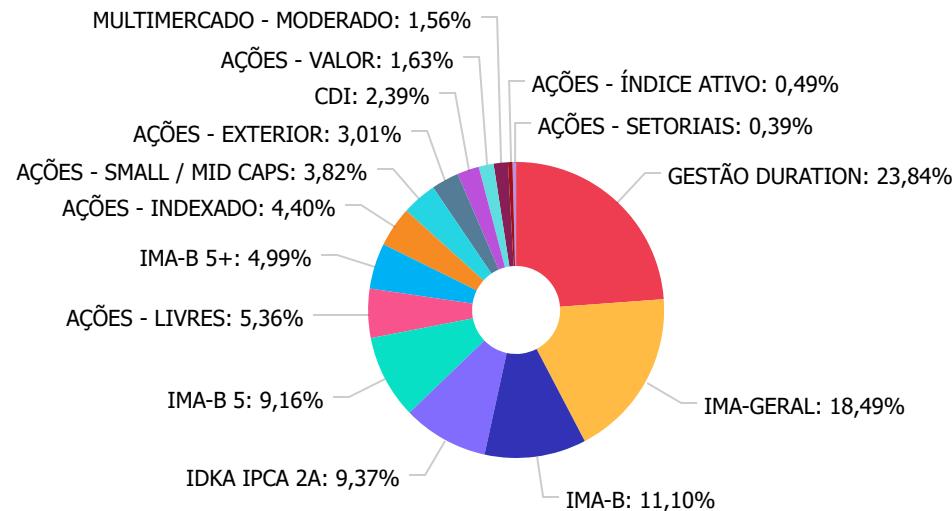


**CRÉDITO  
& MERCADO**

## Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Dezembro / 2020)

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/12/2020



■ GESTÃO DURATION	15.562.054,13	■ IMA-GERAL	12.067.862,74	■ IMA-B	7.247.172,36	■ IDKA IPCA 2A	6.117.887,66
■ IMA-B 5	5.978.922,43	■ AÇÕES - LIVRES	3.501.954,16	■ IMA-B 5+	3.257.241,16	■ AÇÕES - INDEXADO	2.870.017,31
■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	2.494.512,63	■ AÇÕES - EXTERIOR	1.965.880,51	■ CDI	1.562.944,31	■ AÇÕES - VALOR	1.065.202,30
■ MULTIMERCADO - MODERADO	1.018.399,38	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	316.972,17	■ AÇÕES - SETORIAIS	257.133,46		

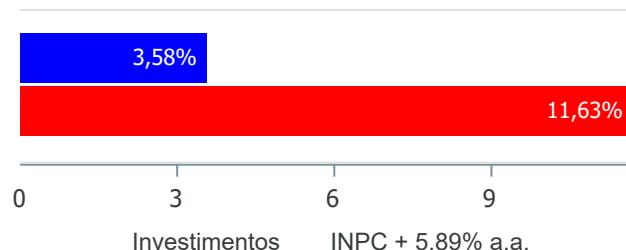


**CRÉDITO  
& MERCADO**

## Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2020

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	71.608.899,47	5.356.522,44	3.185.641,26	74.015.374,95	235.594,30	235.594,30	0,32%	0,32%	0,69%	0,69%	46,16%	2,26%
Fevereiro	74.015.374,95	5.869.135,62	6.576.391,03	72.679.586,37	-628.533,17	-392.938,87	-0,85%	-0,53%	0,58%	1,28%	-41,73%	3,41%
Março	72.679.586,37	7.930.967,98	9.161.261,27	65.956.176,36	-5.493.116,72	-5.886.055,59	-7,56%	-8,05%	0,68%	1,97%	-409,34%	15,19%
Abri	65.956.176,36	10.076.335,85	8.230.349,14	69.061.763,00	1.259.599,93	-4.626.455,66	1,86%	-6,34%	0,22%	2,20%	-288,90%	7,67%
Maio	69.061.763,00	8.562.846,84	6.357.269,70	72.637.854,31	1.370.514,17	-3.255.941,49	1,92%	-4,54%	0,20%	2,40%	-188,91%	3,75%
Junho	72.637.854,31	2.519.009,53	5.277.883,11	71.465.974,93	1.586.994,20	-1.668.947,29	2,18%	-2,46%	0,78%	3,20%	-76,68%	3,18%
Julho	71.465.974,93	3.800.219,46	5.499.307,82	71.932.385,98	2.165.499,41	496.552,12	3,03%	0,50%	0,97%	4,20%	11,91%	2,58%
Agosto	71.932.385,98	6.258.702,47	7.845.822,72	69.441.891,42	-903.374,31	-406.822,19	-1,26%	-0,76%	0,84%	5,07%	-15,01%	2,62%
Setembro	69.441.891,42	3.257.175,38	4.943.224,80	66.683.573,63	-1.072.268,37	-1.479.090,56	-1,54%	-2,29%	1,35%	6,49%	-35,32%	3,74%
Outubro	66.683.573,63	1.836.667,92	3.527.476,32	64.881.088,76	-111.676,47	-1.590.767,03	-0,17%	-2,46%	1,37%	7,96%	-30,89%	2,89%
Novembro	64.881.088,76	5.860.064,42	7.522.392,71	65.014.739,91	1.795.979,44	205.212,41	2,77%	0,24%	1,41%	9,48%	2,56%	2,94%
Dezembro	65.014.739,91	3.201.074,37	5.095.768,96	65.284.156,71	2.164.111,39	2.369.323,80	3,33%	3,58%	1,97%	11,63%	30,77%	2,17%

### Investimentos x Meta de Rentabilidade





CRÉDITO  
& MERCADO

## Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/12/2020

ANO

36M

### Evolução do Patrimônio



Investimentos      Meta de Rentabilidade       CDI       IMA-B

IMA-B 5       IMA-B 5+       IMA Geral       IRF-M       IRF-M 1  
 IRF-M 1+       Ibovespa       IBX       SMLL       IDIV

Investimentos      Meta de Rentabilidade       CDI       IMA-B  
 IMA-B 5

IMA-B 5+       IMA Geral       IRF-M       IRF-M 1       IRF-M 1+  
 Ibovespa       IBX       SMLL       IDIV



**CRÉDITO  
& MERCADO**

**Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Dezembro/2020**

**FUNDOS DE RENDA FIXA**

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	380.025,68	0,00	0,00	408.766,94	28.741,26	7,56%	7,56%	3,42%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	2.650.368,49	0,00	0,00	2.848.474,22	198.105,73	7,47%	7,47%	3,37%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	6.911.695,47	0,00	0,00	7.247.172,36	335.476,89	4,85%	4,85%	2,04%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	6.108.676,44	0,00	0,00	6.273.396,80	164.720,36	2,70%	2,70%	1,09%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.934.889,80	0,00	0,00	11.195.034,20	260.144,40	2,38%	2,38%	1,02%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	854.681,40	0,00	0,00	872.828,54	18.147,14	2,12%	2,12%	0,89%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.362.340,51	0,00	0,00	3.423.528,23	61.187,72	1,82%	1,82%	0,74%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.510.040,56	0,00	0,00	2.555.394,20	45.353,64	1,81%	1,81%	0,75%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.043.259,53	0,00	0,00	4.110.080,98	66.821,45	1,65%	1,65%	0,71%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.977.635,32	0,00	0,00	2.007.806,68	30.171,36	1,53%	1,53%	0,66%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	8.909.399,69	1.704.909,31	3.599.124,57	7.120.723,73	105.539,30	0,99%	1,32%	0,55%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	38.792,87	0,00	0,00	38.891,51	98,64	0,25%	0,25%	0,03%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.163.559,76	0,00	0,00	2.167.933,60	4.373,84	0,20%	0,20%	0,02%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	1.508.756,36	1.496.165,06	1.496.644,39	1.510.173,13	1.896,10	0,06%	0,09%	0,00%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	13.877,74	0,00	0,00	13.879,67	1,93	0,01%	0,01%	0,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>52.367.999,62</b>	<b>3.201.074,37</b>	<b>5.095.768,96</b>	<b>51.794.084,79</b>	<b>1.320.779,76</b>	<b>2,52%</b>		<b>1,11%</b>



**CRÉDITO  
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/12/2020

**Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Dezembro/2020**

**FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL**

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	962.078,07	0,00	0,00	1.065.202,30	103.124,23	10,72%	10,72%	7,54%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	800.604,31	0,00	0,00	871.985,73	71.381,42	8,92%	8,92%	6,40%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.639.131,10	0,00	0,00	2.870.017,31	230.886,21	8,75%	8,75%	6,71%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	846.793,76	0,00	0,00	919.685,90	72.892,14	8,61%	8,61%	5,68%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	292.502,60	0,00	0,00	316.972,17	24.469,57	8,37%	8,37%	6,16%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	237.354,55	0,00	0,00	257.133,46	19.778,91	8,33%	8,33%	6,96%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.065.132,60	0,00	0,00	2.229.710,41	164.577,81	7,97%	7,97%	6,55%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	371.830,81	0,00	0,00	400.258,02	28.427,21	7,65%	7,65%	5,83%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	1.472.869,49	0,00	0,00	1.574.826,73	101.957,24	6,92%	6,92%	7,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>9.688.297,29</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>10.505.792,03</b>	<b>817.494,74</b>	<b>8,44%</b>		<b>6,64%</b>



CRÉDITO  
& MERCADO

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/12/2020

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Dezembro / 2020)

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.954.299,44	0,00	0,00	1.965.880,51	11.581,07	0,59%	0,59%	7,07%
<b>Total Exterior</b>	<b>1.954.299,44</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>1.965.880,51</b>	<b>11.581,07</b>	<b>0,59%</b>		<b>7,07%</b>



**CRÉDITO  
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/12/2020

**Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2020**

**FUNDOS DE RENDA FIXA**

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	6.766.456,88	0,00	0,00	7.247.172,36	480.715,48	7,10%	7,10%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.850.568,10	0,00	0,00	11.195.034,20	344.466,10	3,17%	3,17%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	9.386.141,61	0,00	6.823.080,00	2.848.474,22	285.412,61	3,04%	10,38%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREV...	3.428.835,84	2.619.136,43	0,00	6.273.396,80	225.424,53	3,73%	3,66%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	11.248.197,82	1.704.909,31	6.014.503,59	7.120.723,73	182.120,19	1,41%	2,04%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	3.988.515,41	0,00	0,00	4.110.080,98	121.565,57	3,05%	3,05%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.313.583,73	0,00	0,00	3.423.528,23	109.944,50	3,32%	3,32%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.472.906,16	0,00	0,00	2.555.394,20	82.488,04	3,34%	3,34%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.945.093,21	0,00	0,00	2.007.806,68	62.713,47	3,22%	3,22%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	369.715,09	0,00	0,00	408.766,94	39.051,85	10,56%	10,56%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	848.704,62	0,00	0,00	872.828,54	24.123,92	2,84%	2,84%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.159.623,56	0,00	0,00	2.167.933,60	8.310,04	0,38%	0,38%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	770.603,77	2.740.653,03	2.004.416,95	1.510.173,13	3.333,28	0,09%	0,26%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	544.252,34	0,00	544.773,68	0,00	521,34	0,10%	0,64%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	38.711,61	0,00	0,00	38.891,51	179,90	0,46%	0,46%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	726.054,29	726.150,08	0,00	95,79	0,01%	0,22%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	46.545,07	40,00	32.713,69	13.879,67	8,29	0,02%	0,04%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>58.178.454,82</b>	<b>7.790.793,06</b>	<b>16.145.637,99</b>	<b>51.794.084,79</b>	<b>1.970.474,90</b>	<b>2,99%</b>	



**CRÉDITO  
& MERCADO**

**Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2020**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/12/2020

**FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL**

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.307.082,99	0,00	0,00	2.870.017,31	562.934,32	24,40%	24,40%
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.891.658,22	0,00	0,00	2.229.710,41	338.052,19	17,87%	17,87%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	1.249.183,19	41.679,10	0,00	1.574.826,73	283.964,44	22,00%	22,24%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	750.349,16	65.334,55	0,00	1.065.202,30	249.518,59	30,59%	32,39%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	696.255,34	0,00	0,00	871.985,73	175.730,39	25,24%	25,24%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	800.531,35	0,00	0,00	919.685,90	119.154,55	14,88%	14,88%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	336.840,94	0,00	0,00	400.258,02	63.417,08	18,83%	18,83%
ITAU FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	260.604,08	0,00	0,00	316.972,17	56.368,09	21,63%	21,63%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	212.613,54	0,00	0,00	257.133,46	44.519,92	20,94%	20,94%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,00	1.000.000,00	0,00	1.018.399,38	18.399,38	1,84%	1,96%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>8.505.118,81</b>	<b>1.107.013,65</b>	<b>0,00</b>	<b>11.524.191,41</b>	<b>1.912.058,95</b>	<b>19,89%</b>	



**CRÉDITO  
& MERCADO**

**Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2020**

**FUNDOS DE RENDA FIXA**

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	7.962.264,91	4.535.919,25	6.014.503,59	7.120.723,73	637.043,16	5,10%	6,66%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.465.060,64	1.194.511,04	0,00	11.195.034,20	535.462,52	5,02%	5,09%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	9.166.290,31	0,00	2.350.000,00	7.247.172,36	430.882,05	4,70%	6,05%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	6.353.684,19	1.287.774,28	3.930.578,81	4.110.080,98	399.201,32	5,22%	8,03%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.343.495,57	0,00	1.213.981,11	3.423.528,23	294.013,77	6,77%	7,75%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.370.919,30	0,00	0,00	2.555.394,20	184.474,90	7,78%	7,78%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	6.101.301,50	0,00	6.273.396,80	172.095,30	2,82%	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.860.530,61	0,00	0,00	2.007.806,68	147.276,07	7,92%	7,92%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.092.578,71	9.043.806,55	14.274.793,62	0,00	138.408,36	0,98%	3,63%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	458.704,55	603.873,82	1.133.503,77	0,00	70.925,40	6,67%	7,81%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.107.618,09	0,00	0,00	2.167.933,60	60.315,51	2,86%	2,86%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	835.034,00	0,00	0,00	872.828,54	37.794,54	4,53%	4,53%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	388.438,98	0,00	0,00	408.766,94	20.327,96	5,23%	5,23%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	314.831,41	704.032,01	1.029.841,09	0,00	10.977,67	1,08%	3,47%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	476.206,82	0,00	483.654,18	0,00	7.447,36	1,56%	2,40%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,00	4.162.276,79	2.655.694,30	1.510.173,13	3.590,64	0,09%	1,90%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	214.012,16	7.180.978,40	7.398.393,76	0,00	3.403,20	0,05%	1,64%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	37.959,06	0,00	0,00	38.891,51	932,45	2,46%	2,46%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	452.883,85	25.475.421,91	25.914.764,61	13.879,67	338,52	0,00%	0,15%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	9.861.436,50	0,00	6.823.080,00	2.848.474,22	<b>-189.882,28</b>	<b>-1,93%</b>	5,06%



CRÉDITO  
& MERCADO

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/12/2020

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
Total Renda Fixa	61.761.949,66	60.289.895,55	73.222.788,84	51.794.084,79	2.965.028,42	2,43%	



**CRÉDITO  
& MERCADO**

**Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2020**

**FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL**

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.806.117,39	0,00	0,00	2.870.017,31	63.899,92	2,28%	2,28%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	448.531,12	566.435,15	0,00	1.065.202,30	50.236,03	4,95%	5,98%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,00	1.000.000,00	0,00	1.018.399,38	18.399,38	1,84%	-
ITAU FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	310.322,40	0,00	0,00	316.972,17	6.649,77	2,14%	2,14%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	395.608,45	0,00	0,00	400.258,02	4.649,57	1,18%	1,18%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	255.708,41	0,00	0,00	257.133,46	1.425,05	0,56%	0,56%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	887.548,28	379,96	0,00	871.985,73	<b>-15.942,51</b>	<b>-1,80%</b>	<b>-1,80%</b>
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	937.480,93	0,00	0,00	919.685,90	<b>-17.795,03</b>	<b>-1,90%</b>	<b>-1,90%</b>
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	974.972,54	672.011,62	0,00	1.574.826,73	<b>-72.157,43</b>	<b>-4,38%</b>	<b>-5,72%</b>
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.830.660,29	0,00	0,00	2.229.710,41	<b>-600.949,88</b>	<b>-21,23%</b>	<b>-21,23%</b>
<b>Total Renda Variável</b>	<b>9.846.949,81</b>	<b>2.238.826,73</b>	<b>0,00</b>	<b>11.524.191,41</b>	<b>-561.585,13</b>	<b>-4,65%</b>	



CRÉDITO  
& MERCADO

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/12/2020

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2020

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	2.000.000,00	0,00	1.965.880,51	-34.119,49	-1,71%	47,07%
<b>Total Exterior</b>	<b>0,00</b>	<b>2.000.000,00</b>	<b>0,00</b>	<b>1.965.880,51</b>	<b>-34.119,49</b>	<b>-1,71%</b>	



## Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria 1.467, de 02 de junho de 2022. e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

