

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2019

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 (Setembro / 2019)

| 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 | 9.296.704,37 | 13,64% | 552 | 0,11% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE... | D+1 | Não há | 1.813.051,08 | 2,66% | 876 | 0,02% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | D+1 | Não há | 2.312.257,33 | 3,39% | 608 | 0,05% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI... | D+2 | Não há | 9.564.835,47 | 14,04% | 334 | 0,32% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA... | D+1 | Não há | 819.827,04 | 1,20% | 124 | 0,13% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI... | D+0 | Não há | 509.510,08 | 0,75% | 1.212 | 0,01% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+1 | Não há | 449.505,71 | 0,66% | 38 | 0,97% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | D+0 | Não há | 7.821.700,27 | 11,48% | 643 | 0,10% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE... | D+0 | Não há | 8.323.318,13 | 12,21% | 937 | 0,10% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0 | Não há | 3.506.223,07 | 5,15% | 913 | 0,03% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ... | D+0 | Não há | 377.662,02 | 0,55% | 357 | 0,01% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0 | Não há | 5.169.821,93 | 7,59% | 1.389 | 0,05% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM... | D+0 | Não há | 8.922.123,25 | 13,09% | 302 | 0,30% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO | D+0 | Não há | 41,80 | 0,00% | 729 | 0,00% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE... | D+0 | Não há | 736.005,58 | 1,08% | 695 | 0,02% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 37.507,49 | 0,06% | 391 | 0,00% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO | D+0 | Não há | 130.396,61 | 0,19% | 15.892 | 0,00% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F... | D+1 | Não há | 2.082.760,46 | 3,06% | | 0,04% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES | D+4 | Não há | 2.513.101,86 | 3,69% | 177 | 0,44% | Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a ' |
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES | D+4 | Não há | 793.002,56 | 1,16% | 66 | 0,22% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' |



**CRÉDITO
& MERCADO**

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2019)

| Produto / Fundo | Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | Enquadramento |
|--|---------|-----------------|----------------------|--------------------|----------|------------------|----------------------------------|
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES | D+25 | Não há | 214.554,12 | 0,31% | 2.318 | 0,07% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a' |
| ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES | D+5 | Não há | 275.077,84 | 0,40% | 52 | 0,00% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a' |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | D+24 | Não há | 2.471.500,36 | 3,63% | 152 | 0,00% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a' |
| DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS | D+0 | | 242.530,80 | 0,36% | | 0,00% | DF - Artigo 6º |
| Total para cálculo dos limites da Resolução | | | 68.140.488,43 | | | | |
| DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS | | | 242.530,80 | | | | Artigo 6º |
| | | PL Total | 68.383.019,23 | | | | |



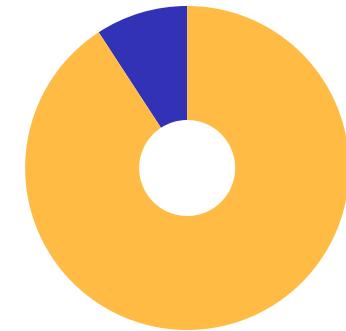
**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2019

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Setembro / 2019)

| Artigos - Renda Fixa | Resolução | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - 2019 | | | GAP Superior |
|-------------------------------------|----------------|----------------------|---------------|-------------------------------|---------------|----------------|----------------------|
| | | | | Inf | Alvo | Sup | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' | 100,00% | 49.964.416,50 | 73,33% | 15,00% | 25,00% | 90,00% | 11.362.023,09 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 60,00% | 8.922.123,25 | 13,09% | 0,00% | 10,00% | 60,00% | 31.962.169,81 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' | 40,00% | 2.986.711,94 | 4,38% | 10,00% | 30,00% | 40,00% | 24.269.483,43 |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a ' | 15,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 2,00% | 1.362.809,77 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a ' | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 5,00% | 3.407.024,42 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c ' | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 3.407.024,42 |
| Total Renda Fixa | 100,00% | 61.873.251,69 | 90,80% | 25,00% | 70,00% | 202,00% | |



RENDA FIXA 61.873.251,69

RENDA VARIÁVEL 6.267.236,74



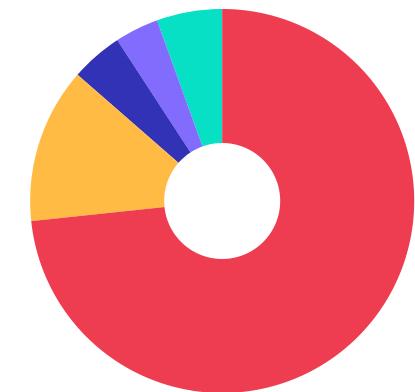
**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2019

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Setembro / 2019)

| Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário | Resolução | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - 2019 | | | GAP Superior |
|---|---------------|---------------------|--------------|-------------------------------|---------------|---------------|--------------|
| | | | | Inf | Alvo | Sup | |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a' | 30,00% | 2.513.101,86 | 3,69% | 0,00% | 0,00% | 10,00% | 4.300.946,98 |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b' | 30,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 10,00% | 6.814.048,84 |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a' | 20,00% | 3.754.134,88 | 5,51% | 0,00% | 10,00% | 20,00% | 9.873.962,81 |
| Artigo 8º, Inciso III | 10,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 10,00% | 10,00% | 6.814.048,84 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a' | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 5,00% | 3.407.024,42 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b' | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 5,00% | 3.407.024,42 |
| Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário | 30,00% | 6.267.236,74 | 9,20% | 0,00% | 30,00% | 60,00% | |



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



Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2019)

| Gestão | Valor | % S/ Carteira | % S/ PL Gestão |
|----------------------------|---------------|---------------|----------------|
| CAIXA DTVM | 34.503.306,89 | 50,64 | - |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 28.807.842,88 | 42,28 | 0,00 |
| ITAÚ UNIBANCO | 2.471.500,36 | 3,63 | 0,00 |
| ITAÚ ASSET MANAGEMENT | 2.082.760,46 | 3,06 | - |
| ITAÚ DTVM | 275.077,84 | 0,40 | 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 - 2019 | | Limite Inferior (%) | Limite Superior (%) |
|-------------------------------------|-------------------------------|------------|---------------------|---------------------|
| | Carteira \$ | Carteira % | | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' | 0,00 | 0,00 | 15,00 | 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 | 10,00 | 40,00 |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2,00 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a ' | 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 | 10,00 |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 20,00 |
| Artigo 8º, Inciso III | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5,00 |



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2019

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2019 - RENDA FIXA

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|------------------------------|--------|--------|-------|--------|--------|--------|---------|------------------|
| IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark) | 1,60% | 9,13% | 2,72% | 6,49% | 12,85% | 22,46% | - | - |
| IMA Geral (Benchmark) | 1,46% | 10,72% | 2,61% | 7,52% | 16,78% | 23,07% | - | - |
| IRF-M 1+ (Benchmark) | 1,87% | 11,89% | 3,27% | 9,07% | 20,81% | 27,25% | - | - |
| IMA-B 5+ (Benchmark) | 3,73% | 26,55% | 4,48% | 17,54% | 44,85% | 43,66% | - | - |
| IRF-M 1 (Benchmark) | 0,64% | 5,31% | 1,92% | 3,72% | 7,44% | 14,70% | - | - |
| IMA-B 5 (Benchmark) | 1,74% | 10,27% | 2,78% | 7,17% | 15,40% | 22,93% | - | - |
| IMA-B (Benchmark) | 2,86% | 19,55% | 3,77% | 13,27% | 31,37% | 34,72% | - | - |
| CDI (Benchmark) | 0,46% | 4,66% | 1,54% | 3,10% | 6,27% | 13,34% | - | - |
| IPCA (Benchmark) | -0,04% | 2,49% | 0,26% | 0,97% | 2,89% | 7,55% | - | - |



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2019

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2019 - RENDA VARIÁVEL

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|----------------------|-------|--------|-------|-------|--------|--------|---------|------------------|
| Ibovespa (Benchmark) | 3,57% | 19,18% | 3,74% | 9,78% | 32,02% | 40,99% | - | - |

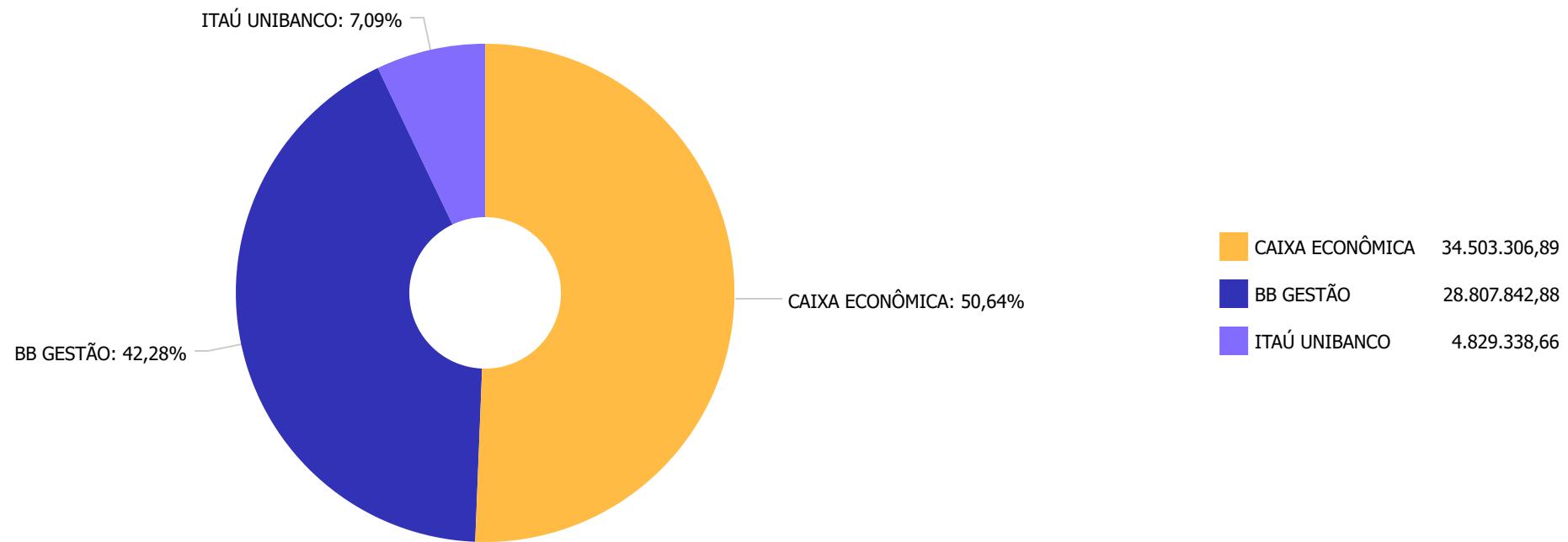


CRÉDITO
& MERCADO

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2019

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Setembro / 2019)



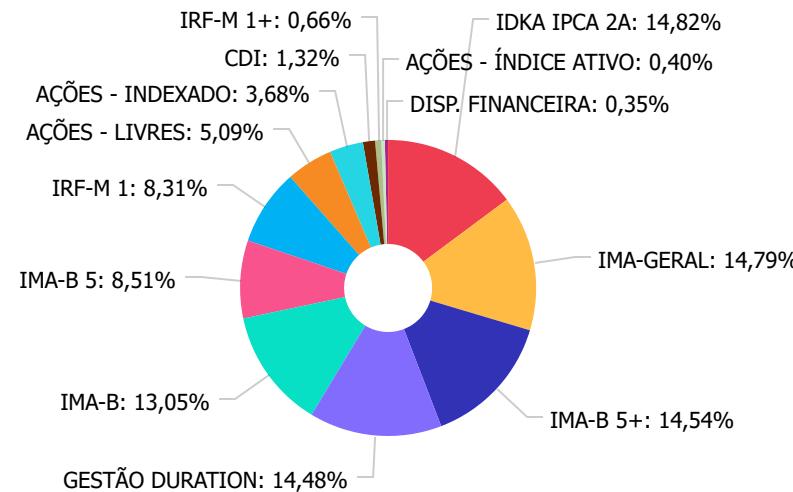


**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2019

Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Setembro / 2019)



| | | | | | | | |
|--------------------|---------------|-------------|---------------|------------|--------------|------------------------|--------------|
| ■ IDKA IPCA 2A | 10.136.369,21 | ■ IMA-GERAL | 10.116.531,41 | ■ IMA-B 5+ | 9.942.497,49 | ■ GESTÃO DURATION | 9.904.460,73 |
| ■ IMA-B | 8.922.123,25 | ■ IMA-B 5 | 5.818.480,40 | ■ IRF-M 1 | 5.679.332,01 | ■ AÇÕES - LIVRES | 3.479.057,04 |
| ■ AÇÕES - INDEXADO | 2.513.101,86 | ■ CDI | 903.951,48 | ■ IRF-M 1+ | 449.505,71 | ■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO | 275.077,84 |
| ■ DISP. FINANCEIRA | 242.530,80 | | | | | | |



**CRÉDITO
& MERCADO**

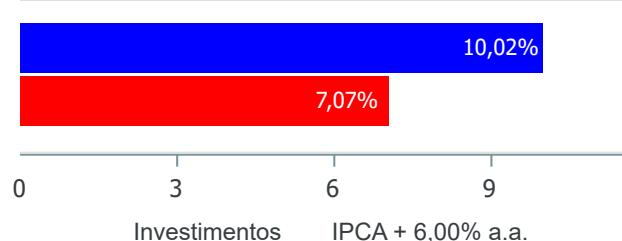
FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2019

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2019

| Mês | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo no Mês | Retorno | Retorno Acum | Retorno Mês | Retorno Acum | Meta Mês | Meta Acum | Gap Acum | VaR |
|-----------|----------------|---------------|---------------|---------------|--------------|--------------|-------------|--------------|----------|-----------|----------|-------|
| Janeiro | 59.146.721,15 | 562.081,80 | 500.815,66 | 60.400.149,03 | 1.192.161,74 | 1.192.161,74 | 2,01% | 2,01% | 0,83% | 0,83% | 242,12% | 1,20% |
| Fevereiro | 60.400.149,03 | 1.563.955,51 | 900.000,00 | 61.229.678,60 | 165.574,06 | 1.357.735,80 | 0,27% | 2,29% | 0,90% | 1,73% | 132,03% | 1,44% |
| Março | 61.229.678,60 | 1.711.728,98 | 1.350.288,39 | 61.854.914,25 | 263.795,06 | 1.621.530,86 | 0,43% | 2,73% | 1,19% | 2,95% | 92,52% | 2,04% |
| Abril | 61.854.914,25 | 855.420,52 | 0,00 | 63.211.658,75 | 501.323,98 | 2.122.854,84 | 0,80% | 3,55% | 1,06% | 4,04% | 87,87% | 1,12% |
| Maio | 63.211.658,75 | 14.530.115,34 | 14.011.630,89 | 64.597.110,27 | 866.967,07 | 2.989.821,91 | 1,36% | 4,96% | 0,64% | 4,71% | 105,35% | 1,51% |
| Junho | 64.597.110,27 | 2.799.976,20 | 4.647.683,03 | 63.871.790,71 | 1.122.387,27 | 4.112.209,18 | 1,74% | 6,78% | 0,45% | 5,18% | 130,98% | 1,51% |
| Julho | 63.871.790,71 | 19.063.286,69 | 18.812.997,51 | 64.820.094,80 | 698.014,91 | 4.810.224,09 | 1,09% | 7,94% | 0,72% | 5,94% | 133,75% | 1,41% |
| Agosto | 64.820.094,80 | 3.460.817,65 | 1.556.379,73 | 66.696.522,09 | -28.010,63 | 4.782.213,46 | -0,04% | 7,90% | 0,62% | 6,60% | 119,74% | 2,53% |
| Setembro | 66.696.522,09 | 1.795.338,76 | 1.664.802,44 | 68.140.488,43 | 1.313.430,02 | 6.095.643,48 | 1,97% | 10,02% | 0,45% | 7,07% | 141,66% | 1,66% |

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: 30/09/2019

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



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2019

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Setembro/2019

FUNDOS DE RENDA FIXA

| Ativos Renda Fixa | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|---|----------------------|---------------------|---------------------|----------------------|---------------------|--------------|------------|--------------|
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE... | 9.222.897,86 | 0,00 | 0,00 | 9.564.835,47 | 341.937,61 | 3,71% | 3,71% | 2,78% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI... | 364.229,21 | 0,00 | 0,00 | 377.662,02 | 13.432,81 | 3,69% | 3,69% | 2,79% |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-... | 8.675.163,80 | 0,00 | 0,00 | 8.922.123,25 | 246.959,45 | 2,85% | 2,85% | 1,98% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 7.659.448,62 | 0,00 | 0,00 | 7.821.700,27 | 162.251,65 | 2,12% | 2,12% | 1,37% |
| BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 441.422,05 | 0,00 | 0,00 | 449.505,71 | 8.083,66 | 1,83% | 1,83% | 1,23% |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 2.273.151,28 | 0,00 | 0,00 | 2.312.257,33 | 39.106,05 | 1,72% | 1,72% | 1,01% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 3.446.931,59 | 0,00 | 0,00 | 3.506.223,07 | 59.291,48 | 1,72% | 1,72% | 1,01% |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 9.159.411,61 | 0,00 | 0,00 | 9.296.704,37 | 137.292,76 | 1,50% | 1,50% | 0,85% |
| BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P... | 808.196,03 | 0,00 | 0,00 | 819.827,04 | 11.631,01 | 1,44% | 1,44% | 0,80% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 8.206.422,63 | 0,00 | 0,00 | 8.323.318,13 | 116.895,50 | 1,42% | 1,42% | 0,82% |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC... | 1.787.801,88 | 0,00 | 0,00 | 1.813.051,08 | 25.249,20 | 1,41% | 1,41% | 0,89% |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX... | 2.066.584,64 | 0,00 | 0,00 | 2.082.760,46 | 16.175,82 | 0,78% | 0,78% | 0,30% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 5.137.621,46 | 0,00 | 0,00 | 5.169.821,93 | 32.200,47 | 0,63% | 0,63% | 0,12% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE... | 506.373,86 | 0,00 | 0,00 | 509.510,08 | 3.136,22 | 0,62% | 0,62% | 0,12% |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 37.325,77 | 0,00 | 0,00 | 37.507,49 | 181,72 | 0,49% | 0,49% | 0,04% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC... | 379.669,33 | 353.266,42 | 0,00 | 736.005,58 | 3.069,83 | 0,42% | 0,45% | 0,01% |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO | 352.549,72 | 1.311.675,73 | 1.664.802,44 | 41,80 | 618,79 | 0,04% | 0,37% | 0,01% |
| CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO | 0,00 | 130.396,61 | 0,00 | 130.396,61 | 0,00 | 0,00% | 0,05% | 0,01% |
| Total Renda Fixa | 60.525.201,34 | 1.795.338,76 | 1.664.802,44 | 61.873.251,69 | 1.217.514,03 | 2,01% | | 1,31% |



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2019

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Setembro/2019

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

| Ativos Renda Variável | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Institit | Var - Mês |
|---------------------------------------|---------------------|-------------|-------------|---------------------|------------------|--------------|--------------|--------------|
| BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES | 2.439.083,48 | 0,00 | 0,00 | 2.513.101,86 | 74.018,38 | 3,03% | 3,03% | 4,71% |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES | 208.338,80 | 0,00 | 0,00 | 214.554,12 | 6.215,32 | 2,98% | 2,98% | 5,20% |
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES | 771.015,70 | 0,00 | 0,00 | 793.002,56 | 21.986,86 | 2,85% | 2,85% | 4,40% |
| ITAU FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES | 269.576,93 | 0,00 | 0,00 | 275.077,84 | 5.500,91 | 2,04% | 2,04% | 4,66% |
| ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | 2.483.305,84 | 0,00 | 0,00 | 2.471.500,36 | -11.805,48 | -0,48% | -0,48% | 6,00% |
| Total Renda Variável | 6.171.320,75 | 0,00 | 0,00 | 6.267.236,74 | 95.915,99 | 1,55% | | 5,20% |



**CRÉDITO
& MERCADO**

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2019

FUNDOS DE RENDA FIXA

| Ativos Renda Fixa | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit |
|---|----------------|--------------|--------------|--------------|---------------|-------------|------------|
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE... | 425.750,18 | 8.835.454,88 | 0,00 | 9.564.835,47 | 303.630,41 | 3,28% | 4,42% |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-... | 3.762.451,50 | 4.889.019,23 | 0,00 | 8.922.123,25 | 270.652,52 | 3,13% | 3,70% |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 5.850.090,29 | 3.216.955,05 | 0,00 | 9.296.704,37 | 229.659,03 | 2,53% | 2,62% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 5.103.582,70 | 2.501.952,08 | 0,00 | 7.821.700,27 | 216.165,49 | 2,84% | 3,11% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 8.123.693,51 | 0,00 | 0,00 | 8.323.318,13 | 199.624,62 | 2,46% | 2,46% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 6.200.292,45 | 0,00 | 1.133.000,00 | 5.169.821,93 | 102.529,48 | 1,65% | 1,86% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 3.413.397,06 | 0,00 | 0,00 | 3.506.223,07 | 92.826,01 | 2,72% | 2,72% |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 2.250.638,38 | 0,00 | 0,00 | 2.312.257,33 | 61.618,95 | 2,74% | 2,74% |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC... | 1.769.488,03 | 0,00 | 0,00 | 1.813.051,08 | 43.563,05 | 2,46% | 2,46% |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX... | 2.040.724,70 | 0,00 | 0,00 | 2.082.760,46 | 42.035,76 | 2,06% | 2,06% |
| BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P... | 799.564,00 | 0,00 | 0,00 | 819.827,04 | 20.263,04 | 2,53% | 2,53% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI... | 361.647,92 | 0,00 | 0,00 | 377.662,02 | 16.014,10 | 4,43% | 4,43% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC... | 3.966.503,43 | 353.266,42 | 3.597.587,68 | 736.005,58 | 13.823,41 | 0,32% | 1,50% |
| BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 435.745,39 | 0,00 | 0,00 | 449.505,71 | 13.760,32 | 3,16% | 3,16% |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 4.880.878,64 | 0,00 | 4.890.162,01 | 0,00 | 9.283,37 | 0,19% | 1,49% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE... | 500.271,83 | 0,00 | 0,00 | 509.510,08 | 9.238,25 | 1,85% | 1,85% |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO | 2.288.000,00 | 4.192.398,83 | 6.484.560,73 | 41,80 | 4.203,70 | 0,06% | 1,25% |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 36.937,75 | 0,00 | 0,00 | 37.507,49 | 569,74 | 1,54% | 1,54% |
| CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO | 0,00 | 130.396,61 | 0,00 | 130.396,61 | 0,00 | 0,00% | 0,22% |



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2019

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2019

FUNDOS DE RENDA FIXA

| Ativos Renda Fixa | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit |
|-------------------|----------------|---------------|---------------|---------------|---------------|-------------|------------|
| Total Renda Fixa | 52.209.657,76 | 24.119.443,10 | 16.105.310,42 | 61.873.251,69 | 1.649.461,25 | 2,74% | |



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2019

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2019

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

| Ativos Renda Variável | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit |
|---------------------------------------|----------------------|-------------------|---------------------|---------------------|-------------------|--------------|------------|
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | 2.329.504,25 | 0,00 | 0,00 | 2.471.500,36 | 141.996,11 | 6,10% | 6,10% |
| BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES | 2.410.986,43 | 0,00 | 0,00 | 2.513.101,86 | 102.115,43 | 4,24% | 4,24% |
| CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP | 2.469.690,98 | 0,00 | 2.502.674,31 | 0,00 | 32.983,33 | 1,34% | 2,25% |
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES | 767.354,84 | 0,00 | 0,00 | 793.002,56 | 25.647,72 | 3,34% | 3,34% |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES | 0,00 | 200.000,00 | 0,00 | 214.554,12 | 14.554,12 | 7,28% | 7,57% |
| ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES | 263.144,63 | 0,00 | 0,00 | 275.077,84 | 11.933,21 | 4,53% | 4,53% |
| BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP | 3.421.451,82 | 0,00 | 3.426.194,95 | 0,00 | 4.743,13 | 0,14% | 2,25% |
| Total Renda Variável | 11.662.132,95 | 200.000,00 | 5.928.869,26 | 6.267.236,74 | 333.973,05 | 2,82% | |



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.

