

# Relatório Analítico dos Investimentos

## em dezembro, 4º trimestre e ano 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 (Dezembro / 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	9.465.060,64	13,22%	580	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	1.860.530,61	2,60%	876	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	2.370.919,30	3,31%	613	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	9.861.436,50	13,77%	342	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	D+1	Não há	835.034,00	1,17%	131	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	314.831,41	0,44%	1.198	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	458.704,55	0,64%	51	0,60%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	7.962.264,91	11,12%	695	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	6.353.684,19	8,87%	964	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	4.343.495,57	6,07%	923	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	388.438,98	0,54%	362	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	5.092.578,71	7,11%	1.361	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	9.166.290,31	12,80%	305	0,30%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	214.012,16	0,30%	726	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	476.206,82	0,67%	654	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	37.959,06	0,05%	376	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	452.883,85	0,63%	15.497	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	2.107.618,09	2,94%	289	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.806.117,39	3,92%	817	0,38%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	887.548,28	1,24%	277	0,20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '



**CRÉDITO  
& MERCADO**

**Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2019)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	448.531,12	0,63%	927	0,06%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	974.972,54	1,36%	13.541	0,26%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	937.480,93	1,31%	1.635	0,05%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	395.608,45	0,55%	2.570	0,08%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	255.708,41	0,36%	8.164	0,05%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAU FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	310.322,40	0,43%	51	0,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	2.830.660,29	3,95%	165	0,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>71.608.899,47</b>				



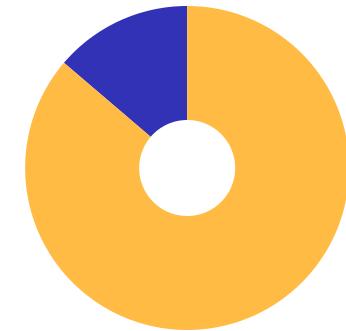
**CRÉDITO  
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/12/2019

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	49.306.979,37	68,86%	15,00%	25,00%	90,00%	15.141.030,15
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	9.166.290,31	12,80%	0,00%	10,00%	60,00%	33.799.049,37
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	3.288.679,98	4,59%	10,00%	30,00%	40,00%	25.354.879,81
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	1.432.177,99
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	3.580.444,97
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.580.444,97
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>61.761.949,66</b>	<b>86,25%</b>	<b>25,00%</b>	<b>70,00%</b>	<b>202,00%</b>	



RENDAS FIXAS 61.761.949,66

RENDAS VARIÁVEIS 9.846.949,81



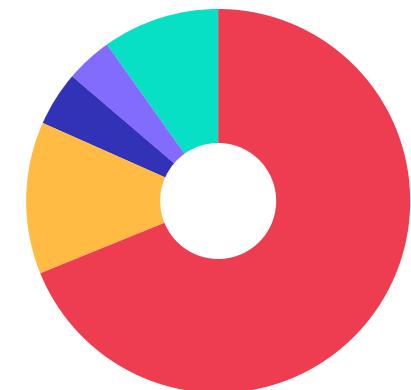
**CRÉDITO  
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/12/2019

**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Dezembro / 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%	2.806.117,39	3,92%	0,00%	0,00%	10,00%	4.354.772,56
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	7.160.889,95
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	7.040.832,42	9,83%	0,00%	10,00%	20,00%	7.280.947,47
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	10,00%	7.160.889,95
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	3.580.444,97
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	3.580.444,97
<b>Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário</b>	<b>30,00%</b>	<b>9.846.949,81</b>	<b>13,75%</b>	<b>0,00%</b>	<b>30,00%</b>	<b>60,00%</b>	



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



**Enquadramento por Gestores - base (Dezembro / 2019)**

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	34.448.912,44	48,11	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	30.973.905,32	43,25	0,00
ITAÚ UNIBANCO	2.830.660,29	3,95	0,00
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	2.107.618,09	2,94	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	937.480,93	1,31	0,00
ITAÚ DTVM	310.322,40	0,43	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: 31/12/2019

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,20%	11,82%	2,46%	5,25%	11,82%	22,73%	-	-
IMA Geral (Benchmark)	0,90%	12,82%	1,90%	4,56%	12,82%	24,14%	-	-
IRF-M 1+ (Benchmark)	0,72%	14,24%	2,10%	5,44%	14,24%	28,25%	-	-
IMA-B 5+ (Benchmark)	2,60%	30,37%	3,02%	7,64%	30,37%	50,45%	-	-
IRF-M 1 (Benchmark)	0,42%	6,76%	1,38%	3,33%	6,76%	14,21%	-	-
IMA-B 5 (Benchmark)	1,24%	13,15%	2,62%	5,47%	13,15%	24,32%	-	-
IMA-B (Benchmark)	2,01%	22,95%	2,85%	6,72%	22,95%	39,01%	-	-
CDI (Benchmark)	0,37%	5,96%	1,24%	2,80%	5,96%	12,76%	-	-
IPCA (Benchmark)	1,15%	4,31%	1,77%	2,03%	4,31%	8,21%	-	-



CRÉDITO  
& MERCADO

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/12/2019

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	6,85%	31,58%	10,41%	14,54%	31,58%	51,36%	-	-
SMILL (Benchmark)	12,65%	58,20%	21,15%	32,65%	58,20%	71,06%	-	-

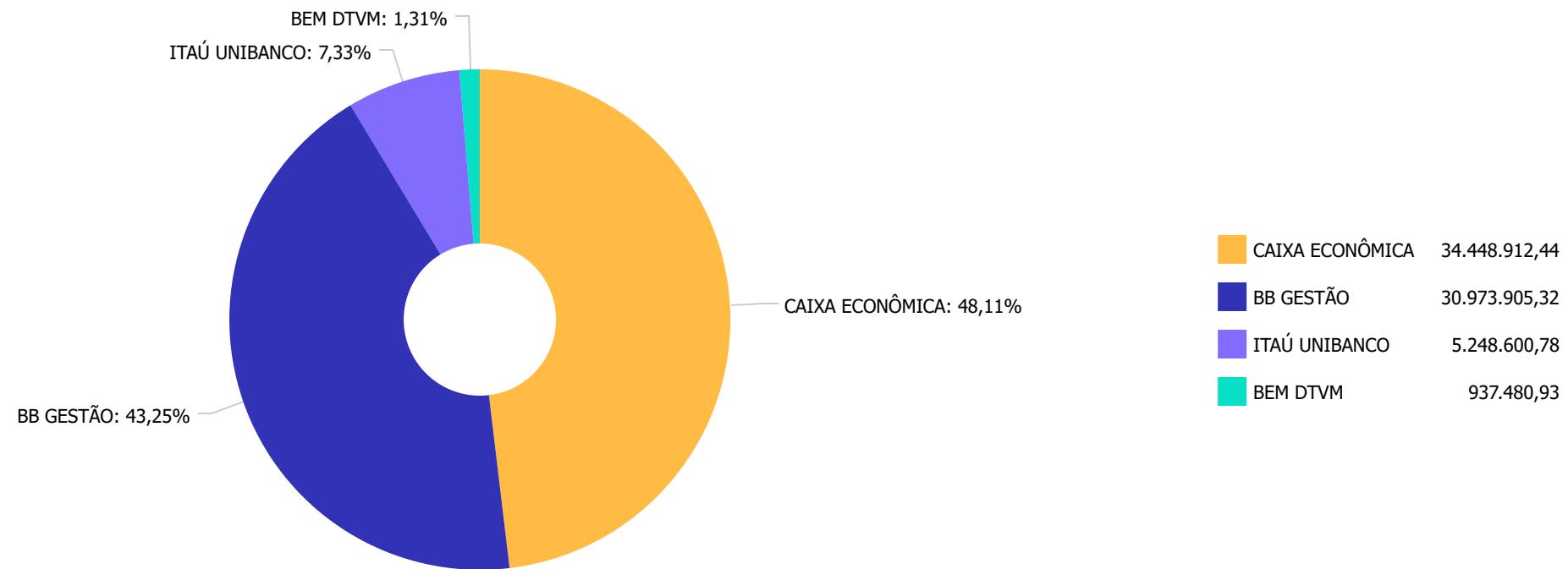


CRÉDITO  
& MERCADO

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/12/2019

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



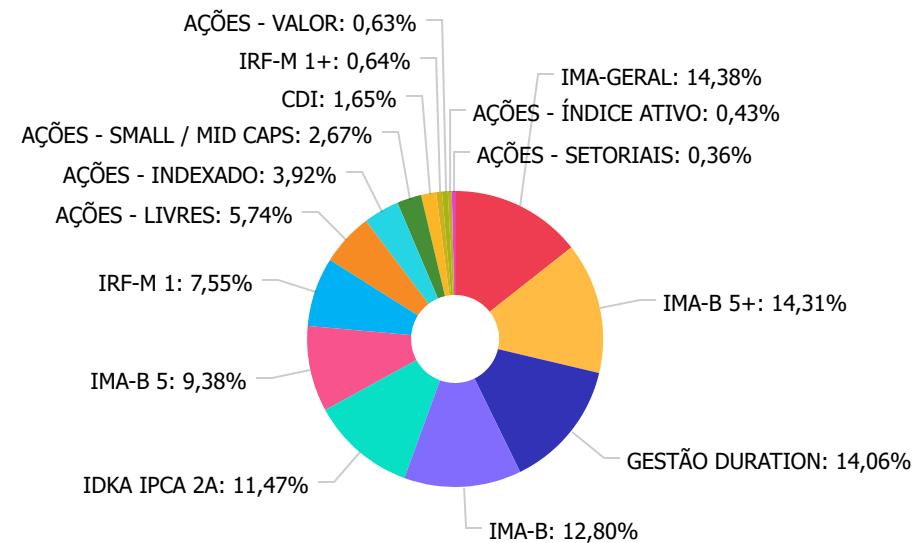


**CRÉDITO  
& MERCADO**

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

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/12/2019



■ IMA-GERAL	10.300.094,64	■ IMA-B 5+	10.249.875,48	■ GESTÃO DURATION	10.069.883,00	■ IMA-B	9.166.290,31
■ IDKA IPCA 2A	8.214.214,80	■ IMA-B 5	6.714.414,87	■ IRF-M 1	5.407.410,12	■ AÇÕES - LIVRES	4.113.817,02
■ AÇÕES - INDEXADO	2.806.117,39	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.912.453,47	■ CDI	1.181.061,89	■ IRF-M 1+	458.704,55
■ AÇÕES - VALOR	448.531,12	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	310.322,40	■ AÇÕES - SETORIAIS	255.708,41		

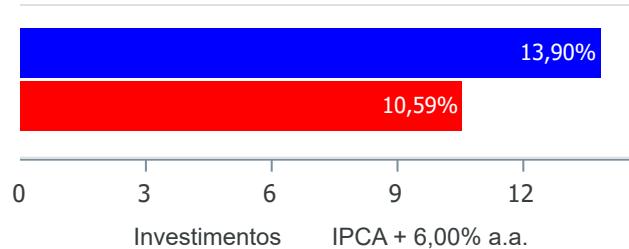


**CRÉDITO  
& MERCADO**

### 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%
Abri	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%
Outubro	68.140.488,43	2.650.457,79	1.710.777,13	70.584.865,10	1.504.696,01	7.600.339,49	2,18%	12,42%	0,63%	7,75%	160,17%	1,89%
Novembro	70.584.865,10	972.843,94	1.992.692,54	68.915.007,46	-650.009,04	6.950.330,45	-0,92%	11,38%	0,98%	8,80%	129,28%	1,81%
Dezembro	68.915.007,46	3.642.882,12	2.531.791,27	71.608.899,47	1.582.801,16	8.533.131,61	2,26%	13,90%	1,64%	10,59%	131,24%	2,02%

### 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: 31/12/2019

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
- 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: 31/12/2019

**Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Dezembro/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...	9.600.187,73	0,00	0,00	9.861.436,50	261.248,77	2,72%	2,72%	4,09%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	378.757,14	0,00	0,00	388.438,98	9.681,84	2,56%	2,56%	4,25%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	8.987.286,84	0,00	0,00	9.166.290,31	179.003,47	1,99%	1,99%	2,79%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.291.733,31	0,00	0,00	4.343.495,57	51.762,26	1,21%	1,21%	1,01%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.342.937,15	0,00	0,00	2.370.919,30	27.982,15	1,19%	1,19%	1,00%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.839.330,11	0,00	0,00	1.860.530,61	21.200,50	1,15%	1,15%	0,75%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	7.476.189,12	0,00	1.200.000,00	6.353.684,19	77.495,07	1,04%	1,10%	0,74%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.375.171,37	0,00	0,00	9.465.060,64	89.889,27	0,96%	0,96%	1,21%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	827.666,64	0,00	0,00	835.034,00	7.367,36	0,89%	0,89%	1,06%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	455.547,54	0,00	0,00	458.704,55	3.157,01	0,69%	0,69%	1,35%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	7.915.296,00	0,00	0,00	7.962.264,91	46.968,91	0,59%	0,59%	0,93%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.072.167,68	0,00	0,00	5.092.578,71	20.411,03	0,40%	0,40%	0,07%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	313.585,24	0,00	0,00	314.831,41	1.246,17	0,40%	0,40%	0,07%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	37.816,96	0,00	0,00	37.959,06	142,10	0,38%	0,38%	0,06%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	474.527,63	0,00	0,00	476.206,82	1.679,19	0,35%	0,35%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.100.398,14	0,00	0,00	2.107.618,09	7.219,95	0,34%	0,34%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	1.544.772,08	1.331.791,27	214.012,16	1.031,35	0,07%	0,28%	0,01%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	1,26	452.855,16	0,00	452.883,85	27,43	0,01%	0,05%	0,01%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>61.488.599,86</b>	<b>1.997.627,24</b>	<b>2.531.791,27</b>	<b>61.761.949,66</b>	<b>807.513,83</b>	<b>1,31%</b>		<b>1,64%</b>



**CRÉDITO  
& MERCADO**

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

**FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL**

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Institit	Var - Mês
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.568.496,11	0,00	0,00	2.830.660,29	262.164,18	10,21%	10,21%	4,42%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	233.823,90	0,00	0,00	255.708,41	21.884,51	9,36%	9,36%	4,25%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	258.435,46	599.000,00	0,00	937.480,93	80.045,47	9,34%	10,43%	4,79%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	361.950,32	0,00	0,00	395.608,45	33.658,13	9,30%	9,30%	3,97%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	286.613,27	0,00	0,00	310.322,40	23.709,13	8,27%	8,27%	4,01%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	820.311,79	0,00	0,00	887.548,28	67.236,49	8,20%	8,20%	4,17%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	287.787,25	127.438,47	0,00	448.531,12	33.305,40	8,02%	8,81%	4,04%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.608.989,50	0,00	0,00	2.806.117,39	197.127,89	7,56%	7,56%	4,36%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	0,00	918.816,41	0,00	974.972,54	56.156,13	6,11%	12,45%	5,12%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>7.426.407,60</b>	<b>1.645.254,88</b>	<b>0,00</b>	<b>9.846.949,81</b>	<b>775.287,33</b>	<b>8,55%</b>		<b>4,43%</b>



**CRÉDITO  
& MERCADO**

**Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2019**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/12/2019

**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...	9.564.835,47	0,00	0,00	9.861.436,50	296.601,03	3,10%	3,10%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	8.922.123,25	0,00	0,00	9.166.290,31	244.167,06	2,74%	2,74%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	8.323.318,13	0,00	2.154.697,51	6.353.684,19	185.063,57	2,22%	2,40%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.296.704,37	0,00	0,00	9.465.060,64	168.356,27	1,81%	1,81%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	7.821.700,27	0,00	0,00	7.962.264,91	140.564,64	1,80%	1,80%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.506.223,07	743.087,37	0,00	4.343.495,57	94.185,13	2,22%	2,52%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.169.821,93	0,00	145.355,23	5.092.578,71	68.112,01	1,32%	1,33%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.312.257,33	0,00	0,00	2.370.919,30	58.661,97	2,54%	2,54%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.813.051,08	0,00	0,00	1.860.530,61	47.479,53	2,62%	2,62%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.082.760,46	0,00	0,00	2.107.618,09	24.857,63	1,19%	1,19%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	819.827,04	0,00	0,00	835.034,00	15.206,96	1,85%	1,85%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	377.662,02	0,00	0,00	388.438,98	10.776,96	2,85%	2,85%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	449.505,71	0,00	0,00	458.704,55	9.198,84	2,05%	2,05%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	736.005,58	0,00	266.267,70	476.206,82	6.468,94	0,88%	1,14%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	509.510,08	0,00	200.000,00	314.831,41	5.321,33	1,04%	1,31%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	41,80	2.807.974,46	2.595.456,53	214.012,16	1.452,43	0,05%	0,97%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	37.507,49	0,00	0,00	37.959,06	451,57	1,20%	1,20%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	130.396,61	1.195.917,00	873.483,97	452.883,85	54,21	0,00%	0,18%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>61.873.251,69</b>	<b>4.746.978,83</b>	<b>6.235.260,94</b>	<b>61.761.949,66</b>	<b>1.376.980,08</b>	<b>2,07%</b>	



**CRÉDITO  
& MERCADO**

**Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2019**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/12/2019

**FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL**

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.471.500,36	0,00	0,00	2.830.660,29	359.159,93	14,53%	14,53%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.513.101,86	0,00	0,00	2.806.117,39	293.015,53	11,66%	11,66%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	0,00	841.530,80	0,00	937.480,93	95.950,13	11,40%	15,15%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	793.002,56	0,00	0,00	887.548,28	94.545,72	11,92%	11,92%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	0,00	918.816,41	0,00	974.972,54	56.156,13	6,11%	19,58%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	214.554,12	130.396,60	0,00	395.608,45	50.657,73	14,69%	14,56%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	0,00	404.632,34	0,00	448.531,12	43.898,78	10,85%	13,36%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	275.077,84	0,00	0,00	310.322,40	35.244,56	12,81%	12,81%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	0,00	223.828,87	0,00	255.708,41	31.879,54	14,24%	14,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>6.267.236,74</b>	<b>2.519.205,02</b>	<b>0,00</b>	<b>9.846.949,81</b>	<b>1.060.508,05</b>	<b>12,07%</b>	



**CRÉDITO  
& MERCADO**

**Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2019**

**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-...	3.273.043,86	4.889.019,23	0,00	9.166.290,31	1.004.227,22	12,30%	22,46%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	7.665.514,49	0,00	2.154.697,51	6.353.684,19	842.867,21	11,00%	11,19%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.073.662,07	6.662.138,14	0,00	9.465.060,64	729.260,43	8,35%	13,07%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	0,00	9.213.579,01	0,00	9.861.436,50	647.857,49	7,03%	30,05%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,00	7.351.191,75	0,00	7.962.264,91	611.073,16	8,31%	16,43%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	10.076.355,26	0,00	5.478.355,23	5.092.578,71	494.578,68	4,91%	6,55%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.124.036,86	804.547,87	0,00	4.343.495,57	414.910,84	10,56%	12,85%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.100.229,48	0,00	0,00	2.370.919,30	270.689,82	12,89%	12,89%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	8.238.818,63	4.848.080,12	13.302.327,32	0,00	215.428,57	1,65%	5,72%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.673.097,98	0,00	0,00	1.860.530,61	187.432,63	11,20%	11,20%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	4.644.194,83	353.266,42	4.673.388,81	476.206,82	152.134,38	3,04%	5,74%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	0,00	1.971.327,98	0,00	2.107.618,09	136.290,11	6,91%	11,91%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	743.123,27	0,00	0,00	835.034,00	91.910,73	12,37%	12,37%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	299.410,46	0,00	0,00	388.438,98	89.028,52	29,73%	29,73%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA ...	1.099.705,40	809.300,00	1.969.199,03	0,00	60.193,63	3,15%	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.179.940,41	0,00	2.187.859,93	37.959,06	45.878,58	2,10%	5,91%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	414.428,08	0,00	458.704,55	44.276,47	10,68%	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	484.707,04	0,00	200.000,00	314.831,41	30.124,37	6,21%	6,49%
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	349.511,02	0,00	378.124,12	0,00	28.613,10	8,19%	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	500.512,09	12.236.885,19	12.533.456,23	214.012,16	10.071,11	0,08%	4,82%



CRÉDITO  
& MERCADO

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/12/2019

**Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2019**

**FUNDOS DE RENDA FIXA**

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	97,11	1.326.313,61	873.581,15	452.883,85	54,28	0,00%	0,98%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>48.525.960,26</b>	<b>50.880.077,40</b>	<b>43.750.989,33</b>	<b>61.761.949,66</b>	<b>6.106.901,33</b>	<b>10,97%</b>	



**CRÉDITO  
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/12/2019

**Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2019**

**FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL**

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.024.233,27	0,00	0,00	2.830.660,29	806.427,02	39,84%	39,84%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.095.530,47	157,69	0,00	2.806.117,39	710.429,23	33,90%	33,90%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	663.916,50	9.465,19	0,00	887.548,28	214.166,59	31,80%	31,96%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2.322.625,96	0,00	2.502.674,31	0,00	180.048,35	7,75%	13,70%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	3.284.657,80	0,00	3.426.194,95	0,00	141.537,15	4,31%	9,03%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	0,00	841.530,80	0,00	937.480,93	95.950,13	11,40%	44,48%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	229.796,89	0,00	0,00	310.322,40	80.525,51	35,04%	35,04%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	0,00	330.396,60	0,00	395.608,45	65.211,85	19,74%	-
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	0,00	918.816,41	0,00	974.972,54	56.156,13	6,11%	52,48%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	0,00	404.632,34	0,00	448.531,12	43.898,78	10,85%	41,43%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	0,00	223.828,87	0,00	255.708,41	31.879,54	14,24%	54,32%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>10.620.760,89</b>	<b>2.728.827,90</b>	<b>5.928.869,26</b>	<b>9.846.949,81</b>	<b>2.426.230,28</b>	<b>18,17%</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.

