

Relatório Analítico dos Investimentos

em junho, 2º trimestre e 1º semestre 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 (Junho / 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	10.839.266,95	15,17%	600	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.914.195,63	2,68%	884	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	2.444.022,53	3,42%	622	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	9.331.371,65	13,06%	310	0,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	847.536,27	1,19%	135	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	390.295,52	0,55%	1.262	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.115.833,45	1,56%	106	0,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	11.217.643,48	15,70%	763	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.949.580,47	8,33%	956	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.475.637,68	6,26%	912	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	367.325,99	0,51%	340	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.859.241,60	5,40%	1.364	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMOBILIÁRIO	D+0	Não há	6.706.880,99	9,38%	305	0,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PESADA	D+3	Não há	66.820,49	0,09%	186	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	10.313,98	0,01%	742	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	449.114,60	0,63%	608	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	663.487,02	0,93%	318	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	38.653,25	0,05%	434	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	603,07	0,00%	15.925	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.155.401,98	3,02%	287	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '



**CRÉDITO
& MERCADO**

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.316.121,69	3,24%	1.411	0,28%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	700.231,71	0,98%	556	0,18%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	766.903,98	1,07%	1.560	0,09%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.213.701,99	1,70%	19.744	0,27%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	791.386,78	1,11%	2.090	0,04%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	337.587,48	0,47%	2.513	0,04%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	214.439,47	0,30%	9.429	0,05%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAU FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	258.770,15	0,36%	53	0,03%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	2.023.605,08	2,83%	162	0,05%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
Total para cálculo dos limites da Resolução			71.465.974,93				



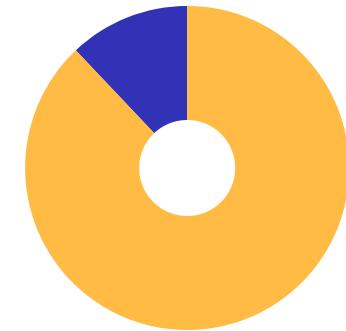
**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2020

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	52.751.951,22	73,81%	20,00%	30,00%	90,00%	11.567.426,22
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	6.706.880,99	9,38%	0,00%	10,00%	60,00%	36.172.703,97
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	3.384.394,39	4,74%	5,00%	30,00%	40,00%	25.201.995,58
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	1.429.319,50
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.573.298,75
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.573.298,75
Total Renda Fixa	100,00%	62.843.226,60	87,93%	25,00%	70,00%	202,00%	



RENDAM FIXA 62.843.226,60

RENDAM VARIÁVEL 8.622.748,33



**CRÉDITO
& MERCADO**

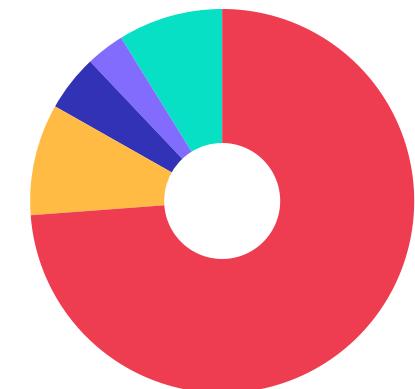
FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2020

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Junho / 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%	2.316.121,69	3,24%	0,00%	2,00%	5,00%	1.257.177,06
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	3.573.298,75
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	6.306.626,64	8,82%	5,00%	15,00%	20,00%	7.986.568,35
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	6,00%	10,00%	7.146.597,49
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	3.573.298,75
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	8.622.748,33	12,07%	5,00%	30,00%	45,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	7.146.597,49
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	



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



Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2020)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	33.831.080,50	47,34	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	32.405.730,44	45,34	0,00
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	2.155.401,98	3,02	-
ITAÚ UNIBANCO	2.023.605,08	2,83	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	791.386,78	1,11	0,00
ITAÚ DTVM	258.770,15	0,36	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: 30/06/2020

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,99%	3,35%	3,35%	3,35%	8,68%	23,17%	-	-
IMA Geral (Benchmark)	0,99%	1,87%	2,89%	1,87%	6,39%	23,45%	-	-
IRF-M 1+ (Benchmark)	1,04%	6,03%	4,53%	6,03%	11,57%	33,23%	-	-
IMA-B 5+ (Benchmark)	2,84%	-5,26%	5,99%	-5,26%	1,68%	43,55%	-	-
IRF-M 1 (Benchmark)	0,28%	2,60%	1,15%	2,60%	5,98%	13,67%	-	-
IMA-B 5 (Benchmark)	1,12%	3,17%	3,77%	3,17%	8,73%	24,75%	-	-
IMA-B (Benchmark)	2,05%	-1,66%	4,96%	-1,66%	4,73%	35,13%	-	-
CDI (Benchmark)	0,21%	1,75%	0,73%	1,75%	4,58%	11,21%	-	-
IPCA (Benchmark)	0,26%	0,10%	-0,43%	0,10%	2,12%	5,57%	-	-



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2020

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	8,76%	-17,80%	30,18%	-17,80%	-6,20%	30,64%	-	-
SMILL (Benchmark)	14,43%	-20,73%	32,49%	-20,73%	5,76%	49,01%	-	-

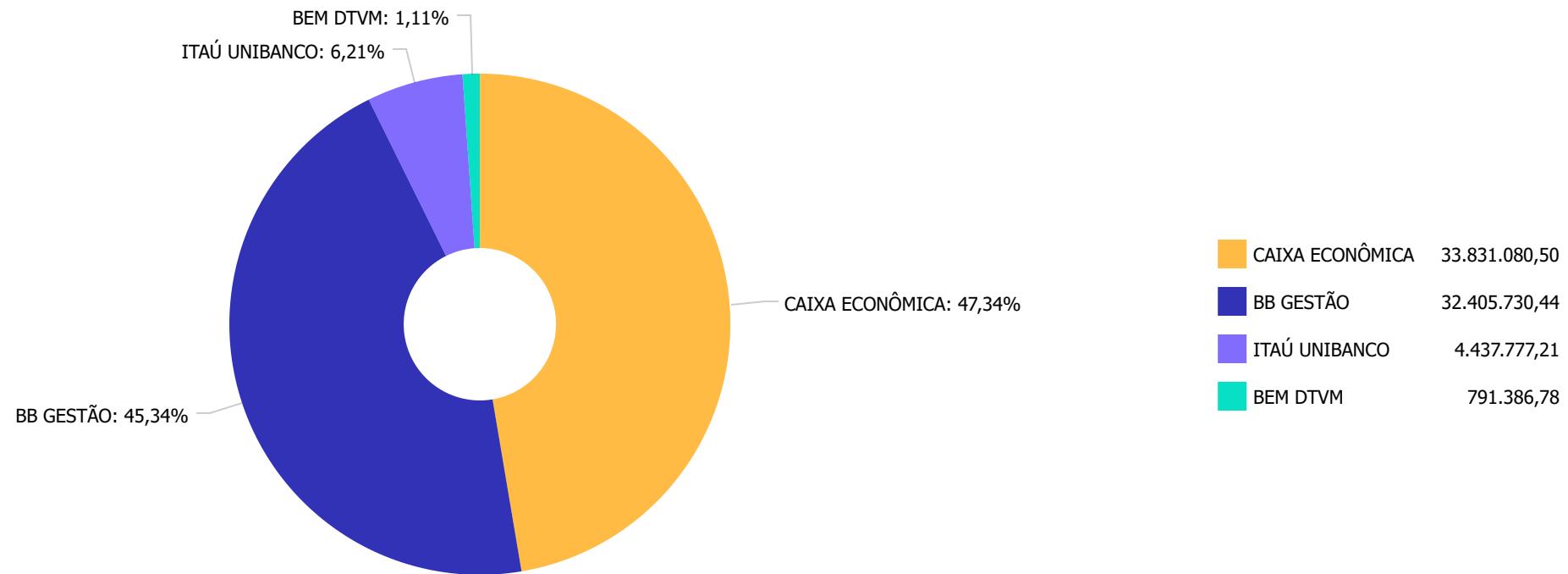


CRÉDITO
& MERCADO

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2020

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



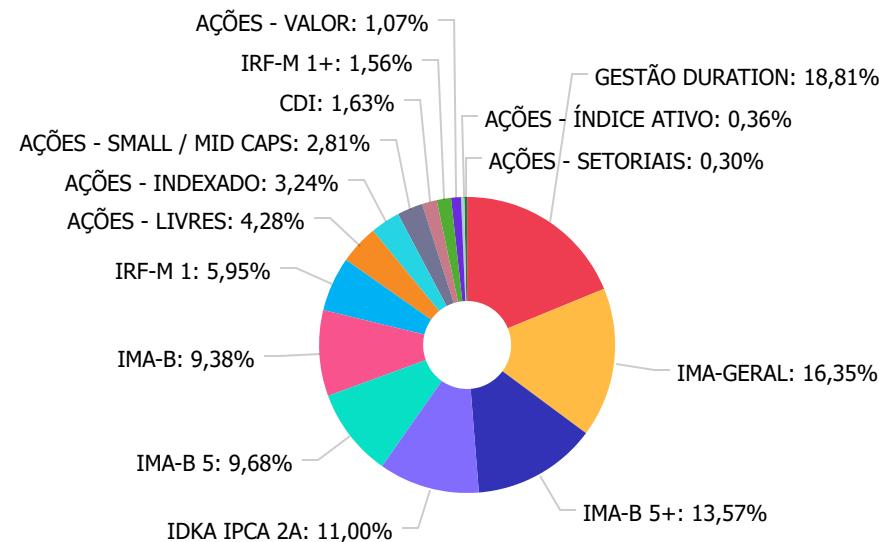


**CRÉDITO
& MERCADO**

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

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2020



■ GESTÃO DURATION	13.439.865,95	■ IMA-B 5	6.919.660,21	■ AÇÕES - INDEXADO	2.316.121,69	■ AÇÕES - VALOR	766.903,98	■ IMA-GERAL	11.686.803,22	■ IMA-B	6.706.880,99	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	2.005.088,77	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	258.770,15	■ IDKA IPCA 2A	9.698.697,64	■ IRF-M 1	4.249.537,12	■ CDI	1.162.171,92	■ IRF-M 1+	214.439,47	■ AÇÕES - SETORIAIS	214.439,47	■ GESTÃO DURATION	7.863.776,10	■ IMA-B 5	3.061.424,27	■ AÇÕES - LIVRES	1.115.833,45
-------------------	---------------	-----------	--------------	--------------------	--------------	-----------------	------------	-------------	---------------	---------	--------------	----------------------------	--------------	------------------------	------------	----------------	--------------	-----------	--------------	-------	--------------	------------	------------	---------------------	------------	-------------------	--------------	-----------	--------------	------------------	--------------



**CRÉDITO
& MERCADO**

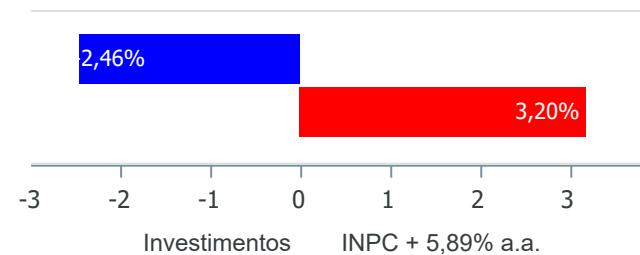
FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2020

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%
Abril	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%

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: 30/06/2020

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**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2020

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Junho/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...	357.226,34	0,00	0,00	367.325,99	10.099,65	2,83%	2,83%	4,98%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	9.077.205,53	0,00	0,00	9.331.371,65	254.166,12	2,80%	2,80%	4,98%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	6.573.762,82	0,00	0,00	6.706.880,99	133.118,17	2,02%	2,02%	2,98%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.891.254,48	0,00	0,00	1.914.195,63	22.941,15	1,21%	1,21%	0,81%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	5.880.468,73	0,00	0,00	5.949.580,47	69.111,74	1,18%	1,18%	0,86%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.427.001,87	0,00	0,00	4.475.637,68	48.635,81	1,10%	1,10%	0,91%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.418.010,23	0,00	0,00	2.444.022,53	26.012,30	1,08%	1,08%	0,89%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.104.455,89	0,00	0,00	1.115.833,45	11.377,56	1,03%	1,03%	1,75%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.737.402,09	0,00	0,00	10.839.266,95	101.864,86	0,95%	0,95%	1,27%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	840.184,91	0,00	0,00	847.536,27	7.351,36	0,87%	0,87%	1,16%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	11.134.180,46	0,00	0,00	11.217.643,48	83.463,02	0,75%	0,75%	1,17%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.146.048,73	0,00	0,00	2.155.401,98	9.353,25	0,44%	0,44%	0,38%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	66.573,34	0,00	66.820,49	247,15	0,37%	0,95%	1,34%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	447.949,82	0,00	0,00	449.114,60	1.164,78	0,26%	0,26%	0,03%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	389.296,16	0,00	0,00	390.295,52	999,36	0,26%	0,26%	0,05%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.658.689,23	1.693.177,93	3.509.524,74	3.859.241,60	16.899,18	0,23%	0,26%	0,05%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	38.570,03	0,00	0,00	38.653,25	83,22	0,22%	0,22%	0,03%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	76.867,40	66.573,34	10.313,98	19,92	0,03%	0,13%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,00	668.083,77	4.601,15	663.487,02	4,40	0,00%	0,14%	0,01%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	1.683.472,33	14.307,09	1.697.183,88	603,07	7,53	0,00%	0,01%	0,01%



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2020

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
Total Renda Fixa	64.805.179,65	2.519.009,53	5.277.883,11	62.843.226,60	796.920,53	1,23%		1,79%



**CRÉDITO
& MERCADO**

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Institit	Var - Mês
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	1.070.377,81	0,00	0,00	1.213.701,99	143.324,18	13,39%	13,39%	16,45%
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.805.209,56	0,00	0,00	2.023.605,08	218.395,52	12,10%	12,10%	14,62%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	307.240,78	0,00	0,00	337.587,48	30.346,70	9,88%	9,88%	12,39%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	641.994,05	0,00	0,00	700.231,71	58.237,66	9,07%	9,07%	12,25%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.126.943,53	0,00	0,00	2.316.121,69	189.178,16	8,89%	8,89%	12,41%
ITAU FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	238.237,78	0,00	0,00	258.770,15	20.532,37	8,62%	8,62%	11,52%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	729.386,20	0,00	0,00	791.386,78	62.000,58	8,50%	8,50%	10,67%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	199.476,17	0,00	0,00	214.439,47	14.963,30	7,50%	7,50%	12,49%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	713.808,78	0,00	0,00	766.903,98	53.095,20	7,44%	7,44%	13,19%
Total Renda Variável	7.832.674,66	0,00	0,00	8.622.748,33	790.073,67	10,09%		13,37%



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2020

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2020

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...	8.818.323,67	0,00	0,00	9.331.371,65	513.047,98	5,82%	5,82%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	10.862.049,61	0,00	0,00	11.217.643,48	355.593,87	3,27%	3,27%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.527.429,76	0,00	0,00	10.839.266,95	311.837,19	2,96%	2,96%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	6.397.673,29	0,00	0,00	6.706.880,99	309.207,70	4,83%	4,83%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	6.224.511,89	0,00	480.500,00	5.949.580,47	205.568,58	3,30%	3,54%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.315.644,65	0,00	0,00	4.475.637,68	159.993,03	3,71%	3,71%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.356.627,50	0,00	0,00	2.444.022,53	87.395,03	3,71%	3,71%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.848.177,50	0,00	0,00	1.914.195,63	66.018,13	3,57%	3,57%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.865.735,03	7.951.644,84	7.016.891,16	3.859.241,60	58.752,89	0,54%	1,09%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.006.553,12	66.583,86	0,00	1.115.833,45	42.696,47	3,98%	4,14%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.131.458,37	0,00	0,00	2.155.401,98	23.943,61	1,12%	1,12%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	825.699,75	0,00	0,00	847.536,27	21.836,52	2,64%	2,64%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	346.940,31	0,00	0,00	367.325,99	20.385,68	5,88%	5,88%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	386.196,43	0,00	0,00	390.295,52	4.099,09	1,06%	1,06%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	445.656,33	0,00	0,00	449.114,60	3.458,27	0,78%	0,78%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	38.352,54	0,00	0,00	38.653,25	300,71	0,78%	0,78%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	66.573,34	0,00	66.820,49	247,15	0,37%	2,88%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	35.560,01	12.128.714,29	12.163.755,08	603,07	83,85	0,00%	0,03%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	209.994,76	199.754,56	10.313,98	73,78	0,04%	0,49%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,00	668.083,77	4.601,15	663.487,02	4,40	0,00%	0,54%



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2020

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
Total Renda Fixa	59.432.589,76	21.091.594,86	19.865.501,95	62.843.226,60	2.184.543,93	3,60%	



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2020

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	1.770.979,42	0,00	0,00	2.316.121,69	545.142,27	30,78%	30,78%
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.514.545,62	0,00	0,00	2.023.605,08	509.059,46	33,61%	33,61%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	864.503,65	66.597,36	0,00	1.213.701,99	282.600,98	30,35%	30,82%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	599.676,91	0,00	0,00	791.386,78	191.709,87	31,97%	31,97%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	612.716,18	0,00	0,00	766.903,98	154.187,80	25,16%	25,16%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	547.345,30	0,00	0,00	700.231,71	152.886,41	27,93%	27,93%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	253.407,10	0,00	0,00	337.587,48	84.180,38	33,22%	33,22%
ITAU FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	197.822,90	0,00	0,00	258.770,15	60.947,25	30,81%	30,81%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	162.589,52	0,00	0,00	214.439,47	51.849,95	31,89%	31,89%
Total Renda Variável	6.523.586,60	66.597,36	0,00	8.622.748,33	2.032.564,37	30,84%	



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2020

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/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	2.790.009,94	0,00	11.217.643,48	465.368,63	4,33%	4,63%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	6.353.684,19	1.287.774,28	1.874.085,97	5.949.580,47	182.207,97	2,38%	3,12%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.465.060,64	1.194.511,04	0,00	10.839.266,95	179.695,27	1,69%	1,75%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.343.495,57	0,00	0,00	4.475.637,68	132.142,11	3,04%	3,04%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.092.578,71	7.951.644,84	9.311.891,16	3.859.241,60	126.909,21	0,97%	2,48%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.370.919,30	0,00	0,00	2.444.022,53	73.103,23	3,08%	3,08%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.860.530,61	0,00	0,00	1.914.195,63	53.665,02	2,88%	2,88%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	458.704,55	603.873,82	0,00	1.115.833,45	53.255,08	5,01%	5,60%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.107.618,09	0,00	0,00	2.155.401,98	47.783,89	2,27%	2,27%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	835.034,00	0,00	0,00	847.536,27	12.502,27	1,50%	1,50%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	314.831,41	66.672,39	0,00	390.295,52	8.791,72	2,30%	2,45%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	476.206,82	0,00	33.412,71	449.114,60	6.320,49	1,33%	1,37%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	214.012,16	3.935.094,46	4.141.972,56	10.313,98	3.179,92	0,08%	1,24%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	37.959,06	0,00	0,00	38.653,25	694,19	1,83%	1,83%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	452.883,85	20.620.247,86	21.072.831,96	603,07	303,32	0,00%	0,09%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	66.573,34	0,00	66.820,49	247,15	0,37%	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,00	668.083,77	4.601,15	663.487,02	4,40	0,00%	1,34%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	388.438,98	0,00	0,00	367.325,99	-21.112,99	-5,44%	-5,44%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	9.166.290,31	0,00	2.350.000,00	6.706.880,99	-109.409,32	-1,19%	-1,86%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	9.861.436,50	0,00	0,00	9.331.371,65	-530.064,85	-5,38%	-5,38%



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2020

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/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	39.184.485,74	38.788.795,51	62.843.226,60	685.586,71	1,10%	



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2020

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2020

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	255.708,41	0,00	0,00	214.439,47	-41.268,94	-16,14%	-16,14%
ITAU FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	310.322,40	0,00	0,00	258.770,15	-51.552,25	-16,61%	-16,61%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	395.608,45	0,00	0,00	337.587,48	-58.020,97	-14,67%	-14,67%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	937.480,93	0,00	0,00	791.386,78	-146.094,15	-15,58%	-15,58%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	448.531,12	500.000,00	0,00	766.903,98	-181.627,14	-19,15%	-18,07%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	887.548,28	0,00	0,00	700.231,71	-187.316,57	-21,10%	-21,10%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	974.972,54	630.332,52	0,00	1.213.701,99	-391.603,07	-24,39%	-25,06%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.806.117,39	0,00	0,00	2.316.121,69	-489.995,70	-17,46%	-17,46%
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.830.660,29	0,00	0,00	2.023.605,08	-807.055,21	-28,51%	-28,51%
Total Renda Variável	9.846.949,81	1.130.332,52	0,00	8.622.748,33	-2.354.534,00	-21,45%	



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.

