

Relatório Analítico dos Investimentos

em junho, 2º trimestre e 1º semestre 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 (Junho / 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	5.850.090,29	9,16%	507	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	1.769.488,03	2,77%	873	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	2.250.638,38	3,52%	576	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	425.750,18	0,67%	308	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	D+1	Não há	799.564,00	1,25%	115	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	500.271,83	0,78%	1.250	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	435.745,39	0,68%	30	1,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	8.123.693,51	12,72%	920	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.413.397,06	5,34%	889	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	361.647,92	0,57%	334	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	6.200.292,45	9,71%	1.419	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	3.762.451,50	5,89%	292	0,13%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.288.000,00	3,58%	719	0,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	3.966.503,43	6,21%	744	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	4.880.878,64	7,64%	821	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	5.103.582,70	7,99%	560	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	36.937,75	0,06%	411	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	2.040.724,70	3,20%	245	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.410.986,43	3,77%	158	0,46%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	767.354,84	1,20%	63	0,23%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '



**CRÉDITO
& MERCADO**

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2019)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	263.144,63	0,41%	52	0,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	2.329.504,25	3,65%	150	0,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	3.421.451,82	5,36%	232	0,59%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	2.469.690,98	3,87%	4.506	0,32%	Artigo 8º, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			63.871.790,71				



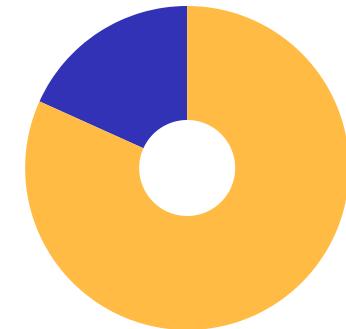
**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 28/06/2019

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	30.130.579,04	47,17%	15,00%	25,00%	90,00%	27.354.032,60
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	3.762.451,50	5,89%	0,00%	10,00%	60,00%	34.560.622,93
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	18.316.627,22	28,68%	10,00%	30,00%	40,00%	7.232.089,06
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	1.277.435,81
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	3.193.589,54
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.193.589,54
Total Renda Fixa	100,00%	52.209.657,76	81,74%	25,00%	70,00%	202,00%	



RENDAS FIXAS 52.209.657,76

RENDAS VARIÁVEIS 11.662.132,95



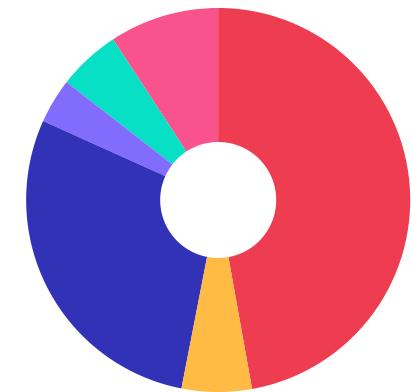
**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 28/06/2019

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Junho / 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%	2.410.986,43	3,77%	0,00%	0,00%	10,00%	3.976.192,64
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	6.387.179,07
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	3.360.003,72	5,26%	0,00%	10,00%	20,00%	9.414.354,42
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	5.891.142,80	9,22%	0,00%	10,00%	10,00%	496.036,27
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	3.193.589,54
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	3.193.589,54
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	11.662.132,95	18,26%	0,00%	30,00%	60,00%	



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



Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2019)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	34.352.572,51	53,78	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	24.885.844,62	38,96	0,00
ITAÚ UNIBANCO	2.329.504,25	3,65	0,00
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	2.040.724,70	3,20	-
ITAÚ DTVM	263.144,63	0,41	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: 28/06/2019

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,23%	6,25%	3,68%	6,25%	13,24%	24,54%	-	-
IMA Geral (Benchmark)	2,00%	7,90%	4,78%	7,90%	15,90%	25,71%	-	-
IRF-M 1+ (Benchmark)	2,72%	8,35%	5,62%	8,35%	19,18%	30,24%	-	-
IMA-B 5+ (Benchmark)	5,06%	21,12%	12,50%	21,12%	40,78%	49,39%	-	-
IRF-M 1 (Benchmark)	0,58%	3,32%	1,77%	3,32%	7,23%	15,60%	-	-
IMA-B 5 (Benchmark)	1,72%	7,28%	4,27%	7,28%	14,65%	25,81%	-	-
IMA-B (Benchmark)	3,73%	15,21%	9,15%	15,21%	28,76%	39,31%	-	-
CDI (Benchmark)	0,47%	3,07%	1,54%	3,07%	6,32%	14,14%	-	-
IPCA (Benchmark)	0,01%	2,23%	0,71%	2,23%	3,37%	7,91%	-	-



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 28/06/2019

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	4,06%	14,88%	5,82%	14,88%	38,76%	60,52%	-	-
CDI (Benchmark)	0,47%	3,07%	1,54%	3,07%	6,32%	14,14%	-	-

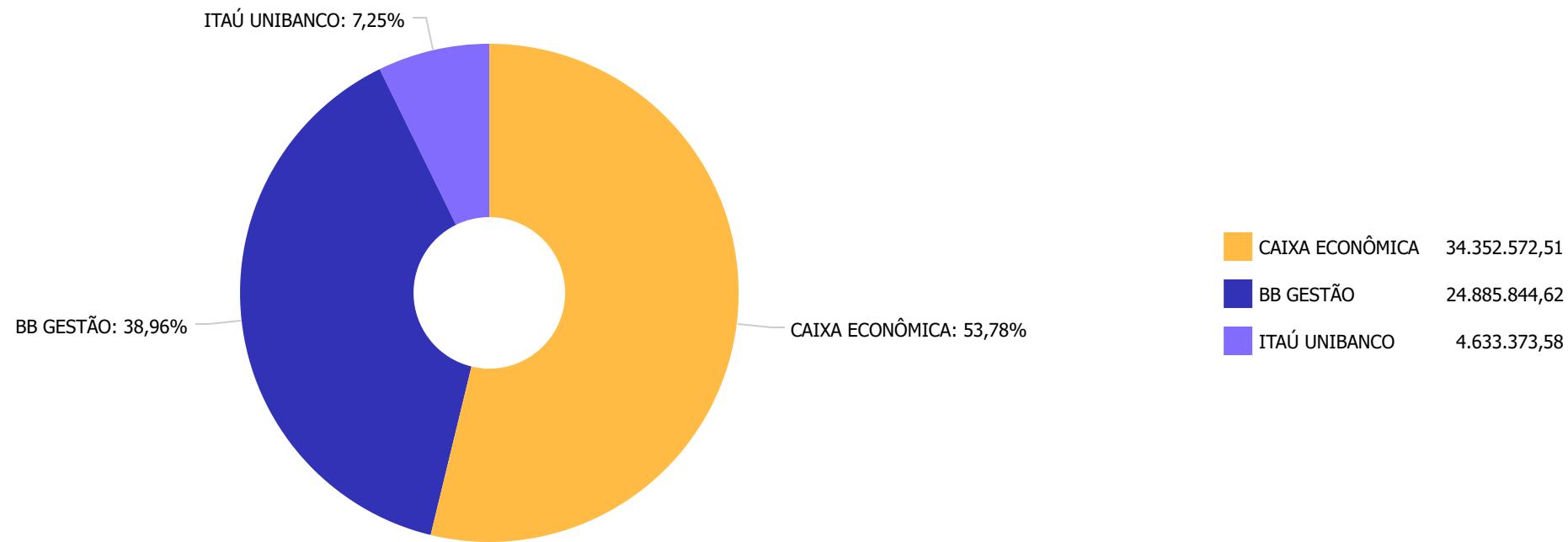


CRÉDITO
& MERCADO

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

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 28/06/2019



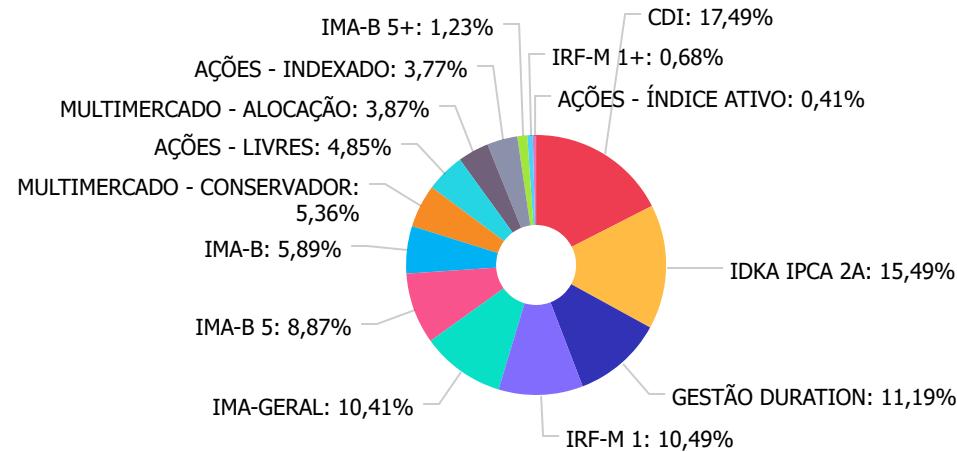


**CRÉDITO
& MERCADO**

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

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 28/06/2019



■ CDI	11.172.319,82	■ IDKA IPCA 2A	9.893.181,54	■ GESTÃO DURATION	7.144.307,40
■ IRF-M 1	6.700.564,28	■ IMA-GERAL	6.649.654,29	■ IMA-B 5	5.664.035,44
■ IMA-B	3.762.451,50	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	3.421.451,82	■ AÇÕES - LIVRES	3.096.859,09
■ MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	2.469.690,98	■ AÇÕES - INDEXADO	2.410.986,43	■ IMA-B 5+	787.398,10
■ IRF-M 1+	435.745,39	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	263.144,63		



**CRÉDITO
& MERCADO**

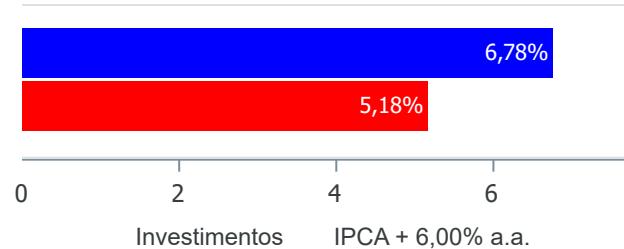
FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 28/06/2019

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%

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: 28/06/2019

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**

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Junho/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...	405.320,73	0,00	0,00	425.750,18	20.429,45	5,04%	5,04%	3,10%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	344.414,42	0,00	0,00	361.647,92	17.233,50	5,00%	5,00%	3,08%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	3.628.827,87	0,00	0,00	3.762.451,50	133.623,63	3,68%	3,68%	2,30%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	4.967.725,28	0,00	0,00	5.103.582,70	135.857,42	2,73%	2,73%	1,65%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	424.796,46	0,00	0,00	435.745,39	10.948,93	2,58%	2,58%	1,56%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.990.028,82	0,00	0,00	2.040.724,70	50.695,88	2,55%	2,55%	1,49%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.285.775,20	447.683,06	0,00	5.850.090,29	116.632,03	2,03%	2,17%	1,21%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	784.423,48	0,00	0,00	799.564,00	15.140,52	1,93%	1,93%	1,02%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.213.009,71	0,00	0,00	2.250.638,38	37.628,67	1,70%	1,70%	1,35%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.356.396,63	0,00	0,00	3.413.397,06	57.000,43	1,70%	1,70%	1,34%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	8.025.865,14	0,00	0,00	8.123.693,51	97.828,37	1,22%	1,22%	0,95%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.750.140,74	0,00	0,00	1.769.488,03	19.347,29	1,11%	1,11%	0,91%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	497.423,98	0,00	0,00	500.271,83	2.847,85	0,57%	0,57%	0,17%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	10.342.616,61	0,00	4.200.000,00	6.200.292,45	57.675,84	0,56%	0,57%	0,15%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	36.760,21	0,00	0,00	36.937,75	177,54	0,48%	0,48%	0,04%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	3.948.444,31	0,00	0,00	3.966.503,43	18.059,12	0,46%	0,46%	0,00%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.858.815,06	0,00	0,00	4.880.878,64	22.063,58	0,45%	0,45%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	382.000,00	2.352.293,14	447.683,03	2.288.000,00	1.389,89	0,05%	0,39%	0,00%
Total Renda Fixa	53.242.784,65	2.799.976,20	4.647.683,03	52.209.657,76	814.579,94	1,53%		0,94%



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 28/06/2019

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.221.018,19	0,00	0,00	2.329.504,25	108.486,06	4,88%	4,88%	6,80%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	251.380,32	0,00	0,00	263.144,63	11.764,31	4,68%	4,68%	6,68%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.312.979,31	0,00	0,00	2.410.986,43	98.007,12	4,24%	4,24%	7,25%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	737.290,78	0,00	0,00	767.354,84	30.064,06	4,08%	4,08%	7,07%
Total Renda Variável	5.522.668,60	0,00	0,00	5.770.990,15	248.321,55	4,50%		7,02%



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 28/06/2019

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
Total Exterior	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%		0,00%



**CRÉDITO
& MERCADO**

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/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-...	3.452.334,70	0,00	0,00	3.762.451,50	310.116,80	8,98%	8,98%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	7.857.480,01	0,00	0,00	8.123.693,51	266.213,50	3,39%	3,39%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,00	4.849.239,67	0,00	5.103.582,70	254.343,03	5,25%	6,70%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.001.629,89	1.596.176,22	0,00	5.850.090,29	252.284,18	4,51%	5,14%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	10.224.127,29	0,00	4.200.000,00	6.200.292,45	176.165,16	1,72%	1,74%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.275.710,82	0,00	0,00	3.413.397,06	137.686,24	4,20%	4,20%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.159.571,41	0,00	0,00	2.250.638,38	91.066,97	4,22%	4,22%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	7.454.804,97	4.848.080,12	7.510.165,31	4.880.878,64	88.158,86	0,72%	1,50%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	0,00	1.971.327,98	0,00	2.040.724,70	69.396,72	3,52%	5,08%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	4.713.074,30	0,00	809.533,43	3.966.503,43	62.962,56	1,34%	1,50%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.714.789,82	0,00	0,00	1.769.488,03	54.698,21	3,19%	3,19%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	0,00	378.124,13	0,00	425.750,18	47.626,05	12,60%	12,35%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	321.995,67	0,00	0,00	361.647,92	39.652,25	12,31%	12,31%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	764.341,67	0,00	0,00	799.564,00	35.222,33	4,61%	4,61%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA ...	1.589.141,87	356.300,00	1.969.199,03	0,00	23.757,16	1,22%	-
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	414.428,08	0,00	435.745,39	21.317,31	5,14%	5,34%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.211.798,44	0,00	2.187.859,93	36.937,75	12.999,24	0,59%	1,58%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	491.781,54	0,00	0,00	500.271,83	8.490,29	1,73%	1,73%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	127.275,92	3.762.370,67	1.604.432,10	2.288.000,00	2.785,51	0,07%	1,27%
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	379.611,49	0,00	378.124,12	0,00	-1.487,37	-0,39%	-



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 28/06/2019

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2019

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
Total Renda Fixa	50.739.469,81	18.176.046,87	18.659.313,92	52.209.657,76	1.953.455,00	2,83%	



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 28/06/2019

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2019

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.139.432,88	0,00	0,00	2.329.504,25	190.071,37	8,88%	8,88%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.267.716,77	0,00	0,00	2.410.986,43	143.269,66	6,32%	6,32%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	3.345.687,25	0,00	0,00	3.421.451,82	75.764,57	2,26%	2,26%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2.399.066,38	0,00	0,00	2.469.690,98	70.624,60	2,94%	2,94%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	717.049,92	9.465,19	0,00	767.354,84	40.839,73	5,62%	5,63%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	246.491,24	0,00	0,00	263.144,63	16.653,39	6,76%	6,76%
Total Renda Variável	11.115.444,44	9.465,19	0,00	11.662.132,95	537.223,32	4,83%	



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 28/06/2019

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/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	0,00	0,00	3.762.451,50	489.407,64	14,95%	14,95%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	7.665.514,49	0,00	0,00	8.123.693,51	458.179,02	5,98%	5,98%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.073.662,07	3.445.183,09	0,00	5.850.090,29	331.245,13	6,00%	8,23%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	10.076.355,26	0,00	4.200.000,00	6.200.292,45	323.937,19	3,21%	3,23%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,00	4.849.239,67	0,00	5.103.582,70	254.343,03	5,25%	10,92%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.124.036,86	61.460,50	0,00	3.413.397,06	227.899,70	7,15%	7,17%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	8.238.818,63	4.848.080,12	8.412.165,31	4.880.878,64	206.145,20	1,58%	3,01%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.100.229,48	0,00	0,00	2.250.638,38	150.408,90	7,16%	7,16%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	4.644.194,83	0,00	809.533,43	3.966.503,43	131.842,03	2,84%	3,01%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.673.097,98	0,00	0,00	1.769.488,03	96.390,05	5,76%	5,76%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	0,00	1.971.327,98	0,00	2.040.724,70	69.396,72	3,52%	8,36%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	299.410,46	0,00	0,00	361.647,92	62.237,46	20,79%	20,79%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA ...	1.099.705,40	809.300,00	1.969.199,03	0,00	60.193,63	3,15%	-
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	743.123,27	0,00	0,00	799.564,00	56.440,73	7,60%	7,60%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	0,00	378.124,13	0,00	425.750,18	47.626,05	12,60%	20,80%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.179.940,41	0,00	2.187.859,93	36.937,75	44.857,27	2,06%	3,06%
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 IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	414.428,08	0,00	435.745,39	21.317,31	5,14%	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	484.707,04	0,00	0,00	500.271,83	15.564,79	3,21%	3,21%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	500.512,09	5.236.511,90	3.453.438,97	2.288.000,00	4.414,98	0,08%	2,53%



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 28/06/2019

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/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	0,00	97,18	0,00	0,07	0,07%	0,58%
Total Renda Fixa	48.525.960,26	22.013.655,47	21.410.417,97	52.209.657,76	3.080.460,00	6,27%	



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 28/06/2019

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2019

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.095.530,47	157,69	0,00	2.410.986,43	315.298,27	15,05%	15,05%
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.024.233,27	0,00	0,00	2.329.504,25	305.270,98	15,08%	15,08%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2.322.625,96	0,00	0,00	2.469.690,98	147.065,02	6,33%	6,33%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	3.284.657,80	0,00	0,00	3.421.451,82	136.794,02	4,16%	4,16%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	663.916,50	9.465,19	0,00	767.354,84	93.973,15	13,96%	14,09%
ITAU FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	229.796,89	0,00	0,00	263.144,63	33.347,74	14,51%	14,51%
Total Renda Variável	10.620.760,89	9.622,88	0,00	11.662.132,95	1.031.749,18	9,71%	



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.

