PREVIBARRAS

Regime Próprio de Previdência do Município de Quatro Barras - PR

[RELATÓRIO MENSAL DE GESTÃO]

Janeiro - 2020

VERSÃO 4.0

Introdução

O presente relatório tem por objetivo cumprir as exigências legais, dispostos pela Resolução do CMN nº 3.922/10, e a Portaria MPS nº 519/11 e as suas alterações subsequentes.

O conteúdo do relatório é baseado em informações obtidas nos Regimes Próprios de Previdência Social (RPPS), além de outras informações de domínio público.

A análise de investimentos se limita a carteira de investimentos, excluindo movimentações em conta corrente, ou outros investimentos fora do contexto de alocação dos RPPS.

O trabalho de consultoria de investimentos é feito com imparcialidade e transparência, e busca tão somente contribuir aos institutos de previdência para buscar as melhores alocações baseados em risco e retorno, sempre com objetivo de cumprir as metas atuariais.

Nossas análises de investimento, em conformidade com as normas da CVM e ANBIMA, não devem assegurar prometer ou sugerir a existência de resultados futuros ou isenção de risco para o investidor.

A análise de desempenho e características gerais de investimento é limitada aos fundos de investimento, e não indicamos ou recomendamos gestores de fundos ou instituições financeiras.

Conteúdo

O Relatório Mensal de Gestão abrangerá os seguintes aspectos:

RELATÓRIOS GERENCIAIS

Carteira de Investimentos – Composição 1
Carteira de Investimentos – Riscos 2
Carteira de Investimentos – Evolução Mensal 3
Rentabilidade dos Fundos de Investimento 4
Rentabilidade da Carteira Consolidada 5
Participação dos Fundos na Rentabilidade da Carteira 6
Distribuição da Carteira por Índices e Perfil 7
Enquadramento da Carteira por Fundos 8
Enquadramento da Carteira por Aplicações 9
DAIR - Informações dos Fundos 10
DAIR - APR Movimentações 11
DAIR - Carteira de Investimentos 12

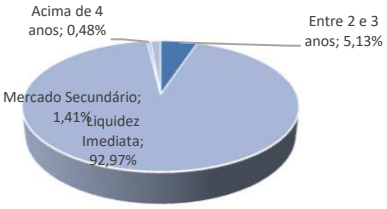
PREVIBARRAS

Regime Próprio de Previdência do Munícipio de Quatro Barras - PR

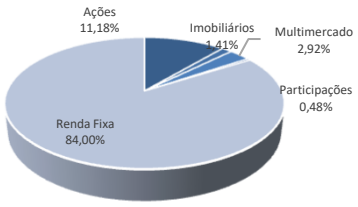
CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - COMPOSIÇÃO

FUNDOS DE INVESTIMENTO (FI)	dezembro-19		janeiro-20	%
FI de Renda Fixa	**54.524.525,07**		**54.663.910,12**	**0,26%**
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RENDA FIXA LP	3.851.685,40		3.861.186,02	0,25%
FIC-FI EM RENDA FIXA LP IMAB 1000	2.746.235,14		2.737.558,23	-0,32%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FI	4.849.177,54		4.861.935,93	0,26%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI	2.974.010,61		2.999.416,75	0,85%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP FIC FI	9.638.165,52		9.678.582,68	0,42%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP IPCA IV FI	938.732,40		943.864,72	0,55%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.082.050,90		9.126.175,20	0,49%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B5+ TP FI	9.450.323,14		9.454.801,98	0,05%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TP FI	6.588.308,52		6.613.672,72	0,38%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC-FI	1.441.757,83	↓	1.410.567,60	-2,16%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP XI FI	596.567,07		600.355,04	0,63%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.367.511,00		2.375.793,25	0,35%
FI de Renda Variável / Multimercado / Estruturados	**10.584.957,78**		**10.409.110,88**	**-1,66%**
AUSTRO MULTIPAR FI EM COTA DE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVAI	1.905.513,97		1.902.864,72	-0,14%
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FI	2.412.253,63		2.386.037,43	-1,09%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI DE AÇÕES	4.919.692,84		4.886.113,86	-0,68%
BRB BLUEJAY FI EM PARTICIPAÇÕES IMOBILIÁRIO MULTIESTRATEGIA PA	315.497,34		314.094,87	-0,44%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FI IMOBILIÁRIO - FI	1.032.000,00		920.000,00	-10,85%
Disponibilidades Financeiras	**129.276,84**		**181.285,82**	**40,23%**
TOTAL DA CARTEIRA	**65.238.759,69**		**65.254.306,82**	**0,02%**

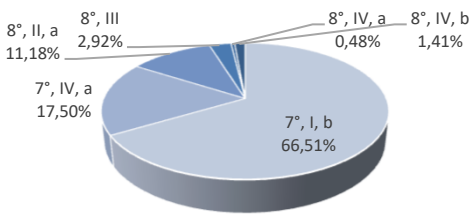
Liquidez (%)



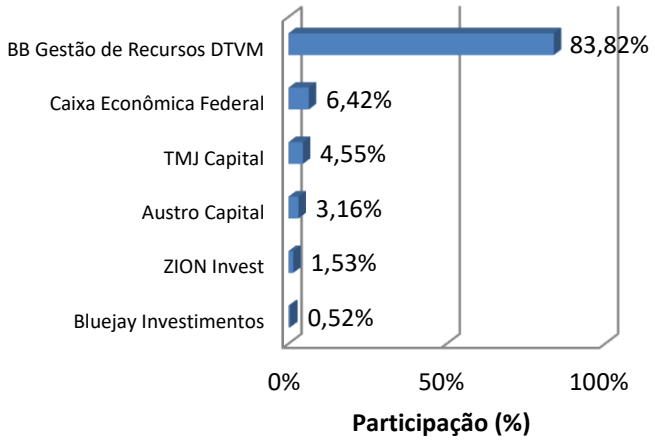
Segmentos (%)



Tipo de Ativo (%)



Composição por Gestor (%)



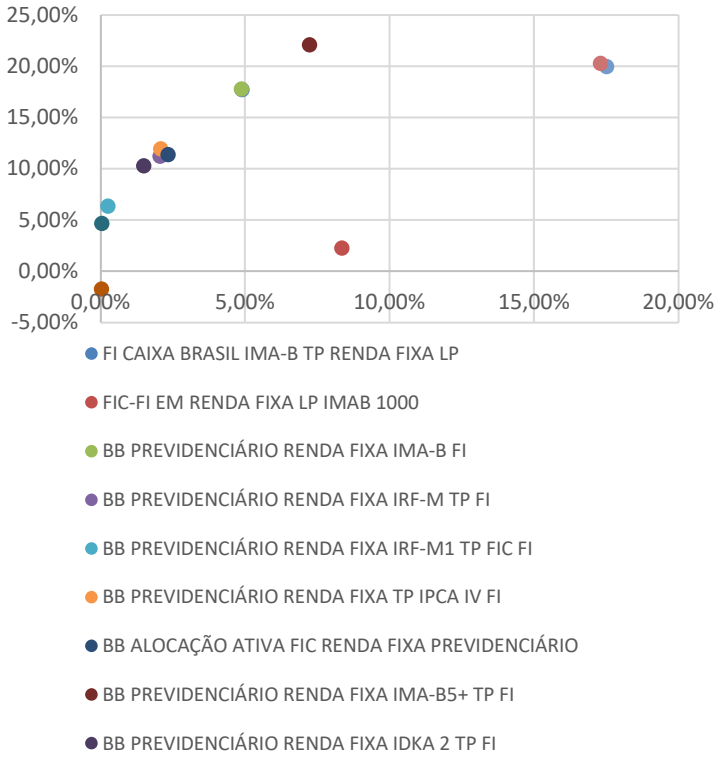
LEGENDA:

- ↓ Resgate de Recursos
- ↑ Entrada de Recursos
- ⊗ Resgate Total Efetuado
- • Nova Aplicação Efetuada

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - RISCOS

FUNDOS DE INVESTIMENTO (FI)	Index	Volatilidade (12m)			Risco	
		Fundo	Index	Status	VaR	%
Fundos ICVM nº 555						
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RENDA FIXA LP	IMA-B	4,89%	4,88%	↑	R$ 27.680	0,7%
FIC-FI EM RENDA FIXA LP IMAB 1000	IMA-B	8,36%	4,88%	↑	R$ 33.532	1,2%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FI	IMA-B	4,87%	4,88%	↓	R$ 34.715	0,7%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI	IRF-M	2,06%	2,06%	↑	R$ 9.056	0,3%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP FIC FI	IRF-M 1	0,26%	0,25%	↑	R$ 3.630	0,0%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP IPCA IV FI	IPCA	2,08%	-	-	R$ 2.881	0,3%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	CDI	2,34%	0,04%	↑	R$ 31.318	0,3%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B5+ TP FI	IMA-B 5+	7,24%	7,26%	↓	R$ 100.252	1,1%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TP FI	IDkA 2	1,49%	-	-	R$ 14.487	0,2%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC-FI	CDI	0,04%	0,04%	↓	R$ 92	0,0%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP XI FI	CDI	2,32%	0,04%	↑	R$ 2.041	0,3%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	CDI	0,05%	0,04%	↑	R$ 184	0,0%
AUSTRO MULTIPAR FI EM COTA DE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRI	IPCA	0,04%	-	-	R$ 104	0,0%
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FI	Ibovespa	17,51%	18,20%	↓	R$ 61.238	2,6%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI DE AÇÕES	Ibovespa	17,31%	18,20%	↓	R$ 123.920	2,5%

Risco x Retorno (diariamente últimos 12 meses)



Descrição

% CDI = Quantidade de vezes acima ou abaixo do CDI diariamente nos últimos 252 dias úteis.
VaR - Perda máxima esperada de um ativo para 1 dia, com 99% de confiança, considerando a volatilidade histórica do ativo no último ano.
Volatilidade - Volatilidade é a medida de dispersão dos retornos de um fundo. Geralmente associada ao risco do fundo, mede a previsibilidade dos retornos. Quanto mais volátil um fundo, menos previsível e mais dispersos são os seus retornos, representando maior risco para o investidor.
Status - Indica se o fundo possui um risco maior que o seu indexador.
↑ = Risco fundo maior que o risco do indexador
↓ = Risco fundo menor que o risco do indexador

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - MENSAL

FUNDOS DE INVESTIMENTO (FI)	janeiro-20	fevereiro-20	março-20
FI de Renda Fixa	**54.663.910,12**	**-**	**-**
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RENDA FIXA LP	3.861.186,02	-	-
FIC-FI EM RENDA FIXA LP IMAB 1000	2.737.558,23	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FI	4.861.935,93	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI	2.999.416,75	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP FIC FI	9.678.582,68	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP IPCA IV FI	943.864,72	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.126.175,20	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B5+ TP FI	9.454.801,98	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TP FI	6.613.672,72	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC-FI	1.410.567,60	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP XI FI	600.355,04	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.375.793,25	-	-
FI de Renda Variável / Multimercado / Estruturados	**10.409.110,88**	**-**	**-**
AUSTRO MULTIPAR FI EM COTA DE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.902.864,72	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FI	2.386.037,43	-	-
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI DE AÇÕES	4.886.113,86	-	-
BRB BLUEJAY FI EM PARTICIPAÇÕES IMOBILIÁRIO MULTIESTRATEGIA PARANÁ I	314.094,87	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FI IMOBILIÁRIO - FII	920.000,00	-	-
Disponibidades Financeiras	**181.285,82**	**-**	**-**
TOTAL DA CARTEIRA	**65.254.306,82**	**-**	**-**

FUNDOS DE INVESTIMENTO (FI)	abril-20	maio-20	junho-20
FI de Renda Fixa	**-**	**-**	**-**
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RENDA FIXA LP	-	-	-
FIC-FI EM RENDA FIXA LP IMAB 1000	-	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FI	-	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI	-	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP FIC FI	-	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP IPCA IV FI	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B5+ TP FI	-	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TP FI	-	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC-FI	-	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP XI FI	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-	-	-
FI de Renda Variável / Multimercado / Estruturados	**-**	**-**	**-**
AUSTRO MULTIPAR FI EM COTA DE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FI	-	-	-
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI DE AÇÕES	-	-	-
BRB BLUEJAY FI EM PARTICIPAÇÕES IMOBILIÁRIO MULTIESTRATEGIA PARANÁ I	-	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FI IMOBILIÁRIO - FII	-	-	-
Disponibidades Financeiras	**-**	**-**	**-**
TOTAL DA CARTEIRA	**-**	**-**	**-**

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - MENSAL

FUNDOS DE INVESTIMENTO (FI)	julho-20	agosto-20	setembro-20
FI de Renda Fixa	-	-	-
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RENDA FIXA LP	-	-	-
FIC-FI EM RENDA FIXA LP IMAB 1000	-	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FI	-	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI	-	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP FIC FI	-	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP IPCA IV FI	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B5+ TP FI	-	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TP FI	-	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC-FI	-	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP XI FI	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-	-	-
FI de Renda Variável / Multimercado / Estruturados	-	-	-
AUSTRO MULTIPAR FI EM COTA DE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FI	-	-	-
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI DE AÇÕES	-	-	-
BRB BLUEJAY FI EM PARTICIPAÇÕES IMOBILIÁRIO MULTIESTRATEGIA PARANÁ I	-	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FI IMOBILIÁRIO - FII	-	-	-
Disponibidades Financeiras	-	-	-
TOTAL DA CARTEIRA	-	-	-

FUNDOS DE INVESTIMENTO (FI)	outubro-20	novembro-20	dezembro-20
FI de Renda Fixa	-	-	-
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RENDA FIXA LP	-	-	-
FIC-FI EM RENDA FIXA LP IMAB 1000	-	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FI	-	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI	-	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP FIC FI	-	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP IPCA IV FI	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B5+ TP FI	-	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TP FI	-	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC-FI	-	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP XI FI	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-	-	-
FI de Renda Variável / Multimercado / Estruturados	-	-	-
AUSTRO MULTIPAR FI EM COTA DE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FI	-	-	-
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI DE AÇÕES	-	-	-
BRB BLUEJAY FI EM PARTICIPAÇÕES IMOBILIÁRIO MULTIESTRATEGIA PARANÁ I	-	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FI IMOBILIÁRIO - FII	-	-	-
Disponibidades Financeiras	-	-	-
TOTAL DA CARTEIRA	-	-	-

PREVIBARRAS

Regime Próprio de Previdência do Munícipio de Quatro Barras - PR

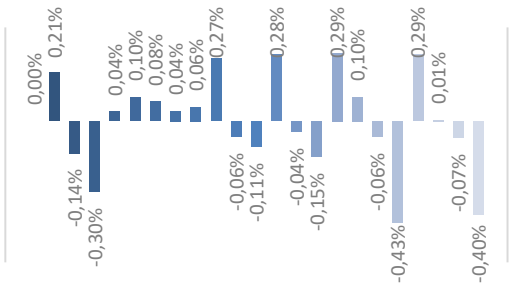
RENTABILIDADE DOS FUNDOS DE INVESTIMENTO

FUNDOS DE INVESTIMENTO (FI)	Index	Rentabilidade jan	Rentabilidade 2020	Rentabilidade 12 m	% do Indexador jan	% do Indexador 2020	% do Indexador 12 m
FI de Renda Fixa							
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RENDA FIXA LP	IMA-B	0,25%	0,25%	17,72%	↓	↓	↓
FIC-FI EM RENDA FIXA LP IMAB 1000	IMA-B	-0,32%	-0,32%	12,25%	↓	↓	↓
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FI	IMA-B	0,26%	0,26%	17,77%	↑	↑	↓
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI	IRF-M	0,85%	0,85%	11,22%	↓	↓	↓
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP FIC FI	IRF-M 1	0,42%	0,42%	6,33%	↓	↓	↓
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP IPCA IV FI	IPCA	0,55%	0,55%	11,93%	-	↑	↑
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	CDI	0,49%	0,49%	11,38%	↑	↑	↑
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B5+ TP FI	IMA-B 5+	0,05%	0,05%	22,08%	↑	↑	↓
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TP FI	IDkA 2	0,38%	0,38%	10,29%	-	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC-FI	CDI	0,29%	0,29%	4,65%	↓	↓	↓
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP XI FI	CDI	0,63%	0,63%	12,62%	↑	↑	↑
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	CDI	0,35%	0,35%	5,55%	↓	↓	↓
FI de Renda Variável / Multimercado / Estruturados							
AUSTRO MULTIPAR FI EM COTA DE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PF	IPCA	-0,14%	-0,14%	-1,76%	-	↓	↓
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FI	Ibovespa	-1,09%	-1,09%	19,95%	↑	↑	↑
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI DE AÇÕES	Ibovespa	-0,68%	-0,68%	20,26%	↑	↑	↑

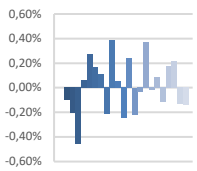
PRINCIPAIS INDICADORES	Index	Rentabilidade jan	Rentabilidade 2020	Rentabilidade 12 m	% da Meta jan	% da Meta 2020	% da Meta 12 m
CDI (CERTIFICADO DE DEPÓSITO INTERFINANCEIRO)	CDI	0,38%	0,38%	5,78%	56%	25%	83%
IMA - GERAL (ÍNDICE DE MERCADO ANBIMA - GERAL)	IMA - Geral	0,56%	0,56%	11,32%	82%	37%	163%
IMA-B (ÍNDICE DE MERCADO ANBIMA - B)	IMA-B	0,26%	0,26%	18,11%	39%	18%	260%
IMA-B 5 (ÍNDICE DE MERCADO ANBIMA - B 5)	IMA-B 5	0,56%	0,56%	12,06%	82%	37%	173%
IMA-B 5+ (ÍNDICE DE MERCADO ANBIMA - B 5+)	IMA-B 5+	0,03%	0,03%	22,33%	5%	2%	321%
IRF-M (ÍNDICE DE RENDA FIXA DO MERCADO)	IRF-M	0,88%	0,88%	11,47%	129%	59%	165%
IRF-M 1 (ÍNDICE DE RENDA FIXA DO MERCADO - 1)	IRF-M 1	0,44%	0,44%	6,61%	65%	30%	95%
IRF-M 1+ (ÍNDICE DE RENDA FIXA DO MERCADO - 1+)	IRF-M 1+	1,11%	1,11%	13,57%	164%	75%	195%
IBOVESPA (ÍNDICE DA BOLSA DE SÃO PAULO)	Ibovespa	-1,63%	-1,63%	16,81%	-240%	-109%	242%
BRL / USD (COTAÇÃO DÓLAR AMERICANO)	Dólar	5,92%	5,92%	16,91%	874%	398%	243%
ÍNDICE NACIONAL DE PREÇOS AO CONSUMIDOR AMPLO	IPCA	0,21%	0,21%	4,19%	31%	14%	60%
ÍNDICE NACIONAL DE PREÇOS AO CONSUMIDOR	INPC	0,19%	0,19%	4,30%	28%	13%	62%
ÍNDICE GERAL DE PREÇOS DO MERCADO	IGP-M	0,48%	0,48%	7,82%	71%	32%	112%

RENTABILIDADE DIÁRIA CARTEIRA x INDICES NO MÊS

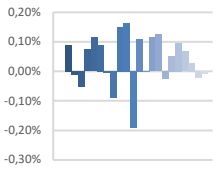
CARTEIRA



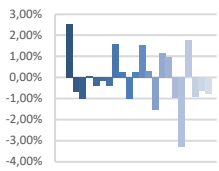
IMA-B



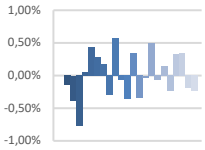
IRF-M



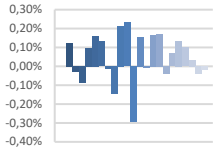
IBOVESPA



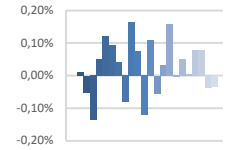
IMA-B 5+



IRF-M +1



IMA Geral



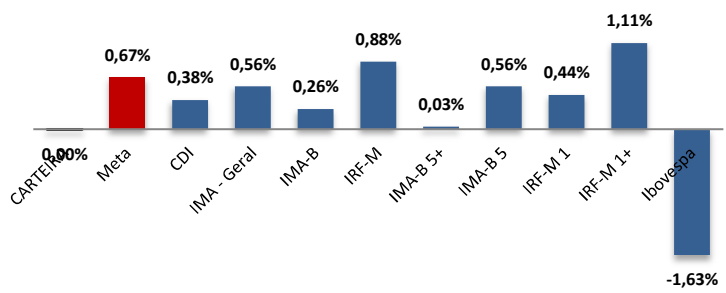
PREVIBARRAS

Regime Próprio de Previdência do Munícipio de Quatro Barras - PR

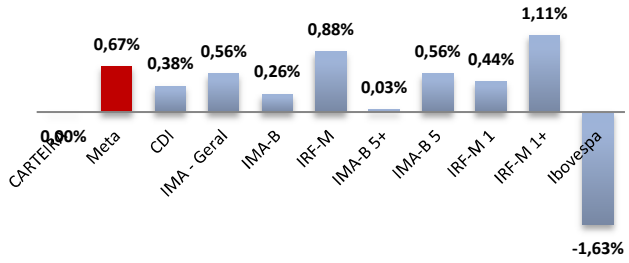
RENTABILIDADE DA CARTEIRA CONSOLIDADA

PERÍODO	Carteira	Meta	CDI	IMA-B	IMA Geral	p.p Meta	% Meta	% CDI	% IMA-B	% IMA Geral
janeiro-20	**0,00%**	**0,67%**	0,38%	0,26%	0,56%	**-0,67p.p.**	-0,2%	-0,4%	-0,6%	-0,3%
fevereiro-20										
março-20										
abril-20										
maio-20										
junho-20										
julho-20										
agosto-20										
setembro-20										
outubro-20										
novembro-20										
dezembro-20										
2020 (acumulado)	**0,00%**	**0,67%**	0,38%	0,26%	0,56%	**-0,67p.p.**	-0,2%	-0,4%	-0,6%	-0,3%

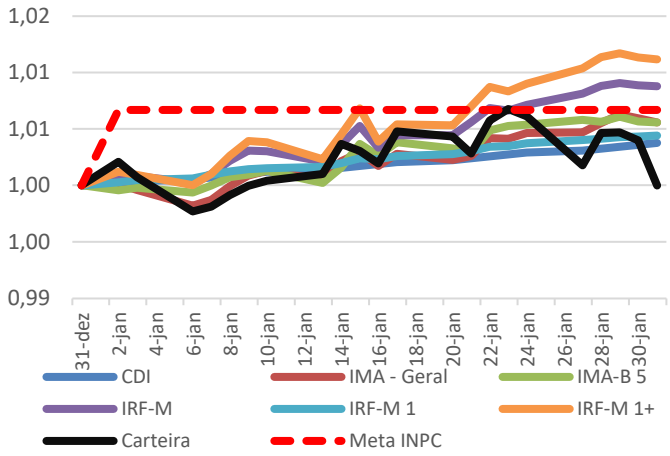
Carteira x Indicadores (jan/20)



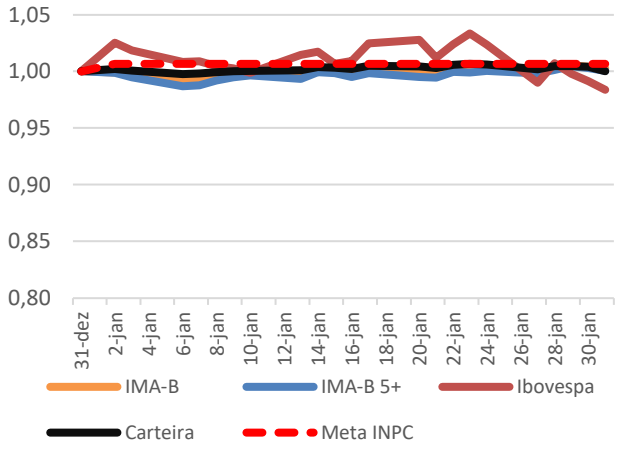
Carteira x Indicadores (2020)



Rentabilidade Diária no Ano (%) - Séries Menor Vol



Rentabilidade Diária no Ano (%) - Séries Maior Vol



PARTICIPAÇÃO DOS FUNDOS NA RENTABILIDADE DA CARTEIRA

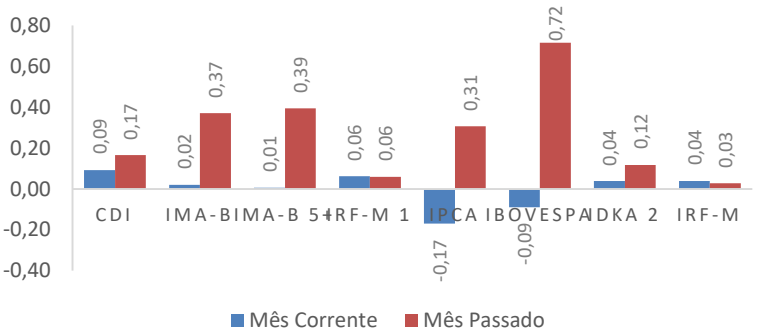
Últimos 6 meses

FUNDOS DE INVESTIMENTO (FI)	Indexador	Rentabilidade Diária x Peso Diário					
		jan	dez	nov	out	set	ago
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RENDA FIXA LP	IMA-B	0,01	0,12	-0,15	0,11	0,08	-0,01
FIC-FI EM RENDA FIXA LP IMAB 1000	IMA-B	-0,01	0,03	-0,17	0,10	0,06	-0,12
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FI	IMA-B	0,02	0,22	-0,31	0,49	0,43	-0,06
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI	IRF-M	0,04	0,03	-0,02	0,08	0,07	0,01
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP FIC FI	IRF-M 1	0,06	0,06	0,05	0,09	0,09	0,08
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP IPCA IV FI	IPCA	0,01	0,02	-0,00	0,02	0,02	0,00
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	CDI	0,07	0,14	-0,13	0,25	0,21	0,01
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B5+ TP FI	IMA-B 5+	0,01	0,39	-0,61	0,68	0,53	-0,11
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TP FI	IDkA 2	0,04	0,12	0,02	0,13	0,14	0,01
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC-FI	CDI	0,01	0,01	0,00	0,01	0,00	0,01
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP XI FI	CDI	0,01	0,01	-0,00	0,02	0,02	0,00
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	CDI	0,01	0,01	0,01	0,02	0,02	0,02
AUSTRO MULTIPAR FI EM COTA DE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVAI	IPCA	-0,00	-0,00	-0,00	-0,00	-0,00	-0,00
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FI	Ibovespa	-0,04	0,21	0,02	0,05	0,06	0,01
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI DE AÇÕES	Ibovespa	-0,05	0,51	0,09	0,09	0,10	-0,01
BRB BLUEJAY FI EM PARTICIPAÇÕES IMOBILIÁRIO MULTIESTRATEGIA PA	IPCA	-0,00	-0,00	-0,00	-0,00	-0,00	-0,00
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FI IMOBILIÁRIO - FI	IPCA	-0,17	0,30	-0,37	-0,24	-0,04	-0,04

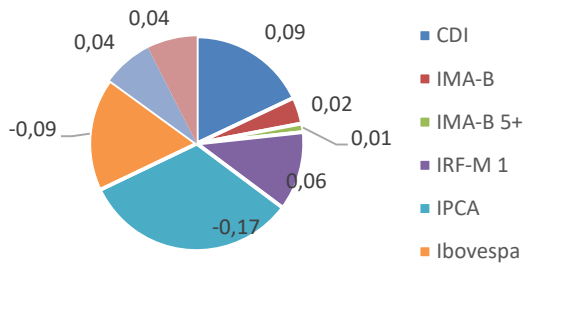
Últimos 6 meses

FUNDOS DE INVESTIMENTO (FI)		Peso Fechamento Carteira					
		jan	dez	nov	out	set	ago
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RENDA FIXA LP	IMA-B	4,14%	4,14%	4,32%	4,33%	2,11%	2,12%
FIC-FI EM RENDA FIXA LP IMAB 1000	IMA-B	4,75%	4,75%	4,95%	4,97%	5,04%	5,05%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FI	IMA-B	3,32%	3,31%	5,60%	5,62%	7,15%	7,17%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI	IRF-M	1,93%	1,93%	2,01%	2,02%	2,04%	2,05%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP FIC FI	IRF-M 1	13,71%	13,70%	14,28%	14,33%	14,38%	14,42%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP IPCA IV FI	IPCA	1,65%	1,65%	1,72%	1,72%	1,75%	1,75%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	CDI	23,40%	23,38%	24,38%	24,47%	24,80%	24,87%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B5+ TP FI	IMA-B 5+	10,41%	10,41%	10,85%	10,89%	11,04%	11,07%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TP FI	IDkA 2	9,21%	9,20%	9,60%	9,63%	9,76%	9,79%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC-FI	CDI	2,53%	2,59%	1,76%	1,40%	1,04%	0,78%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP XI FI	CDI	1,40%	1,40%	1,46%	1,46%	1,48%	1,49%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	CDI	3,94%	3,94%	4,11%	4,13%	4,18%	4,19%
AUSTRO MULTIPAR FI EM COTA DE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVAI	IPCA	4,32%	4,32%	4,51%	4,52%	4,58%	4,60%
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FI	Ibovespa	2,94%	2,94%	1,75%	1,75%	1,78%	1,78%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI DE AÇÕES	Ibovespa	9,36%	9,35%	5,59%	5,61%	5,69%	5,70%
BRB BLUEJAY FI EM PARTICIPAÇÕES IMOBILIÁRIO MULTIESTRATEGIA PA	IPCA	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FI IMOBILIÁRIO - FI	IPCA	3,00%	2,99%	3,12%	3,13%	3,18%	3,18%

Contribuição por Indexador - jan/20 contra dez/19



Contribuição por Indexador - Global jan/20



DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES

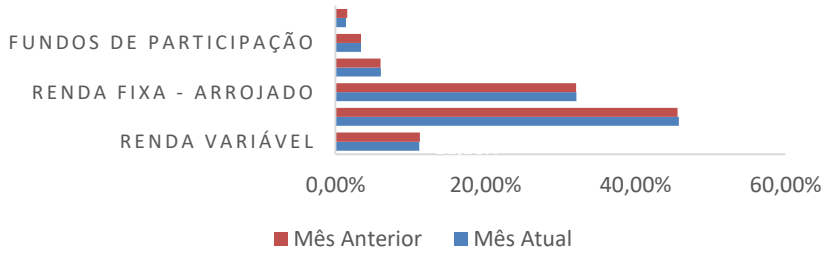
ÍNDICES	dez/19	jan/20
CDI	**20,72%**	**20,77%**
IRF-M	**19,37%**	**19,48%**
IRF-M	4,57%	4,61%
IRF-M 1	14,80%	14,87%
IRF-M 1+	0,00%	0,00%
IMA-B	**32,10%**	**32,14%**
IMA-B	17,58%	17,61%
IMA-B 5	0,00%	0,00%
IMA-B 5+	14,51%	14,53%
IMA - Geral	**0,00%**	**0,00%**
IDkA	**10,12%**	**10,16%**
IDkA 2	10,12%	10,16%
IDkA 20	0,00%	0,00%
Outros RF	**0,00%**	**0,00%**
RV	**11,26%**	**11,18%**
Ibovespa	11,26%	11,18%
IBrX	0,00%	0,00%
IBrX-50	0,00%	0,00%
Outros RV	0,00%	0,00%
IPCA	**6,44%**	**6,27%**

Rentabilidade por Segmento	jan/20
Renda Fixa	**0,27%**
Direitos Creditórios	**0,00%**
Ações	**-0,09%**
Multimercados	**0,00%**
Participações	**0,00%**
Imobiliários	**-0,17%**
Investimentos no Exterior	**0,00%**
Total	**0,01%**

Conceitos

CDI = FIDC + Multimercados + LFT + FI no qual o índice é o CDI
IRF-M = FI no qual o índice é o IRF-M
IRF-M 1 = NTN-F e/ou LTN com vencimento igual ou inferior a 1 ano + FI no qual o índice é o IRF-M 1
IRF-M 1+ = NTN-F e/ou LTN com vencimento superior a 1 ano + FI no qual o índice é o IRF-M 1+
IMA-B = FI no qual o índice é o IMA-B
IMA-B 5 = NTN-B com vencimento igual ou inferior a 5 anos + FI no qual o índice é o IMA-B 5
IMA-B 5+ = NTN-B com vencimento superior a 5 anos + FI no qual o índice é o IMA-B 5+
IMA Geral = FI no qual o índice é o IMA Geral
IDkA = Fundos com o benchmark IDkA
Outros RF = Fundos de Renda Fixa com outro índice de referência
Ibovespa = FIA no qual o índice é o Ibovespa
IBrX = FIA no qual o índice é o IBrX
IBrX-50 = FIA no qual o índice é o IBrX-50
Outros = FIA no qual o índice não é Ibovespa, IBrX ou IBrX-50
IPCA = Fundos que tem o indicador de desempenho atrelado ao IPCA ou uma composição que inclua o IPCA.

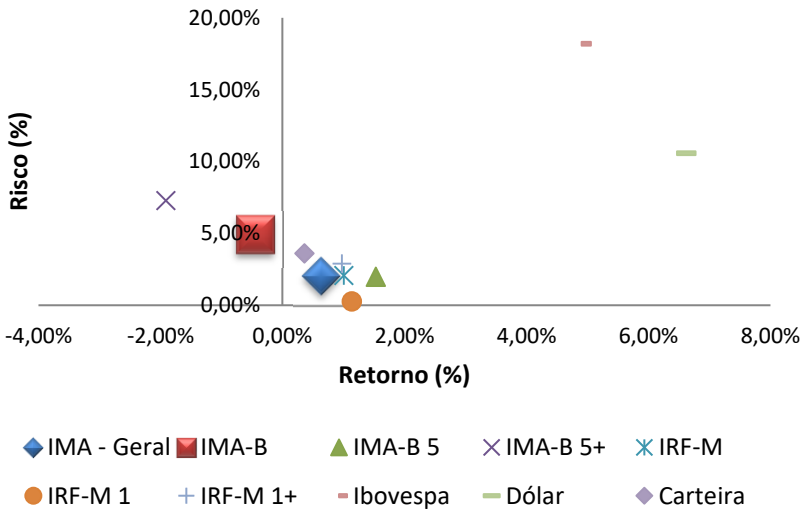
Distribuição da Carteira por Classes (mensalmente)



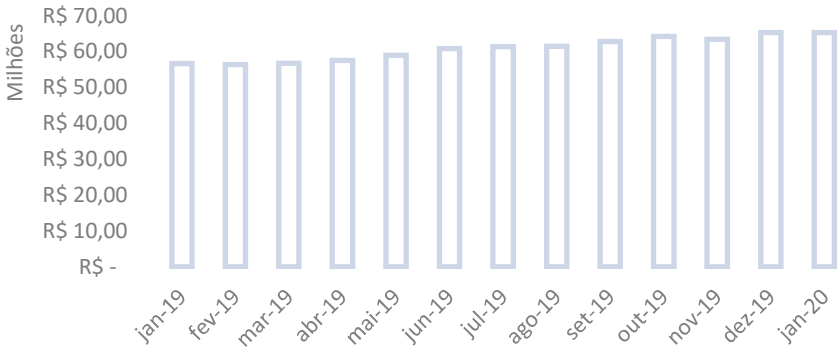
Classificação Classes de Fundos

1) Renda Fixa - Arrojado = IMA - B 5+ | IMA-B | IRF-M | IRF-M 1+ | IDkA 20, 2) Renda Fixa - Conservador = CDI | IRF-M 1 | IMA-B 5 | IMA Geral | IDkA | Outros, 3) Multimercados, 4) Fundos de Participação, 5) Renda Variável, 6) Fundos Imobiliários

Relação Risco x Retorno da Carteira (em 3 meses)



Evolução do Patrimônio (em R$ milhões)



ENQUADRAMENTO DA CARTEIRA POR APLICAÇÕES

Segmento de Renda Fixa

Artigo	Tipo de Ativo / Condições de Enquadramento	Limite 3.922	Lim. Máx.	Limite da PI	Total (R$)	% da Carteira	Status
7°	**Renda Fixa e Títulos Públicos**	**100%**	**100%**	**100%**	**54.663.910,12**	**83,77%**	**Enquadrado**
7°, I	**Fundos 100% Títulos Públicos ou 100% Títulos Públicos**	**100%**	**100%**	**100%**	**43.278.055,11**	**66,32%**	**Enquadrado**
7°, I, a	Títulos Públicos	100%	100%	100%	-	0,00%	Enquadrado
7°, I, b	Cotas de FI em Renda Fixa nome "Referenciado" com Aplicação em 100% TP	100%	100%	100%	43.278.055,11	66,32%	Enquadrado
7°, I, c	Cotas de FI em índices de Mercado com Carteira Exclusivamente por TP	100%	100%	100%	-	0,00%	Enquadrado
7°, II	**Operações Compromissadas Lastro 100% Títulos Públicos**	**5%**	**5%**	**5%**	-	**0,00%**	**Enquadrado**
7°, III	**Fundos de Renda Fixa**	**60%**	**60%**	**60%**	**-**	**0,00%**	**Enquadrado**
7°, III, a	Cotas de FI Renda Fixa nome "Referenciado"	60%	60%	60%	-	0,00%	Enquadrado
7°, III, b	Cotas de FI em índices de Mercado de RF	60%	60%	60%	-	0,00%	Enquadrado
7°, IV	**Fundos Renda Fixa Geral**	**40%**	**40%**	**40%**	**11.385.855,01**	**17,45%**	**Enquadrado**
7°, IV, a	Cotas de FI Classificados como Renda Fixa (Condomínio Aberto)	40%	40%	40%	11.385.855,01	17,45%	Enquadrado
7°, IV, b	Cotas de FI em Índice de Mercado de Renda Fixa - Negociáveis em Bolsa de Valores	40%	40%	40%	-	0,00%	Enquadrado
7°, V	**Letras Imobiliárias Garantidas**	**20%**	**20%**	**20%**	**-**	**0,00%**	**Enquadrado**
7°, V, b	Letras Imobiliárias Garantidas (LIG)	**20%**	**20%**	**20%**	-	0,00%	Enquadrado
7°, VI	**Certificado Depósito Bancário / Depósito em Poupança**	**15%**	**15%**	**0%**	**-**	**0,00%**	**Enquadrado**
7°, VI, a	Certificado Depósito Bancário (CDB)	15%	15%	0%	-	0,00%	Enquadrado
7°, VI, b	Depósito em Poupança	15%	15%	0%	-	0,00%	Enquadrado
7°, VII	**FIDCs/Renda Fixa - Crédito Privado/ Debêntures de Infraestrutura**	**15%**	**18,75%**	**10%**	**-**	**0,00%**	**Enquadrado**
7°, VII, a	Fundos Investimentos Direitos Creditórios	5%	6,25%	0%	-	0,00%	Enquadrado
7°, VII, b	FI Renda Fixa (Crédito Privado)	5%	6,25%	5%	-	0,00%	Enquadrado
7°, VII, c	Debêntures de Infraestrutura	5%	6,25%	5%	-	0,00%	Enquadrado

Segmento de Renda Variável

Artigo	Tipo de Ativo	Limite 3.922	Lim. Máx.	Limite da PI	Total (R$)	% da Carteira	Status
8°	**Renda Variável e Estruturados**	**30%**	**30%**	**30%**	**10.409.110,88**	**15,95%**	**Enquadrado**
8°, I	**FI Referenciados / Index. Ibovespa, IBrX ou IBrX-50, exclusiv.**	**30%**	**30%**	**30%**	**-**	**0,00%**	**Enquadrado**
8°, I, a	Cotas de FI em Renda Variável Referenciados em índices de Renda Variável	30%	30%	30%	-	0,00%	Enquadrado
8°, I, b	Cotas de FI em Índices de Merc. Renda Variável	30%	30%	30%	-	0,00%	Enquadrado
8°, II	**FI Índices Ref. Ações / Index Ibov, IBrX ou IBrX-50, exclusiv.**	**20%**	**20%**	**20%**	**7.272.151,29**	**11,14%**	**Enquadrado**
8°, II, a	Cotas de FI Classificados como Ações	20%	20%	20%	7.272.151,29	11,14%	Enquadrado
8°, II, b	Cotas de FI em Índice de Mercado Variável	20%	20%	20%	-	0,00%	Enquadrado
8°, III	**FI Multimercado**	**10%**	**10,0%**	**10%**	**1.902.864,72**	**2,92%**	**Enquadrado**
8°, IV	**Fundos de Investimentos Estruturados**	**10%**	**12,50%**	**6%**	**1.234.094,87**	**1,89%**	**Enquadrado**
8°, IV, a	Cotas de FI em Participações (Fechado)	5%	6,25%	1%	314.094,87	0,48%	Enquadrado
8°, IV, b	Cotas de FI Imobiliários (Negociados em Bolsa)	5%	6,25%	5%	920.000,00	1,41%	Enquadrado

Segmento de Renda Variável

Artigo	Tipo de Ativo	Limite 3.922	Lim. Máx.	Limite da PI	Total (R$)	% da Carteira	Status
9°	**Renda Variável e Estruturados**	**10%**	**10%**	**10%**	**-**	**0,00%**	**Enquadrado**
9°, I	Cotas de FI em Renda Fixa - Dívida Externa	10%	10%	10%	-	0,00%	Enquadrado
9°, II	Cotas de FI com sufixo Investimento no Exterior	10%	10%	10%	-	0,00%	Enquadrado
9°, III	Cotas de FI Ações - BDR Nível I	10%	10%	10%	-	0,00%	Enquadrado
-	**Disponibilidade de Caixa - Conta Corrente**	**100%**	**100%**	**100%**	**181.285,82**	**0,28%**	
TOTAL DA CARTEIRA					**65.254.306,82**	100,0%	

Comentários:

A Carteira de investimentos encontra-se enquadrada de acordo com a Resolução 3.922/4.392 do CMN.

ENQUADRAMENTO DA CARTEIRA POR FUNDOS

FUNDOS DE INVESTIMENTO (FI)	Art	Enquadramento por PL			PL
		PL jan/20	PL Fundo	%	
FI enquadrados dentro da restrição de 15% do PL					**< 15%**
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RENDA FIXA LP	7°, I, b	3.861.186,02	6.604.088.892,56	0,06%	Sim
FIC-FI EM RENDA FIXA LP IMAB 1000	7°, IV, a	2.737.558,23	35.766.477,59	7,65%	Sim
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FI	7°, IV, a	4.861.935,93	1.618.694.263,00	0,30%	Sim
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI	7°, I, b	2.999.416,75	5.205.249.143,09	0,06%	Sim
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP FIC FI	7°, I, b	9.678.582,68	7.374.284.212,96	0,13%	Sim
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP IPCA IV FI	7°, I, b	943.864,72	529.547.773,86	0,18%	Sim
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7°, I, b	9.126.175,20	10.446.730.359,40	0,09%	Sim
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B5+ TP FI	7°, I, b	9.454.801,98	2.287.850.661,28	0,41%	Sim
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TP FI	7°, I, b	6.613.672,72	6.900.045.813,02	0,10%	Sim
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC-FI	7°, IV, a	1.410.567,60	1.500.776.659,75	0,09%	Sim
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP XI FI	7°, I, b	600.355,04	198.917.349,88	0,30%	Sim
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7°, IV, a	2.375.793,25	2.903.514.199,57	0,08%	Sim
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FI	8°, II, a	2.386.037,43	826.438.302,84	0,29%	Sim
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI DE AÇÕES	8°, II, a	4.886.113,86	323.389.730,78	1,51%	Sim
FI enquadrados dentro da restrição de 5% do PL					**< 5%**
AUSTRO MULTIPAR FI EM COTA DE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	8°, III	1.902.864,72	96.540.658,56	1,97%	Sim
BRB BLUEJAY FI EM PARTICIPAÇÕES IMOBILIÁRIO MULTIESTRATEGIA PARAN	8°, IV, a	314.094,87	7.670.659,88	4,09%	Sim
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FI IMOBILIÁRIO - FII	8°, IV, b	920.000,00	204.888.764,45	0,45%	Sim

LEGENDA:

⊗ Resgates Efetuados em 2020

• Aplicações Novos Fundos em 2020

DAIR - INFORMAÇÕES DE FUNDOS

FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RENDA FIXA LP

CNPJ Fundo	Segmento	Tipo de Ativo	Data Início	Resgate	Em Enquad.	Investidor	Taxa Adm (a.a.)%	Taxa Perf (a.s.) %
10.740.658/0001-93	Renda Fixa	7°, I, b	08/03/2010	0	Não	Geral	0,20%	0,00%

Administrador	CNPJ Administrador	Gestor	CNPJ Gestor
Caixa Econômica Federal	00.360.305/0001-04	Caixa Econômica Federal	00.360.305/0001-04

Características dos Ativos

Aplicação 100% em Títulos Públicos Indexados à Inflação de média maturidade

Descrição da Operação

O objetivo do FUNDO é proporcionar ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação em carteira composta por títulos públicos federais, buscando acompanhar o subíndice Índice de Mercado ANBIMA série B - IMA-B.

FI Cotas	Fundos Investidos
Não	Não aplica

FIC-FI EM RENDA FIXA LP IMAB 1000

CNPJ Fundo	Segmento	Tipo de Ativo	Data Início	Resgate	Em Enquad.	Investidor	Taxa Adm (a.a.)%	Taxa Perf (a.s.) %
12.402.646/0001-84	Renda Fixa	7°, IV, a	26/10/2010	1000	Não	Qualificado	1,00%	0,00%

Administrador	CNPJ Administrador	Gestor	CNPJ Gestor
RJI Corretora de Valores	11.010.779/0001-42	TMJ Capital	11.886.095/0001-09

Características dos Ativos

Investe seus recursos em cotas de fundo de investimento de ativos financeiros, pós ou prefixados, públicos e privados.

Descrição da Operação

Obter rentabilidade superior ao índice IMA-B.

FI Cotas	Fundos Investidos
Sim	61,15% 27.385.044/0001-33 MZL IMA-B FI RF |16% 26.326.304/0001-37 TMJ Capital JR | 10 % TMJ FII

BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FI

CNPJ Fundo	Segmento	Tipo de Ativo	Data Início	Resgate	Em Enquad.	Investidor	Taxa Adm (a.a.)%	Taxa Perf (a.s.) %
07.861.554/0001-22	Renda Fixa	7°, IV, a	09/03/2006	1	Não	Geral	0,30%	0,00%

Administrador	CNPJ Administrador	Gestor	CNPJ Gestor
BB Gestão de Recursos DTVM	30.822.936/0001-69	BB Gestão de Recursos DTVM	30.822.936/0001-69

Características dos Ativos

Aplicação 100% em Títulos Públicos de média maturidade

Descrição da Operação

O FUNDO tem como objetivo proporcionar a valorização de suas cotas, mediante aplicação de seus recursos em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais disponíveis no âmbito do mercado financeiro.

FI Cotas	Fundos Investidos
Não	Não aplica

BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI

CNPJ Fundo	Segmento	Tipo de Ativo	Data Início	Resgate	Em Enquad.	Investidor	Taxa Adm (a.a.)%	Taxa Perf (a.s.) %
07.111.384/0001-69	Renda Fixa	7°, I, b	08/12/2004	1	Não	Geral	0,20%	0,00%

Administrador	CNPJ Administrador	Gestor	CNPJ Gestor
BB Gestão de Recursos DTVM	30.822.936/0001-69	BB Gestão de Recursos DTVM	30.822.936/0001-69

Características dos Ativos

Aplicação 100% em Títulos Públicos Pré-fixados de média maturidade

Descrição da Operação

Tem como objetivo proporcionar a rentabilidade de suas cotas, através da diversificação dos ativos financeiros que compõem sua carteira, de forma a acompanhar as variações diárias da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços.

FI Cotas	Fundos Investidos
Não	Não aplica

DAIR - INFORMAÇÕES DE FUNDOS

BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP FIC FI

CNPJ Fundo	Segmento	Tipo de Ativo	Data Início	Resgate	Em Enquad.	Investidor	Taxa Adm (a.a.)%	Taxa Perf (a.s.) %
11.328.882/0001-35	Renda Fixa	7°, I, b	08/12/2009	0	Não	Geral	0,10%	0,00%

Administrador	CNPJ Administrador	Gestor	CNPJ Gestor
BB Gestão de Recursos DTVM	30.822.936/0001-69	BB Gestão de Recursos DTVM	30.822.936/0001-69

Características dos Ativos

Aplicação 100% em Títulos Públicos Pré-fixados de curta maturidade

Descrição da Operação

O FUNDO tem como objetivo proporcionar a rentabilidade de suas cotas, mediante aplicação de seus recursos em cotas de fundos de investimento que têm em sua composição 100% em Títulos Públicos Federais.

FI Cotas	Fundos Investidos
Sim	100 % BB IRF-M 1 FI RENDA FIXA CNPJ: 11.839.250/0001-36

BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP IPCA IV FI

CNPJ Fundo	Segmento	Tipo de Ativo	Data Início	Resgate	Em Enquad.	Investidor	Taxa Adm (a.a.)%	Taxa Perf (a.s.) %
19.515.015/0001-10	Renda Fixa	7°, I, b	19/02/2014	0	Não	Qualificado	0,20%	0,00%

Administrador	CNPJ Administrador	Gestor	CNPJ Gestor
BB Gestão de Recursos DTVM	30.822.936/0001-69	BB Gestão de Recursos DTVM	30.822.936/0001-70

Características dos Ativos

Aplica seus recursos em títulos públicos federais atrelados ao IPCA e/ou operações compromissadas.

Descrição da Operação

Obter rentabilidade compatível com a variação do IPCA + 6% a.a.

FI Cotas	Fundos Investidos
Não	Não aplica

BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

CNPJ Fundo	Segmento	Tipo de Ativo	Data Início	Resgate	Em Enquad.	Investidor	Taxa Adm (a.a.)%	Taxa Perf (a.s.) %
25.078.994/0001-90	Renda Fixa	7°, I, b	31/08/2016	3	Não	Geral	0,30%	0,00%

Administrador	CNPJ Administrador	Gestor	CNPJ Gestor
BB Gestão de Recursos DTVM	30.822.936/0001-69	BB Gestão de Recursos DTVM	30.822.936/0001-69

Características dos Ativos

Aplicação 100% em Títulos Públicos Pré-fixados de curta maturidade

Descrição da Operação

O FUNDO tem como objetivo proporcionar a rentabilidade de suas cotas, mediante aplicação de seus recursos em carteira composta por ativos financeiros de renda fixa, indexados a taxas prefixadas, pós-fixadas (SELIC/CDI) e/ou índices de preços (IPCA).

FI Cotas	Fundos Investidos
Sim	36,54% 11.839.250/0001-36 BB IRF-M 1 FI RENDA FIXA | 32,79% 05.949.051/0001-88 BB TOP RF AGRESSIVO PRE FI RENDA FIXA LP 30,62% 07.995.631/0001-37 BB TOP RF ÍNDICE DE PREÇO FI RENDA FIXA LP

BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B5+ TP FI

CNPJ Fundo	Segmento	Tipo de Ativo	Data Início	Resgate	Em Enquad.	Investidor	Taxa Adm (a.a.)%	Taxa Perf (a.s.) %
13.327.340/0001-73	Renda Fixa	7°, I, b	24/04/2011	2	Não	Geral	0,20%	0,00%

Administrador	CNPJ Administrador	Gestor	CNPJ Gestor
BB Gestão de Recursos DTVM	30.822.936/0001-69	BB Gestão de Recursos DTVM	30.822.936/0001-69

Características dos Ativos

Aplicação 100% em Títulos Públicos Indexados à Inflação de longa maturidade

Descrição da Operação

O FUNDO tem como objetivo proporcionar a rentabilidade de suas cotas, mediante aplicação de seus recursos em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais disponíveis no âmbito do mercado financeiro.

FI Cotas	Fundos Investidos
Não	Não aplica

DAIR - INFORMAÇÕES DE FUNDOS

BRB BLUEJAY FI EM PARTICIPAÇÕES IMOBILIÁRIO MULTIESTRATEGIA PARANÁ I

CNPJ Fundo	Segmento	Tipo de Ativo	Data Início	Resgate	Em Enquad.	Investidor	Taxa Adm (a.a.)%	Taxa Perf (a.s.) %
16.720.629/0001-46	Renda Variável	8°, IV, a	15/08/2012	3650	Não	Qualificado	0,50%	20,00%

Administrador	CNPJ Administrador	Gestor	CNPJ Gestor
BRB DTVM	33.850.686/0001-69	Bluejay Investimentos	09.722.735/0001-01

Características dos Ativos

Investe em Valores Mobiliários, voltadas para financiamento imobiliário

Descrição da Operação

Proporcionar aos cotistas, no longo prazo, a valorização do capital investido em Valores Mobiliários de emissão das companhias alvo.

FI Cotas	Fundos Investidos
Não	00/01/1900

BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TP FI

CNPJ Fundo	Segmento	Tipo de Ativo	Data Início	Resgate	Em Enquad.	Investidor	Taxa Adm (a.a.)%	Taxa Perf (a.s.) %
13.322.205/0001-35	Renda Fixa	7°, I, b	28/04/2011	1	Não	Geral	0,20%	0,00%

Administrador	CNPJ Administrador	Gestor	CNPJ Gestor
BB Gestão de Recursos DTVM	30.822.936/0001-69	BB Gestão de Recursos DTVM	30.822.936/0001-69

Características dos Ativos

Aplicação 100% em Títulos Públicos Pré-fixados de curta maturidade

Descrição da Operação

O FUNDO tem como objetivo proporcionar a rentabilidade de suas cotas, mediante aplicação de seus recursos em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais disponíveis no âmbito do mercado financeiro.

FI Cotas	Fundos Investidos
Não	Não aplica

BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC-FI

CNPJ Fundo	Segmento	Tipo de Ativo	Data Início	Resgate	Em Enquad.	Investidor	Taxa Adm (a.a.)%	Taxa Perf (a.s.) %
13.077.415/0001-05	Renda Fixa	7°, IV, a	28/04/2011	0	Não	Geral	1,00%	0,00%

Administrador	CNPJ Administrador	Gestor	CNPJ Gestor
BB Gestão de Recursos DTVM	30.822.936/0001-69	BB Gestão de Recursos DTVM	30.822.936/0001-69

Características dos Ativos

Possui seus recursos em Fis compostos por TP indexados ao CDI/SELIC e em operações compromissadas lastreadas em TP de no mínimo 80% em ativos de rentabilida

Descrição da Operação

O FUNDO tem como objetivo proporcionar a rentabilidade de suas cotas, mediante aplicação de seus recursos em cotas de fundos de investimento que atendam aos limites e garantias exigidas pela Resolução 3922/10 do CMN, doravante denominados FIs.

FI Cotas	Fundos Investidos
Sim	100% BB TOP TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS FI RENDA FIXA

BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP XI FI

CNPJ Fundo	Segmento	Tipo de Ativo	Data Início	Resgate	Em Enquad.	Investidor	Taxa Adm (a.a.)%	Taxa Perf (a.s.) %
24.117.278/0001-01	Renda Fixa	7°, I, b	14/03/2016	0	Não	Geral	0,20%	0,00%

Administrador	CNPJ Administrador	Gestor	CNPJ Gestor
BB Gestão de Recursos DTVM	30.822.936/0001-69	BB Gestão de Recursos DTVM	30.822.936/0001-69

Características dos Ativos

Aplicação 100% em Títulos Públicos Pré-fixados de curta maturidade

Descrição da Operação

O FUNDO tem como objetivo proporcionar a rentabilidade de suas cotas, mediante aplicação de seus recursos em carteira composta por ativos financeiros de renda fixa, indexados a taxas prefixadas, pós-fixadas (SELIC/CDI) e/ou índices de preços (IPCA).

FI Cotas	Fundos Investidos
Não	Não aplica

DAIR - INFORMAÇÕES DE FUNDOS

BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

CNPJ Fundo	Segmento	Tipo de Ativo	Data Início	Resgate	Em Enquad.	Investidor	Taxa Adm (a.a.)%	Taxa Perf (a.s.) %
13.077.418/0001-49	Renda Fixa	7°, IV, a	28/04/2011	0	Não	Geral	0,20%	0,00%

Administrador	CNPJ Administrador	Gestor	CNPJ Gestor
BB Gestão de Recursos DTVM	30.822.936/0001-69	BB Gestão de Recursos DTVM	30.822.936/0001-69

Características dos Ativos

Aplicação Pós Fixada ou Ativa com Mínimo 51% títulos públicos

Descrição da Operação

O FUNDO tem como objetivo proporcionar a rentabilidade de suas cotas, através da diversificação dos ativos financeiros que compõem sua carteira, mediante aplicação de seus recursos em cotas de fundos de investimento, doravante denominados FIs.

FI Cotas	Fundos Investidos
Sim	50% BB TOP RF ARROJADO FI RENDA FIXA LP 03.389.374/0001-39 50% BB TOP RF MODERADO FI RENDA FIXA LP 01.608.572/0001-10

BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FI IMOBILIÁRIO - FII

CNPJ Fundo	Segmento	Tipo de Ativo	Data Início	Resgate	Em Enquad.	Investidor	Taxa Adm (a.a.)%	Taxa Perf (a.s.) %
13.584.584/0001-31	Renda Variável	8°, IV, b	12/12/2011	9999	Não	Qualificado	1,60%	20,00%

Administrador	CNPJ Administrador	Gestor	CNPJ Gestor
Planner Corretora	00.806.535/0001-54	ZION Invest	97.543.940/0001-69

Características dos Ativos

O Fundo aplicará seus recursos preponderantemente em Ativos Imobiliários

Descrição da Operação

O Fundo tem por objeto a aquisição de ativos previstos no art. 45 da Instrução CVM 472.

FI Cotas	Fundos Investidos
Não	Não aplica

AUSTRO MULTIPAR FI EM COTA DE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO

CNPJ Fundo	Segmento	Tipo de Ativo	Data Início	Resgate	Em Enquad.	Investidor	Taxa Adm (a.a.)%	Taxa Perf (a.s.) %
18.366.002/0001-64	Renda Variável	8°, III	06/08/2013	1	Não	Qualificado	1,50%	25,00%

Administrador	CNPJ Administrador	Gestor	CNPJ Gestor
Austro Capital	14.717.397/0001.41	Austro Capital	09.442.277/0001-49

Características dos Ativos

Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento de participação.

Descrição da Operação

Consiste em alocar seu patrimônio, preferencialmente em cotas de fundos de investimento em participação, com o objetivo de tentar superar substancialmente, a variação do IPCA + 8% ao ano.

FI Cotas	Fundos Investidos
Sim	44,35% 12.231.743/0001-51 AUSTRO MULTISSETORIAL FIP | 32,86% 17.921.463/0001-99 AUSTRO FLEX FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO 11,70% 15.798.354/0001-09 LSH MULTIESTRATÉGIA FIP | 10,20% 16.617.536/0001-90 PUMA FIP

BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FI

CNPJ Fundo	Segmento	Tipo de Ativo	Data Início	Resgate	Em Enquad.	Investidor	Taxa Adm (a.a.)%	Taxa Perf (a.s.) %
10.418.335/0001-88	Renda Variável	8°, II, a	10/06/2009	4	Não	Qualificado	1,00%	0,00%

Administrador	CNPJ Administrador	Gestor	CNPJ Gestor
BB Gestão de Recursos DTVM	30.822.936/0001-70	BB Gestão de Recursos DTVM	30.822.936/0001-70

Características dos Ativos

Aplica, preponderantemente, em ações.

Descrição da Operação

Buscar rentabilidade próxima à variação do IGC - Índice de Ações com Governança Corporativa Diferenciada.

FI Cotas	Fundos Investidos
Não	Não aplica

DAIR - INFORMAÇÕES DE FUNDOS

CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI DE AÇÕES

CNPJ Fundo	Segmento	Tipo de Ativo	Data Início	Resgate	Em Enquad.	Investidor	Taxa Adm (a.a.)%	Taxa Perf (a.s.) %
14.550.994/0001-24	Renda Variável	8°, II, a	16/12/2011	4	Não	Geral	2,00%	20,00%

Administrador	CNPJ Administrador	Gestor	CNPJ Gestor
BEM DTVM	00.066.670/0001-00	Constância Investimentos	10.626.543/0001-72

Características dos Ativos
Aplica seus recursos no mercado de renda variável, podendo realizar investimentos em outras classes de ativos

Descrição da Operação
Obter rentabilidade superior à variação do Ibovespa, no médio e longo prazo.

FI Cotas	Fundos Investidos
Não	Não aplica

DAIR - APR Movimentações

	Quantidade Cotas	Movimentação (R$)	Cota (R$)	PL Fundo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC-FI				
13.077.415/0001-05				
Resgates				
23/01/2020	3.534,02721300	-R$ 7.366,35	2,0844067	R$ 1.889.913.714,66
27/01/2020	28.767,61361900	-R$ 59.978,95	2,08494701	R$ 1.792.815.455,26
30/01/2020	171.980,74277100	-R$ 358.709,90	2,085756197	R$ 1.588.151.115,90
31/01/2020	1.115,01002800	-R$ 2.325,93	2,086017113	R$ 1.500.776.659,75
Aplicações				
14/01/2020	80.678,39070000	R$ 168.011,56	2,082485267	R$ 1.761.186.617,15
15/01/2020	82.931,89006500	R$ 172.726,78	2,082754655	R$ 1.704.201.644,15
16/01/2020	24.410,14346300	R$ 50.847,55	2,083050027	R$ 1.723.919.065,38
23/01/2020	392,47139200	R$ 818,07	2,084406702	R$ 1.889.913.714,66
28/01/2020	58,60286800	R$ 122,20	2,085222177	R$ 1.906.885.418,88

DAIR - Carteira **Data-Base: 31/01/2020**

			Cotas			
Segmento	**Enquad.**	**CNPJ FUNDO**	**Qtde**	**Valor**	**PL Investido**	**PL Fundo**
			(Conferir)	(Alterar)	(Conferir)	(Alterar)
Renda Fixa	7°, I, b	10.740.658/0001-93	1.105.878,865387	3,4915090000	R$ 3.861.186,02	6.604.088.892,56
Renda Fixa	7°, IV, a	12.402.646/0001-84	1.268.493,630262	2,1581174400	R$ 2.737.558,23	35.766.477,59
Renda Fixa	7°, IV, a	07.861.554/0001-22	885.235,091971	5,4922539500	R$ 4.861.935,93	1.618.694.263,00
Renda Fixa	7°, I, b	07.111.384/0001-69	514.686,724373	5,8276551760	R$ 2.999.416,75	5.205.249.143,09
Renda Fixa	7°, I, b	11.328.882/0001-35	3.659.429,686281	2,6448330000	R$ 9.678.582,68	7.374.284.212,96
Renda Fixa	7°, I, b	19.515.015/0001-10	439.709,222611	2,1465656700	R$ 943.864,72	529.547.773,86
Renda Fixa	7°, I, b	25.078.994/0001-90	6.246.883,747207	1,4609164450	R$ 9.126.175,20	10.446.730.359,40
Renda Fixa	7°, I, b	13.327.340/0001-73	2.780.734,761259	3,4001092850	R$ 9.454.801,98	2.287.850.661,28
Renda Fixa	7°, I, b	13.322.205/0001-35	2.459.057,987278	2,6895147470	R$ 6.613.672,72	6.900.045.813,02
Renda Fixa	7°, IV, a	13.077.415/0001-05	676.248,434724	2,0860170000	R$ 1.410.567,60	1.500.776.659,75
Renda Fixa	7°, I, b	24.117.278/0001-01	373.260,480878	1,6084077360	R$ 600.355,04	198.917.349,88
Renda Fixa	7°, IV, a	13.077.418/0001-49	1.053.241,865380	2,2556950000	R$ 2.375.793,25	2.903.514.199,57
Renda Variável	8°, III	18.366.002/0001-64	1.154.557,381842	1,6481335200	R$ 1.902.864,72	96.540.658,56
Renda Variável	8°, II, a	10.418.335/0001-88	784.221,152743	3,0425568380	R$ 2.386.037,43	826.438.302,84
Renda Variável	8°, II, a	14.550.994/0001-24	2.498.473,573187	1,9556396000	R$ 4.886.113,86	323.389.730,78
Renda Variável	8°, IV, a	16.720.629/0001-46	11,331836	27.717,9142249600	R$ 314.094,87	7.670.659,88
Renda Variável	8°, IV, b	13.584.584/0001-31	800.000,000000	1,1500000000	R$ 920.000,00	204.888.764,45
		Disponibilidades			R$ 181.285,82	
TOTAL DE RECURSOS DO RPPS PARA CÔMPUTO DOS LIMITES:					**R$ 65.073.021,00**	
TOTAL DE RECURSOS DO RPPS:					**R$ 65.254.306,82**	

Informações:

A AMX CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS LTDA (“AMX Capital – Consultoria de Investimentos”) é uma consultoria de valores mobiliários com funcionamento autorizado pela Comissão de Valores Mobiliário (CVM), com especialidade no segmento previdenciário e institucional. Através do Ato Declaratório de nº 14.576, de 20 de outubro de 2015, o Superintendente de Relações com Investidores Institucionais da Comissão de Valores Mobiliários, no uso da competência que lhe foi delegada pela Deliberação CVM nº 158, de 21/07/93, autoriza a AMX CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS LTDA, C.N.P.J. nº 22.863.573/0001-81, a prestar os serviços de Consultor de Valores Mobiliários, previstos no artigo 27 da lei nº 6.385/76, de 07 de dezembro de 1976.

Fale Conosco
Rua Nereu Ramos, 942, Sala 301
Jardim Blumenau - Blumenau - SC
CEP: 89010-401
Fone: (47) 3232-2290
contato@amxcapital.com.br