

**DEPARTAMENTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO
MUNICÍPIO DE PORTO ALEGRE**

COMITÊ DE INVESTIMENTOS DO PREVIMPA

ATA Nº 09/2020

Reunião Ordinária 09/2020 - Comitê de Investimentos - PREVIMPA

Data e Hora	Local
19/05/2020- 14 horas	Rua Uruguai, 277 - 14º andar - Sala de Reuniões - PREVIMPA e plataforma "webex-cisco"
Participantes	
Rodrigo Machado Costa - Diretor Administrativo-Financeiro - Previmpa; Dalvin Gabriel José de Souza - Chefe da Unidade de Investimentos - Previmpa; Carlos Fabretti Patrício (plataforma webex) e Rogério de Oliveira - Economistas, Unidade de Investimentos - Previmpa; Giordana Zimmermann Besen - Atuára, Assessoria de Planejamento - Previmpa; Isabela Belém Meneghello - Chefe da Unidade de Gestão de Ativos Imobiliários - Previmpa; Cárin Cecília da Rosa Carvalho - Administradora - Previmpa; Christian Fouchard Justin, representante do Conselho de Administração (plataforma webex) e Roger Sotoriva Piccini - Administrador da Unidade de Investimentos - convidado	
Pauta:	
<p>1 – Informes gerais e consultoria</p> <p>2 – Apresentação dos Resultados Abril/2020</p> <p>3 – Análise e deliberação renovação credenciamento Banco Banestes (processo SEI 19.13.000002290-1) e Banestes DTVM (processo SEI 19.13.000002333-9)</p>	
Resumo da Reunião	
<p>Atendendo ao primeiro item da pauta, Sr. Rodrigo informa que está sendo designado novo representante da Procuradoria Geral do Município, em substituição à procuradora Anelise, o qual será o procurador Alexandre Fontoura Dionello, aguardando designação do Sr. Prefeito. Quanto ao contrato com consultoria Sete Capital, o mesmo encerrou em 16/05/2020, não sendo renovado. Dessa forma, as apresentações serão elaboradas através dos controles da Unidade de Investimentos. O Sr. Christian questiona se houve demanda do Conselho de Administração em relação aos resultados dos investimentos, sendo informado a todos que foi encaminhado através de processo SEI, sendo que serão anexadas a apresentação de Abril/2020 onde consta o acumulado no ano, bem como os relatórios técnicos 03/2020 da UINV, bem como emitido pela consultoria Sete Capital. Seguindo a pauta, foram apresentados os resultados dos investimentos de Abril/2020, conforme anexo a presente Ata, sendo que no mês o rendimento total da carteira foi de 2,78%, ante à meta atuarial mensal de 0,15%. No acumulado do ano, a rentabilidade da carteira é de -3,53% e a meta atuarial de 2,14%. Não havendo questionamentos, passou-se ao último tópico da pauta, sendo que os processos foram analisados previamente, sendo deliberado, unanimemente, pela renovação do credenciamento do Banco Banestes e Banestes DTVM.</p>	
Encaminhamentos	
Renovação credenciamento Banco Banestes e Banestes DTVM por 12 meses	
Pendências	



Documento assinado eletronicamente por **Rodrigo Machado Costa, Diretor Administrativo-Financeiro**, em 20/05/2020, às 14:53, conforme o art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006, e o Decreto Municipal 18.916/2015.



Documento assinado eletronicamente por **Dalvin Gabriel José de Souza, Chefe de Unidade**, em 20/05/2020, às 17:14, conforme o art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006, e o Decreto Municipal 18.916/2015.



Documento assinado eletronicamente por **Christian Fouchard Justin, Servidor Público**, em 21/05/2020, às 08:51, conforme o art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006, e o Decreto Municipal 18.916/2015.



Documento assinado eletronicamente por **Rogério de Oliveira, Economista**, em 21/05/2020, às 12:57, conforme o art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006, e o Decreto Municipal



Documento assinado eletronicamente por **Giordana Zimmermann Besen, Atuário**, em 29/05/2020, às 14:11, conforme o art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006, e o Decreto Municipal 18.916/2015.



Documento assinado eletronicamente por **Carlos Fabretti Patrício, Economista**, em 29/05/2020, às 16:52, conforme o art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006, e o Decreto Municipal 18.916/2015.



Documento assinado eletronicamente por **Isabela Belém Meneghello, Chefe de Unidade**, em 15/06/2020, às 17:38, conforme o art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006, e o Decreto Municipal 18.916/2015.



Documento assinado eletronicamente por **Carin Cecília da Rosa Carvalho, Administrador(a)**, em 23/06/2020, às 16:42, conforme o art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006, e o Decreto Municipal 18.916/2015.



A autenticidade do documento pode ser conferida no site <http://sei.procempa.com.br/autenticidade/seipmpa> informando o código verificador **10391175** e o código CRC **BA47AD6F**.

Relatório Analítico dos Investimentos

em abril de 2020

Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.



Carteira consolidada de investimentos - base (Abril / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
TÍTULOS PÚBLICOS			1.981.789.822,57	75,34%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	54.006.030,13	2,05%	743	0,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	16.817.469,97	0,64%	1.251	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	17.952.182,58	0,68%	333	1,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	30.044.657,43	1,14%	958	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	24.816.222,77	0,94%	1.370	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	D+1	Não há	380.719,07	0,01%	789	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	34.889.488,01	1,33%	883	0,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
MIRAE ASSET PRÉ FUNDO DE ÍNDICE RENDA FIXA - FIX...	D+2	Não há	12.962.941,92	0,49%	522	8,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	455.983,92	0,02%	677	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	8.565.223,58	0,33%	317	1,48%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	6.862.578,67	0,26%	746	0,42%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	D+3	Não há	52.708.500,00	2,00%	11.738	0,83%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVA11	D+3	Não há	81.763.500,00	3,11%	101.466	0,68%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '
ISHARES BM&FBOVESPA SMALL CAP FUNDO DE ÍNDICE - ...	D+3	Não há	39.425.850,80	1,50%	38.546	2,80%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	54.973.984,93	2,09%	2.563	8,77%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB VALE FI AÇÕES	D+4	Não há	16.712.375,17	0,64%	32.614	2,65%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	13.815.917,65	0,53%	33.869	1,64%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	20.917.023,87	0,80%	475	6,69%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES	D+3 du	Não há	16.347.982,14	0,62%	20.855	4,57%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

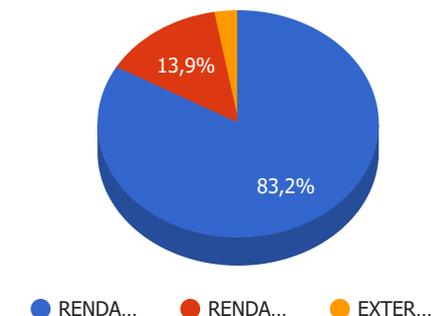
Carteira consolidada de investimentos - base (Abril / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	13.376.539,57	0,51%	9.427	3,62%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC ...	D+34	Não há	13.863.234,79	0,53%	277	10,93%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
IT NOW IDIV FUNDO DE ÍNDICE - DIVO11	D+3	Não há	25.247.903,00	0,96%	9.642	10,98%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MUL...	D+2	01/10/2020	11.710.777,10	0,45%	956	2,31%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	D+4	Não há	74.246.373,84	2,82%	94	6,91%	Artigo 9º - A, Inciso III
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	D+31	0	5.721.045,77	0,22%	22	12,49%	Desenquadrado - RV
Total para cálculo dos limites da Resolução			2.630.374.329,25				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Abril / 2020)

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	1.981.789.822,57	75,34%	0,00%	70,00%	100,00%	648.584.506,68
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	178.906.769,96	6,80%	0,00%	2,00%	100,00%	2.451.467.559,29
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	12.962.941,92	0,49%	0,00%	0,00%	100,00%	2.617.411.387,33
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	0,00%	0,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	60,00%	1.578.224.597,55
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	1.578.224.597,55
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	15.883.786,17	0,60%	0,00%	1,00%	40,00%	1.036.265.945,53
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	1.052.149.731,70
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	526.074.865,85
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	394.556.149,39
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	394.556.149,39
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	131.518.716,46
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	131.518.716,46
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	131.518.716,46
Total Renda Fixa	100,00%	2.189.543.320,62	83,24%	0,00%	78,00%	565,00%	

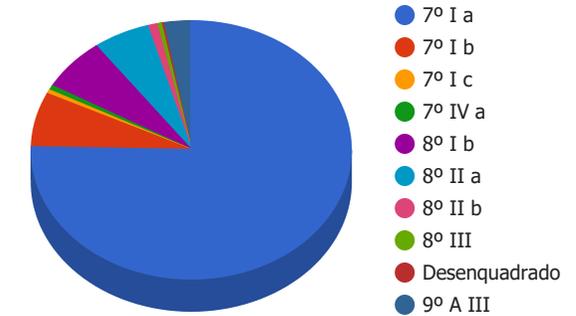
Distribuição por Segmento



Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Abril / 2020)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	30,00%	789.112.298,78
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	173.897.850,80	6,61%	0,00%	6,00%	30,00%	615.214.447,98
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	150.007.058,12	5,70%	0,00%	6,00%	20,00%	376.067.807,73
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	25.247.903,00	0,96%	0,00%	2,00%	20,00%	500.826.962,85
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	11.710.777,10	0,45%	0,00%	2,00%	10,00%	251.326.655,83
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	131.518.716,46
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	131.518.716,46
Desenquadrado - RV	0,00%	5.721.045,77	0,22%	0,00%	0,00%	0,00%	-5.721.045,77
Total Renda Variável	30,00%	366.584.634,79	13,94%	0,00%	21,00%	120,00%	

Distribuição por Artigos



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	74.246.373,84	2,82%	0,00%	1,00%	10,00%	188.791.059,09
Total Exterior	10,00%	74.246.373,84	2,82%	0,00%	1,00%	10,00%	

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P/BM&F Índice de Futuros DI 3 anos ER (Benchmark)	-2,56%	-22,40%	-18,83%	-22,98%	-15,90%	-17,33%	-	-
MIRAE ASSET PRÉ FUNDO DE ÍNDICE RENDA FIXA - FIXA11	1,65%	4,27%	3,01%	4,11%	15,14%	-	0,07%	0,04%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,57%	0,57%	0,03%	1,79%	8,62%	18,84%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,32%	-0,34%	-0,72%	1,02%	6,95%	16,67%	0,03%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,43%	0,02%	-0,44%	1,13%	7,34%	17,02%	0,03%	0,03%
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	0,50%	0,19%	-0,34%	1,18%	7,58%	17,19%	0,03%	0,03%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,45%	1,88%	1,44%	2,65%	6,60%	13,72%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,41%	1,79%	1,37%	2,51%	6,31%	13,19%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,43%	1,82%	1,39%	2,55%	6,39%	13,32%	0,00%	0,00%
BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,42%	1,81%	1,38%	2,54%	6,37%	13,24%	0,01%	0,00%
CDI (Benchmark)	0,28%	1,30%	0,92%	2,07%	5,19%	11,87%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00%	0,79%	0,42%	1,46%	4,46%	10,92%	0,00%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,20%	0,95%	0,67%	1,54%	4,07%	9,49%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,22%	1,02%	0,72%	1,65%	4,31%	10,01%	0,00%	0,00%
IPCA (Benchmark)	-0,31%	0,22%	0,01%	1,89%	2,40%	7,46%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1,11%	2,43%	1,60%	2,52%	13,47%	24,61%	0,05%	0,04%

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

Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
-----	-----	----	----	-----	-----	---------	------------------

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDIV (Benchmark)	3,76%	-28,65%	-27,50%	-19,68%	-7,18%	10,38%	-	-
IT NOW IDIV FUNDO DE ÍNDICE - DIVO11	3,86%	-28,67%	-27,53%	-19,71%	-7,42%	10,13%	0,20%	0,31%
Ibovespa (Benchmark)	10,25%	-30,39%	-29,23%	-24,92%	-16,45%	-6,51%	-	-
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVA11	10,23%	-30,39%	-29,22%	-24,88%	-16,50%	-6,75%	0,23%	0,35%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES	16,56%	-13,98%	-17,97%	3,05%	23,66%	38,05%	0,20%	0,37%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	10,49%	-29,74%	-30,52%	-20,71%	-4,10%	12,34%	0,24%	0,38%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	9,48%	-32,48%	-31,54%	-26,34%	-18,11%	-8,19%	0,21%	0,37%
BB VALE FI AÇÕES	3,56%	-17,44%	-12,42%	-4,67%	-11,18%	-8,07%	0,21%	0,23%
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	-8,17%	-37,16%	-34,96%	-36,97%	-37,62%	-20,80%	0,17%	0,28%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,25%	1,41%	1,09%	2,61%	7,30%	-	0,00%	0,01%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	12,64%	-27,85%	-30,07%	-19,61%	-	-	0,24%	-
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	10,25%	-30,38%	-29,22%	-24,85%	-16,42%	-6,29%	0,23%	0,35%
SMLL (Benchmark)	10,19%	-34,07%	-34,37%	-21,91%	-4,59%	5,90%	-	-
ISHARES BM&FBOVESPA SMALL CAP FUNDO DE ÍNDICE - SMAL11	10,09%	-34,04%	-34,30%	-21,98%	-5,03%	5,11%	0,24%	0,43%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	16,41%	-24,59%	-26,09%	-18,98%	-3,08%	16,50%	0,25%	0,40%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	8,83%	-28,58%	-29,34%	-18,63%	-4,61%	11,58%	0,18%	0,36%

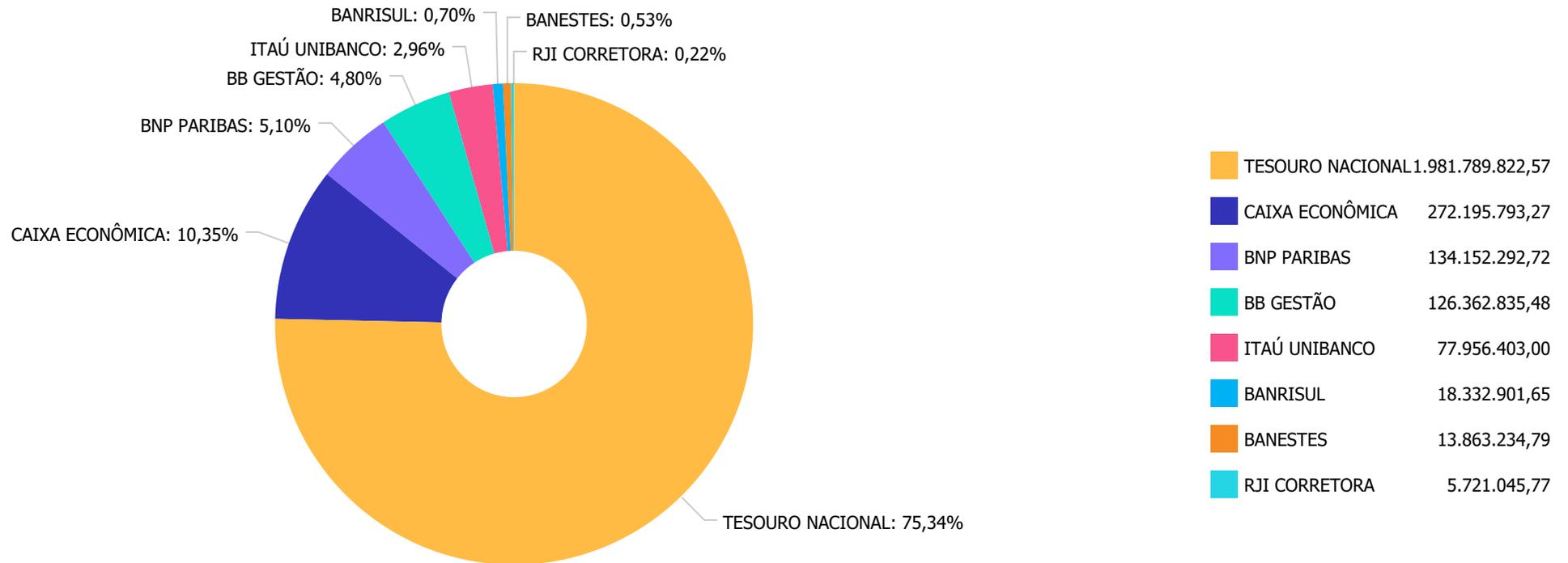
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Abril/2020 - RENDA VARIÁVEL

Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
-----	-----	----	----	-----	-----	---------	------------------

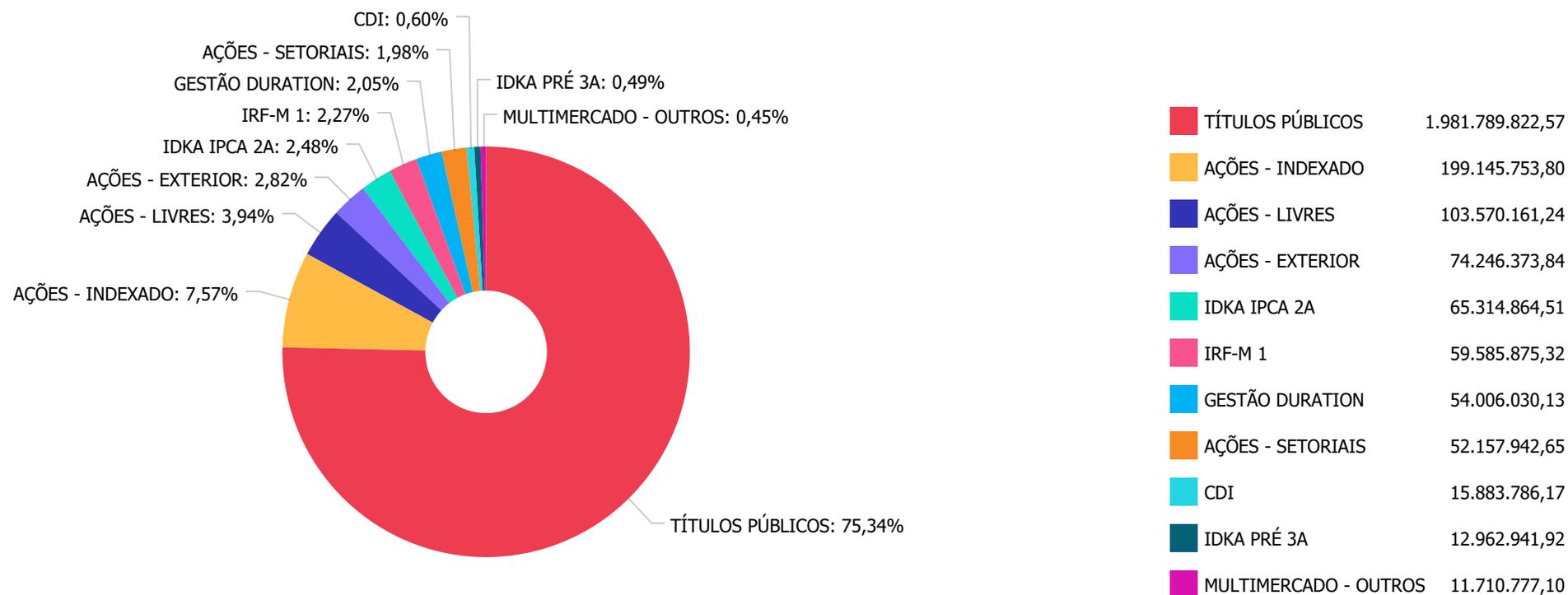
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Abril/2020 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	16,32%	23,16%	15,68%	32,24%	39,49%	79,08%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	15,96%	23,85%	16,27%	32,52%	39,65%	76,46%	0,17%	0,22%

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



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



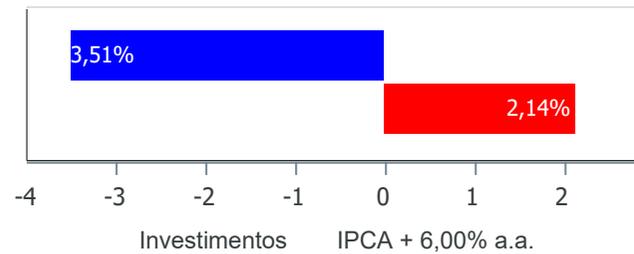
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Abril / 2020)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
LTN - Letra do Tesouro Nacional	01/01/2022	21/03/2018	80.000	727,418914	941,714758	58.193.513,12	75.337.180,64	Mercado
LTN - Letra do Tesouro Nacional	01/01/2022	09/04/2018	200.000	732,978346	941,714758	146.595.669,20	188.342.951,60	Mercado
LTN - Letra do Tesouro Nacional	01/04/2022	07/02/2020	160.000	898,51867100	928,181583	143.762.987,36	148.509.053,28	Mercado
LTN - Letra do Tesouro Nacional	01/07/2022	26/06/2019	120.000	825,383252	914,012162	99.045.990,24	109.681.459,44	Mercado
LTN - Letra do Tesouro Nacional	01/07/2023	14/06/2019	190.000	753,636224	846,250038	143.190.882,56	160.787.507,22	Mercado
LTN - Letra do Tesouro Nacional	01/01/2024	03/01/2020	200.000	787,45838900	811,682048	157.491.677,80	162.336.409,60	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2028	06/06/2019	20.000	3.820,891426	3.904,711533	76.417.828,52	78.094.230,66	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2028	06/06/2019	30.000	3.820,891426	3.904,711533	114.626.742,78	117.141.345,99	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2028	06/06/2019	20.000	3.820,891426	3.904,711533	76.417.828,52	78.094.230,66	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2023	17/10/2017	50.000	1.051,661907	1.155,548839	52.583.095,35	57.777.441,95	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2023	13/10/2017	50.000	1.052,640809	1.155,548839	52.632.040,45	57.777.441,95	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2023	10/10/2017	25.000	1.050,747229	1.155,548839	26.268.680,73	28.888.720,98	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2025	14/11/2018	50.000	1.037,699013	1.174,224265	51.884.950,65	58.711.213,25	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2025	14/11/2018	140.000	1.038,996258	1.174,224265	145.459.476,12	164.391.397,10	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2025	13/10/2017	60.000	1.049,132984	1.174,224265	62.947.979,04	70.453.455,90	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2027	20/05/2019	100.000	1.092,532528	1.177,697376	109.253.252,80	117.769.737,60	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2029	25/05/2019	50.000	1.094,981011	1.183,446326	54.749.050,55	59.172.316,30	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2029	01/08/2019	60.000	1.192,017651	1.183,446326	71.521.059,06	71.006.779,56	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2029	12/11/2019	10.000	1.254,155389	1.183,446326	12.541.553,89	11.834.463,26	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2029	08/11/2019	140.000	1.257,994167	1.183,446326	176.119.183,38	165.682.485,64	Mercado

Retorno e Meta Atuarial 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	2.632.923.382,27	697.509.577,57	691.667.390,65	2.658.338.535,94	19.572.966,75	19.572.966,75	0,74%	0,74%	0,72%	0,72%	102,87%	5,63%
Fevereiro	2.658.338.535,94	439.877.375,00	413.872.045,09	2.655.747.844,38	-28.596.021,47	-9.023.054,72	-1,07%	-0,33%	0,67%	1,39%	-23,78%	10,80%
Março	2.655.747.844,38	119.956.504,87	102.310.509,49	2.518.534.593,44	-154.859.246,32	-163.882.301,04	-5,79%	-6,10%	0,58%	1,98%	-307,95%	36,14%
Abril	2.518.534.593,44	48.557.850,91	21.394.435,51	2.616.000.808,08	70.302.799,24	-93.579.501,80	2,76%	-3,51%	0,15%	2,14%	-164,29%	15,06%

Investimentos x Meta Atuarial



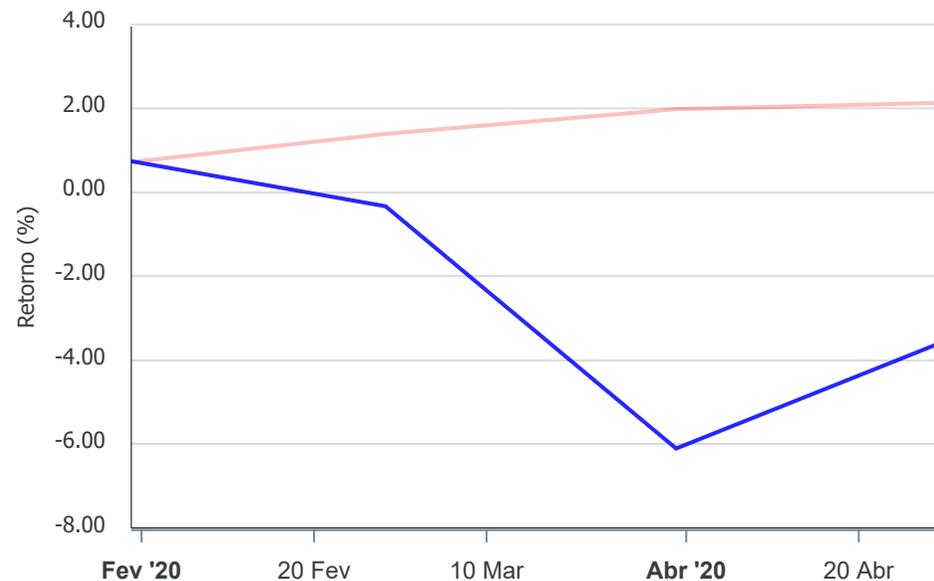
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- Investimentos Meta Atuarial CDI IMA-B IMA-B 5
- IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1 IRF-M 1+
- Ibovespa IBX SMLL IDIV

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
MIRAE ASSET PRÉ FUNDO DE ÍNDICE RENDA FIXA - FIXA1...	12.752.894,25	0,00	0,00	12.962.941,92	210.047,67	1,65%	1,65%	6,53%
TÍTULOS PÚBLICOS	1.953.808.470,55	0,00	0,00	1.981.789.822,57	27.981.352,02	1,43%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	53.412.463,42	0,00	0,00	54.006.030,13	593.566,71	1,11%	1,11%	4,96%
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	378.843,03	0,00	0,00	380.719,07	1.876,04	0,50%	0,50%	2,88%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	29.917.266,32	0,00	0,00	30.044.657,43	127.391,11	0,43%	0,43%	2,75%
BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	17.877.446,16	0,00	0,00	17.952.182,58	74.736,42	0,42%	0,42%	0,51%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	34.776.913,89	0,00	0,00	34.889.488,01	112.574,12	0,32%	0,32%	2,68%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	0,00	16.766.212,00	0,00	16.817.469,97	51.257,97	0,31%	0,41%	0,49%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	0,00	24.743.356,93	0,00	24.816.222,77	72.865,84	0,29%	0,43%	0,49%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	7.077.895,77	5.518.437,75	4.047.294,53	8.565.223,58	16.184,59	0,13%	0,22%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.790.753,95	11.833.259,16	18.779.005,83	6.862.578,67	17.571,39	0,07%	0,20%	0,01%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	455.968,06	0,00	0,00	455.983,92	15,86	0,00%	0,00%	0,45%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	7.792.293,70	0,00	7.791.352,33	0,00	-941,37	-0,01%	0,26%	0,12%
Total Renda Fixa	2.132.041.209,10	58.861.265,84	30.617.652,69	2.189.543.320,62	29.258.498,37	1,35%		2,69%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES	14.024.939,25	0,00	0,00	16.347.982,14	2.323.042,89	16,56%	16,56%	20,20%
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇ...	11.909.160,30	0,00	0,00	13.863.234,79	1.954.074,49	16,41%	16,41%	25,34%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	48.805.587,90	0,00	0,00	54.973.984,93	6.168.397,03	12,64%	12,64%	24,36%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	12.106.124,72	0,00	0,00	13.376.539,57	1.270.414,85	10,49%	10,49%	23,51%
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	47.833.500,00	0,00	0,00	52.708.500,00	4.875.000,00	10,19%	10,25%	22,79%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	19.105.338,09	0,00	0,00	20.917.023,87	1.811.685,78	9,48%	9,48%	21,11%
ISHARES BM&FBOVESPA SMALL CAP FUNDO DE ÍNDICE - SM...	36.022.117,60	0,00	0,00	39.425.850,80	3.403.733,20	9,45%	10,09%	23,67%
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVA11	74.823.000,00	0,00	0,00	81.763.500,00	6.940.500,00	9,28%	10,23%	22,79%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	12.695.103,16	0,00	0,00	13.815.917,65	1.120.814,49	8,83%	8,83%	18,12%
IT NOW IDIV FUNDO DE ÍNDICE - DIVO11	24.347.276,40	0,00	0,00	25.247.903,00	900.626,60	3,70%	3,86%	19,77%
BB VALE FI AÇÕES	16.137.130,45	0,00	0,00	16.712.375,17	575.244,72	3,56%	3,56%	21,14%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	11.681.707,92	0,00	0,00	11.710.777,10	29.069,18	0,25%	0,25%	0,38%
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	6.229.917,77	0,00	0,00	5.721.045,77	-508.872,00	-8,17%	-8,17%	17,18%
Total Renda Variável	335.720.903,56	0,00	0,00	366.584.634,79	30.863.731,23	9,19%		21,77%

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

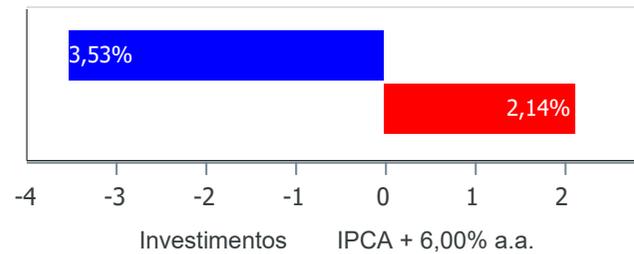
FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	64.024.921,97	0,00	0,00	74.246.373,84	10.221.451,87	15,96%	15,96%	16,55%
Total Renda Variável	64.024.921,97	0,00	0,00	74.246.373,84	10.221.451,87	15,96%		16,55%

Retorno e Meta Atuarial 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	2.613.148.416,16	693.886.550,38	678.067.286,86	2.648.507.119,14	19.539.439,46	19.539.439,46	0,74%	0,74%	0,72%	0,72%	103,07%	5,79%
Fevereiro	2.648.507.119,14	433.429.794,92	410.102.357,43	2.643.210.831,75	-28.623.724,88	-9.084.285,42	-1,07%	-0,34%	0,67%	1,39%	-24,11%	11,21%
Março	2.643.210.831,75	113.058.545,97	97.319.261,32	2.504.079.437,53	-154.870.678,87	-163.954.964,29	-5,82%	-6,14%	0,58%	1,98%	-309,77%	37,95%
Abril	2.504.079.437,53	25.931.227,92	1.360.955,34	2.598.911.970,47	70.262.260,36	-93.692.703,93	2,78%	-3,53%	0,15%	2,14%	-165,28%	15,82%

Investimentos x Meta Atuarial



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



ANO 36M

Investimentos Meta Atuarial 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 Atuarial CDI IMA-B IMA-B 5

IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1 IRF-M 1+

Ibovespa IBX SMLL IDIV

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
MIRAE ASSET PRÉ FUNDO DE ÍNDICE RENDA FIXA - FIXA1...	12.752.894,25	0,00	0,00	12.962.941,92	210.047,67	1,65%	1,65%	6,53%
TÍTULOS PÚBLICOS	1.953.808.470,55	0,00	0,00	1.981.789.822,57	27.981.352,02	1,43%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	53.412.463,42	0,00	0,00	54.006.030,13	593.566,71	1,11%	1,11%	4,96%
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	378.843,03	0,00	0,00	380.719,07	1.876,04	0,50%	0,50%	2,88%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	29.917.266,32	0,00	0,00	30.044.657,43	127.391,11	0,43%	0,43%	2,75%
BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	17.877.446,16	0,00	0,00	17.952.182,58	74.736,42	0,42%	0,42%	0,51%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	34.776.913,89	0,00	0,00	34.889.488,01	112.574,12	0,32%	0,32%	2,68%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	0,00	24.743.356,93	0,00	24.816.222,77	72.865,84	0,29%	0,43%	0,49%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	519.204,99	428.443,41	436.453,25	512.408,62	1.213,47	0,13%	0,22%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	434.141,33	759.427,58	924.502,09	270.504,82	1.438,00	0,12%	0,20%	0,01%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	455.968,06	0,00	0,00	455.983,92	15,86	0,00%	0,00%	0,45%
Total Renda Fixa	2.104.333.612,00	25.931.227,92	1.360.955,34	2.158.080.961,84	29.177.077,26	1,37%		3,13%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES	14.024.939,25	0,00	0,00	16.347.982,14	2.323.042,89	16,56%	16,56%	20,20%
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇ...	11.909.160,30	0,00	0,00	13.863.234,79	1.954.074,49	16,41%	16,41%	25,34%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	48.805.587,90	0,00	0,00	54.973.984,93	6.168.397,03	12,64%	12,64%	24,36%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	12.106.124,72	0,00	0,00	13.376.539,57	1.270.414,85	10,49%	10,49%	23,51%
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	47.833.500,00	0,00	0,00	52.708.500,00	4.875.000,00	10,19%	10,25%	22,79%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	19.105.338,09	0,00	0,00	20.917.023,87	1.811.685,78	9,48%	9,48%	21,11%
ISHARES BM&FBOVESPA SMALL CAP FUNDO DE ÍNDICE - SM...	36.022.117,60	0,00	0,00	39.425.850,80	3.403.733,20	9,45%	10,09%	23,67%
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVA11	74.823.000,00	0,00	0,00	81.763.500,00	6.940.500,00	9,28%	10,23%	22,79%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	12.695.103,16	0,00	0,00	13.815.917,65	1.120.814,49	8,83%	8,83%	18,12%
IT NOW IDIV FUNDO DE ÍNDICE - DIVO11	24.347.276,40	0,00	0,00	25.247.903,00	900.626,60	3,70%	3,86%	19,77%
BB VALE FI AÇÕES	16.137.130,45	0,00	0,00	16.712.375,17	575.244,72	3,56%	3,56%	21,14%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	11.681.707,92	0,00	0,00	11.710.777,10	29.069,18	0,25%	0,25%	0,38%
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	6.229.917,77	0,00	0,00	5.721.045,77	-508.872,00	-8,17%	-8,17%	17,18%
Total Renda Variável	335.720.903,56	0,00	0,00	366.584.634,79	30.863.731,23	9,19%		21,77%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	64.024.921,97	0,00	0,00	74.246.373,84	10.221.451,87	15,96%	15,96%	16,55%
Total Renda Variável	64.024.921,97	0,00	0,00	74.246.373,84	10.221.451,87	15,96%		16,55%