


CONVOCAÇÃO

A Presidente do **Conselho Administrativo** do SANTAFÉPREV – Instituto Municipal de Previdência Social de Santa Fé do Sul, com base na Lei Municipal nº 3.104, de 14 de agosto de 2013, **CONVOCA**, para o Dia 11/12/2020, às 14h, na sala de Reuniões do Santaféprev, sito a Rua 07, nº 1.167, Centro, nesta Cidade, os membros do **Conselho de Administração**, para uma **REUNIÃO ORDINÁRIA** para tratar dos seguintes assuntos:

- 1 - Comparativo das Aplicações Financeiras Outubro-Novembro/2020;
- 2 - Extrato de Ativos pela Consultoria Financeira Novembro/2020;
- 3 – Outros assuntos.

Estância Turística de Santa Fé do Sul, 10 de Dezembro de 2020.



Fernanda Eloisa da Silva
Presidente do Conselho
CGRPPS nº 3.174



INSTITUTO MUNICIPAL DE
PREVIDÊNCIA SOCIAL
ESTÂNCIA TURÍSTICA DE SANTA FÉ DO SUL
"CADA VEZ MAIS PREZANTE. CUIDANDO DO FUTURO DE NOSSOS SERVIDORES!"

SANTAFÉPREV

Instituto Municipal de Previdência Social

CONVOCAÇÃO – REUNIÃO 11/12/2020

MEMBROS

Andressa Evangelista de Alencar Rezende
Membro
CGRPPS nº 1.120

José André do Nascimento
Membro
CGRPPS nº 3.007

Edna Mara da Silva Ferreira
Membro
CGRPPS nº 3.673

ATA DE REUNIÃO ORDINÁRIA DO CONSELHO DE ADMINISTRAÇÃO DO SANTAFÉPREV – INSTITUTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA SOCIAL.

Aos (11) onze dias do mês de dezembro de 2020, na sala de Reuniões do Santaféprev, sito a Rua 07, nº 1.167, Centro, nesta Cidade, com início às 16h, realizou-se a **OCTAGÉSIMA NONA** reunião do Conselho de Administração conjunta com o Conselho Fiscal, Comitê de Investimento e o Sr. Adriano César Calenti – Controlador Interno do Município, atendendo solicitação do Sr. Ronaldo da Silva Salvini, Diretor Presidente do Santaféprev. Na oportunidade verificou-se a presença dos seguintes Conselheiros: Andressa Evangelista de Alencar Rezende, Edna Mara da Silva Ferreira, José André do Nascimento e Fernanda Eloisa da Silva, e a presença de Antonio Elpidio Prado, Diretor Financeiro e Ronaldo da Silva Salvini, Diretor Presidente. Havendo quórum dos Conselheiros, a Presidente do Conselho iniciou os trabalhos, convidando a Sra. Edna Mara da Silva Ferreira para secretariá-la. Inicialmente agradeceu a presença de todos, apresentando a pauta de trabalho do dia: **1 - Comparativo das Aplicações Financeiras Outubro-Novembro/2020; 2 - Extrato de Ativos pela Consultoria Financeira Novembro/2020; 3 Outros assuntos.** O presidente do Santaféprev a pedido da Presidente do Conselho iniciou sua apresentação. **Item 1** - Informou que no fechamento de novembro de 2020, o saldo financeiro foi de R\$ 78.772.885,39 (setenta e oito milhões, setecentos e setenta e sete mil, oitocentos e oitenta e cinco reais e trinta e nove centavos), apresentando uma valorização de R\$ 1.442.056,08 (um milhão, quatrocentos e quarenta e dois mil, cinquenta e seis reais e oito centavos) em relação ao mês de outubro de 2020. **Item 2** – Apresentou a rentabilidade da carteira do Santaféprev que até o mês de Novembro de 2020, foi de **2,97%**, sendo que a meta atuarial foi de **8,73%**, havendo, portanto, uma rentabilidade de **-5,77%** abaixo da meta atuarial, conforme extrato consolidado de ativos da LDB Empresas de Consultoria Financeira. **Item 3** – Referente aos débitos da parte patronal da Prefeitura Municipal, foi aprovado a Lei Municipal nº 4.053, de 25 de novembro de 2020, que suspende recolhimento das contribuições previdenciárias patronais no período de 1º de março a 31 de dezembro de 2020, e o mesmo dispositivo autorizou o acordo de parcelamento em 60 (sessenta) meses, que deverá ser realizado até 31 de janeiro de 2021. Aproveito a oportunidade e peço licença aos nobres membros deste conselho, para me despedir da presidência deste Instituto Municipal de Previdência Social – SANTAFÉPREV, já formalizei minha solicitação de desligamento do cargo em comissão de Diretor Presidente a partir de 31 de dezembro de 2020, retornando para meu cargo de origem de Oficial Administrativo, padrão 21-J, junto ao Quadro de Pessoal do Instituto Municipal de Previdência Social – SANTAFÉPREV, conforme Portaria nº 578, de 19 de novembro de 2020. Nesses oito anos à frente desta autarquia, tenho que agradecer a cada um dos servidores e conselheiros que participaram de nossa Gestão, iniciamos nossos desafios juntos, uma carteira de investimentos de aproximadamente de




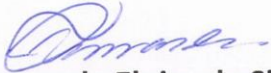
INSTITUTO MUNICIPAL DE
PREVIDÊNCIA SOCIAL
ESTÂNCIA TURÍSTICA DE SANTA FÉ DO SUL
"CADA VEZ MAIS PRESIDENTE... CUIDANDO DO FUTURO DE Nossos SERVIDORES!"

SANTA FÉ PREV

Instituto Municipal de Previdência Social

15 (quinze) milhões de reais, com vários desenquadramentos perante a legislação vigente. Mas depois de todo esse período, temos a alegria de deixarmos uma autarquia estruturada, com servidores qualificados e altamente técnicos e um conselho capacitado e certificado para poderem discutir e melhorar a cada dia a gestão de nosso instituto. Com alegria e com a sensação de dever cumprido, entregamos nosso Instituto com uma carteira de investimento enquadrada conforme Resolução CNM nº 3922/2010 e com um patrimônio de 80 (oitenta) milhões de reais. Também deixamos encaminhado para próxima Gestão estudo atuarial referente aos impactos da Reforma da Previdência, Convênio do Pró-Gestão e Estudo ALM – Asset Liability Management. Fica aqui meus sinceros agradecimentos a todos que participaram direta ou indiretamente nesse período todo de nossa gestão. E desejo ao novo(a) gestor(a) muito sucesso, que possa dar continuidade aos desafios que serão apresentados e também que traga a tecnologia a favor da informação e da gestão deste conceituado Regime Próprio de Previdência Social. Obrigado. Obrigado. Finalizo desejando a todos um Feliz Natal e um 2021 de esperança, fé, saúde, prosperidade e vida. **NADA MAIS** havendo a tratar, a Presidente do Conselho declarou encerrada a reunião, precisamente às 15h, e para constar, eu (Edna Mara da Silva Ferreira) Secretária eleita, digitei a presente ata que é assinada por mim e pelo Presidente.


Edna Mara da Silva Ferreira
Secretária
CGRPPS nº 3.673


Fernanda Eloisa da Silva
Presidente do Conselho
CGRPPS nº 3.174



INSTITUTO MUNICIPAL DE
PREVIDÊNCIA SOCIAL
ESTÂNCIA TURÍSTICA DE SANTA FÉ DO SUL
"CADA VEZ MAIS PREZENTE, CUIDANDO DO FUTURO DE Nossos SERVIDORES!"

SANTAFÉPREV

Instituto Municipal de Previdência Social

PARECER DO CONSELHO ADMINISTRATIVO

O **Conselho Administrativo** do Santaféprev – Instituto Municipal de Previdência Social de Santa Fé do Sul, com base no artigo 105 e 106, da Lei Municipal nº 3.104, de 14/08/2013, reuniu nesta data para tratar de assuntos relacionados nos itens 1 a 3 da pauta de convocação e outros assuntos da ordem geral.

Após análise dos mesmos, julgou-se regulares e satisfatórias os assuntos relacionados nos itens 1 ao 3.

Estância Turística de Santa Fé do Sul, 11 de Dezembro de 2020.

Fernanda Eloisa da Silva
Presidente do Conselho
CGRPPS nº 3.174

José André do Nascimento
Membro
CGRPPS nº 3.007

Andressa Evangelista de Alencar Rezende
Membro
CGRPPS nº 1.120

Edna Mara da Silva Ferreira
Membro
CGRPPS nº 3.673



Cada vez mais presente, cuidando do futuro de todos os brasileiros.

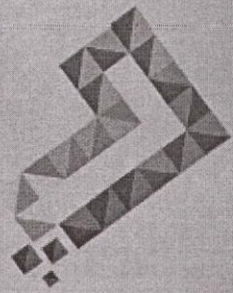
POSIÇÃO DOS INVESTIMENTOS

COMPARATIVO BIMESTRAL: OUTUBRO-NOVEMBRO /2020

DENOMINAÇÃO DO FUNDO	INICIO APLICAÇÃO	CNPJ	Resgate	OUTUBRO	%	NOVEMBRO	%	DIFERENÇA	COTAS 31-10	COTAS 30-11	% REMT.
RENDA FIXA - ART. 7º - INCISO I, "B" - L 100% - PI 75%											
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M1 TP	24/02/2015	11.328.882/0001-35	D+1	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	2.71127	2.71127	0,00
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA (APORTE)	22/02/2019	25.078.994/0001-90	D+1	16.277.746,26	21,23	16.415.773,53	21,15	138.027,27	1.47980	1.49235	0,85
BB PREVIDENCIÁRIO TP PCA II	06/02/2014	19.303.794/0001-90	D+1	-	0,00	-	0,00	0,00	0,00000	0,00000	0,00
BB PREVID IMA-B TP	23/01/2020	07.442.078/0001-05	D+1	7.797.137,97	10,17	7.952.546,10	10,24	155.408,13	6.11772	6.29966	1,99
FI CAIXA BRASIL IRFM 1 TP RF	06/02/2014	10.740.670/0001-06	D+1	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	2.59999	2.59999	0,00
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	28/11/2019	23.215.097/0001-55	D+0	10.040.087,56	13,09	10.122.414,45	13,04	82.326,89	1.48247	1.49463	0,82
CAIXA FI BRASIL IMA GERAL TP RF LP	28/11/2019	11.061.217/0001-28	D+0	10.303.257,08	13,44	10.374.981,54	13,37	71.724,46	2.98801	2.91818	0,70
CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	24/01/2020	10.740.658/0001-93	D+0	12.891.632,79	16,81	13.147.980,52	16,94	256.347,73	3.45480	3.52350	1,99
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	20/05/2013	11.060.913/0001-10	D+1	13.819.019,02	18,02	13.986.986,86	18,03	177.967,84	3.13081	3.17113	1,29
**SANTANDER IMA-B TIT. PUB. (RESERVA TAXA-ADM.)	02/10/2011	11.180.607/0001-17	D+1	201.764,89	0,27	205.714,93	0,27	3.950,04	352.72694	359.63242	1,96
SUB-TOTAL				71.330.645,97	95,02	73.764.227,30	93,03	887.958,21	887.958,21	887.958,21	0,00
RENDA FIXA - ART. 7º - INCISO III "A" - L 80% - PI 10%											
**FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RF LP	14/12/2011	11.902.276/0001-81	D+730	335.007,86	0,44	335.242,15	0,43	234,29	0,60	0,60	0,07
SUB-TOTAL				335.007,86	0,44	335.242,15	0,43	234,29	0,60	0,60	0,07
RENDA FIXA - ART. 7º - INCISO IV "A" - L 30% - PI 30%											
SANTANDER FI COTAS EM FI INSTITUCIONAL RF REF DI	18/04/2018	02.224.354/0001-45	D+0	1.210.615,66	1,58	1.212.587,22	1,56	1.971,56	186.07952	186.38257	0,16
SUB-TOTAL				1.210.615,66	1,58	1.212.587,22	1,56	1.971,56	186.07952	186.38257	0,16
RENDA FIXA - ART. 7º - INCISO VII, "A" - L 5% - PI 3%											
**FIDC TRENDBANK BANCO DE FOMENTO MULTISECTORIAL	02/05/2011	08.927.488/0001-09	2019	-	0,00	-	0,00	0,00	0,00000	0,00000	0,00
SUB-TOTAL				0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00000	0,00000	0,00
TOTAL RENDA FIXA				72.876.269,09	95,03	73.764.227,30	93,03	887.958,21	887.958,21	887.958,21	0,00
RENDA VARIÁVEL - ART. 8º - INCISO II "A" - L 15% - PI 2%											
**4JUM SMALL CAPS FIA (ANTIGA J MALUCELU)	03/02/2011	09.550.197/0001-07	D+20	495.635,53	0,65	548.984,58	0,71	53.349,05	3.91080	4.33175	10,76
SUB-TOTAL				495.635,53	0,65	548.984,58	0,71	53.349,05	3.91080	4.33175	10,76
RENDA VARIÁVEL - ART. 8º - INCISO IV "A" - L 5% - PI 5%											
**FI EM PARTICIPAÇÕES FP2 (FUNDO ROMA)	14/12/2010	20.886.575/0001-60	D+1440	2.644.252,12	3,45	2.644.070,84	3,41	-181,28	93.359.89075	93.353.49030	-0,01
**FOCO CONQUEST FIP	29/11/2011	10.625.626/0001-47	2017	670.359,30	0,87	667.615,96	0,86	-2.743,34	6.62450	6.59739	-0,41
SUB-TOTAL				3.314.611,42	4,32	2.992.686,80	4,27	-321.924,62	99.989.341	99.950.229	-0,04
TOTAL RENDA VARIÁVEL				3.810.246,95	4,97	3.860.671,38	4,97	50.424,43	50.424,43	50.424,43	0,07
SAUDO CONTA CORRENTE				644.313,27		1.147.986,71		503.673,44			
TOTAL GERAL				77.330.829,31	100,00	78.772.885,39	101,48	1.442.056,08	1.442.056,08	1.442.056,08	1,86

BANCO	OUTUBRO		NOVEMBRO	
	VALOR	%	VALOR	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	47.053.596,45	60,85	47.642.363,37	60,48
BANCO DO BRASIL	24.074.884,23	31,13	24.368.319,63	30,93
BANCO SANTANDER	1.412.380,55	1,83	1.212.587,22	1,54
**GESTÃO ANTERIOR	4.347.019,70	5,62	4.401.628,46	5,59
DISPONIBILIDADES	644.313,27	0,83	1.147.986,71	1,46
TOTALS	77.532.594,20	100,26	78.772.885,39	100,00

Assinaturas manuscritas em azul.

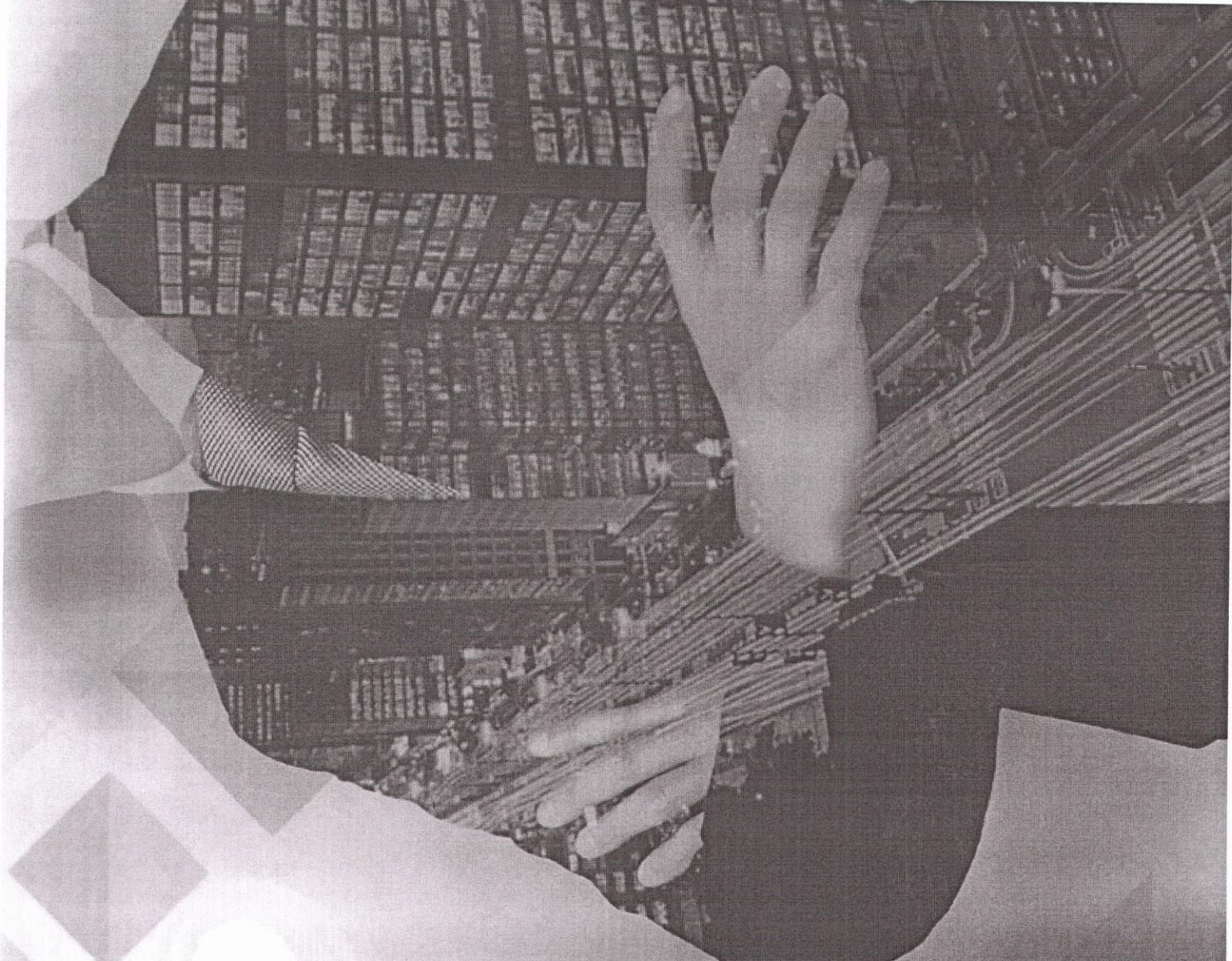


LDDB

EMPRESAS

SANTA FÉ DO SUL
NOVEMBRO 2020

[Handwritten signatures and initials]



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 11.12.2020.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.



Handwritten signatures and initials in blue ink, including a large stylized signature, a smaller signature, and the initials 'LDB'.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

 RENDA FIXA 95,03%

Artigo 7º I, Alinea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC IMA B TP RF	12,83	1,96	0,71	205.714,93	0,27	15.270.679,06	1,35
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,79	1,99	1,07	7.952.546,10	10,24	5.721.224.105,90	0,14
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,85	1,99	0,92	13.147.980,52	16,94	5.938.047.265,27	0,22
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,53	0,70	2,66	10.374.981,54	13,37	1.160.833.344,04	0,89
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,04	1,29	5,82	13.996.986,86	18,03	19.732.912.783,40	0,07
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,28	0,85	2,65	16.415.773,53	21,15	9.499.641.282,04	0,17
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,97	0,82	5,27	10.122.414,45	13,04	14.161.450.965,39	0,07
Sub-total Artigo 7º I, Alinea b			7,65	1,24	3,19	72.216.397,93	93,03		

Artigo 7º IV, Alinea a (Fundos de Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,37	0,16	1,56	1.212.587,22	1,56	1.764.091.252,64	0,07
BRZ	INTRADER	FI RECUPERACAO BR RF LONGO PRAZO	15,89	0,07	11,30	335.242,15	0,43	79.221.840,75	0,42
Sub-total Artigo 7º IV, Alinea a			2,57	0,14	3,49	1.547.829,37	1,99		

Artigo 7º VII, Alinea a (Cota Sênior de FIDC)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRPP	BRPP	FIDC TRENBANK B.F. MULT-SEN 2	146,11	0,00	-83,89	0,00	0,00	0,00	
Sub-total Artigo 7º VII, Alinea a			146,11	0,00	-100,00	0,00	0,00		
Renda Fixa			7,45	1,22	3,22	73.764.227,30	95,03		



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

4,97%

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
4UM	BEM	4UM SMALL CAPS FIA	34,95	10,76	-9,15	548.984,58	0,71	209.682.985,02	0,26
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			34,95	10,76	-9,15	548.984,58	0,71		

Artigo 8º IV, Alínea a (Fundos de Participações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CABEDAL	CABEDAL	FP2 FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES	0,04	-0,01	-0,03	2.644.070,84	3,41	1.470.213.909,47	0,18
FOCO	FOCO	FOCO CONQUEST FIEM PARTICIPAÇÕES	0,52	-0,41	-0,38	667.615,96	0,86	159.721.488,04	0,42
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			0,11	-0,09	-0,10	3.311.686,80	4,27		

Renda Variável e Investimentos Estruturados

			4,44	1,32	-1,50	3.860.671,38	4,97		
--	--	--	------	------	-------	--------------	------	--	--

Total

			7,20	1,22	2,97	77.624.898,68	100,00		
--	--	--	------	------	------	---------------	--------	--	--



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Limite Legal
				Mínimo	Objetivo	Máximo	
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alinea b	Fundos 100% Títulos Públicos	72.216.397,93	93,03	0,00	75,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alinea a	Fundos de Renda Fixa	1.547.829,37	1,99	0,00	17,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alinea a	Cota Sênior de FIDC	0,00	0,00	0,00	1,00	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	73.764.227,30	95,03				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alinea a	Fundos de Ações	548.984,58	0,71	0,00	1,00	20,00	20,00
Artigo 8º IV, Alinea a	Fundos de Participações	3.311.686,80	4,27	0,00	5,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	3.860.671,38	4,97				



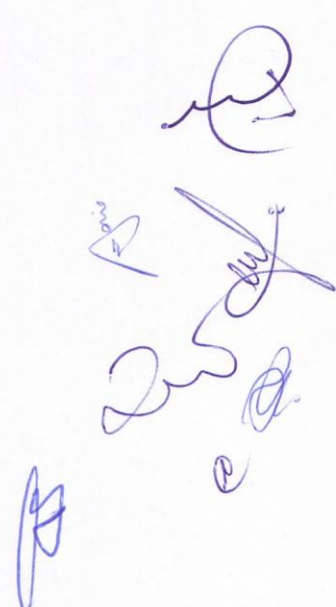
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,24 830,66	3,19 123,26	0,48 103,49	3,16 305,11	3,99 134,03	885.752,36	2.169.133,19
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,00 0,00	-0,49 -18,88	0,00 0,00	0,00 0,00	-8,48 -285,21	0,00	-1.559,88
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,14 95,47	3,49 134,90	0,30 65,56	0,90 87,13	3,58 120,44	2.205,85	60.222,34
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	0,00 0,00	-100,00 -3.862,34	0,00 0,00	0,00 0,00	-100,00 -3.363,04	0,00	-571,29
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	10,76 -5,14	-9,15 -3,31	6,11 -3,48	16,81 -7,78	7,44 6,83	53.349,05	-55.263,06
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,09 -15,99	-0,10 5,74	-0,12 -9,70	-0,13 -24,72	-0,11 -0,72	-2.924,62	-3.337,84
SANTA FÉ DO SUL (Total)						938.382,64	2.168.623,46

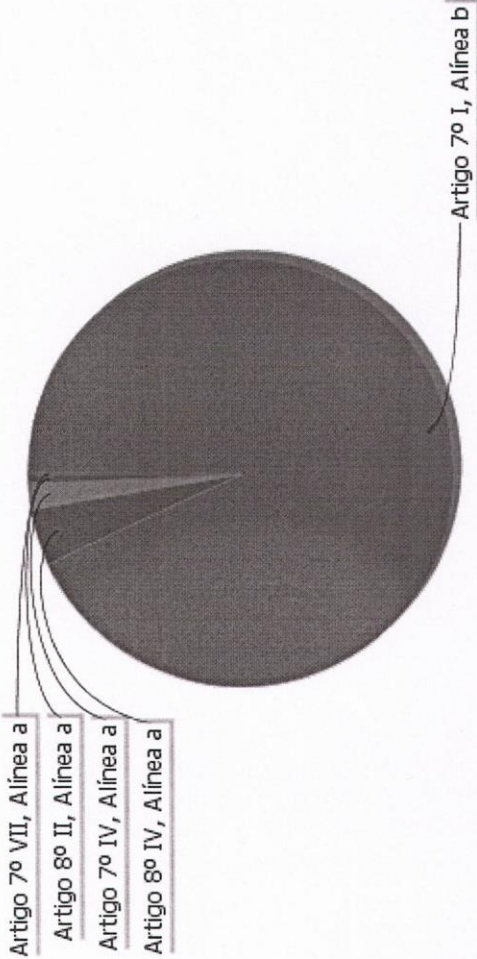
Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	73.977.969,73	95,30	73.977.969,73	95,30
de 31 a 364 dias	0,00	0,00	73.977.969,73	95,30
acima de 365 dias	3.646.928,95	4,70	77.624.898,68	100,00



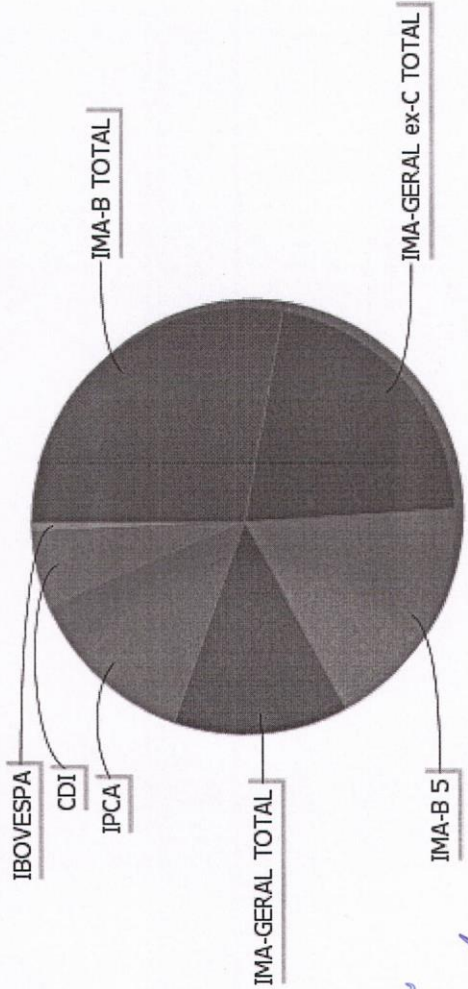
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



- Artigo 7º I, Alínea b: 93.03%
- Artigo 8º IV, Alínea a: 4.27%
- Artigo 7º IV, Alínea a: 1.99%
- Artigo 8º II, Alínea a: 0.71%
- Artigo 7º VII, Alínea a: 0.00%

Alocação Por Estratégia

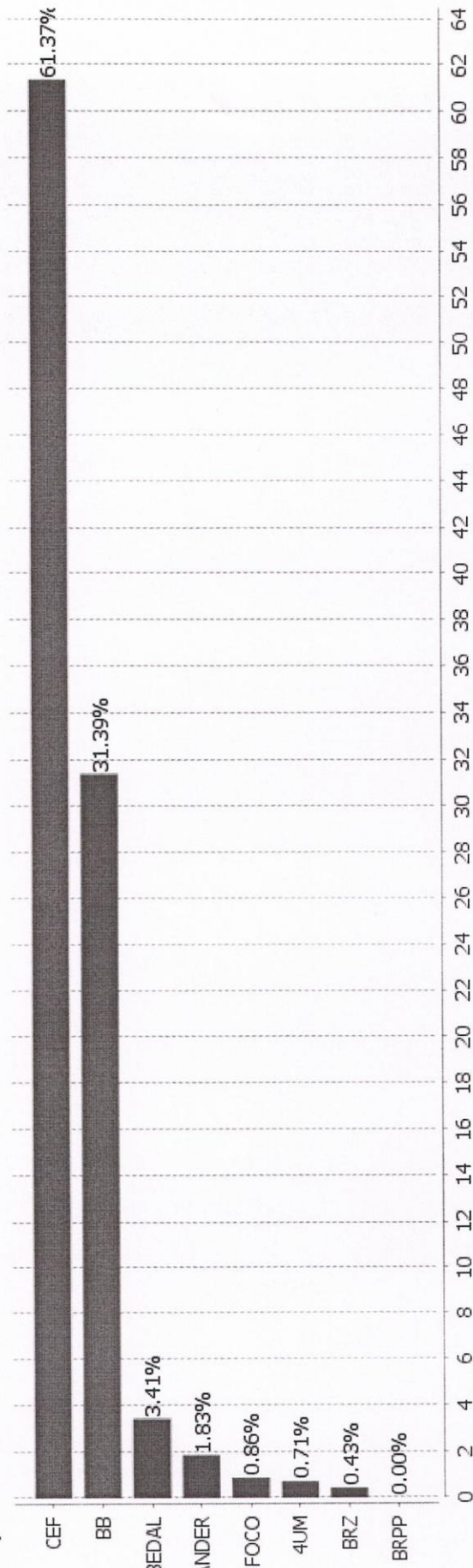


- IMA-B TOTAL: 27.88%
- IMA-GERAL ex-C TOTAL: 21.15%
- IMA-B 5: 18.03%
- IMA-GERAL TOTAL: 13.37%
- IPCA: 13.04%
- CDI: 5.83%
- IBOVESPA: 0.71%

[Handwritten signatures in blue ink]

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2020	0,49	0,43	-3,19	0,91	1,36	1,24	2,14	-0,83	-0,79	0,06	1,22	0,82	2,97
IPCA + 6%	0,72	0,67	0,58	0,15	0,08	0,75	0,90	0,73	1,13	1,35	1,36	1,64	8,73
p.p. indexador	-0,23	-0,24	-3,77	0,75	1,28	0,49	1,24	-1,56	-1,92	-1,29	-0,13	-0,83	-5,77
2019	0,87	0,45	0,52	0,69	1,00	1,11	0,78	0,30	1,02	1,04	-0,40	0,82	8,48
IPCA + 6%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	0,04	-0,44	-0,68	-0,37	0,36	0,66	0,05	-0,32	0,57	0,40	-1,37	-0,83	-2,11
2018	0,55	0,52	0,76	-0,10	-0,35	0,25	0,80	0,23	0,57	1,39	0,43	0,73	5,94
IPCA + 6%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
p.p. indexador	-0,25	-0,22	0,19	-0,81	-1,24	-1,50	-0,04	-0,21	-0,36	0,43	0,18	0,12	-3,98

PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

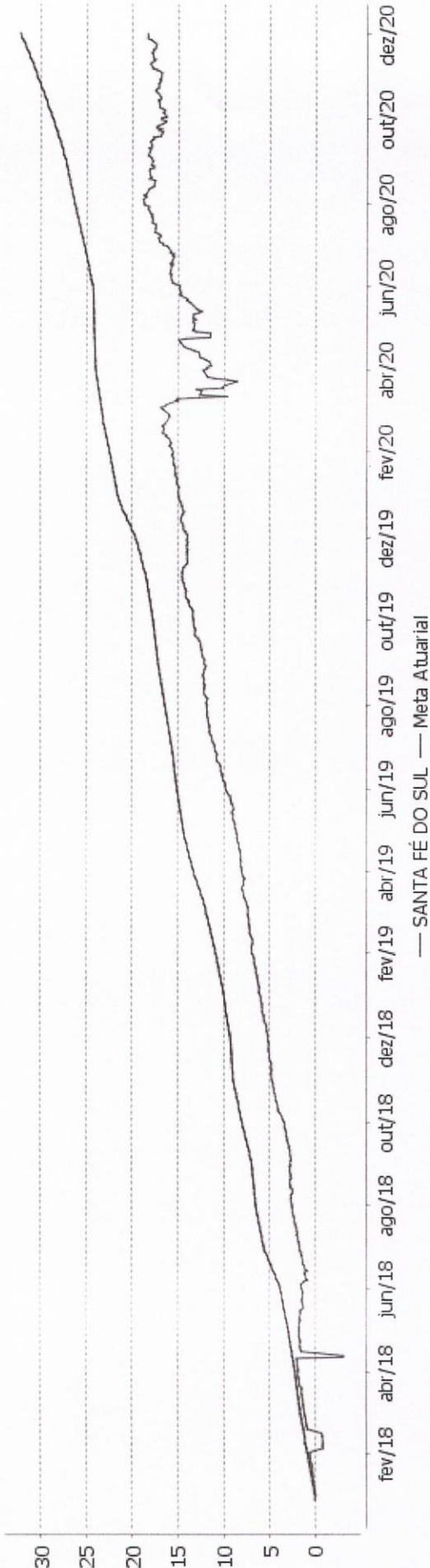
RELATÓRIO TRIMESTRAL

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	14	40,00	03 meses	0,49	3,89	-3,40	3,66
Meses abaixo da Meta Atuarial	21	60,00	06 meses	3,04	6,37	-3,33	3,41
			12 meses	3,81	10,52	-6,71	7,20
			24 meses	12,52	20,99	-8,46	5,13
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	2,14	2020-07					
Menor rentabilidade da Carteira	-3,19	2020-03	Desde 29/12/2017	18,33	32,18	-13,84	6,03

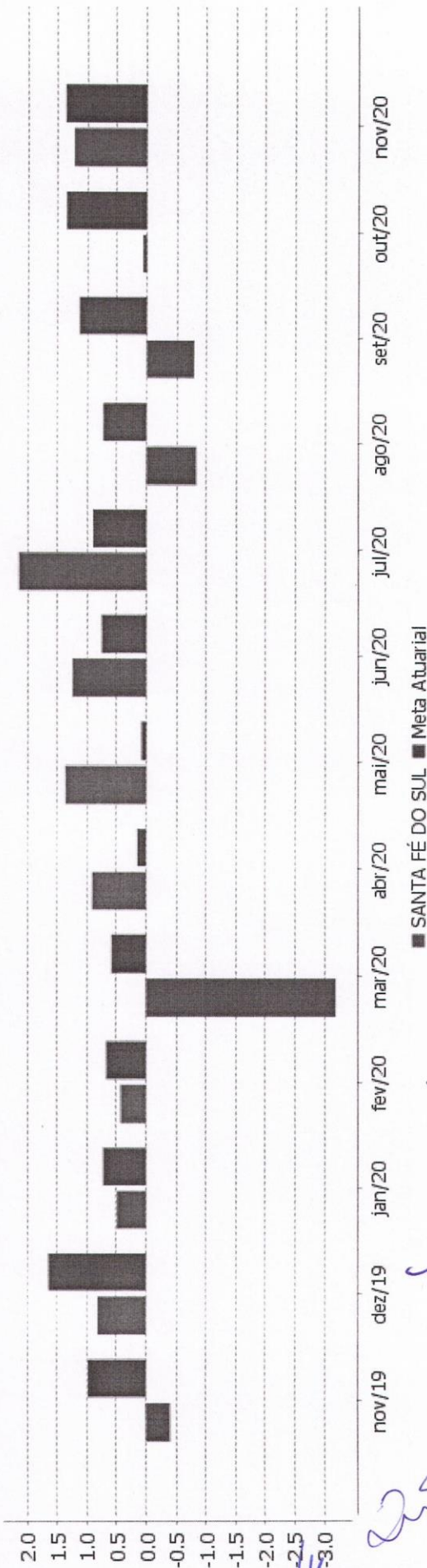



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



[Handwritten signatures and initials in blue ink]

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

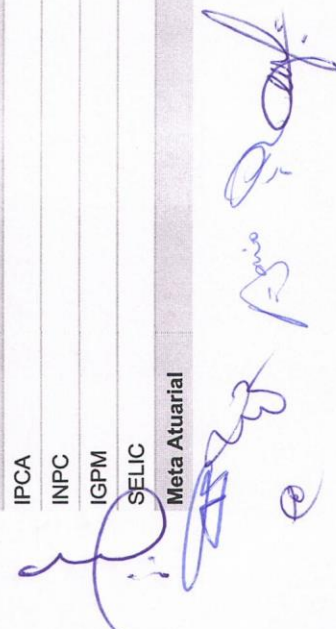
Fundo	Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,99	1,17	0,62	5,19	3,18	26,04	41,07
Var. IMA-B TOTAL p.p.		-0,01	-0,32	-0,05	-0,12	-0,34	-0,79	-1,17
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,29	5,82	1,31	3,83	7,10	21,07	32,11
Var. IMA-B 5 p.p.		-0,03	-0,28	-0,09	-0,16	-0,31	-0,62	-0,96
SANTANDER FIC IMA B TP RF		1,96	0,71	0,53	4,98	2,67	25,01	39,43
Var. IMA-B TOTAL p.p.		-0,04	-0,77	-0,14	-0,33	-0,84	-1,82	-2,80
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		0,85	2,65	0,02	1,84	3,63	17,42	28,71
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.		0,15	-0,02	0,04	-0,02	0,03	0,43	0,61
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,82	5,27	0,20	1,37	5,90	24,20	33,20
Var. IPCA p.p.		-0,07	2,15	-2,20	-1,92	1,59	16,47	21,12
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI		1,99	1,24	0,60	5,13	3,24	26,17	41,14
Var. IMA-B TOTAL p.p.		-0,01	-0,24	-0,07	-0,18	-0,27	-0,66	-1,09
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,70	2,66	0,11	1,93	3,59	16,65	27,52
Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.		-0,04	-0,59	-0,11	-0,42	-0,59	-1,20	-1,79
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2		0,00	-83,89	0,00	0,00	-87,46	-97,89	-99,15
% do CDI		0,00	-3.240,31	0,00	0,00	-2.941,19	-1.059,41	-608,07
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI		0,16	1,82	0,39	0,95	2,20	8,28	15,18
% do CDI		108,94	70,26	84,85	91,57	73,83	89,62	93,13
FI RECUPERACAO BR RF LONGO PRAZO		0,07	11,30	-0,02	0,41	2,36	-31,84	-51,67
Var. IMA-B TOTAL p.p.		-1,93	9,81	-0,69	-4,90	-1,16	-58,66	-93,90
4UM SMALL CAPS FIA		10,76	-9,15	6,11	16,81	7,44	52,46	71,14
Var. IBOVESPA p.p.		-5,14	-3,31	-3,48	-7,78	6,83	30,80	19,84
FOCO CONQUEST FIE M PARTICIPAÇÕES		-0,41	-0,38	-0,50	-0,61	-0,41	-0,78	-0,20
% do CDI		-273,75	-14,64	-107,85	-58,66	-13,67	-8,42	-1,20
FP2 FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES		-0,01	-0,03	-0,02	-0,01	-0,04	-0,13	-0,20
% do CDI		-4,59	-1,17	-4,49	-0,69	-1,24	-1,45	-1,20
SANTA FÉ DO SUL		1,22	2,97	0,49	3,04	3,81	12,52	16,31
Var. IPCA + 6% p.p.		-0,13	-5,77	-3,40	-3,33	-6,71	-8,46	-8,46
CDI		0,15	2,59	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
IBOVESPA		15,90	-5,84	9,58	24,59	0,61	21,66	51,30
INPC + 6%		1,42	9,58	4,22	6,96	11,46	22,12	33,99
IPCA + 6%		1,36	8,73	3,89	6,37	10,52	20,99	33,37



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Renda Fixa							
IRF-M 1	0,23	3,52	0,54	1,19	3,95	11,13	18,89
IRF-M 1+	0,46	5,24	-1,06	0,29	6,00	22,54	36,94
IRF-M TOTAL	0,36	4,65	-0,53	0,58	5,30	19,04	31,44
IMA-B 5	1,32	6,10	1,40	3,99	7,41	21,69	33,06
IMA-B 5+	2,59	-1,87	0,14	6,53	0,68	30,33	48,80
IMA-B TOTAL	2,00	1,48	0,67	5,31	3,52	26,83	42,23
IMA-C TOTAL	1,94	23,44	7,90	19,17	23,94	48,54	75,37
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,70	2,67	-0,02	1,86	3,60	17,00	28,09
IMA-GERAL TOTAL	0,73	3,25	0,22	2,35	4,17	17,84	29,30
IDKA 2	1,25	6,77	1,31	4,33	8,05	20,89	32,56
IDKA 20	3,37	-8,22	-0,40	9,06	-4,60	35,17	60,63
CDI	0,15	2,59	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
Renda Variável							
IBOVESPA	15,90	-5,84	9,58	24,59	0,61	21,66	51,30
IBRX 100	15,46	-5,18	9,57	25,07	1,72	24,85	55,25
IBRX 50	16,21	-5,30	10,24	25,90	0,92	19,73	48,77
SMALL CAP	16,64	-7,60	7,78	33,38	4,09	49,24	69,17
IFIX	1,51	-12,17	0,95	5,68	-2,83	22,09	26,91
Índice Consumo - ICON	8,93	-3,98	1,63	18,62	3,72	48,84	43,97
Índice Dividendos - IDIV	14,40	-9,12	9,82	21,30	-0,05	32,77	60,52
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,89	3,13	2,41	3,29	4,31	7,73	12,09
INPC	0,95	3,93	2,73	3,87	5,20	8,74	12,61
IGPM	3,28	21,97	11,24	18,66	24,52	29,46	41,99
SELIC	0,15	2,59	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
Meta Atuarial							



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
-----	------	-------	-----------	---------	------------	------------

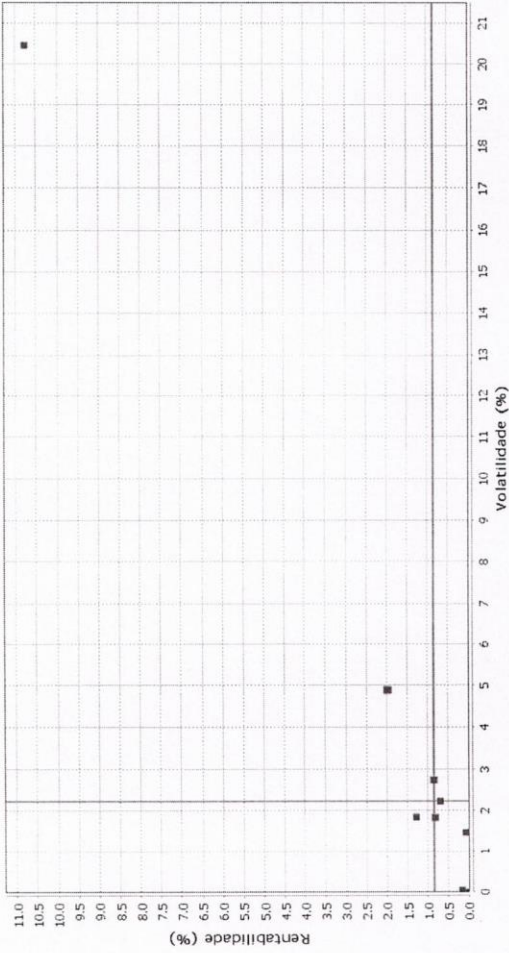
Total



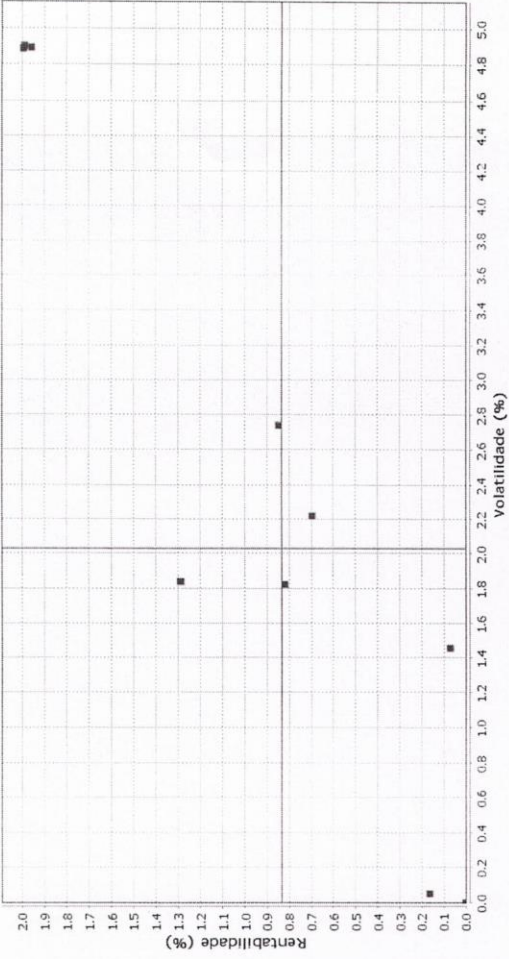
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

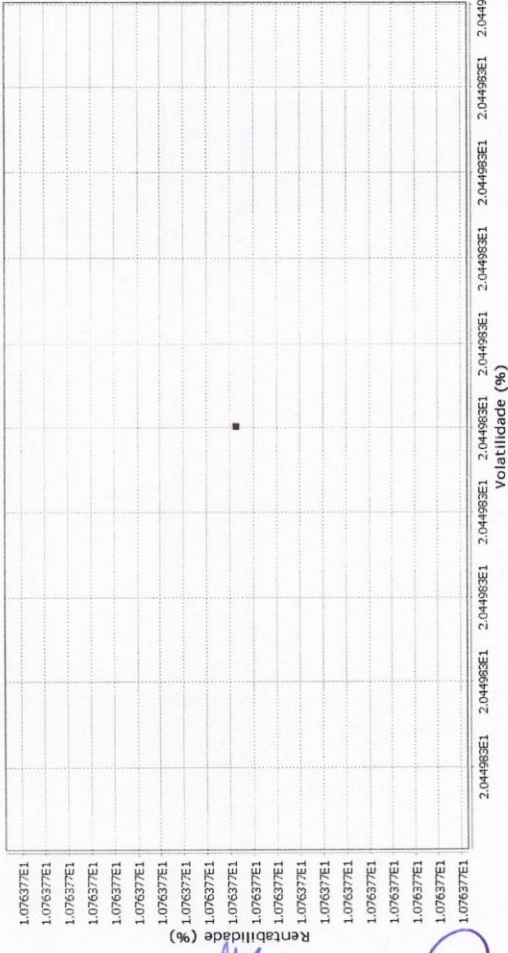
SANTA FÉ DO SUL - No Mês



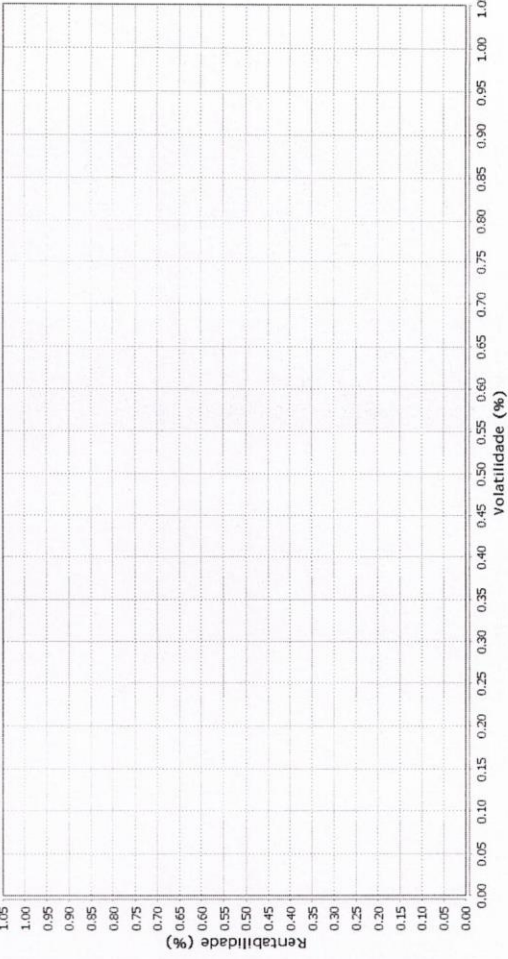
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Horizonte: 21 dias / Nivel de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 1.166.741,64

Value-At-Risk: 1,50%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	Artigo 7º VII, Alinea a	0,00	NaN	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alinea a	0,05	0,10	0,00	0,26	0,16	1.212.587,22	1,56
FI RECUPERACAO BR RF LONGO PRAZO	Artigo 7º IV, Alinea a	1,46	0,38	0,00	-0,05	0,07	335.242,15	0,43
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alinea b	1,82	1,23	0,15	0,37	0,82	10.122.414,45	13,04
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alinea b	1,84	1,03	0,16	0,62	1,29	13.996.986,86	18,03
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alinea b	2,22	1,12	0,15	0,25	0,70	10.374.981,54	13,37
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alinea b	2,74	1,33	0,28	0,25	0,85	16.415.773,53	21,15
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alinea b	4,89	2,66	0,27	0,38	1,99	7.952.546,10	10,24
SANTANDER FIC IMA B TP RF	Artigo 7º I, Alinea b	4,89	2,66	0,01	0,37	1,96	205.714,93	0,27
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alinea b	4,90	2,67	0,45	0,38	1,99	13.147.980,52	16,94
4UM SMALL CAPS FIA	Artigo 8º II, Alinea a	20,45	10,66	0,04	0,52	10,76	548.984,58	0,71




EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

Observar que no respectivo mês, novembro de 2020:

- O Instituto possui 21,15% dos seus recursos alocados no fundo BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI, percentual este superior ao permitido pela Resolução 3.922 de 25 de novembro de 2010.



Assinatura