

RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

OUTUBRO/2020



1 CARTEIRA FUNDO PREVIDENCIÁRIO
CAPITALIZADO

2 DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO
FINANCEIRA

3 DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO

4 DISTRIBUIÇÃO POR NÍVEL DE RISCO

5 DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICE DE
REFERÊNCIA

6 POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

7 DISTRIBUIÇÃO POR TIPO DE ATIVO

8 RENTABILIDADES E PERFORMANCE

9 EVOLUÇÃO PATRIMONIAL

10 RERNDIMENTOS MENSAIS

11 COMPARATIVO VOLUME ANBIMA

12 MOVIMENTAÇÕES DE RECURSOS

A carteira do Fundo Previdenciário Capitalizado do Instituto de Previdência dos Servidores do Município de Jaboatão dos Guararapes – JABOATÃO PREV, fechou o mês de outubro/2020 com um patrimônio de R\$ 354.493.029,63. Como pode ser observado na **Tabela 1**, esse valor está distribuído em 25 fundos de investimentos, sendo 22 do segmento de renda fixa com 91,64% do patrimônio e 3 fundos do segmento de renda variável, representando 8,36% do patrimônio. No mesmo período, o total de disponibilidade financeira foi de R\$ 10.702,08.

Tabela 1

Fundo	Administrador	Índice de Referência	Classificação de Risco (1 a 5)	% PL JABOATÃO PREV	% PL Fundo Investido	Valor (R\$)	Rentabilidade mensal	Rentabilidade anual
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	IMA-B	5,00	0,98%	0,26%	R\$ 3.468.034,60	0,18%	-0,87%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	IMA Geral	3,00	1,60%	1,07%	R\$ 5.686.415,83	0,02%	1,65%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	IRF-M	5,00	9,12%	0,67%	R\$ 32.331.085,67	-0,31%	3,99%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	IMA-B	2,00	0,08%	0,12%	R\$ 276.960,68	0,49%	3,15%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	IMA GERAL EX-C	5,00	0,92%	0,03%	R\$ 3.253.899,83	-0,07%	1,78%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	IRFM-1	1,00	18,81%	0,85%	R\$ 66.675.992,05	0,11%	2,94%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	IDKA IPCA 2A	1,00	8,10%	0,40%	R\$ 28.703.353,81	0,33%	4,89%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	IMA-B	5,00	1,98%	0,13%	R\$ 7.028.459,82	0,20%	-0,73%

Fundo	Administrador	Índice de Referência	Classificação de Risco (1 a 5)	% PL JABOATÃOPREV	% PL Fundo Investido	Valor (R\$)	Rentabilidade mensal	Rentabilidade anual
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	IMA-B 5	1,00	10,78%	0,87%	R\$ 38.201.081,89	0,19%	4,50%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC	BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	IPCA	3,00	0,49%	0,09%	R\$ 1.727.991,35	-0,07%	2,82%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	IRF-M 1+	3,00	4,33%	0,49%	R\$ 15.345.333,81	-0,56%	4,57%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	IMA-B 5	3,00	5,67%	0,11%	R\$ 20.111.664,88	0,18%	4,48%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	IRFM-1	2,00	5,65%	0,18%	R\$ 20.037.777,60	0,14%	3,11%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	IPCA	3,00	10,39%	0,27%	R\$ 36.849.238,63	-0,11%	4,42%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	IMA-B	3,00	6,16%	0,38%	R\$ 21.823.728,30	0,19%	-0,81%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	IMA B	4,00	1,25%	2,61%	R\$ 4.421.823,31	-0,54%	-1,53%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	IMA-B 5+	3,00	2,68%	0,53%	R\$ 9.515.886,83	0,22%	-4,61%

1.1

RENTA FIXA

Tabela 1

Fundo	Administrador	Índice de Referência	Classificação de Risco (1 a 5)	% PL JABOATÃOPREV	% PL Fundo Investido	Valor (R\$)	Rentabilidade mensal	Rentabilidade anual
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	IRF-M	3,00	1,18%	0,05%	R\$ 4.172.567,98	-0,36%	4,04%
BBIF MASTER FIDC LP	SANTANDER CACEIS (GRUPO SANTANDER)	CDI	5,00	0,22%	3,40%	R\$ 790.295,52	-0,45%	9,90%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	RJI CORRETORA DE VALORES	IRF-M	5,00	0,85%	10,72%	R\$ 3.012.500,43	0,04%	-5,25%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	RJI CORRETORA DE VALORES	IMA-B 5	5,00	0,11%	0,57%	R\$ 385.890,67	-0,30%	-19,69%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	RJI CORRETORA DE VALORES	IMA-B 5	5,00	0,29%	0,40%	R\$ 1.036.246,46	-0,08%	-34,66%
Renda Fixa				91,64%		R\$ 324.856.229,93		

1.2

RENTA VARIÁVEL

Tabela 1

Fundo	Administrador	Índice de Referência	Classificação de Risco (1 a 5)	% PL JABOATÃOPREV	% PL Fundo Investido	Valor (R\$)	Rentabilidade mensal	Rentabilidade anual
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA BRASIL IBX-50	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	IBRX-50	4,00	8,13%	2,77%	R\$ 28.826.083,81	-0,87%	-19,55%
GERAÇÃO DE ENERGIA FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTIESTRATÉGIA	BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A.	IPCA+ 10,50%	5,00	0,01%	0,39%	R\$ 32.322,56	-0,44%	-83,79%
HAZ FII - ATCR11	RJI CORRETORA DE VALORES	CDI	5,00	0,22%	1,07%	R\$ 767.691,24	-0,29%	2,24%
Renda Variável				8,36%		R\$ 29.626.097,62		

Banco	Saldo	
CC 22484-7 - BANCO DO BRASIL	R\$	753,19
CC 71747-9 - BANCO DO BRASIL	R\$	727,72
CC 00000040-6 CAIXA ECONOMICA	R\$	-
CC 00000098-8 CAIXA ECONOMICA	R\$	-
CC 290000974 - BANCO SANTANDER	R\$	-
CC 290000981 - BANCO SANTANDER	R\$	9.221,17
Saldo Conta Corrente	R\$	10.702,08
TOTAL FUNDO PREVIDENCIÁRIO	R\$	354.493.029,63

2

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Conforme demonstrado na **Tabela 2**, a seguir, os recursos do Fundo Previdenciário Capitalizado estão distribuídos entre cinco instituições administradoras de recursos, das quais três são também gestoras de recursos. A maior participação na carteira é do Banco do Brasil com 52,85% dos recursos, seguido pela Caixa Econômica Federal com 45,45%. Juntas estas duas instituições possuem 98,30% dos recursos do fundo.

2.1 FUNDO PREVIDENCIÁRIO CAPITALIZADO - ADMINISTRADORES

Tabela 2

BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	R\$	187.353.275,52	52,85%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$	161.104.105,16	45,45%
RJI CORRETORA DE VALORES	R\$	5.202.328,80	1,47%
SANTANDER CACEIS (GRUPO SANTANDER)	R\$	790.295,52	0,22%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A.	R\$	32.322,56	0,01%

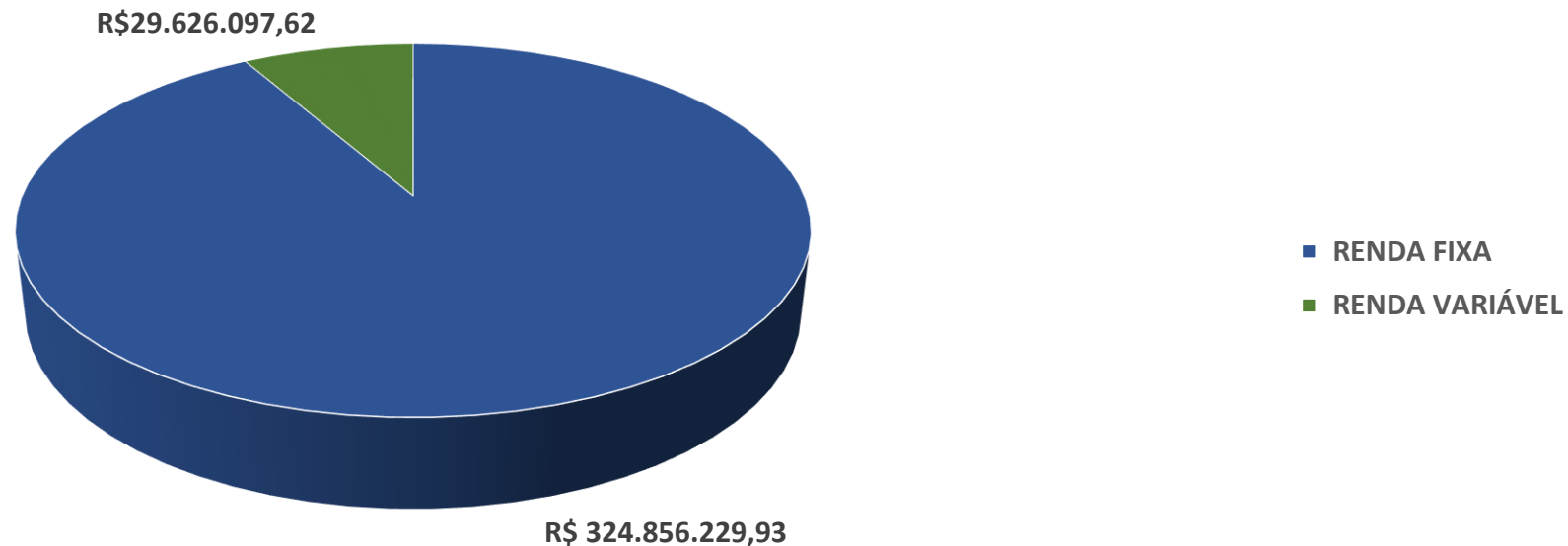
2.2 FUNDO PREVIDENCIÁRIO CAPITALIZADO - GESTORES

Tabela 2

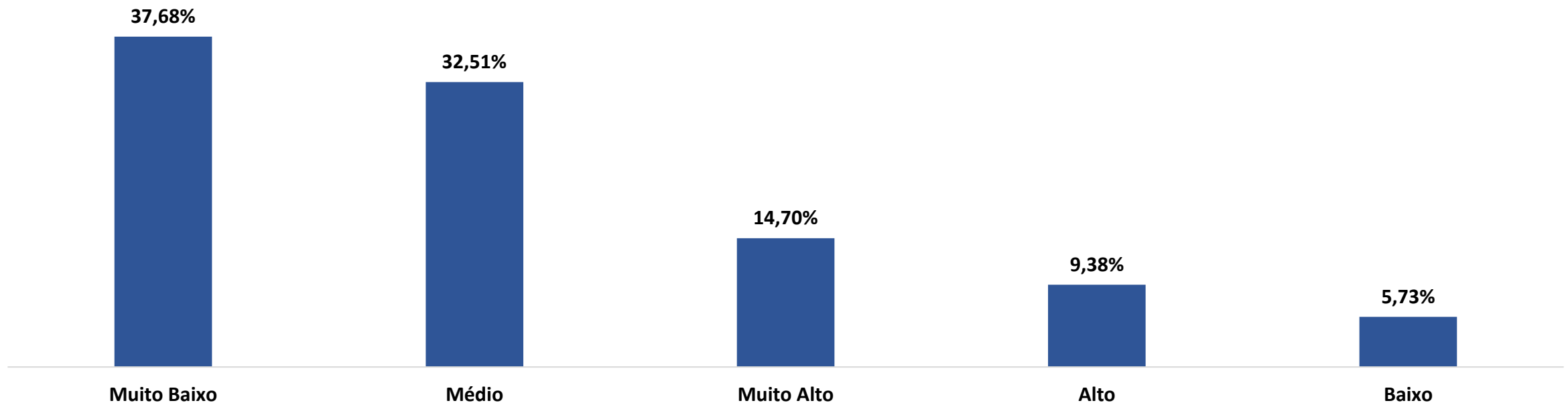
BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	R\$	187.353.275,52	52,85%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$	161.104.105,16	45,45%
MULTINVEST CAPITAL	R\$	3.012.500,43	0,85%
PLURAL	R\$	1.826.541,98	0,52%
GRAPHEN INVESTIMENTOS	R\$	767.691,24	0,22%
RJI CORRETORA DE VALORES	R\$	385.890,67	0,11%
BRPP GESTÃO DE P. EST. LTDA (GRUPO BRASIL PLURAL)	R\$	32.322,56	0,01%

O **Gráfico 1** mostra a distribuição dos recursos do Fundo Previdenciário Capitalizado entre os segmentos de renda fixa e renda variável. O patrimônio do fundo está alocado, preponderantemente, no segmento de renda fixa, com aproximadamente R\$ 325 milhões.

Gráfico 1



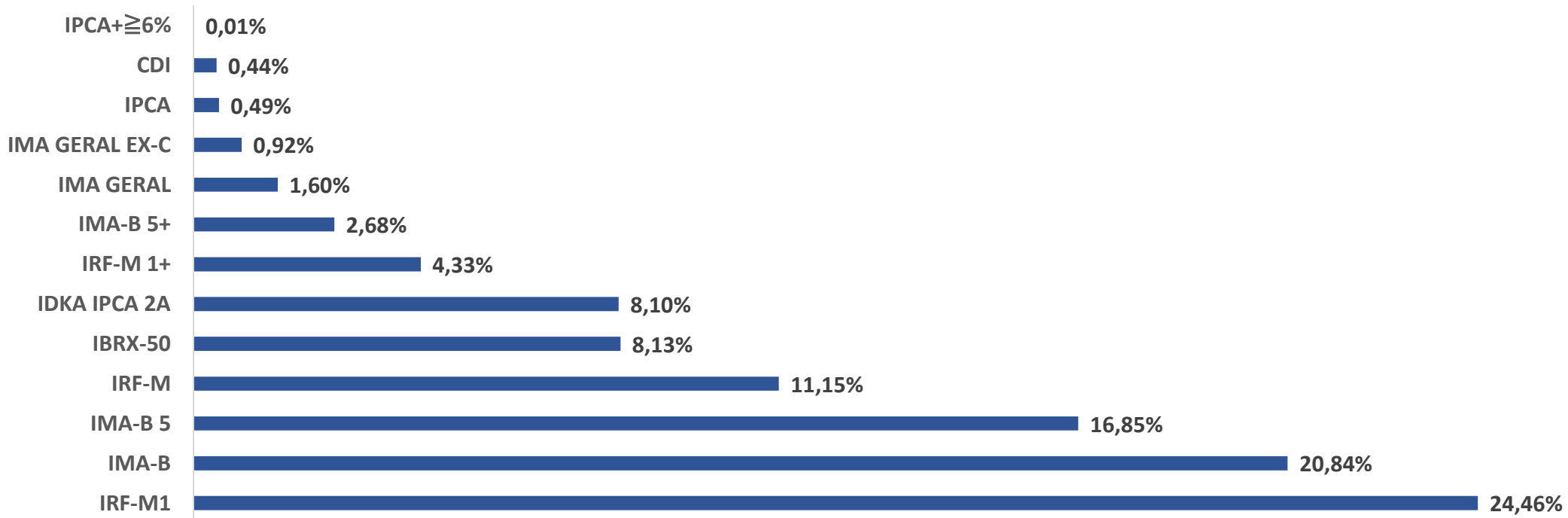
Os administradores classificam o nível de risco dos fundos de investimentos numa escala de 1 a 5, cada número significa um nível de volatilidade, sendo 1 muito baixa, 2 baixa, 3 média, 4 alta e 5 muito alta. A carteira do Fundo Previdenciário Capitalizado tem 78,92% dos recursos alocados em fundos até o nível de volatilidade média, conforme **Gráfico 2**.

Gráfico 2

5 DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICE DE REFERÊNCIA

Cerca de 90% do volume dos recursos do Fundo Previdenciário Capitalizado estão alocados em fundos de títulos públicos que utilizam como índice de referência os sub índices da Anbima. Como mostra o **Gráfico 3**, os fundos que utilizam como referência o IRF-M1, índice composto por títulos prefixados com prazo de vencimento de até 1 ano, tem maior participação na carteira com 24,46%, seguido pelos fundos com índice de referência IMA – B e IMA B5, compostos por títulos públicos atrelado à inflação, com 20,84% e 16,85% do volume de recursos do fundo.

Gráfico 3

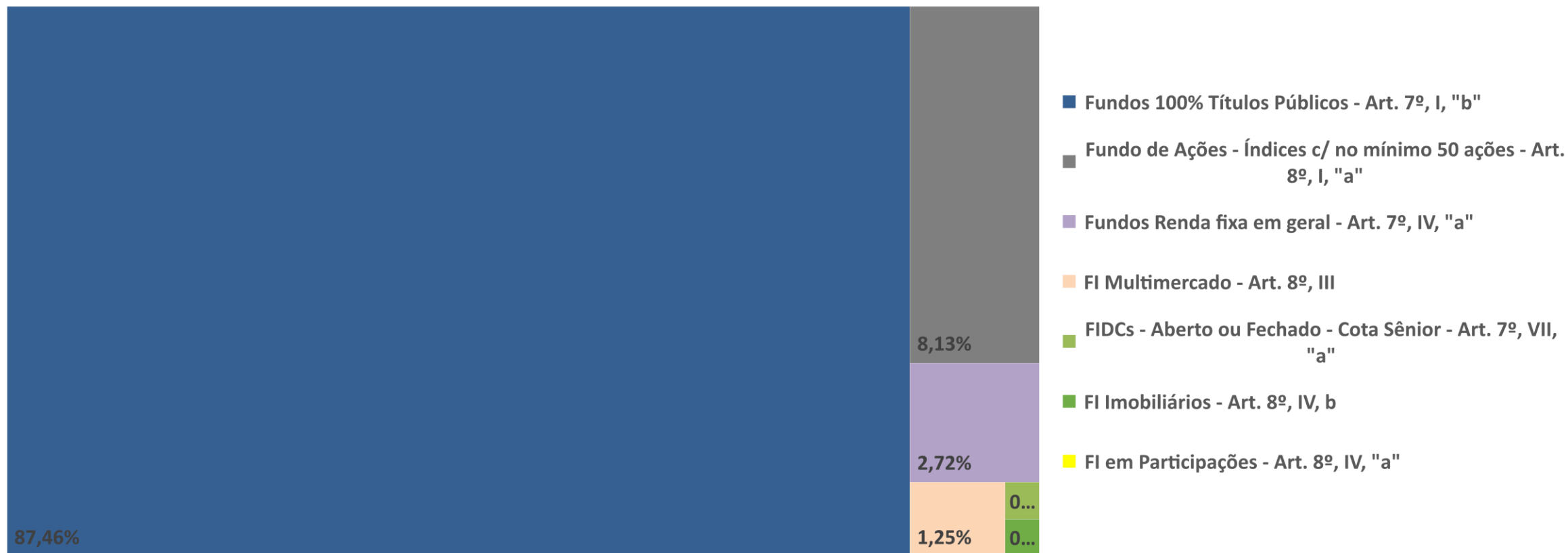


Na **Tabela 3**, pode ser conferida a Política de Investimentos do Fundo Previdenciário Capitalizado para o ano de 2020. Na segunda coluna estão os limites máximos permitidos pela resolução CMN nº 3.922, para cada tipo de ativo da primeira coluna. O limite inferior, a estratégia alvo e o limite superior devem ser definidos pelos RPPS, respeitando os limites da resolução. Na coluna Limite Atual da Carteira, pode ser conferida a adequação da carteira do fundo capitalizado relativa aos limites máximos da Resolução CMN 3.922.

Tipo de Ativo	Limite da Resolução CMN (%)	Limite Inferior (%)	Estratégia Alvo (%)	Limite Superior (%)	Limite Atual da Carteira
Títulos Públicos de emissão do TN - Art. 7º , I, a	100,00%	0,00%	10,00%	100,00%	0,00%
Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"	100,00%	0,00%	10,00%	100,00%	87,45%
ETF - 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, c	100,00%	0,00%	5,00%	100,00%	0,00%
Operações compromissadas - Art. 7º, II	5,00%	0,00%	5,00%	5,00%	0,00%
FI Renda Fixa "Referenciado" - Art.7º, III, a	60,00%	0,00%	5,00%	60,00%	0,00%
ETF - Renda Fixa "Referenciado" - Art. 7º, III, b	60,00%	0,00%	5,00%	60,00%	0,00%
Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"	40,00%	0,00%	5,00%	40,00%	2,72%
ETF - Demais Indicadores de RF - Art. 7º, IV, b	40,00%	0,00%	5,00%	40,00%	0,00%
Letras Imobiliárias Garantidas - Art.7º, V, b	20,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
CDB - Certificado de Depósito Bancário - Art. 7º, VI, a	15,00%	0,00%	5,00%	15,00%	0,00%
Poupança - Art. 7º, VI, b	15,00%	0,00%	5,00%	15,00%	0,00%
FIDCs - Aberto ou Fechado - Cota Sênior - Art. 7º, VII, "a"	5,00%	0,00%	5,00%	5,00%	0,22%
FI Renda Fixa "Crédito Privado" - Art. 7º, VII, b	5,00%	0,00%	5,00%	5,00%	0,00%
FI Debêntures de Infraestrutura - Art. 7º, VII, c	5,00%	0,00%	5,00%	5,00%	0,00%
Sub Total	0,00%	0,00%	75,00%	0,00%	90,39%
Fundo de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações - Art. 8º, I, "a"	30,00%	0,00%	5,00%	20,00%	8,13%
ETF - Índice de Ações (c/ no mínimo 50) - Art. 8º, I, b	30,00%	0,00%	5,00%	20,00%	0,00%
FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a	20,00%	0,00%	5,00%	20,00%	0,00%
ETF - Demais Índices de Ações - Art. 8º, II, b	20,00%	0,00%	2,00%	20,00%	0,00%
FI Multimercado - Art. 8º, III	10,00%	0,00%	2,00%	10,00%	1,25%
FI em Participações - Art. 8º, IV, "a"	5,00%	0,00%	2,00%	5,00%	0,01%
FI Imobiliários - Art. 8º, IV, b	5,00%	0,00%	2,00%	5,00%	0,22%
FI Ações - Mercado de Acesso - Art. 8º, IV, "c"	5,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Sub Total	0,00%	0,00%	23,00%	0,00%	9,60%
FIC e FIC FI - Renda Fixa - Dívida Externa - Art. 9º, I	10,00%	0,00%	0,00%	10,00%	0,00%
FIC Aberto - Investimento no Exterior - Art. 9º, II	10,00%	0,00%	0,00%	10,00%	0,00%
Fundo de Ações – BDR Nível I - Art. 9º, III	10,00%	0,00%	2,00%	10,00%	0,00%
Sub Total			2,00%		0,00%
Total Geral			100,00%		100,00%

O **Gráfico 4** mostra a distribuição do patrimônio líquido do Fundo Previdenciário Capitalizado por tipo de ativo definido na Resolução do CMN nº 3.922. O fundo capitalizado tem 87,16% de seus recursos alocados em fundos de investimentos com carteiras compostas exclusivamente por títulos públicos federais.

Gráfico 4



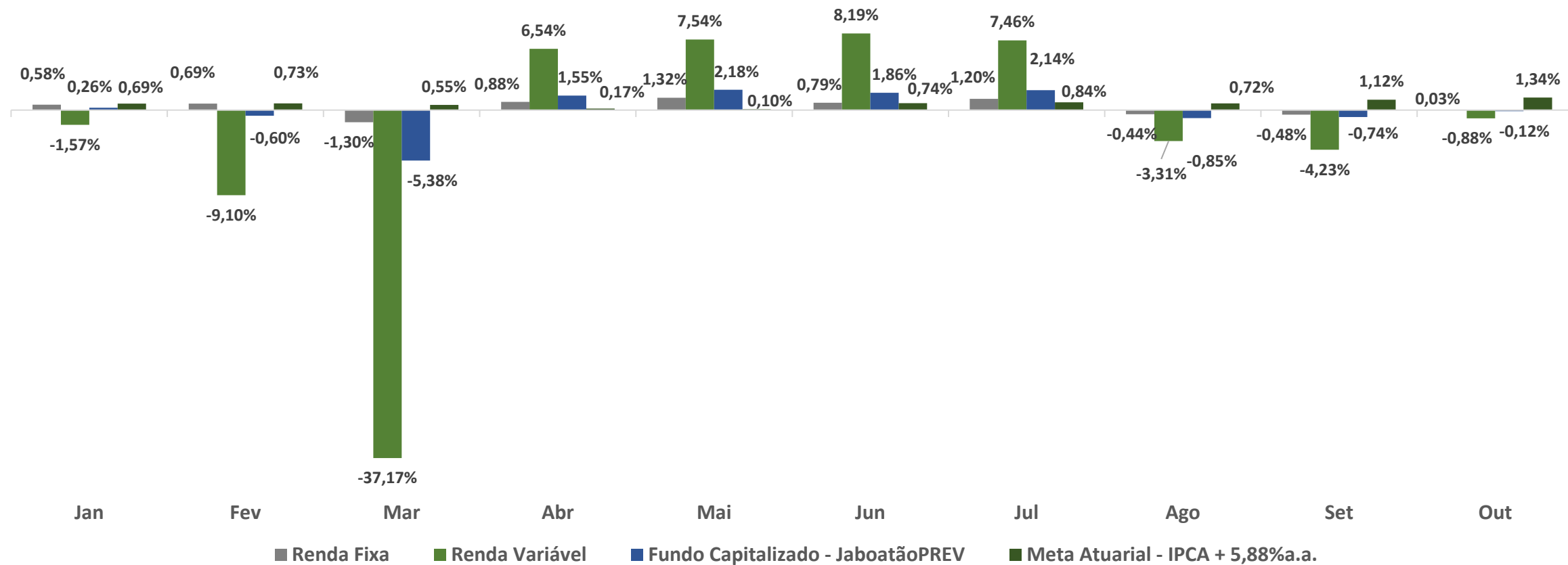
O **Gráfico 5** mostra o retorno mensal do segmento de renda fixa, segmento de renda variável, fundo Previdenciário Capitalizado e meta atuarial. É possível verificar o forte impacto da pandemia do Covid-19 nos investimentos, principalmente no mês de março.

No **Gráfico 6** pode ser observado o desempenho do fundo capitalizado em relação a meta atuarial para o ano de 2020, no acumulado até outubro, o fundo teve retorno de 0,06% contra uma meta atuarial de 7,20%.

Ainda em termos de valores acumulados, o segmento de renda fixa rentabilizou, até o mês atual, 3,29%, enquanto renda variável, segmento que mais sofreu com a pandemia, tem rentabilidade negativa no ano de 31,27%, como pode ser verificado no **Gráfico 7**.

O **Gráfico 8**, mostra o comparativo, em termos acumulados no ano, entre o retorno do fundo Previdenciário Capitalizado, a meta atuarial, a inflação medida pelo IPCA, o CDI e o Ibovespa. Os baixos juros praticados pelo mercado, representados no gráfico pelo CDI, e a inflação acima do esperado, praticamente anularam os juros reais dos investimentos mais conservadores. A inflação mais alta também contribuiu para uma meta atuarial mais desafiadora, já que esta tem o IPCA em sua composição.

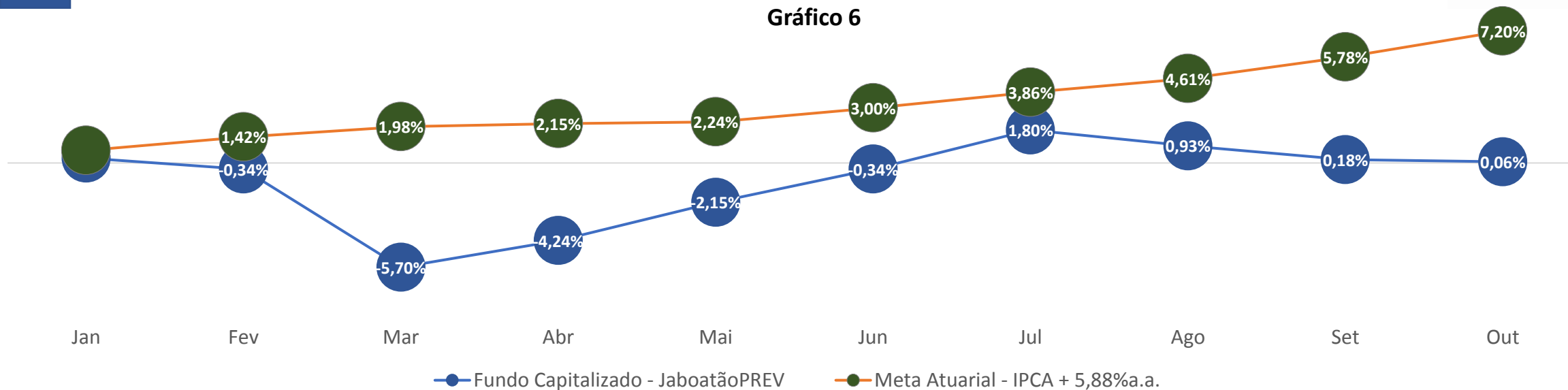
Gráfico 5



8.2

RENTABILIDADE ACUMULADA

Gráfico 6



8.3

RENTABILIDADE ACUMULADA POR SEGMENTO

Gráfico 7

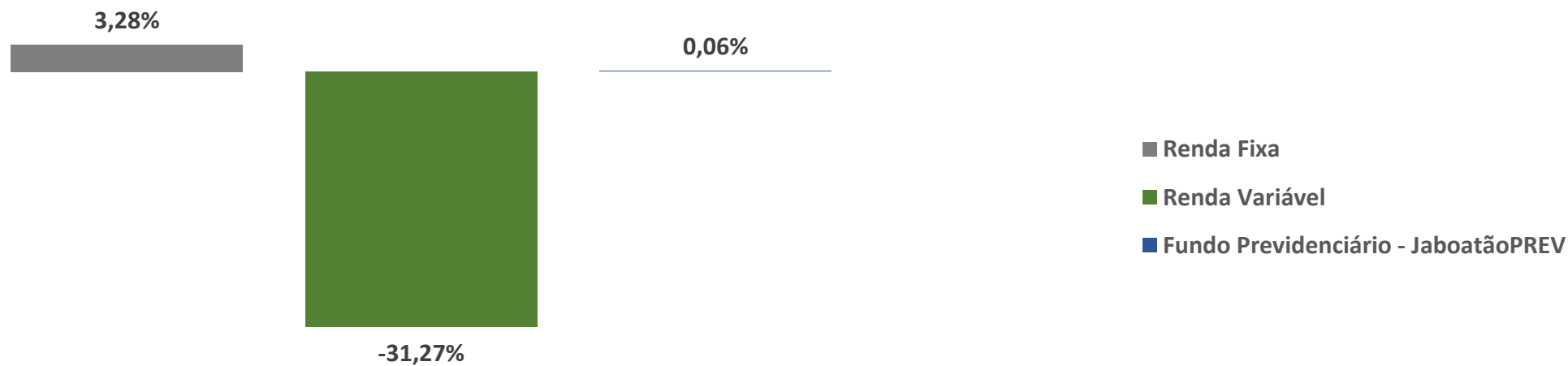
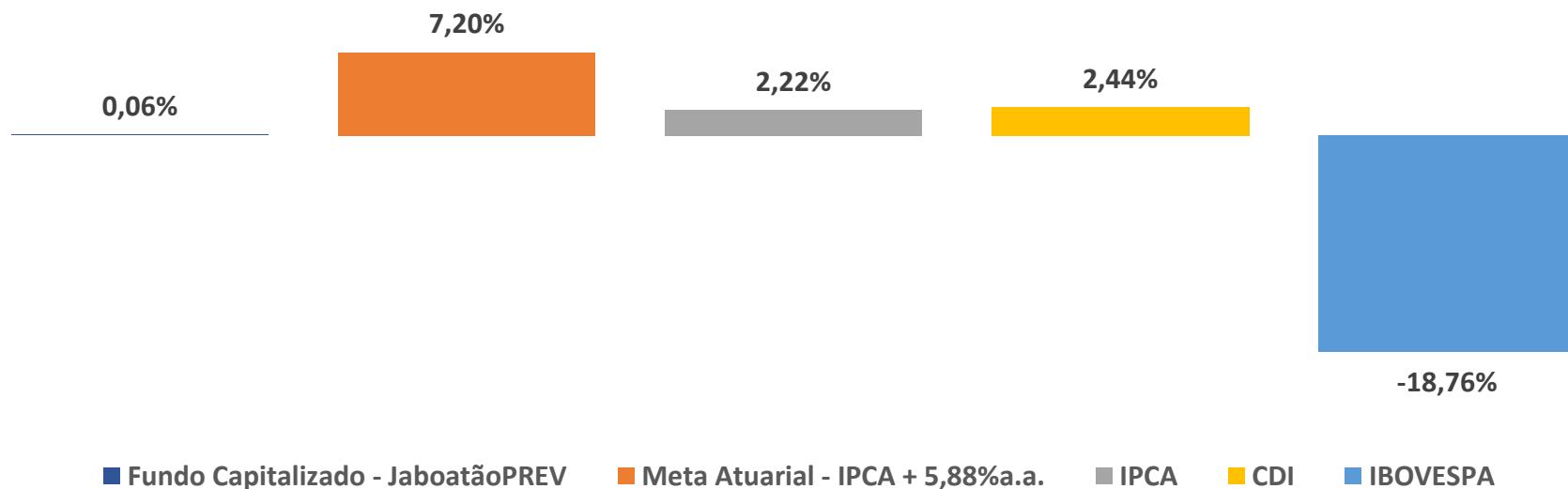
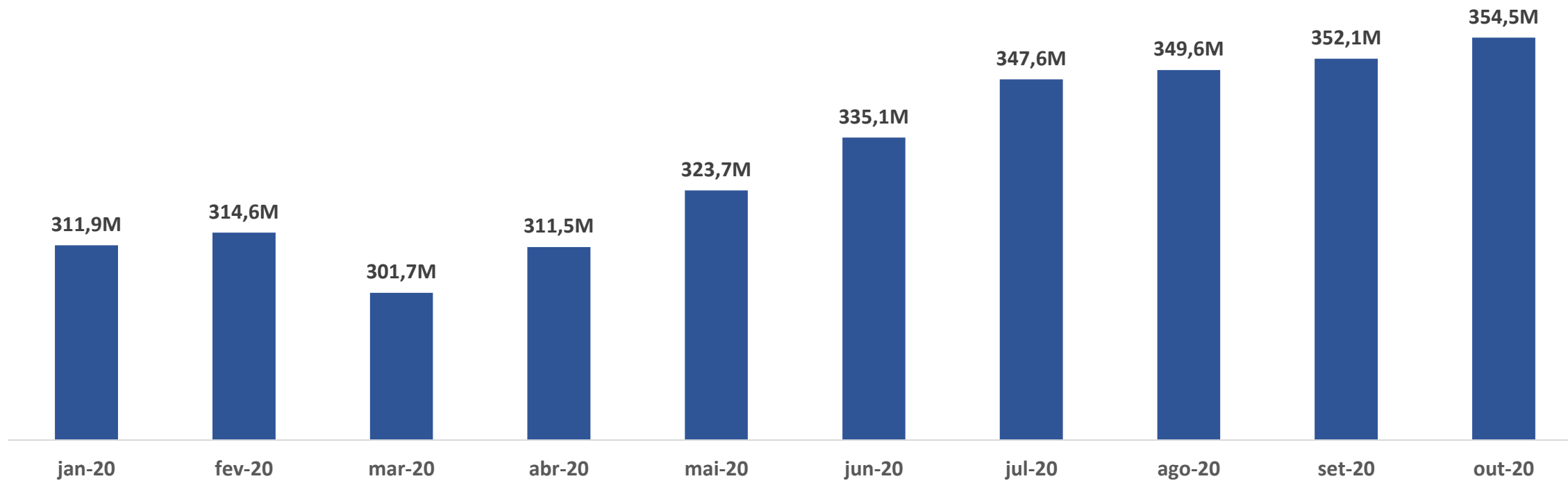


Gráfico 8

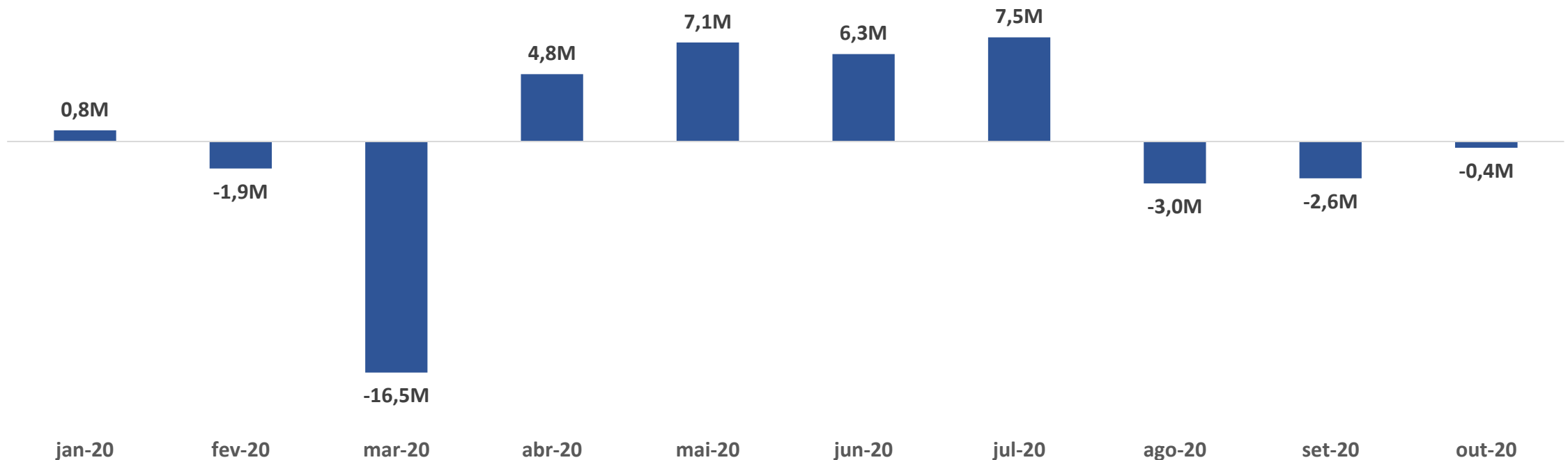


O **Gráfico 9** mostra a evolução patrimonial do Fundo Previdenciário Capitalizado ao longo do ano. Em janeiro de 2020 o fundo possuía um patrimônio líquido de 311,9 milhões e no mês atual possui 354,5 milhões de reais.

Gráfico 9

No **Gráfico 10** pode ser observado o rendimento do Fundo Previdenciário Capitalizado em milhões de reais. Mais uma vez é possível observar o impacto negativo nos investimentos no mês de março, gerado pela incerteza que dominou o mercado financeiro já no início da pandemia do Covid-19. Nos meses seguintes, abril a julho, o fundo teve bons rendimentos refletindo o bom ritmo de recuperação dos mercados. A incerteza voltou a dominar o mercado nos meses de agosto a outubro, impactando negativamente a rentabilidade do fundo.

Gráfico 10



De acordo com a Resolução nº 3.922, o total das aplicações dos recursos do RPPS em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico. Na **Tabela 4**, a coluna “Volume Aplicado x Volume sob Gestão” mostra os percentuais do valor aplicado pelo Fundo Previdenciário Capitalizado comparado ao total de recursos geridos pelas instituições financeiras. Todos os números desta coluna são inferiores ao limite determinado na norma. A resolução também determina que os RPPS somente poderão alocar recursos em fundos de investimentos cujo administrador do fundo detenha, no máximo, 50% dos recursos sob sua administração oriundos de regimes próprios de previdência social. Na coluna “Volume com RPPS x Volume de Administração” da **Tabela 5**, é mostrado o percentual de recursos oriundos de RPPS em relação ao total de recursos administrados. A caixa Econômica tem a maior participação relativa de recursos de RPPS com 19,54%.

VOLUME APLICADO X VOLUME SOB GESTÃO ANBIMA**Tabela 4**

Gestor de Recursos	Volume Aplicado (A)	% PL JaboatãoPrev	Volume Gestão Anbima (B)	Volume Aplicado x Volume sob Gestão (A/B)	Volume de Gestão Anbima Junto a RPPS (C)	Volume com RPPS x Volume de Gestão (C/B)
BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	R\$ 187.353.275,52	52,85%	R\$ 1.178.564.891.581,16	0,02%	R\$ 60.600.974.988,73	5,14%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$ 161.104.105,16	45,45%	R\$ 399.887.077.524,85	0,04%	R\$ 89.167.455.600,14	22,30%
MULTINVEST CAPITAL	R\$ 3.012.500,43	0,85%	R\$ 287.458.690,71	1,05%	R\$ 66.911.475,70	23,28%
PLURAL	R\$ 1.826.541,98	0,52%	R\$ 3.786.788.478,11	0,05%	R\$ 879.000,45	0,02%
GRAPHEN INVESTIMENTOS	R\$ 767.691,24	0,22%	R\$ 364.079.818,38	0,21%	R\$ 360.810.236,45	99,10%
RJI CORRETORA DE VALORES	R\$ 385.890,67	0,11%	R\$ 548.349.755,92	0,07%	R\$ 12.857.460,00	2,34%
BRPP GESTÃO DE P. EST. LTDA (GRUPO BRASIL PLURAL)	R\$ 32.322,56	0,01%	R\$ 19.711.318.008,02	0,00%	R\$ 567.085.576,29	2,88%

VOLUME APLICADO X VOLUME SOB ADMINISTRAÇÃO ANBIMA**Tabela 5**

Administrador de Recursos	Volume Aplicado (A)	% PL JaboatãoPrev	Volume de Administração Anbima (B)	Volume Aplicado x Volume sob Administração (A/B)	Volume de Administração Anbima junto a RPPS (C)	Volume com RPPS x Volume de Administração (C/B)
BB DTVM (GRUPO BANCO DO BRASIL)	R\$ 187.353.275,52	52,85%	R\$ 1.175.159.398.000,00	0,02%	R\$ 62.170.834.000,00	5,29%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$ 161.104.105,16	45,45%	R\$ 467.282.563.680,00	0,03%	R\$ 91.320.442.240,00	19,54%
RJI CORRETORA DE VALORES	R\$ 5.202.328,80	1,47%	R\$ 8.796.301.179,75	0,06%	Não Informado	Não Informado
SANTANDER CACEIS (GRUPO SANTANDER)	R\$ 790.295,52	0,22%	R\$ 380.898.901.493,40	0,00%	R\$ 3.337.721.179,60	0,88%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A.	R\$ 32.322,56	0,01%	R\$ 297.181.746.196,81	0,00%	R\$ 620.250.686,96	0,21%

A **Tabela 6**, mostra a composição da carteira de investimentos, as movimentações ocorridas e os rendimentos de cada fundo de investimentos da carteira do fundo capitalizado, no mês de outubro. Já a **Tabela 7**, mostra os mesmos valores para o fundo financeiro.

Tabela 6

Fundo	Saldo Anterior	Aplicações R\$	Resgates R\$	Rendimento Mês R\$	Saldo Atual
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$ 3.461.815,61	R\$ -	R\$ -	R\$ 6.218,99	R\$ 3.468.034,60
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$ 5.685.522,61	R\$ -	R\$ -	R\$ 893,22	R\$ 5.686.415,83
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$ 32.432.886,59	R\$ -	R\$ -	-R\$ 101.800,92	R\$ 32.331.085,67
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$ 275.603,32	R\$ -	R\$ -	R\$ 1.357,36	R\$ 276.960,68
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 3.256.186,88	R\$ -	R\$ -	-R\$ 2.287,05	R\$ 3.253.899,83
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	R\$ 61.611.379,06	R\$ 5.120.000,00	-R\$ 130.872,51	R\$ 75.485,50	R\$ 66.675.992,05
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 28.705.639,67	R\$ -	-R\$ 96.621,00	R\$ 94.335,14	R\$ 28.703.353,81
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 7.014.724,54	R\$ -	R\$ -	R\$ 13.735,28	R\$ 7.028.459,82
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	R\$ 38.156.083,02	R\$ -	-R\$ 26.270,00	R\$ 71.268,87	R\$ 38.201.081,89
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC	R\$ 1.729.237,93	R\$ -	R\$ -	-R\$ 1.246,58	R\$ 1.727.991,35
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	R\$ 15.431.886,07	R\$ -	R\$ -	-R\$ 86.552,26	R\$ 15.345.333,81

Fundo	Saldo Anterior	Aplicações R\$	Resgates R\$	Rendimento Mês R\$	Saldo Atual
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 20.075.280,49	R\$ -	R\$ -	R\$ 36.384,39	R\$ 20.111.664,88
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	R\$ 25.004.767,34	R\$ -	-R\$ 5.000.000,00	R\$ 33.010,26	R\$ 20.037.777,60
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA	R\$ 36.889.009,23	R\$ -	R\$ -	-R\$ 39.770,60	R\$ 36.849.238,63
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	R\$ 21.781.575,39	R\$ -	R\$ -	R\$ 42.152,91	R\$ 21.823.728,30
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	R\$ 4.445.774,24	R\$ -	R\$ -	-R\$ 23.950,93	R\$ 4.421.823,31
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	R\$ 9.495.202,70	R\$ -	R\$ -	R\$ 20.684,13	R\$ 9.515.886,83
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	R\$ 4.187.590,96	R\$ -	R\$ -	-R\$ 15.022,98	R\$ 4.172.567,98
BBIF MASTER FIDC LP	R\$ 793.885,24	R\$ -	R\$ -	-R\$ 3.589,72	R\$ 790.295,52
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	R\$ 3.011.264,37	R\$ -	R\$ -	R\$ 1.236,06	R\$ 3.012.500,43
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	R\$ 387.059,26	R\$ -	R\$ -	-R\$ 1.168,59	R\$ 385.890,67
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	R\$ 1.037.105,14	R\$ -	R\$ -	-R\$ 858,68	R\$ 1.036.246,46
Total Renda Fixa	R\$ 324.869.479,66	R\$ 5.120.000,00	-R\$ 5.253.763,51	R\$ 120.513,78	R\$ 324.856.229,93

MOVIMENTAÇÕES FUNDO PREVIDENCIÁRIO CAPITALIZADO

Fundo	Saldo Anterior	Aplicações R\$	Resgates R\$	Rendimento Mês R\$	Saldo Atual
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA BRASIL IBX-50	R\$ 24.380.560,89	R\$ 5.002.915,07	R\$ -	-R\$ 557.392,15	R\$ 28.826.083,81
GERAÇÃO DE ENERGIA FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTIESTRATÉGIA	R\$ 32.466,20	R\$ -	R\$ -	-R\$ 143,64	R\$ 32.322,56
HAZ FII - ATCR11	R\$ 769.935,27	R\$ -	R\$ -	-R\$ 2.244,03	R\$ 767.691,24
Total Renda Variável	R\$ 25.182.962,36	R\$ 5.002.915,07	R\$ -	-R\$ 559.779,81	R\$ 29.626.097,62

MOVIMENTAÇÕES FUNDO PREVIDENCIÁRIO FINANCEIRO

Fundo	Saldo Anterior	Aplicações R\$	Resgates R\$	Rendimento Mês R\$	Saldo Atual
BB IMA-B 5 Prev Renda Fixa LP	R\$ 634.999,43	R\$ 185.000,00	R\$ -	R\$ 1.075,59	R\$ 821.075,02
BB IMA-B	R\$ 201.390,62	R\$ -	R\$ -	R\$ 361,79	R\$ 201.752,41
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 1.953.850,90	R\$ 104.747,37	R\$ -	R\$ 3.942,44	R\$ 2.062.540,72
BB IRF M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$ 2.668.541,39	R\$ 11.285.000,00	-R\$ 11.562.050,11	R\$ 7.690,01	R\$ 2.399.181,29
Total Renda Fixa	R\$ 6.121.063,15	R\$ 11.574.747,37	-R\$ 11.562.050,11	R\$ 11.798,01	R\$ 6.145.558,43

O total das carteiras de investimentos do Instituto de Previdência dos Servidores do Município de Jaboatão dos Guararapes – JABOATÃO PREV, no mês de outubro de 2020, foi de R\$ 360.640,513,91, conforme **Tabela 8**.

Tabela 8

Fundo	Saldo Anterior	Aplicações R\$	Resgates R\$	Rendimento Mês R\$	Saldo Atual
TOTAL FUNDO PREVIDENCIÁRIO	R\$ 350.059.813,29	R\$ 10.122.915,07 -R\$	5.253.763,51 -R\$	439.266,03	R\$ 354.493.029,63
TOTAL FUNDO FINANCEIRO	R\$ 6.121.396,09	R\$ 11.574.747,37 -R\$	11.562.050,11 R\$	11.798,01	R\$ 6.147.484,28
TOTAL GERAL DAS CARTEIRAS	R\$ 356.181.209,38	R\$ 21.697.662,44 -R\$	16.815.813,62 -R\$	427.468,02	R\$ 360.640.513,91

Andreson Carlos Gomes de Oliveira
Gerente de Investimentos

PARECER COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Os membros participantes da Reunião do Comitê de Investimentos do Instituto de Previdência dos Servidores Públicos do Município de Jaboatão dos Guararapes, realizada em 19 de maio de 2021, **APROVAM** o Relatório Mensal de Investimentos referente ao mês de outubro do ano de 2020.

Mayara L de L Barbosa

Vanessa de O. Vasconcelos

Andreson Carlos G. de Oliveira

PARECER CONSELHO FISCAL

Os membros participantes da Reunião do Conselho Fiscal do Instituto de Previdência dos Servidores Públicos do Município de Jaboatão dos Guararapes, realizada em 21 de maio de 2021, **APROVAM** o Relatório Mensal de Investimentos referente ao mês de outubro do ano de 2020.

PARECER CONSELHO DE ADMINISTRAÇÃO

Os membros participantes da Reunião do Conselho de Administração do Instituto de Previdência dos Servidores Públicos do Município de Jaboatão dos Guararapes, realizada em 20 de maio de 2021, **APROVAM** o Relatório Mensal de Investimentos referente ao mês de outubro do ano de 2020.

