

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS  
SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE GOV.  
JORGE TEIXEIRA

CNPJ 13.363.520/0001-00

## RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS

MAIO  
2020

## 1. FUNDOS DE INVESTIMENTO

PRODUTO / FUNDO	DISP. RESG.	SALDO	PARTICIP. S/TOTAL	QUANT. COTISTAS	% / PL DO FUNDO	RESOLUÇÃO
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	5.997.094,50	37,37%	744	0,30%	Art. 7º, IV, a
BB IMA-B 5+ TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	D+2	3.262.871,73	20,33%	319	0,17%	Art. 7º, I, b
BB IMA-GERAL EX-C TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	D+1	859.165,19	5,35%	134	0,15%	Art. 7º, I, b
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	D+0	686.522,23	4,28%	669	0,01%	Art. 7º, IV, a
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	4.407.007,87	27,46%	1.372	0,04%	Art. 7º, I, b
LEME IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	134.824,68	0,84%	0	0,18%	Art. 7º, VII, a
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	516.270,12	3,22%	31	0,18%	Art. 7º, IV, a
TOWER II RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	D+1471	186.247,42	1,16%	26	0,26%	Art. 7º, IV, a
<b>TOTAL</b>		<b>16.050.003,74</b>				

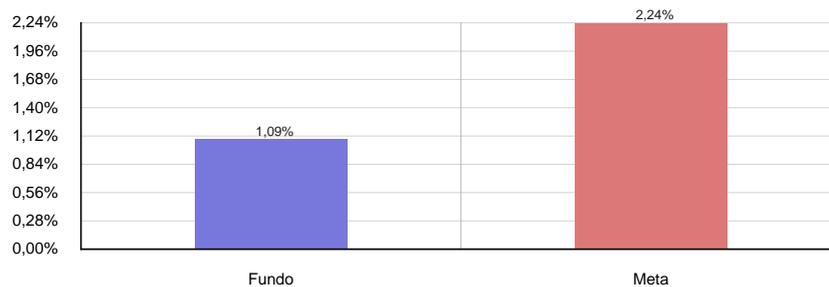
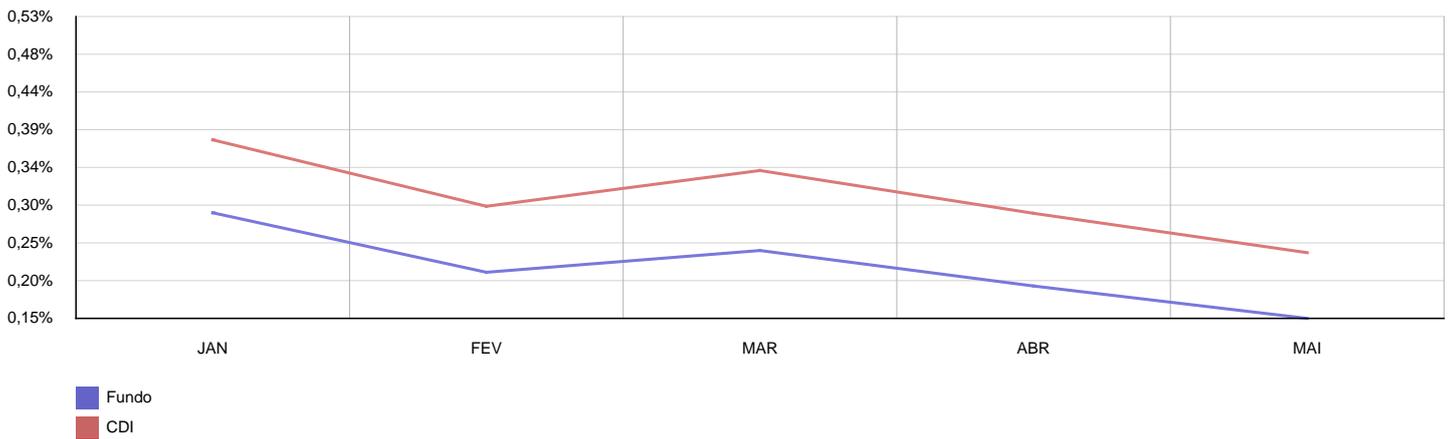
## 2. RENTABILIDADE DOS FUNDOS

CNPJ	FUNDO	MÊS	ANTERIOR	6 MESES	ANO	12 MESES
13.077.415/0001-05	BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,16%	0,20%	1,40%	1,11%	3,77%
13.327.340/0001-73	BB IMA-B 5+ TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	1,00%	1,92%	-5,45%	-7,95%	4,09%
14.964.240/0001-10	BB IMA-GERAL EX-C TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	0,95%	0,80%	1,51%	0,62%	7,11%
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	0,33%	0,00%	1,48%	1,12%	4,25%
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,39%	0,43%	2,63%	2,22%	6,11%
12.440.789/0001-80	LEME IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-0,43%	-0,26%	-3,17%	-2,75%	-3,52%
12.845.801/0001-37	TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,10%	0,23%	-27,59%	-29,05%	-23,83%
23.954.899/0001-87	TOWER II RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	0,76%	0,40%	-15,22%	-15,52%	-13,57%

### 3. CARTEIRA DE FUNDOS DE INVESTIMENTO

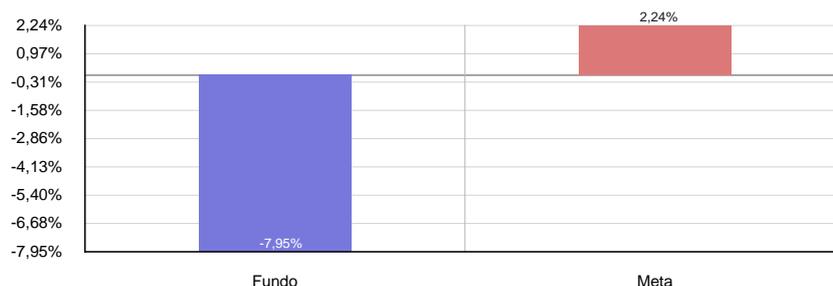
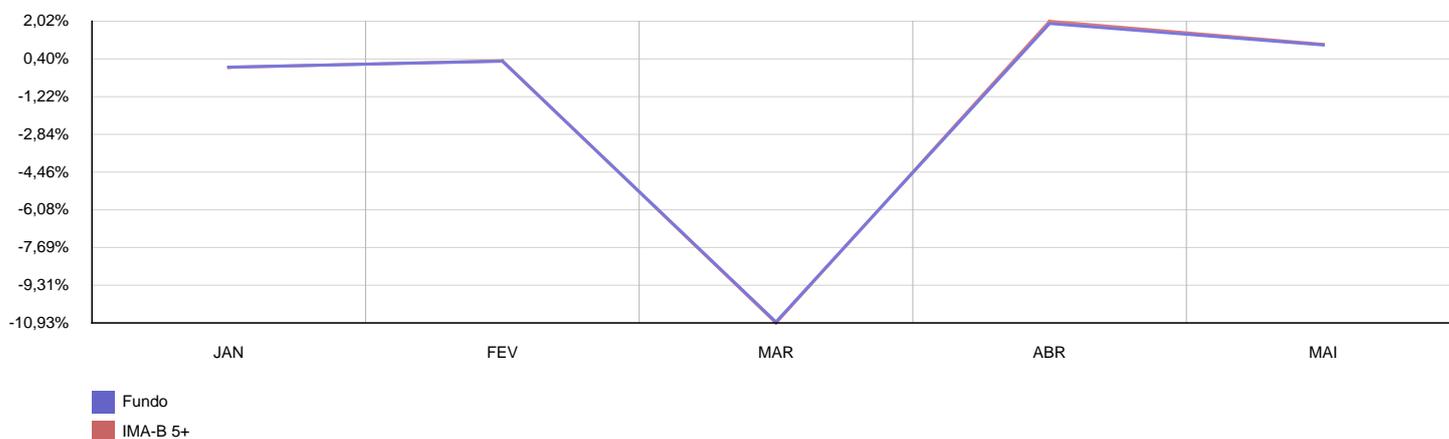
2020	BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO					CNPJ: 13.077.415/0001-05	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO (\$)	RETORNO (%)	META (%)
Janeiro	5.282.065,06	0,00	13,00	5.297.136,98	15.084,92	0,29%	0,69%
Fevereiro	5.297.136,98	103.783,26	63.238,67	5.349.094,57	11.413,00	0,21%	0,73%
Março	5.349.094,57	366.487,72	55.657,30	5.673.556,06	13.631,07	0,24%	0,55%
Abril	5.673.556,06	171.092,48	12.877,50	5.843.120,62	11.349,58	0,19%	0,17%
Maio	5.843.120,62	178.325,35	33.610,30	5.997.094,50	9.258,83	0,15%	0,09%
<b>Acumulado no Ano</b>					<b>60.737,40</b>	<b>1,09%</b>	<b>2,24%</b>

BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO



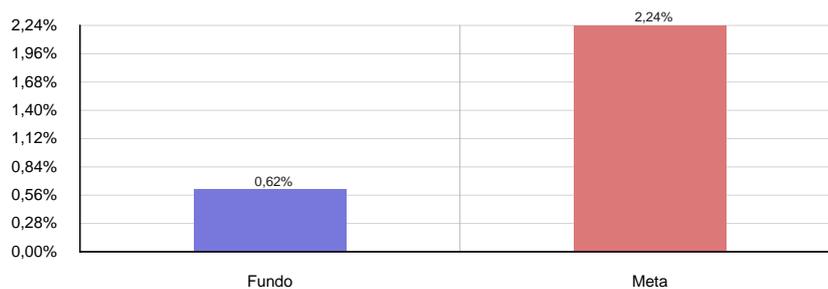
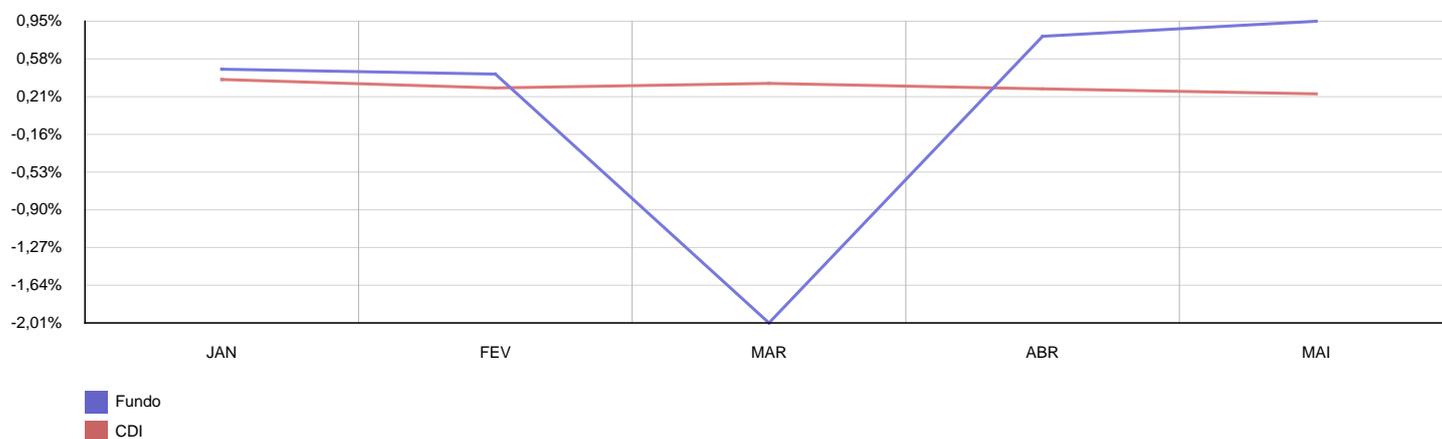
2020	BB IMA-B 5+ TP FI RF PREVIDENCIÁRIO					CNPJ: 13.327.340/0001-73	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO (\$)	RETORNO (%)	META (%)
Janeiro	3.544.769,61	0,00	0,00	3.546.449,64	1.680,03	0,05%	0,69%
Fevereiro	3.546.449,64	0,00	0,00	3.557.054,65	10.605,01	0,30%	0,73%
Março	3.557.054,65	0,00	0,00	3.169.814,64	-387.240,01	-10,89%	0,55%
Abril	3.169.814,64	0,00	0,00	3.230.642,71	60.828,07	1,92%	0,17%
Mai	3.230.642,71	0,00	0,00	3.262.871,73	32.229,02	1,00%	0,09%
<b>Acumulado no Ano</b>					<b>-281.897,88</b>	<b>-7,95%</b>	<b>2,24%</b>

BB IMA-B 5+ TP FI RF PREVIDENCIÁRIO



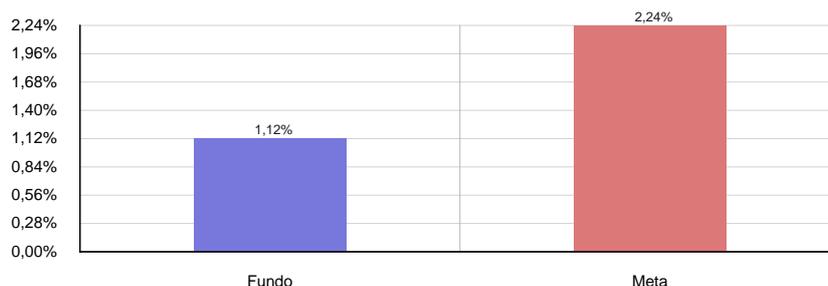
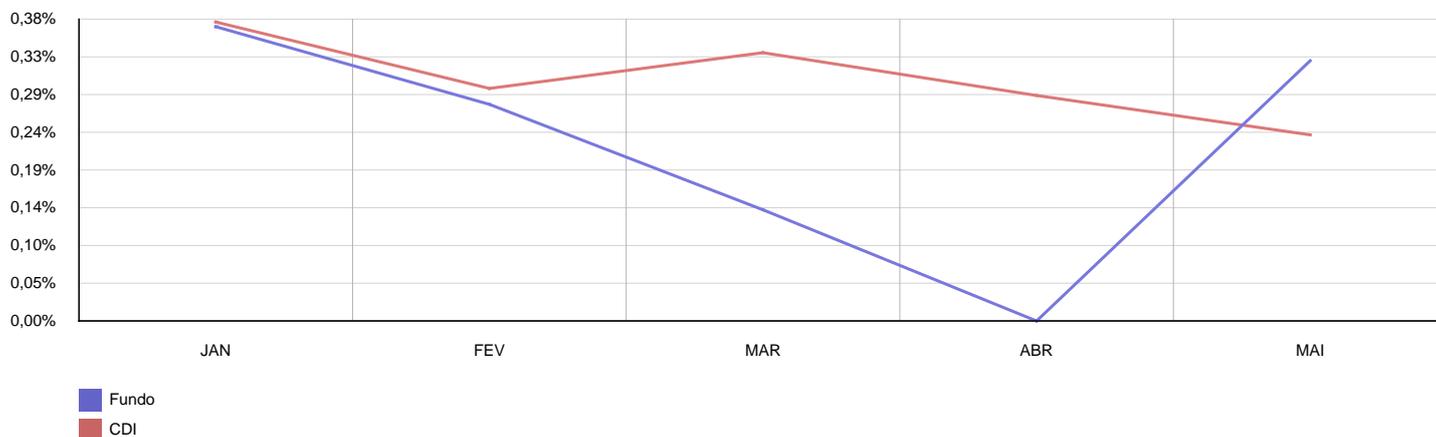
2020	BB IMA-GERAL EX-C TP FI RF PREVIDENCIÁRIO					CNPJ: 14.964.240/0001-10	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO (\$)	RETORNO (%)	META (%)
Janeiro	853.897,92	0,00	0,00	857.972,50	4.074,58	0,48%	0,69%
Fevereiro	857.972,50	0,00	0,00	861.658,97	3.686,47	0,43%	0,73%
Março	861.658,97	0,00	0,00	844.352,80	-17.306,17	-2,01%	0,55%
Abril	844.352,80	0,00	0,00	851.104,05	6.751,25	0,80%	0,17%
Mai	851.104,05	0,00	0,00	859.165,19	8.061,14	0,95%	0,09%
<b>Acumulado no Ano</b>					<b>5.267,27</b>	<b>0,62%</b>	<b>2,24%</b>

BB IMA-GERAL EX-C TP FI RF PREVIDENCIÁRIO



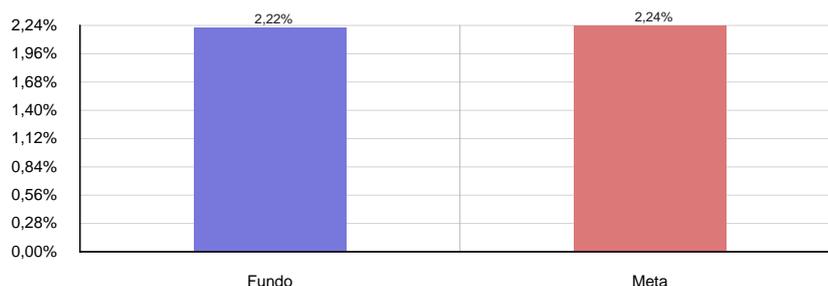
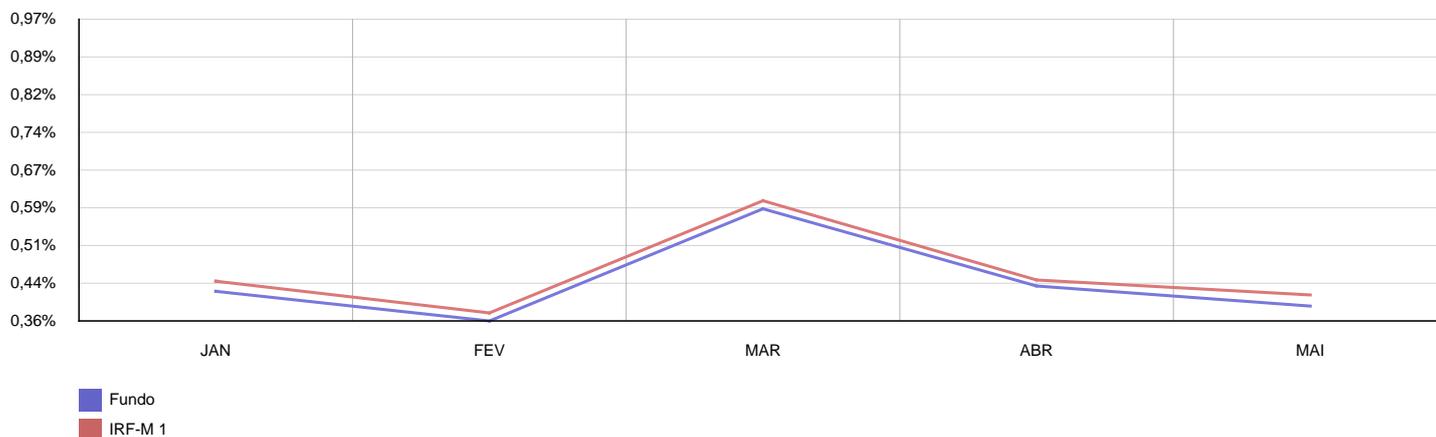
2020	CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP					CNPJ: 03.737.206/0001-97	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO (\$)	RETORNO (%)	META (%)
Janeiro	678.896,22	0,00	0,00	681.413,62	2.517,40	0,37%	0,69%
Fevereiro	681.413,62	0,00	0,00	683.279,87	1.866,25	0,27%	0,73%
Março	683.279,87	0,00	0,00	684.251,76	971,89	0,14%	0,55%
Abril	684.251,76	0,00	0,00	684.275,56	23,80	0,00%	0,17%
Mai	684.275,56	0,00	0,00	686.522,23	2.246,67	0,33%	0,09%
<b>Acumulado no Ano</b>					<b>7.626,01</b>	<b>1,12%</b>	<b>2,24%</b>

CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP



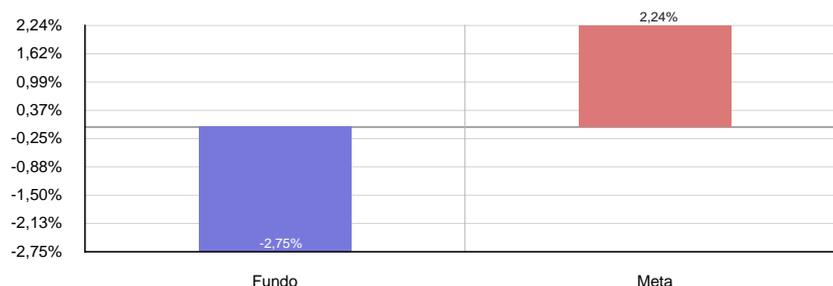
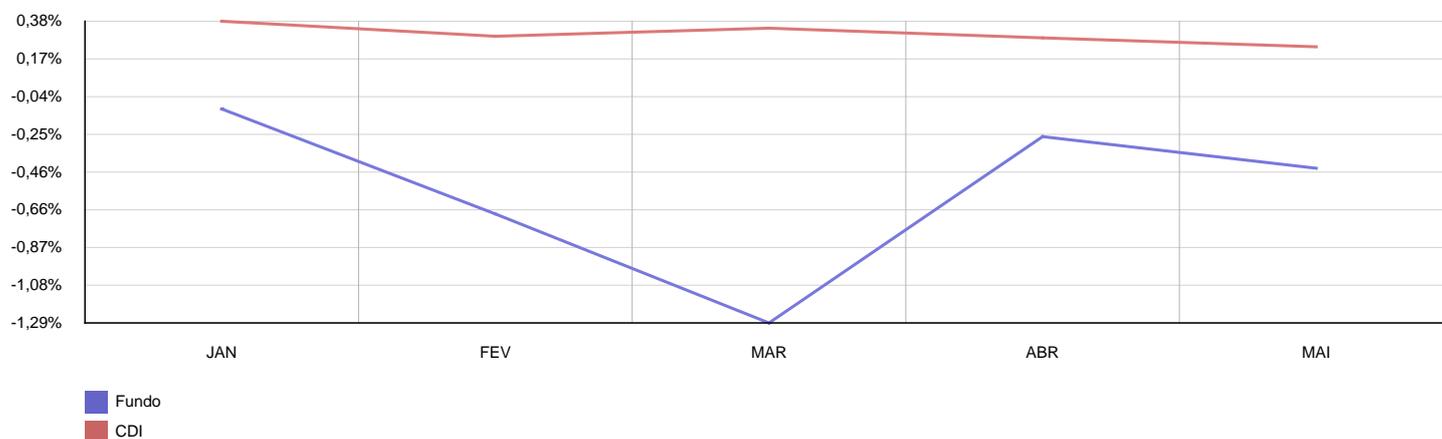
2020	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA					CNPJ: 10.740.670/0001-06	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO (\$)	RETORNO (%)	META (%)
Janeiro	4.311.331,22	0,00	0,00	4.329.549,73	18.218,51	0,42%	0,69%
Fevereiro	4.329.549,73	0,00	0,00	4.345.276,98	15.727,25	0,36%	0,73%
Março	4.345.276,98	0,00	0,00	4.370.818,79	25.541,81	0,59%	0,55%
Abril	4.370.818,79	0,00	0,00	4.389.755,44	18.936,65	0,43%	0,17%
Mai	4.389.755,44	0,00	0,00	4.407.007,87	17.252,43	0,39%	0,09%
<b>Acumulado no Ano</b>					<b>95.676,65</b>	<b>2,22%</b>	<b>2,24%</b>

CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA



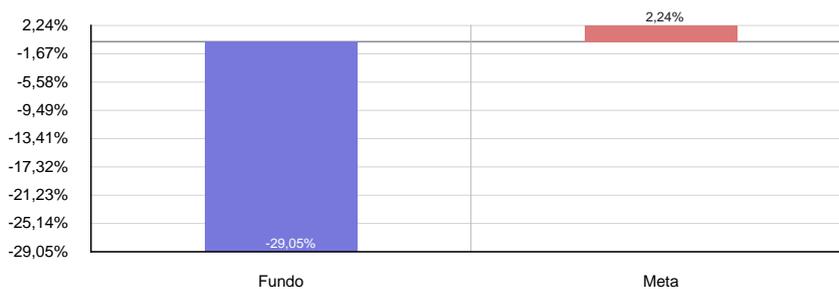
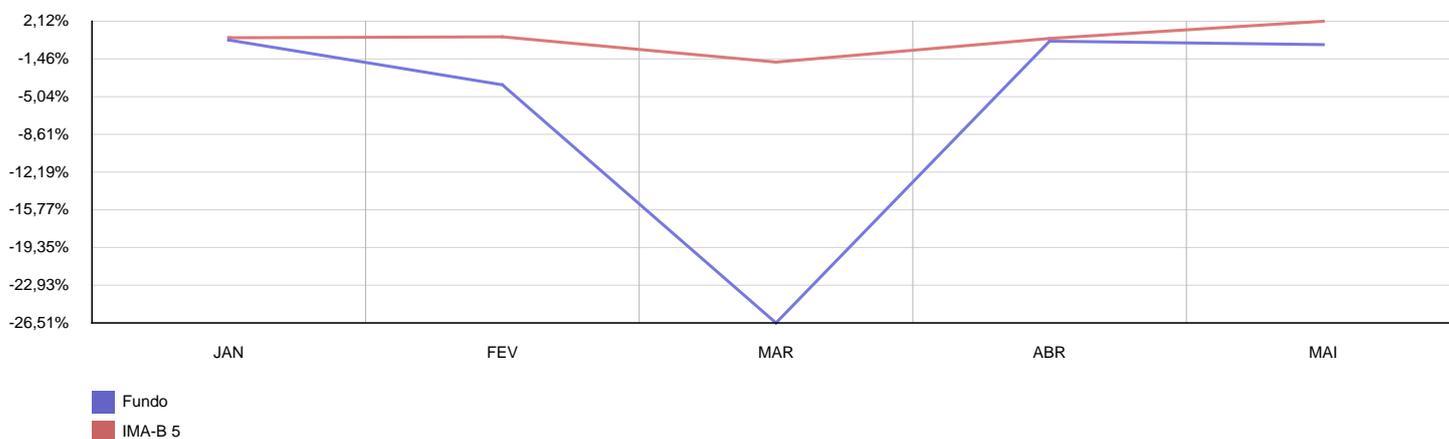
2020	LEME IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR					CNPJ: 12.440.789/0001-80	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO (\$)	RETORNO (%)	META (%)
Janeiro	138.635,12	0,00	0,00	138.486,25	-148,87	-0,11%	0,69%
Fevereiro	138.486,25	0,00	0,00	137.535,90	-950,35	-0,69%	0,73%
Março	137.535,90	0,00	0,00	135.765,31	-1.770,59	-1,29%	0,55%
Abril	135.765,31	0,00	0,00	135.412,59	-352,72	-0,26%	0,17%
Mai	135.412,59	0,00	0,00	134.824,68	-587,91	-0,43%	0,09%
<b>Acumulado no Ano</b>					<b>-3.810,44</b>	<b>-2,75%</b>	<b>2,24%</b>

LEME IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR



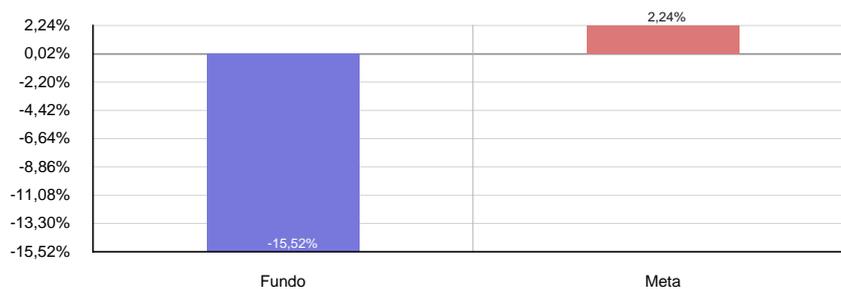
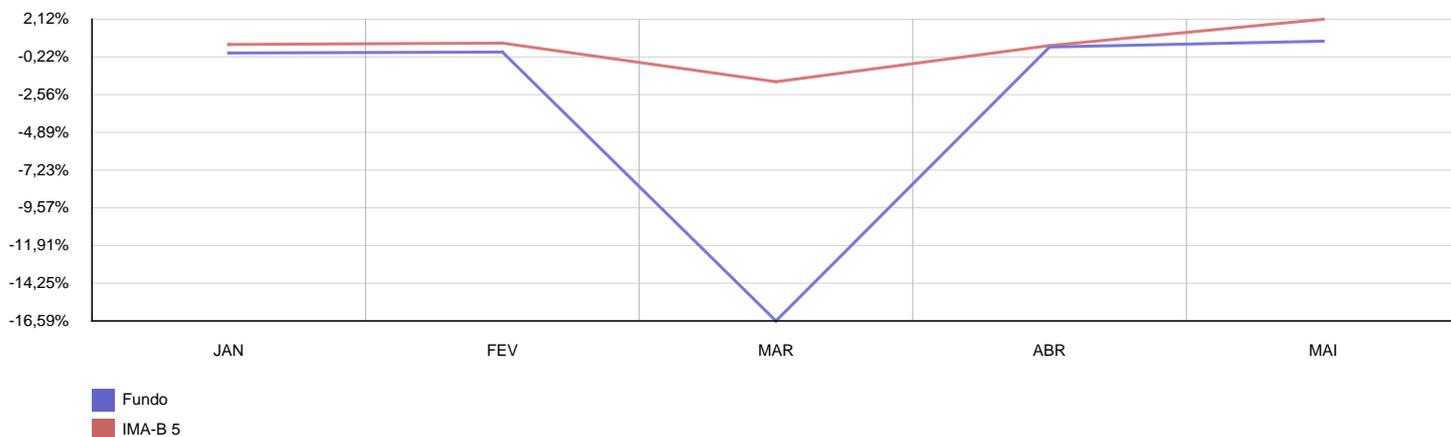
2020	TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA					CNPJ: 12.845.801/0001-37	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO (\$)	RETORNO (%)	META (%)
Janeiro	727.673,20	0,00	0,00	730.121,00	2.447,80	0,34%	0,69%
Fevereiro	730.121,00	0,00	0,00	701.547,06	-28.573,94	-3,91%	0,73%
Março	701.547,06	0,00	0,00	515.590,13	-185.956,93	-26,51%	0,55%
Abril	515.590,13	0,00	0,00	516.770,83	1.180,70	0,23%	0,17%
Mai	516.770,83	0,00	0,00	516.270,12	-500,71	-0,10%	0,09%
<b>Acumulado no Ano</b>					<b>-211.403,08</b>	<b>-29,05%</b>	<b>2,24%</b>

TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA



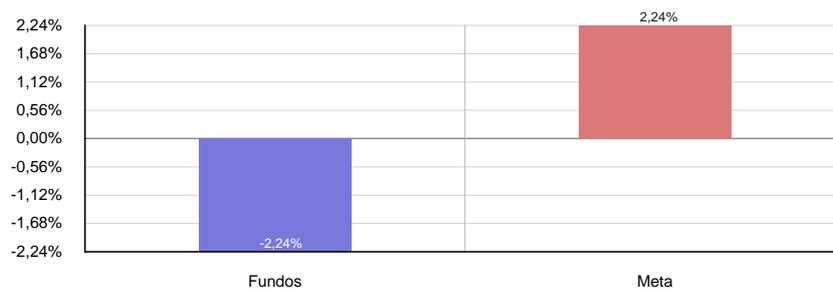
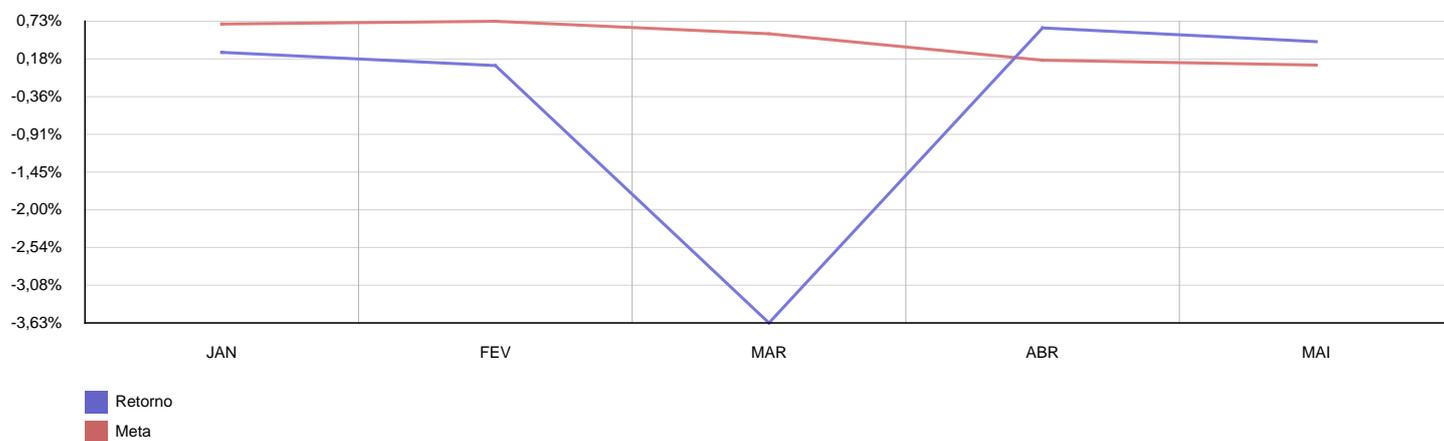
2020	TOWER II RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5					CNPJ: 23.954.899/0001-87	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO (\$)	RETORNO (%)	META (%)
Janeiro	220.462,52	0,00	0,00	220.524,34	61,82	0,03%	0,69%
Fevereiro	220.524,34	0,00	0,00	220.714,59	190,25	0,09%	0,73%
Março	220.714,59	0,00	0,00	184.107,82	-36.606,77	-16,59%	0,55%
Abril	184.107,82	0,00	0,00	184.845,70	737,88	0,40%	0,17%
Mai	184.841,84	0,00	0,00	186.247,42	1.405,58	0,76%	0,09%
<b>Acumulado no Ano</b>					<b>-34.211,24</b>	<b>-15,52%</b>	<b>2,24%</b>

TOWER II RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5



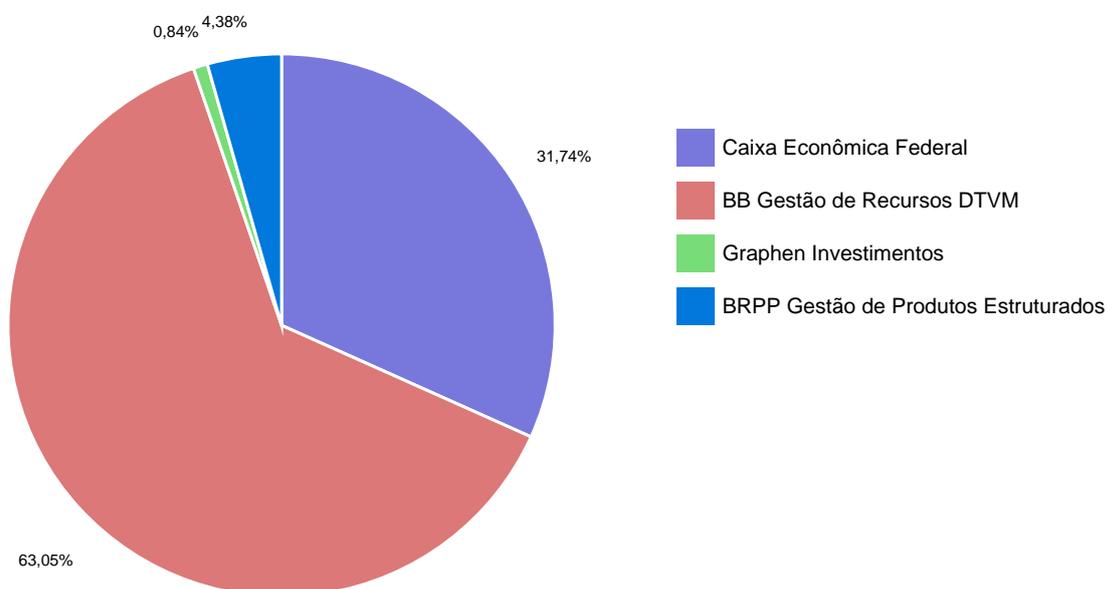
#### 4. CONSOLIDADO

MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO \$	RETORNO %	META	GAP
Janeiro	15.757.730,87	0,00	13,00	15.801.654,06	43.936,19	0,28%	0,69%	40,56%
Fevereiro	15.801.654,06	103.783,26	63.238,67	15.856.162,59	13.963,94	0,09%	0,73%	12,06%
Março	15.856.162,59	366.487,72	55.657,30	15.578.257,31	-588.735,70	-3,63%	0,55%	-663,71%
Abril	15.578.257,31	171.092,48	12.877,50	15.835.927,50	99.455,21	0,63%	0,17%	382,70%
Maio	15.835.923,64	178.325,35	33.610,30	16.050.003,74	69.365,05	0,43%	0,09%	457,42%
<b>Acumulado no Ano</b>					<b>-362.015,31</b>	<b>-2,24%</b>	<b>2,24%</b>	<b>-100,15%</b>



## 5. CONSOLIDADO POR GESTOR

GESTÃO	VALOR	% S/ CARTEIRA	% S/ PL GESTÃO
Caixa Econômica Federal	5.093.530,10	31,74%	0,03%
BB Gestão de Recursos DTVM	10.119.131,42	63,05%	0,22%
Graphen Investimentos	134.824,68	0,84%	0,18%
BRPP Gestão de Produtos Estruturados	702.517,54	4,38%	0,20%
<b>Total da Carteira</b>	<b>16.050.003,74</b>	<b>100,00%</b>	



## 6. RETORNO POR SEGMENTO

SEGMENTO	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO (\$)	RETORNO (%)
Renda Fixa	15.835.923,64	178.325,35	33.610,30	16.050.003,74	69.365,05	0,43%

ATIVOS RENDA FIXA	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO (\$)	RETORNO (%)
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.843.120,62	178.325,35	33.610,30	5.997.094,50	9.258,83	0,15%
BB IMA-B 5+ TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	3.230.642,71	0,00	0,00	3.262.871,73	32.229,02	1,00%
BB IMA-GERAL EX-C TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	851.104,05	0,00	0,00	859.165,19	8.061,14	0,95%
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	684.275,56	0,00	0,00	686.522,23	2.246,67	0,33%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.389.755,44	0,00	0,00	4.407.007,87	17.252,43	0,39%
LEME IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	135.412,59	0,00	0,00	134.824,68	-587,91	-0,43%
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	516.770,83	0,00	0,00	516.270,12	-500,71	-0,10%
TOWER II RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	184.841,84	0,00	0,00	186.247,42	1.405,58	0,76%

## 7. ENQUADRAMENTO

OBJETIVO DE ALOCAÇÃO DOS RECURSOS POR SEGMENTO DE APLICAÇÃO E CARTEIRA			
Alocação dos Recursos / Diversificação	Alocação dos Recursos		
	Limite da Resolução	Enquadramento Atual	%
<b>Renda Fixa</b>			
Títulos Públicos de Emissão do TN - Art. 7º, I, "a"	100%	R\$ 0,00	0,00%
FI Referenciado 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b"		R\$ 8.529.044,79	53,14%
ETF - 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "c"		R\$ 0,00	0,00%
Operações Compromissadas - Art. 7º, II	5%	R\$ 0,00	0,00%
FI Renda Fixa "Referenciado" - Art. 7º, III, "a"	60%	R\$ 0,00	0,00%
ETF - Renda Fixa "Referenciado" - Art. 7º, III, "b"		R\$ 0,00	0,00%
FI Renda Fixa Geral - Art. 7º, IV, "a"	40%	R\$ 7.386.134,27	46,02%
ETF - Demais Indicadores de RF - Art. 7º, IV, "b"		R\$ 0,00	0,00%
Letras Imobiliárias Garantidas - Art. 7º, V, "b"	20%	R\$ 0,00	0,00%
Certificado de Bancário (CDB) , Art. 7º, VI, "a"	15%	R\$ 0,00	0,00%
Poupança - Art. 7º, VI, b		R\$ 0,00	0,00%
FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior, Art. 7º, VII, "a"	5%	R\$ 134.824,68	0,84%
Cotas FI Renda Fixa "Crédito Privado"- Art. 7º, VII, "b"		R\$ 0,00	0,00%
FI Debêntures de Infraestrutura - Art. 7º, VII, "c"		R\$ 0,00	0,00%
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>			
FI Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações - Art. 8º, I, "a"	30%	R\$ 0,00	0,00%
ETF - Índices de Ações (c/ no mínimo 50) - Art. 8º, I, "b"		R\$ 0,00	0,00%
FI Ações - Geral - Art. 8º, II, "a"	20%	R\$ 0,00	0,00%
ETF - Demais índices de Ações - Art. 8º, II, "b"		R\$ 0,00	0,00%
FI Multimercado - Aberto - Art. 8º, III	10%	R\$ 0,00	0,00%
FI em Participações - Art. 8º, IV, "a"	5%	R\$ 0,00	0,00%
FI em Imobiliários - Art. 8º, IV, "b"	5%	R\$ 0,00	0,00%
FI Ações - Mercado de Acesso - Art. 8º, IV, "c"	5%	R\$ 0,00	0,00%
<b>Investimento do Exterior</b>			
Fundo de Renda Fixa - Dívida Externa - Art. 9º - A, I	10%	R\$ 0,00	0,00%
Fundo Investimento - Sufixo Invest. no Exterior - Art. 9º- A, II	10%	R\$ 0,00	0,00%
Fundo de Ações BDR Nível 1 - Art. 9º-A, III	10%	R\$ 0,00	0,00%
Disponibilidades Financeiras		R\$ 0,00	0,00%
<b>TOTAL GERAL</b>		<b>R\$ 16.050.003,74</b>	<b>100,00%</b>

## 8. GERENCIAMENTO DE RISCO

Fundo	Sharpe	VAR	Modi M.	Sharpe M.
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	0,00%	0,04	0,00
BB IMA-B 5+ TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	0,00	0,02%	0,05	0,00
BB IMA-GERAL EX-C TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	0,02	0,01%	0,05	0,02
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	0,00	0,00%	0,04	0,00
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,10	0,00%	0,06	0,00
LEME IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,00	0,00%	0,03	0,00
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,00	inf%	0,05	0,00
TOWER II RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	0,00	inf%	0,05	0,00

## 9. ÍNDICES ECONÔMICOS

ÍNDICE	MÊS	ANTERIOR	6 MESES	ANO	12 MESES
Bovespa	8,57%	10,25%	-24,42%	-24,42%	-13,43%
CDI	0,24%	0,28%	1,92%	1,54%	4,38%
IMA - Geral	1,02%	0,86%	0,88%	0,88%	5,48%
IMA-B	1,52%	1,31%	-3,64%	-3,64%	2,84%
IMA-B 5	2,12%	0,49%	2,03%	2,03%	7,61%
IMA-B 5+	1,02%	2,01%	-7,88%	-7,88%	-0,85%
IMA-C	2,63%	1,39%	3,59%	3,59%	9,13%
IMA-Geral ex-C	0,97%	0,84%	0,80%	0,80%	5,37%
IMA-S	0,24%	0,27%	1,50%	1,50%	4,36%
IPCA	-0,38%	-0,31%	-0,16%	-0,16%	1,87%
IRF-M	1,42%	1,15%	4,05%	4,05%	8,96%
IRF-M 1	0,42%	0,45%	2,31%	2,31%	5,71%
IRF-M 1+	1,92%	1,50%	4,94%	4,94%	10,65%
Selic	0,24%	0,28%	1,92%	1,54%	4,38%
Meta Atuarial	0,09%	0,17%	2,73%	2,24%	7,85%