

*Relatório de
Investimentos
Janeiro de 2020*



*Instituto de Previdência e
Assistência dos Servidores do
Município de Porto Velho*

Ficha Cadastral Janeiro de 2020

Dados do Ente Federativo

Ente Federativo	Prefeitura Municipal de Porto Velho
CNPJ	05.903.125/0001-45
Endereço	Rua Dom Pedro II, S/N
E-mail	gabineteprimeiro@pvh.gov.br
Telefone	(69) 3901-0001
Prefeito	HILDON DE LIMA CHAVES
Início da Gestão	01/01/2017
E-mail	gabineteprimeiro@pvh.gov.br

Dados da Unidade Gestora do RPPS do Município de Porto Velho

Unidade Gestora	Instituto de Previdência e Assistência dos Servidores do Município de Porto Velho
Nome Fantasia	IPAM
CNPJ	34.481.804/0001-71
Endereço	Rua Antonio Lourenço Pereira Lima, 2774
CEP	76820-810
Telefone	
E-mail	ipamro@hotmail.com

Representante Legal	IVAN FURTADO OLIVEIRA	Gestor de Recursos	ODILON JOSE DE SANTANA JUNIOR
Cargo	Presidente	Cargo	Gestor
Início da Gestão	06/03/2017	Início da Gestão	03/01/2017
E-mail	ivan.furtado@gmail.com	E-mail	odilon@ipam.ro.gov.br
Telefone		Telefone	(69) 3211-8134
Certificação		Certificação	CEA
Validade		Validade	06/03/2021

Membros da Unidade Gestora do RPPS do Município de Porto Velho

Colegiado Deliberativo

José Maria Miranda Martins
Sílvia Ney Leal Santos
Ediney Ferreira da Silva
Sergio da Mota de Moraes
Sidvam Costa Pereira
Diolanda Valente de Oliveira
Sidnei de Souza
Raimundo Socorro Lopes Lamarão
Cleusa Ferreira Mendes
Lúcia Valéria de Lima e Silva
Francilene dos Santos Carvalho
JULIETA FELICIANA PANTOJA

Conselho de Fiscalização

Comitê de Investimentos

NOEL LEITE DA SILVA
RODRIGO FERREIRA SOARES
MARIA IRISNEY BARBOSA DE SOUZA
IVAN FURTADO OLIVEIRA
ODILON JOSE DE SANTANA JUNIOR

Atenção!

Qualquer alteração dos dados cadastrais como Prefeito, Gestor e membros dos Conselhos e Comitê, devem nos solicitar a Fica Cadastral através do e-mail relatorio@setecapitalrpps.com.br aos cuidados da Equipe do Backoffice ou ligar no (62) 3924-6211 / (62) 3773-1606 e falar com a equipe do Backoffice.

Com quem falar na Consultoria?

Departamento Backoffice | e-mail: relatorio@setecapitalrpps.com.br | (62) 3924-6211

Assuntos: Relatórios, APR, ATA's, DAIR e Declaração de Veracidade

Responsável depto.: Amanda Oliveira
Responsável RPPS: Felipe Nobre

Tel Ramal.: (62) 3773-1606
Tel Ramal.: (62) 3773-1608

Departamento de Investimentos | e-mail: comercial@setecapitalrpps.com.br | (62) 3924-6211

Assunto: Orientação de Aplicação e Resgate, Notificações e Diligência, Análises de Carteiras e Fundos de Investimentos e Cenário Macro Econômico

Responsável Téc.: Arthur
Consultor Interno: Beatriz

Tel Ramal.: (62) 3773-1626
Tel Ramal.: (62) 3773-1630

Departamento Financeiro | e-mail: financeiro@setecapitalrpps.com.br | (62) 3924-6211

Assunto: Emissão de NF e Boletos e Agendamento de Reuniões presenciais

Responsável: Keity

Tel Ramal.: (62) 3773-1618

Departamento Compliance | e-mail: compliance@setecapitalrpps.com.br | (62) 3924-6211

Assunto: Controle Interno de Normas e Condutas interno e externo

Responsável: Thales

Tel Ramal.: (62) 3773-1620

Departamento Licitação e Contratos | e-mail: licitacao@setecapitalrpps.com.br | (62) 3924-6211

Assunto: Licitações, Documentos da empresa, sócios e demais e formalização de contratos

Responsável: Daniella Nielsen

Tel Ramal.: (62) 3773-1614

Departamento Serviço Atendimento ao Cliente - SAC | e-mail: contato@setecapitalrpps.com.br | (62) 3924-6211

Assunto: Cursos de Capacitação

Responsável: Viviane Vieira

Tel Ramal.: (62) 3773-1632

Departamento Educacional | e-mail: contato@jornadaeducacional.com.br | (62) 3924-6211

Assunto: Cursos de Capacitação

Responsável: Viviane Vieira
Responsável: Amanda Rocha

Tel Ramal.: (62) 3773-1632
Tel Ramal.: (62) 3773-1633

Abaixo é demonstrado a rentabilidade mensal e acumulada da carteira de investimentos, assim como o retorno financeiro. O Instituto de Previdência e Assistência dos Servidores do Município de Porto Velho obteve no mês de janeiro um retorno de R\$ 2.374.678,10, equivalente a 0,35%. Assim, no ano de 2020 acumulou-se um retorno de R\$ 2.374.678,10 representando uma rentabilidade de 0,35%

Relatório de Risco:

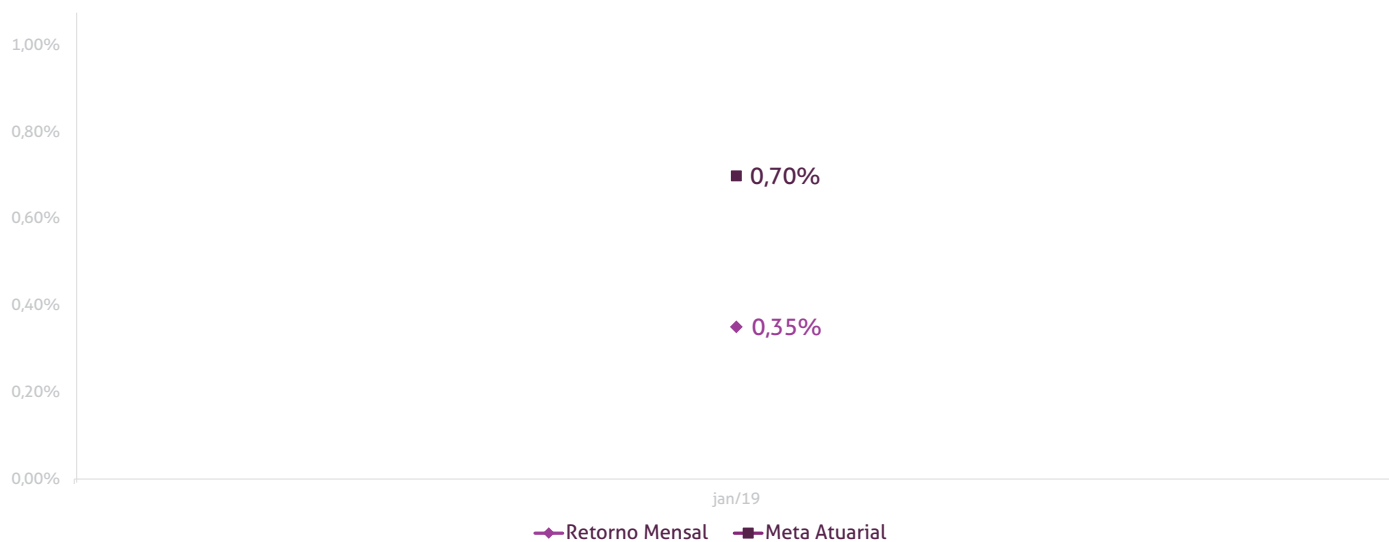
Performance Absoluta

	jan-20	fev-20	mar-20	abr-20	mai-20	jun-20
Carteira	0,35%					
Retorno Financeiro	2.374.678,10					
Meta Atuarial	0,70%					

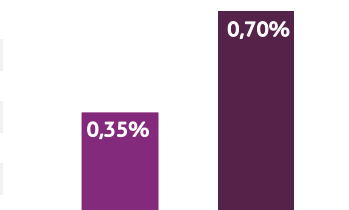
	jul-20	ago-20	set-20	out-20	nov-20	dez-20
Carteira						
Retorno Financeiro						
Meta Atuarial						

Retorno Mensal X Meta Atuarial Mensal

**Meta
IPCA + 6%**



Estatística			Consolidado - 2020	
Meses acima da Meta Atuarial:	0		Carteira	0,35%
Meses abaixo da Meta Atuarial:	1		Retorno	R\$ 2.374.678,10
Retorno Mensal Máximo	0,35%	jan-20	Meta	0,70%
Retorno Mensal Médio	0,35%		Meta Atuarial	IPCA + 6%
Retorno Mensal Mínimo	0,35%	jan-20	Retorno 2019	R\$55.043.058,72
			Retorno 2018	R\$38.496.060,40
			Retorno 2017	R\$48.674.443,05



No extrato consolidado é exibido o detalhamento da carteira de investimentos do Instituto de Previdência e Assistência dos Servidores do Município de Porto Velho durante o exercício de 2020, assim como suas movimentações e realocações do período. No mês de janeiro observou-se o total de R\$ 12.213.893,32 em aplicações e o total de -R\$ 10.688.231,15 em resgates.

Extrato Consolidado

Porto Velho

Janeiro de 2020

jan/20

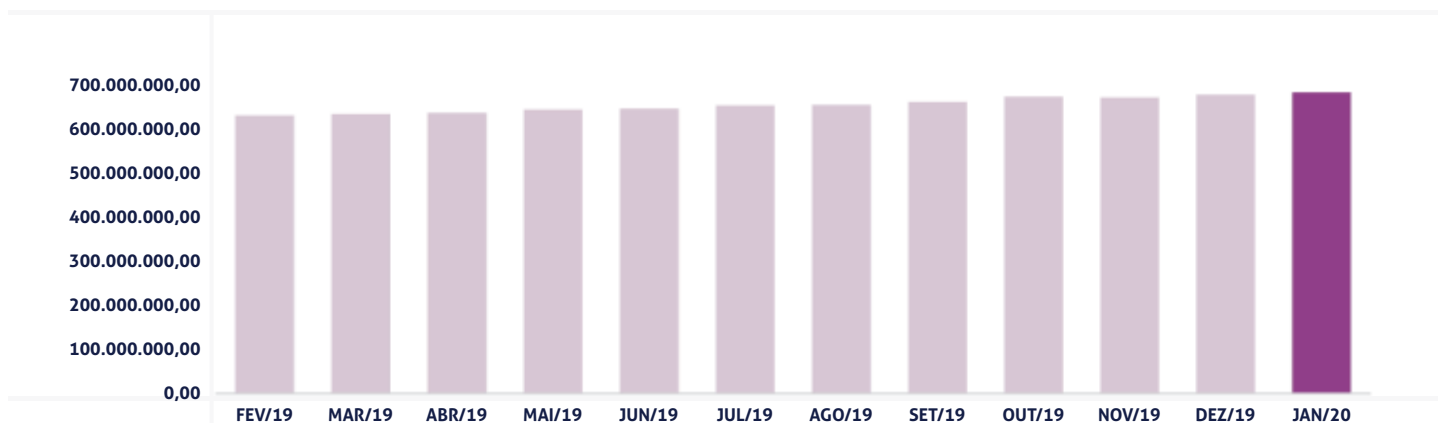
Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 2757-X cc 9143-X	7.737.515,20				32.446,88	0,42%	7.769.962,08
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 2757-X cc 7219-2	20.592.564,46	4.767.365,51	-9.755.925,00		77.650,34	0,42%	15.681.655,31
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 2757-X cc 8808-0	23.336.838,55		-600.000,00		96.831,13	0,42%	22.833.669,68
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 2757-X cc 8809-9	17.495.981,13	3.751.897,29	-156.600,00		73.660,36	0,42%	21.164.938,78
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 2757-X cc 8809-9	162.469.086,71				422.399,50	0,26%	162.891.486,21
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 2757-X cc 8160-4	25.444.381,10				66.152,24	0,26%	25.510.533,34
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 2757-X cc 8809-9	15.969.816,68				31.398,40	0,20%	16.001.215,08
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 2757-X cc 8809-9	88.685.048,46				341.426,79	0,38%	89.026.475,25
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 2757-X cc 8160-4	0,00	847.831,88			373,01	0,38%	848.204,89
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 2757-X cc 9143-X	39.596.124,74				152.440,33	0,38%	39.748.565,07
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 0632 cc 755-8	93.690.206,72				395.909,17	0,42%	94.086.115,89
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 0632 cc 2378-2	16.768.681,15				70.859,85	0,42%	16.839.541,00
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 2757-X cc 8809-9	42.828.163,48				208.076,63	0,49%	43.036.240,11
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 0632 cc 2378-2	86.489.410,02				395.389,61	0,46%	86.884.799,63
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 2757-X cc 8809-9	8.834.033,76				30.904,04	0,35%	8.864.937,80
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 2757-X cc 7925-1	938.188,59	2.846.798,64	-175.706,15		5.125,00	0,29%	3.614.406,08
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11		11.664.656,45				-3.472,99	-0,03%	11.661.183,46
ÁQUILLA FII - AQLL11		13.499.406,82				-22.892,19	-0,17%	13.476.514,63
Aplicações		676.040.104,02						679.940.444,29
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		0,00						1.740.143,46
Caixa 755-8		0,00						0,00
Caixa 2378-2		0,00						0,00
Banco do Brasil 7925-1		0,00						0,00
Banco do Brasil 8808-0		0,00						4.475,56
Banco do Brasil 8160-4		0,00						0,00
Banco do Brasil 9143-X		0,00						0,00
Banco do Brasil 8809-9		0,00						1.665.045,22
Banco do Brasil 7219-2		0,00						70.622,68
Final		676.040.104,02	12.213.893,32	-10.688.231,15	0,00	2.374.678,10	0,35%	681.680.587,75

O Instituto de Previdência e Assistência dos Servidores do Município de Porto Velho encerrou o mês de Janeiro com R\$ 681.680.587,75 em seu Patrimônio Líquido, representando um aumento de R\$ 5.640.483,73 com relação ao mês anterior e um aumento de R\$ 5.640.483,73 com relação ao exercício de 2019. Observando o histórico dos últimos doze meses, obteve um crescimento de 8,92%.

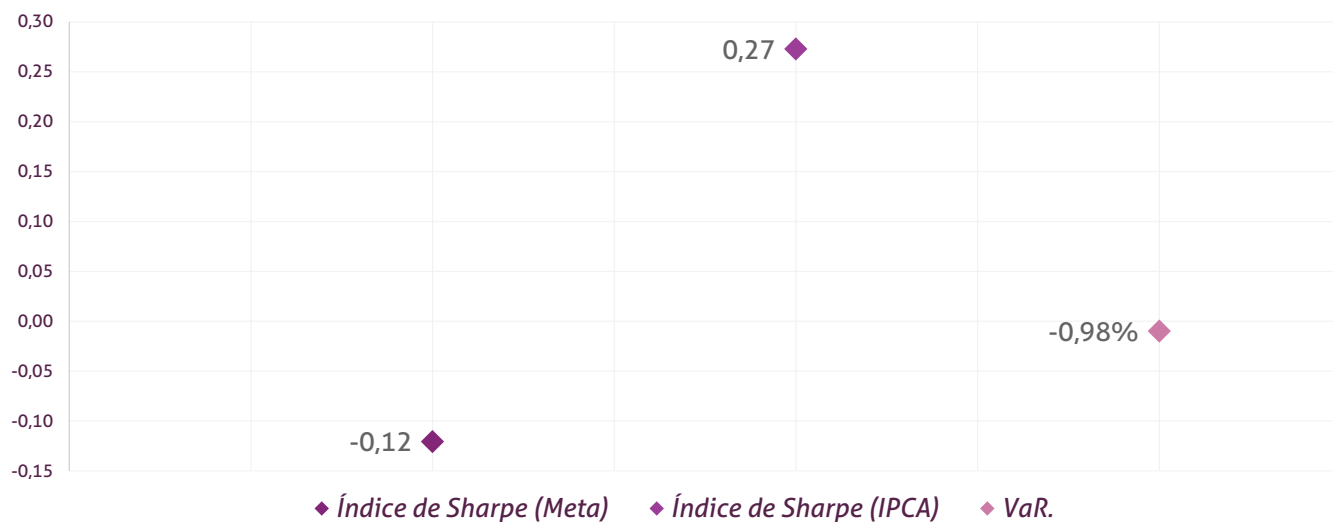
Evolução Patrimônio Líquido

Saldo inicial do ano (31/12/2019)	Evolução nos últimos 12 meses	Evolução em 2020
R\$ 676.040.104,02	8,92%	0,83%

Jan	681.680.587,75	Fev	Mar	Abr
Mai		Jun	Jul	Ago
Set		Out	Nov	Dez



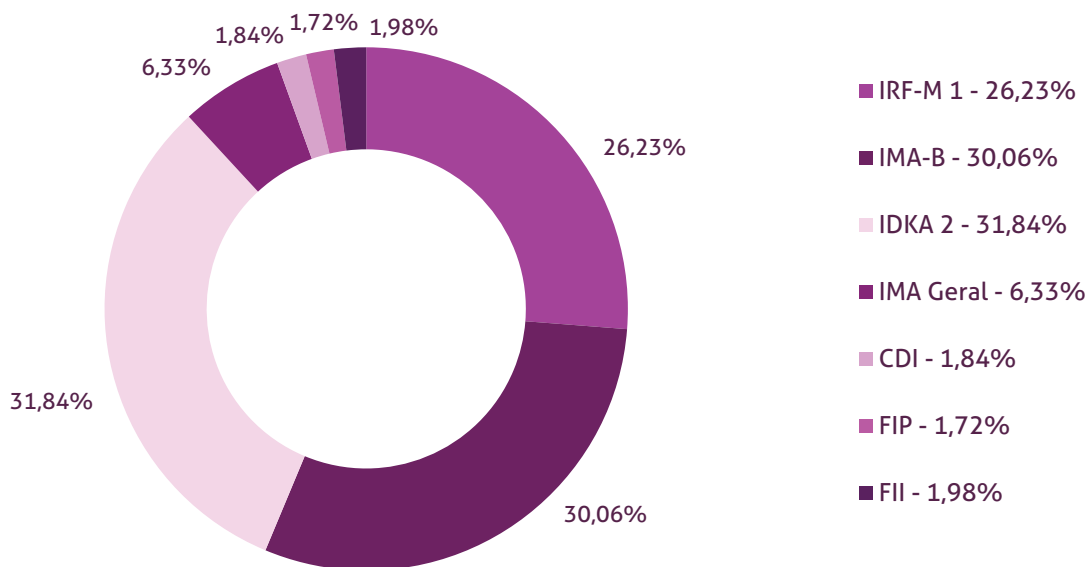
Índice de Sharpe e Var da Carteira



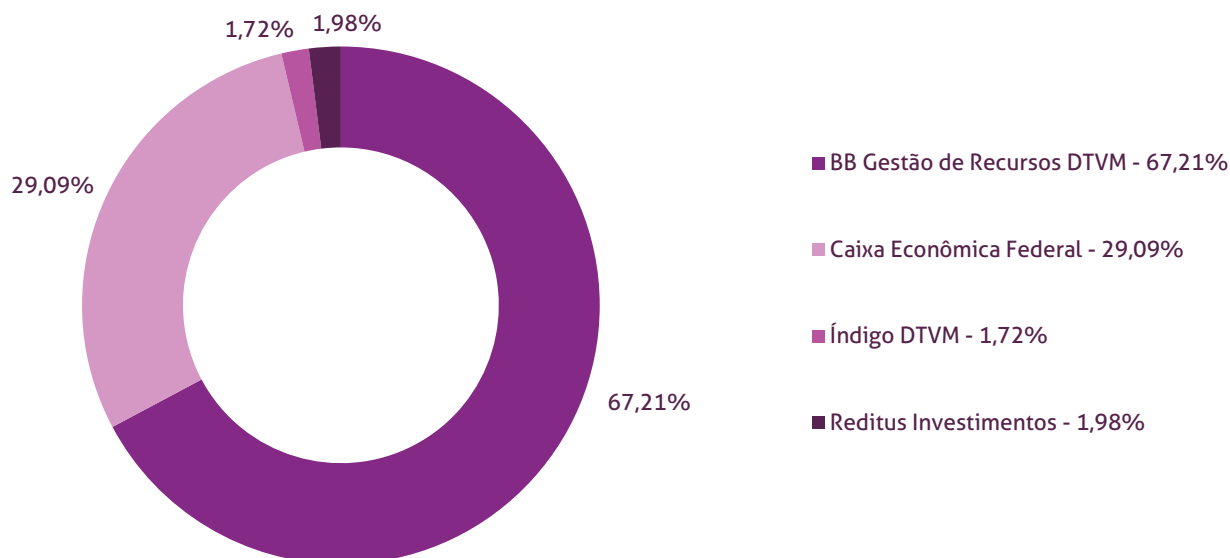
Durante o exercício de 2020, o Instituto de Previdência e Assistência dos Servidores do Município de Porto Velho alocou seus recursos nos Fundos de Investimentos listados abaixo. É possível observar algumas de suas principais características técnicas como: gestão, taxa de administração, benchmark e período de liquidez para resgate.

Fundos	CNPJ	Gestão	Taxa de Administração	Benchmark	Resgate
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.328.882/0001-35	BB Gestão de Recursos DTVM	0,10%	IRF-M 1	D+0
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	07.442.078/0001-05	BB Gestão de Recursos DTVM	0,20%	IMA-B	D+1 du
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	19.523.305/0001-06	BB Gestão de Recursos DTVM	0,20%	IMA-B	D+0
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.322.205/0001-35	BB Gestão de Recursos DTVM	0,20%	IDKA 2	D+1 du
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	Caixa Econômica Federal	0,20%	IRF-M 1	D+0
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	25.078.994/0001-90	BB Gestão de Recursos DTVM	0,30%	IMA Geral	D+3 du
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.386.926/0001-71	Caixa Econômica Federal	0,20%	IDKA 2	D+0
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	13.077.418/0001-49	BB Gestão de Recursos DTVM	0,20%	CDI	D+0
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.077.415/0001-05	BB Gestão de Recursos DTVM	1,00%	CDI	D+0
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	10.625.626/0001-47	Índigo DTVM	0,40%	FIP	Não se aplica
ÁQUILLA FII - AQLL11	13.555.918/0001-49	Reditus Investimentos	1,50%	FII	Não se aplica

Distribuição por Indicador - Janeiro de 2020



Distribuição por Instituição - Janeiro de 2020

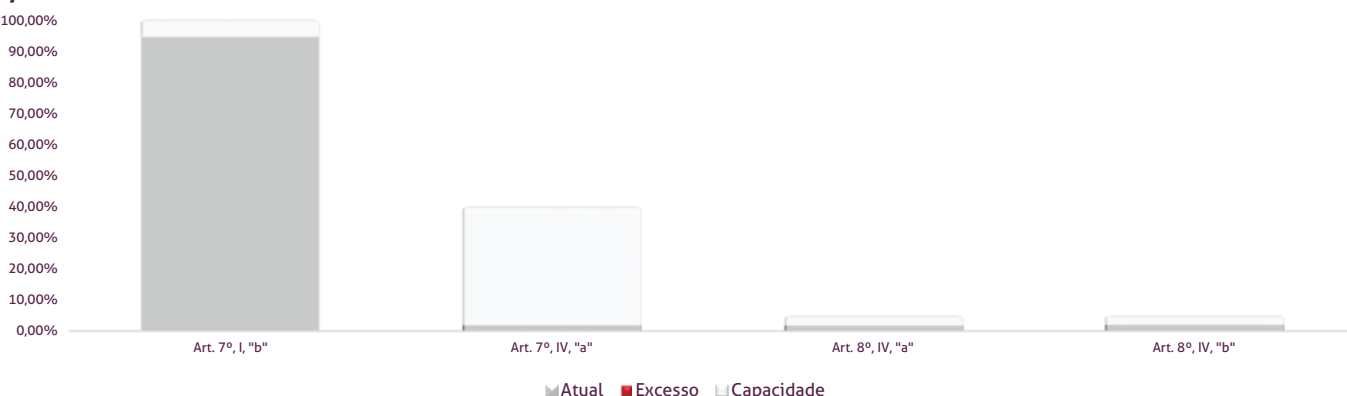


Os limites de alocação dos recursos do Instituto de Previdência e Assistência dos Servidores do Município de Porto Velho seguem as diretrizes da Resolução CMN 3.922 de 25 de novembro de 2010, onde são classificados de acordo com o tipo de ativo e quando se tratando de fundos de investimento, de acordo com os ativos que compõem sua carteira. Sendo assim, o mesmo encontra-se desenquadrado.

Limites Resolução 3.922

Fundos	Saldo no Mês	Limite do RPPS	Regularidade
Renda Fixa	654.802.746,20	96,30%	100%
Art. 7º, I, "b" - FI (100% TPF) - IMA ou IDKA	642.323.402,32	94,47%	100%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.769.962,08	1,14%	
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.681.655,31	2,31%	
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	22.833.669,68	3,36%	
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	21.164.938,78	3,11%	
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	162.891.486,21	23,96%	
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	25.510.533,34	3,75%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.001.215,08	2,35%	
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	89.026.475,25	13,09%	
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	848.204,89	0,12%	
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	39.748.565,07	5,85%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	94.086.115,89	13,84%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	16.839.541,00	2,48%	
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	43.036.240,11	6,33%	
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	86.884.799,63	12,78%	
Art. 7º, IV, "a" - FI Referenciado RF ou RF	12.479.343,88	1,84%	40%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	8.864.937,80	1,30%	
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.614.406,08	0,53%	
Renda Variável e Investimentos Estruturados	25.137.698,09	3,70%	30%
Art. 8º, IV, "a" - FI em Participações - FIP	11.661.183,46	1,72%	5%
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	11.661.183,46	1,72%	
Art. 8º, IV, "b" - FI Imobiliário - FII	13.476.514,63	1,98%	5%
ÁQUILLA FII - AQLL11	13.476.514,63	1,98%	
Aplicações	679.940.444,29	99,74%	
Conta Corrente	1.740.143,46	0,26%	
CARTEIRA	681.680.587,75	100,00%	

Disponibilidade 3.922



Irregularidade por ultrapassar limite do Patrimônio Líquido do fundo CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11 de 5%, com 7,28%. Patrimônio Líquido do fundo: R\$ 160.136.328,18

Irregularidade por ultrapassar limite do Patrimônio Líquido do fundo ÁQUILLA FII - AQLL11 de 5%, com 9,10%. Patrimônio Líquido do fundo: R\$ 148.135.109,15

Limites Resolução 3.922

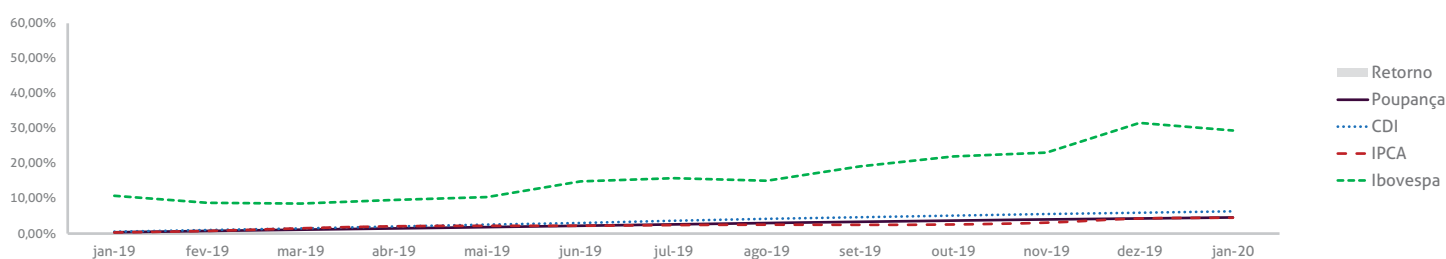
Fundos	Porcentagem do RPPS	Limite	Limite Individual	Política de Investimentos		
				Limite Mínimo	Alvo	Limite Máximo
Renda Fixa	96,30%	100%				
Art. 7º, I, "a" - Títulos Públicos Federais - SELIC	0,00%	100%	-	0%	0%	100%
Art. 7º, I, "b" - FI (100% TPF) - IMA ou IDKA	94,47%	100%	-	50%	80%	100%
Art. 7º, I, "c" - FI (100% TPF) - Bolsa de Valores	0,00%	100%	-	0%	0%	100%
Art. 7º, II - Compromissadas	0,00%	5%	-	0%	0%	5%
Art. 7º, III, "a" - FI Referenciado RF ou RF - IMA ou IDKA	0,00%	60%	20%	0%	0%	60%
Art. 7º, III, "b" - FI de Índices RF - IMA ou IDKA	0,00%	60%	20%	0%	0%	60%
Art. 7º, IV, "a" - FI Referenciado RF ou RF	1,84%	40%	20%	0%	2%	40%
Art. 7º, IV, "b" - FI de Índices RF	0,00%	40%	20%	0%	0%	40%
Art. 7º, V, "b" - LIG - Letras Imobiliárias Garantidas	0,00%	20%	250 mil	0%	0%	20%
Art. 7º, VI, "a" - CDB - Certificado de Depósito Bancário	0,00%	15%	250 mil	0%	0%	15%
Art. 7º, VI, "b" - Poupança	0,00%	15%	250 mil	0%	0%	15%
Art. 7º, VII, "a" - FIDC - Sênior	0,00%	5%	-	0%	0%	3%
Art. 7º, VII, "b" - FI Crédito Privado - Aberto	0,00%	5%	-	0%	0%	1%
Art. 7º, VII, "c" - FI Debêntures	0,00%	5%	-	0%	0%	1%
Renda Variável e Investimentos Estruturados	3,70%	30%				
Art. 8º, I, "a" - FI Renda Variável	0,00%	30%	20%	0%	0%	10%
Art. 8º, I, "b" - FI de Índices de Renda Variável	0,00%	30%	20%	0%	0%	10%
Art. 8º, II, "a" - FIA - Fundo de Ações	0,00%	20%	-	0%	5%	20%
Art. 8º, II, "b" - FI de Índices de Renda Variável	0,00%	20%	-	0%	1%	10%
Art. 8º, III - FI Multimercado - FIM	0,00%	10%	-	0%	5%	10%
Art. 8º, IV, "a" - FI em Participações - FIP	1,72%	5%	-	0%	2%	3%
Art. 8º, IV, "b" - FI Imobiliário - FII	1,98%	5%	-	0%	2%	3%
Art. 8º, IV, "c" - Mercado de Acesso	0,00%	5%	-	0%	0%	4%
Investimento no Exterior	0,00%	10%				
Art. 9º, I, "a" - Renda Fixa - Dívida Externa	0,00%	10%	-	0%	0%	10%
Art. 9º, II, "a" - Investimento no Exterior	0,00%	10%	-	0%	0%	10%
Art. 9º, III, "a" - Ações - BDR Nível I	0,00%	10%	-	0%	1%	10%
Aplicações	99,74%					
Imóveis	0,00%					
Conta Corrente	0,26%					
Carteira	100,00%					



Pode-se observar a rentabilidade dos principais índices do mercado financeiro que influenciam diretamente na rentabilidade dos ativos que o Instituto de Previdência e Assistência dos Servidores do Município de Porto Velho aloca seus recursos. Também é possível verificar o histórico de rentabilidade dos fundos de investimentos da carteira.

Indicadores

	IRF-M	IRF-M 1	CDI	IMA-B	IDKA 2	Poupança	IPCA	Ibovespa	Dólar	Selic	IPCA + 6%
2019	12,03%	6,76%	5,95%	22,94%	11,82%	4,33%	4,31%	31,58%	4,02%	4,50%	10,56%
fev-19	0,29%	0,47%	0,49%	0,55%	0,53%	0,37%	0,43%	-1,86%	2,37%	6,50%	0,92%
mar-19	0,59%	0,47%	0,47%	0,58%	0,67%	0,37%	0,75%	-0,18%	4,23%	6,50%	1,24%
abr-19	0,61%	0,50%	0,52%	1,51%	1,03%	0,37%	0,57%	0,98%	1,25%	6,50%	1,06%
mai-19	1,77%	0,68%	0,54%	3,66%	1,37%	0,37%	0,13%	0,70%	-0,12%	6,50%	0,62%
jun-19	2,16%	0,58%	0,47%	3,73%	1,23%	0,37%	0,01%	4,06%	-2,75%	6,50%	0,50%
jul-19	1,09%	0,72%	0,57%	1,29%	1,02%	0,37%	0,19%	0,84%	-1,76%	6,00%	0,68%
ago-19	0,26%	0,55%	0,50%	-0,40%	0,08%	0,37%	0,11%	-0,67%	9,92%	6,00%	0,60%
set-19	1,44%	0,64%	0,46%	2,86%	1,60%	0,34%	-0,04%	3,57%	0,63%	5,50%	0,45%
out-19	1,70%	0,62%	0,48%	3,36%	1,23%	0,34%	0,10%	2,36%	-3,85%	5,00%	0,59%
nov-19	-0,46%	0,33%	0,38%	-2,45%	0,01%	0,32%	0,51%	0,95%	5,49%	5,00%	1,00%
dez-19	0,62%	0,42%	0,37%	2,01%	1,20%	0,29%	1,15%	6,85%	-4,58%	4,50%	1,64%
jan-20	0,88%	0,44%	0,38%	0,26%	0,54%	0,26%	0,21%	-1,63%	5,92%	4,50%	0,70%
12 meses	11,47%	6,62%	5,78%	18,11%	11,02%	4,21%	4,19%	16,80%	16,91%	-	10,44%
2020	0,88%	0,44%	0,38%	0,26%	0,54%	0,26%	0,21%	-1,63%	5,92%	4,50%	0,70%



Rentabilidade

Fundos	2019	12 meses	nov/19	dez/19	jan/20	2020
Renda Fixa						
Art. 7º, I, "b" - FI (100% TPF) - IMA ou IDKA						
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6,49%	6,33%	0,31%	0,40%	0,42%	0,42%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	22,64%	17,83%	-2,48%	1,97%	0,26%	0,26%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10,46%	9,21%	0,43%	0,92%	0,20%	0,20%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11,20%	10,29%	0,21%	1,15%	0,38%	0,38%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6,55%	6,40%	0,31%	0,40%	0,42%	0,42%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13,07%	11,38%	-0,94%	0,96%	0,49%	0,49%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11,19%	10,30%	0,01%	1,10%	0,46%	0,46%
Art. 7º, IV, "a" - FI Referenciado RF ou RF						
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	5,74%	5,55%	0,34%	0,35%	0,35%	0,35%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,82%	4,65%	0,29%	0,28%	0,29%	0,29%
Renda Variável						
Art. 8º, IV, "a" - FI em Participações - FIP						
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11		-0,35%	-0,03%	-0,03%	-0,03%	-0,03%
Art. 8º, IV, "b" - FI Imobiliário - FII						
ÁQUILLA FII - AQLL11		-11,78%	-0,15%	3,08%	-0,17%	-0,17%

*Relatório de
Investimentos
Administrativo*

Janeiro de 2020



*Instituto de Previdência e
Assistência dos Servidores do
Município de Porto Velho*

Abaixo é demonstrado a rentabilidade mensal e acumulada da carteira de investimentos, assim como o retorno financeiro. O Instituto de Previdência e Assistência dos Servidores do Município de Porto Velho obteve no mês de janeiro um retorno de R\$ 96.831,13, equivalente a 0,43%. Assim, no ano de 2020 acumulou-se um retorno de R\$ 96.831,13 representando uma rentabilidade de 0,43%

Relatório de Risco:

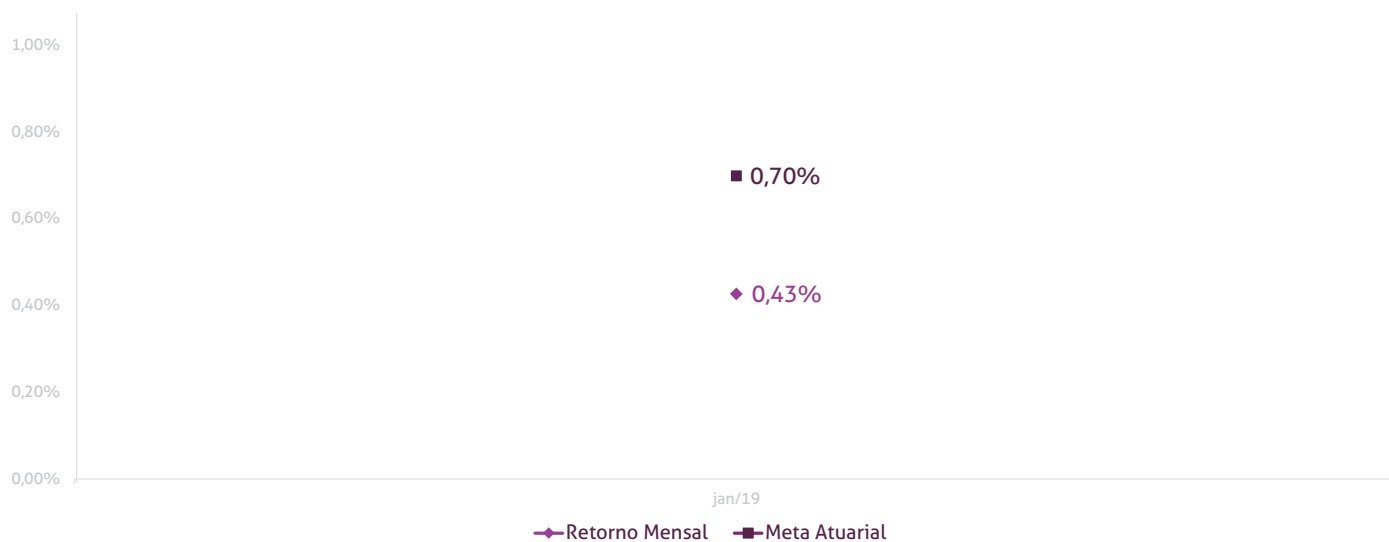
Performance Absoluta

	jan-20	fev-20	mar-20	abr-20	mai-20	jun-20
Carteira	0,43%					
Retorno Financeiro	96.831,13					
Meta Atuarial	0,70%					

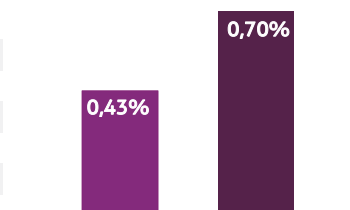
	jul-20	ago-20	set-20	out-20	nov-20	dez-20
Carteira						
Retorno Financeiro						
Meta Atuarial						

Retorno Mensal X Meta Atuarial Mensal

**Meta
IPCA + 6%**



Estatística			Consolidado - 2020	
Meses acima da Meta Atuarial:	0		Carteira	0,43%
Meses abaixo da Meta Atuarial:	1		Retorno	R\$ 96.831,13
Retorno Mensal Máximo	0,43%	jan-20	Meta	0,70%
Retorno Mensal Médio	0,43%		Meta Atuarial	IPCA + 6%
Retorno Mensal Mínimo	0,43%	jan-20	Retorno 2019	R\$2.308.346,63
			Retorno 2018	R\$2.011.206,94
			Retorno 2017	R\$2.457.743,03



No extrato consolidado é exibido o detalhamento da carteira de investimentos do Instituto de Previdência e Assistência dos Servidores do Município de Porto Velho durante o exercício de 2020, assim como suas movimentações e realocações do período. No mês de janeiro observou-se o total de -R\$ 600.000,00 em resgates.

Extrato Consolidado

Porto Velho - Administrativo

Janeiro de 2020

jan/20

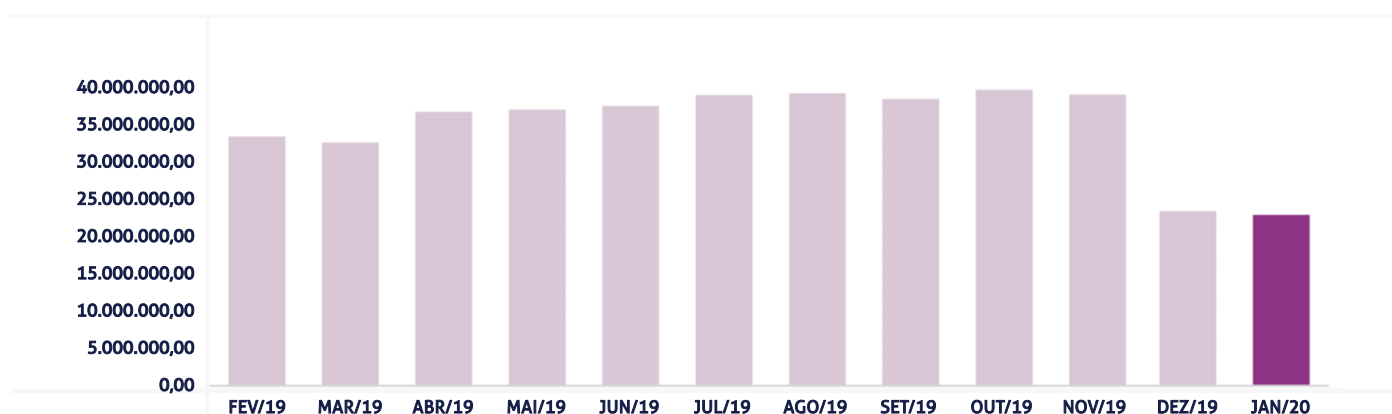
Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 2757-X cc 8808-0	23.336.838,55		-600.000,00		96.831,13	0,42%	22.833.669,68
Aplicações		23.336.838,55						22.833.669,68
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		0,00						4.475,56
Banco do Brasil 8808-0		0,00						4.475,56
Final		23.336.838,55	0,00	-600.000,00	0,00	96.831,13	0,43%	22.838.145,24

O Instituto de Previdência e Assistência dos Servidores do Município de Porto Velho encerrou o mês de Janeiro com R\$ 22.838.145,24 em seu Patrimônio Líquido, representando uma perda de -R\$ 498.693,31 com relação ao mês anterior e uma perda de -R\$ 498.693,31 com relação ao exercício de 2020. Observando o histórico dos últimos doze meses, obteve um decréscimo de -32,62%.

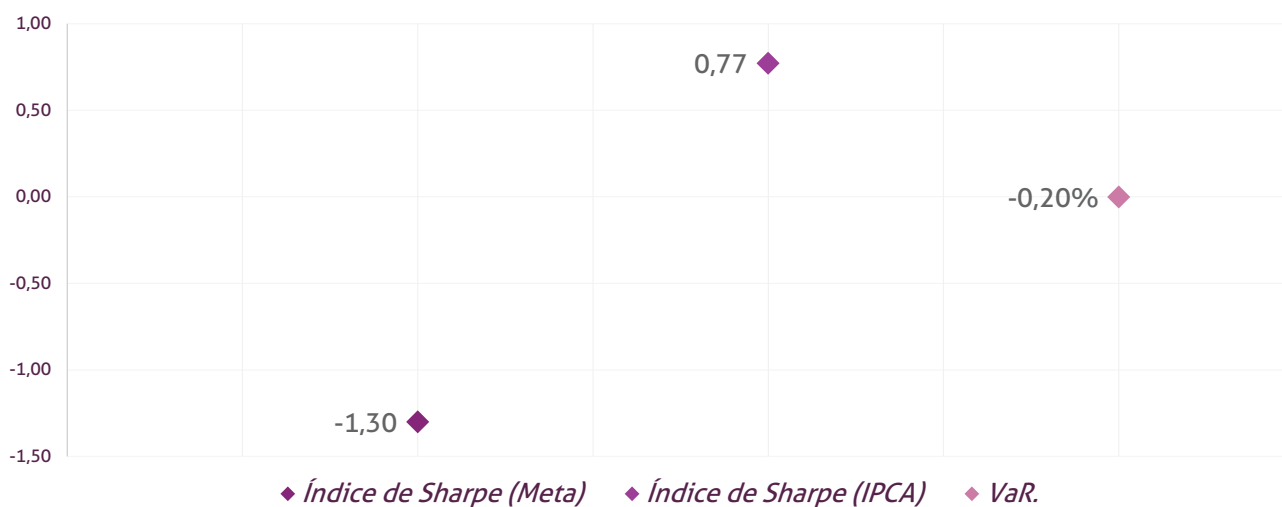
Evolução Patrimônio Líquido

Saldo inicial do ano (31/12/2019)	Evolução nos últimos 12 meses	Evolução em 2020
R\$ 23.336.838,55	-32,62%	-2,14%

Jan	22.838.145,24	Fev	Mar	Abr
Mai	Jun	Jul	Ago	Set
Out	Nov	Dez		



Índice de Sharpe e Var da Carteira



*Relatório de
Investimentos
Capitalizado
Janeiro de 2020*



*Instituto de Previdência e
Assistência dos Servidores do
Município de Porto Velho*

Abaixo é demonstrado a rentabilidade mensal e acumulada da carteira de investimentos, assim como o retorno financeiro. O Instituto de Previdência e Assistência dos Servidores do Município de Porto Velho obteve no mês de janeiro um retorno de R\$ 1.503.774,89, equivalente a 0,35%. Assim, no ano de 2020 acumulou-se um retorno de R\$ 1.503.774,89 representando uma rentabilidade de 0,35%

Relatório de Risco:

Performance Absoluta

	jan-20	fev-20	mar-20	abr-20	mai-20	jun-20
Carteira	0,35%					
Retorno Financeiro	1.503.774,89					
Meta Atuarial	0,70%					

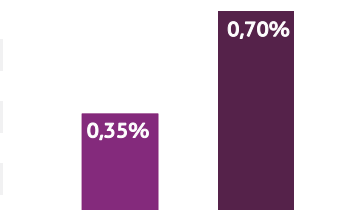
	jul-20	ago-20	set-20	out-20	nov-20	dez-20
Carteira						
Retorno Financeiro						
Meta Atuarial						

Retorno Mensal X Meta Atuarial Mensal

**Meta
IPCA + 6%**



Estatística			Consolidado - 2020	
Meses acima da Meta Atuarial:	0		Carteira	0,35%
Meses abaixo da Meta Atuarial:	1		Retorno	R\$ 1.503.774,89
Retorno Mensal Máximo	0,35%	jan-20	Meta	0,70%
Retorno Mensal Médio	0,35%		Meta Atuarial	IPCA + 6%
Retorno Mensal Mínimo	0,35%	jan-20	Retorno 2019	R\$36.730.866,59
			Retorno 2018	R\$22.967.884,84
			Retorno 2017	R\$26.388.954,40



No extrato consolidado é exibido o detalhamento da carteira de investimentos do Instituto de Previdência e Assistência dos Servidores do Município de Porto Velho durante o exercício de 2020, assim como suas movimentações e realocações do período. No mês de janeiro observou-se o total de R\$ 3.751.897,29 em aplicações e o total de -R\$ 156.600,00 em resgates.

Extrato Consolidado

Porto Velho - Capitalizado

Janeiro de 2020

jan/20

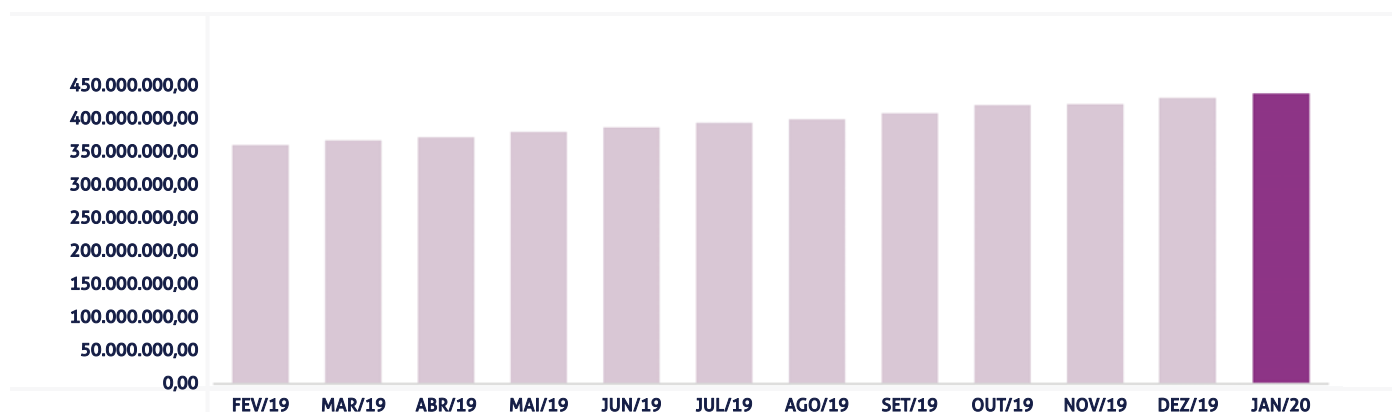
Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 2757-X cc 8809-9	15.969.816,68				31.398,40	0,20%	16.001.215,08
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 2757-X cc 8809-9	17.495.981,13	3.751.897,29	-156.600,00		73.660,36	0,42%	21.164.938,78
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 0632 cc 755-8	93.690.206,72				395.909,17	0,42%	94.086.115,89
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 2757-X cc 8809-9	162.469.086,71				422.399,50	0,26%	162.891.486,21
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 2757-X cc 8809-9	88.685.048,46				341.426,79	0,38%	89.026.475,25
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 2757-X cc 8809-9	42.828.163,48				208.076,63	0,49%	43.036.240,11
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 2757-X cc 8809-9	8.834.033,76				30.904,04	0,35%	8.864.937,80
Aplicações		429.972.336,94						435.071.409,12
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		0,00						1.665.045,22
Caixa 755-8		0,00						0,00
Banco do Brasil 8809-9		0,00						1.665.045,22
Final		429.972.336,94	3.751.897,29	-156.600,00	0,00	1.503.774,89	0,35%	436.736.454,34

O Instituto de Previdência e Assistência dos Servidores do Município de Porto Velho encerrou o mês de Janeiro com R\$ 436.736.454,34 em seu Patrimônio Líquido, representando um aumento de R\$ 6.764.117,40 com relação ao mês anterior e um aumento de R\$ 6.764.117,40 com relação ao exercício de 2020. Observando o histórico dos últimos doze meses, obteve um crescimento de 23,17%.

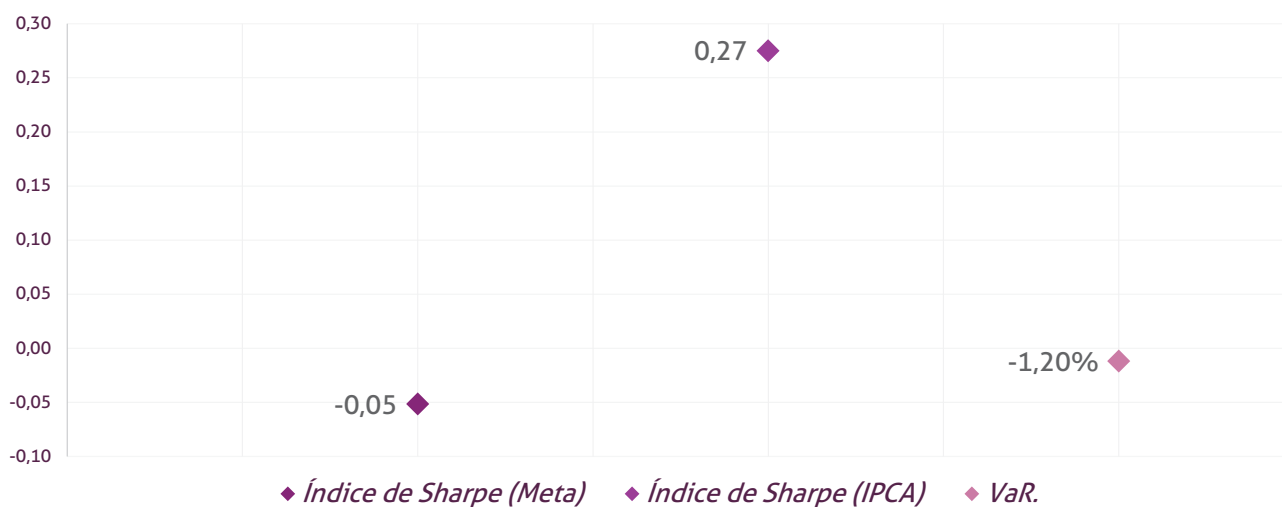
Evolução Patrimônio Líquido

Saldo inicial do ano (31/12/2019)	Evolução nos últimos 12 meses	Evolução em 2020
R\$ 429.972.336,94	23,17%	1,57%

Jan	436.736.454,34	Fev	Mar	Abr
Mai	Jun	Jul	Ago	Set
Out	Nov	Dez		



Índice de Sharpe e Var da Carteira



*Relatório de
Investimento
Financeiro
Janeiro de 2020*



*Instituto de Previdência e
Assistência dos Servidores do
Município de Porto Velho*

Abaixo é demonstrado a rentabilidade mensal e acumulada da carteira de investimentos, assim como o retorno financeiro. O Instituto de Previdência e Assistência dos Servidores do Município de Porto Velho obteve no mês de janeiro um retorno de R\$ 774.072,08, equivalente a 0,35%. Assim, no ano de 2020 acumulou-se um retorno de R\$ 774.072,08 representando uma rentabilidade de 0,35%

Relatório de Risco:

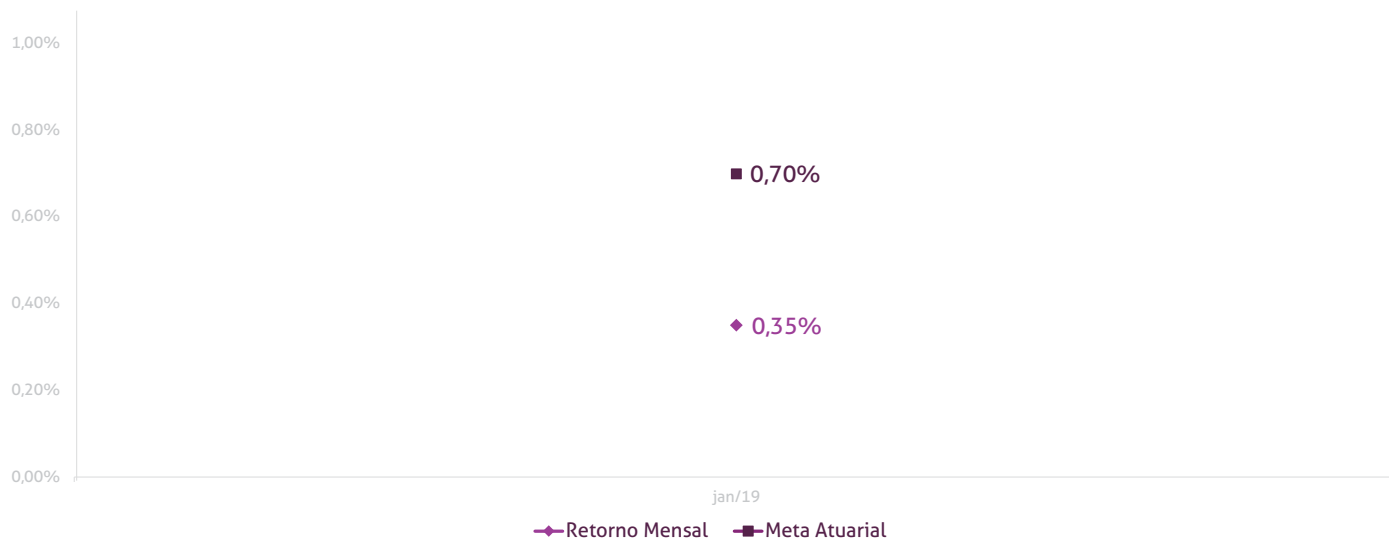
Performance Absoluta

	jan-20	fev-20	mar-20	abr-20	mai-20	jun-20
Carteira	0,35%					
Retorno Financeiro	774.072,08					
Meta Atuarial	0,70%					

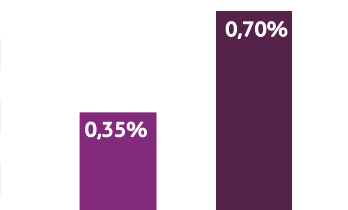
	jul-20	ago-20	set-20	out-20	nov-20	dez-20
Carteira						
Retorno Financeiro						
Meta Atuarial						

Retorno Mensal X Meta Atuarial Mensal

**Meta
IPCA + 6%**



Estatística			Consolidado - 2020	
Meses acima da Meta Atuarial:	0		Carteira	0,35%
Meses abaixo da Meta Atuarial:	1		Retorno	R\$ 774.072,08
Retorno Mensal Máximo	0,35%	jan-20	Meta	0,70%
Retorno Mensal Médio	0,35%		Meta Atuarial	IPCA + 6%
Retorno Mensal Mínimo	0,35%	jan-20	Retorno 2019	R\$16.003.845,50
			Retorno 2018	R\$13.516.968,62
			Retorno 2017	R\$19.827.745,62



No extrato consolidado é exibido o detalhamento da carteira de investimentos do Instituto de Previdência e Assistência dos Servidores do Município de Porto Velho durante o exercício de 2020, assim como suas movimentações e realocações do período. No mês de janeiro observou-se o total de R\$ 8.461.996,03 em aplicações e o total de -R\$ 9.931.631,15 em resgates.

Extrato Consolidado

Porto Velho - Financeiro

Janeiro de 2020

jan/20

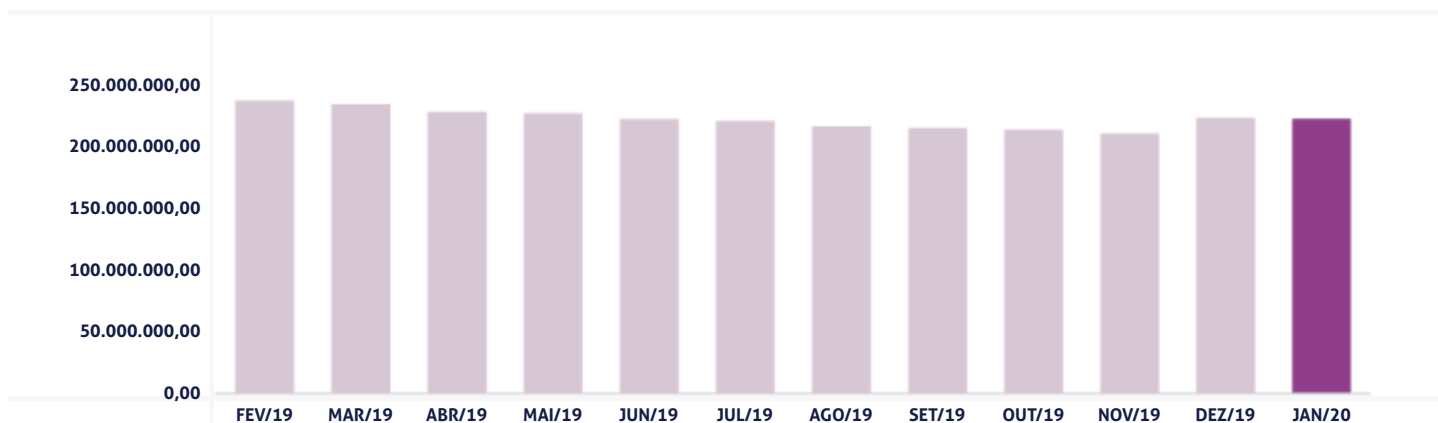
Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 2757-X cc 7219-2	20.592.564,46	4.767.365,51	-9.755.925,00		77.650,34	0,42%	15.681.655,31
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 2757-X cc 9143-X	7.737.515,20				32.446,88	0,42%	7.769.962,08
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 2757-X cc 8160-4	0,00	847.831,88			373,01	0,38%	848.204,89
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 2757-X cc 9143-X	39.596.124,74				152.440,33	0,38%	39.748.565,07
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 0632 cc 2378-2	16.768.681,15				70.859,85	0,42%	16.839.541,00
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 2757-X cc 8160-4	25.444.381,10				66.152,24	0,26%	25.510.533,34
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 0632 cc 2378-2	86.489.410,02				395.389,61	0,46%	86.884.799,63
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 2757-X cc 7925-1	938.188,59	2.846.798,64	-175.706,15		5.125,00	0,29%	3.614.406,08
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11		11.664.656,45				-3.472,99	-0,03%	11.661.183,46
ÁQUILLA FII - AQLL11		13.499.406,82				-22.892,19	-0,17%	13.476.514,63
Aplicações		222.730.928,53						222.035.365,49
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		0,00						70.622,68
Caixa 2378-2		0,00						0,00
Banco do Brasil 7925-1		0,00						0,00
Banco do Brasil 8160-4		0,00						0,00
Banco do Brasil 9143-X		0,00						0,00
Banco do Brasil 7219-2		0,00						70.622,68
Final		222.730.928,53	8.461.996,03	-9.931.631,15	0,00	774.072,08	0,35%	222.105.988,17

O Instituto de Previdência e Assistência dos Servidores do Município de Porto Velho encerrou o mês de Janeiro com R\$ 222.105.988,17 em seu Patrimônio Líquido, representando uma perda de -R\$ 624.940,36 com relação ao mês anterior e uma perda de -R\$ 624.940,36 com relação ao exercício de 2020. Observando o histórico dos últimos doze meses, obteve um decréscimo de -6,44%.

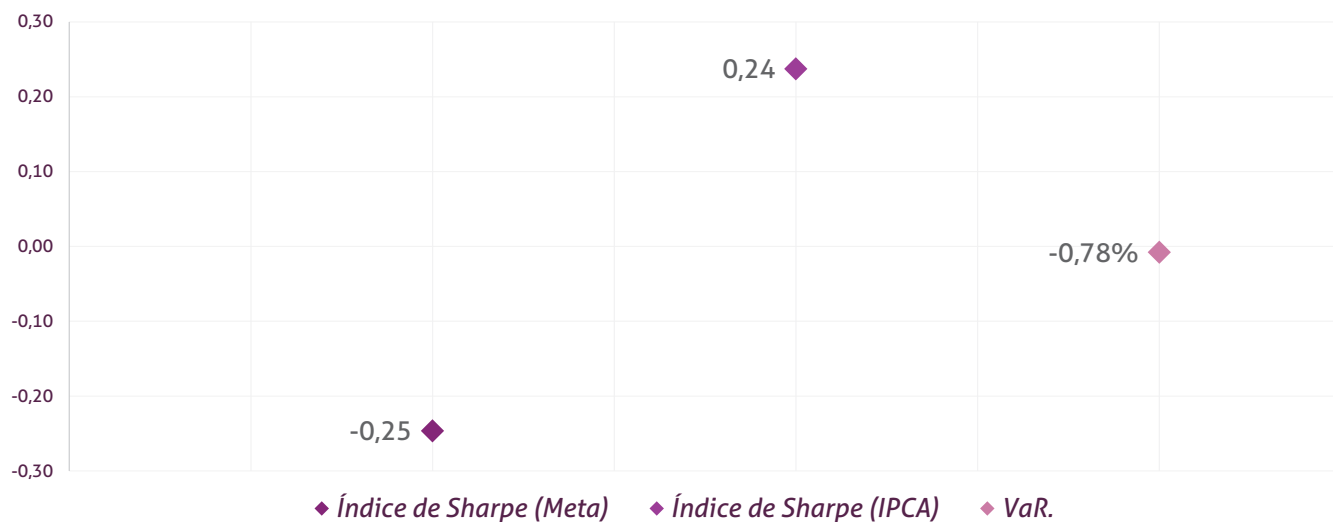
Evolução Patrimônio Líquido

Saldo inicial do ano (31/12/2019)	Evolução nos últimos 12 meses	Evolução em 2020
R\$ 222.730.928,53	-6,44%	-0,28%

Jan	222.105.988,17	Fev	Mar	Abr
Mai	Jun	Jul	Ago	
Set	Out	Nov	Dez	



Índice de Sharpe e Var da Carteira



EUA & China

O ano começou com perspectivas favoráveis da concretização do acordo comercial entre EUA e China e da melhora potencial de indicadores econômicos de ambos os países.

A tensão entre EUA e Irã aumentou após ataque americano que matou general iraniano, também, a epidemia do Coronavírus na China com relatos de surgimento da doença em outros países pelo globo, assim como, a aproximação das primeiras convenções estaduais relativas à eleição norte-americana de 2020 pressionaram o prêmio de risco, porém, ainda assim ocorreu deslocamento para baixo das curvas de juros globais com seus consequentes aumentos de preços.

Em relação ao Irã, a rápida escalada nas tensões após a morte do general Qasem Soleimani foi interrompida de maneira bilateral e não tende a ter repercussões adicionais.



Quanto ao Coronavírus, assunto dominante em janeiro, cabe ressaltar que a epidemia é uma tragédia do ponto de vista humanitário, mas no plano econômico restaram dúvidas sobre o impacto econômico de médio prazo tendo em vista de ainda não ter trazido reflexo relevante nos prêmios de risco. Autoridades monetárias, contudo, já mencionaram a possibilidade de corte de juros caso a epidemia cause impacto de desaceleração econômica.



Em janeiro houve reunião do Fed, banco central norte americano, que justificou a manutenção da taxa básica de juros com os bons números da atividade econômica e do mercado de trabalho, o qual não exigia como necessária a redução da taxa de juros como meio de estimular o setor produtivo.

Setor Externo

Indicadores de atividade econômica divulgados em janeiro corroboraram desaceleração da atividade produtiva do Reino Unido, com retração de 0,3% de novembro ante outubro. Ainda no Reino Unido, no último dia do mês foi dado andamento ao Brexit, processo de saída do Reino Unido da União Europeia, com isso, terá prazo de apenas 11 meses para fechar acordos comerciais.

Brasil

No Brasil, ainda em recesso parlamentar, as novidades se concentraram nos dados de atividade econômica e inflação. Após meses de atividade forte, setembro e outubro, indicadores de novembro e dezembro frustraram parte das expectativas e sugeriram continuidade da lenta recuperação da atividade produtiva. Por outro lado, indicadores do mercado de trabalho e crédito seguiram indicando recuperação contínua.

Com relação aos preços, a antecipação do choque de preços de proteínas e sua dissipação em velocidade acima do esperado fez com que as expectativas expressas no relatório FOCUS fossem revisadas para baixo, com projeções ligeiramente inferiores à meta de inflação para o ano.

Em entrevista, o presidente do Banco Central disse entender que o aumento de preços causado majoritariamente pela carne está se dissipando e não há perspectiva de que continue pressionando o IPCA para cima.

Mercado

O Ibovespa terminou o mês de janeiro com desvalorização de -1,63%, aos 113.760 pontos.

O CDI teve rentabilidade de +0,38% no mês, com acumulado de +5,76% em 12 meses. Pela cotação

do Banco Central, Ptax 800, o dólar teve valorização de +5,92%, cotado a R\$ 4,2695.



O IRF-M 1 apresentou variação de +0,44%, com acumulado de 6,58% nos últimos 12 meses. O IMA-B variou 0,26% no mês, com acumulado de 17,54% em 12 meses e, por fim, o IDKA IPCA 2 ANOS rendeu +0,54% no mês, com acumulado de 10,92% nos últimos 12 meses.

Luiz Arthur Hotz Fierozzi
SETE CAPITAL CONSULTORIA LTDA
CNPJ: 14.057.808/0001-10