

*Relatório de  
Investimentos  
Fevereiro de 2020*



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

## Ficha Cadastral Fevereiro de 2020

### Dados do Ente Federativo

|                  |  |
|------------------|--|
| Ente Federativo  | <b>Prefeitura Municipal de Porto Velho</b> |
| CNPJ             | <b>05.903.125/0001-45</b>                  |
| Endereço         | <b>Rua Dom Pedro II, S/N</b>               |
| E-mail           | <b>gabineteprefeitopvh@gmail.com</b>       |
| Telefone         | <b>(69) 3901-0001</b>                      |
| Prefeito         | <b>HILDON DE LIMA CHAVES</b>               |
| Início da Gestão | <b>01/01/2017</b>                          |
| E-mail           | <b>gabineteprefeitopvh@gmail.com</b>       |

### Dados da Unidade Gestora do RPPS do Município de Porto Velho

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

|                     |                               |                    |                                      |
|---------------------|-------------------------------|--------------------|--------------------------------------|
| Representante Legal | <b>Ivan Furtado Oliveira</b>  | Gestor de Recursos | <b>Odilon Jose de Santana Júnior</b> |
| Cargo               | <b>Presidente</b>             | Cargo              | <b>Gestor</b>                        |
| Início da Gestão    | <b>06/03/2017</b>             | Início da Gestão   | <b>03/01/2017</b>                    |
| E-mail              | <b>ivan.furtado@gmail.com</b> | E-mail             | <b>odilon@ipam.ro.gov.br</b>         |
| Telefone            |                               | Telefone           | <b>(69) 3211-8134</b>                |
| Certificação        |                               | Certificação       | <b>CEA</b>                           |
| Validade            |                               | Validade           | <b>06/03/2021</b>                    |

### Membros da Unidade Gestora do RPPS do Município de Porto Velho

#### Colegiado Deliberativo

#### Conselho de Fiscalização

#### Comitê de Investimentos

|                                |  |                                |
|--------------------------------|--|--------------------------------|
| José Maria Miranda Martins     |  | NOEL LEITE DA SILVA            |
| Silvio Ney Leal Santos         |  | RODRIGO FERREIRA SOARES        |
| Ediney Ferreira da Silva       |  | MARIA IRISNEY BARBOSA DE SOUZA |
| Sergio da Mota de Moraes       |  | IVAN FURTADO OLIVEIRA          |
| Sidivam Costa Pereira          |  | ODILON JOSE DE SANTANA JUNIOR  |
| 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      |  |                                |

### Atenção!

Qualquer alteração dos dados cadastrais como Prefeito, Gestor e membros dos Conselhos e Comitê, devem nos solicitar a Ficha Cadastral através do e-mail [relatorio@setecapitalrpps.com.br](mailto: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](mailto: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) 3773-1604

**Departamento de Investimentos | e-mail: [comercial@setecapitalrpps.com.br](mailto: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.: Reiter  
Consultor Interno: Beatriz

Tel Ramal.: (62) 3773-1634  
Tel Ramal.: (62) 3773-1629

**Departamento Financeiro | e-mail: [financeiro@setecapitalrpps.com.br](mailto: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](mailto: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](mailto: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](mailto: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](mailto: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 fevereiro um retorno de -R\$ 1.295.699,97, equivalente a -0,19%. Assim, no ano de 2020 acumulou-se um retorno de R\$ 1.078.978,13 representando uma rentabilidade de 0,16%

## Relatório de Risco:

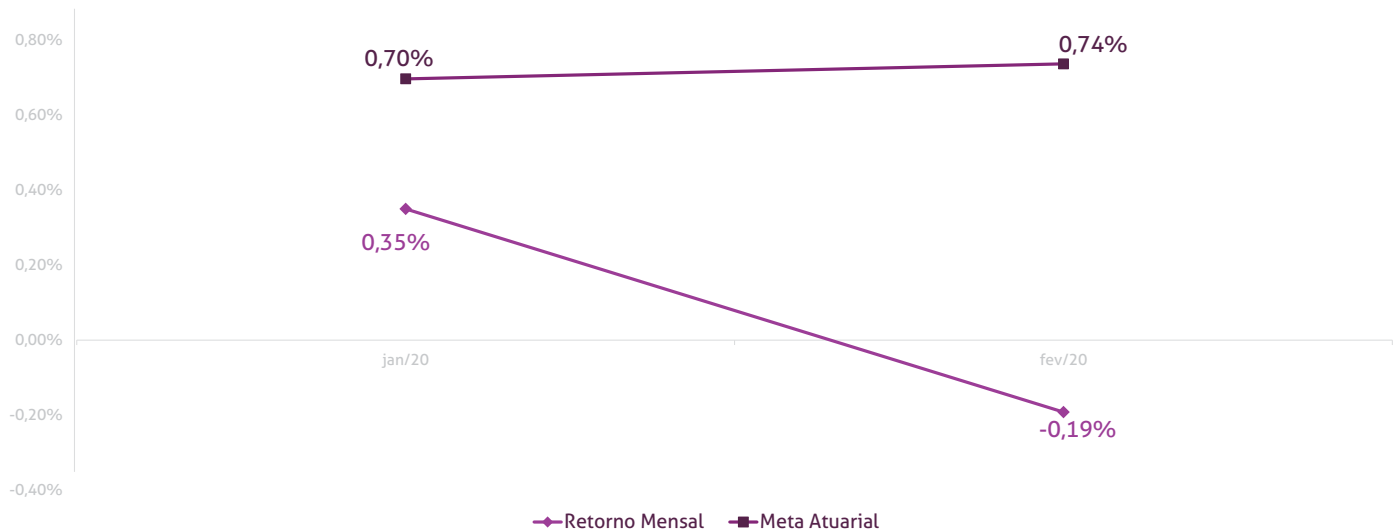
### Performance Absoluta

|                    | jan-20       | fev-20        | mar-20 | abr-20 | mai-20 | jun-20 |
|--------------------|--------------|---------------|--------|--------|--------|--------|
| Carteira           | 0,35%        | -0,19%        |        |        |        |        |
| Retorno Financeiro | 2.374.678,10 | -1.295.699,97 |        |        |        |        |
| Meta Atuarial      | 0,70%        | 0,74%         |        |        |        |        |

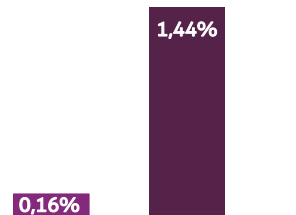
|                    | jul-20 | ago-20 | set-20 | out-20 | nov-20 | dez-20 |
|--------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Carteira           |        |        |        |        |        |        |
| Retorno Financeiro |        |        |        |        |        |  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

### Retorno Mensal X Meta Atuarial Mensal

**Meta  
IPCA + 6%**



| Estadística                    | Consolidado - 2020 |                               |
|--------------------------------|--------------------|-------------------------------|
| Meses acima da Meta Atuarial:  | 0                  | Carteira 0,16%                |
| Meses abaixo da Meta Atuarial: | 2                  | Retorno R\$ 1.078.978,13      |
| Retorno Mensal Máximo          | 0,35% jan-20       | Meta 1,44%                    |
| Retorno Mensal Médio           | 0,08%              | Meta Atuarial IPCA + 6%       |
| Retorno Mensal Mínimo          | -0,19% fev-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 fevereiro observou-se o total de R\$ 204.473.339,36 em aplicações e o total de -R\$ 209.898.611,79 em resgates.

## Extrato Consolidado

Porto Velho

Fevereiro 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         |
| <b>Aplicações</b>   |                      | <b>676.040.104,02</b> |                      |                       |             |                     |              | <b>679.940.444,29</b> |
| <b>Imóveis</b>  |                      | <b>0,00</b>           |                      |                       |             |                     |              | <b>0,00</b>           |
| <b>Conta Corrente</b>                                       |                      | <b>0,00</b>           |                      |                       |             |                     |              | <b>1.740.143,46</b>   |
| 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             |
| <b>Final</b>  |                      | <b>676.040.104,02</b> | <b>12.213.893,32</b> | <b>-10.688.231,15</b> | <b>0,00</b> | <b>2.374.678,10</b> | <b>0,35%</b> | <b>681.680.587,75</b> |

fev/20

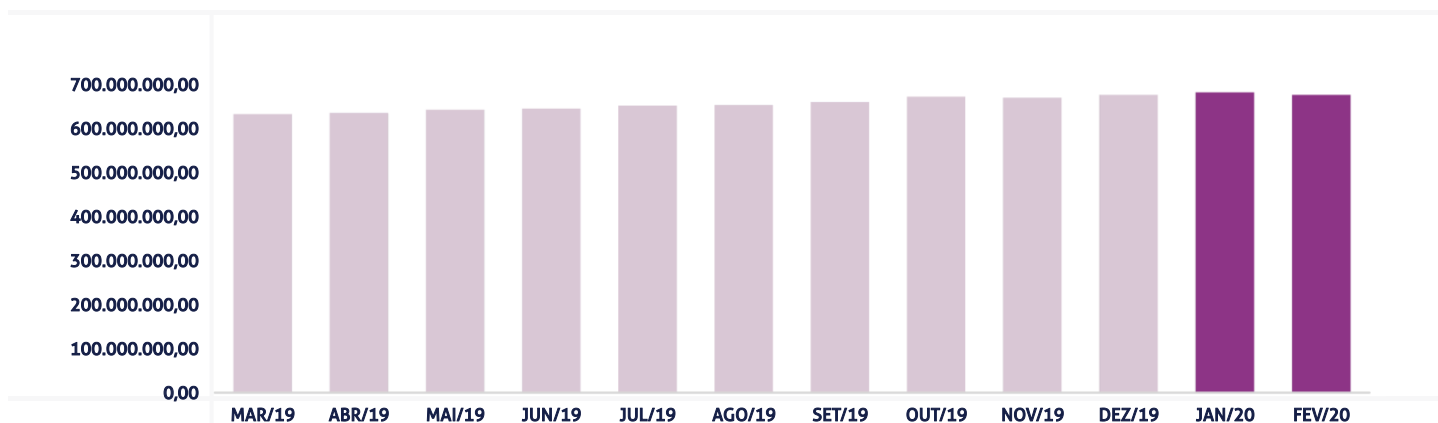
| Aplicações  | Cc vinculada         | Financeiro Inicial | Aplicação      | Resgate         | Amortização | Rendimento    | Rent. % | Total          |
|---|----------------------|--------------------|----------------|-----------------|-------------|---------------|---------|----------------|
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | Ag. 2757-X cc 9143-X | 7.769.962,08       |                |                 |             | 27.423,37     | 0,35%   | 7.797.385,45   |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | Ag. 2757-X cc 7219-2 | 15.681.655,31      | 1.689.103,60   | -6.675.000,00   |             | 49.720,87     | 0,35%   | 10.745.479,78  |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | Ag. 2757-X cc 8808-0 | 22.833.669,68      |                | -1.111.000,00   |             | 78.824,47     | 0,35%   | 21.801.494,15  |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | Ag. 2757-X cc 8809-9 | 21.164.938,78      | 200.000,00     | -21.171.977,28  |             | 7.108,28      | 0,35%   | 200.069,78     |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO      | Ag. 2757-X cc 8809-9 | 162.891.486,21     |                | -100.040.000,00 |             | 623.324,66    | 0,44%   | 63.474.810,87  |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO      | Ag. 2757-X cc 8160-4 | 25.510.533,34      |                | -25.599.374,44  |             | 88.841,10     | 0,44%   | 0,00           |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO        | Ag. 2757-X cc 8809-9 | 16.001.215,08      |                | -420.449,90     |             | 65.614,37     | 0,41%   | 15.646.379,55  |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | Ag. 2757-X cc 8809-9 | 89.026.475,25      | 123.661.981,71 |                 |             | 1.212.555,27  | 0,63%   | 213.901.012,23 |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | Ag. 2757-X cc 8160-4 | 848.204,89         | 25.609.094,57  |                 |             | 45.674,56     | 0,63%   | 26.502.974,02  |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | Ag. 2757-X cc 9143-X | 39.748.565,07      |                |                 |             | 249.688,11    | 0,63%   | 39.998.253,18  |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | Ag. 0632 cc 755-8    | 94.086.115,89      |                |                 |             | 341.771,25    | 0,36%   | 94.427.887,14  |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | Ag. 0632 cc 2378-2   | 16.839.541,00      |                |                 |             | 61.170,25     | 0,36%   | 16.900.711,25  |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO             | Ag. 2757-X cc 8809-9 | 43.036.240,11      |                | -43.136.307,15  |             | 100.067,04    | 0,46%   | 0,00           |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | Ag. 0632 cc 2378-2   | 86.884.799,63      |                |                 |             | 522.573,78    | 0,60%   | 87.407.373,41  |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP  | Ag. 2757-X cc 8809-9 | 8.864.937,80       |                | -8.866.291,60   |             | 1.353,80      | 0,27%   | 0,00           |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                      | Ag. 2757-X cc 7925-1 | 3.614.406,08       | 423.159,48     | -2.878.211,42   |             | 6.052,90      | 0,22%   | 1.165.407,04   |
| BB SMALL CAPS FIC AÇÕES                                     | Ag. 2757-X cc 8809-9 | 0,00               | 52.890.000,00  |                 |             | -4.798.390,84 | -8,85%  | 48.091.609,16  |
| CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11                   |                      | 11.661.183,46      |                |                 |             | 40.011,16     | 0,34%   | 11.701.194,62  |
| ÁQUILLA FII - AQLL11  |                      | 13.476.514,63      |                |                 |             | -19.084,37    | -0,14%  | 13.457.430,26  |
| Aplicações  |                      | 679.940.444,29     |                |                 |             |               |         | 673.219.471,89 |
| Imóveis   |                      | 0,00               |                |                 |             |               |         | 0,00           |
| Conta Corrente  |                      | 1.740.143,46       |                |                 |             |               |         | 2.857.820,64   |
| 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                                      |                      | 4.475,56           |                |                 |             |               |         | 129.995,03     |
| Banco do Brasil 8160-4                                      |                      | 0,00               |                |                 |             |               |         | 0,00           |
| Banco do Brasil 9143-X                                      |                      | 0,00               |                |                 |             |               |         | 0,00           |
| Banco do Brasil 8809-9                                      |                      | 1.665.045,22       |                |                 |             |               |         | 1.664.370,35   |
| Banco do Brasil 7219-2                                      |                      | 70.622,68          |                |                 |             |               |         | 1.063.455,26   |
| FINAL   |                      | 681.680.587,75     | 204.473.339,36 | -209.898.611,79 | 0,00        | -1.295.699,97 | -0,19%  | 676.077.292,53 |

O Instituto de Previdência e Assistência dos Servidores do Município de Porto Velho encerrou o mês de Fevereiro com R\$ 676.077.292,53 em seu Patrimônio Líquido, representando uma desvalorização de -R\$ 5.603.295,22 com relação ao mês anterior e um aumento de R\$ 37.188,51 com relação ao exercício de 2019. Observando o histórico dos últimos doze meses, obteve um crescimento de 7,48%.

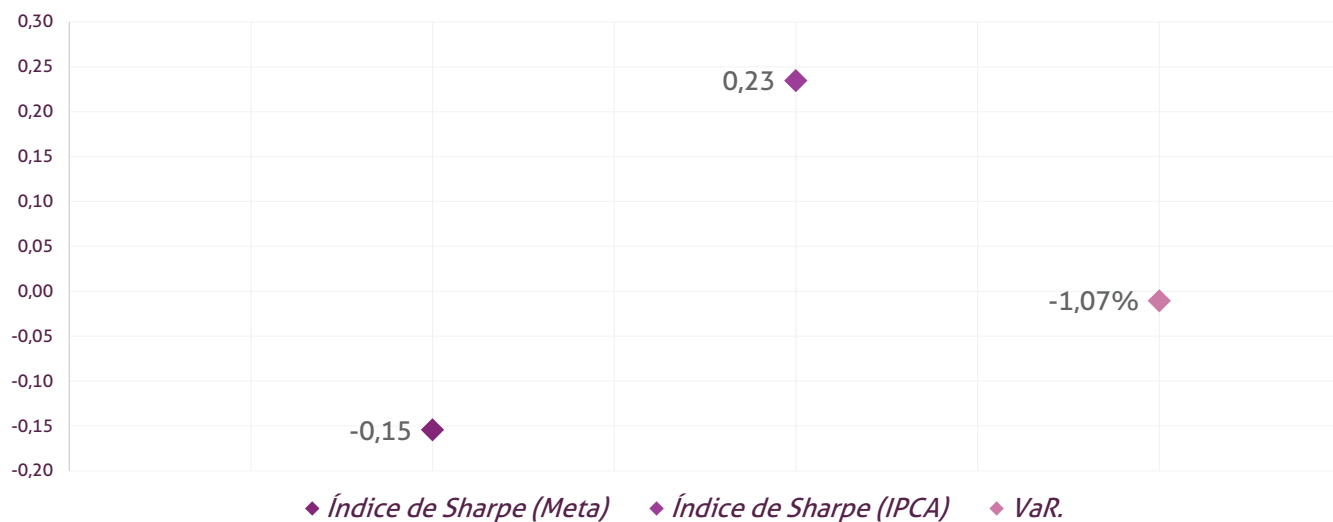
## Evolução Patrimônio Líquido

|                                   |                               |                  |
|-----------------------------------|-------------------------------|------------------|
| Saldo inicial do ano (31/12/2019) | Evolução nos últimos 12 meses | Evolução em 2020 |
| R\$ 676.040.104,02                | 7,48%                         | 0,01%            |

|            |                       |            |                       |            |            |
|------------|-----------------------|------------|-----------------------|------------|------------|
| <b>Jan</b> | <b>681.680.587,75</b> | <b>Fev</b> | <b>676.077.292,53</b> | <b>Mar</b> | <b>Abr</b> |
| <b>Mai</b> |                       | <b>Jun</b> |                       | <b>Jul</b> | <b>Ago</b> |
| <b>Set</b> |                       | <b>Out</b> |                       | <b>Nov</b> | <b>Dez</b> |



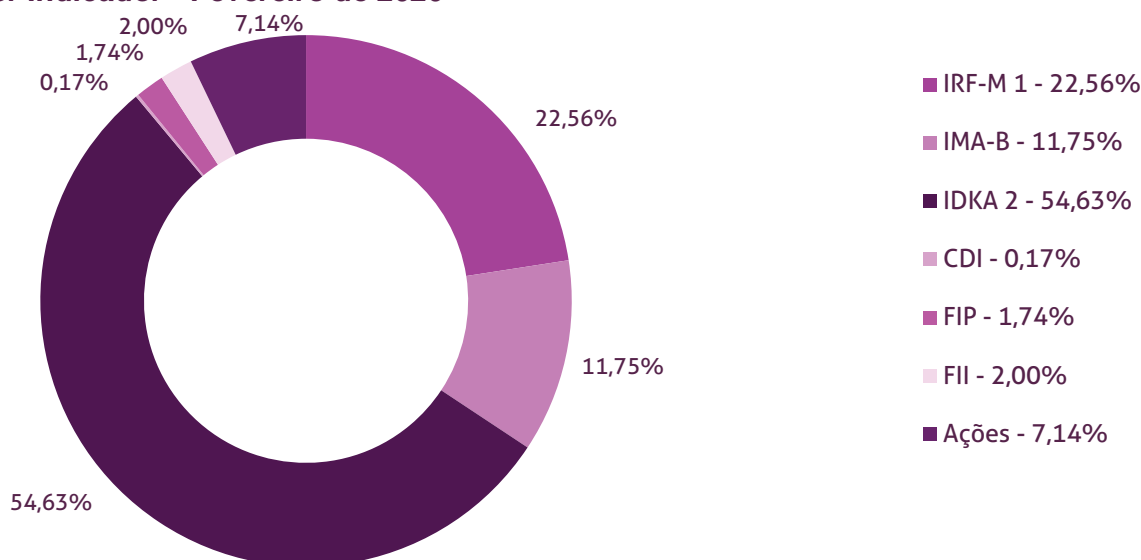
## Índice de Sharpe e Var da Carteira



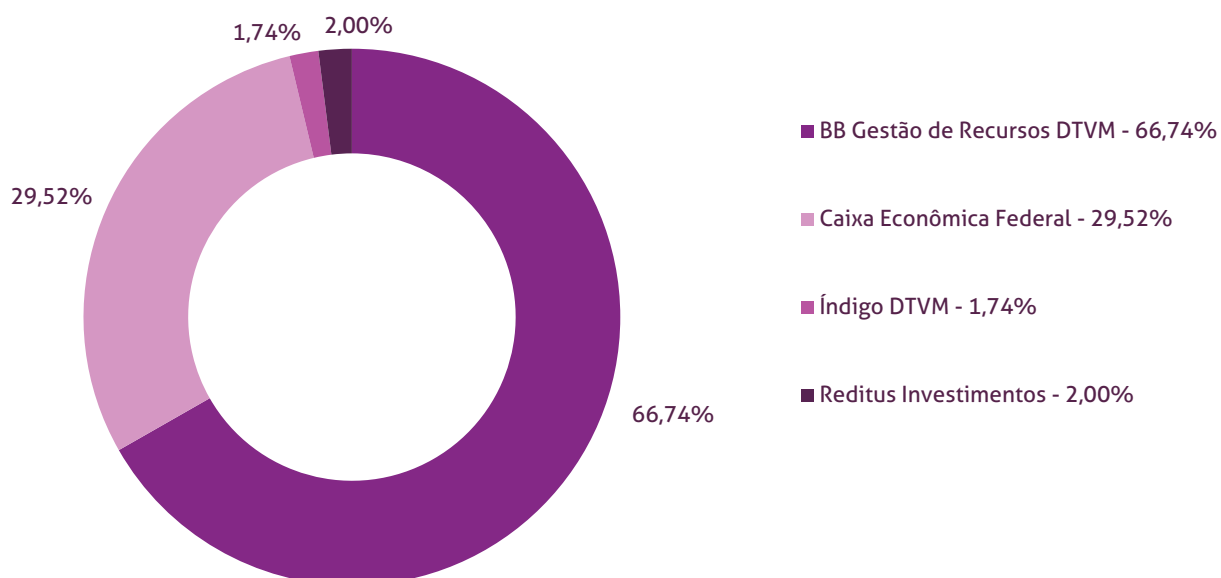
Durante o exercício de 2020, o Instituto de Previdência e Assistência dos Servidores do Município de Porto Velho alocou seus recursos nos Fundos de Investimentos listados abaixo. É possível observar algumas de suas principais características técnicas como: gestão, taxa de administração, benchmark e período 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 |
| BB SMALL CAPS FIC AÇÕES                                     | 05.100.221/0001-55 | BB Gestão de Recursos DTVM | 2,00%                 | Ações     | D+3 du        |

### Distribuição por Indicador - Fevereiro de 2020



### Distribuição por Instituição - Fevereiro de 2020



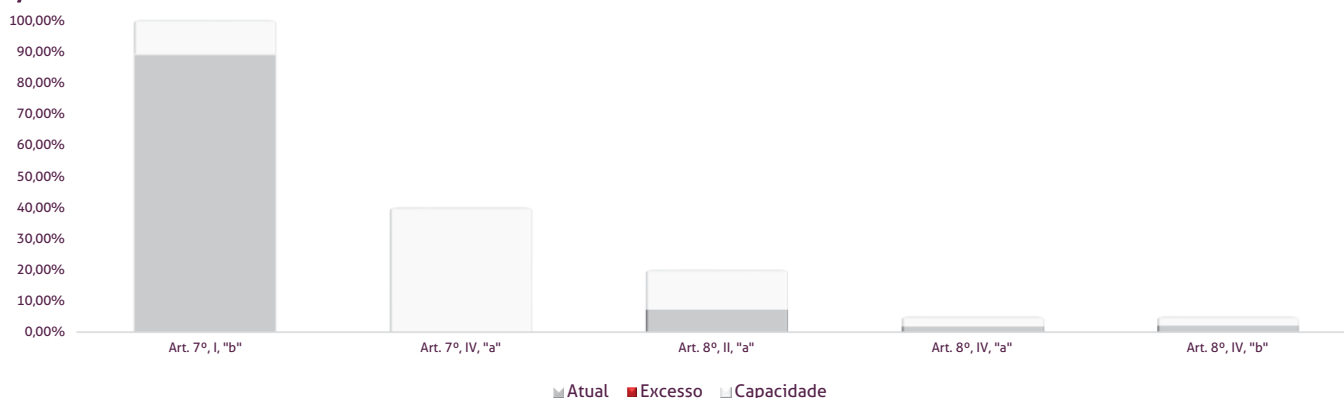


Os limites de alocação dos recursos do Instituto de Previdência e Assistência dos Servidores do Município de Porto Velho seguem as diretrizes da Resolução CMN 3.922 de 25 de novembro de 2010, onde são classificados de acordo com o tipo de ativo e quando se tratando de fundos de investimento, de acordo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

## Limites Resolução 3.922

| Fundos  | Saldo no Mês          | Limite do RPPS | Regularidade |
|---|-----------------------|----------------|--------------|
| <b>Renda Fixa</b>   | <b>599.969.237,85</b> | <b>89,12%</b>  | <b>100%</b>  |
| <b>Art. 7º, I, "b" - FI (100% TPF) - IMA ou IDKA</b>        | <b>598.803.830,81</b> | <b>88,95%</b>  | <b>100%</b>  |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | 7.797.385,45          | 1,16%          |              |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | 10.745.479,78         | 1,60%          |              |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | 21.801.494,15         | 3,24%          |              |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | 200.069,78            | 0,03%          |              |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO      | 63.474.810,87         | 9,43%          |              |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO        | 15.646.379,55         | 2,32%          |              |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | 213.901.012,23        | 31,77%         |              |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | 26.502.974,02         | 3,94%          |              |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | 39.998.253,18         | 5,94%          |              |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | 94.427.887,14         | 14,03%         |              |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | 16.900.711,25         | 2,51%          |              |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 87.407.373,41         | 12,98%         |              |
| <b>Art. 7º, IV, "a" - FI Referenciado RF ou RF</b>          | <b>1.165.407,04</b>   | <b>0,17%</b>   | <b>40%</b>   |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                      | 1.165.407,04          | 0,17%          |              |
| <b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>          | <b>73.250.234,04</b>  | <b>10,88%</b>  | <b>30%</b>   |
| <b>Art. 8º, II, "a" - FIA - Fundo de Ações</b>              | <b>48.091.609,16</b>  | <b>7,14%</b>   | <b>20%</b>   |
| BB SMALL CAPS FIC AÇÕES                                     | 48.091.609,16         | 7,14%          |              |
| <b>Art. 8º, IV, "a" - FI em Participações - FIP</b>         | <b>11.701.194,62</b>  | <b>1,74%</b>   | <b>5%</b>    |
| CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11                   | 11.701.194,62         | 1,74%          |              |
| <b>Art. 8º, IV, "b" - FI Imobiliário - FII</b>              | <b>13.457.430,26</b>  | <b>2,00%</b>   | <b>5%</b>    |
| ÁQUILLA FII - AQLL11  | 13.457.430,26         | 2,00%          |              |
| <b>Aplicações</b>   | <b>673.219.471,89</b> | <b>99,58%</b>  |              |
| <b>Conta Corrente</b>                                       | <b>2.857.820,64</b>   | <b>0,42%</b>   |              |
| <b>CARTEIRA</b>   | <b>676.077.292,53</b> | <b>100,00%</b> |              |

### Disponibilidade 3.922

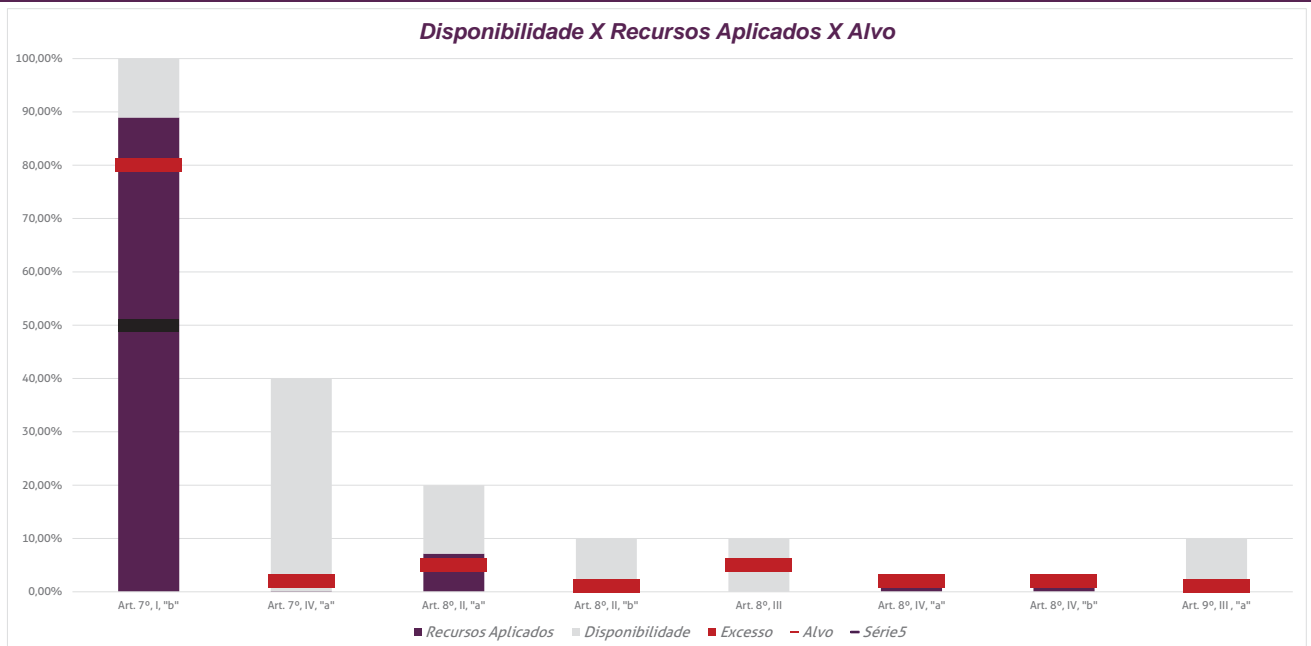


Irregularidade por ultrapassar limite do Patrimônio Líquido do fundo CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11 de 5%, com 7,28%. Patrimônio Líquido do fundo: R\$ 160.136.328,18

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

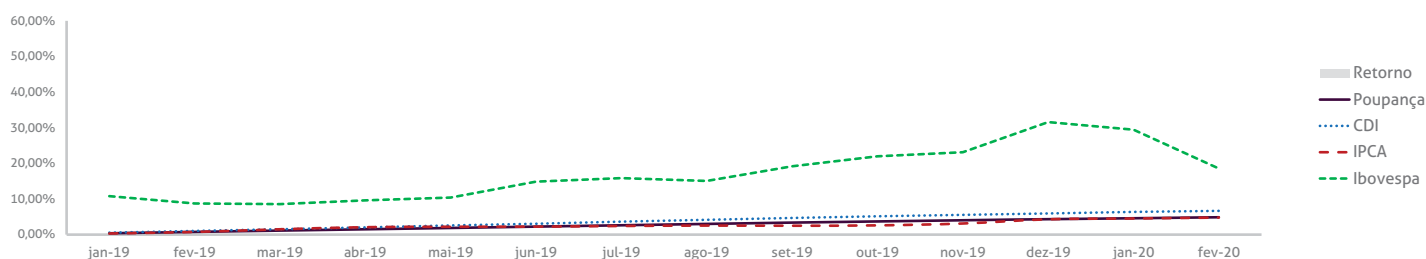
| Fundos   | Porcentagem do RPPS | Limite      | Limite Individual | Política de Investimentos |      |               |
|--|---------------------|-------------|-------------------|---------------------------|------|---------------|
|  |                     |             |                   | Limite Mínimo             | Alvo | Limite Máximo |
| <b>Renda Fixa</b>  | <b>89,12%</b>       | <b>100%</b> |                   |                           |      |               |
| Art. 7º, I, "a" - Títulos Públicos Federais - SELIC        | 0,00%               | 100%        | -                 | 0%                        | 0%   | 100%          |
| Art. 7º, I, "b" - FI (100% TPF) - IMA ou IDKA              | 88,95%              | 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                | 0,17%               | 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%            |
| <b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>         | <b>10,88%</b>       | <b>30%</b>  |                   |                           |      |               |
| 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                    | 7,14%               | 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               | 1,74%               | 5%          | -                 | 0%                        | 2%   | 3%            |
| Art. 8º, IV, "b" - FI Imobiliário - FII                    | 2,00%               | 5%          | -                 | 0%                        | 2%   | 3%            |
| Art. 8º, IV, "c" - Mercado de Acesso                       | 0,00%               | 5%          | -                 | 0%                        | 0%   | 4%            |
| <b>Investimento no Exterior</b>                            | <b>0,00%</b>        | <b>10%</b>  |                   |                           |      |               |
| 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%           |
| <b>Aplicações</b>  | <b>99,58%</b>       |             |                   |                           |      |               |
| <b>Imóveis</b>   | <b>0,00%</b>        |             |                   |                           |      |               |
| <b>Conta Corrente</b>                                      | <b>0,42%</b>        |             |                   |                           |      |               |
| <b>Carteira</b>  | <b>100,00%</b>      |             |                   |                           |      |               |



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%    |
| 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%     |
| fev-20   | 0,65%  | 0,38%   | 0,29% | 0,45%  | 0,69%  | 0,26%    | 0,25%  | -8,43%   | 5,37%  | 4,25% | 0,74%     |
| 12 meses | 11,86% | 6,53%   | 5,57% | 17,99% | 11,19% | 4,10%    | 4,00%  | 8,98%    | 20,33% | -     | 10,25%    |
| 2020     | 1,53%  | 0,82%   | 0,67% | 0,71%  | 1,22%  | 0,52%    | 0,46%  | -9,92%   | 11,61% | 4,25% | 1,44%     |



## Rentabilidade

| Fundos  | 2019   | 12 meses | dez/19 | jan/20 | fev/20 | 2020   |
|---|--------|----------|--------|--------|--------|--------|
| <b>Renda Fixa</b>   |        |          |        |        |        |        |
| Art. 7º, I, "b" - FI (100% TPF) - IMA ou IDKA               |        |          |        |        |        |        |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | 6,49%  | 6,24%    | 0,40%  | 0,42%  | 0,35%  | 0,77%  |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO      | 22,64% | 17,76%   | 1,97%  | 0,26%  | 0,44%  | 0,70%  |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO        | 10,46% | 9,09%    | 0,92%  | 0,20%  | 0,41%  | 0,61%  |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | 11,20% | 10,31%   | 1,15%  | 0,38%  | 0,63%  | 1,02%  |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | 6,55%  | 6,31%    | 0,40%  | 0,42%  | 0,36%  | 0,79%  |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 11,19% | 10,35%   | 1,10%  | 0,46%  | 0,60%  | 1,06%  |
| Art. 7º, IV, "a" - FI Referenciado RF ou RF                 |        |          |        |        |        |        |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                      | 4,82%  | 4,45%    | 0,28%  | 0,29%  | 0,22%  | 0,50%  |
| <b>Renda Variável</b>                                       |        |          |        |        |        |        |
| Art. 8º, II, "a" - FIA - Fundo de Ações                     |        |          |        |        |        |        |
| BB SMALL CAPS FIC AÇÕES                                     |        | 30,35%   | 12,45% | 0,38%  | -8,85% | -8,51% |
| Art. 8º, IV, "a" - FI em Participações - FIP                |        |          |        |        |        |        |
| CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11                   |        | 0,01%    | -0,03% | -0,03% | 0,34%  | 0,31%  |
| Art. 8º, IV, "b" - FI Imobiliário - FII                     |        |          |        |        |        |        |
| AQUILLA FII - AQLL11  |        | -13,89%  | 3,08%  | -0,17% | -0,14% | -0,31% |

*Relatório de  
Investimentos  
Administrativo*

***Fevereiro 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 fevereiro um retorno de R\$ 78.824,47, equivalente a 0,36%. Assim, no ano de 2020 acumulou-se um retorno de R\$ 175.655,60 representando uma rentabilidade de 0,79%

## Relatório de Risco:

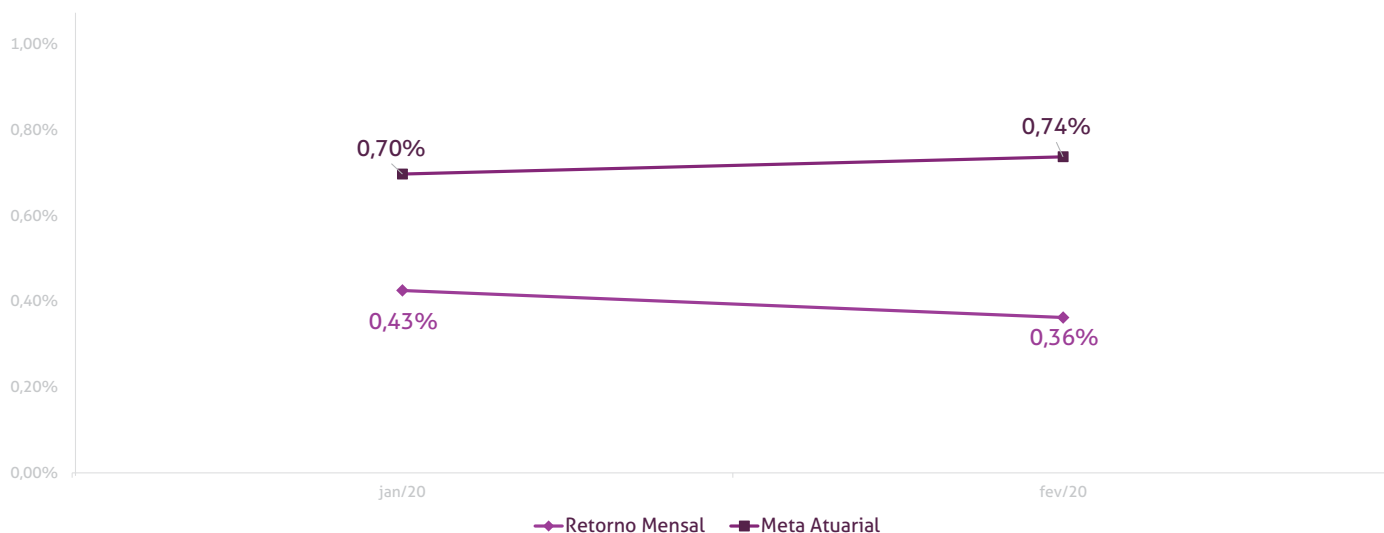
### Performance Absoluta

|                    | jan-20    | fev-20    | mar-20 | abr-20 | mai-20 | jun-20 |
|--------------------|-----------|-----------|--------|--------|--------|--------|
| Carteira           | 0,43%     | 0,36%     |        |        |        |        |
| Retorno Financeiro | 96.831,13 | 78.824,47 |        |        |        |        |
| Meta Atuarial      | 0,70%     | 0,74%     |        |        |        |        |

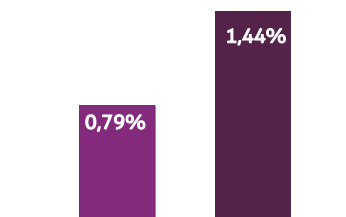
|                    | jul-20 | ago-20 | set-20 | out-20 | nov-20 | dez-20 |
|--------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Carteira           |        |        |        |        |        |        |
| Retorno Financeiro |        |        |        |        |        |  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

### Retorno Mensal X Meta Atuarial Mensal

**Meta  
IPCA + 6%**



| Estadística                    | Consolidado - 2020 |                              |
|--------------------------------|--------------------|------------------------------|
| Meses acima da Meta Atuarial:  | 0                  | Carteira 0,79%               |
| Meses abaixo da Meta Atuarial: | 2                  | Retorno R\$ 175.655,60       |
| Retorno Mensal Máximo          | 0,43% jan-20       | Meta 1,44%                   |
| Retorno Mensal Médio           | 0,39%              | Meta Atuarial IPCA + 6%      |
| Retorno Mensal Mínimo          | 0,36% fev-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 fevereiro observou-se o total de -R\$ 1.111.000,00 em resgates.

## Extrato Consolidado

## Porto Velho - Administrativo

Fevereiro 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             |
| <b>Final</b>  |                      | <b>23.336.838,55</b> | <b>0,00</b> | <b>-600.000,00</b> | <b>0,00</b> | <b>96.831,13</b> | <b>0,43%</b> | <b>22.838.145,24</b> |

### fev/20

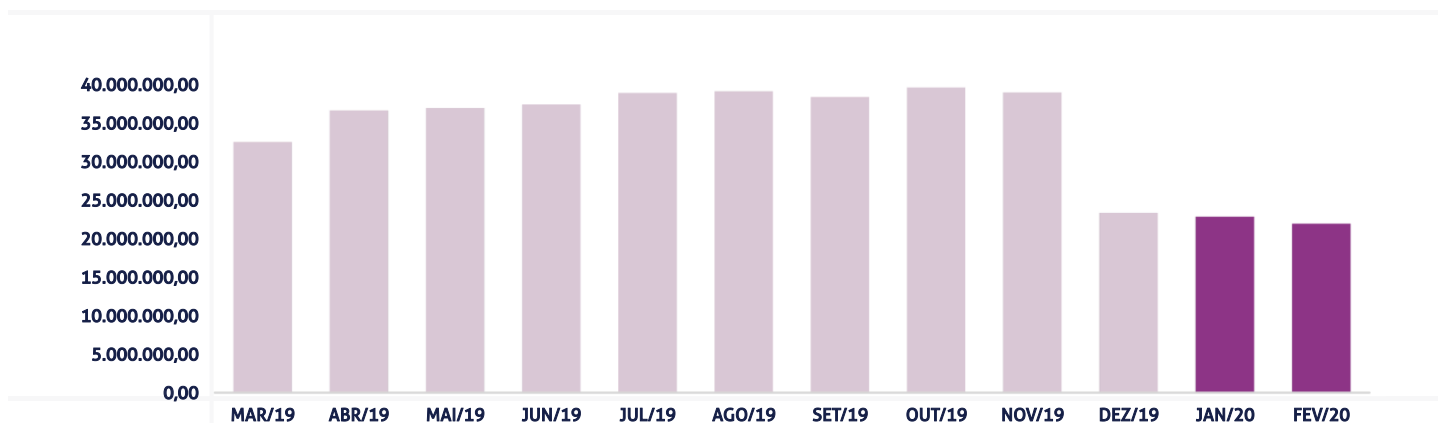
| Aplicações  | Cc vinculada | Financeiro Inicial   | Aplicação   | Resgate              | Amortização | Rendimento       | Rent. %      | Total                |
|---|--------------|----------------------|-------------|----------------------|-------------|------------------|--------------|----------------------|
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO |              | 22.833.669,68        |             | -1.111.000,00        |             | 78.824,47        | 0,35%        | 21.801.494,15        |
| Aplicações  |              | 22.833.669,68        |             |                      |             |                  |              | 21.801.494,15        |
| Imóveis   |              | 0,00                 |             |                      |             |                  |              | 0,00                 |
| Conta Corrente  |              | 4.475,56             |             |                      |             |                  |              | 129.995,03           |
| Banco do Brasil 8808-0                                    |              | 4.475,56             |             |                      |             |                  |              | 129.995,03           |
| <b>FINAL</b>  |              | <b>22.838.145,24</b> | <b>0,00</b> | <b>-1.111.000,00</b> | <b>0,00</b> | <b>78.824,47</b> | <b>0,36%</b> | <b>21.931.489,18</b> |

O Instituto de Previdência e Assistência dos Servidores do Município de Porto Velho encerrou o mês de Fevereiro com R\$ 21.931.489,18 em seu Patrimônio Líquido, representando uma perda de -R\$ 906.656,06 com relação ao mês anterior e uma perda de -R\$ 1.405.349,37 com relação ao exercício de 2020. Observando o histórico dos últimos doze meses, obteve um decréscimo de -34,17%.

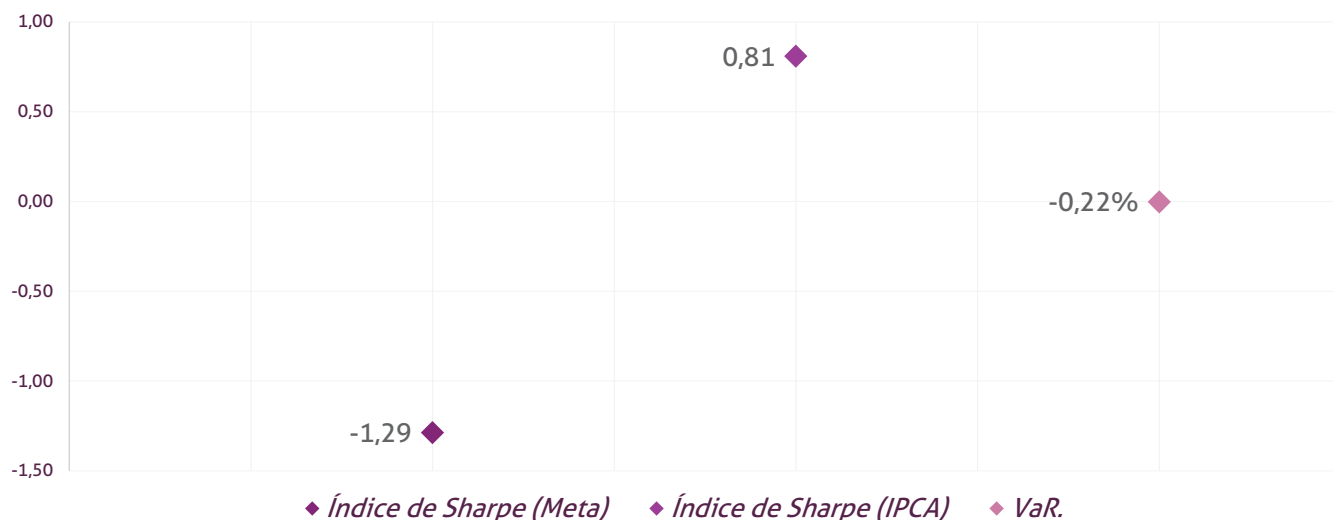
## Evolução Patrimônio Líquido

|                                   |                               |                  |
|-----------------------------------|-------------------------------|------------------|
| Saldo inicial do ano (31/12/2019) | Evolução nos últimos 12 meses | Evolução em 2020 |
| R\$ 23.336.838,55                 | -34,17%                       | -6,02%           |

|            |                      |            |                      |            |            |
|------------|----------------------|------------|----------------------|------------|------------|
| <b>Jan</b> | <b>22.838.145,24</b> | <b>Fev</b> | <b>21.931.489,18</b> | <b>Mar</b> | <b>Abr</b> |
| <b>Mai</b> |                      | <b>Jun</b> |                      | <b>Jul</b> | <b>Ago</b> |
| <b>Set</b> |                      | <b>Out</b> |                      | <b>Nov</b> | <b>Dez</b> |



## Índice de Sharpe e Var da Carteira



*Relatório de  
Investimentos  
Capitalizado  
Fevereiro 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 fevereiro um retorno de -R\$ 2.446.596,17, equivalente a -0,56%. Assim, no ano de 2020 acumulou-se um retorno de -R\$ 942.821,28 representando uma rentabilidade de -0,21%

## Relatório de Risco:

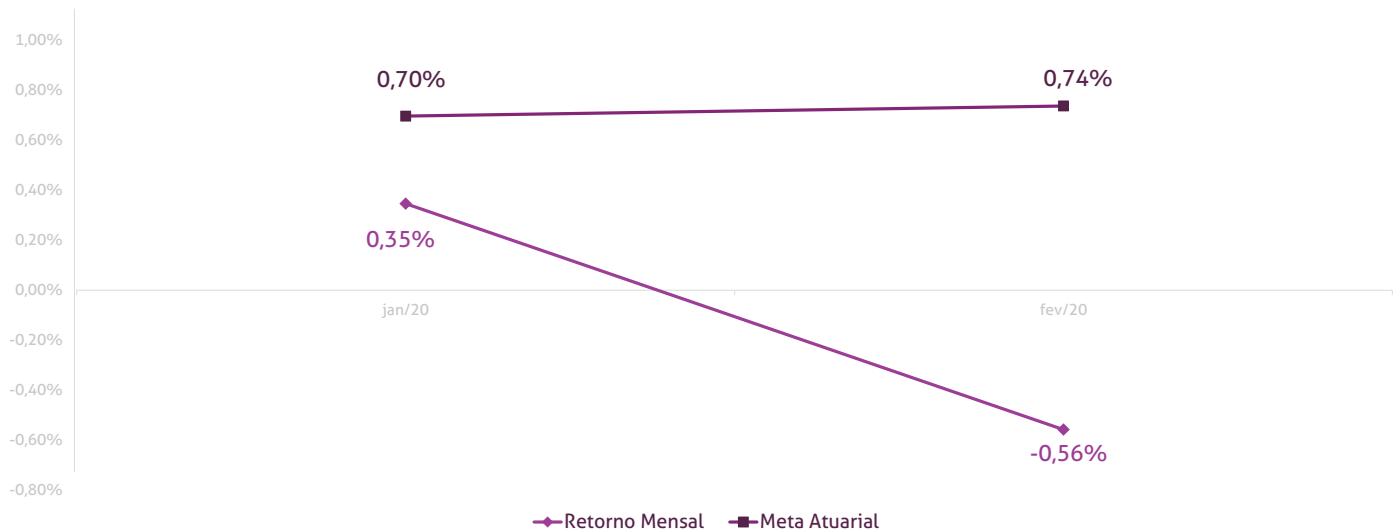
### Performance Absoluta

|                    | jan-20       | fev-20        | mar-20 | abr-20 | mai-20 | jun-20 |
|--------------------|--------------|---------------|--------|--------|--------|--------|
| Carteira           | 0,35%        | -0,56%        |        |        |        |        |
| Retorno Financeiro | 1.503.774,89 | -2.446.596,17 |        |        |        |        |
| Meta Atuarial      | 0,70%        | 0,74%         |        |        |        |        |

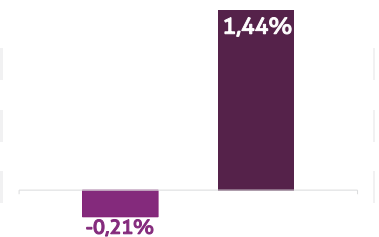
|                    | jul-20 | ago-20 | set-20 | out-20 | nov-20 | dez-20 |
|--------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Carteira           |        |        |        |        |        |        |
| Retorno Financeiro |        |        |        |        |        |  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

### Retorno Mensal X Meta Atuarial Mensal

**Meta  
IPCA + 6%**



| Estadística                    | Consolidado - 2020 |                               |
|--------------------------------|--------------------|-------------------------------|
| Meses acima da Meta Atuarial:  | 0                  | Carteira -0,21%               |
| Meses abaixo da Meta Atuarial: | 2                  | Retorno -R\$ 942.821,28       |
| Retorno Mensal Máximo          | 0,35% jan-20       | Meta 1,44%                    |
| Retorno Mensal Médio           | -0,11%             | Meta Atuarial IPCA + 6%       |
| Retorno Mensal Mínimo          | -0,56% fev-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 fevereiro observou-se o total de R\$ 176.751.981,71 em aplicações e o total de -R\$ 173.635.025,93 em resgates.

## Extrato Consolidado

## Porto Velho - Capitalizado

Fevereiro 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 |

fev/20

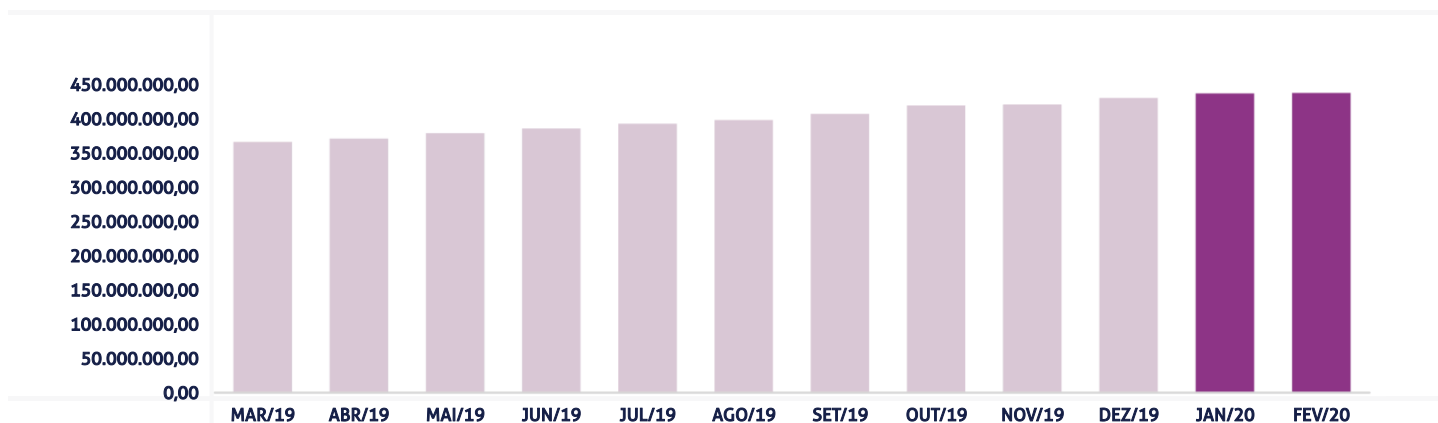
| Aplicações   | Cc vinculada         | Financeiro Inicial | Aplicação      | Resgate         | Amortização | Rendimento    | Rent. % | Total          |
|--|----------------------|--------------------|----------------|-----------------|-------------|---------------|---------|----------------|
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO       | Ag. 2757-X cc 8809-9 | 16.001.215,08      |                | -420.449,90     |             | 65.614,37     | 0,41%   | 15.646.379,55  |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO  | Ag. 2757-X cc 8809-9 | 21.164.938,78      | 200.000,00     | -21.171.977,28  |             | 7.108,28      | 0,35%   | 200.069,78     |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA        | Ag. 0632 cc 755-8    | 94.086.115,89      |                |                 |             | 341.771,25    | 0,36%   | 94.427.887,14  |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | Ag. 2757-X cc 8809-9 | 162.891.486,21     |                | -100.040.000,00 |             | 623.324,66    | 0,44%   | 63.474.810,87  |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO    | Ag. 2757-X cc 8809-9 | 89.026.475,25      | 123.661.981,71 |                 |             | 1.212.555,27  | 0,63%   | 213.901.012,23 |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO            | Ag. 2757-X cc 8809-9 | 43.036.240,11      |                | -43.136.307,15  |             | 100.067,04    | 0,46%   | 0,00           |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP | Ag. 2757-X cc 8809-9 | 8.864.937,80       |                | -8.866.291,60   |             | 1.353,80      | 0,27%   | 0,00           |
| BB SMALL CAPS FIC AÇÕES                                    | Ag. 2757-X cc 8809-9 | 0,00               | 52.890.000,00  |                 |             | -4.798.390,84 | -8,85%  | 48.091.609,16  |
| Aplicações   |                      | 435.071.409,12     |                |                 |             |               |         | 435.741.768,73 |
| Imóveis  |                      | 0,00               |                |                 |             |               |         | 0,00           |
| Conta Corrente   |                      | 1.665.045,22       |                |                 |             |               |         | 1.664.370,35   |
| Caixa 755-8  |                      | 0,00               |                |                 |             |               |         | 0,00           |
| Banco do Brasil 8809-9                                     |                      | 1.665.045,22       |                |                 |             |               |         | 1.664.370,35   |
| FINAL  |                      | 436.736.454,34     | 176.751.981,71 | -173.635.025,93 | 0,00        | -2.446.596,17 | -0,56%  | 437.406.139,08 |

O Instituto de Previdência e Assistência dos Servidores do Município de Porto Velho encerrou o mês de Fevereiro com R\$ 437.406.139,08 em seu Patrimônio Líquido, representando um aumento de R\$ 669.684,74 com relação ao mês anterior e um aumento de R\$ 7.433.802,14 com relação ao exercício de 2020. Observando o histórico dos últimos doze meses, obteve um crescimento de 21,83%.

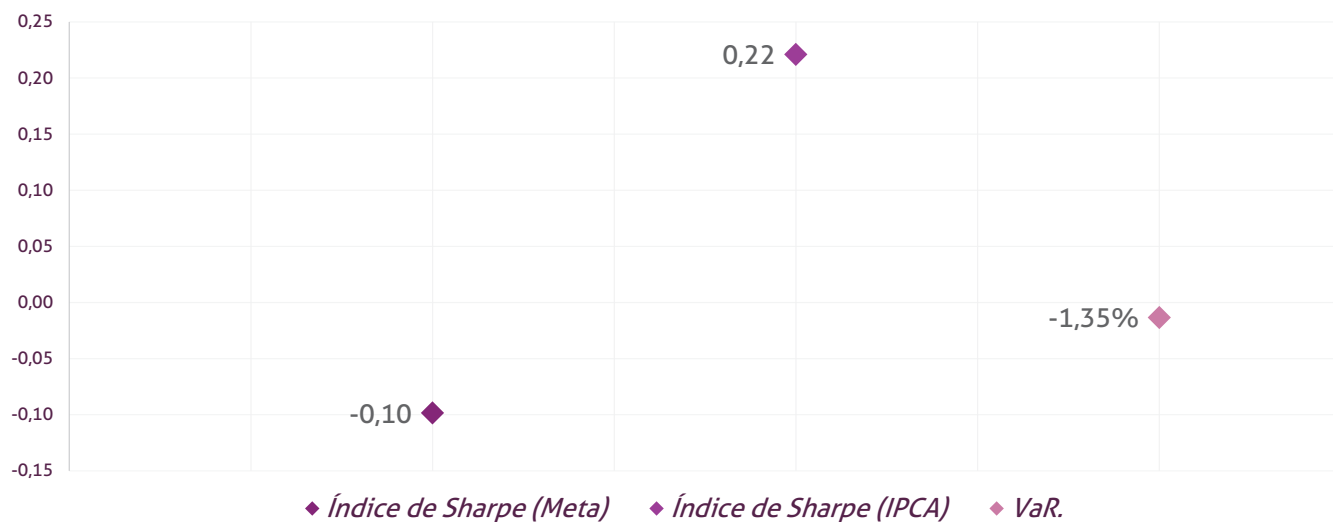
## Evolução Patrimônio Líquido

|                                   |                               |                  |
|-----------------------------------|-------------------------------|------------------|
| Saldo inicial do ano (31/12/2019) | Evolução nos últimos 12 meses | Evolução em 2020 |
| R\$ 429.972.336,94                | 21,83%                        | 1,73%            |

|     |                |     |                |     |  |     |  |
|-----|----------------|-----|----------------|-----|--|-----|--|
| Jan | 436.736.454,34 | Fev | 437.406.139,08 | Mar |  | Abr |  |
| Mai |                | Jun |                | Jul |  | Ago |  |
| Set |                | Out |                | Nov |  | Dez |  |



## Índice de Sharpe e Var da Carteira



*Relatório de  
Investimento Financeiro  
Fevereiro 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 fevereiro um retorno de R\$ 1.072.071,73, equivalente a 0,50%. Assim, no ano de 2020 acumulou-se um retorno de R\$ 1.846.143,81 representando uma rentabilidade de 0,85%

## Relatório de Risco:

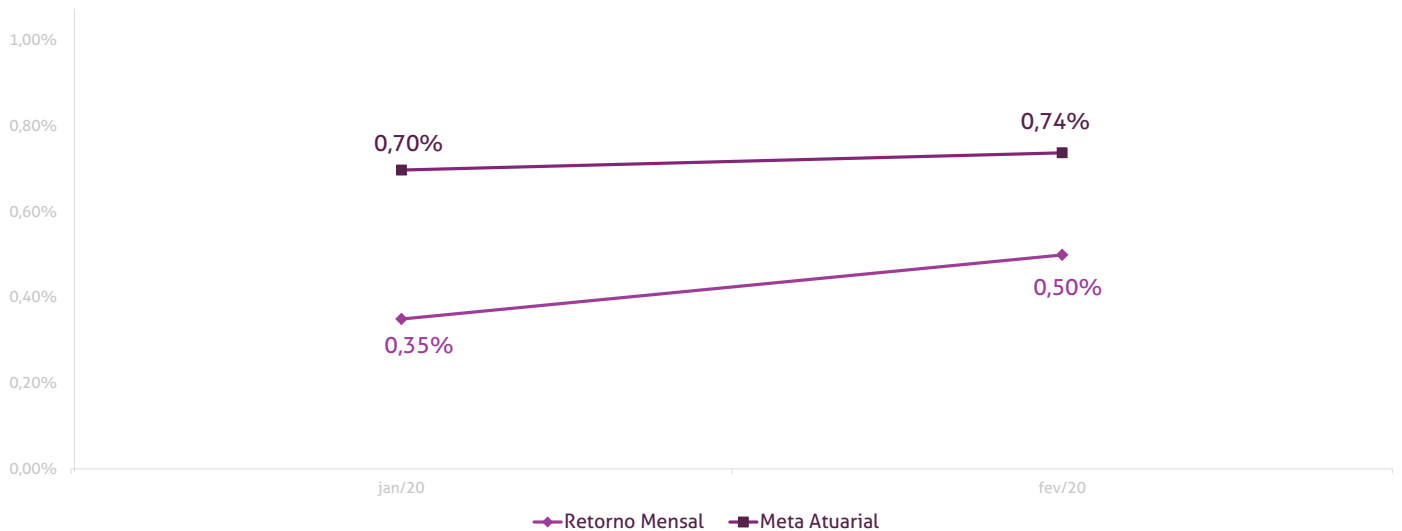
### Performance Absoluta

|                    | jan-20     | fev-20       | mar-20 | abr-20 | mai-20 | jun-20 |
|--------------------|------------|--------------|--------|--------|--------|--------|
| Carteira           | 0,35%      | 0,50%        |        |        |        |        |
| Retorno Financeiro | 774.072,08 | 1.072.071,73 |        |        |        |        |
| Meta Atuarial      | 0,70%      | 0,74%        |        |        |        |        |

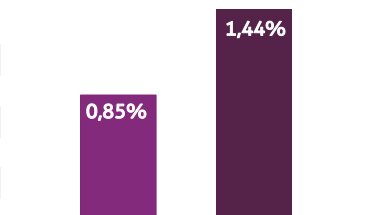
|                    | jul-20 | ago-20 | set-20 | out-20 | nov-20 | dez-20 |
|--------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Carteira           |        |        |        |        |        |        |
| Retorno Financeiro |        |        |        |        |        |  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

### Retorno Mensal X Meta Atuarial Mensal

**Meta  
IPCA + 6%**



| Estadística                    | Consolidado - 2020 |                               |
|--------------------------------|--------------------|-------------------------------|
| Meses acima da Meta Atuarial:  | 0                  | Carteira 0,85%                |
| Meses abaixo da Meta Atuarial: | 2                  | Retorno R\$ 1.846.143,81      |
| Retorno Mensal Máximo          | 0,50% fev-20       | Meta 1,44%                    |
| Retorno Mensal Médio           | 0,42%              | 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 fevereiro observou-se o total de R\$ 27.721.357,65 em aplicações e o total de -R\$ 35.152.585,86 em resgates.

## Extrato Consolidado

## Porto Velho - Financeiro

Fevereiro 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 |

fev/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 | 15.681.655,31         | 1.689.103,60         | -6.675.000,00         |             | 49.720,87           | 0,35%        | 10.745.479,78         |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | Ag. 2757-X cc 9143-X | 7.769.962,08          |                      |                       |             | 27.423,37           | 0,35%        | 7.797.385,45          |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | Ag. 2757-X cc 8160-4 | 848.204,89            | 25.609.094,57        |                       |             | 45.674,56           | 0,63%        | 26.502.974,02         |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | Ag. 2757-X cc 9143-X | 39.748.565,07         |                      |                       |             | 249.688,11          | 0,63%        | 39.998.253,18         |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | Ag. 0632 cc 2378-2   | 16.839.541,00         |                      |                       |             | 61.170,25           | 0,42%        | 16.900.711,25         |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO      | Ag. 2757-X cc 8160-4 | 25.510.533,34         |                      | -25.599.374,44        |             | 88.841,10           | 0,26%        | 0,00                  |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | Ag. 0632 cc 2378-2   | 86.884.799,63         |                      |                       |             | 522.573,78          | 0,46%        | 87.407.373,41         |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                      | Ag. 2757-X cc 7925-1 | 3.614.406,08          | 423.159,48           | -2.878.211,42         |             | 6.052,90            | 0,29%        | 1.165.407,04          |
| CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11                   |                      | 11.661.183,46         |                      |                       |             | 40.011,16           | -0,03%       | 11.701.194,62         |
| ÂQUILLA FII - AQLL11  |                      | 13.476.514,63         |                      |                       |             | -19.084,37          | -0,17%       | 13.457.430,26         |
| Aplicações  |                      | 222.035.365,49        |                      |                       |             |                     |              | 215.676.209,01        |
| Imóveis   |                      | 0,00                  |                      |                       |             |                     |              | 0,00                  |
| Conta Corrente  |                      | 70.622,68             |                      |                       |             |                     |              | 1.063.455,26          |
| 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                                      |                      | 70.622,68             |                      |                       |             |                     |              | 1.063.455,26          |
| <b>FINAL</b>  |                      | <b>222.105.988,17</b> | <b>27.721.357,65</b> | <b>-35.152.585,86</b> | <b>0,00</b> | <b>1.072.071,73</b> | <b>0,50%</b> | <b>216.739.664,27</b> |

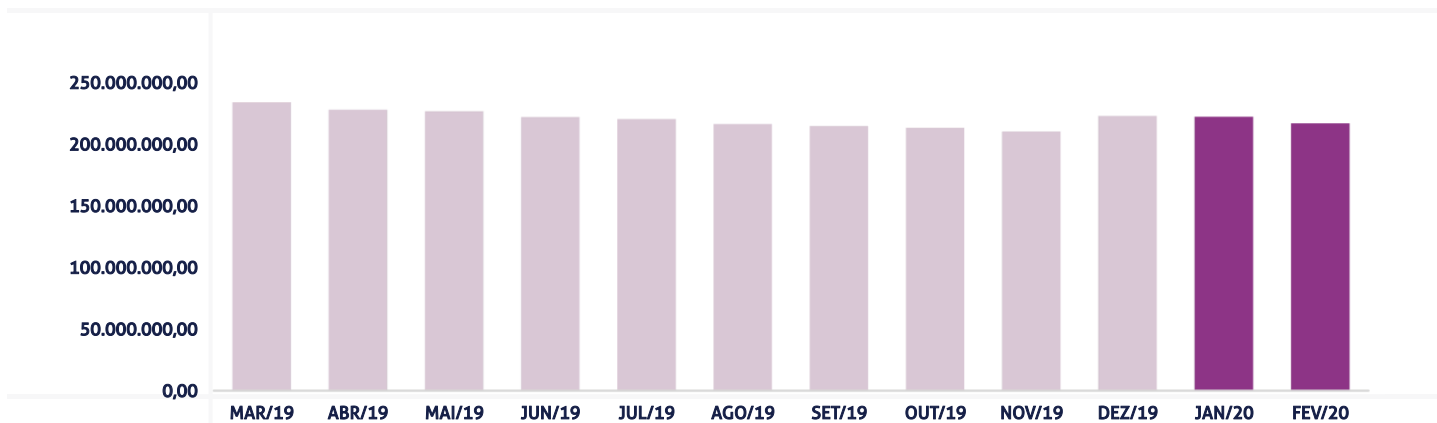


O Instituto de Previdência e Assistência dos Servidores do Município de Porto Velho encerrou o mês de Fevereiro com R\$ 216.739.664,27 em seu Patrimônio Líquido, representando uma perda de -R\$ 5.366.323,90 com relação ao mês anterior e uma perda de -R\$ 5.991.264,26 com relação ao exercício de 2020. Observando o histórico dos últimos doze meses, obteve um decréscimo de -8,43%.

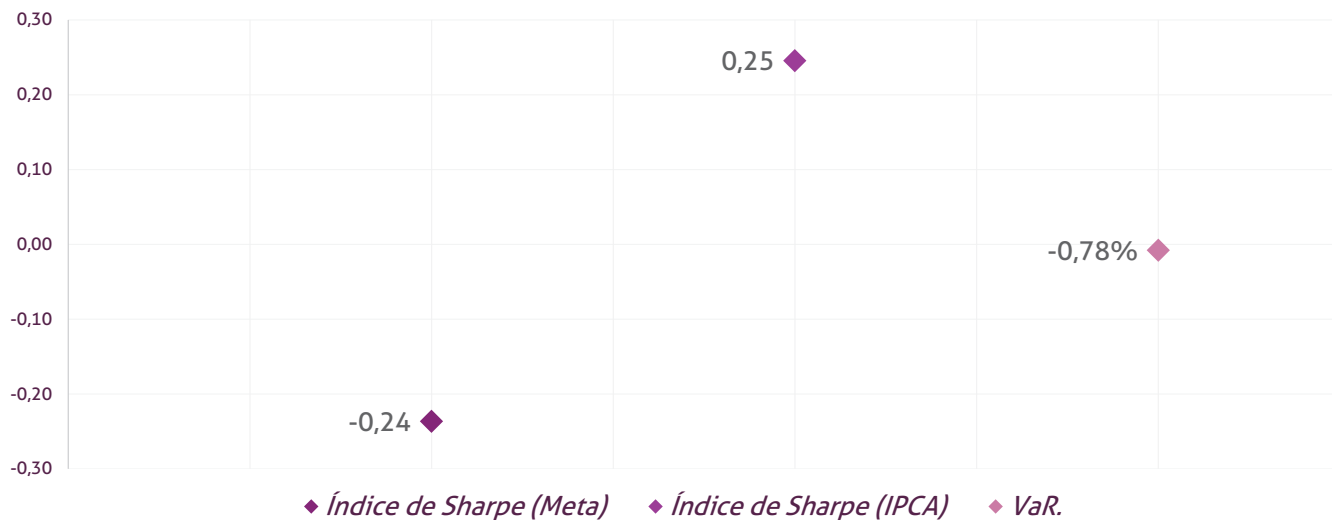
## Evolução Patrimônio Líquido

|                                   |                               |                  |
|-----------------------------------|-------------------------------|------------------|
| Saldo inicial do ano (31/12/2019) | Evolução nos últimos 12 meses | Evolução em 2020 |
| R\$ 222.730.928,53                | -8,43%                        | -2,69%           |

|     |                |     |                |     |  |     |  |
|-----|----------------|-----|----------------|-----|--|-----|--|
| Jan | 222.105.988,17 | Fev | 216.739.664,27 | Mar |  | Abr |  |
| Mai |                | Jun |                | Jul |  | Ago |  |
| Set |                | Out |                | Nov |  | Dez |  |



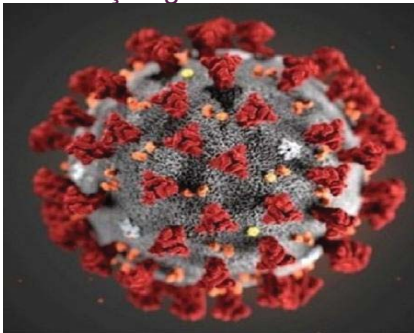
## Índice de Sharpe e Var da Carteira



## Setor Externo

Fevereiro foi marcado pelos desdobramentos relacionados ao coronavírus, COVID-19. Os mercados iniciaram o mês acompanhando o ritmo das medidas de contenção implementadas pela China. Com o impacto até então restrito a China, o impacto do coronavírus era visto como um choque de oferta mundial por meio da deterioração de cadeias globais de comércio. Contudo, com o aparecimento de focos de contágio em outras regiões, a capacidade de contenção do vírus foi colocada em xeque e a probabilidade de uma pandemia a nível global aumentou.

Assim, além de um choque de oferta vindo do continente asiático, os mercados passaram a vislumbrar também o risco de deterioração dos sistemas de saúde ao redor do mundo e um possível choque de demanda em outras regiões, choque este que se daria a partir da queda da confiança dos agentes e da adoção de medidas de contenção generalizadas.



Com o aumento das incertezas relacionadas ao ciclo de expansão econômica, os mercados apresentaram movimentos extremos, típicos de momento de crise. No centro da atenção do mercado, a bolsa americana, que estava em seu maior nível até meados do mês, teve sua maior queda semanal desde a crise financeira de 2008.

De modo geral, as curvas de juros globais intensificaram movimento de fechamento e o mercado passou a precificar probabilidade de reunião extraordinária do Fed, banco central americano.

Nos EUA, um assunto que ficou em segundo plano mas que merece

atenção, é o desenrolar das eleições. Bernie Sanders assumiu o favoritismo nas primárias Democratas, junto com Joe Biden, candidato mais moderado e preferido pelas lideranças do partido.

## Brasil

Com a magnitude dos movimentos nos mercados globais, os assuntos domésticos ficaram em segundo plano. De maneira semelhante aos demais pares emergentes, os ativos brasileiros apresentaram resultado bastante negativos ao longo do mês.

Do ponto de vista político, o poder executivo continuou demonstrando baixa capacidade de articulação, de modo que o avanço das reformas continuou dependente das lideranças do legislativo.

Com relação à atividade econômica, os dados continuaram apontando para uma recuperação lenta com inflação baixa. Antes da deterioração dos mercados causada pelo COVID-19, um cenário de estabilidade na política monetária, isso é, a manutenção da taxa básica de juros vinha se desenhando. Com a nova rodada de estímulos monetários que se iniciou para dirimir os efeitos do coronavírus, o mercado passou a vislumbrar a possibilidade de que o Banco Central continue a cortar a taxa básica de juros.

De modo geral, a política monetária frouxa, a concessão de crédito privado em cenário de baixa alavancagem, o avanço de reformas micro e macro e redução gradual da ociosidade dos fatores de produção, sugerem continuidade da recuperação da economia sem pressões inflacionárias.



## Mercado

O Ibovespa terminou o mês de fevereiro com desvalorização de -8,43%, aos 104.171 pontos.

O CDI teve rentabilidade de +0,29% no mês, com acumulado de +5,58% em 12 meses. Pela cotação do Banco Central, Ptax 800, o dólar teve valorização de +5,37%, cotado a R\$ 4,4987.

O IRF-M 1 apresentou variação de +0,38%, com acumulado de 6,54% nos últimos 12 meses. O IMA-B variou 0,45% no mês, com acumulado de 18,03% em 12 meses e, por fim, o IDKA IPCA 2 ANOS rendeu +0,69% no mês, com acumulado de 11,15% nos últimos 12 meses.

*Reider Fonseca Peixoto*

SETE CAPITAL CONSULTORIA LTDA.  
CNPJ: 14.057.808/0001-10