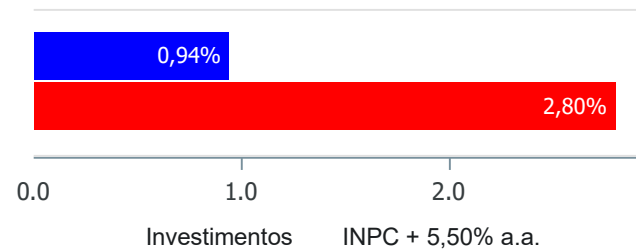


Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

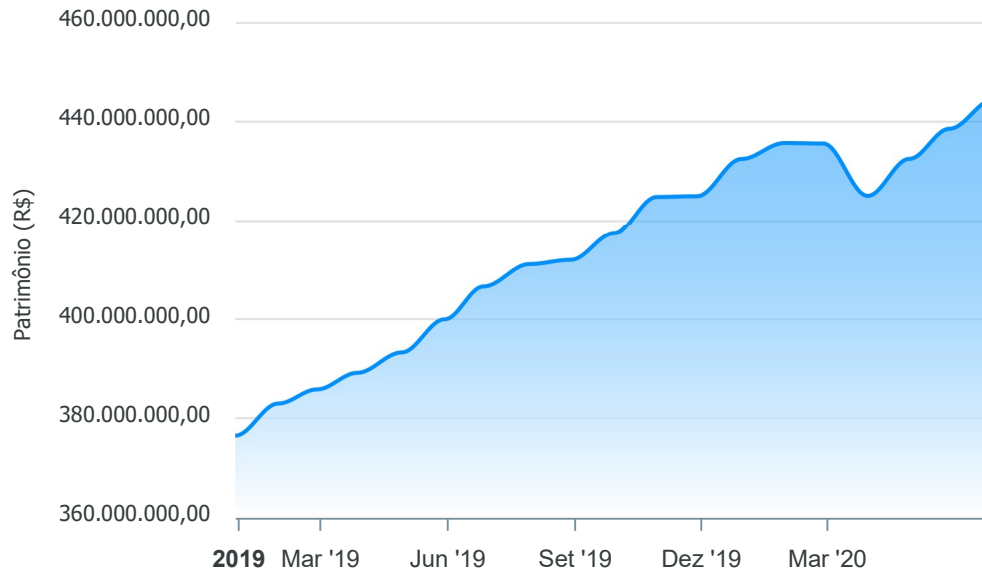
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	432.514.517,11	3.529.515,44	2.410.000,00	435.729.733,63	2.095.701,08	2.095.701,08	0,48%	0,48%	0,66%	0,66%	73,29%	0,61%
Fevereiro	435.729.733,63	120.455.102,35	120.631.634,81	435.630.862,65	77.661,48	2.173.362,56	0,02%	0,50%	0,55%	1,22%	41,19%	1,44%
Março	435.630.862,65	4.479.792,70	3.930.000,00	425.120.433,41	-11.060.221,94	-8.886.859,38	-2,54%	-2,05%	0,65%	1,87%	-109,24%	7,11%
Abril	425.120.433,41	6.036.793,79	2.410.000,00	432.543.953,33	3.796.726,13	-5.090.133,25	0,89%	-1,18%	0,19%	2,07%	-56,92%	3,85%
Mai	432.543.953,33	3.607.405,79	2.290.612,00	438.595.482,71	4.734.735,59	-355.397,66	1,09%	-0,10%	0,17%	2,25%	-4,50%	1,64%
Junho	438.595.482,71	4.316.513,44	3.010.000,00	444.503.060,88	4.601.064,73	4.245.667,07	1,05%	0,94%	0,54%	2,80%	33,69%	1,34%

Investimentos x Meta Atuarial



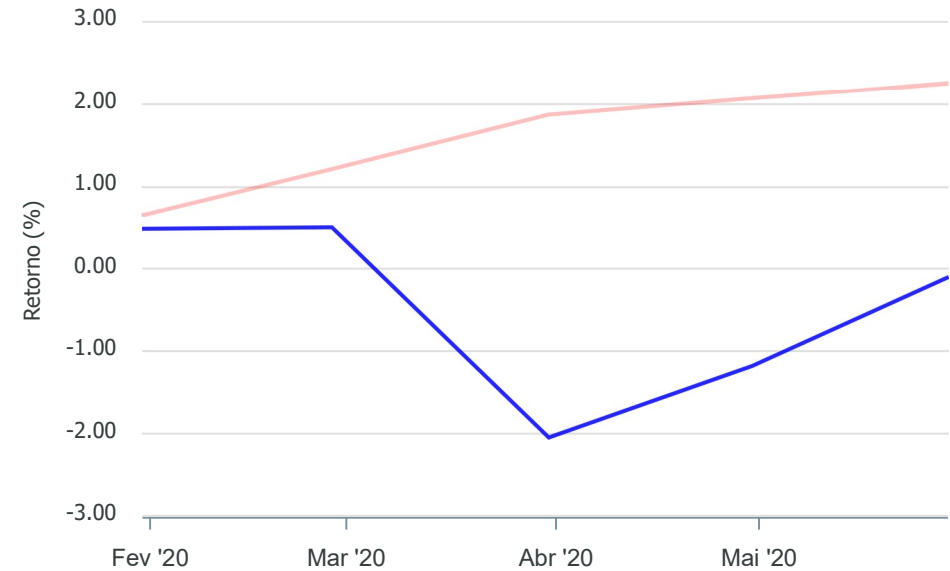
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- Investimentos    Meta Atuarial     CDI     IMA-B     IMA-B 5
- IMA-B 5+     IMA Geral     IRF-M     IRF-M 1     IRF-M 1+
- Ibovespa     IBX     SMLL     IDIV

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Junho/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	7.222.908,12	0,00	0,00	7.427.117,22	204.209,10	2,83%	2,83%	4,98%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	1.017.341,67	0,00	0,00	1.045.827,73	28.486,06	2,80%	2,80%	4,98%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	13.639.014,37	0,00	0,00	13.915.231,05	276.216,68	2,03%	2,03%	2,99%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	18.810.135,40	0,00	0,00	19.191.039,14	380.903,74	2,02%	2,02%	2,98%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	40.113.773,01	0,00	0,00	40.923.889,93	810.116,92	2,02%	2,02%	2,98%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	891.014,50	0,00	0,00	902.269,00	11.254,50	1,26%	1,26%	1,61%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	509.842,80	0,00	0,00	516.148,80	6.306,00	1,24%	1,24%	1,72%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	6.645.248,39	0,00	0,00	6.725.856,10	80.607,71	1,21%	1,21%	0,81%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	674.163,72	0,00	0,00	682.135,55	7.971,83	1,18%	1,18%	0,85%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.321.133,60	0,00	0,00	4.371.918,85	50.785,25	1,18%	1,18%	0,86%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	7.767.652,00	0,00	0,00	7.856.580,57	88.928,57	1,14%	1,14%	0,75%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	820.547,89	0,00	0,00	829.930,05	9.382,16	1,14%	1,14%	1,22%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.587.604,13	0,00	0,00	1.605.568,17	17.964,04	1,13%	1,13%	0,94%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.464.652,52	0,00	0,00	4.513.701,97	49.049,45	1,10%	1,10%	0,91%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	1.999.771,54	0,00	0,00	2.021.556,77	21.785,23	1,09%	1,09%	0,73%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	37.120.994,70	0,00	0,00	37.520.332,31	399.337,61	1,08%	1,08%	0,89%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	5.506.398,55	0,00	0,00	5.561.038,65	54.640,10	0,99%	0,99%	0,45%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	5.565.273,23	0,00	0,00	5.619.644,08	54.370,85	0,98%	0,98%	0,82%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28.152.685,80	0,00	0,00	28.419.768,04	267.082,24	0,95%	0,95%	1,27%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	113.108,79	0,00	0,00	114.118,10	1.009,31	0,89%	0,89%	1,18%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Junho/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDEN...	2.365.194,03	0,00	0,00	2.386.284,55	21.090,52	0,89%	0,89%	0,40%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	131.707,54	0,00	0,00	132.859,94	1.152,40	0,87%	0,87%	1,16%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	38.098.779,41	0,00	0,00	38.384.371,97	285.592,56	0,75%	0,75%	1,17%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.881.758,34	0,00	0,00	2.895.483,08	13.724,74	0,48%	0,48%	0,15%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	110.713,27	0,00	0,00	111.027,23	313,96	0,28%	0,28%	0,06%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	32.966.880,43	0,00	0,00	33.052.334,91	85.454,48	0,26%	0,26%	0,05%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	83.647.008,85	0,00	0,00	83.861.737,00	214.728,15	0,26%	0,26%	0,05%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	48.055.214,38	4.230.000,00	3.010.000,00	49.407.386,34	132.171,96	0,25%	0,26%	0,03%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	66.631,43	0,00	0,00	66.775,19	143,76	0,22%	0,22%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	30.888,77	0,00	0,00	30.947,19	58,42	0,19%	0,19%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	4.613,02	0,00	0,00	4.621,67	8,65	0,19%	0,19%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.417.576,46	86.513,44	0,00	4.509.874,05	5.784,15	0,13%	0,13%	0,01%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIAD...	4.314.725,96	0,00	0,00	4.316.411,15	1.685,19	0,04%	0,04%	0,29%
TÍTULOS PÚBLICOS	11.525.760,87	0,00	0,00	11.525.760,87	0,00	0,00%	-	-
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>415.560.717,49</b>	<b>4.316.513,44</b>	<b>3.010.000,00</b>	<b>420.449.547,22</b>	<b>3.582.316,29</b>	<b>0,86%</b>		<b>1,03%</b>

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Junho/2020

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.560.000,00	0,00	0,00	1.875.867,17	315.867,17	20,25%	20,00%	15,34%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	1.333.704,56	0,00	0,00	1.505.662,95	171.958,39	12,89%	12,89%	16,18%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	1.275.290,63	0,00	0,00	1.390.976,96	115.686,33	9,07%	9,07%	12,25%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.343.191,77	0,00	0,00	1.443.102,32	99.910,55	7,44%	7,44%	13,19%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.290.192,69	0,00	0,00	1.374.400,37	84.207,68	6,53%	6,53%	10,47%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1.061.491,59	0,00	0,00	1.089.090,15	27.598,56	2,60%	2,60%	3,49%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.028.270,98	0,00	0,00	2.078.013,69	49.742,71	2,45%	2,45%	12,76%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1.955.348,31	0,00	0,00	1.999.191,25	43.842,94	2,24%	2,24%	2,60%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.752.032,98	0,00	0,00	1.767.902,90	15.869,92	0,91%	0,91%	0,93%
BB DINÂMICO FIC MULTIMERCADO LP	6.494.141,51	0,00	0,00	6.530.481,90	36.340,39	0,56%	0,56%	0,50%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.811.936,40	0,00	0,00	1.820.322,05	8.385,65	0,46%	0,46%	0,86%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>21.905.601,42</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>22.875.011,71</b>	<b>969.410,29</b>	<b>4,43%</b>		<b>6,37%</b>

# CRÉDITO E MERCADO

*Engenharia Financeira*

INSTITUTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA DE SERTÃOZINHO - SERTPREV - CONSOLIDADO  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2020

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Junho / 2020)

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	1.129.163,80	0,00	0,00	1.178.501,95	49.338,15	4,37%	4,37%	12,44%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>1.129.163,80</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>1.178.501,95</b>	<b>49.338,15</b>	<b>4,37%</b>		<b>12,44%</b>