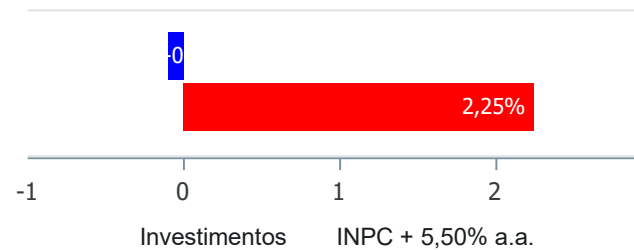


Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

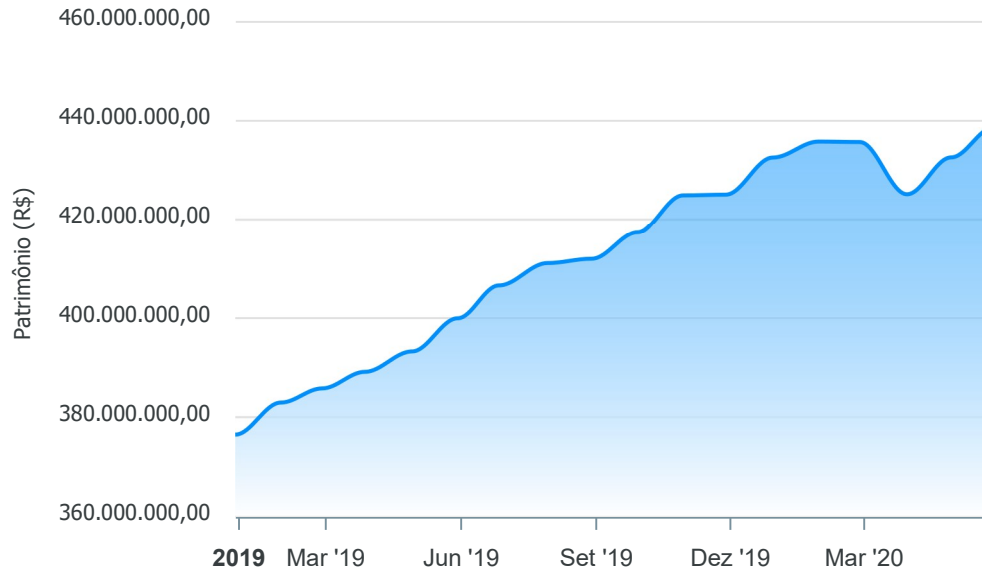
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	432.514.517,11	3.529.515,44	2.410.000,00	435.729.733,63	2.095.701,08	2.095.701,08	0,48%	0,48%	0,66%	0,66%	73,29%	0,61%
Fevereiro	435.729.733,63	120.455.102,35	120.631.634,81	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%

Investimentos x Meta Atuarial



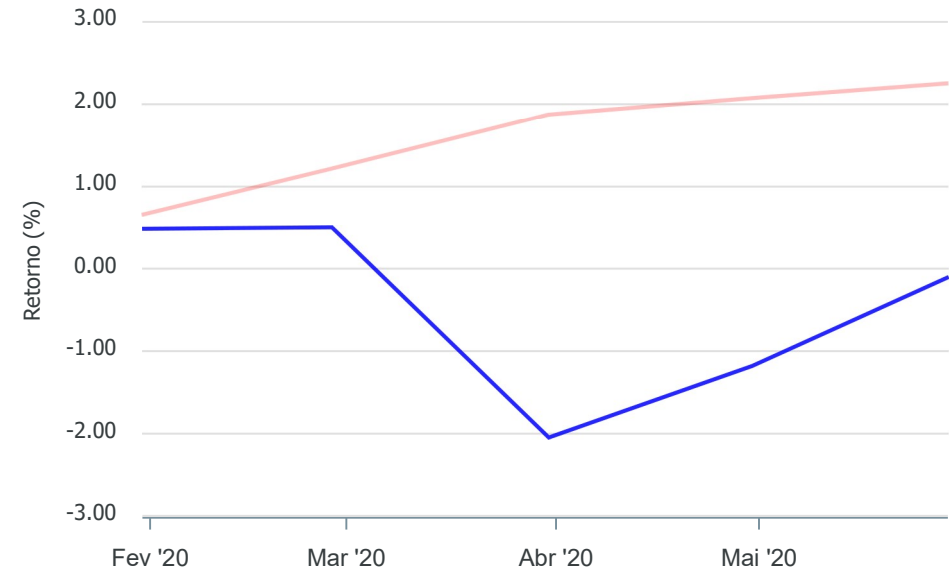
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Maio/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	494.249,10	0,00	0,00	509.842,80	15.593,70	3,16%	3,16%	2,56%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	866.604,50	0,00	0,00	891.014,50	24.410,00	2,82%	2,82%	2,47%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	820.990,57	0,00	20.612,00	820.547,89	20.169,32	2,46%	2,50%	1,82%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	5.446.912,89	0,00	0,00	5.565.273,23	118.360,34	2,17%	2,17%	1,12%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.554.171,86	0,00	0,00	1.587.604,13	33.432,27	2,15%	2,15%	1,28%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	36.354.668,61	0,00	0,00	37.120.994,70	766.326,09	2,11%	2,11%	1,24%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.372.598,03	0,00	0,00	4.464.652,52	92.054,49	2,11%	2,11%	1,25%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	660.357,66	0,00	0,00	674.163,72	13.806,06	2,09%	2,09%	1,07%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	6.514.910,95	0,00	0,00	6.645.248,39	130.337,44	2,00%	2,00%	1,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	7.621.166,51	0,00	0,00	7.767.652,00	146.485,49	1,92%	1,92%	0,92%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.240.337,66	0,00	0,00	4.321.133,60	80.795,94	1,91%	1,91%	1,06%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	1.963.756,15	0,00	0,00	1.999.771,54	36.015,39	1,83%	1,83%	0,94%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	39.520.428,69	0,00	0,00	40.113.773,01	593.344,32	1,50%	1,50%	3,64%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	13.437.369,96	0,00	0,00	13.639.014,37	201.644,41	1,50%	1,50%	3,66%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	18.534.709,39	0,00	0,00	18.810.135,40	275.426,01	1,49%	1,49%	3,63%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	37.580.645,41	0,00	0,00	38.098.779,41	518.134,00	1,38%	1,38%	1,72%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	5.438.525,04	0,00	0,00	5.506.398,55	67.873,51	1,25%	1,25%	0,48%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	27.854.050,26	0,00	0,00	28.152.685,80	298.635,54	1,07%	1,07%	1,74%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	7.151.389,53	0,00	0,00	7.222.908,12	71.518,59	1,00%	1,00%	5,80%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	1.007.292,88	0,00	0,00	1.017.341,67	10.048,79	1,00%	1,00%	5,79%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	112.039,53	0,00	0,00	113.108,79	1.069,26	0,95%	0,95%	1,53%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	130.471,79	0,00	0,00	131.707,54	1.235,75	0,95%	0,95%	1,51%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDEN...	2.346.400,72	0,00	0,00	2.365.194,03	18.793,31	0,80%	0,80%	0,54%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	110.228,89	0,00	0,00	110.713,27	484,38	0,44%	0,44%	0,21%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	32.837.822,56	0,00	0,00	32.966.880,43	129.057,87	0,39%	0,39%	0,20%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	83.323.114,60	0,00	0,00	83.647.008,85	323.894,25	0,39%	0,39%	0,20%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	66.462,17	0,00	0,00	66.631,43	169,26	0,25%	0,25%	0,08%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	46.680.672,65	3.520.612,00	2.270.000,00	48.055.214,38	123.929,73	0,25%	0,26%	0,05%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIAD...	4.305.379,63	0,00	0,00	4.314.725,96	9.346,33	0,22%	0,22%	0,10%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	30.823,09	0,00	0,00	30.888,77	65,68	0,21%	0,21%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	4.603,28	0,00	0,00	4.613,02	9,74	0,21%	0,21%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.323.875,64	86.793,79	0,00	4.417.576,46	6.907,03	0,16%	0,16%	0,01%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.880.565,15	0,00	0,00	2.881.758,34	1.193,19	0,04%	0,04%	0,13%
TÍTULOS PÚBLICOS	11.525.760,87	0,00	0,00	11.525.760,87	0,00	0,00%	-	-
Total Renda Fixa	410.113.356,22	3.607.405,79	2.290.612,00	415.560.717,49	4.130.567,48	1,00%		1,35%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.249.691,80	0,00	0,00	1.343.191,77	93.499,97	7,48%	7,48%	14,19%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	1.190.377,54	0,00	0,00	1.275.290,63	84.913,09	7,13%	7,13%	14,88%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.206.996,68	0,00	0,00	1.290.192,69	83.196,01	6,89%	6,89%	10,63%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	1.273.060,77	0,00	0,00	1.333.704,56	60.643,79	4,76%	4,76%	18,41%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.501.872,00	0,00	0,00	1.560.000,00	58.128,00	3,87%	3,87%	12,69%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.966.046,72	0,00	0,00	2.028.270,98	62.224,26	3,16%	3,16%	14,80%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1.035.740,64	0,00	0,00	1.061.491,59	25.750,95	2,49%	2,49%	4,03%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1.909.889,26	0,00	0,00	1.955.348,31	45.459,05	2,38%	2,38%	3,87%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.736.203,00	0,00	0,00	1.752.032,98	15.829,98	0,91%	0,91%	0,85%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.801.640,84	0,00	0,00	1.811.936,40	10.295,56	0,57%	0,57%	0,94%
BB DINÂMICO FIC MULTIMERCADO LP	6.460.472,44	0,00	0,00	6.494.141,51	33.669,07	0,52%	0,52%	0,56%
Total Renda Variável	21.331.991,69	0,00	0,00	21.905.601,42	573.609,73	2,69%		6,61%

CRÉDITO E MERCADO

Engenharia Financeira

INSTITUTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA DE SERTÃOZINHO - SERTPREV - CONSOLIDADO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/05/2020

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	1.098.605,42	0,00	0,00	1.129.163,80	30.558,38	2,78%	2,78%	11,11%
Total Renda Variável	1.098.605,42	0,00	0,00	1.129.163,80	30.558,38	2,78%		11,11%