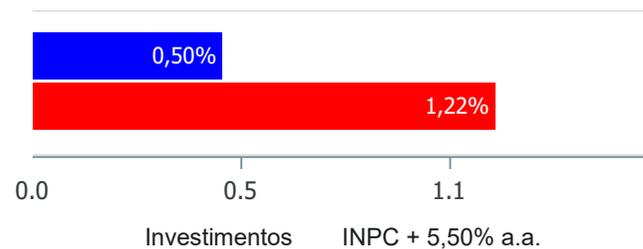


Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

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%

Investimentos x Meta Atuarial



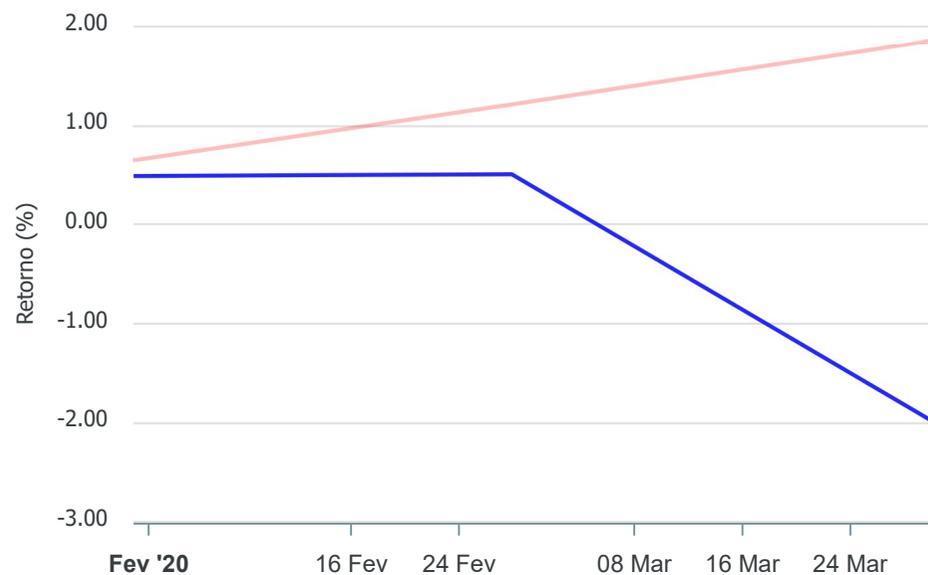
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Fevereiro/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	823.637,01	0,00	0,00	829.983,48	6.346,47	0,77%	0,77%	1,23%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	8.368.881,29	0,00	8.300.000,00	132.089,83	63.208,54	0,76%	0,43%	0,96%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	878.398,50	0,00	0,00	884.864,50	6.466,00	0,74%	0,74%	1,46%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	680.988,20	0,00	16.947,53	668.941,79	4.901,12	0,72%	0,72%	0,83%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	512.935,50	0,00	12.111,12	504.417,60	3.593,22	0,70%	-1,66%	4,70%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	7.865.539,35	0,00	198.317,91	7.718.867,31	51.645,87	0,66%	0,66%	0,74%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	36.600.375,42	0,00	0,00	36.838.518,03	238.142,61	0,65%	0,65%	0,85%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.404.270,04	0,00	0,00	4.431.996,75	27.726,71	0,63%	0,63%	0,86%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	6.562.462,60	0,00	0,00	6.603.685,94	41.223,34	0,63%	0,63%	0,67%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	36.896.221,54	0,00	0,00	37.123.907,10	227.685,56	0,62%	0,62%	0,91%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.259.027,71	0,00	0,00	4.284.643,87	25.616,16	0,60%	0,60%	0,69%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.608.647,99	0,00	40.250,73	1.578.007,45	9.610,19	0,60%	0,60%	0,85%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	2.031.918,88	0,00	51.760,96	1.991.237,66	11.079,74	0,55%	0,55%	0,69%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.913.439,69	0,00	80.894,79	2.847.729,11	15.184,21	0,52%	-2,26%	4,92%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	14.216.203,38	0,00	0,00	14.278.601,40	62.398,02	0,44%	0,44%	2,42%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	41.760.372,43	0,00	0,00	41.942.807,11	182.434,68	0,44%	0,44%	2,42%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	5.629.422,95	0,00	147.919,41	5.504.587,48	23.083,94	0,41%	0,41%	0,39%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	8.851.947,62	6.318.146,00	15.118.139,00	113.350,89	61.396,27	0,40%	0,44%	0,97%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	72.046.415,65	8.681.489,85	0,00	80.995.945,64	268.040,14	0,33%	0,35%	0,07%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	5.518.723,72	0,00	0,00	5.536.231,71	17.507,99	0,32%	0,32%	0,94%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	1.105.759,38	0,00	0,00	1.109.065,95	3.306,57	0,30%	0,30%	3,74%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	7.850.981,98	0,00	0,00	7.873.859,34	22.877,36	0,29%	0,29%	3,75%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIAD...	4.293.804,75	0,00	0,00	4.305.844,26	12.039,51	0,28%	0,28%	0,01%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	21.456.744,54	0,00	21.400.000,00	110.155,62	53.411,08	0,25%	0,32%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDEN...	2.436.062,72	0,00	68.398,22	2.373.713,47	6.048,97	0,25%	0,25%	0,22%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.486.478,61	0,00	12.450.000,00	66.021,67	29.543,06	0,24%	0,29%	0,03%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	34.979.221,75	16.211.379,95	5.869.999,98	45.432.887,22	112.285,50	0,22%	0,27%	0,02%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	13.448.458,86	17.500.000,00	0,00	31.013.977,56	65.518,70	0,21%	0,36%	0,07%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	13.509.632,42	0,00	13.500.000,00	30.645,08	21.012,66	0,16%	0,28%	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	2.953.809,49	0,00	2.953.809,49	4.576,83	4.576,83	0,15%	0,27%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	41.031.983,54	3.694.086,55	40.423.085,67	4.360.504,59	57.520,17	0,13%	0,22%	0,01%
TÍTULOS PÚBLICOS	11.525.760,87	0,00	0,00	11.525.760,87	0,00	0,00%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	28.300.000,00	0,00	28.194.592,67	-105.407,33	-0,37%	0,46%	1,08%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	2.315.367,11	17.500.000,00	0,00	19.684.125,96	-131.241,15	-0,66%	0,44%	2,41%
Total Renda Fixa	431.823.895,49	98.205.102,35	120.631.634,81	410.896.145,74	1.498.782,71	0,28%		0,92%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.805.838,14	0,00	0,00	1.809.017,35	3.179,21	0,18%	0,18%	0,99%
BB DINÂMICO FIC MULTIMERCADO LP	0,00	6.500.000,00	0,00	6.483.473,61	-16.526,39	-0,25%	0,06%	0,62%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,00	2.000.000,00	0,00	1.991.205,31	-8.794,69	-0,44%	-2,28%	4,73%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,00	1.750.000,00	0,00	1.741.796,27	-8.203,73	-0,47%	-0,09%	1,26%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,00	1.100.000,00	0,00	1.094.139,31	-5.860,69	-0,53%	-2,41%	4,41%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	0,00	1.750.000,00	0,00	1.591.268,19	-158.731,81	-9,07%	-8,48%	15,07%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,00	2.700.000,00	0,00	2.448.854,07	-251.145,93	-9,30%	-8,37%	16,17%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	0,00	1.750.000,00	0,00	1.580.407,70	-169.592,30	-9,69%	-8,96%	15,23%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	0,00	1.950.000,00	0,00	1.760.846,43	-189.153,57	-9,70%	-8,60%	18,15%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	0,00	1.750.000,00	0,00	1.573.726,55	-176.273,45	-10,07%	-7,87%	17,86%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.100.000,00	0,00	0,00	1.768.800,00	-331.200,00	-15,77%	-15,77%	34,34%
Total Renda Variável	3.905.838,14	21.250.000,00	0,00	23.843.534,79	-1.312.303,35	-5,22%		9,68%

CRÉDITO E MERCADO

Engenharia Financeira

INSTITUTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA DE SERTÃOZINHO - SERTPREV - CONSOLIDADO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 28/02/2020

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	891.182,12	-108.817,88	-10,88%	-5,69%	13,66%
Total Renda Variável	0,00	1.000.000,00	0,00	891.182,12	-108.817,88	-10,88%		13,66%