

Fundo de previdência social do Município de Olinda

Relatório Trimestral de investimentos

1º Trimestre

2020

RECURSOS EM 31 JANEIRO/2020

Relatório Mensal de Investimentos - Portaria MPS nº 519/2011 Art 3º, V

FINANCEIRO	NOME DO FUNDO	RENDIMENTO	TOTAL DE RECURSOS	RENTABILIDADE	TIPO	
	001	REF. DI LP - CDI (caixa) 03.737.206/0001-97	R\$35.86	R\$ 641.51	0.3708%	Renda Fixa
	002	IRF M1 TP RF (CAIXA) 10.740.670/0001-06	R\$58.24	R\$ 1,115.87	0.4225%	FI 100% Títulos Públicos
	003	RF IRF-M1 (BB) 11.328.882/0001-35	R\$504.03	R\$ 120,698.64	0.4193%	FI 100% Títulos Públicos
	004	Soberano RF IRF-M1 08.703.063/0001-16	R\$3,338.71	R\$988,898.94	0.4300%	FI 100% Títulos Públicos
	-	R\$ 3,936.84	R\$ 1,111,354.96			

CAPITALIZADO	NOME DO FUNDO	RENDIMENTO	TOTAL DE RECURSOS	RENTABILIDADE	TIPO	
	005	IRF M1 TP RF (CAIXA) 10.740.670/0001-06	R\$ 62,180.89	R\$ 14,777,746.82	0.4225%	FI 100% Títulos Públicos
	006	IDKA2 IPCA 2A (CAIXA) 14.386.926/0001-71	R\$ 70,424.59	R\$ 15,475,441.41	0.4572%	FI 100% Títulos Públicos
	007	REF. DI LP - CDI (caixa) 03.737.206/0001-97	R\$ 36,332.14	R\$ 9,834,448.34	0.3708%	Renda Fixa
	008	TP IPCA I (BB) 19.303.793/0001-46	R\$ 10,625.87	R\$ 1,669,266.25	0.6406%	FI 100% Títulos Públicos
	009	TP IPCA VI (BB) 19.523.306/0001-50	R\$ 22,322.82	R\$ 3,251,464.48	0.6912%	FI 100% Títulos Públicos
	010	RF IRF-M1 (BB) 11.328.882/0001-35	R\$ 18,873.33	R\$ 4,519,541.88	0.4193%	FI 100% Títulos Públicos
	011	RF IMA-B5+ (BB) 13.327.340/0001-73	R\$ 102.50	R\$ 216,363.78	0.0473%	FI 100% Títulos Públicos
	012	IDKA2 (BB) 13.322.205/0001-35	R\$ 33,045.84	R\$ 8,616,648.95	0.3849%	FI 100% Títulos Públicos
	013	RF TP XI (BB) 24.117.278/0001-01	R\$ 16,729.43	R\$ 2,651,443.65	0.6349%	FI 100% Títulos Públicos
	014	RF Alocação Ativa (BB) 25.078.994/0001-90	R\$6,394.29	R\$ 1,322,523.20	0.4858%	FI 100% Títulos Públicos
	015	BB Ações Valor 29.258.294/0001-38	-R\$3,198.29	R\$ 219,023.69	-1.4392%	Renda Variável
	016	FIDC DUNAS (B. Paulista) 13.633.964/0001-19	R\$0.00	R\$ 0.00	0.00%	FIDC FECHADO
	017	Soberano RF IRF-M1 08.703.063/0001-16	R\$ 39,309.22	R\$ 9,227,422.94	0.4300%	FI 100% Títulos Públicos
	018	Itaú Alocação Dinâmica 21.838.150/0001-49	R\$ 33,075.98	R\$ 10,083,478.56	0.3400%	Renda Fixa
	019	INSTITUCIONAL AÇÕES PHOENIX	R\$ 25,957.69	R\$ 1,795,303.09	1.4700%	Renda Variável
	020	Ações Dunamis FIC 24.571.992/0001-75	-R\$ 745.74	R\$ 394,025.02	-0.1900%	Renda Variável
	021	ITAÚ LEGEND RF LP 29.241.799/0001-90	R\$ 296.90	R\$ 187,918.46	0.1600%	Renda Fixa
	022	RF IMA-B5+ FIC 14.437.684/0001-06	R\$ 266.32	R\$ 294,349.56	0.01%	Renda Fixa
	023	BNB Plus FI RF LP 06.124.241/0001-29	R\$ 1,966.01	R\$ 573,957.55	0.3437%	Renda Fixa
		-	R\$ 373,959.79	R\$ 85,110,367.63		

DISPONIBILIDADE FUNDO FINANCEIRO	R\$4,596.90
DISPONIBILIDADE FUNDO CAPITALIZADO	R\$12,433.77
TOTAL DE DISPONIBILIDADE	R\$17,030.67

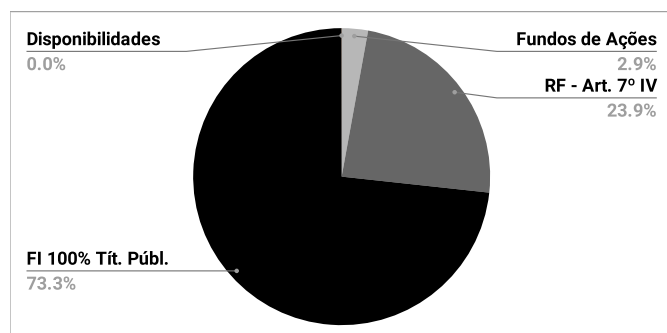
RECURSOS FUNDO FINANCEIRO	R\$1,111,354.96
RECURSOS FUNDO CAPITALIZADO	R\$85,110,367.63
TOTAL DE RECURSOS APLICADOS	R\$86,221,722.59

TOTAL	R\$86,238,753.26
--------------	-------------------------

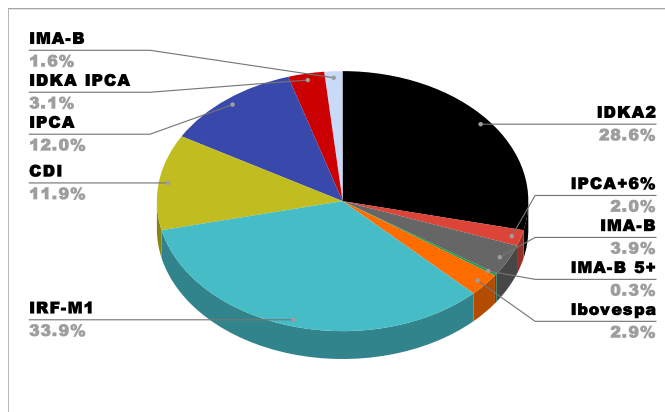
Composição da Carteira - Fundo Capitalizado - Janeiro/2020

Fundos de Ações	R\$2,408,351.80
Renda Fixa - Art. 7º IV	R\$20,679,802.91
FI 100% Títulos Públicos	R\$62,022,212.92
FIDC	R\$0.00
Disponibilidades	R\$12,433.77
Total	R\$85,122,801.40

Percentual por Tipo de Ativo



Percentual de Composição da Carteira Por Benchmark



Desempenho da Carteira - Capitalizado

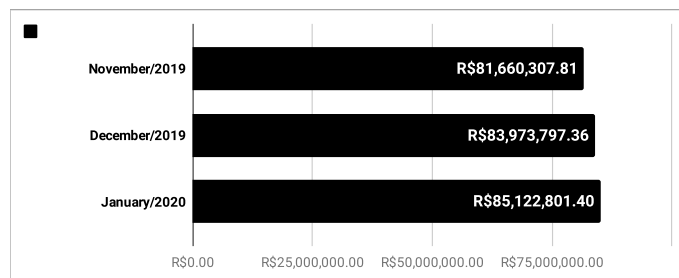
IPCA de Janeiro	0.21%
Meta Atuarial Janeiro	0.60%
Meta Atuarial Acumulada 2020	0.60%
Rentabilidade janeiro	0.45%
Rentabilidade acumulada do Fundo	0.45%

* Meta Atuarial anual IPCA + 4,61%

Tabela IPCA 2020

Mês	Valor Mensal	Acumulado no ano	Acumulado em 12 meses
JAN	0.21%	0.21%	4.19%
FEV			
MAR			
ABR			
MAI			
JUN			
JUL			
AGO			
SET			
OUT			
NOV			
DEZ			

Evolução Patrimonial - FUNDPREV-Olinda - Fundo Capitalizado



Fundo Capitalizado - Rendimento 2020

	Saldo Anterior	Saldo Atual	Rendimento	Rendimento Carteira
Janeiro	R\$83,973,797.36	R\$85,110,367.63	R\$373,959.79	0.45%
Fevereiro				0.45%
Março				0.45%
Abril				0.45%
Maio				0.45%
Junho				0.45%
Julho				0.45%
Agosto				0.45%
Setembro				0.45%
Outubro				0.45%
Novembro				0.45%
Dezembro				0.45%
Total			R\$373,959.79	0.45%

Fundo Financeiro - Rendimento 2020

	Saldo	Rendimento (R\$)
Janeiro	R\$1,111,354.96	R\$3,936.84
Fevereiro		
Março		
Abril		
Maio		
Junho		
Julho		
Agosto		
Setembro		
Outubro		
Novembro		
Dezembro		
Total		R\$3,936.84

RECURSOS EM 29 FEVEREIRO/2020

Relatório Mensal de Investimentos - Portaria MPS nº 519/2011 Art 3º, V

	NOME DO FUNDO	RENDIMENTO	TOTAL DE RECURSOS	RENTABILIDADE	TIPO	
FINANCEIRO	001	REF. DI LP - CDI (caixa) 03.737.206/0001-97	R\$1.76	R\$ 643.27	0.2738%	Renda Fixa
	002	IRF M1 TP RF (CAIXA) 10.740.670/0001-06	R\$4.06	R\$ 1,119.93	0.3632%	FI 100% Títulos Públicos
	003	RF IRF-M1 (BB) 11.328.882/0001-35	R\$425.99	R\$ 121,124.63	0.3529%	FI 100% Títulos Públicos
	004	Soberano RF IRF-M1 08.703.063/0001-16	R\$1,936.24	R\$26,661.85	0.3300%	FI 100% Títulos Públicos
		-	R\$ 2,368.05	R\$ 149,549.68		

	NOME DO FUNDO	RENDIMENTO	TOTAL DE RECURSOS	RENTABILIDADE	TIPO	
CAPITALIZADO	005	IRF M1 TP RF (CAIXA) 10.740.670/0001-06	R\$ 53,680.69	R\$ 14,831,427.51	0.3632%	FI 100% Títulos Públicos
	006	IDKA2 IPCA 2A (CAIXA) 14.386.926/0001-71	R\$ 93,077.98	R\$ 15,568,519.39	0.6015%	FI 100% Títulos Públicos
	007	REF. DI LP - CDI (caixa) 03.737.206/0001-97	R\$ 26,934.46	R\$ 9,861,382.80	0.2738%	Renda Fixa
	008	TP IPCA I (BB) 19.303.793/0001-46	R\$ 42,072.15	R\$ 1,639,263.34	0.7284%	FI 100% Títulos Públicos
	009	TP IPCA VI (BB) 19.523.306/0001-50	R\$ 23,165.40	R\$ 3,194,945.00	0.7150%	FI 100% Títulos Públicos
	010	RF IRF-M1 (BB) 11.328.882/0001-35	R\$ 15,951.31	R\$ 4,535,493.19	0.3529%	FI 100% Títulos Públicos
	011	RF IMA-B5+ (BB) 13.327.340/0001-73	-R\$ 198.12	R\$ 251,165.66	0.2990%	FI 100% Títulos Públicos
	012	IDKA2 (BB) 13.322.205/0001-35	R\$ 54,127.11	R\$ 8,670,776.06	0.6281%	FI 100% Títulos Públicos
	013	RF TP XI (BB) 24.117.278/0001-01	R\$ 19,082.62	R\$ 2,604,540.66	0.7249%	FI 100% Títulos Públicos
	014	RF Alocação Ativa (BB) 25.078.994/0001-90	R\$5,468.90	R\$ 1,445,734.74	0.4559%	FI 100% Títulos Públicos
	015	BB Ações Valor 29.258.294/0001-38	-R\$22,796.86	R\$ 231,226.83	-8.9627%	Renda Variável
	016	FIDC DUNAS (B. Paulista) 13.633.964/0001-19	R\$0.00	R\$ 0.00	0.00%	FIDC FECHADO
	017	Soberano RF IRF-M1 08.703.063/0001-16	R\$ 30,571.68	R\$ 9,262,291.98	0.3300%	FI 100% Títulos Públicos
	018	Itaú Alocação Dinâmica 21.838.150/0001-49	R\$ 26,798.58	R\$ 10,696,410.75	0.2600%	Renda Fixa
	019	INSTITUCIONAL AÇÕES PHOENIX	-R\$ 166,354.57	R\$ 1,628,948.52	-9.2700%	Renda Variável
	020	Ações Dunamis FIC 24.571.992/0001-75	-R\$ 38,584.94	R\$ 355,440.08	-9.7900%	Renda Variável
	021	ITAÚ LEGEND RF LP 29.241.799/0001-90	R\$ 1,102.96	R\$ 189,021.42	0.5900%	Renda Fixa
	022	RF IMA-B5+ FIC 14.437.684/0001-06	R\$ 499.17	R\$ 329,848.73	0.30%	Renda Fixa
	023	BNB Plus FI RF LP 06.124.241/0001-29	R\$ 1,509.35	R\$ 575,466.90	0.2630%	Renda Fixa
		-	R\$ 166,107.87	R\$ 85,871,903.56		

DISPONIBILIDADE FUNDO FINANCEIRO	R\$60.95
DISPONIBILIDADE FUNDO CAPITALIZADO	R\$8,121.77
TOTAL DE DISPONIBILIDADE	R\$8,182.72

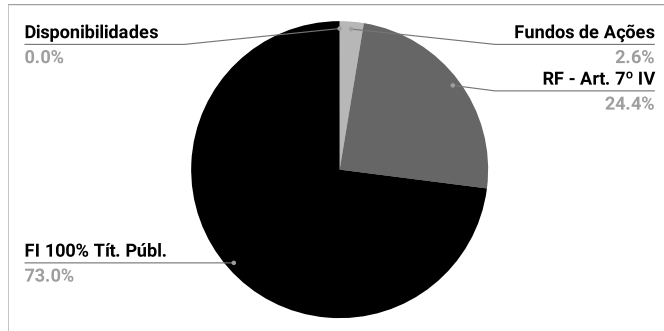
RECURSOS FUNDO FINANCEIRO	R\$149,549.68
RECURSOS FUNDO CAPITALIZADO	R\$85,871,903.56
TOTAL DE RECURSOS APLICADOS	R\$86,021,453.24

TOTAL	R\$86,029,635.96
--------------	-------------------------

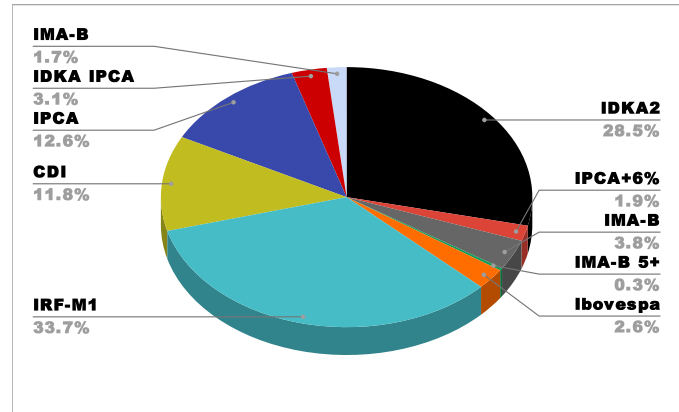
Composição da Carteira - Fundo Capitalizado - Fevereiro/2020

Fundos de Ações	R\$2,215,615.43
Renda Fixa - Art. 7º IV	R\$21,322,281.87
FI 100% Títulos Públicos	R\$62,334,006.26
FIDC	R\$0.00
Disponibilidades	R\$8,121.77
Total	R\$85,880,025.33

Percentual por Tipo de Ativo



Percentual de Composição da Carteira Por Benchmark



Desempenho da Carteira - Capitalizado

IPCA de fevereiro	0.2500%
Meta Atuarial fevereiro	0.5148%
Meta Atuarial Acumulada 2020	1.0686%
Rentabilidade fevereiro	0.1952%
Rentabilidade acumulada do Fundo	0.6414%

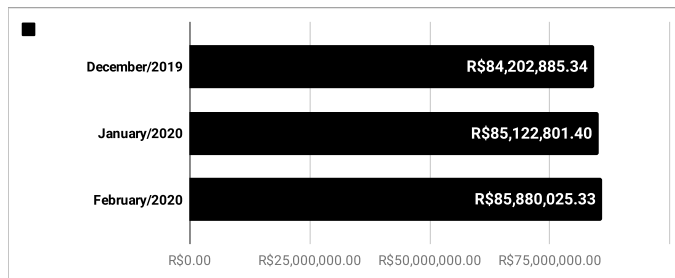
* Meta Atuarial anual IPCA + 4,61%

Tabela IPCA 2020

Mês	Valor Mensal	Acumulado no ano	Acumulado em 12 meses
JAN	0.21%	0.21%	4.19%
FEV	0.25%	0.46%	4,01%
MAR			
ABR			
MAI			
JUN			
JUL			
AGO			
SET			
OUT			
NOV			
DEZ			

0.67%

Evolução Patrimonial - FUNDPREV-Olinda - Fundo Capitalizado



Fundo Capitalizado - Rendimento 2020				
	Saldo Anterior	Saldo Atual	Rendimento	Rendimento Carteira
Janeiro	R\$83,973,797.36	R\$85,110,367.63	R\$373,959.79	0.4453%
Fevereiro	R\$85,110,367.63	R\$85,871,903.56	R\$166,107.87	0.1952%
Março				
Abril				
Maio				
Junho				
Julho				
Agosto				
Setembro				
Outubro				
Novembro				
Dezembro				
Total			R\$540,067.66	0.6414%

Fundo Capitalizado - Rendimento 2020		
	Saldo	Rendimento (R\$)
Janeiro	R\$1,111,354.96	R\$3,936.84
Fevereiro	R\$149,549.68	R\$2,368.05
Março		
Abril		
Maio		
Junho		
Julho		
Agosto		
Setembro		
Outubro		
Novembro		
Dezembro		
Total		R\$6,304.89

RECURSOS EM 31 MARÇO/2020

Relatório Mensal de Investimentos - Portaria MPS nº 519/2011 Art 3º, V

		NOME DO FUNDO	RENDIMENTO	TOTAL DE RECURSOS	RENTABILIDADE	TIPO
FINANCEIRO	001	REF. DI LP - CDI (caixa) 03.737.206/0001-97	R\$0.91	R\$87,764.62	0.1422%	Renda Fixa
	002	IRF M1 TP RF (CAIXA) 10.740.670/0001-06	R\$6.58	R\$ 6,171.96	0.5878%	FI 100% Títulos Públicos
	003	RF IRF-M1 (BB) 11.328.882/0001-35	R\$723.85	R\$ 121,848.48	0.5976%	FI 100% Títulos Públicos
	004	Soberano RF IRF-M1 08.703.063/0001-16	R\$4,949.40	R\$4,362.98	0.5700%	FI 100% Títulos Públicos
		-	R\$ 5,680.74	R\$ 220,148.04		

		NOME DO FUNDO	RENDIMENTO	TOTAL DE RECURSOS	RENTABILIDADE	TIPO
CAPITALIZADO	005	IRF M1 TP RF (CAIXA) 10.740.670/0001-06	R\$ 87,180.14	R\$ 14,918,607.65	0.5878%	FI 100% Títulos Públicos
	006	IDKA2 IPCA 2A (CAIXA) 14.386.926/0001-71	-R\$ 226,318.21	R\$ 15,342,201.18	-1.4537%	FI 100% Títulos Públicos
	007	REF. DI LP - CDI (caixa) 03.737.206/0001-97	R\$ 14,026.74	R\$ 9,875,409.54	0.1422%	Renda Fixa
	008	TP IPCA I (BB) 19.303.793/0001-46	-R\$ 28,339.70	R\$ 1,610,923.64	-1.7288%	FI 100% Títulos Públicos
	009	TP IPCA VI (BB) 19.523.306/0001-50	-R\$ 65,804.19	R\$ 3,129,140.81	-2.0596%	FI 100% Títulos Públicos
	010	RF IRF-M1 (BB) 11.328.882/0001-35	R\$ 27,104.49	R\$ 4,562,597.68	0.5976%	FI 100% Títulos Públicos
	011	RF IMA-B5+ (BB) 13.327.340/0001-73	-R\$ 27,343.24	R\$ 223,822.42	-10.8865%	FI 100% Títulos Públicos
	012	IDKA2 (BB) 13.322.205/0001-35	-R\$ 144,164.35	R\$ 8,526,611.71	-1.6626%	FI 100% Títulos Públicos
	013	RF TP XI (BB) 24.117.278/0001-01	-R\$ 45,167.56	R\$ 2,559,373.10	-1.7341%	FI 100% Títulos Públicos
	014	RF Alocação Ativa (BB) 25.078.994/0001-90	-R\$30,378.51	R\$ 1,415,356.23	-2.1012%	FI 100% Títulos Públicos
	015	BB Ações Valor 29.258.294/0001-38	-R\$62,538.68	R\$ 168,688.15	-27.0464%	Renda Variável
	016	FIDC DUNAS (B. Paulista) 13.633.964/0001-19	R\$0.00	R\$ 0.00	0.00%	FIDC FECHADO
	017	Soberano RF IRF-M1 08.703.063/0001-16	R\$ 54,117.77	R\$ 9,809,943.47	0.5700%	FI 100% Títulos Públicos
	018	Itaú Alocação Dinâmica 21.838.150/0001-49	R\$ 57,175.92	R\$ 10,894,106.35	0.5300%	Renda Fixa
	019	INSTITUCIONAL AÇÕES PHOENIX	-R\$ 682,259.74	R\$ 946,688.78	-41.8800%	Renda Variável
	020	Ações Dunamis FIC 24.571.992/0001-75	-R\$ 115,321.28	R\$ 240,118.80	-32.4400%	Renda Variável
	021	ITAÚ LEGEND RF LP 29.241.799/0001-90	R\$ 6,563.50	R\$ 195,584.92	3.4700%	Renda Fixa
	022	RF IMA-B5+ FIC 14.437.684/0001-06	-R\$ 36,229.71	R\$ 293,619.02	-10.9800%	Renda Fixa
	023	BNB Plus FI RF LP 06.124.241/0001-29	R\$ 841.44	R\$ 576,308.34	0.1462%	Renda Fixa
		-	-R\$ 1,216,855.17	R\$ 85,289,101.79		

DISPONIBILIDADE FUNDO FINANCEIRO	R\$60.95
DISPONIBILIDADE FUNDO CAPITALIZADO	R\$8,121.77
TOTAL DE DISPONIBILIDADE	R\$8,182.72

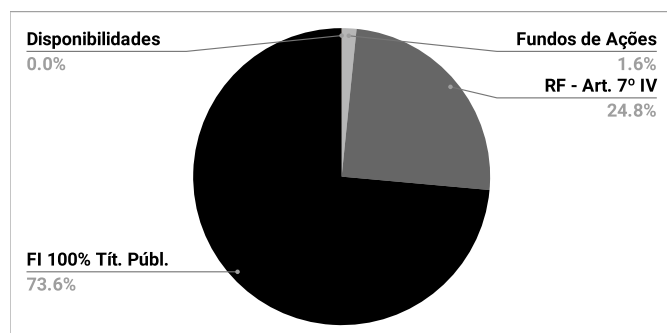
RECURSOS FUNDO FINANCEIRO	R\$220,148.04
RECURSOS FUNDO CAPITALIZADO	R\$85,289,101.79
TOTAL DE RECURSOS APLICADOS	R\$85,509,249.83

TOTAL	R\$85,517,432.55
--------------	-------------------------

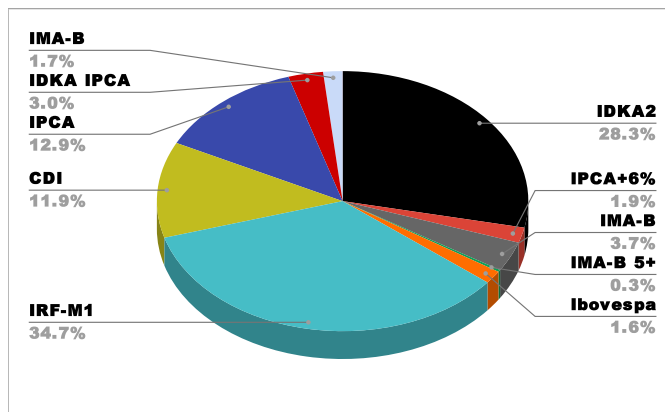
Composição da Carteira - Fundo Capitalizado - março/2020

Fundos de Ações	R\$1,355,495.73
Renda Fixa - Art. 7º IV	R\$21,541,409.15
FI 100% Títulos Públicos	R\$62,392,196.91
FIDC	R\$0.00
Disponibilidades	R\$8,121.77
Total	R\$85,297,223.56

Percentual por Tipo de Ativo



Percentual de Composição da Carteira Por Benchmark



Desempenho da Carteira - Capitalizado

IPCA de março	0.0700%
Meta Atuarial março	0.4476%
Meta Atuarial Acumulada 2020	1.5313%
Rentabilidade março	-1.4171%
Rentabilidade acumulada do Fundo	-0.7848%

* Meta Atuarial anual IPCA + 4,61%

Evolução Patrimonial - FUNDPREV-Olinda - Fundo Capitalizado

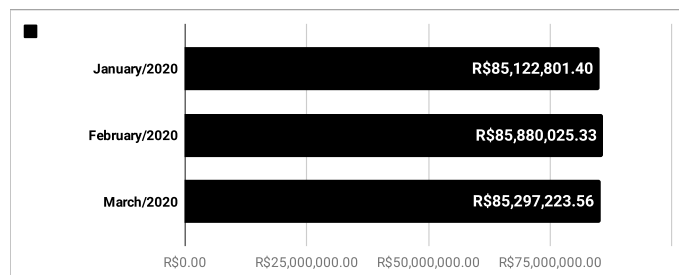


Tabela IPCA 2020

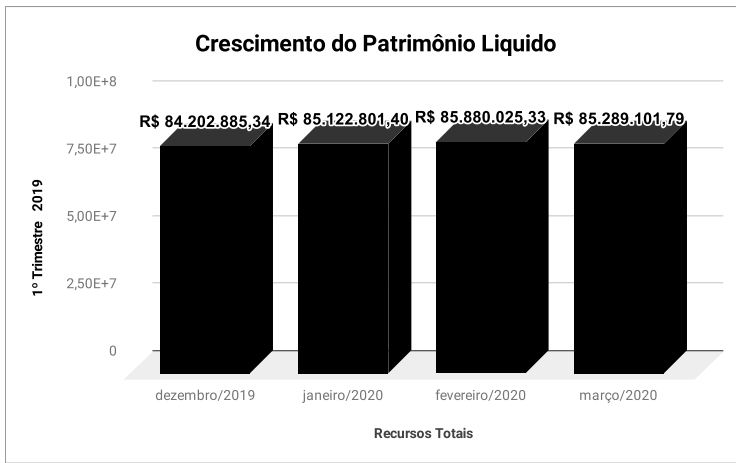
Mês	Valor Mensal	Acumulado no ano	Acumulado em 12 meses
JAN	0.21%	0.21%	4.19%
FEV	0.25%	0.46%	4.01%
MAR	0.07%	0.53%	3.30%
ABR			
MAI			
JUN			
JUL			
AGO			
SET			
OUT			
NOV			
DEZ			

0.67%

Fundo Capitalizado - Rendimento 2020				
	Saldo Anterior	Saldo Atual	Rendimento	Rendimento Carteira
Janeiro	R\$83,973,797.36	R\$85,110,367.63	R\$373,959.79	0.4453%
Fevereiro	R\$85,110,367.63	R\$85,871,903.56	R\$166,107.87	0.1952%
Março	R\$85,871,903.56	R\$85,289,101.79	-R\$1,216,855.17	-1.4171%
Abril				
Maio				
Junho				
Julho				
Agosto				
Setembro				
Outubro				
Novembro				
Dezembro				
Total			-R\$676,787.51	-0.7848%

-7,848

Fundo Financeiro - Rendimento 2020		
	Saldo	Rendimento (R\$)
Janeiro	R\$1,111,354.96	R\$3,936.84
Fevereiro	R\$149,549.68	R\$2,368.05
Março	R\$220,148.04	R\$5,680.74
Abril		
Maio		
Junho		
Julho		
Agosto		
Setembro		
Outubro		
Novembro		
Dezembro		
Total		R\$11,985.63



Fundo Capitalizado - Recursos Aplicados

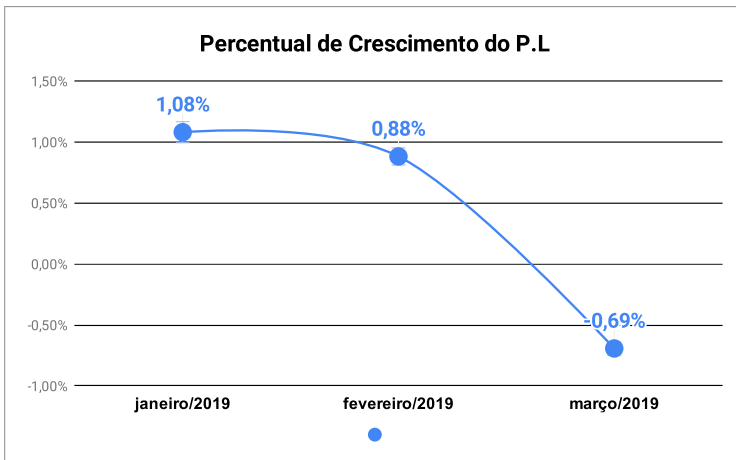
dezembro/2019	R\$ 83.973.797,36
janeiro/2020	R\$ 85.110.367,63
fevereiro/2020	R\$ 85.871.903,56
março/2020	R\$ 85.289.101,79

Disponibilidade

dezembro/2019	R\$ 229.087,98
janeiro/2020	R\$ 12.433,77
fevereiro/2020	R\$ 8.121,77
março/2020	R\$ 0,00

Recursos Totais

dezembro/2019	R\$ 84.202.885,34
janeiro/2020	R\$ 85.122.801,40
fevereiro/2020	R\$ 85.880.025,33
março/2020	R\$ 85.289.101,79



Percentual de Crescimento do P.L

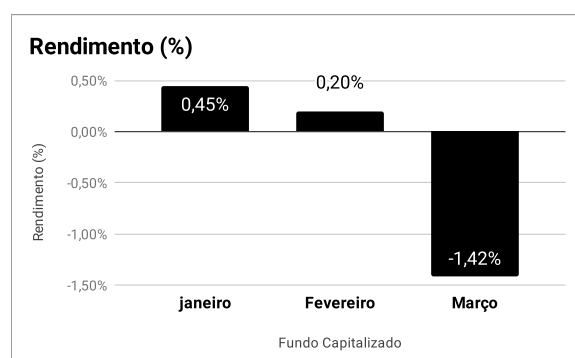
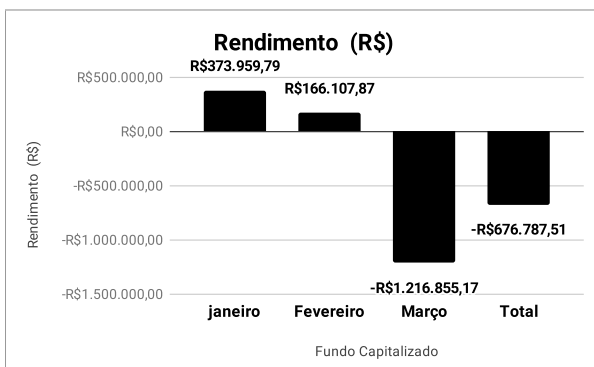
janeiro/2019	1,08%
fevereiro/2019	0,88%
março/2019	-0,69%
Total	1,27%

Fundo Capitalizado

	Rendimento (R\$)	Rendimento (%)
janeiro	R\$373.959,79	0,45%
Fevereiro	R\$166.107,87	0,20%
Março	-R\$1.216.855,17	-1,42%
Total	-R\$676.787,51	-

Desempenho da Carteira

Meta Atuarial para o Ano	IPCA + 4,61%
Meta Atuarial Acumulada	1,53%
Rentabilidade acumulada do Fundo	-0,78%
Percentual Atingido da Meta Atuarial	-51,29%



Resumo - Meta atuarial 2020 - Fundo Capitalizado

Mês	Saldo Total Anterior	Aplicações	Resgates	Retorno de investimentos	Saldo Atual Recursos Aplicados	Retorno (%)	IPCA Mensal	Meta atuarial	Percentual atingido da Meta Atuarial
Janeiro	R\$ 83.973.797,36	R\$ 768.860,28	R\$ 6.249,80	R\$ 373.959,79	R\$ 85.110.367,63	0,45%	0,21%	0,60%	74,22%
Fevereiro	R\$ 85.110.367,63	R\$ 821.310,02	R\$ 195.879,05	R\$ 166.107,87	R\$ 85.871.903,56	0,20%	0,25%	1,08%	59,39%
Março	R\$ 85.871.903,56	R\$ 634.053,40	R\$ 0,00	-R\$ 1.216.855,17	R\$ 85.289.101,79	-1,42%	0,07%	1,53%	-51,29%
Abril									
maio									
Junho									
Julho									
Agosto									
Setembro									
Outubro									
Novembro									
Dezembro									
TOTAL				-R\$ 676.787,51		-0,7848%			

	IPCA 2019	IPCA Acumulado
Janeiro	0,21%	0,21%
Fevereiro	0,25%	0,46%
Março	0,07%	0,53%
Abril		
maio		
Junho		
Julho		
Agosto		
Setembro		
Outubro		
Novembro		
Dezembro		