

02 INVESTIMENTOS DO RPPS DA CIDADE DE SÃO PAULO

Setembro/2019

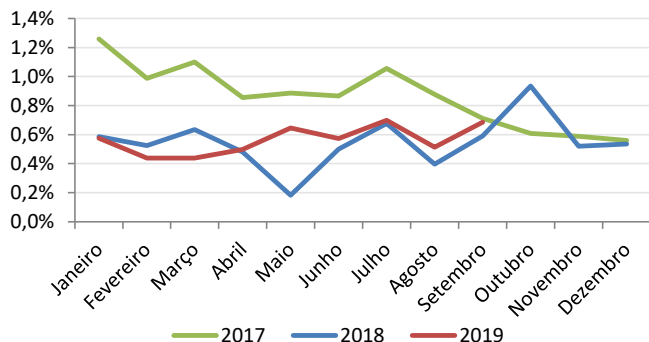
Ano PI	Rentabilidade												
	Informações Atuariais			IPCA	INPC	BB Prev RF IRF-M1		BB Prev RF IMA-B 5 LP		Total - Carteira		Projetado / Realizado	
	DRAA	Meta	Indexador			FI (tx nominal)	FI (tx real)	FI (tx nominal)	FI (tx real)	FI (tx nominal)	FI (tx real)	nominal	real
2017	2016	6%	IPCA	2,95%	2,07%	10,86%	7,69%	12,42%	9,20%	10,86%	7,69%	10,86%	✓ 7,69%
2018	2017	5%	IPCA	3,75%	3,43%	6,76%	2,89%	9,65%	5,69%	6,76%	2,89%	6,76%	✗ 2,89%
2019 ^{projetado}	2018	5%	IPCA	2,49%	2,63%	5,12%	2,56%	10,09%	7,41%	5,88%	3,31%	6,97%	✗ 3,51%

Fonte: DRAA; IBGE; BB. Elaboração Própria.

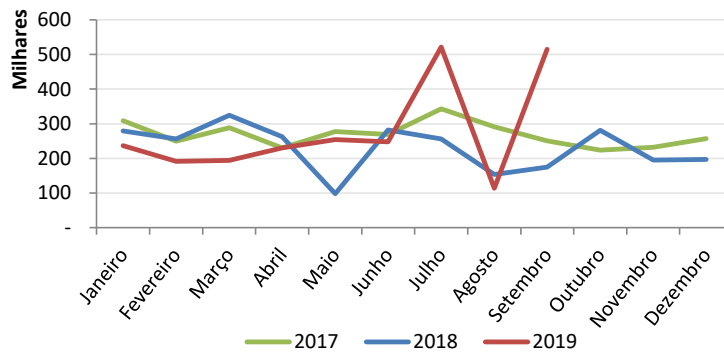
Gestão dos Recursos do RPPS-SP	
Credenciamento	
Data do Credenciamento	11/04/2019 ✓
Fundos Credenciados	Classificação ANBIMA
BB Prev RF IRF-M1 TP FIC FI (11.328.882/0001-35)	Art. 7º, I, "b"
BB Prev RF IMA-B 5 LP TP FIC FI (03.543.447/0001-03)	Art. 7º, I, "b"
BB Prev RF Fluxo FIC FI (13.077.415/0001-05)	Art. 7º, IV, "a"
BB Prev RF IDKA 2 TP FI (13.322.205/0001-35)	Art. 7º, I, "b"
BB Prev RF IMA Geral EX-C TP FI (14.964.240/0001-10)	Art. 7º, I, "b"
BB Prev RF Perfil FIC FI (13.077.418/0001-49)	Art. 7º, IV, "a"

Fonte: Processo SEI de credenciamento.

Rentabilidade mensal (%)

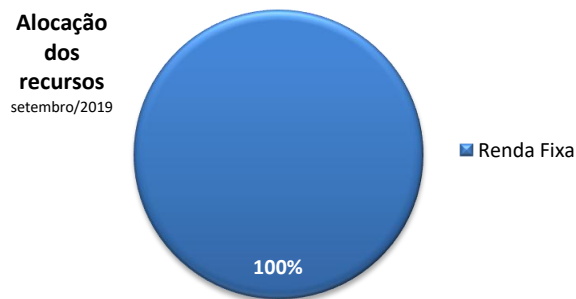
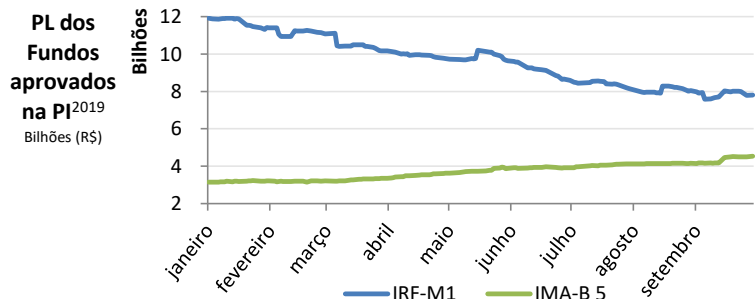


Rentabilidade mensal (R\$)

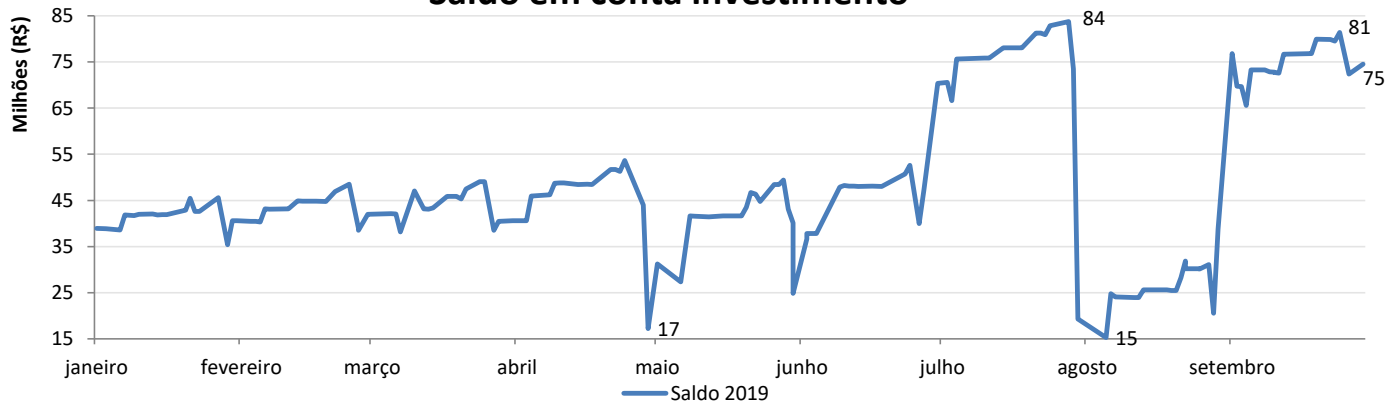


Política de Investimentos		
Fundos Aprovados na Política para 2019		
↳ BB Prev RF IRF-M1 TP FIC FI (11.328.882/0001-35)		
↳ BB Prev RF IMA-B 5 LP TP FIC FI (03.543.447/0001-03)		
Sobre os Fundos	IRF-M1	IMA-B 5
Aplicações subsequentes	Qualquer valor	0,01
Resgate	Qualquer valor	0,01
Saldo mínimo	Qualquer valor	0,01
Cota aplicação	D + 00	D + 00
Cota resgate	D + 00	D + 01
Crédito em conta corrente	D + 00	D + 01
Horário limite de movimentação (H de Brasília)	15:00:00	15:00:00
Aplicação e resgate programado	Sim	Sim
Opção de resgate automático	Nao	Nao
Grau de risco	Muito Baixo	Muito Baixo
Classificação de Risco DD BTVM	1,0	1,3
Prazo de carência	Não há.	30 dias
Taxa de administração (a.a.)	0,3%	0,2%

Fonte: PI; BB.



Saldo em conta investimento



Carteira de Investimentos - Setembro/2019				
Composição				
↳ BB Prev RF IRF-M1 TP FIC FI (11.328.882/0001-35)				
↳ BB Prev RF IMA-B 5 LP TP FIC FI (03.543.447/0001-03)				
Conta investimento	IRF-M1	IMA-B 5		
↳ Saldo no Fundo (Fechamento)	69.445.574,96	5.085.196,85		
↳ Valor máximo resgatado	9.127.000,00	-		
↳ Saldo mínimo em conta	60.568.942,98	4.993.762,74		
↳ Saldo máximo em conta	76.340.887,79	5.085.196,85		
↳ PL do Fundo (Fechamento)	7.803.027.907,11	4.532.246.367,34		
↳ Vlr. aplicado/PL (art. 14 Resolução)	✓ 0,89% ✓	0,11%		
Rentabilidade (R\$)				
(R\$)	2018	Setembro/2019	Acumulado ²⁰¹⁹	Projetado ²⁰¹⁹
(%) Nominal	2.761.368,66	515.360,06	2.505.685,51	3.340.914,01
(%)	6,76%	0,69%	5,88%	6,97%

Fonte: Extrato Conta Investimento.

Comitê de Investimentos	
Membros	Certificação/Vencimento
Roberto Augusto Baviera	CPA-10 ANBIMA (26/02/2022) ✓
Valéria Ap. Catossi Madeira	CPA-10 ANBIMA (10/10/2022) ✗
Yara Silva Martínez	-
Bruno Leme Ferreira da Silva	(Secretário)

Fonte: Portaria IPREM nº 63/2019 e suas alterações posteriores (67/2019); ANBIMA.