

Relatório de Análise, Enquadramento, Rentabilidade e Risco - 31/08/2021

Retorno e Meta Atuarial - Agosto de 2021

RENTA FIXA

Ativo			Rentabilidade						Enquad.
CNPJ	FUNDO	Valor Anterior	Mês	Aplicação	Resgate	CUPOM/DIV	Rentabilidade	Valor do Mês	
10.740.670/0001-06	21 - CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF (ADM)	R\$ 31.802.276,27	0,34%	R\$ 1.453.684,42	R\$ 722.497,31	R\$ -	R\$ 108.412,11	R\$ 32.641.875,49	Art. 7º, I, b
10.740.670/0001-06	22 - CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF (BENEF)	R\$ 110.120.114,09	0,34%	R\$ 152.391.492,43	R\$ 238.296.585,77	R\$ -	R\$ 229.923,52	R\$ 24.444.944,27	
11.060.913/0001-10	56 - FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	R\$ -	0,54%	R\$ 100.000.000,00	R\$ -	R\$ -	R\$ 539.252,74	R\$ 100.539.252,74	
13.322.205/0001-35	58 - BB PREVID RF IDKA 2 TP FI	R\$ -	0,67%	R\$ 130.723.689,93	R\$ -	R\$ -	R\$ 877.902,31	R\$ 131.601.592,24	
14.386.926/0001-71	98 - FI CAIXA BRASIL IDKA 2A TIT RF LONGO P	R\$ -	0,68%	R\$ 100.610.447,83	R\$ -	R\$ -	R\$ 679.926,38	R\$ 101.290.374,21	
13.327.340/0001-73	100 - BB PREVID RF IMA-B 5+	R\$ 118.050.928,09	-4,25%	R\$ -	R\$ 113.030.334,02	R\$ -	R\$ (5.020.594,07)	R\$ -	
23.215.097/0001-55	113 - CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 223.340.506,66	-1,45%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (3.237.507,62)	R\$ 220.102.999,04	
10.577.519/0001-90	116 - CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP	R\$ 195.593.234,12	-1,16%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (2.264.501,44)	R\$ 193.328.732,68	
10.577.503/0001-88	122 - CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ TP RF LP	R\$ 170.342.959,32	-3,66%	R\$ -	R\$ 164.110.447,83	R\$ -	R\$ (6.232.511,49)	R\$ -	
19.418.031/0001-95	134 - ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RF I	R\$ 42.864.967,15	-2,54%	R\$ -	R\$ 18.500.000,00	R\$ -	R\$ (1.089.500,33)	R\$ 23.275.466,82	
10.922.432/0001-03	135 - ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA F	R\$ 101.334.496,08	0,09%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 86.573,51	R\$ 101.421.069,59	
10.756.541/0001-06	144 - ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO LONGA	R\$ 120.459.978,57	-3,96%	R\$ -	R\$ 115.692.811,62	R\$ -	R\$ (4.767.166,95)	R\$ -	
17.517.577/0001-78	161 - WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RF	R\$ -	0,99%	R\$ 80.000.000,00	R\$ -	R\$ -	R\$ 793.197,47	R\$ 80.793.197,47	
13.455.117/0001-01	163 - SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC	R\$ -	0,30%	R\$ 93.048.788,10	R\$ -	R\$ -	R\$ 275.368,61	R\$ 93.324.156,71	
SUBTOTAL		R\$ 1.113.909.460,35		R\$ 658.228.102,71	R\$ 650.352.676,55	R\$ -	R\$ (19.021.225,25)	R\$ 1.102.763.661,26	
13.594.673/0001-69	94 - TMJ IMA-B FI RF	R\$ 4.779.544,13	0,59%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 28.045,19	R\$ 4.717.798,50	Art. 7º IV, a
21.838.150/0001-49	103 - ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂ	R\$ 304.447.906,67	0,31%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 933.194,54	R\$ 305.381.101,21	
26.507.132/0001-06	147 - SANTANDER RENDA FIXA ATIVO FIC FI	R\$ 61.759.830,72	0,23%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 140.500,68	R\$ 61.900.331,40	
SUBTOTAL		R\$ 370.987.281,52		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 1.101.740,41	R\$ 371.999.231,11	
13.344.834/0001-66	62 - INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II	R\$ (2.111.464,83)	0,00%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 12.438,75	R\$ (2.099.026,08)	Art. 7º, VII, a
17.013.985/0001-92	106 - FIDC GGR PRIME I	R\$ 24.551.122,29	-0,02%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (4.470,57)	R\$ 24.546.651,72	
SUBTOTAL		R\$ 22.439.657,46		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 7.968,18	R\$ 22.447.625,64	
TOTAL RENDA FIXA		R\$ 1.507.336.399,33		R\$ 658.228.102,71	R\$ 650.352.676,55	R\$ -	R\$ (17.911.516,66)	R\$ 1.497.210.518,01	

Enquadramento da Resolução CMN nº 3.922	Enquadramento	% da Carteira	Limites por Enquadramento / Política	% da Carteira
Fundo RF - 100% Títulos do Tesouro Nacional	Artigo 7º, I, "b"	45,17%	100% / 42%	 - Fundo RF - 100% Títulos do Tesouro Nacional - Fundo RF - Geral - Fundo RF - FIDC - Direitos Creditórios - Fundo RV - Ações Geral - Fundo RV - Multimercado - Fundo RV - FIP - Participações - Fundo RV - FII - Imobiliário - Fundo RV - Investimentos no Exterior - Fundo RV - Investimentos no Exterior
Fundo RF - Geral	Artigo 7º, IV, "a"	15,24%	40% / 16%	
Fundo RF - FIDC - Direitos Creditórios	Artigo 7º, VII, "a"	0,92%	5% / 2%	
Fundo RV - Ações Geral	Artigo 8º, II, "a"	14,50%	20% / 15%	
Fundo RV - Multimercado	Artigo 8º, III	10,39%	10% / 10%	
Fundo RV - FIP - Participações	Artigo 8º, IV, "a"	2,53%	5% / 3%	
Fundo RV - FII - Imobiliário	Artigo 8º, IV, "b"	1,35%	5% / 2%	
Fundo RV - Investimentos no Exterior	Artigo 9º, II	7,86%	10% / 8%	
Fundo RV - Investimentos no Exterior	Artigo 9º, III	2,04%	10% / 2%	

ACOMPANHAMENTO DE RECURSOS NO ANO DE 2021

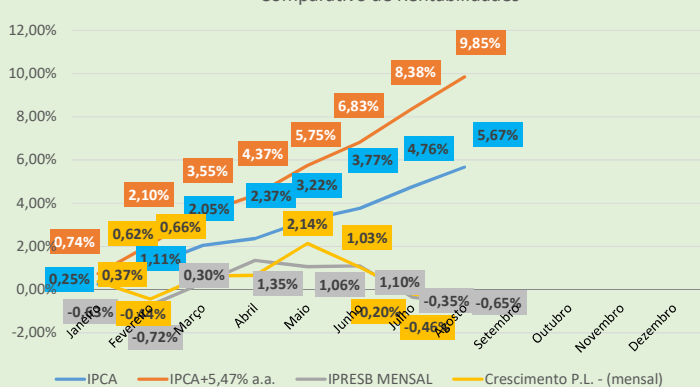
Período	Recursos	Contribuição	Rentabilidade Mensal	Crescimento P.L. - (mensal)	Rendimento Mensal	Rend Médio Trimestral	Rendim. Semestral
Janeiro	R\$ 2.361.470.713,09	R\$ 15.811.023,69	R\$ (15.026.025,73)	0,37%	-0,63%	-0,35%	0,41%
Fevereiro	R\$ 2.351.118.718,70	R\$ 15.659.553,52	R\$ (17.033.150,43)	-0,44%	-0,72%		
Março	R\$ 2.365.780.939,98	R\$ 15.783.964,81	R\$ 7.131.575,37	0,62%	0,30%		
Abril	R\$ 2.381.475.613,39	R\$ 15.784.391,13	R\$ 31.989.002,77	0,66%	1,35%	1,17%	0,41%
Maio	R\$ 2.432.375.827,20	R\$ 15.907.497,19	R\$ 25.280.977,46	2,14%	1,06%		
Junho	R\$ 2.457.379.432,04	R\$ 15.855.902,47	R\$ 26.684.657,85	1,03%	1,10%		
Julho	R\$ 2.452.442.013,19	R\$ 15.886.213,81	R\$ (8.503.595,08)	-0,20%	-0,35%	-	-
Agosto	R\$ 2.441.242.583,77	R\$ 15.865.807,27	R\$ (15.836.362,75)	-0,46%	-0,65%		
Setembro							
Outubro						-	-
Novembro							
Dezembro							

DESEMPENHO E INDICADORES

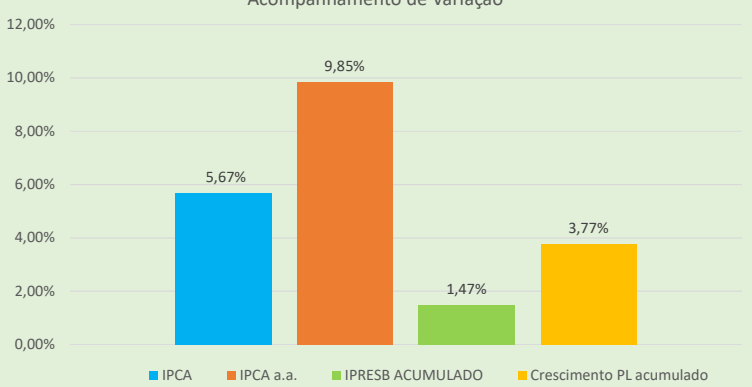
MÊS	IPCA		IPCA+5,47% a.a.		IPRESB MENSAL		
	MENSAL	ACUMULADO	MENSAL	ACUMULADO	MENSAL	ACUMULADO	RENTAB. MÉDIA
Janeiro	0,25%	0,25%	0,74%	0,74%	-0,63%	-0,63%	-0,63%
Fevereiro	0,86%	1,11%	1,35%	2,10%	-0,72%	-1,36%	-0,99%
Março	0,93%	2,05%	1,42%	3,55%	0,30%	-1,05%	-1,01%
Abril	0,31%	2,37%	0,80%	4,37%	1,35%	0,30%	-0,69%
Maio	0,83%	3,22%	1,32%	5,75%	1,06%	1,36%	-0,28%
Junho	0,53%	3,77%	1,02%	6,83%	1,10%	2,46%	0,18%
Julho	0,96%	4,76%	1,45%	8,38%	-0,35%	2,13%	0,46%
Agosto	0,87%	5,67%	1,36%	9,85%	-0,65%	1,47%	0,58%
Setembro							
Outubro							
Novembro							
Dezembro							

INDICADORES DE REFERÊNCIA			
INDICADOR	MÊS	ACUMULADO	ANO (Previsto)
IBOVESPA	-2,48%	-0,20%	IPCA+5,47% a.a.
CDI	0,42%	2,06%	
IPCA a.a.	0,87%	5,67%	

Comparativo de Rentabilidades



Acompanhamento de Variação



RESUMO DAS INFORMAÇÕES

RECURSO INICIAL EM JANEIRO 2021	R\$ 2.370.321.994,20
TOTAL DE RECURSOS INVESTIDOS + SALDO EM CONTA CORRENTE	R\$ 2.441.242.583,77
TOTAL DAS CONTRIBUIÇÕES	R\$ 126.554.353,89
TOTAL DE RENDIMENTOS	R\$ 34.687.079,46
VARIAÇÃO AUMENTATIVA DO P.L.	2,99%
META ATUARIAL 5,47% + 8,35% (Boletim Focus 20/09/21)	13,82%
RENDIMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS EM %	1,46%
CUMPRIMENTO DA META ATUARIAL	10,59%

Este relatório visa dar publicidade à Carteira de Investimentos do IPRESB, contendo as informações referentes ao mês de Agosto/2021.

O Instituto possui contrato com a empresa LDB Consultoria Financeira Ltda – EPP, para prestação de serviços de consultoria em investimentos, vigência: 06/2020 a 06/2021. Valor: R\$ 106.500,00 anual (cento e seis mil e quinhentos reais). Empenho: nº 321 de 15/06/2020.Processo: nº 015/2020.