

Relatório de Análise, Enquadramento, Rentabilidade e Risco - 31/08/2020

Retorno e Meta Atuarial - Agosto de 2020

RENTA FIXA

Ativo			Rentabilidade						Enquad.
CNPJ	FUNDO	Valor Anterior (R\$)	Mês	Aplicação (R\$)	Resgate (R\$)	CUPOM/DIVIDEN/ AMORTIZ COTA	Rentabilidade (R\$)	Valor do Mês (R\$)	
10.740.670/0001-06	21 - CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF (ADM)	23.313.675,53	0,24%	1.355.109,83	616.484,93	0,00	22.279,85	24.074.580,28	Art. 7º, I, b
10.740.670/0001-06	22 - CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF (BENEF)	453.641.328,00	0,24%	44.818.039,47	480.322.349,88	0,00	401.973,18	18.538.990,77	
21.919.953/0001-28	96 - CAIXA TITULOS PUBLICOS 2020	23.179.318,45	0,11%	0,00	23.204.898,34	0,00	25.579,89	-	
13.327.340/0001-73	100 - BB PREVID RF IMA-B 5+	118.064.356,88	-3,69%	0,00	0,00	0,00	(4.354.431,77)	113.709.925,11	
10.577.503/0001-88	122 - CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ TP RF LP	170.015.094,13	-3,64%	0,00	0,00	0,00	(6.194.193,64)	163.820.900,49	
10.922.432/0001-03	135 - ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA F	69.937.505,31	0,33%	0,00	0,00	0,00	234.080,83	70.171.586,14	
10.756.541/0001-06	144 - ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO LONGA F	153.631.919,24	-3,66%	0,00	0,00	0,00	(5.629.800,09)	148.002.119,15	
19.418.031/0001-95	134 - ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RF L	41.173.149,90	-2,09%	0,00	0,00	0,00	(860.394,88)	40.312.755,02	
10.577.519/0001-90	116 - CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP	-	1,18%	200.000.000,00	0,00	0,00	515.541,81	200.515.541,81	
23.215.097/0001-55	113 - CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATEGICA	-	0,56%	200.000.000,00	0,00	0,00	354.820,79	200.354.820,79	
SUBTOTAL		1.052.956.347,44		446.173.149,30	504.143.733,15	0,00	(15.484.544,03)	979.501.219,56	
13.594.673/0001-69	94 - TMJ IMA-B FI RF	8.560.648,51	-1,47%	0,00	0,00	0,00	(125.782,07)	8.434.866,44	Art. 7º IV, a
21.838.150/0001-49	103 - ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAN	326.168.451,38	-0,12%	0,00	0,00	0,00	(406.788,96)	325.761.662,42	
26.507.132/0001-06	147 - SANTANDER RENDA FIXA ATIVO FIC FI	30.886.903,45	-0,37%	30.000.000,00	0,00	0,00	(115.133,13)	60.771.770,32	
SUBTOTAL		365.616.003,34		30.000.000,00	0,00	0,00	(647.704,16)	394.968.299,18	
13.344.834/0001-66	62 - INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II	6.658.237,53	-226,21%	0,00	0,00	0,00	(15.061.473,06)	8.403.235,53	Art. 7º, VII, a
17.013.985/0001-92	106 - FIDC GGR Prime I	24.991.293,61	-0,11%	0,00	0,00	0,00	(27.707,30)	24.963.586,31	
SUBTOTAL		31.649.531,14		0,00	0,00	0,00	(15.089.180,36)	16.560.350,78	
TOTAL RENDA FIXA		1.450.221.881,92		476.173.149,30	504.143.733,15	0,00	- 31.221.428,55	1.391.029.869,52	



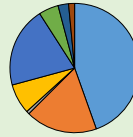
Relatório de Análise, Enquadramento, Rentabilidade e Risco - 31/08/2020

Retorno e Meta Atuarial - Agosto de 2020

RENDA FIXA									
Ativo			Rentabilidade						
CNPJ	FUNDO	Valor Anterior (R\$)	Mês	Aplicação (R\$)	Resgate (R\$)	CUPOM/DIVIDEN/ AMORTIZ COTA	Rentabilidade (R\$)	Valor do Mês (R\$)	Enquad.
RENDA VARIÁVEL									
Ativo			Rentabilidade						
CNPJ	FUNDO	Valor Anterior (R\$)	Mês	Aplicação (R\$)	Resgate (R\$)	CUPOM/DIVIDEN/ AMORTIZ COTA	Rentabilidade (R\$)	Valor do Mês (R\$)	Enquad.
01.699.688/0001-02	129 - SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTITU	119.726.024,92	-2,91%	-	-	-	(3.479.720,64)	116.246.304,28	Art. 8º, I, a
03.394.711/0001-86	132 - BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	29.667.384,52	-3,47%	-	-	(1.029.560,47)	28.637.824,05		
06.224.719/0001-92	146 - ICATU VANGUARDA AÇÕES IBX FUNDO	25.933.193,31	-2,74%	-	5.000.000,00	-	(710.210,14)	20.222.983,17	
SUBTOTAL		175.326.602,75		-	5.000.000,00	-	(5.219.491,25)	165.107.111,50	
11.392.165/0001-72	123 - AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	86.149.639,35	-3,21%	-	-	-	(2.767.690,17)	83.381.949,18	Art. 8º, II, a
23.731.629/0001-07	133 - ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES PHOENIX F	76.243.512,84	-3,92%	-	-	-	(2.992.527,21)	73.250.985,63	
11.628.883/0001-03	138 - OCCAM FIC FIA	92.622.037,30	-2,37%	10.000.000,00	-	-	(2.196.195,23)	100.425.842,07	
08.279.304/0001-41	145 - ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	143.963.979,82	-4,49%	-	-	-	(6.470.377,93)	137.493.601,89	
34.791.108/0001-61	148 - AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIO	19.072.331,57	-3,92%	20.000.000,00	-	-	(748.193,37)	38.324.138,20	
11.977.794/0001-64	149 - BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONA	-	1,14%	5.000.000,00	-	-	57.169,22	5.057.169,22	
08.621.010/0001-56	150 - BRASIL PLURAL ESTRATÉGIA FIC FIA	-	-2,39%	5.000.000,00	-	-	(116.341,19)	4.883.658,81	
SUBTOTAL		418.051.500,88		40.000.000,00	-	-	(15.234.155,88)	442.817.345,00	
03.737.188/0001-43	137 - CAIXA FI MULTIMERCADO RV30 LP	39.686.401,92	-0,78%	-	-	-	(307.696,02)	39.378.705,90	Art. 8º, III
10.418.362/0001-50	FALSO	17.069.652,27	-0,42%	-	-	-	(72.232,25)	16.997.420,02	
15.578.417/0001-03	142 - OCCAM INSTITUCIONAL FIM II	5.575.361,72	0,40%	-	-	-	22.450,90	5.597.812,62	
26.269.692/0001-61	143 - ITAÚ PRIVATE MULTIMERCADO S&P500	42.954.682,15	6,97%	-	-	-	2.993.187,11	45.947.869,26	
35.637.151/0001-30	151 - ICATU VANGUARDA LONG BIASED FIM	-	-0,95%	1.000.000,00	-	-	(9.467,52)	990.532,48	
SUBTOTAL		105.286.098,06		-	-	-	2.626.242,22	108.912.340,28	
12.312.767/0001-35	63 - BRASIL FLORESTAL - FUNDO DE INVESTIM	9.481.052,75	-0,14%	-	-	-	(13.607,41)	9.467.445,34	Art. 8º, IV, a
16.676.620/0001-85	66 - FIP CAIXA CYRELA	1.642.611,83	-0,15%	-	-	-	(2.488,85)	1.640.122,98	
14.584.094/0001-06	67 - BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC FIP	10.177.442,94	4,10%	-	-	-	416.862,13	10.594.305,07	
15.711.367/0001-90	88 - W7 FIP	15.194.767,39	-0,23%	-	-	-	(35.145,86)	15.159.621,53	
14.721.044/0001-15	121 - INFRA SETORIAL FUNDO DE INVESTIMEN	15.095.273,08	-0,06%	-	-	-	(8.829,00)	15.086.444,08	
27.782.774/0001-78	136 - KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTI	6.995.841,92	-3,96%	-	-	997.681,60	(277.011,47)	5.721.148,85	
SUBTOTAL		58.586.989,91		-	-	997.681,60	79.779,54	57.669.087,85	
12.887.506/0001-43	37 - CAIXA FII CX TRX	313.350,00	4,07%	-	-	-	12.740,00	326.090,00	Art. 8º, IV, b
14.423.780/0001-97	44 - ITAU - FII KII REAL	1.611.220,80	-1,43%	-	-	-	(23.017,44)	1.588.203,36	
18.369.510/0001-04	80 - FII INFRA REAL ESTATE FII	14.881.603,81	0,24%	-	69.994,10	-	36.152,51	14.847.762,22	
15.461.076/0001-91	105 - FII BR HOTEIS	16.239.001,36	-0,13%	-	-	-	(20.853,79)	16.218.147,57	
SUBTOTAL		33.045.175,97		-	69.994,10	-	5.021,28	32.980.203,15	
TOTAL RENDA VARIÁVEL		790.296.367,57		40.000.000,00	5.069.994,10	997.681,60	- 17.742.604,09	807.486.087,78	
CONTA CORRENTE									
Número	Descrição	Saldo Ant. (R\$)					Saldo Atual (R\$)		
15-0	Caixa Econômica Federal - 00.360.305/0001-0	100,00					100,00		
16-9	Caixa Econômica Federal - 00.360.305/0001-0	10.218,74					10.101,04		
33888-1	Itaú Unibanco - 60.701.190/0001-03	-	Recebemos da RJJ CORR TITS VALORES MOB LTDA o extrato do Fundo: 62 - INCENTIVO FIDC MULTISETORIAL II sob CNPJ 13.344.834/0001-66 apresentando um saldo negativo por motivo de pagamento de CREDORES.				-		
79680-7	Itaú Unibanco - 60.701.190/0001-04	75,68					51,86		
40104-8	Banco do Brasil - 00.000.000/0001-91	47,75					47,75		
98300-4	Banco Bradesco - 60.746.948/0001-12	78,05					78,05		
130003250-0	Banco Santander - 90.400.888/0001-42	100,06					100,06		
Total de Recursos (Mês Anterior)		2.240.528.869,77					CRESCIMENTO DA CARTEIRA NO MÊS DE AGOSTO/2020		
Total de Recursos (Mês Atual)		2.198.526.436,06					-1,87%		

Enquadramento da Resolução CMN nº 3.922	Enquadramento	% da Carteira
Fundo RF - 100% Títulos do Tesouro Nacional	Artigo 7º, I, "b"	44,55%
Fundo RF - Geral	Artigo 7º, IV, "a"	17,97%
Fundo RF - FIDC - Direitos Creditórios	Artigo 7º, VII, "a"	0,75%
Fundo RV - Ações 50+ Ativos	Artigo 8º, I, "a"	7,51%
Fundo RV - Ações Geral	Artigo 8º, II, "a"	20,14%
Fundo RV - Multimercado	Artigo 8º, III	4,95%
Fundo RV - FIP - Participações	Artigo 8º, IV, "a"	2,62%
Fundo RV - FII - Imobiliário	Artigo 8º, IV, "b"	1,50%

% da Carteira

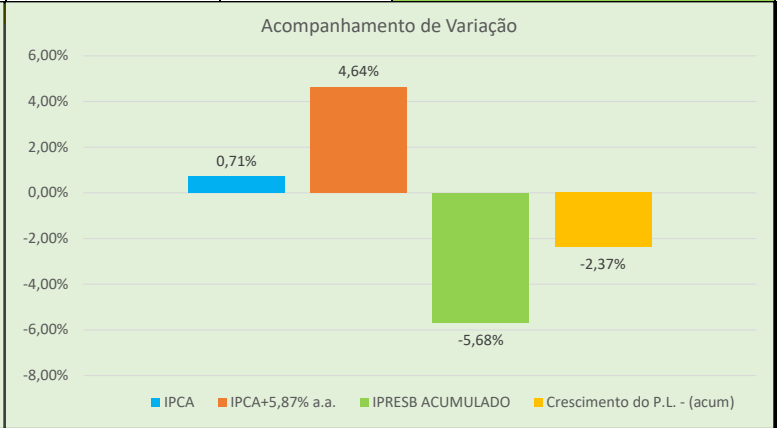
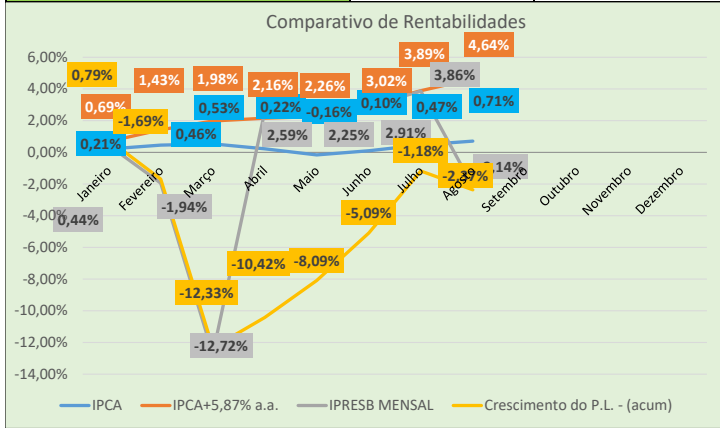


- Fundo RF - 100% Títulos do Tesouro Nacional
- Fundo RF - Geral
- Fundo RF - FIDC - Direitos Creditórios
- Fundo RV - Ações 50+ Ativos
- Fundo RV - Ações Geral
- Fundo RV - Multimercado
- Fundo RV - FIP - Participações
- Fundo RV - FII - Imobiliário

ACOMPANHAMENTO DE RECURSOS NO ANO DE 2020							
Período	Recursos (R\$)	Contribuição (R\$)	Rentabilidade no Mês	Crescimento do P.L. - (acum)	Rendimento Mensal	Rend Medio Trimestral	Rendim. Semestral
Janeiro	R\$ 2.285.100.608,11	R\$ 15.916.944,65	R\$ 10.000.854,69	0,79%	0,44%	-4,74%	-1,08%
Fevereiro	R\$ 2.246.388.562,38	R\$ 15.848.374,30	-R\$ 44.385.033,04	-1,69%	-1,94%		
Março	R\$ 1.969.668.286,36	R\$ 15.917.531,29	-R\$ 285.736.404,74	-12,33%	-12,72%		
Abril	R\$ 2.031.066.499,43	R\$ 15.831.484,26	R\$ 50.920.404,78	-10,42%	2,59%	2,58%	
Maio	R\$ 2.083.822.283,35	R\$ 15.796.467,75	R\$ 45.791.587,96	-8,09%	2,25%		
Junho	R\$ 2.151.843.412,66	R\$ 15.586.723,63	R\$ 60.672.098,57	-5,09%	2,91%		
Julho	R\$ 2.240.528.869,77	R\$ 15.701.143,37	R\$ 83.157.659,02	-1,18%	3,86%	-	
Agosto	R\$ 2.213.587.909,12	R\$ 16.023.048,49	-R\$ 47.966.351,04	-2,37%	-2,14%		
Setembro							
Outubro							
Novembro							
Dezembro							

MÊS	IPCA		IPCA+5,87% a.a.		IPRESB MENSAL		
	MENSAL	ACUMULADO	MENSAL	ACUMULADO	MENSAL	ACUMULADO	RENTAB. MÉDIA
Janeiro	0,21%	0,21%	0,69%	0,69%	0,44%	0,44%	0,44%
Fevereiro	0,25%	0,46%	0,73%	1,43%	-1,94%	-1,51%	-0,75%
Março	0,07%	0,53%	0,55%	1,98%	-12,72%	-14,04%	-4,74%
Abril	-0,31%	0,22%	0,17%	2,16%	2,59%	-11,82%	-2,91%
Maio	-0,38%	-0,16%	0,10%	2,26%	2,25%	-9,83%	-1,88%
Junho	0,26%	0,10%	0,74%	3,02%	2,91%	-7,20%	-1,08%
Julho	0,37%	0,47%	0,85%	3,89%	3,86%	-3,62%	-0,37%
Agosto	0,24%	0,71%	0,72%	4,64%	-2,14%	-5,68%	-0,59%
Setembro							
Outubro							
Novembro							
Dezembro							

INDICADORES DE REFERÊNCIA				
INDICADOR	MÊS	ACUMULADO	ANO (Previsto)	
IBOVESPA	-3,44%	-14,07%	-	
CDI	0,16%	2,12%	-	
IPCA+5,87% a.a.	0,72%	4,64%	7,50%	



RESUMO DAS INFORMAÇÕES		Obs: Este relatório visa dar publicidade a Carteira de Investimentos do IPRESB, contendo as informações referentes ao mês de Agosto/2020.	
RECURSO INICIAL EM JANEIRO 2020	R\$ 2.267.267.269,68		
TOTAL DE RECURSOS INVESTIDOS + SALDO EM CONTA CORRENTE	R\$ 2.198.526.436,06		
TOTAL DAS CONTRIBUIÇÕES 2020	R\$ 126.621.717,74		
TOTAL DE RENDIMENTOS 2020	-R\$ 127.545.183,80		
VARIÇÃO AUMENTATIVA DO P.L.	-3,03%		
META ATUARIAL 1,63% (PROJEÇÃO BOLETIM FOCUS, 03/07)+ 5,87% DRAA	7,50%		
RENDIMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS EM % 2020	-5,68%		
CUMPRIMENTO DA META ATUARIAL EM 2020	-75,72%		