

Relatório de Análise, Enquadramento, Rentabilidade e Risco - 30/09/2020

Retorno e Meta Atuarial - Setembro 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)	24.074.580,28	0,13%	1.347.319,37	678.555,42	0,00	31.875,96	24.775.220,19	Art. 7º, I, b
10.740.670/0001-06	22 - CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF (BENEF)	18.538.990,77	0,13%	16.455.429,92	9.391.886,53	0,00	38.629,64	25.641.163,80	
13.327.340/0001-73	100 - BB PREVID RF IMA-B 5+	113.709.925,11	-2,65%	0,00	0,00	0,00	(3.009.420,58)	110.700.504,53	
10.577.503/0001-88	122 - CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ TP RF LP	163.820.900,49	-2,64%	0,00	0,00	0,00	(4.329.789,66)	159.491.110,83	
10.922.432/0001-03	135 - ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA P	70.171.586,14	-0,22%	0,00	0,00	0,00	(154.840,33)	70.016.745,81	
10.756.541/0001-06	144 - ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO LONGA P	148.002.119,15	-2,62%	0,00	0,00	0,00	(3.882.938,16)	144.119.180,99	
10.577.519/0001-90	116 - CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP	200.515.541,81	-0,98%	0,00	0,00	0,00	(1.960.763,42)	198.554.778,39	
23.215.097/0001-55	113 - CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATEGICA	200.354.820,79	-0,50%	0,00	0,00	0,00	(1.008.102,78)	199.346.718,01	
SUBTOTAL		939.188.464,54		17.802.749,29	10.070.441,95	0,00	(14.275.349,33)	932.645.422,55	
13.594.673/0001-69	94 - TMJ IMA-B FI RF	8.434.866,44	-0,83%	0,00	0,00	740.881,43	(69.743,20)	7.624.241,81	Art. 7º IV, a
21.838.150/0001-49	103 - ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAM	325.761.662,42	-0,23%	0,00	0,00	0,00	(746.808,47)	325.014.853,95	
19.418.031/0001-95	134 - ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RF L	40.312.755,02	-2,04%	0,00	0,00	0,00	(821.308,03)	39.491.446,99	
26.507.132/0001-06	147 - SANTANDER RENDA FIXA ATIVO FIC FI	60.771.770,32	-0,23%	0,00	0,00	0,00	(136.807,35)	60.634.962,97	
SUBTOTAL		435.281.054,20		0,00	0,00	740.881,43	(1.774.667,05)	432.765.505,72	
13.344.834/0001-66	62 - INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II	8.403.235,53	-0,38%	0,00	0,00	0,00	(32.047,47)	8.435.283,00	Art. 7º, VII, a
17.013.985/0001-92	106 - FIDC GGR Prime I	24.963.586,31	-0,13%	0,00	0,00	0,00	(31.742,30)	24.931.844,01	
SUBTOTAL		16.560.350,78		0,00	0,00	0,00	(63.789,77)	16.496.561,01	
TOTAL RENDA FIXA		1.391.029.869,52		17.802.749,29	10.070.441,95	740.881,43	- 16.113.806,15	1.381.907.489,28	

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"	43,33%	100% / 44%	 - 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
Fundo RF - Geral	Artigo 7º, IV, "a"	20,11%	40% / 14%	
Fundo RF - FIDC - Direitos Creditórios	Artigo 7º, VII, "a"	0,77%	5% / 2%	
Fundo RV - Ações 50+ Ativos	Artigo 8º, I, "a"	7,34%	20% / 9%	
Fundo RV - Ações Geral	Artigo 8º, II, "a"	19,33%	20% / 21%	
Fundo RV - Multimercado	Artigo 8º, III	4,92%	20% / 5%	
Fundo RV - FIP - Participações	Artigo 8º, IV, "a"	2,67%	20% / 3%	
Fundo RV - FII - Imobiliário	Artigo 8º, IV, "b"	1,53%	20% / 2%	

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%	-0,03%	-
Agosto	R\$ 2.213.587.909,12	R\$ 15.809.176,58	R\$ 34.900.241,18	-2,37%	-1,56%		
Setembro	R\$ 2.152.200.580,06	R\$ 16.533.757,44	-R\$ 53.174.395,71	-2,11%	-2,40%		
Outubro						-	-
Novembro							
Dezembro							

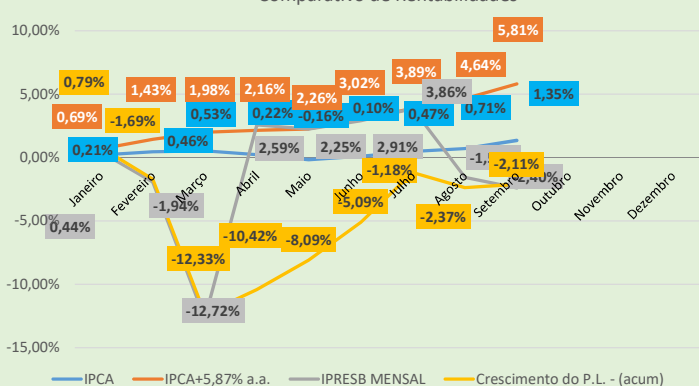
DESEMPENHO E INDICADORES

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%	-1,56%	-5,12%	-0,52%
Setembro	0,64%	1,35%	1,12%	5,81%	-2,40%	-7,40%	-0,73%
Outubro							
Novembro							
Dezembro							

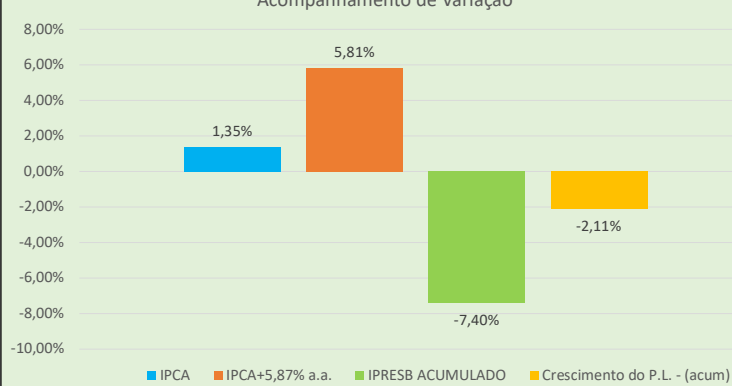
INDICADORES DE REFERÊNCIA

	INDICADOR	MÊS	ACUMULADO	ANO (Previsto)
	IBOVESPA	-4,58%	-17,42%	-
	CDI	0,16%	2,29%	-
	IPCA+5,87% a.a.	1,12%	5,81%	7,50%

Comparativo de Rentabilidades



Acompanhamento de Variação



RESUMO DAS INFORMAÇÕES

RECURSO INICIAL EM JANEIRO 2020	R\$ 2.267.267.269,68
TOTAL DE RECURSOS INVESTIDOS + SALDO EM CONTA CORRENTE	R\$ 2.152.200.580,06
TOTAL DAS CONTRIBUIÇÕES 2020	R\$ 142.941.603,27
TOTAL DE RENDIMENTOS 2020	-R\$ 167.653.469,65
VARIAÇÃO AUMENTATIVA DO P.L.	-5,08%
META ATUARIAL 1,63% (PROJEÇÃO BOLETIM FOCUS, 03/07)+ 5,87% DRAA	7,50%
RENDIMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS EM % 2020	-7,40%
CUMPRIMENTO DA META ATUARIAL EM 2020	-98,61%

Obs: Este relatório visa dar publicidade a Carteira de Investimentos do IPRESB, contendo as informações referentes ao mês de Setembro/2020.