

Relatório de Análise, Enquadramento, Rentabilidade e Risco - 31/07/2020

Retorno e Meta Atuarial - Julho de 2020

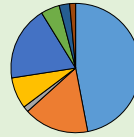
RENDA FIXA

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)	22.596.405,69	0,24%	1.359.137,64	695.364,63	0,00	53.496,83	23.313.675,53	Art. 7º, I, b
10.740.670/0001-06	22 - CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF (BENEF)	438.660.649,18	0,24%	23.109.024,77	9.230.959,32	0,00	1.102.613,37	453.641.328,00	
21.919.953/0001-28	96 - CAIXA TITULOS PUBLICOS 2020	23.162.977,27	0,07%	0,00	0,00	0,00	16.341,18	23.179.318,45	
13.327.340/0001-73	100 - BB PREVID RF IMA-B 5+	110.054.545,62	7,28%	0,00	0,00	0,00	8.009.811,26	118.064.356,88	
10.577.503/0001-88	122 - CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ TP RF LP	158.460.480,29	7,29%	0,00	0,00	0,00	11.554.613,84	170.015.094,13	
10.922.432/0001-03	135 - ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA F	69.231.023,43	1,02%	0,00	0,00	0,00	706.481,88	69.937.505,31	
10.756.541/0001-06	144 - ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO LONGA F	143.119.374,71	7,35%	0,00	0,00	0,00	10.512.544,53	153.631.919,24	
19.418.031/0001-95	134 - ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RF L	40.347.778,39	2,05%	0,00	0,00	0,00	825.371,51	41.173.149,90	
SUBTOTAL		1.005.633.234,58		24.468.162,41	9.926.323,95	0,00	32.781.274,40	1.052.956.347,44	
13.594.673/0001-69	94 - TMJ IMA-B FI RF	11.196.495,40	0,49%	0,00	2.690.705,50	0,00	54.858,61	8.560.648,51	Art. 7º IV, a
21.838.150/0001-49	103 - ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAM	324.379.521,04	0,55%	0,00	0,00	0,00	1.788.930,34	326.168.451,38	
26.507.132/0001-06	147 - SANTANDER RENDA FIXA ATIVO FIC FI	30.722.657,65	0,53%	0,00	0,00	0,00	164.245,80	30.886.903,45	
SUBTOTAL		366.298.674,09		0,00	2.690.705,50	0,00	2.008.034,75	365.616.003,34	
13.344.834/0001-66	62 - INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II	6.665.372,56	-0,11%	0,00	0,00	0,00	(7.135,03)	6.658.237,53	Art. 7º, VII, a
17.013.985/0001-92	106 - FIDC GGR Prime I	27.387.415,20	0,61%	0,00	0,00	2.562.122,48	2.728.123,37	24.991.293,61	
SUBTOTAL		34.052.787,76		0,00	0,00	2.562.122,48	158.865,86	31.649.531,14	
TOTAL RENDA FIXA		1.405.984.696,43		24.468.162,41	12.617.029,45	2.562.122,48	34.948.175,01	1.450.221.881,92	

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 INSTIT	110.189.838,17	8,65%	-	-	-	9.536.186,75	119.726.024,92	Art. 8º, I, a							
03.394.711/0001-86	132 - BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	27.414.346,29	8,22%	-	-	-	2.253.038,23	29.667.384,52								
06.224.719/0001-92	146 - ICATU VANGUARDA AÇÕES IBX FUNDO	23.845.452,80	8,76%	-	-	-	2.087.740,51	25.933.193,31								
SUBTOTAL		161.449.637,26		-	-	-	13.876.965,49	175.326.602,75								
11.392.165/0001-72	123 - AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	75.502.746,55	14,10%	-	-	-	10.646.892,80	86.149.639,35	Art. 8º, II, a							
23.731.629/0001-07	133 - ITÁU INSTITUCIONAL AÇÕES PHOENIX F	72.065.434,72	5,80%	-	-	-	4.178.078,12	76.243.512,84								
11.628.883/0001-03	138 - OCCAM FIC FIA	84.278.090,59	9,90%	-	-	-	8.343.946,71	92.622.037,30								
08.279.304/0001-41	145 - ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	137.947.204,94	4,36%	-	-	-	6.016.774,88	143.963.979,82								
34.791.108/0001-61	148 - AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIO	16.752.659,87	13,85%	-	-	-	2.319.671,70	19.072.331,57								
SUBTOTAL		386.546.136,67		-	-	-	31.505.364,21	418.051.500,88								
03.737.188/0001-43	137 - CAIXA FI MULTIMERCADO RV30 LP	38.742.397,37	2,44%	-	-	-	944.004,55	39.686.401,92	Art. 8º, III							
10.418.362/0001-50	139 - BB PREV MULTIMERCADO FDO DE INVE	17.006.758,56	0,37%	-	-	-	62.893,71	17.069.652,27								
15.578.417/0001-03	142 - OCCAM INSTITUCIONAL FIM II	5.540.994,16	0,62%	-	-	-	34.367,56	5.575.361,72								
26.269.692/0001-61	143 - ITAU PRIVATE MULTIMERCADO S&P500	40.647.588,48	5,68%	-	-	-	2.307.093,67	42.954.682,15								
SUBTOTAL		101.937.738,57		-	-	-	3.348.359,49	105.286.098,06								
12.312.767/0001-35	63 - BRASIL FLORESTAL - FUNDO DE INVESTIM	9.494.751,71	-0,14%	-	-	-	(13.698,96)	9.481.052,75	Art. 8º, IV, a							
16.676.620/0001-85	66 - FIP CAIXA CYRELA	3.392.524,86	-0,12%	-	-	1.745.677,74	1.741.442,45	1.642.611,83								
14.584.094/0001-06	67 - BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC FI	10.192.060,27	-0,14%	-	-	-	(14.617,33)	10.177.442,94								
15.711.367/0001-90	88 - W7 FIP	15.222.257,17	-0,18%	-	-	-	(27.489,78)	15.194.767,39								
14.721.044/0001-15	121 - INFRA SETORIAL FUNDO DE INVESTIME	15.121.883,72	-0,18%	-	-	-	(26.610,64)	15.095.273,08								
27.782.774/0001-78	136 - KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INST	7.182.849,23	-2,60%	-	-	-	(187.007,31)	6.995.841,92								
SUBTOTAL		60.606.326,96		-	-	1.745.677,74	(273.659,31)	58.586.989,91								
12.887.506/0001-43	37 - CAIXA FII CX TRX	405.010,00	-22,63%	-	-	-	(91.660,00)	313.350,00	Art. 8º, IV, b							
14.423.780/0001-97	44 - ITAU - FII KII REAL	1.687.945,60	3,61%	-	-	137.656,97	198.589,14	1.611.220,80								
18.369.510/0001-04	80 - FII INFRA REAL ESTATE FII	16.948.933,35	-10,65%	-	262.477,89	-	(1.804.851,65)	14.881.603,81								
15.461.076/0001-91	105 - FII BR HOTEIS	16.258.988,52	-0,12%	-	-	-	(19.987,16)	16.239.001,36								
SUBTOTAL		35.300.877,47		-	262.477,89	137.656,97	(1.855.566,64)	33.045.175,97								
TOTAL RENDA VARIÁVEL		745.840.716,93		-	262.477,89	1.883.334,71	46.601.463,24	790.296.367,57								
CONTA CORRENTE																
Número	Descrição	Saldo Ant. (R\$)							Saldo Atual (R\$)							
15-0	Caixa Econômica Federal - 00.360.305/0001-4	100,00	Ocorreu no FUNDO: 80 - FII INFRA REAL ESTATE FII - REPROCESSAMENTO DA CARTEIRA DE 30/06/2020 – Em razão da reavaliação dos ativos, o Administrador reprocessou a carteira de 30/06/2020 refletindo os efeitos da reavaliação.						100,00							
16-9	Caixa Econômica Federal - 00.360.305/0001-4	7.623,02							10.218,74							
33888-1	Itaú Unibanco - 60.701.190/0001-03	-							-							
79680-7	Itaú Unibanco - 60.701.190/0001-04	10.050,72							75,68							
40104-8	Banco do Brasil - 00.000.000/0001-91	47,75							47,75							
98300-4	Banco Bradesco - 60.746.948/0001-12	77,75							78,05							
130003250-0	Banco Santander - 90.400.888/0001-42	100,06							100,06							
		17.999,30							10.620,28							
Total de Recursos (Mês Anterior)		2.151.843.412,66							CRESCIMENTO DA CARTEIRA NO MÊS DE JULHO/2020							
Total de Recursos (Mês Atual)		2.240.528.869,77							4,12%							
Página 1 de 2																
IPRESB - Instituto de Previdência Social dos Servidores Municipais de Barueri - Avenida Wagih Salles Nemer, nº 85 - Tel.: (11) 4163-1723																

Enquadramento da Resolução CMN nº 3.922	Enquadramento	% da Carteira
Fundo RF - 100% Títulos do Tesouro Nacional	Artigo 7º, I, "b"	47,00%
Fundo RF - Geral	Artigo 7º, IV, "a"	16,32%
Fundo RF - FIDC - Direitos Creditórios	Artigo 7º, VII, "a"	1,41%
Fundo RV - Ações 50+ Ativos	Artigo 8º, I, "a"	7,83%
Fundo RV - Ações Geral	Artigo 8º, II, "a"	18,66%
Fundo RV - Multimercado	Artigo 8º, III	4,70%
Fundo RV - FIP - Participações	Artigo 8º, IV, "a"	2,61%
Fundo RV - FII - Imobiliário	Artigo 8º, IV, "b"	1,47%

% da Carteira

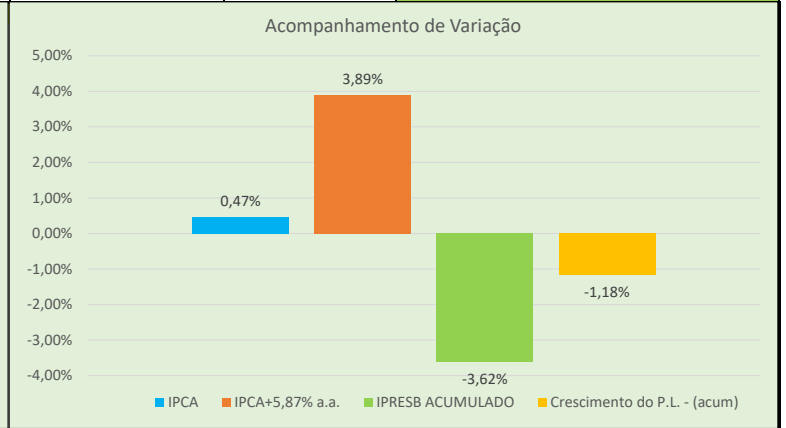
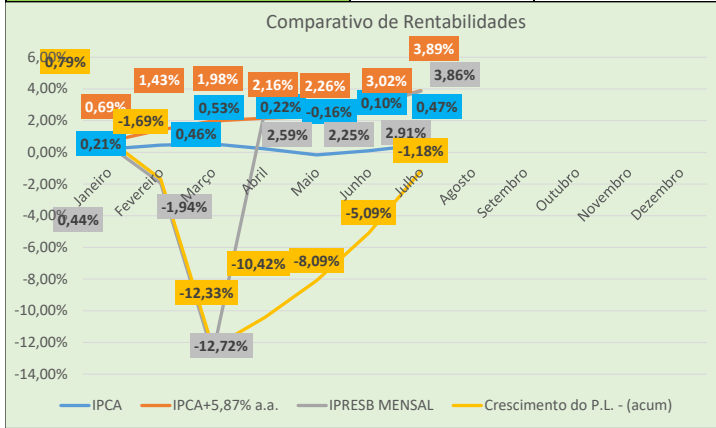


- Fundo RF - 100% Títulos do Tesouro Nacional
- Fundo RF - Geral
- Fundo RF - FIDC - Direitos Creditórios
- Fundo RV - Ações 50+ Ativos
- Fundo RV - Ações Geral
- Fundo RV - Multimercado
- Fundo RV - FIP - Participações
- Fundo RV - FII - Imobiliário

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%	
Maió	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							
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%
Maió	-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							
Setembro							
Outubro							
Novembro							
Dezembro							

INDICADORES DE REFERÊNCIA				
INDICADOR	MÊS	ACUMULADO	ANO (Previsto)	
IBOVESPA	8,27%	-11,01%	-	
CDI	0,19%	1,96%	-	
IPCA+5,87% a.a.	0,37%	3,02%	7,50%	



RESUMO DAS INFORMAÇÕES	
RECURSO INICIAL EM JANEIRO 2020	R\$ 2.267.267.269,68
TOTAL DE RECURSOS INVESTIDOS + SALDO EM CONTA CORRENTE	R\$ 2.240.528.869,77
TOTAL DAS CONTRIBUIÇÕES 2020	R\$ 110.598.669,25
TOTAL DE RENDIMENTOS 2020	-R\$ 79.578.832,76
VARIACÃO AUMENTATIVA DO P.L.	-1,18%
META ATUARIAL 1,63% (PROJEÇÃO BOLETIM FOCUS, 03/07)+ 5,87% DRAA	7,50%
RENDIMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS EM % 2020	-3,62%
CUMPRIMENTO DA META ATUARIAL EM 2020	-48,21%

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

*Meta atuarial atualizada conforme Boletim Focus (Data de referência 03/07/2020).