

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

em agosto de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2020)

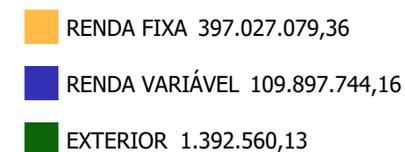
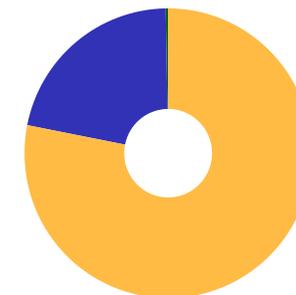
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	21.462.624,99	4,22%	339	1,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	36.453.117,80	7,17%	905	0,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	83.982.363,09	16,52%	970	0,94%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	7.268.357,41	1,43%	1.359	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	1.375.390,25	0,27%	165	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	78.238.645,65	15,39%	932	0,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2022	13.549.732,32	2,67%	115	2,97%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	98.007.253,26	19,28%	852	0,73%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	1.397.769,78	0,27%	1.244	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	3.218.717,65	0,63%	696	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	25.245.331,32	4,97%	81	5,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3 du	Não há	10.868.841,90	2,14%	361	0,56%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	D+0	3 anos	4.799.178,88	0,94%	74	2,60%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	11.159.755,06	2,20%	74	1,83%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	19.310.817,33	3,80%	98	1,93%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	27.376.695,98	5,39%	122	4,00%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.415.252,68	0,28%	1.633	0,15%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	D+15	Não há	15.898.802,38	3,13%	61	6,36%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	11.693.010,52	2,30%	2.497	1,34%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	14.699.005,41	2,89%	114	2,02%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	2.526.242,58	0,50%	16.747	0,21%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	3.241.636,45	0,64%	20.483	0,14%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	3.059.877,31	0,60%	80	0,37%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MUL...	D+2	01/10/2020	3.531.696,38	0,69%	956	0,70%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	5.317.886,92	1,05%	19.855	0,11%	Artigo 8º, Inciso III
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se ...	Não se aplica	1.826.820,22	0,36%		0,08%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	D+4	Não há	1.392.560,13	0,27%	137	0,09%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			508.317.383,65				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Agosto / 2020)

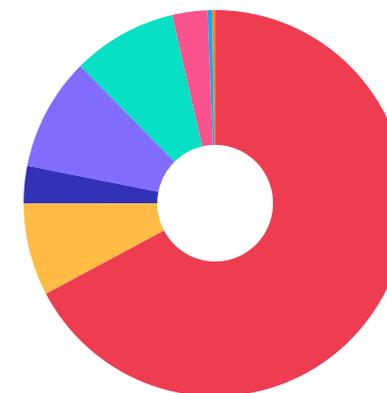
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	341.735.254,55	67,23%	30,00%	60,00%	90,00%	115.750.390,74
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	152.495.215,10
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	39.332.890,87	7,74%	1,00%	13,00%	40,00%	163.994.062,59
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	25.415.869,18
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	25.415.869,18
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	15.958.933,94	3,14%	1,00%	2,50%	5,00%	9.456.935,24
Total Renda Fixa	100,00%	397.027.079,36	78,11%	32,00%	76,50%	175,00%	



Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Agosto / 2020)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	48.102.765,99	9,46%	5,00%	12,00%	15,00%	28.144.841,56
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	44.817.060,89	8,82%	0,00%	5,00%	10,00%	6.014.677,48
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	15.151.097,06	2,98%	1,00%	5,50%	10,00%	35.680.641,31
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	25.415.869,18
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	1.826.820,22	0,36%	0,00%	0,50%	5,00%	23.589.048,96
Total Renda Variável	30,00%	109.897.744,16	21,62%	6,00%	23,00%	45,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	25.415.869,18
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	25.415.869,18
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	1.392.560,13	0,27%	0,00%	0,50%	5,00%	24.023.309,05
Total Exterior	10,00%	1.392.560,13	0,27%	0,00%	0,50%	15,00%	



Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (Agosto / 2020)

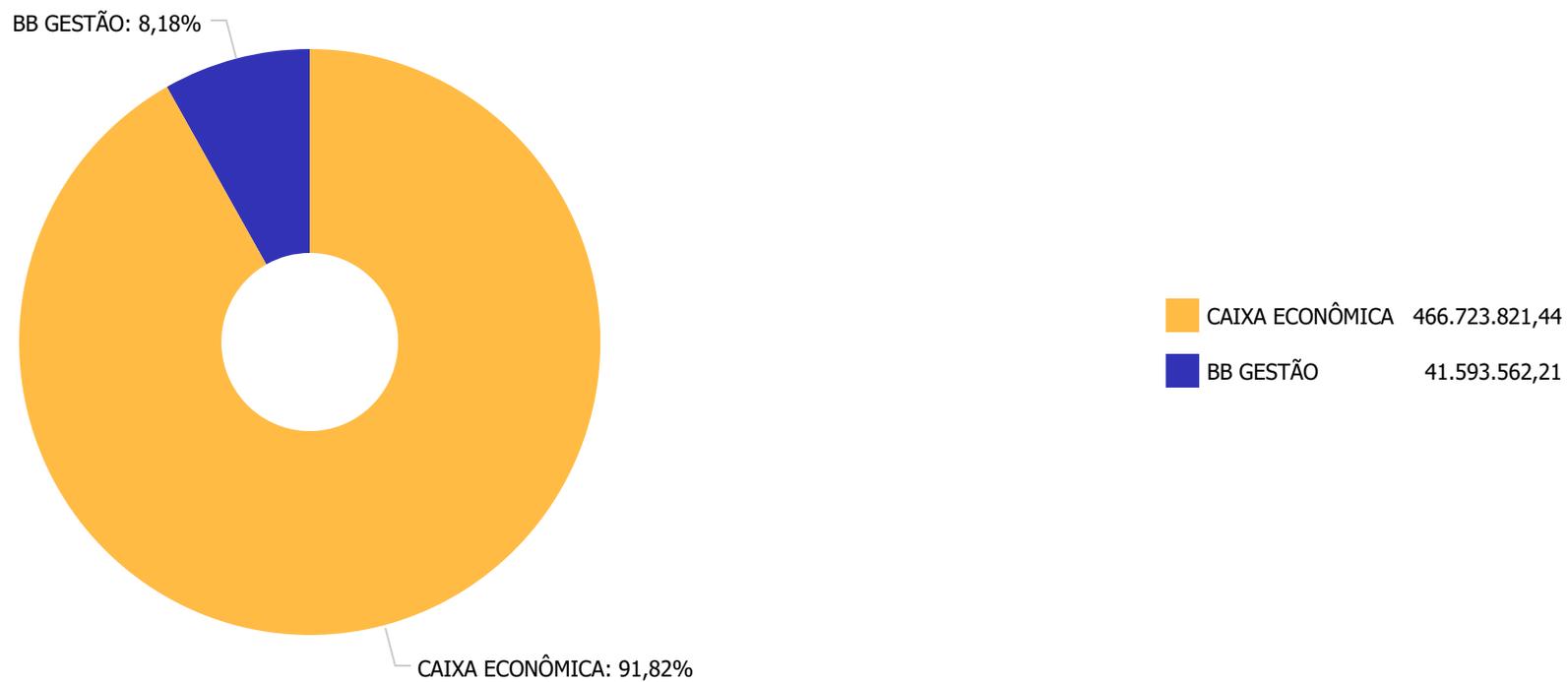
Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	452.024.816,03	88,93	0,08
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	39.766.741,99	7,82	0,00
VINCI PARTNERS	14.699.005,41	2,89	0,01
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	1.826.820,22	0,36	0,51

Artigo 14º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

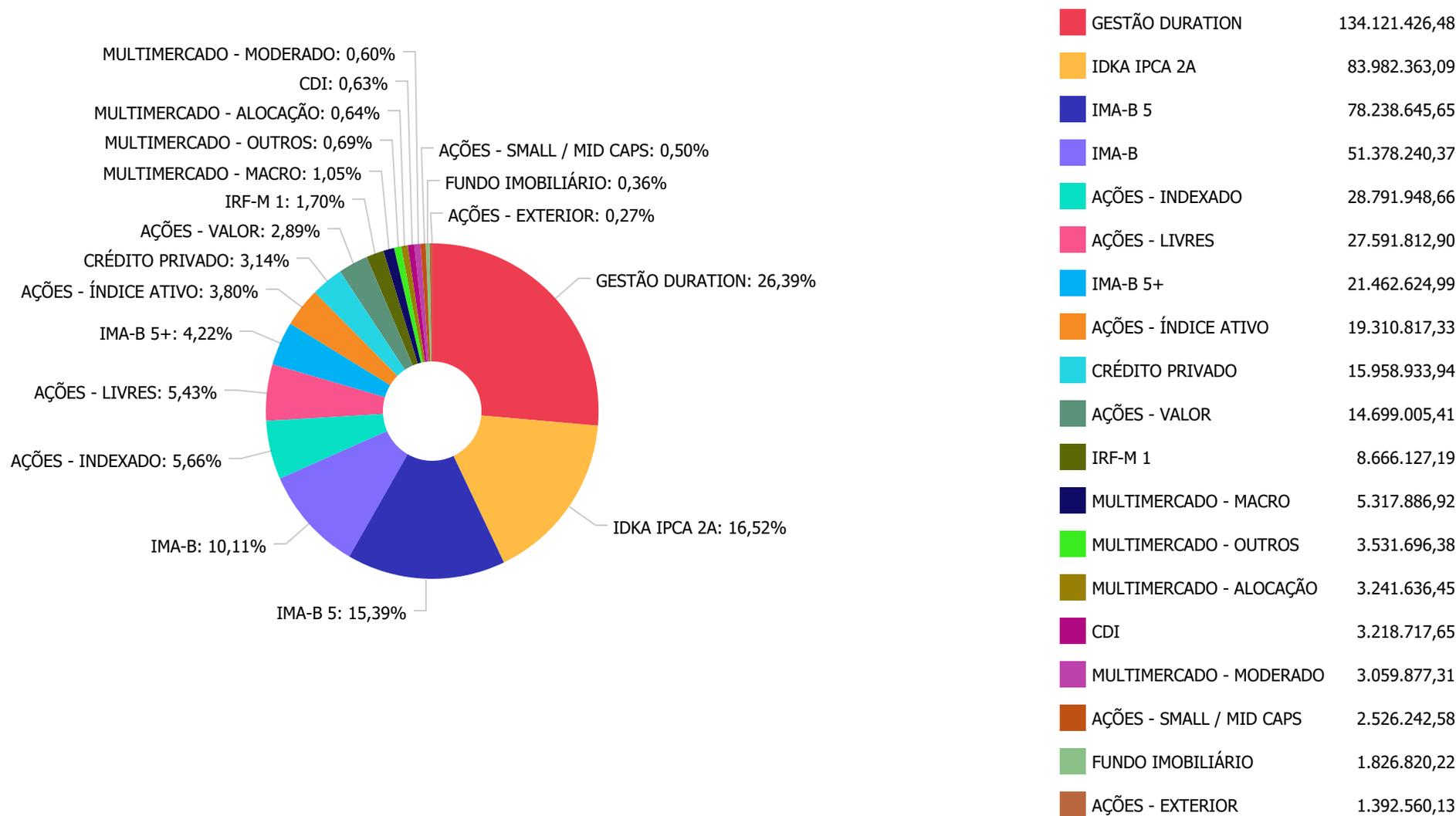
Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	341.735.254,55	67,23	30,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	39.332.890,87	7,74	1,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	15.958.933,94	3,14	1,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	48.102.765,99	9,46	5,00	10,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	44.817.060,89	8,82	1,00	10,00
Artigo 8º, Inciso III	15.151.097,06	2,98	1,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	1.826.820,22	0,36	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso I	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso III	1.392.560,13	0,27	0,00	5,00

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Agosto / 2020)



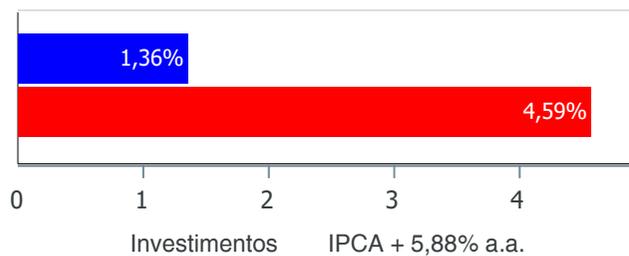
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Agosto / 2020)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

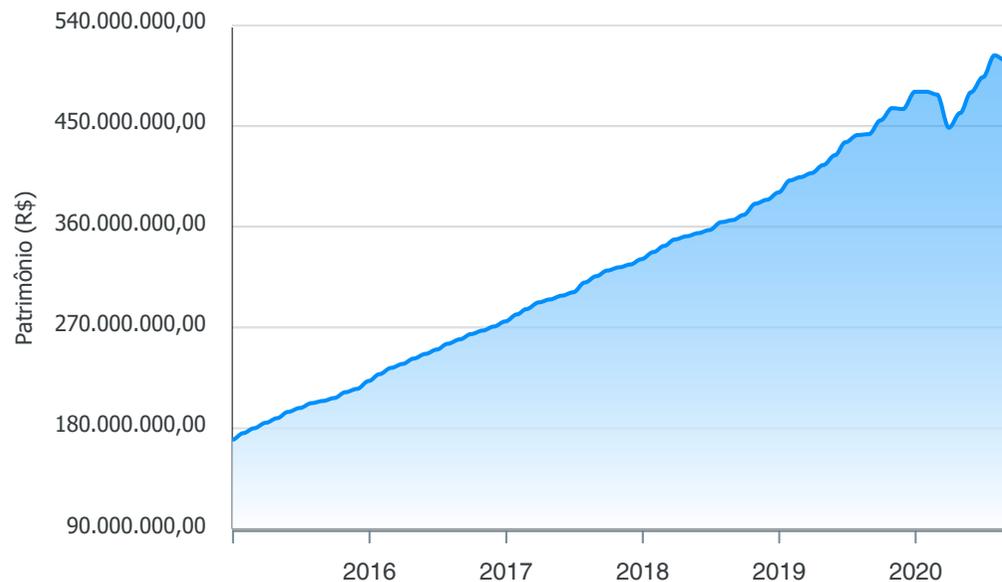
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	480.726.013,95	31.194.230,79	34.435.535,00	479.118.394,83	1.633.685,09	1.633.685,09	0,34%	0,34%	0,71%	0,71%	47,79%	1,80%
Fevereiro	479.118.394,83	47.123.300,03	42.981.918,47	478.272.443,50	-4.987.332,89	-3.353.647,80	-1,03%	-0,70%	0,66%	1,38%	-50,57%	3,34%
Março	478.272.443,50	11.262.131,93	9.530.400,00	447.969.637,61	-32.034.537,82	-35.388.185,62	-6,67%	-7,32%	0,57%	1,95%	-374,77%	14,39%
Abril	447.969.637,61	16.153.351,94	11.828.900,00	461.799.607,99	9.505.518,44	-25.882.667,18	2,10%	-5,38%	0,14%	2,10%	-255,98%	7,58%
Mai	461.799.607,99	26.415.208,16	20.544.134,69	480.300.710,11	12.630.028,65	-13.252.638,53	2,70%	-2,82%	0,07%	2,17%	-129,70%	4,19%
Junho	480.300.710,11	6.958.586,09	5.572.400,00	493.784.579,25	12.097.683,05	-1.154.955,48	2,51%	-0,38%	0,74%	2,93%	-12,95%	3,42%
Julho	493.784.579,25	11.425.233,31	5.438.100,00	513.334.591,85	13.562.879,29	12.407.923,81	2,71%	2,32%	0,88%	3,84%	60,54%	2,75%
Agosto	513.334.591,85	8.347.272,93	8.546.182,58	508.317.383,65	-4.818.298,55	7.589.625,26	-0,94%	1,36%	0,72%	4,59%	29,74%	2,72%

Investimentos x Meta Atuarial



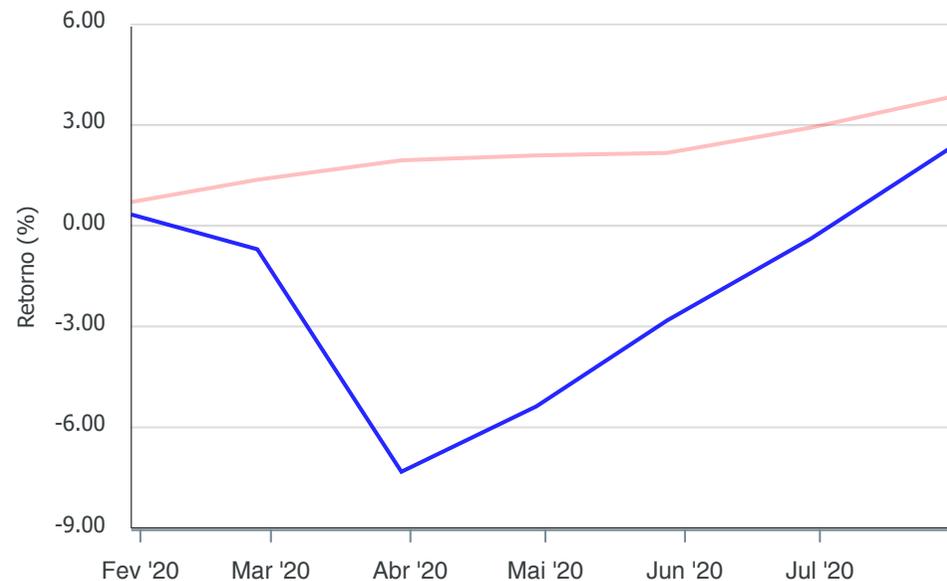
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- Investimentos Meta Atuarial CDI IMA-B IMA-B 5
- IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1 IRF-M 1+
- Ibovespa IBX SMLL IDIV

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Agosto/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	83.322.829,80	0,00	0,00	83.982.363,09	659.533,29	0,79%	0,79%	0,77%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	15.821.588,16	0,00	2.387.152,56	13.549.732,32	115.296,72	0,73%	0,76%	0,67%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	11.105.337,70	0,00	0,00	11.159.755,06	54.417,36	0,49%	0,49%	0,97%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	77.933.302,46	0,00	0,00	78.238.645,65	305.343,19	0,39%	0,39%	0,83%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	3.955.690,23	0,00	2.594.530,02	1.375.390,25	14.230,04	0,36%	0,47%	0,32%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.214.058,19	0,00	0,00	3.218.717,65	4.659,46	0,14%	0,14%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	10.808.757,18	0,00	3.551.000,00	7.268.357,41	10.600,23	0,10%	0,10%	0,15%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.388.508,38	8.033,25	0,00	1.397.769,78	1.228,15	0,09%	0,09%	0,15%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	4.809.577,67	0,00	0,00	4.799.178,88	-10.398,79	-0,22%	-0,22%	1,42%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	22.391.045,33	2.933.286,87	0,00	25.245.331,32	-79.000,88	-0,31%	-0,35%	0,88%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	98.556.367,78	0,00	0,00	98.007.253,26	-549.114,52	-0,56%	-0,56%	0,92%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	5.539.628,42	5.405.952,81	0,00	10.868.841,90	-76.739,33	-0,70%	-1,05%	1,19%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	37.132.792,46	0,00	0,00	36.453.117,80	-679.674,66	-1,83%	-1,83%	2,27%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	22.274.143,26	0,00	0,00	21.462.624,99	-811.518,27	-3,64%	-3,64%	3,79%
Total Renda Fixa	398.253.627,02	8.347.272,93	8.532.682,58	397.027.079,36	-1.041.138,01	-0,26%		1,13%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Agosto/2020

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	3.530.894,21	0,00	0,00	3.531.696,38	802,17	0,02%	0,02%	0,02%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.325.162,03	0,00	0,00	5.317.886,92	-7.275,11	-0,14%	-0,14%	1,46%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	3.066.942,15	0,00	0,00	3.059.877,31	-7.064,84	-0,23%	-0,23%	2,59%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	3.266.965,84	0,00	0,00	3.241.636,45	-25.329,39	-0,78%	-0,78%	2,84%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	2.561.722,15	0,00	0,00	2.526.242,58	-35.479,57	-1,38%	-1,38%	9,90%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	19.959.730,68	0,00	0,00	19.310.817,33	-648.913,35	-3,25%	-3,25%	10,67%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.463.021,61	0,00	0,00	1.415.252,68	-47.768,93	-3,27%	-3,27%	9,81%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	28.348.941,45	0,00	0,00	27.376.695,98	-972.245,47	-3,43%	-3,43%	10,16%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	12.111.140,43	0,00	0,00	11.693.010,52	-418.129,91	-3,45%	-3,45%	8,79%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	16.577.595,22	0,00	0,00	15.898.802,38	-678.792,84	-4,09%	-4,09%	8,68%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	15.442.922,61	0,00	0,00	14.699.005,41	-743.917,20	-4,82%	-4,82%	8,78%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	2.216.716,15	0,00	13.500,00	1.826.820,22	-376.395,93	-16,98%	-0,02%	-
Total Renda Variável	113.871.754,53	0,00	13.500,00	109.897.744,16	-3.960.510,37	-3,48%		8,49%

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE RIO BRANCO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/08/2020

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Agosto / 2020)

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	1.209.210,30	0,00	0,00	1.392.560,13	183.349,83	15,16%	15,16%	8,52%
Total Renda Variável	1.209.210,30	0,00	0,00	1.392.560,13	183.349,83	15,16%		8,52%