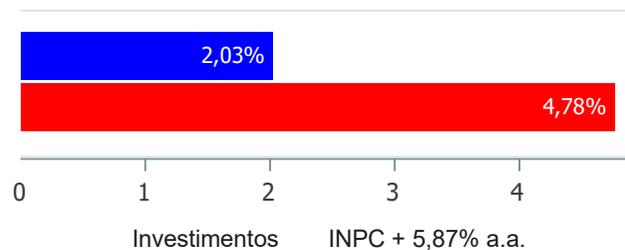


Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	432.514.517,11	3.529.515,44	2.410.000,00	435.729.733,63	2.095.701,08	2.095.701,08	0,48%	0,48%	0,69%	0,69%	70,02%	0,61%
Fevereiro	435.729.733,63	120.455.102,35	120.631.634,81	435.630.862,65	77.661,48	2.173.362,56	0,02%	0,50%	0,58%	1,27%	39,37%	1,44%
Março	435.630.862,65	4.479.792,70	3.930.000,00	425.120.433,41	-11.060.221,94	-8.886.859,38	-2,54%	-2,05%	0,68%	1,96%	-104,35%	7,11%
Abril	425.120.433,41	6.036.793,79	2.410.000,00	432.543.953,33	3.796.726,13	-5.090.133,25	0,89%	-1,18%	0,22%	2,19%	-53,90%	3,85%
Mai	432.543.953,33	3.607.405,79	2.290.612,00	438.595.482,71	4.734.735,59	-355.397,66	1,09%	-0,10%	0,20%	2,40%	-4,23%	1,64%
Junho	438.595.482,71	4.316.513,44	3.010.000,00	444.499.193,71	4.597.197,56	4.241.799,90	1,05%	0,94%	0,78%	3,19%	29,53%	1,34%
Julho	444.499.193,71	3.786.530,95	4.025.000,00	451.015.912,49	6.755.187,83	10.996.987,73	1,52%	2,48%	0,96%	4,19%	59,14%	1,10%
Agosto	451.015.912,49	9.820.867,70	8.740.453,11	450.127.582,21	-1.968.744,87	9.028.242,86	-0,44%	2,03%	0,57%	4,78%	42,49%	1,07%

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
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	687.473,37	0,00	16.985,41	676.123,78	5.635,82	0,82%	0,82%	0,76%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.408.169,75	0,00	0,00	4.443.062,16	34.892,41	0,79%	0,79%	0,77%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.920.497,54	0,00	79.299,92	2.863.402,65	22.205,03	0,76%	-1,95%	0,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	7.910.794,14	0,00	1.193.576,29	6.774.866,21	57.648,36	0,73%	0,76%	0,67%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	6.780.110,14	0,00	0,00	6.826.630,12	46.519,98	0,69%	0,69%	0,74%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	839.222,55	0,00	0,00	844.764,39	5.541,84	0,66%	0,66%	1,05%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	5.674.933,74	0,00	0,00	5.702.741,53	27.807,79	0,49%	0,49%	0,97%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.557.646,94	0,00	0,00	4.575.503,83	17.856,89	0,39%	0,39%	0,83%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	37.883.238,16	0,00	0,00	38.022.169,00	138.930,84	0,37%	0,37%	0,81%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	5.578.838,98	0,00	3.659.150,32	1.939.757,74	20.069,08	0,36%	0,47%	0,32%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	2.036.199,88	0,00	752.180,28	1.291.217,40	7.197,80	0,35%	0,42%	0,64%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.621.006,64	0,00	412.444,45	1.213.036,60	4.474,41	0,28%	0,33%	0,86%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIAD...	4.327.866,07	0,00	0,00	4.338.507,67	10.641,60	0,25%	0,25%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDEN...	2.388.033,73	0,00	0,00	2.392.328,04	4.294,31	0,18%	0,18%	0,18%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	49.203.768,52	9.734.336,75	2.615.000,00	56.420.571,74	97.466,47	0,17%	0,18%	0,03%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	66.899,76	0,00	0,00	66.997,79	98,03	0,15%	0,15%	0,03%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	111.372,02	0,00	0,00	111.533,56	161,54	0,15%	0,15%	0,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	30.999,77	0,00	0,00	31.042,30	42,53	0,14%	0,14%	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	4.629,44	0,00	0,00	4.635,69	6,25	0,14%	0,14%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	33.132.007,98	0,00	0,00	33.163.971,90	31.963,92	0,10%	0,10%	0,15%

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
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	84.057.068,50	0,00	0,00	84.131.269,04	74.200,54	0,09%	0,09%	0,15%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.601.071,07	86.530,95	0,00	4.691.108,11	3.506,09	0,07%	0,08%	0,00%
TÍTULOS PÚBLICOS	11.525.760,87	0,00	0,00	11.525.760,87	0,00	0,00%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	919.013,50	0,00	0,00	917.026,50	-1.987,00	-0,22%	-0,22%	1,42%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	525.271,50	0,00	11.816,44	512.217,00	-1.238,06	-0,24%	-2,49%	1,64%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	38.759.502,96	0,00	0,00	38.543.551,35	-215.951,61	-0,56%	-0,56%	0,92%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	116.003,44	0,00	0,00	115.164,28	-839,16	-0,72%	-0,72%	0,93%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	135.078,14	0,00	0,00	134.097,86	-980,28	-0,73%	-0,73%	0,92%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28.922.163,85	0,00	0,00	28.665.118,06	-257.045,79	-0,89%	-0,89%	1,05%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	14.524.024,19	0,00	0,00	14.258.178,01	-265.846,18	-1,83%	-1,83%	2,27%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	20.034.734,31	0,00	0,00	19.664.099,48	-370.634,83	-1,85%	-1,85%	2,27%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	42.709.175,91	0,00	0,00	41.917.495,08	-791.680,83	-1,85%	-1,85%	2,27%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	7.968.687,40	0,00	0,00	7.678.362,64	-290.324,76	-3,64%	-3,64%	3,79%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	1.121.943,46	0,00	0,00	1.080.564,12	-41.379,34	-3,69%	-3,69%	3,80%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>426.083.208,22</b>	<b>9.820.867,70</b>	<b>8.740.453,11</b>	<b>425.536.876,50</b>	<b>-1.626.746,31</b>	<b>-0,38%</b>		<b>0,85%</b>

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
BB DINÂMICO FIC MULTIMERCADO LP	6.555.963,08	0,00	0,00	6.573.968,70	18.005,62	0,27%	0,27%	0,34%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.779.575,64	0,00	0,00	1.781.013,36	1.437,72	0,08%	0,08%	0,53%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2.049.593,47	0,00	0,00	2.044.872,14	-4.721,33	-0,23%	-0,23%	2,59%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.827.053,89	0,00	0,00	1.819.322,50	-7.731,39	-0,42%	-0,42%	0,45%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1.115.627,13	0,00	0,00	1.106.977,47	-8.649,66	-0,78%	-0,78%	2,84%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	1.645.307,43	0,00	0,00	1.622.520,11	-22.787,32	-1,38%	-1,38%	9,90%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	1.494.779,08	0,00	0,00	1.445.687,65	-49.091,43	-3,28%	-3,28%	9,10%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.482.031,73	0,00	0,00	1.432.598,98	-49.432,75	-3,34%	-3,34%	9,16%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.535.128,88	0,00	0,00	1.480.573,06	-54.555,82	-3,55%	-3,55%	9,60%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.171.044,99	0,00	0,00	2.040.528,68	-130.516,31	-6,01%	-6,01%	9,22%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.076.000,00	0,00	0,00	1.860.000,00	-216.000,00	-10,40%	-10,40%	11,49%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>23.732.105,32</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>23.208.062,65</b>	<b>-524.042,67</b>	<b>-2,21%</b>		<b>4,70%</b>

# CRÉDITO E MERCADO

*Consultoria em Investimentos*

INSTITUTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA DE SERTÃOZINHO - SERTPREV - CONSOLIDADO  
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	1.200.598,95	0,00	0,00	1.382.643,06	182.044,11	15,16%	15,16%	8,52%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>1.200.598,95</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>1.382.643,06</b>	<b>182.044,11</b>	<b>15,16%</b>		<b>8,52%</b>