



IPREMA



Setembro/2021



<p>Patrimônio</p> <p>R\$ 37.066.508,13</p>	<p>Rentabilidade</p> <p>Mês: 0,03%</p> <p>Acum.: 0,31%</p>	<p>Meta</p> <p>Mês: 1,57%</p> <p>Acum.: 10,87%</p>	<p>Gap</p> <p>Mês: -1,54p.p.</p> <p>Acum.: -10,56p.p.</p>	<p>VaR</p> <p>0,24%</p>
---	--	--	---	-------------------------




Evolução do Patrimônio

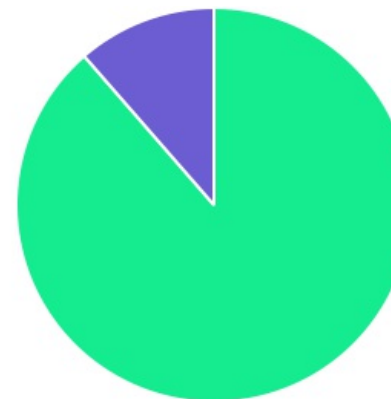







Comparativo (Rentabilidades | Metas)

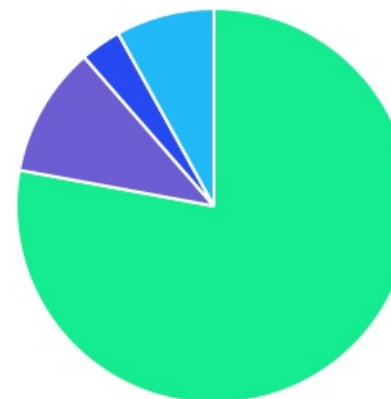





ATIVO	SALDO	CARTEIRA(%)	RESG.	3.922	RETORNO (R\$)	(%)
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RF PREVID	R\$ 6.522.695,15	17.89%	D+1	7, I "b"	R\$ -346,51	-0,01%
BB IMA-B 5 FIC RF PREVID...	R\$ 4.092.178,60	11.23%	D+1	7, I "b"	R\$ 39.617,23	0,98%
BB IRF-M 1 TP FIC RF...	R\$ 7.877.447,92	21.61%	D+0	7, I "b"	R\$ 29.387,13	0,37%
BB IRF-M TP FI RF PREVID	R\$ 1.974.772,18	5.42%	D+1	7, I "b"	R\$ -7.449,77	-0,38%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RF	R\$ 3.202.599,61	8.79%	D+0	7, I "b"	R\$ 11.327,54	0,35%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP...	R\$ 4.730.345,82	12.98%	D+0	7, I "b"	R\$ 50.463,83	1,08%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC...	R\$ 2.055.647,94	5.64%	D+3	7, IV "a"	R\$ 2.201,59	0,11%
BRADERCO FEDERAL EXTRA FI REF DI	R\$ 1.844.360,34	5.06%	D+0	7, IV "a"	R\$ 8.202,70	0,45%
BB RETORNO TOTAL ESTILO FIC AÇÕES	R\$ 1.219.622,22	3.35%	D+3	8, II "a"	R\$ -101.938,23	-7,71%
BB ALOCAÇÃO FI...	R\$ 2.933.420,47	8.05%	D+5	8, III	R\$ -20.861,30	-0,71%
Total investimentos	R\$ 36.453.090,25	100.00%			R\$ 10.604,21	0,03%
Disponibilidade	R\$ 613.417,88	-			-	-
Total patrimônio	R\$ 37.066.508,13	100.00%			-	-

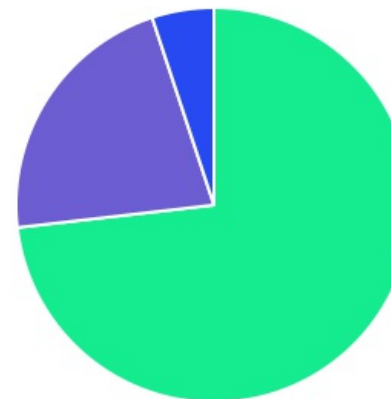
CLASSE	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Renda Fixa	88,61%	R\$ 32.300.047,56	
Renda Variável	11,39%	R\$ 4.153.042,69	
Total	100,00%	R\$ 36.453.090,25	






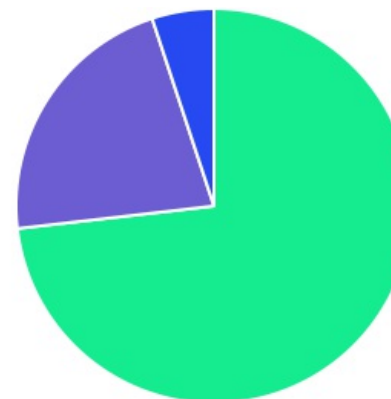
ENQUADRAMENTO	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	77,91%	R\$ 28.400.039,28	
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea "a"	10,70%	R\$ 3.900.008,28	
Artigo 8º, Inciso III	8,05%	R\$ 2.933.420,47	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	3,35%	R\$ 1.219.622,22	
Total	100,00%	R\$ 36.453.090,25	










GESTOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
BB GESTAO	73,18%	R\$ 26.675.784,48	
CAIXA ECONOMICA	21,76%	R\$ 7.932.945,43	
BRAM - BRADESCO	5,06%	R\$ 1.844.360,34	
Total	100,00%	R\$ 36.453.090,25	



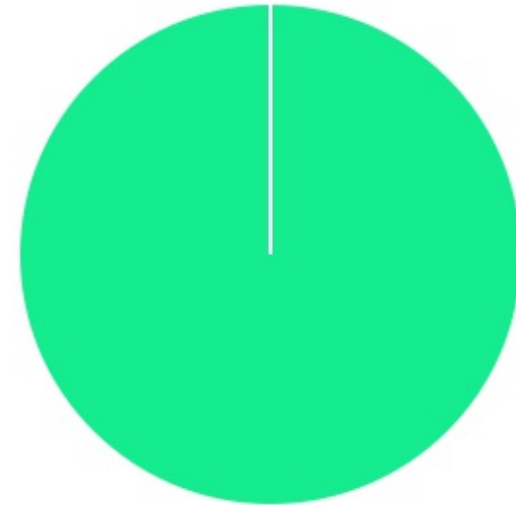
ADMINISTRADOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
BB GESTAO	73,18%	R\$ 26.675.784,48	
CAIXA ECONOMICA	21,76%	R\$ 7.932.945,43	
BANCO BRADESCO	5,06%	R\$ 1.844.360,34	
Total	100,00%	R\$ 36.453.090,25	



BENCHMARK	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
IMA Geral ex-C	32,32%	R\$ 11.780.942,70	
IRF-M 1	21,61%	R\$ 7.877.447,92	
CDI	13,11%	R\$ 4.777.780,81	
IDKA IPCA 2A	12,98%	R\$ 4.730.345,82	
IMA-B 5	11,23%	R\$ 4.092.178,60	
IRF-M	5,42%	R\$ 1.974.772,18	
IBOVESPA	3,35%	R\$ 1.219.622,22	
Total	100,00%	R\$ 36.453.090,25	



LIQUIDEZ	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
0 a 30 dias	100,00%	R\$ 36.453.090,25	
Total	100,00%	R\$ 36.453.090,25	



RENDA FIXA	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Títulos Tesouro Nacional - SELIC - 7, I "a"	100%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	2,00%	100,00%
FI Renda Fixa Referenciado 100% títulos TN - 7, I "b"	100%	R\$ 28.400.039,28	77.91%	40,00%	60,00%	100,00%
FI em Índices de Renda Fixa 100% títulos TN - 7, I "c"	100%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	2,00%	100,00%
Operações Compromissadas - 7, II	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	5,00%
FI Renda Fixa Referenciados - 7, III "a"	60%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	2,00%	60,00%
FI de Índices Renda Fixa - 7, III "b"	60%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	60,00%
FI de Renda Fixa - 7, IV "a"	40%	R\$ 3.900.008,28	10.70%	0,00%	10,00%	40,00%
FI de Índices Renda Fixa - 7, IV "b"	40%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	40,00%
Letras Imobiliárias Garantidas - 7, V "b"	20%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	20,00%
Certificados de Depósitos Bancários (CDB) - 7, VI "a"	15%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	2,00%	15,00%
Poupança - 7, VI "b"	15%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	2,00%	15,00%
FI Direitos Creditórios (FIDC) - sênior - 7, VII "a"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	5,00%
FI Renda Fixa "Crédito Privado" - 7, VII "b"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	5,00%
FI Debêntures - 7, VII "c"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa		R\$ 32.300.047,56	88,61%			

RENDA VARIÁVEL	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Ações Referenciados - 8, I "a"	30%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	30,00%
FI de Índices Ações Referenciados - 8, I "b"	30%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	30,00%
FI em Ações Livre - 8, II "a"	20%	R\$ 1.219.622,22	3.35%	0,00%	5,00%	20,00%
FI de Índices em Ações Livre - 8, II "b"	20%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	20,00%
FI Multimercado - 8, III	10%	R\$ 2.933.420,47	8.05%	0,00%	6,00%	10,00%
FI em Participações - 8, IV "a"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	5,00%
FI Imobiliário - 8, IV "b"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	5,00%
Total Renda Variável		R\$ 4.153.042,69	11,39%			
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Renda Fixa - Dívida Externa - 9 - A, I	10%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	10,00%
Investimento no Exterior - 9 - A, II	10%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	10,00%
Ações - BDR Nível I - 9 - A, III	10%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	3,00%	10,00%
Total Investimentos no exterior		R\$ 0,00	0,00%			
Total Global		R\$ 36.453.090,25	100,00%			

PERÍODO	SALDO ANTERIOR	SALDO FINAL	META	RENT.(R\$)	RENT.(%)	GAP
2021			IPCA + 4.98% a.a.			
Janeiro	R\$ 35.030.382,72	R\$ 34.800.470,27	0,66%	R\$ -72.602,81	-0,21%	-0,86p.p.
Fevereiro	R\$ 34.800.470,27	R\$ 34.885.485,44	1,27%	R\$ -215.828,54	-0,63%	-1,89p.p.
Março	R\$ 34.885.485,44	R\$ 35.203.326,39	1,34%	R\$ 65.610,87	0,19%	-1,15p.p.
Abril	R\$ 35.203.326,39	R\$ 35.622.781,62	0,72%	R\$ 310.388,98	0,88%	0,17p.p.
Maiο	R\$ 35.622.781,62	R\$ 36.160.988,43	1,24%	R\$ 204.485,49	0,58%	-0,66p.p.
Junho	R\$ 36.160.988,43	R\$ 36.502.135,32	0,94%	R\$ 10.608,31	0,03%	-0,90p.p.
Julho	R\$ 36.502.135,32	R\$ 36.725.944,17	1,37%	R\$ -108.155,29	-0,30%	-1,67p.p.
Agosto	R\$ 36.725.944,17	R\$ 36.797.075,73	1,28%	R\$ -96.052,17	-0,26%	-1,54p.p.
Setembro	R\$ 36.797.075,73	R\$ 37.066.508,13	1,57%	R\$ 10.604,21	0,03%	-1,54p.p.
Total	R\$ 36.797.075,73	R\$ 37.066.508,13	10,87%	R\$ 109.059,05	0,31%	-10,56p.p.

ATIVO	CNPJ	RENTABILIDADE				
		Mês (%)	Ano (%)	12 meses (%)	24 meses (%)	Início (%)
BB IRF-M 1 TP FIC RF...	11.328.882/0001-35	-	-	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RF PREVID	25.078.994/0001-90	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RF	23.215.097/0001-55	-	-	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RF PREVID...	03.543.447/0001-03	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP...	14.386.926/0001-71	-	-	-	-	-
BB IRF-M TP FI RF PREVID	07.111.384/0001-69	-	-	-	-	-
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REF DI	03.256.793/0001-00	-	-	-	-	-
BB RETORNO TOTAL ESTILO FIC AÇÕES	09.005.805/0001-00	-	-	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC...	35.292.588/0001-89	-	-	-	-	-
BB ALOCAÇÃO FI...	35.292.597/0001-70	-	-	-	-	-

TÍTULO	VENC.	COMPRA	QTD.	P.U. COMPRA	ATUAL	MARCAÇÃO	VALOR COMPRA	VALOR ATUAL	RETORNO
Total Públicos							R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00 (0,00%)
Total Privados							R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00 (0,00%)
Total Global							R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00 (0,00%)