

Relatório de Análise, Enquadramento, Rentabilidade e Risco - 31/07/2021

Retorno e Meta Atuarial - Julho de 2021

RENDA FIXA

Ativo			Rentabilidade						
CNPJ	FUNDO	Valor Anterior	Mês	Aplicação	Resgate	CUPOM/DIV	Rentabilidade	Valor do Mês	Enquad.
10.740.670/0001-06	21 - CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF (ADM)	R\$ 31.002.817,70	0,17%	R\$ 1.408.227,51	R\$ 660.180,88	R\$ -	R\$ 51.411,94	R\$ 31.802.276,27	Art. 7º, I, b
10.740.670/0001-06	22 - CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF (BENEF)	R\$ 91.427.712,92	0,17%	R\$ 109.769.958,55	R\$ 91.247.431,24	R\$ -	R\$ 169.873,86	R\$ 110.120.114,09	
13.327.340/0001-73	100 - BB PREVID RF IMA-B 5+	R\$ 118.974.626,10	-0,78%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (923.698,01)	R\$ 118.050.928,09	
10.577.503/0001-88	122 - CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ TP RF LP	R\$ 171.655.925,18	-0,76%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (1.312.965,86)	R\$ 170.342.959,32	
10.922.432/0001-03	135 - ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA F	R\$ 91.399.642,33	-0,07%	R\$ 10.000.000,00	R\$ -	R\$ -	R\$ (65.146,25)	R\$ 101.334.496,08	
10.756.541/0001-06	144 - ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO LONGA F	R\$ 121.442.979,13	-0,81%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (983.000,56)	R\$ 120.459.978,57	
19.418.031/0001-95	134 - ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RF L	R\$ 53.565.163,07	-1,31%	R\$ -	R\$ 10.000.000,00	R\$ -	R\$ (700.195,92)	R\$ 42.864.967,15	
10.577.519/0001-90	116 - CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP	R\$ 197.306.919,41	-0,87%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (1.713.685,29)	R\$ 195.593.234,12	
23.215.097/0001-55	113 - CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 225.086.322,84	-0,78%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (1.745.816,18)	R\$ 223.340.506,66	
SUBTOTAL		R\$ 1.101.862.108,68		R\$ 121.178.186,06	R\$ 101.907.612,12	R\$ -	R\$ (7.223.222,27)	R\$ 1.113.909.460,35	
13.594.673/0001-69	94 - TMJ IMA-B FI RF	R\$ 5.319.041,80	0,55%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 29.416,50	R\$ 4.779.544,13	Art. 7º IV, a
21.838.150/0001-49	103 - ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂM	R\$ 303.974.072,14	0,16%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 473.834,53	R\$ 304.447.906,67	
26.507.132/0001-06	147 - SANTANDER RENDA FIXA ATIVO FIC FI	R\$ 61.586.122,93	0,28%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 173.707,79	R\$ 61.759.830,72	
SUBTOTAL		R\$ 370.879.236,87		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 676.958,82	R\$ 370.987.281,52	
13.344.834/0001-66	62 - INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II	R\$ (1.565.267,20)	0,00%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (546.197,63)	R\$ (2.111.464,83)	Art. 7º, VII, a
17.013.985/0001-92	106 - FIDC GGR PRIME I	R\$ 24.868.225,55	-1,28%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (317.103,26)	R\$ 24.551.122,29	
SUBTOTAL		R\$ 23.302.958,35		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (863.300,89)	R\$ 22.439.657,46	
TOTAL RENDA FIXA		R\$ 1.496.044.303,90		R\$ 121.178.186,06	R\$ 101.907.612,12	R\$ -	R\$ (7.409.564,34)	R\$ 1.507.336.399,33	

RENDA VARIÁVEL										
Ativo			Rentabilidade							Enquad.
CNPJ	FUNDO	Valor Anterior (R\$)	Mês	Aplicação	Resgate	CUPOM/DIV	Rentabilidade (R\$)	Valor do Mês (R\$)		
11.392.165/0001-72	123 - AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	R\$ 103.873.829,30	-4,44%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (4.615.420,74)	R\$ 99.258.408,56	Art. 8º, II, a	
11.628.883/0001-03	138 - OCCAM FIC FIA	R\$ 121.652.587,69	-4,12%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (5.007.558,25)	R\$ 116.645.029,44		
08.279.304/0001-41	145 - ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 93.265.393,41	0,00%	R\$ -	R\$ 93.265.393,41	R\$ -	R\$ -	R\$ -		
34.791.108/0001-61	148 - AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCI	R\$ 47.767.151,61	-4,43%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (2.117.827,07)	R\$ 45.649.324,54		
11.977.794/0001-64	149 - BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCION	R\$ 5.761.762,35	-4,57%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (263.496,96)	R\$ 5.498.265,39		
08.621.010/0001-56	150 - BRASIL PLURAL ESTRATÉGIA FIC FIA	R\$ 5.996.314,89	-3,58%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (214.408,74)	R\$ 5.781.906,15		
29.549.642/0001-26	157 - SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO A	R\$ 99.754.984,68	-4,14%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (4.127.146,43)	R\$ 95.627.838,25		
SUBTOTAL		R\$ 478.072.023,93		R\$ -	R\$ 93.265.393,41	R\$ -	R\$ (16.345.858,19)	R\$ 368.460.772,33		
26.269.692/0001-61	143 - ITAU PRIVATE MULTIMERCADO S&P50	R\$ 77.168.035,44	2,58%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 1.988.536,55	R\$ 79.156.571,99	Art. 8º III	
30.036.235/0001-02	158 - FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA N	R\$ 82.300.224,38	2,63%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 2.163.077,30	R\$ 84.463.301,68		
17.453.850/0001-48	159 - WESTERN ASSET US INDEX 500 FIM	R\$ -	2,24%	R\$ 80.000.000,00	R\$ -	R\$ -	R\$ 1.792.773,24	R\$ 81.792.773,24		
SUBTOTAL		R\$ 159.468.259,82		R\$ 80.000.000,00	R\$ -	R\$ -	R\$ 5.944.387,09	R\$ 245.412.646,91		
12.312.767/0001-35	63 - BRASIL FLORESTAL - FUNDO DE INVESTI	R\$ 9.368.434,17	-0,09%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (8.010,70)	R\$ 9.360.423,47	Art. 8º, IV, a	
14.584.094/0001-06	67 - BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC F	R\$ 9.419.739,07	-0,11%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (10.478,12)	R\$ 9.409.260,95		
15.711.367/0001-90	88 - W7 FIP	R\$ 15.473.470,52	-0,13%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (19.754,40)	R\$ 15.453.716,12		
14.721.044/0001-15	121 - INFRA SETORIAL FUNDO DE INVESTIM	R\$ 18.079.490,69	-0,15%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (26.305,32)	R\$ 18.053.185,37		
27.782.774/0001-78	136 - KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INST	R\$ 9.406.917,70	-1,05%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (98.368,62)	R\$ 9.308.549,08		
SUBTOTAL		R\$ 61.748.052,15		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (162.917,16)	R\$ 61.585.134,99		
12.887.506/0001-43	37 - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIC	R\$ 388.370,00	2,73%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 10.610,00	R\$ 398.980,00	Art. 8º, IV, b	
14.423.780/0001-97	44 - ITAU - FII KII REAL	R\$ 1.051.129,76	-10,58%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (111.250,96)	R\$ 939.878,80		
18.369.510/0001-04	80 - FII INFRA REAL ESTATE FII	R\$ 14.637.490,63	11,57%	R\$ -	R\$ -	R\$ 54.332,02	R\$ 1.748.326,81	R\$ 16.226.494,26		
15.461.076/0001-91	105 - FII BR HOTÉIS	R\$ 15.689.887,10	-0,14%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (22.270,95)	R\$ 15.667.616,15		
SUBTOTAL		R\$ 31.766.877,49		R\$ -	R\$ -	R\$ 54.332,02	R\$ 1.571.082,88	R\$ 33.232.969,21		
34.246.525/0001-23	154 - SANTANDER GO NORTH AMERICAN EC	R\$ 36.720.461,82	0,01%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 5.423,84	R\$ 36.725.885,66	Art. 9º, II	
37.308.394/0001-50	155 - SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES	R\$ 56.605.678,80	6,34%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 3.589.596,68	R\$ 60.195.275,48		
37.331.365/0001-09	156 - GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 89.362.284,72	1,80%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 1.610.059,52	R\$ 90.972.344,24		
SUBTOTAL		R\$ 182.688.425,34		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 5.205.080,04	R\$ 187.893.505,38		
17.502.937/0001-68	153 - CAIXA FI AÇÕES INSTITUCIONAL BDR N	R\$ 46.015.771,88	5,42%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 2.494.227,21	R\$ 48.509.999,09	Art. 9º, III	
SUBTOTAL		R\$ 46.015.771,88		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 2.494.227,21	R\$ 48.509.999,09		
TOTAL RENDA VARIÁVEL		R\$ 959.759.410,61		R\$ 80.000.000,00	R\$ 93.265.393,41	R\$ 54.332,02	R\$ (1.293.998,13)	R\$ 945.095.027,91		

CONTA CORRENTE				
Número	Descrição	Saldo Anterior	Saldo Atual	
15-0	Caixa Econômica Federal - 00.360.305/0001	R\$ 100,00	R\$	245,51
16-9	Caixa Econômica Federal - 00.360.305/0001	R\$ 10.000,00	R\$	10.007,35
33888-1	Itaú Unibanco - 60.701.190/0001-03	R\$ -	R\$	-
79680-7	Itaú Unibanco - 60.701.190/0001-04	R\$ 124,47	R\$	107,23
40104-8	Banco do Brasil - 00.000.000/0001-91	R\$ 47,75	R\$	47,75
98300-4	Banco Bradesco - 60.746.948/0001-12	R\$ 78,05	R\$	78,05
130003250-0	Banco Santander - 90.400.888/0001-42	R\$ 100,06	R\$	100,06
Total Conta Corrente		R\$ 10.450,33	R\$	10.585,95
Total de Recursos		R\$ 2.455.814.164,84	R\$	2.452.442.013,19
<p>Este relatório visa dar publicidade à Carteira de Investimentos do IPRESB, contendo as informações referentes ao mês de Julho/2021. Obs: Houve uma reavaliação do Fundo: 80 - FII INFRA REAL ESTATE FII, tendo um acréscimo na cota de 16,82% . Incremento no valor de Contribuição mensal com a inclusão do valor referente ao COMPREV desde 02/2021. Valores lançados de acordo com o credito recebido. Valor do Fundo 62 - INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II, foi efetuado acerto de informação de saldos de acordo com extrato emitido pela ADM, apresentando saldo negativo.</p> <p>CRESCIMENTO DA CARTEIRA NO MÊS DE JUNHO/2021 -0,14%</p>				

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"	45,42%	100% / 42%	<ul style="list-style-type: none"> Fundo RF - 100% Títulos do Tesouro Nacional Fundo RF - Geral Fundo RF - FIDC - Direitos Creditórios Fundo RV - Ações Geral Fundo RV - Multimercado Fundo RV - FIP - Participações Fundo RV - FII - Imobiliário Fundo RV - Investimentos no Exterior Fundo RV - Investimentos no Exterior
Fundo RF - Geral	Artigo 7º, IV, "a"	15,13%	40% / 16%	
Fundo RF - FIDC - Direitos Creditórios	Artigo 7º, VII, "a"	0,91%	5% / 2%	
Fundo RV - Ações Geral	Artigo 8º, II, "a"	15,02%	20% / 15%	
Fundo RV - Multimercado	Artigo 8º, III	10,01%	10% / 10%	
Fundo RV - FIP - Participações	Artigo 8º, IV, "a"	2,51%	5% / 3%	
Fundo RV - FII - Imobiliário	Artigo 8º, IV, "b"	1,36%	5% / 2%	
Fundo RV - Investimentos no Exterior	Artigo 9º, II	7,66%	10% / 8%	
Fundo RV - Investimentos no Exterior	Artigo 9º, III	1,98%	10% / 2%	

ACOMPANHAMENTO DE RECURSOS NO ANO DE 2021

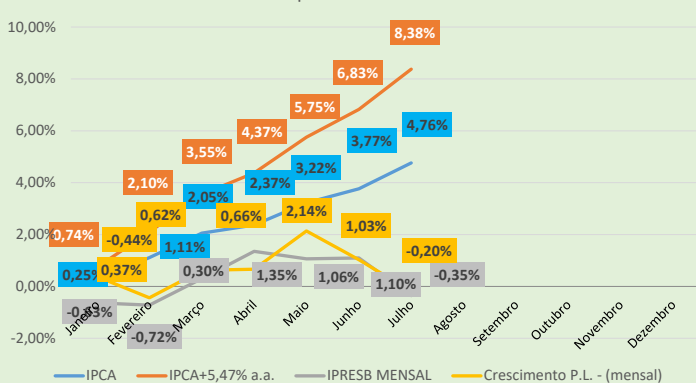
Período	Recursos	Contribuição	Rentabilidade Mensal	Crescimento P.L. - (mensal)	Rendimento Mensal	Rend Médio Trimestral	Rendim. Semestral
Janeiro	R\$ 2.361.470.713,09	R\$ 15.811.023,69	R\$ (15.026.025,73)	0,37%	-0,63%	-0,35%	0,41%
Fevereiro	R\$ 2.351.118.718,70	R\$ 16.014.015,80	R\$ (17.033.150,43)	-0,44%	-0,72%		
Março	R\$ 2.365.780.939,98	R\$ 15.827.002,38	R\$ 7.131.575,37	0,62%	0,30%		
Abril	R\$ 2.381.475.613,39	R\$ 15.827.428,70	R\$ 31.989.002,77	0,66%	1,35%	1,17%	
Maió	R\$ 2.432.375.827,20	R\$ 15.950.534,76	R\$ 25.280.977,46	2,14%	1,06%		
Junho	R\$ 2.457.379.432,04	R\$ 15.900.565,81	R\$ 26.684.657,85	1,03%	1,10%	-	
Julho	R\$ 2.452.442.013,19	R\$ 15.925.905,57	R\$ (8.503.595,08)	-0,20%	-0,35%		
Agosto							
Setembro							
Outubro							
Novembro							
Dezembro							

DESEMPENHO E INDICADORES

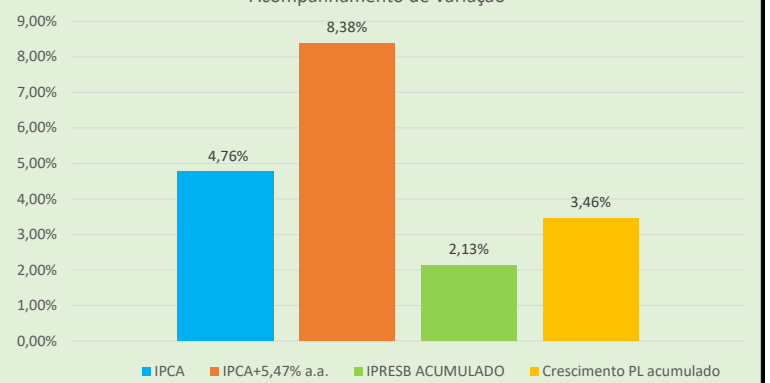
MÊS	IPCA		IPCA+5,47% a.a.		IPRESB MENSAL		RENTAB. MÉDIA
	MENSAL	ACUMULADO	MENSAL	ACUMULADO	MENSAL	ACUMULADO	
Janeiro	0,25%	0,25%	0,74%	0,74%	-0,63%	-0,63%	-0,63%
Fevereiro	0,86%	1,11%	1,35%	2,10%	-0,72%	-1,36%	-0,99%
Março	0,93%	2,05%	1,42%	3,55%	0,30%	-1,05%	-1,01%
Abril	0,31%	2,37%	0,80%	4,37%	1,35%	0,30%	-0,69%
Maió	0,83%	3,22%	1,32%	5,75%	1,06%	1,36%	-0,28%
Junho	0,53%	3,77%	1,02%	6,83%	1,10%	2,46%	0,18%
Julho	0,96%	4,76%	1,45%	8,38%	-0,35%	2,13%	0,46%
Agosto							
Setembro							
Outubro							
Novembro							
Dezembro							

INDICADORES DE REFERÊNCIA			
INDICADOR	MÊS	ACUMULADO	ANO (Previsto)
IBOVESPA	-2,75%	3,19%	
CDI	0,36%	1,63%	
IPCA+5,47% a.a.	0,96%	8,38%	12,52%

Comparativo de Rentabilidades



Acompanhamento de Variação



RESUMO DAS INFORMAÇÕES

RECURSO INICIAL EM JANEIRO 2021	R\$ 2.370.321.994,20
TOTAL DE RECURSOS INVESTIDOS + SALDO EM CONTA CORRENTE	R\$ 2.452.442.013,19
TOTAL DAS CONTRIBUIÇÕES	R\$ 111.256.476,71
TOTAL DE RENDIMENTOS	R\$ 50.523.442,21
VARIAÇÃO AUMENTATIVA DO P.L.	3,46%
META ATUARIAL 5,47% + 6,11% (IPCA BOLETIM FOCUS, 13/08/2021)	12,52%
RENDIMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS EM %	2,13%
CUMPRIMENTO DA META ATUARIAL	17,02%

Este relatório visa dar publicidade à Carteira de Investimentos do IPRESB, contendo as informações referentes ao mês de Julho/2021. Obs: Houve uma reavaliação do Fundo: 80 - FII INFRA REAL ESTATE FII, tendo um acréscimo na cota de 16,82%. Incremento no valor de Contribuição mensal com a inclusão do valor referente ao COMPREV desde 02/2021. Valores lançados de acordo com o crédito recebido. Valor do Fundo 62 - INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II, foi efetuado acerto de informação de saldos de acordo com extrato emitido pela ADM, apresentando saldo negativo.

O Instituto possui contrato com a empresa LDB Consultoria Financeira Ltda - EPP, para prestação de serviços de consultoria em investimentos, vigência: 06/2020 a 06/2021. Valor: R\$ 106.500,00 anual (cento e seis mil e quinhentos reais). Empenho: nº 321 de 15/06/2020. Processo: nº 015/2020.