

Relatório de Análise, Enquadramento, Rentabilidade e Risco - 30/09/2021

Retorno e Meta Atuarial - Setembro de 2021

RENDA FIXA

Ativo			Rentabilidade						Enquad.
CNPJ	FUNDO	Valor Anterior	Mês	Aplicação	Resgate	CUPOM/DIV	Rentabilidade	Valor do Mês	
10.740.670/0001-06	21 - CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF (ADM)	R\$ 32.641.875,49	0,37%	R\$ 1.422.360,55	R\$ 765.525,30	R\$ -	R\$ 121.963,70	R\$ 33.420.674,44	Art. 7º, I, b
10.740.670/0001-06	22 - CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF (BENEF)	R\$ 24.444.944,27	0,37%	R\$ 15.689.251,19	R\$ 11.626.621,98	R\$ -	R\$ 137.502,51	R\$ 28.645.075,99	
11.060.913/0001-10	56 - FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	R\$ 100.539.252,74	0,98%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 986.355,46	R\$ 101.525.608,20	
13.322.205/0001-35	58 - BB PREVID RF IDKA 2 TP FI	R\$ 131.601.592,24	1,03%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 1.360.031,98	R\$ 132.961.624,22	
14.386.926/0001-71	98 - FI CAIXA BRASIL IDKA 2A TIT RF LONGO P	R\$ 101.290.374,21	1,08%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 1.092.228,34	R\$ 102.382.602,55	
23.215.097/0001-55	113 - CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 220.102.999,04	0,35%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 781.263,81	R\$ 220.884.262,85	
10.577.519/0001-90	116 - CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP	R\$ 193.328.732,68	-0,78%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (1.507.010,87)	R\$ 191.821.721,81	
19.418.031/0001-95	134 - ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RF II	R\$ 23.275.466,82	-1,77%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (411.073,88)	R\$ 22.864.392,94	
10.922.432/0001-03	135 - ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA F	R\$ 101.421.069,59	0,96%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 970.185,19	R\$ 102.391.254,78	
17.517.577/0001-78	161 - WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RF	R\$ 80.793.197,47	0,67%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 544.435,70	R\$ 81.337.633,17	
13.455.117/0001-01	163 - SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC	R\$ 93.324.156,71	0,99%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 920.280,57	R\$ 94.244.437,28	
SUBTOTAL		R\$ 1.102.763.661,26		R\$ 17.111.611,74	R\$ 12.392.147,28	R\$ -	R\$ 4.996.162,51	R\$ 1.112.479.288,23	
13.594.673/0001-69	94 - TMJ IMA-B FI RF	R\$ 4.717.798,50	-13,57%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (640.072,65)	R\$ 4.077.725,85	Art. 7º IV, a
21.838.150/0001-49	103 - ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂM	R\$ 305.381.101,21	0,84%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 2.555.804,81	R\$ 307.936.906,02	
26.507.132/0001-06	147 - SANTANDER RENDA FIXA ATIVO FIC FI	R\$ 61.900.331,40	0,31%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 188.895,85	R\$ 62.089.227,25	
SUBTOTAL		R\$ 371.999.231,11		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 2.104.628,01	R\$ 374.103.859,12	
13.344.834/0001-66	62 - INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II	R\$ (2.099.026,08)	-363,05%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (7.620.502,37)	R\$ (9.719.528,45)	Art. 7º, VII, a
17.013.985/0001-92	106 - FIDC GGR PRIME I	R\$ 24.546.651,72	-2,38%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (585.271,60)	R\$ 23.961.380,12	
SUBTOTAL		R\$ 22.447.625,64		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (8.205.773,97)	R\$ 14.241.851,67	
TOTAL RENDA FIXA		R\$ 1.497.210.518,01		R\$ 17.111.611,74	R\$ 12.392.147,28	R\$ -	R\$ (1.104.983,45)	R\$ 1.500.824.999,02	

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\$ 94.235.501,48	-4,19%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (3.947.780,78)	R\$ 90.287.720,70	Art. 8º, II, a
11.628.883/0001-03	138 - OCCAM FIC FIA	R\$ 113.798.476,64	-6,93%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (7.883.681,92)	R\$ 105.914.794,72	
34.791.108/0001-61	148 - AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCION	R\$ 43.336.122,05	-4,21%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (1.824.375,78)	R\$ 41.511.746,27	
11.977.794/0001-64	149 - BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCION	R\$ 5.123.200,76	-8,84%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (452.946,11)	R\$ 4.670.254,65	
08.621.010/0001-56	150 - BRASIL PLURAL ESTRATÉGIA FIC FIA	R\$ 5.551.757,13	-6,95%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (385.576,72)	R\$ 5.166.180,41	
30.068.169/0001-44	160 - FIC FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUA	R\$ 46.387.616,46	-3,75%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (1.737.548,36)	R\$ 44.650.068,10	
09.005.805/0001-00	162 - BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	R\$ 45.515.285,82	-7,71%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (3.510.809,82)	R\$ 42.004.476,00	
SUBTOTAL		R\$ 353.947.960,34		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (19.742.719,49)	R\$ 334.205.240,85	
26.269.692/0001-61	143 - ITAU PRIVATE MULTIMERCADO S&P500	R\$ 81.813.845,26	-4,61%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (3.769.439,28)	R\$ 78.044.405,98	
30.036.235/0001-02	158 - FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA M	R\$ 87.283.386,43	-4,64%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (4.048.470,13)	R\$ 83.234.916,30	
17.453.850/0001-48	159 - WESTERN ASSET US INDEX 500 FIM	R\$ 84.530.038,68	-4,60%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (3.889.926,49)	R\$ 80.640.112,19	
SUBTOTAL		R\$ 253.627.270,37		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (11.707.835,90)	R\$ 241.919.434,47	
12.312.767/0001-35	63 - BRASIL FLORESTAL - FUNDO DE INVESTIM	R\$ 9.352.803,35	-0,08%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (7.272,46)	R\$ 9.345.530,89	Art. 8º, IV, a
14.584.094/0001-06	67 - BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC FI	R\$ 9.398.659,17	-0,10%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (9.844,49)	R\$ 9.388.814,68	
15.711.367/0001-90	88 - W7 FIP	R\$ 15.431.723,04	-0,10%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (14.953,51)	R\$ 15.416.769,53	
14.721.044/0001-15	121 - INFRA SETORIAL FUNDO DE INVESTIME	R\$ 18.387.482,75	21,82%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 4.012.388,99	R\$ 22.399.871,74	
27.782.774/0001-78	136 - KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INST	R\$ 9.220.036,27	-1,09%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (100.150,34)	R\$ 9.119.885,93	
SUBTOTAL		R\$ 61.790.704,58		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 3.880.168,19	R\$ 65.670.872,77	
12.887.506/0001-43	37 - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	R\$ 401.150,00	-0,29%	R\$ -	R\$ -	R\$ 778,70	R\$ (1.180,00)	R\$ 399.970,00	Art. 8º, IV, b
14.423.780/0001-97	44 - ITAU - FII KII REAL	R\$ 813.282,88	2,83%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 23.017,44	R\$ 836.300,32	
18.369.510/0001-04	80 - FII INFRA REAL ESTATE FII	R\$ 16.132.840,41	0,10%	R\$ -	R\$ -	R\$ 30.479,55	R\$ 16.797,91	R\$ 16.079.644,22	
15.461.076/0001-91	105 - FII BR HOTÉIS	R\$ 15.646.426,71	-0,13%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (20.193,15)	R\$ 15.626.233,56	
SUBTOTAL		R\$ 32.993.700,00		R\$ -	R\$ -	R\$ 31.258,25	R\$ 18.442,20	R\$ 32.942.148,10	
34.246.525/0001-23	154 - SANTANDER GO NORTH AMERICAN EQ	R\$ 37.370.407,61	-6,00%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (2.240.889,38)	R\$ 35.129.518,23	Art. 9º, II
37.308.394/0001-50	155 - SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES	R\$ 61.410.312,48	1,46%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 894.044,57	R\$ 62.304.357,05	
37.331.365/0001-09	156 - GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 93.178.412,24	-1,35%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (1.255.844,37)	R\$ 91.922.567,87	
SUBTOTAL		R\$ 191.959.132,33		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (2.602.689,18)	R\$ 189.356.443,15	
17.502.937/0001-68	153 - CAIXA FI AÇÕES INSTITUCIONAL BDR NI	R\$ 49.691.410,83	-0,25%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (124.276,09)	R\$ 49.567.134,74	Art. 9º, III
SUBTOTAL		R\$ 49.691.410,83		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (124.276,09)	R\$ 49.567.134,74	
TOTAL RENDA VARIÁVEL		R\$ 944.010.178,45		R\$ -	R\$ -	R\$ 31.258,25	R\$ (30.278.910,27)	R\$ 913.661.274,08	

CONTA CORRENTE

Número	Descrição	Saldo Anterior	Saldo Atual	
15-0	Caixa Econômica Federal - 00.360.305/0001-0	R\$ 100,00	R\$ 100,00	Este relatório visa dar publicidade à Carteira de Investimentos do IPRESB, contendo as informações referentes ao mês de Setembro/2021. O fundo 62-FIDC Incentivo Multissetorial sob CNPJ. 13.344.834/0001-66, gerou um rendimento negativo de R\$ 7.620.502,37. Com isso a rentabilidade no referido mês foi de -1,28%, sendo o acumulado para o ano corrente de 0,14%. Caso não houvesse a marcação contábil do mesmo, os valores seriam -0,97% e 0,46%, respectivamente.
16-9	Caixa Econômica Federal - 00.360.305/0001-0	R\$ 10.000,00	R\$ 10.000,00	
33888-1	Itaú Unibanco - 60.701.190/0001-03	R\$ -	R\$ -	
79680-7	Itaú Unibanco - 60.701.190/0001-04	R\$ 11.561,45	R\$ 76,40	
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\$ 21.887,31	R\$ 10.402,26	
Total de Recursos		R\$ 2.441.242.583,77	R\$ 2.414.496.675,36	
CRESCIMENTO DA CARTEIRA NO MÊS DE SETEMBRO/2021				

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"	46,07%	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"	15,49%	40% / 16%	
Fundo RF - FIDC - Direitos Creditórios	Artigo 7º, VII, "a"	0,59%	5% / 2%	
Fundo RV - Ações Geral	Artigo 8º, II, "a"	13,84%	20% / 15%	
Fundo RV - Multimercado	Artigo 8º, III	10,02%	10% / 10%	
Fundo RV - FIP - Participações	Artigo 8º, IV, "a"	2,72%	5% / 3%	
Fundo RV - FII - Imobiliário	Artigo 8º, IV, "b"	1,36%	5% / 2%	
Fundo RV - Investimentos no Exterior	Artigo 9º, II	7,84%	10% / 8%	
Fundo RV - Investimentos no Exterior	Artigo 9º, III	2,05%	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\$ 15.659.553,52	R\$ (17.033.150,43)	-0,44%	-0,72%		
Março	R\$ 2.365.780.939,98	R\$ 15.783.964,81	R\$ 7.131.575,37	0,62%	0,30%		
Abril	R\$ 2.381.475.613,39	R\$ 15.784.391,13	R\$ 31.989.002,77	0,66%	1,35%	1,17%	
Maió	R\$ 2.432.375.827,20	R\$ 15.907.497,19	R\$ 25.280.977,46	2,14%	1,06%		
Junho	R\$ 2.457.379.432,04	R\$ 15.855.902,47	R\$ 26.684.657,85	1,03%	1,10%		
Julho	R\$ 2.452.442.013,19	R\$ 15.886.213,81	R\$ (8.503.595,08)	-0,20%	-0,35%	-0,76%	
Agosto	R\$ 2.441.242.583,77	R\$ 15.823.341,28	R\$ (15.836.362,75)	-0,46%	-0,65%		
Setembro	R\$ 2.414.496.675,36	R\$ 15.845.070,27	R\$ (31.352.635,47)	-1,10%	-1,28%		
Outubro							
Novembro							
Dezembro							

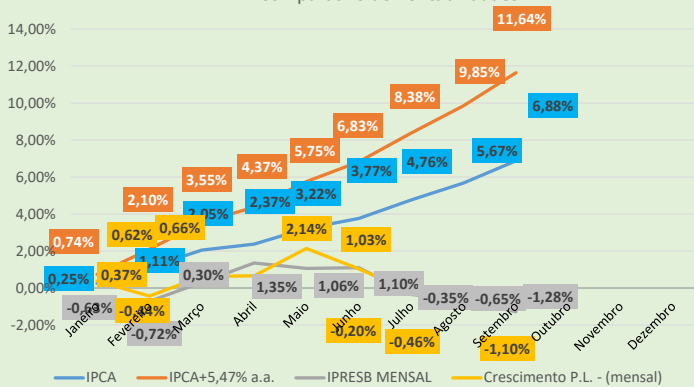
DESEMPENHO E INDICADORES

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	0,87%	5,67%	1,36%	9,85%	-0,65%	1,47%	0,58%
Setembro	1,14%	6,88%	1,63%	11,64%	-1,28%	0,14%	0,54%
Outubro							
Novembro							
Dezembro							

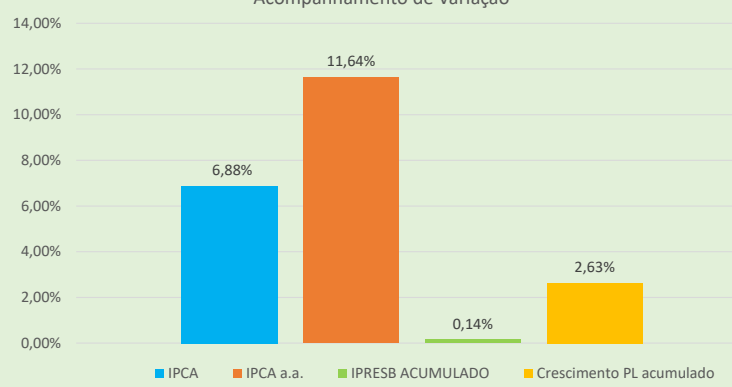
INDICADORES DE REFERÊNCIA

INDICADOR	MÊS	ACUMULADO	ANO (Previsto)
IBOVESPA	-6,57%	-6,75%	IPCA+5,47% a.a.
CDI	0,44%	2,51%	
IPCA a.a.	1,14%	6,88%	14,06%

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\$ 2.414.496.675,36
TOTAL DAS CONTRIBUIÇÕES	R\$ 142.356.958,17
TOTAL DE RENDIMENTOS	R\$ 3.334.443,99
VARIAÇÃO AUMENTATIVA DO P.L.	1,86%
META ATUARIAL 5,47% + 8,59% (Boletim Focus 08/10/21)	14,06%
RENDIMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS EM %	0,14%
CUMPRIMENTO DA META ATUARIAL	1,00%

Este relatório visa dar publicidade à Carteira de Investimentos do IPRESB, contendo as informações referentes ao mês de Setembro/2021.

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.