

Relatório de Análise, Enquadramento, Rentabilidade e Risco - 28/02/2019
Retorno e Meta Atuarial - Fevereiro de 2019

RENTA FIXA

| Ativo | | | Rentabilidade | | | Enquadramento |
|-------------------------|---|-------------------------|---------------|-----------------------|-------------------------|-----------------|
| CNPJ | FUNDO | Valor Anterior (R\$) | Mês | Rentabilidade (R\$) | Valor do Mês (R\$) | |
| 10.740.670/0001-06 | 21 - CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF (ADM) | 15.204.739,96 | 0,57% | 66.658,48 | 15.433.812,43 | Art. 7º, I, b |
| 10.740.670/0001-06 | 22 - CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF (BENEF) | 11.482.849,26 | 0,57% | 100.853,20 | 19.312.067,68 | |
| 21.919.953/0001-28 | 96 - CAIXA TITULOS PUBLICOS 2020 | 23.190.638,60 | 0,53% | 123.270,68 | 22.690.835,79 | |
| 18.687.230/0001-36 | 97 - ITAU INSTITUCIONAL TITULOS PUBLICOS RF FI | 6.344.593,86 | 0,72% | 45.673,04 | 6.390.266,90 | |
| 14.386.926/0001-71 | 98 - CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP | 228.866.804,31 | 0,56% | 1.275.513,25 | 230.142.317,56 | |
| 13.327.340/0001-73 | 100 - BB PREVID RF IMA-B 5+ | 17.606.478,74 | 0,46% | 81.171,42 | 17.687.650,16 | |
| 10.396.381/0001-23 | 115 - ITAU INSTITUCIONAL RF PRE LP FICFI | 22.790.721,23 | 0,26% | 59.083,78 | 22.849.805,01 | |
| 10.577.519/0001-90 | 116 - CAIXA FI BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP | 181.701.500,71 | 0,21% | 381.828,26 | 182.083.328,97 | |
| 07.111.384/0001-69 | 119 - BB PREV. IRF-M | 307.581.038,44 | 0,28% | 848.053,42 | 308.429.091,86 | |
| 10.577.503/0001-88 | 122 - CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ TP RF LP | 166.952.238,92 | 0,52% | 866.187,61 | 167.818.426,53 | |
| 13.455.197/0001-03 | 128 - SANTANDER FI IRF-M TITULOS PUBLICOS RF | 93.854.697,12 | 0,28% | 258.305,79 | 94.113.002,91 | |
| SUBTOTAL | | 1.075.576.301,15 | | 4.106.598,93 | 1.086.950.605,80 | |
| 13.594.673/0001-69 | 94 - TMJ IMA-B FI RF | 12.223.285,70 | -1,66% | (202.946,54) | 12.020.339,16 | |
| 21.838.150/0001-49 | 103 - ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FIC FI | 19.622.481,48 | 0,34% | 66.872,42 | 19.689.353,90 | |
| 25.306.703/0001-73 | 109 - ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA II RF FIC FI | 132.932.784,31 | 0,34% | 451.483,82 | 133.384.268,13 | |
| 03.399.411/0001-90 | 125 - BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM | 36.932.631,75 | 0,48% | 178.801,32 | 37.111.433,07 | |
| 19.418.031/0001-95 | 134 - ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RF LP | 10.457.102,15 | 0,11% | 11.278,12 | 10.468.380,27 | |
| 10.922.432/0001-03 | 135 - ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RF | 32.195.527,91 | 0,52% | 168.950,16 | 32.364.478,07 | |
| SUBTOTAL | | 244.363.813,30 | | 674.439,30 | 245.038.252,60 | |
| 13.344.834/0001-66 | 62 - INCENTIVO FIDC MULTISETORIAL II | 6.504.567,79 | 0,00% | - | 6.504.567,79 | Art. 7º, VII, a |
| 23.431.871/0001-65 | 93 - TRX FIDC SENIOR | 327.279,07 | 0,86% | 2.820,39 | 330.099,46 | |
| 17.013.985/0001-92 | 106 - FIDC GGR Prime I | 35.463.213,85 | -3,74% | (1.326.824,79) | 34.136.389,06 | |
| SUBTOTAL | | 42.295.060,71 | | (1.324.004,40) | 40.971.056,31 | |
| TOTAL RENTA FIXA | | 1.362.235.175,16 | | 3.457.033,83 | 1.372.959.914,71 | |

RENTA VARIÁVEL

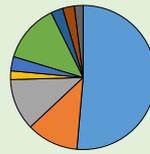
| Ativo | | | Rentabilidade | | | Enquadramento |
|-----------------------------|--|-----------------------|---------------|-----------------------|-----------------------|----------------|
| CNPJ | FUNDO | Valor Anterior (R\$) | Mês | Rentabilidade (R\$) | Valor do Mês (R\$) | |
| 01.699.688/0001-02 | 129 - SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL AÇÕES | 41.034.064,67 | -1,86% | (761.462,83) | 40.272.601,84 | Art. 8º, I, a |
| 03.394.711/0001-86 | 132 - BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS | 28.188.381,22 | -1,85% | (520.592,19) | 27.667.789,03 | |
| SUBTOTAL | | 69.222.445,89 | | (1.282.055,02) | 67.940.390,87 | |
| 11.392.165/0001-72 | 123 - AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA | 58.456.302,09 | -2,88% | (1.685.188,47) | 56.771.113,62 | Art. 8º, II, a |
| 06.916.384/0001-73 | 126 - BRADESCO FIA DIVIDENDOS | 26.299.460,79 | -0,76% | (199.620,64) | 26.099.840,15 | |
| 02.436.763/0001-05 | 130 - SANTANDER FIC FI SELEÇÃO TOP AÇÕES | 11.456.158,84 | -1,86% | (213.287,79) | 11.242.871,05 | |
| 07.279.657/0001-89 | 131 - AZ QUEST AÇÕES FIC FIA | 53.886.161,63 | -2,38% | (1.280.096,18) | 52.606.065,45 | |
| 23.731.629/0001-07 | 133 - ITAU INSTITUCIONAL AÇÕES PHOENIX FIC DE FI | 78.062.300,30 | -1,49% | (1.164.109,70) | 76.898.190,60 | |
| 11.628.883/0001-03 | 138 - OCCAM FIC FIA | 25.479.034,89 | -1,20% | (304.591,65) | 25.174.443,24 | |
| 03.168.062/0001-03 | 141 - ARX INCOME FIA | 28.154.064,66 | -1,99% | (558.950,83) | 27.595.113,83 | |
| SUBTOTAL | | 281.793.483,20 | | (5.405.845,26) | 276.387.637,94 | |
| 03.737.188/0001-43 | 137 - CAIXA FI MULTIMERCADO RV30 L P | 22.038.424,24 | -0,31% | (68.438,53) | 21.969.985,71 | Art. 8º, III |
| 10.418.362/0001-50 | 139 - BB PREV MULTIMERCADO FDO DE INVEST LONGO PRAZO | 15.580.929,85 | 0,59% | 92.656,00 | 15.673.585,85 | |
| 26.680.228/0001-63 | 140 - ICATU VANGUARDA ESTRATEGIA FIM | 4.097.364,05 | 0,17% | 6.981,36 | 4.104.345,41 | |
| 15.578.417/0001-03 | 142 - OCCAM INSTITUCIONAL FIM II | 5.130.136,45 | 0,30% | 15.574,56 | 5.145.711,01 | |
| 26.269.692/0001-61 | 143 - ITAU PRIVATE MULTIMERCADO S&P500 | 9.717.622,48 | 3,41% | 331.603,01 | 10.049.225,49 | |
| SUBTOTAL | | 56.564.477,07 | | 378.376,40 | 56.942.853,47 | |
| 12.312.767/0001-35 | 63 - ATICO FLORESTAL FIP | 11.830.184,77 | 0,00% | - | 11.830.184,77 | Art. 8º, IV, a |
| 16.676.620/0001-85 | 66 - FIP CAIXA CYRELA | 4.134.244,08 | 7,57% | 312.843,46 | 4.130.802,76 | |
| 14.584.094/0001-06 | 67 - BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC FIP | 7.139.193,56 | 9,46% | 675.331,83 | 7.814.525,39 | |
| 15.711.367/0001-90 | 88 - W7 FIP | 15.651.739,71 | -0,16% | (24.581,54) | 15.627.158,17 | |
| 14.721.044/0001-15 | 121 - INFRA SETORIAL FUNDO DE INVESTIMENTOS EM PARTICIP | 15.390.624,85 | -0,16% | (24.896,15) | 15.365.728,70 | |
| 27.782.774/0001-78 | 136 - KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP M | 754.043,01 | -2,57% | (19.370,26) | 734.672,75 | |
| SUBTOTAL | | 54.900.029,98 | | 919.327,34 | 55.503.072,54 | |
| 12.887.506/0001-43 | 37 - CAIXA FII CX TRX | 475.110,00 | 1,92% | 9.110,00 | 484.220,00 | Art. 8º, IV, b |
| 14.423.780/0001-97 | 44 - ITAU - FII KII REAL | 3.809.386,32 | 0,10% | 3.836,24 | 3.813.222,56 | |
| 18.369.510/0001-04 | 80 - FII INFRA REAL ESTATE FII | 20.295.887,79 | 0,03% | 5.481,87 | 20.301.369,66 | |
| 15.461.076/0001-91 | 105 - FII BR HOTEIS | 16.397.170,54 | -0,07% | (10.928,36) | 16.386.242,18 | |
| SUBTOTAL | | 40.977.554,65 | | 7.499,75 | 40.985.054,40 | |
| TOTAL RENTA VARIÁVEL | | 503.457.990,79 | | - 5.382.696,79 | 497.759.009,22 | |

CONTA CORRENTE

| Número | Descrição | Saldo Anterior (R\$) | Saldo Atual (R\$) |
|-----------------------------------|--|-------------------------|---|
| 16-9 | Caixa Econômica Federal - 00.360.305/0001-04 | 8.497,34 | 10.757,51 |
| 15-0 | Caixa Econômica Federal - 00.360.305/0001-04 | 100,00 | 103.299,26 |
| 79680-7 | Itaú Unibanco - 60.701.190/0001-04 | 100,00 | 62,88 |
| 40104-8 | Banco do Brasil - 00.000.000/0001-91 | - | 100,00 |
| 98300-4 | Banco Bradesco - 60.746.948/0001-12 | 100,00 | 100,00 |
| 130003250-0 | Banco Santander - 90.400.888/0001-42 | 100,01 | 100,01 |
| TOTAL RENTA CONTA CORRENTE | | 8.897,35 | 114.419,66 |
| Total de Recursos (Mês Anterior) | | 1.865.702.063,30 | CRESCIMENTO DA CARTEIRA NO MÊS DE FEVEREIRO/2019 0,28% |
| Total de Recursos (Mês Atual) | | 1.870.833.343,59 | |

| Enquadramento da Resolução CMN nº 3.922 | Enquadramento | % da Carteira |
|---|---------------------|---------------|
| Fundo RF - 100% Títulos do Tesouro Nacional | Artigo 7º, I, "b" | 58,10% |
| Fundo RF - Referenciado | Artigo 7º, III, "a" | 13,10% |
| Fundo RF - Geral | Artigo 7º, IV, "a" | 13,10% |
| Fundo RF - FIDC - Direitos Creditórios | Artigo 7º, VII, "a" | 2,19% |
| Fundo RV - Ações 50+ Ativos | Artigo 8º, I, "a" | 3,63% |
| Fundo RV - Ações Geral | Artigo 8º, II, "a" | 14,77% |
| Fundo RV - Multimercado | Artigo 8º, III | 3,04% |
| Fundo RV - FIP - Participações | Artigo 8º, IV, "a" | 2,97% |
| Fundo RV - FII - Imobiliário | Artigo 8º, IV, "b" | 2,19% |

% da Carteira



- Fundo RF - 100% Títulos do Tesouro Nacional
- Fundo RF - Referenciado
- Fundo RF - Geral
- Fundo RF - FIDC - Direitos Creditórios
- Fundo RV - Ações 50+ Ativos
- Fundo RV - Ações Geral
- Fundo RV - Multimercado
- Fundo RV - FIP - Participações
- Fundo RV - FII - Imobiliário

ACOMPANHAMENTO DE RECURSOS NO ANO DE 2018

| Período | Recursos (R\$) | Contribuição (R\$) | Rentabilidade no Mês | Crescimento do P.L. | Rendimento Mensal | Rend. Medio Trimestral | Rendim. Semestral |
|-----------|------------------|--------------------|----------------------|---------------------|-------------------|------------------------|-------------------|
| Janeiro | 1.865.673.156,61 | 14.586.779,72 | 56.363.969,32 | 3,47% | 3,13% | - | - |
| Fevereiro | 1.870.833.243,59 | 14.560.576,42 | 1.925.662,96 | 0,28% | -0,10% | - | - |
| Março | | | | | | | |
| Abril | | | | | | | |
| Maio | | | | | | | |
| Junho | | | | | | | |
| Julho | | | | | | | |
| Agosto | | | | | | | |
| Setembro | | | | | | | |
| Outubro | | | | | | | |
| Novembro | | | | | | | |
| Dezembro | | | | | | | |

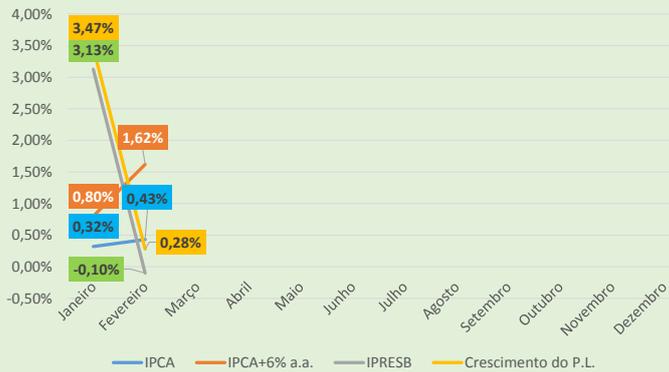
DESEMPENHO E INDICADORES

| MÊS | IPCA | | IPCA+6% a.a. | | IPRESB | | |
|-----------|--------|-----------|--------------|-----------|--------|-----------|---------------|
| | MENSAL | ACUMULADO | MENSAL | ACUMULADO | MENSAL | ACUMULADO | RENTAB. MÉDIA |
| Janeiro | 0,32% | 0,32% | 0,80% | 0,80% | 3,13% | 3,13% | 3,13% |
| Fevereiro | 0,43% | 0,75% | 0,82% | 1,62% | -0,10% | 3,75% | 1,51% |
| Março | | | | | | | |
| Abril | | | | | | | |
| Maio | | | | | | | |
| Junho | | | | | | | |
| Julho | | | | | | | |
| Agosto | | | | | | | |
| Setembro | | | | | | | |
| Outubro | | | | | | | |
| Novembro | | | | | | | |
| Dezembro | | | | | | | |

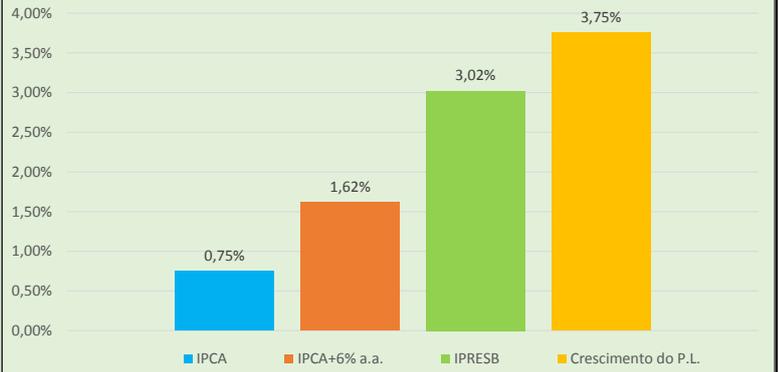
INDICADORES DE REFERÊNCIA

| INDICADOR | MÊS | ACUMULADO | ANO (Previsto) |
|--------------|--------|-----------|----------------|
| IBOVESPA | 10,82% | 10,82% | - |
| CDI | 0,54% | 0,54% | - |
| IPCA+6% a.a. | 0,82% | 1,62% | 10,03% |

Comparativo de Rentabilidades



Acompanhamento de Variação



RESUMO DAS INFORMAÇÕES

| | |
|---|----------------------|
| RECURSO INICIAL EM JANEIRO 2018 | R\$ 1.803.186.674,91 |
| TOTAL DE RECURSOS INVESTIDOS | R\$ 1.870.833.343,59 |
| TOTAL DAS CONTRIBUIÇÕES 2018 | R\$ 29.147.356,14 |
| TOTAL DE RENDIMENTOS 2019 | R\$ 54.438.306,36 |
| VARIAÇÃO AUMENTATIVA DO P.L. | 3,75% |
| META ATUARIAL IPCA+6% a.a. | 10,03% |
| RENDIMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS EM % 2019 | 3,02% |
| CUMPRIMENTO DA META ATUARIAL EM 2019 | 30,10% |

Observação: Este relatório visa dar publicidade a Carteira de Investimentos do IPRESB, contendo as informações referentes ao mês de Fevereiro/2019.

Com referencia aos fundos: 62 - INCENTIVO FIDC MULTISETORIAL II a empresa Gradual era a administradora, não recebemos o extrato atualizado, replicando o último disponível de 13/11/2018. 63 - ATICO FLORESTAL FIP Adm: BNY Mellon Serviços Financeiros não nos enviaram extrato atualizado.