

Relatório de Análise, Enquadramento, Rentabilidade e Risco - 29/02/2020

Retorno e Meta Atuarial - Fevereiro de 2020

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) | 18.750.049,03 | 0,36% | 67.756,25 | 19.528.610,58 | Art. 7º, I, b |
| 10.740.670/0001-06 | 22 - CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF (BENEF) | 214.637.430,35 | 0,36% | 820.975,94 | 226.657.497,96 | |
| 21.919.953/0001-28 | 96 - CAIXA TITULOS PUBLICOS 2020 | 23.618.248,08 | 0,25% | 58.240,46 | 23.042.289,88 | |
| 13.327.340/0001-73 | 100 - BB PREVID RF IMA-B 5+ | 347.408.825,44 | 0,30% | 1.038.862,76 | 348.447.688,20 | |
| 10.577.503/0001-88 | 122 - CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ TP RF LP | 283.262.324,48 | 0,29% | 825.412,24 | 284.087.736,72 | |
| 10.922.432/0001-03 | 135 - ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RF | 47.018.061,07 | 0,62% | 290.970,90 | 47.309.031,97 | |
| 10.756.541/0001-06 | 144 - ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO LONGA FI RF | 93.603.089,00 | 0,28% | 265.783,60 | 93.868.872,60 | |
| 19.418.031/0001-95 | 134 - ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RF LP | 30.730.394,58 | 0,83% | 255.459,71 | 30.985.854,29 | |
| SUBTOTAL | | 1.059.028.422,03 | | 3.623.461,86 | 1.073.927.582,20 | |
| 13.594.673/0001-69 | 94 - TMJ IMA-B FI RF | 13.527.366,43 | 0,85% | 115.273,84 | 13.642.640,27 | Art. 7º IV, a |
| 21.838.150/0001-49 | 103 - ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FIC FI | 318.269.089,08 | 0,26% | 819.949,02 | 319.089.038,10 | |
| 26.507.132/0001-06 | 147 - SANTANDER RENDA FIXA ATIVO FIC FI | 30.229.002,39 | 0,27% | 80.397,74 | 30.309.400,13 | |
| SUBTOTAL | | 362.025.457,90 | | 1.015.620,60 | 363.041.078,50 | |
| 13.344.834/0001-66 | 62 - INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II | 6.698.895,24 | -0,10% | (6.626,53) | 6.692.268,71 | Art. 7º, VII, a |
| 17.013.985/0001-92 | 106 - FIDC GGR Prime I | 30.795.006,92 | -0,56% | 2.230.832,07 | 28.221.859,35 | |
| SUBTOTAL | | 37.493.902,16 | | (177.784,28) | 34.914.128,06 | |
| TOTAL RENDA FIXA | | 1.458.547.782,09 | | 4.461.298,18 | 1.471.882.788,76 | |

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 | 105.272.715,58 | -8,98% | (9.451.133,02) | 95.821.582,56 | Art. 8º, I, a |
| 03.394.711/0001-86 | 132 - BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS | 32.849.562,27 | -8,42% | (2.767.402,95) | 30.082.159,32 | |
| 06.224.719/0001-92 | 146 - ICATU VANGUARDA AÇÕES IBX FUNDO DE INVESTIMENTO | 22.049.964,17 | -8,40% | (1.851.149,11) | 20.198.815,06 | |
| SUBTOTAL | | 160.172.242,02 | | (14.069.685,08) | 146.102.556,94 | |
| 11.392.165/0001-72 | 123 - AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA | 100.999.735,62 | -6,19% | (6.254.656,61) | 94.745.079,01 | Art. 8º, II, a |
| 23.731.629/0001-07 | 133 - ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES PHOENIX FIC DE FI | 102.285.519,19 | -9,27% | (9.477.877,80) | 92.807.641,39 | |
| 11.628.883/0001-03 | 138 - OCCAM FIC FIA | 74.830.888,81 | -9,52% | (7.122.407,16) | 67.708.481,65 | |
| 08.279.304/0001-41 | 145 - ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA | 173.628.889,00 | -7,00% | (12.155.939,93) | 161.472.949,07 | |
| 34.791.108/0001-61 | 148 - AZ QUEST SMALL CAPS RPPS FIC FIA | 15.205.833,47 | -6,01% | (913.603,19) | 14.292.230,28 | |
| SUBTOTAL | | 466.950.866,09 | | (35.924.484,69) | 431.026.381,40 | |
| 03.737.188/0001-43 | 137 - CAIXA FI MULTIMERCADO RV30 L P | 39.883.258,64 | -2,41% | (961.246,60) | 38.922.012,04 | Art. 8º, III |
| 10.418.362/0001-50 | 139 - BB PREV MULTIMERCADO FDO DE INVEST LONGO PRAZO | 16.871.439,47 | 0,18% | 29.702,42 | 16.901.141,89 | |
| 15.578.417/0001-03 | 142 - OCCAM INSTITUCIONAL FIM II | 5.488.263,76 | 0,07% | 3.839,96 | 5.492.103,72 | |
| 26.269.692/0001-61 | 143 - ITAÚ PRIVATE MULTIMERCADO S&P500 | 43.369.550,28 | -7,54% | (3.270.224,04) | 40.099.326,24 | |
| 0 | | 105.612.512,15 | | (4.197.928,26) | 101.414.583,89 | |
| 12.312.767/0001-35 | 63 - BRASIL FLORESTAL - FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÃO | 7.908.364,40 | -0,11% | (8.984,26) | 7.899.380,14 | Art. 8º, IV, a |
| 16.676.620/0001-85 | 66 - FIP CAIXA CYRELA | 4.000.983,72 | -0,09% | (3.556,18) | 3.997.427,54 | |
| 14.584.094/0001-06 | 67 - BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC FIP | 6.803.209,19 | 14,19% | 1.767.071,89 | 7.768.437,48 | |
| 15.711.367/0001-90 | 88 - W7 FIP | 15.343.562,89 | -0,14% | (21.689,39) | 15.321.873,50 | |
| 14.721.044/0001-15 | 121- INFRA SETORIAL FUNDO DE INVESTIMENTOS EM PARTICIPAÇÃO | 15.235.620,86 | -0,15% | (22.107,56) | 15.213.513,30 | |
| 27.782.774/0001-78 | 136 - KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULT | 5.117.299,44 | 22,34% | 1.143.277,75 | 6.260.577,19 | |
| SUBTOTAL | | 54.409.040,50 | | 2.052.168,65 | 56.461.209,15 | |
| 12.887.506/0001-43 | 37 - CAIXA FII CX TRX | 390.680,00 | -1,71% | (6.680,00) | 384.000,00 | Art. 8º, IV, b |
| 14.423.780/0001-97 | 44 - ITAÚ - FII KII REAL | 2.205.838,00 | -1,91% | (42.198,64) | 2.163.639,36 | |
| 18.369.510/0001-04 | 80 - FII INFRA REAL ESTATE FII | 20.441.290,13 | 0,73% | 148.305,69 | 20.589.595,82 | |
| 15.461.076/0001-91 | 105 - FII BR HOTEIS | 16.336.409,68 | -0,06% | (9.662,31) | 16.326.747,37 | |
| SUBTOTAL | | 39.374.217,81 | | 89.764,74 | 39.463.982,55 | |
| TOTAL RENDA VARIÁVEL | | 826.518.878,57 | | - 52.050.164,64 | 774.468.713,93 | |

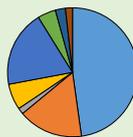
CONTA CORRENTE

| Número | Descrição | Saldo Anterior (R\$) | Saldo Atual (R\$) |
|---|--|-------------------------|---|
| 16-9 | Caixa Econômica Federal - 00.360.305/0001-04 | 9.590,36 | 29.123,23 |
| 15-0 | Caixa Econômica Federal - 00.360.305/0001-04 | 100,00 | 100,00 |
| 33888-1 | Itaú Unibanco - 60.701.190/0001-03 | - | - |
| 79680-7 | Itaú Unibanco - 60.701.190/0001-04 | 24.057,08 | 7.636,40 |
| 40104-8 | Banco do Brasil - 00.000.000/0001-91 | - | - |
| 98300-4 | Banco Bradesco - 60.746.948/0001-12 | 100,00 | 100,00 |
| 130003250-0 | Banco Santander - 90.400.888/0001-42 | 100,01 | 100,06 |
| | | 33.947,45 | 37.059,69 |
| Total de Recursos (Mês Anterior) | | 2.285.100.608,11 | CRESCIMENTO DA CARTEIRA NO MÊS DE FEVEREIRO/2020 |
| Total de Recursos (Mês Atual) | | 2.246.388.562,38 | -1,69% |

Retorno e Meta Atuarial - Fevereiro de 2020

| Enquadramento da Resolução CMN nº 3.922 | Enquadramento | % da Carteira |
|---|---------------------|---------------|
| Fundo RF - 100% Títulos do Tesouro Nacional | Artigo 7º, I, "b" | 47,81% |
| Fundo RF - Geral | Artigo 7º, IV, "a" | 16,16% |
| Fundo RF - FIDC - Direitos Creditórios | Artigo 7º, VII, "a" | 1,55% |
| Fundo RV - Ações 50+ Ativos | Artigo 8º, I, "a" | 6,50% |
| Fundo RV - Ações Geral | Artigo 8º, II, "a" | 19,19% |
| Fundo RV - Multimercado | Artigo 8º, III | 4,51% |
| Fundo RV - FIP - Participações | Artigo 8º, IV, "a" | 2,51% |
| Fundo RV - FII - Imobiliário | Artigo 8º, IV, "b" | 1,76% |

% da Carteira



- Fundo RF - 100% Títulos do Tesouro Nacional
- 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 2020

| Período | Recursos (R\$) | Contribuição (R\$) | Rentabilidade no Mês | Crescimento do P.L. - (acum) | Rendimento Mensal | Rend Medio Trimestral | Rendim. Semestral |
|-----------|----------------------|--------------------|----------------------|------------------------------|-------------------|-----------------------|-------------------|
| Janeiro | R\$ 2.285.100.608,11 | R\$ 15.916.944,65 | R\$ 10.000.854,69 | 0,79% | 0,44% | | |
| Fevereiro | R\$ 2.246.388.562,38 | R\$ 15.848.374,30 | -R\$ 44.385.033,04 | -1,69% | -1,94% | - | - |
| Março | | | | | | | |
| Abril | | | | | | | |
| Maio | | | | | | | |
| Junho | | | | | | | |
| Julho | | | | | | | |
| Agosto | | | | | | | |
| Setembro | | | | | | | |
| Outubro | | | | | | | |
| Novembro | | | | | | | |
| Dezembro | | | | | | | |

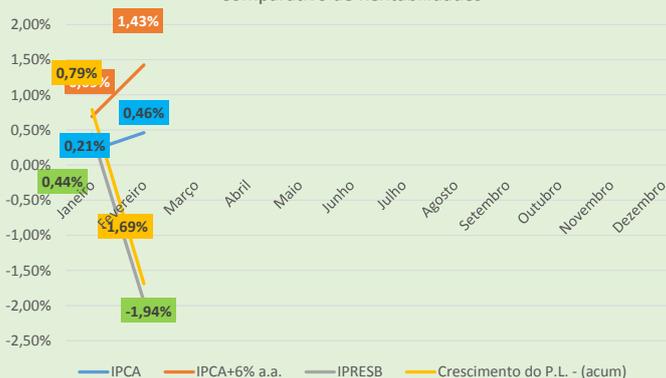
DESEMPENHO E INDICADORES

| MÊS | IPCA | | IPCA+6% a.a. | | IPRESB | | |
|-----------|--------|-----------|--------------|-----------|--------|-----------|---------------|
| | MENSAL | ACUMULADO | MENSAL | ACUMULADO | MENSAL | ACUMULADO | RENTAB. MÉDIA |
| Janeiro | 0,21% | 0,21% | 0,69% | 0,69% | 0,44% | 0,44% | 0,44% |
| Fevereiro | 0,25% | 0,46% | 0,73% | 1,43% | -1,94% | -1,51% | -0,75% |
| Março | | | | | | | |
| Abril | | | | | | | |
| Maio | | | | | | | |
| Junho | | | | | | | |
| Julho | | | | | | | |
| Agosto | | | | | | | |
| Setembro | | | | | | | |
| Outubro | | | | | | | |
| Novembro | | | | | | | |
| Dezembro | | | | | | | |

INDICADORES DE REFERÊNCIA

| INDICADOR | MÊS | ACUMULADO | ANO (Previsto) |
|--------------|--------|-----------|----------------|
| IBOVESPA | -8,43% | -9,92% | - |
| CDI | 0,29% | 0,67% | - |
| IPCA+6% a.a. | 0,73% | 1,43% | 9,60% |

Comparativo de Rentabilidades



Acompanhamento de Variação



RESUMO DAS INFORMAÇÕES

| | |
|---|----------------------|
| RECURSO INICIAL EM JANEIRO 2020 | R\$ 2.267.267.269,68 |
| TOTAL DE RECURSOS INVESTIDOS | R\$ 2.246.388.562,38 |
| TOTAL DAS CONTRIBUIÇÕES 2020 | R\$ 31.765.318,95 |
| TOTAL DE RENDIMENTOS 2020 | -R\$ 34.384.178,35 |
| VARIAÇÃO AUMENTATIVA DO P.L. | -0,92% |
| META ATUARIAL IPCA+6% a.a. | 9,60% |
| RENDIMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS EM % 2020 | -1,51% |
| CUMPRIMENTO DA META ATUARIAL EM 2020 | -15,73% |

Obs: Este relatório visa dar publicidade a Carteira de Investimentos do IPRESB, contendo as informações referentes ao mês de Fevereiro/2020.