



Relatório de Análise, Enquadramento, Rentabilidade - 28/02/2022

Retorno e Meta Atuarial - Fevereiro de 2022

RENDA FIXA

Ativo			Rentabilidade						Enquad.
CNPJ	FUNDO	Valor Anterior	Mês	Aplicação	Resgate	CUPOM/DIV	Rentabilidade	Valor do Mês	Enquad.
	LFT - SET/2022	R\$ 25.568.712,75	0,59%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 151.571,00	R\$ -	Art. 7º, I,
	NTN-B (IPCA + 5,34%)	R\$ 1.243.187.732,85	-0,17%	R\$ 38.056.783,40	R\$ -	R\$ 15.772.466,92	R\$ (2.164.679,97)	R\$ 1.279.079.836,28	a
	SUBTOTAL	R\$ -		R\$ 38.056.783,40	R\$ -	R\$ 15.772.466,92	R\$ (2.013.108,97)	R\$ 1.279.079.836,28	
23.215.097/0001-55	113 - CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 21.412.922,32	0,78%	R\$ -	R\$ 21.579.353,03	R\$ -	R\$ 166.430,71	R\$ -	Art. 7º, I, b
10.577.519/0001-90	116 - CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP	R\$ 192.428.014,13	0,45%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 866.154,44	R\$ 193.294.168,57	
19.418.031/0001-95	134 - ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RF L	R\$ 22.841.882,74	0,41%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 92.553,10	R\$ 22.934.435,84	
05.164.358/0001-73	165 - FI CAIXA ALIANÇA TIT PUB RF - BENEF (I	R\$ 22.023.312,03	1,32%	R\$ 57.771.989,65	R\$ 26.184.737,34	R\$ -	R\$ 290.508,34	R\$ 53.901.072,68	
05.164.358/0001-73	183 - FI CAIXA ALIANÇA TIT PUB RF - ADM (I	R\$ 36.515.646,11	0,73%	R\$ 1.447.350,40	R\$ 712.949,24	R\$ -	R\$ 265.252,07	R\$ 37.515.299,34	
	SUBTOTAL	R\$ 295.221.777,33		R\$ 59.219.340,05	R\$ 48.477.039,61	R\$ -	R\$ 1.680.898,66	R\$ 307.644.976,43	
13.594.673/0001-69	94 - TMJ IMA-B FI RF	R\$ 4.082.998,24	0,37%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 15.206,34	R\$ 4.033.555,25	Art. 7º IV, a
	SUBTOTAL	R\$ 4.082.998,24		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 15.206,34	R\$ 4.033.555,25	
13.344.834/0001-66	62 - INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II	R\$ (9.660.369,14)	0,10%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 9.230,06	R\$ (9.651.139,08)	Art. 7º,
17.013.985/0001-92	106 - FIDC GGR PRIME I	R\$ 22.241.214,59	-0,09%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (19.269,96)	R\$ 22.221.944,63	VII, a
	SUBTOTAL	R\$ 12.580.845,45		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (10.039,90)	R\$ 12.570.805,55	
	TOTAL RENDA FIXA	R\$ 1.580.642.066,62		R\$ 97.276.123,45	R\$ 48.477.039,61	R\$ 15.772.466,92	R\$ (327.043,87)	R\$ 1.603.329.173,51	

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\$ 85.018.193,66	-1,47%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (1.252.718,45)	R\$ 83.765.475,21	Art. 8º, II, a	
11.628.883/0001-03	138 - OCCAM FIC FIA	R\$ 108.078.786,14	1,05%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 1.132.770,72	R\$ 109.211.556,86		
34.791.108/0001-61	148 - AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONA	R\$ 39.024.927,20	-1,31%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (511.879,51)	R\$ 38.513.047,69		
11.977.794/0001-64	149 - BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONA	R\$ 3.950.311,37	-2,08%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (82.332,69)	R\$ 3.867.978,68		
08.621.010/0001-56	150 - BRASIL PLURAL ESTRATÉGIA FIC FIA	R\$ 5.060.719,81	0,21%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 10.659,37	R\$ 5.071.379,18		
30.068.169/0001-44	160 - FIC FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUA	R\$ 44.772.819,99	-0,38%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (170.952,17)	R\$ 44.601.867,82		
09.005.805/0001-00	162 - BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	R\$ 38.164.353,75	-2,55%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (972.870,19)	R\$ 37.191.483,56		
36.178.569/0001-99	167 - BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	R\$ 19.613.514,56	-2,56%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (502.593,67)	R\$ 19.110.920,89		
SUBTOTAL		R\$ 343.683.626,48		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (2.349.916,59)	R\$ 341.333.709,89		
26.269.692/0001-61	143 - ITAU PRIVATE MULTIMERCADO S&P500	R\$ 83.543.319,13	-2,18%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (1.824.335,62)	R\$ 81.718.983,51		Art. 8º III
30.036.235/0001-02	158 - FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA M	R\$ 89.124.794,39	-2,09%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (1.866.671,34)	R\$ 87.258.123,05		
17.453.850/0001-48	159 - WESTERN ASSET US INDEX 500 FIM	R\$ 47.249.379,76	-2,09%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (987.077,44)	R\$ 46.262.302,32		
36.499.594/0001-74	166 - BTG PACTUAL S&P 500 BRL FIM	R\$ 9.793.489,95	-2,12%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (207.723,41)	R\$ 9.585.766,54		
SUBTOTAL		R\$ 229.710.983,23		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (4.885.807,81)	R\$ 224.825.175,42		
12.312.767/0001-35	63 - BRASIL FLORESTAL - FUNDO DE INVESTIM	R\$ 9.316.087,03	-0,03%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (2.656,53)	R\$ 9.313.430,50	Art. 8º, IV, a	
14.584.094/0001-06	67 - BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC FIP	R\$ 9.354.549,39	1,70%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 159.305,18	R\$ 9.513.854,57		
15.711.367/0001-90	88 - W7 FIP	R\$ 15.341.584,24	-0,11%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (16.785,13)	R\$ 15.324.799,11		
14.721.044/0001-15	121 - INFRA SETORIAL FUNDO DE INVESTIME	R\$ 22.190.089,15	-0,02%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (4.649,57)	R\$ 22.185.439,58		
27.782.774/0001-78	136 - KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTI	R\$ 9.958.007,66	23,63%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 2.353.302,80	R\$ 10.193.503,56		
SUBTOTAL		R\$ 66.160.317,47		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 2.488.516,75	R\$ 66.531.027,32		
12.887.506/0001-43	37 - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	R\$ 309.970,00	-6,12%	R\$ -	R\$ -	R\$ 791,07	R\$ (18.970,00)	R\$ 291.000,00	Art. 8º, IV, b	
14.423.780/0001-97	44 - ITAU - FII KII REAL	R\$ 579.272,24	10,25%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 59.397,46	R\$ 349.097,84		
18.369.510/0001-04	80 - FII INFRA REAL ESTATE FII	R\$ 7.526.342,00	1,51%	R\$ -	R\$ -	R\$ 4.907,91	R\$ 113.860,80	R\$ 7.548.860,49		
15.461.076/0001-91	105 - FII BR HOTÉIS	R\$ 15.244.027,75	-0,01%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (2.026,84)	R\$ 15.242.000,91		
SUBTOTAL		R\$ 23.659.611,99		R\$ -	R\$ -	R\$ 5.698,98	R\$ 152.261,42	R\$ 23.430.959,24		
37.308.394/0001-50	155 - SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES C	R\$ 59.117.011,86	-5,52%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (3.261.172,22)	R\$ 55.855.839,64	Art. 9º, I	
37.331.365/0001-09	156 - GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 42.157.837,22	-7,99%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (3.367.133,04)	R\$ 38.790.704,18		
17.804.792/0001-50	196 - SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR M	R\$ 27.683.453,67	-5,29%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (1.464.419,14)	R\$ 26.219.034,53		
SUBTOTAL		R\$ 128.958.302,75		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (8.092.724,40)	R\$ 120.865.578,35		
17.502.937/0001-68	153 - CAIXA FI AÇÕES INSTITUCIONAL BDR NÍ	R\$ 67.505.452,61	-7,12%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (4.804.243,99)	R\$ 62.701.208,62	Art. 9º, II	
SUBTOTAL		R\$ 67.505.452,61		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (4.804.243,99)	R\$ 62.701.208,62		
TOTAL RENDA VARIÁVEL		R\$ 859.678.294,53		R\$ -	R\$ -	R\$ 5.698,98	R\$ (17.491.914,62)	R\$ 839.687.658,84		

CONTA CORRENTE				
Número	Descrição	Saldo Anterior	Saldo Atual	
15-0	Caixa Econômica Federal - 00.360.305/0001-0	R\$ 100,00	R\$ 100,00	
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\$ 120,75	R\$ 19.710,04	
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\$ -	R\$ -	
130003250-0	Banco Santander - 90.400.888/0001-42	R\$ 100,00	R\$ 100,00	
843404	CONTA CORRENTE - XP	R\$ 100,03	R\$ 100,02	
Total Conta Corrente		R\$ 10.468,53	R\$ 30.057,81	
Total de Recursos		R\$ 2.440.330.829,68	R\$ 2.443.046.890,16	CRESCIMENTO DA CARTEIRA NO MÊS
				0,11%

Este relatório visa dar publicidade à Carteira de Investimentos do IPRESB, contendo as informações do mês. A rentabilidade das NTN-B aparecem como negativo por motivo do recebimento de CUPON's, lançamento para ajuste de saldos contábeis.

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, "a"	52,36%	100,00% / 25,00%	 <ul style="list-style-type: none"> Fundo RF - 100% Títulos do Tesouro Nacional 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 - 100% Títulos do Tesouro Nacional	Artigo 7º, I, "b"	12,59%	100,00% / 25,00%	
Fundo RF - Geral	Artigo 7º, IV, "a"	0,17%	40,00% / 2,00%	
Fundo RF - FIDC - Direitos Creditórios	Artigo 7º, VII, "a"	0,51%	5,00% / 1,00%	
Fundo RV - Ações Geral	Artigo 8º, II, "a"	13,97%	20,00% / 15,20%	
Fundo RV - Multimercado	Artigo 8º, III	9,20%	10,00% / 10,00%	
Fundo RV - FIP - Participações	Artigo 8º, IV, "a"	2,72%	5,00% / 2,50%	
Fundo RV - FII - Imobiliário	Artigo 8º, IV, "b"	0,96%	5,00% / 1,30%	
Fundo RV - Investimentos no Exterior	Artigo 9º, II	4,95%	10,00% / 8,00%	
Fundo RV - Investimentos no Exterior	Artigo 9º, III	2,57%	10,00% / 2,00%	

ACOMPANHAMENTO DE RECURSOS NO ANO DE 2022

Período	Recursos	Contribuições	Comprev	Rentabilidade Mensal	Crescimento P.L. - (mensal)	Rend Médio Trimestral	Rendim. Semestral
Janeiro	R\$ 2.440.330.829,68	R\$ 18.149.918,22	R\$ 42.351,68	(25.451.055,26)	-0,94%	-	-
Fevereiro	R\$ 2.443.046.890,16	R\$ 17.990.403,54	R\$ 42.351,68	(2.040.792,59)	0,11%	-	-
Março							
Abril							
Maio							
Junho							
Julho							
Agosto							
Setembro							
Outubro							
Novembro							
Dezembro							

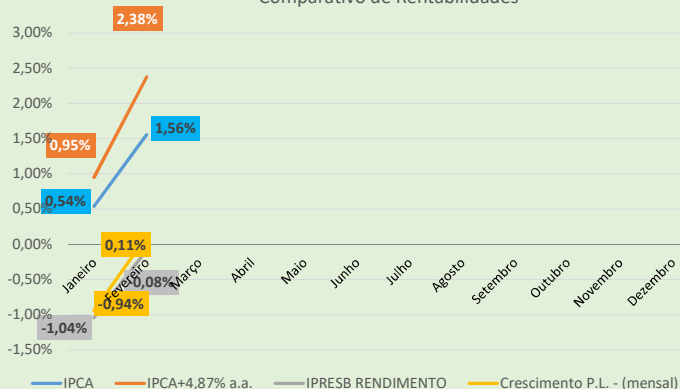
DESEMPENHO E INDICADORES

MÊS	IPCA		IPCA+4,87% a.a.		IPRESB RENDIMENTO		
	MENSAL	ACUMULADO	MENSAL	ACUMULADO	RENDIMENTO MENSAL	ACUMULADO	RENTAB. MÉDIA
Janeiro	0,54%	0,54%	0,95%	0,95%	-1,04%	-1,04%	-1,04%
Fevereiro	1,01%	1,56%	1,42%	2,38%	-0,08%	-1,12%	-0,56%
Março							
Abril							
Maio							
Junho							
Julho							
Agosto							
Setembro							
Outubro							
Novembro							
Dezembro							

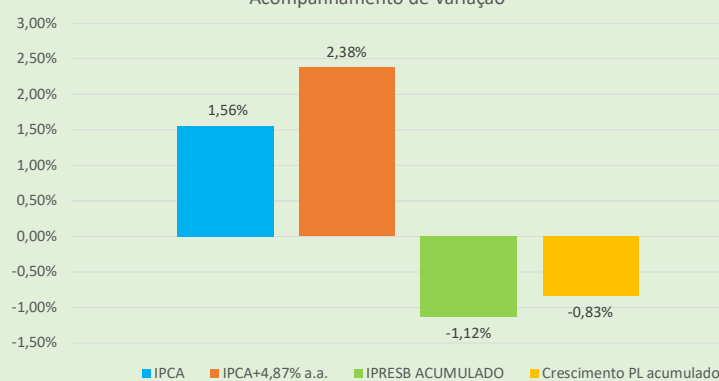
INDICADORES DE REFERÊNCIA

INDICADOR	MÊS	ACUMULADO	ANO (Previsto)
IBOVESPA	1,46%	8,43%	IPCA+4,87% a.a.
CDI	0,75%	1,49%	
IPCA a.a.	1,01%	1,56%	

Comparativo de Rentabilidades



Acompanhamento de Variação



RESUMO DAS INFORMAÇÕES

RECURSO INICIAL EM JANEIRO 2022	R\$ 2.463.520.920,67
TOTAL DE RECURSOS INVESTIDOS + SALDO EM CONTA CORRENTE	R\$ 2.443.046.890,16
TOTAL DAS CONTRIBUIÇÕES	R\$ 36.140.321,76
TOTAL DE RENDIMENTOS	R\$ (27.491.847,85)
VARIAÇÃO AUMENTATIVA DO P.L.	-0,83%
META ATUARIAL 4,87% + 6,59 % (Boletim Focus 21/03/2022)	11,46%
RENDIMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS EM %	-1,12%
CUMPRIMENTO DA META ATUARIAL	-9,74%

Este relatório visa dar publicidade à Carteira de Investimentos do IPRESB, contendo as informações do mês. A rentabilidade das NTN-B aparecem como negativo por motivo do recebimento de CUPON's, lançamento para ajuste de saldos contábeis.

O Instituto possui contrato com a empresa LDB Consultoria Financeira Ltda – EPP, para prestação de serviços de consultoria em investimentos, vigência: 01/2022 a 07/2022. Valor: R\$ 2.850,00 mensal (Dois mil oitocentos e cinquenta reais). Processo: nº 004/2022.