

Relatório de Análise, Enquadramento, Rentabilidade e Risco - 31/03/2021

Retorno e Meta Atuarial - Março de 2021

RENDA FIXA

Ativo			Rentabilidade						Enquad.
CNPJ	FUNDO	Valor Anterior	Mês	Aplicação	Resgate	CUPOM/DIVIDEN/	Rentabilidade	Valor do Mês	
10.740.670/0001-06	21 - CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF (ADM)	R\$ 27.842.331,16	0,00%	R\$ 1.417.971,33	R\$ 682.352,82	R\$ -	R\$ 3.199,06	R\$ 28.581.148,73	Art. 7º, I, b
10.740.670/0001-06	22 - CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF (BENEF)	R\$ 48.789.921,30	0,01%	R\$ 81.370.804,71	R\$ 95.624.449,57	R\$ -	R\$ 4.967,20	R\$ 34.541.243,64	
13.327.340/0001-73	100 - BB PREVID RF IMA-B 5+	R\$ 117.335.613,35	-1,19%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (1.395.560,66)	R\$ 115.940.052,69	
10.577.503/0001-88	122 - CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ TP RF LP	R\$ 169.273.509,24	-1,20%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (2.022.943,25)	R\$ 167.250.565,99	
10.922.432/0001-03	135 - ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA F	R\$ 89.899.465,97	0,28%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 255.119,18	R\$ 90.154.585,15	
10.756.541/0001-06	144 - ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO LONGA	R\$ 134.967.652,39	-1,21%	R\$ -	R\$ 15.000.000,00	R\$ -	R\$ (1.632.038,44)	R\$ 118.335.613,95	
19.418.031/0001-95	134 - ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RF LP	R\$ 53.898.537,18	-2,50%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (1.345.166,11)	R\$ 52.553.371,07	
10.577.519/0001-90	116 - CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP	R\$ 197.477.372,54	-1,49%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (2.939.764,15)	R\$ 194.537.608,39	
23.215.097/0001-55	113 - CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATEGICA	R\$ 222.405.174,22	0,30%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 669.549,27	R\$ 223.074.723,49	
SUBTOTAL		R\$ 1.061.889.577,35		R\$ 82.788.776,04	R\$ 111.306.802,39	R\$ -	R\$ (8.402.637,90)	R\$ 1.024.968.913,10	
13.594.673/0001-69	94 - TMJ IMA-B FI RF	R\$ 6.537.085,03	1,94%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 126.896,17	R\$ 5.791.215,12	Art. 7º IV, a
21.838.150/0001-49	103 - ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAM	R\$ 251.560.672,93	0,16%	R\$ 50.000.000,00	R\$ -	R\$ -	R\$ 402.215,28	R\$ 301.962.888,21	
26.507.132/0001-06	147 - SANTANDER RENDA FIXA ATIVO FIC FI	R\$ 61.039.049,42	0,09%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 55.508,22	R\$ 61.094.557,64	
SUBTOTAL		R\$ 319.136.807,38		R\$ 50.000.000,00	R\$ -	R\$ -	R\$ 584.619,67	R\$ 368.848.660,97	
13.344.834/0001-66	62 - INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II	R\$ -	0,00%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (81.901,65)	R\$ -	Art. 7º, VII, a
17.013.985/0001-92	106 - FIDC GGR Prime I	R\$ 24.936.812,77	0,15%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 36.852,02	R\$ 24.973.664,79	
SUBTOTAL		R\$ 24.936.812,77		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (45.049,63)	R\$ 24.973.664,79	
TOTAL RENDA FIXA		R\$ 1.405.963.197,50		R\$ 132.788.776,04	R\$ 111.306.802,39	R\$ -	R\$ (7.863.067,86)	R\$ 1.418.791.238,86	



Relatório de Análise, Enquadramento, Rentabilidade e Risco - 31/03/2021


Retorno e Meta Atuarial - Março de 2021

RENDA VARIÁVEL

Ativo		Rentabilidade							Enquad.
CNPJ	FUNDO	Valor Anterior (R\$)	Mês	Aplicação	Resgate	CUPOM/DIVIDEN	Rentabilidade (R\$)	Valor do Mês (R\$)	Enquad.
11.392.165/0001-72	123 - AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	R\$ 90.663.286,51	0,73%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 663.416,67	R\$ 91.326.703,18	Art. 8º, II, a
11.628.883/0001-03	138 - OCCAM FIC FIA	R\$ 108.857.410,52	3,94%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 4.283.681,32	R\$ 113.141.091,84	
08.279.304/0001-41	145 - ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 144.423.540,64	5,06%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 7.315.043,17	R\$ 151.738.583,81	
34.791.108/0001-61	148 - AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIO	R\$ 41.673.713,05	0,77%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 319.864,48	R\$ 41.993.577,53	
11.977.794/0001-64	149 - BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONA	R\$ 5.342.664,43	1,73%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 92.192,07	R\$ 5.434.856,50	
08.621.010/0001-56	150 - BRASIL PLURAL ESTRATÉGIA FIC FIA	R\$ 5.415.661,17	0,70%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 37.663,16	R\$ 5.453.324,33	
29.549.642/0001-26	157 - SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO A	R\$ 90.196.507,19	1,48%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 1.338.698,68	R\$ 91.535.205,87	
SUBTOTAL		R\$ 486.572.783,51		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 14.050.559,55	R\$ 500.623.343,06	
03.737.188/0001-43	137 - CAIXA FI MULTIMERCADO RV30 LP	R\$ 40.291.742,51	1,58%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 636.628,69	R\$ 40.928.371,20	Art. 8º, III
10.418.362/0001-50	139 - BB PREV MULTIMERCADO FDO DE INVE	R\$ 20.118.464,26	0,45%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 90.300,17	R\$ 20.208.764,43	
15.578.417/0001-03	142 - OCCAM INSTITUCIONAL FIM II	R\$ 5.644.365,55	0,20%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 11.561,79	R\$ 5.655.927,34	
26.269.692/0001-61	143 - ITAU PRIVATE MULTIMERCADO S&P500	R\$ 50.030.647,37	4,16%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 2.080.987,02	R\$ 52.111.634,39	
35.637.151/0001-30	151 - ICATU VANGUARDA LONG BIASED FIM	R\$ 1.085.891,38	0,64%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 6.941,07	R\$ 1.092.832,45	
SUBTOTAL		R\$ 117.171.111,07		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 2.826.418,74	R\$ 119.997.529,81	
12.312.767/0001-35	63 - BRASIL FLORESTAL - FUNDO DE INVESTIM	R\$ 9.398.364,41	-0,08%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (7.970,60)	R\$ 9.390.393,81	Art. 8º, IV, a
14.584.094/0001-06	67 - BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC FII	R\$ 12.713.795,61	-1,47%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (187.228,62)	R\$ 12.526.566,99	
15.711.367/0001-90	88 - W7 FIP	R\$ 15.755.357,87	-0,14%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (22.239,60)	R\$ 15.733.118,27	
14.721.044/0001-15	121 - INFRA SETORIAL FUNDO DE INVESTIME	R\$ 18.148.321,62	-0,10%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (18.866,92)	R\$ 18.129.454,70	
27.782.774/0001-78	136 - KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTI	R\$ 8.840.998,76	0,23%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 20.118,41	R\$ 8.861.117,17	
SUBTOTAL		R\$ 64.856.838,27		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (216.187,33)	R\$ 64.640.650,94	
12.887.506/0001-43	37 - CAIXA FII CX TRX	R\$ 353.620,00	0,67%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 2.380,00	R\$ 356.000,00	Art. 8º, IV, b
14.423.780/0001-97	44 - ITAU - FII KII REAL	R\$ 1.288.976,64	0,89%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 11.508,72	R\$ 1.300.485,36	
18.369.510/0001-04	80 - FII INFRA REAL ESTATE FII	R\$ 14.570.928,05	0,17%	R\$ -	R\$ -	R\$ 17.184,05	R\$ 41.412,14	R\$ 14.525.162,04	
15.461.076/0001-91	105 - FII BR HOTEIS	R\$ 15.775.682,81	-0,14%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (22.301,79)	R\$ 15.753.381,02	
SUBTOTAL		R\$ 31.989.207,50		R\$ -	R\$ -	R\$ 17.184,05	R\$ 15.815,02	R\$ 31.935.028,42	
34.246.525/0001-23	154 - SANTANDER GO NORTH AMERICAN EQU	R\$ 35.021.341,38	-6,44%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (2.256.720,44)	R\$ 32.764.620,94	Art. 9º, II
37.308.394/0001-50	155 - SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES	R\$ 38.091.754,02	2,62%	R\$ 20.000.000,00	R\$ -	R\$ -	R\$ 997.747,00	R\$ 59.089.501,02	
37.331.365/0001-09	156 - GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 75.721.324,37	-3,74%	R\$ 15.000.000,00	R\$ -	R\$ -	R\$ (2.830.727,85)	R\$ 87.890.596,52	
SUBTOTAL		R\$ 148.834.419,77		R\$ 35.000.000,00	R\$ -	R\$ -	R\$ (4.089.701,29)	R\$ 179.744.718,48	
17.502.937/0001-68	153 - CAIXA FI AÇÕES INSTITUCIONAL BDR NI	R\$ 95.720.735,22	2,50%	R\$ -	R\$ 50.000.000,00	R\$ -	R\$ 2.390.554,49	R\$ 48.111.289,71	Art. 9º, III
					R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	
					R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	
SUBTOTAL				R\$ -	R\$ 50.000.000,00	R\$ -	R\$ 2.390.554,49	R\$ 48.111.289,71	
TOTAL RENDA VARIÁVEL		R\$ 945.145.095,34		R\$ 35.000.000,00	R\$ 50.000.000,00	R\$ 17.184,05	R\$ 14.977.459,18	R\$ 945.052.560,42	

CONTA CORRENTE

Número	Descrição	Saldo Ant	Saldo Atual
15-0	Caixa Econômica Federal - 00.360.305/0001-0	R\$ 100,00	R\$ 1.870.413,11
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\$ 26.437,35
79680-7	Itaú Unibanco - 60.701.190/0001-04	R\$ 100,00	R\$ 30.064,38
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
		R\$ 10.425,86	R\$ 1.937.140,70
Total de Recursos (Mês Anterior)		R\$ 2.351.118.718,70	CRESCIMENTO DA CARTEIRA NO MÊS DE MARÇO/2021 0,62%
Total de Recursos (Mês Atual)		R\$ 2.365.780.939,98	

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"	43,32%	100% / 44%	 <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"	15,59%	40% / 14%	
Fundo RF - FIDC - Direitos Creditórios	Artigo 7º, VII, "a"	1,06%	5% / 2%	
Fundo RV - Ações Geral	Artigo 8º, II, "a"	21,16%	20% / 21%	
Fundo RV - Multimercado	Artigo 8º, III	5,07%	20% / 5%	
Fundo RV - FIP - Participações	Artigo 8º, IV, "a"	2,73%	20% / 3%	
Fundo RV - FII - Imobiliário	Artigo 8º, IV, "b"	1,35%	20% / 2%	
Fundo RV - Investimentos no Exterior	Artigo 9º, II	7,60%	10% / 6%	
Fundo RV - Investimentos no Exterior	Artigo 9º, III	2,03%	10% / 4%	

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%	
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\$ 7.148.759,42	0,62%	0,30%		
Abril					0,00%	-	
Maio					#DIV/0!		
Junho					#DIV/0!		
Julho					#DIV/0!	-	
Agosto					#DIV/0!		
Setembro					#DIV/0!		
Outubro					#DIV/0!	-	
Novembro					#DIV/0!		
Dezembro					#DIV/0!		

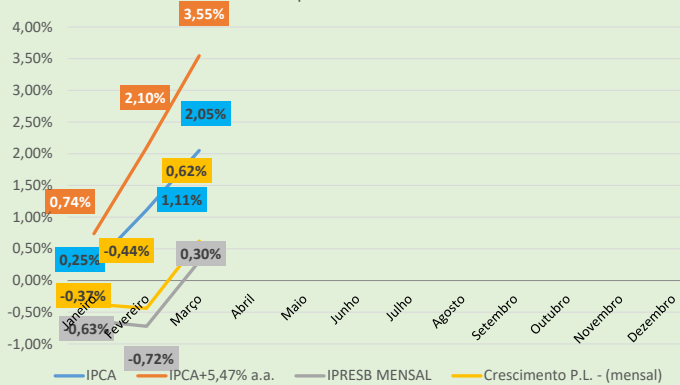
DESEMPENHO E INDICADORES

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%	-1,35%	-0,99%
Março	0,93%	2,05%	1,42%	3,55%	0,30%	-1,05%	-1,01%
Abril							
Maio							
Junho							
Julho							
Agosto							
Setembro							
Outubro							
Novembro							
Dezembro							

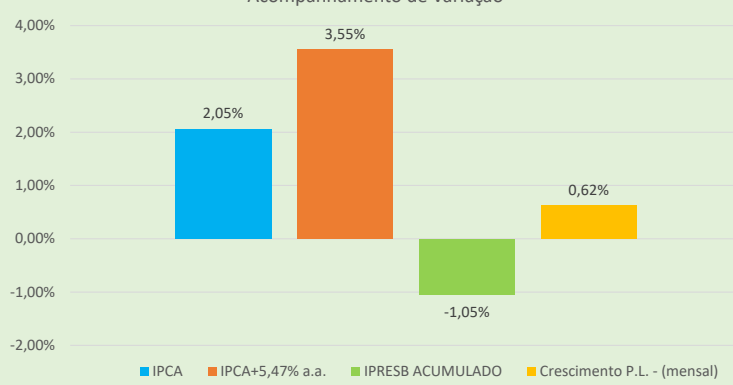
INDICADORES DE REFERÊNCIA

INDICADOR	MÊS	ACUMULADO	ANO (Previsto)
IBOVESPA	6,04%	-0,72%	
CDI	0,20%	0,48%	
IPCA+5,47% a.a.	0,93%	1,42%	8,94%

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\$ 2.365.780.939,98
TOTAL DAS CONTRIBUIÇÕES	R\$ 47.254.542,02
TOTAL DE RENDIMENTOS	R\$ (24.910.416,74)
VARIAÇÃO AUMENTATIVA DO P.L.	-0,19%
META ATUARIAL 5,47% + 3,47% (IPCA BOLETIM FOCUS, 22/11/2020)	8,94%
RENDIMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS EM %	-1,05%
CUMPRIMENTO DA META ATUARIAL	-11,76%

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