



Relatório de Análise, Enquadramento, Rentabilidade e Risco - 31/05/2019

Retorno e Meta Atuarial - Maio 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)	15.386.028,62	0,57%	106.544,51	16.911.529,29	Art. 7º, I, b
10.740.670/0001-06	22 - CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF (BENEF)	14.576.292,38	0,57%	177.998,54	26.829.437,11	
21.919.953/0001-28	96 - CAIXA TITULOS PUBLICOS 2020	23.039.350,30	0,54%	125.507,58	23.164.857,88	
18.687.230/0001-36	97 - ITAU INSTITUCIONAL TITULOS PUBLICOS RF FI	6.487.932,51	-2,65%	(171.949,98)	6.315.982,53	
14.386.926/0001-71	98 - CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	133.331.611,34	1,06%	1.418.319,86	134.749.931,20	
13.327.340/0001-73	100 - BB PREVID RF IMA-B 5+	220.308.190,37	1,75%	11.283.027,55	231.591.217,92	
10.396.381/0001-23	115 - ITAU INSTITUCIONAL RF PRE LP FICFI	23.112.415,22	1,75%	403.834,27	23.516.249,49	
10.577.519/0001-90	116 - CAIXA FI BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	184.241.747,62	2,12%	3.904.636,33	188.146.383,95	
07.111.384/0001-69	119 - BB PREV. IRF-M	151.426.089,34	1,75%	2.645.025,42	154.071.114,76	
10.577.503/0001-88	122 - CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ TP RF LP	252.823.534,87	5,11%	12.915.211,21	265.738.746,08	
<b>SUBTOTAL</b>		<b>1.024.733.192,57</b>		<b>32.808.155,29</b>	<b>1.071.035.450,21</b>	
13.594.673/0001-69	94 - TMJ IMA-B FI RF	12.250.942,10	3,38%	413.513,14	12.664.455,24	Art. 7º IV, a
21.838.150/0001-49	103 - ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FIC FI	19.896.617,77	12,24%	2.434.637,03	22.331.254,80	
25.306.703/0001-73	109 - ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA II RF FIC FI	194.933.877,75	0,73%	1.426.508,23	196.360.385,98	
19.418.031/0001-95	134 - ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RF LP	17.621.403,92	2,79%	492.281,55	18.113.685,47	
10.922.432/0001-03	135 - ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RF	43.040.692,33	1,40%	601.644,75	43.642.337,08	
10.756.541/0001-06	144 - ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO LONGA FI RF	45.891.800,94	#DIV/0!	2.359.677,87	48.251.478,81	
<b>SUBTOTAL</b>		<b>333.635.334,81</b>		<b>7.728.262,57</b>	<b>341.363.597,38</b>	
13.344.834/0001-66	62 - INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II	6.515.266,81	2,52%	164.054,46	6.679.321,27	Art. 7º, VII, a
23.431.871/0001-65	93 - TRX FIDC SENIOR	337.959,43	-10,25%	(34.634,69)	303.324,74	
17.013.985/0001-92	106 - FIDC GGR Prime I	33.212.305,12	0,94%	311.674,13	33.523.979,25	
<b>SUBTOTAL</b>		<b>40.065.531,36</b>		<b>441.093,90</b>	<b>40.506.625,26</b>	
<b>TOTAL RENTA FIXA</b>		<b>1.398.434.058,74</b>		<b>40.977.511,76</b>	<b>1.452.905.672,85</b>	

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	50.694.275,52	1,10%	558.103,62	51.252.379,14	Art. 8º, I, a
03.394.711/0001-86	132 - BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	27.876.281,30	0,68%	189.389,72	28.065.671,02	
<b>SUBTOTAL</b>		<b>78.570.556,82</b>		<b>747.493,34</b>	<b>79.318.050,16</b>	
11.392.165/0001-72	123 - AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	57.236.237,10	1,21%	693.246,04	57.929.483,14	Art. 8º, II, a
02.436.763/0001-05	130 - SANTANDER FIC FI SELEÇÃO TOP AÇÕES	11.437.125,13	1,32%	151.025,72	11.588.150,85	
07.279.657/0001-89	131 - AZ QUEST AÇÕES FIC FIA	53.106.842,25	0,48%	253.029,48	53.359.871,73	
23.731.629/0001-07	133 - ITAU INSTITUCIONAL AÇÕES PHOENIX FIC DE FI	77.202.878,47	2,45%	1.892.910,52	79.095.788,99	
11.628.883/0001-03	138 - OCCAM FIC FIA	25.322.712,37	1,08%	274.309,47	25.597.021,84	
03.168.062/0001-03	141 - ARX INCOME FIA	27.156.536,11	1,36%	369.244,88	27.525.780,99	
08.279.304/0001-41	145 - ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	20.709.857,39	#DIV/0!	482.520,50	21.192.377,89	
<b>SUBTOTAL</b>		<b>272.172.188,82</b>		<b>4.116.286,61</b>	<b>276.288.475,43</b>	
03.737.188/0001-43	137 - CAIXA FI MULTIMERCADO RV30 L P	22.182.032,04	0,70%	154.333,72	22.336.365,76	Art. 8º, III
10.418.362/0001-50	139 - BB PREV MULTIMERCADO FDO DE INVEST LONGO PRAZO	15.865.817,01	0,77%	122.874,72	15.988.691,73	
15.578.417/0001-03	142 - OCCAM INSTITUCIONAL FIM II	5.181.972,78	0,74%	38.408,34	5.220.381,12	
26.269.692/0001-61	143 - ITAU PRIVATE MULTIMERCADO S&P500	20.930.850,63	-6,45%	(1.349.774,09)	19.581.076,54	
<b>SUBTOTAL</b>		<b>64.160.672,46</b>		<b>(1.034.157,31)</b>	<b>63.126.515,15</b>	
12.312.767/0001-35	63 - ATICO FLORESTAL FIP	7.172.200,51	-0,16%	(11.356,64)	7.160.843,87	Art. 8º, IV, a
16.676.620/0001-85	66 - FIP CAIXA CYRELA	4.052.851,78	-0,10%	(4.164,60)	4.048.687,18	
14.584.094/0001-06	67 - BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC FIP	8.067.601,97	-0,10%	(7.981,45)	8.059.620,52	
15.711.367/0001-90	88 - W7 FIP	15.578.098,59	-0,17%	(26.922,94)	15.551.175,65	
14.721.044/0001-15	121 - INFRA SETORIAL FUNDO DE INVESTIMENTOS EM PARTICIP	15.353.477,33	0,06%	9.675,97	15.363.153,30	
27.782.774/0001-78	136 - KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP M	677.975,13	-2,29%	(15.557,39)	3.412.417,74	
<b>SUBTOTAL</b>		<b>50.902.205,31</b>		<b>(56.307,05)</b>	<b>53.595.898,26</b>	
12.887.506/0001-43	37 - CAIXA FII CX TRX	447.580,00	-8,13%	(36.380,00)	411.200,00	Art. 8º, IV, b
14.423.780/0001-97	44 - ITAU - FII KII REAL	3.337.528,80	1,40%	46.706,13	3.322.183,84	
18.369.510/0001-04	80 - FII INFRA REAL ESTATE FII	20.381.658,53	0,02%	4.671,52	20.386.330,05	
15.461.076/0001-91	105 - FII BR HOTEIS	16.397.381,89	-0,07%	(11.518,65)	16.385.863,24	
<b>SUBTOTAL</b>		<b>40.564.149,22</b>		<b>3.479,00</b>	<b>40.505.577,13</b>	
<b>TOTAL RENTA VARIÁVEL</b>		<b>506.369.772,63</b>		<b>3.776.794,59</b>	<b>512.834.516,13</b>	

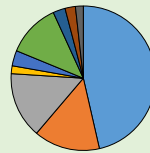
CONTA CORRENTE

Número	Descrição	Saldo Anterior (R\$)	Saldo Atual (R\$)
16-9	Caixa Econômica Federal - 00.360.305/0001-04	10.603,43	100,00
15-0	Caixa Econômica Federal - 00.360.305/0001-04		9.985,85
79680-7	Itaú Unibanco - 60.701.190/0001-04	65,53	31,40
40104-8	Banco do Brasil - 00.000.000/0001-91	89,82	89,82
98300-4	Banco Bradesco - 60.746.948/0001-12	100,00	100,00
130003250-0	Banco Santander - 90.400.888/0001-42	100,01	
<b>TOTAL RENTA CONTA CORRENTE</b>		<b>11.138,79</b>	<b>10.407,08</b>
<b>Total de Recursos (Mês Anterior)</b>		<b>1.904.814.970,16</b>	<b>CRESCIMENTO DA CARTEIRA NO MÊS DE Maio/2019</b> <b>3,20%</b>
<b>Total de Recursos (Mês Atual)</b>		<b>1.965.750.596,06</b>	

Retorno e Meta Atuarial - Maio de 2019

Enquadramento da Resolução CMN nº 3.922	Enquadramento	% da Carteira
Fundo RF - 100% Títulos do Tesouro Nacional	Artigo 7º, I, "b"	54,48%
Fundo RF - Referenciado	Artigo 7º, III, "a"	17,37%
Fundo RF - Geral	Artigo 7º, IV, "a"	17,37%
Fundo RF - FIDC - Direitos Creditórios	Artigo 7º, VII, "a"	2,06%
Fundo RV - Ações 50+ Ativos	Artigo 8º, I, "a"	4,04%
Fundo RV - Ações Geral	Artigo 8º, II, "a"	14,06%
Fundo RV - Multimercado	Artigo 8º, III	3,21%
Fundo RV - FIP - Participações	Artigo 8º, IV, "a"	2,73%
Fundo RV - FII - Imobiliário	Artigo 8º, IV, "b"	2,06%

% 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. - (acum)	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%	0,99%	
Fevereiro	1.870.833.243,59	14.560.576,42	1.925.662,96	3,75%	-0,10%		
Março	1.876.630.206,72	14.996.241,05	1.183.900,79	4,07%	-0,06%		
Abril	1.904.814.970,16	15.452.821,80	21.635.411,76	5,64%	1,15%	-	
Maio	1.965.750.596,06	15.767.068,09	44.754.306,35	9,02%	2,35%		
Junho							
Julho						-	
Agosto							
Setembro							
Outubro						-	
Novembro							
Dezembro							

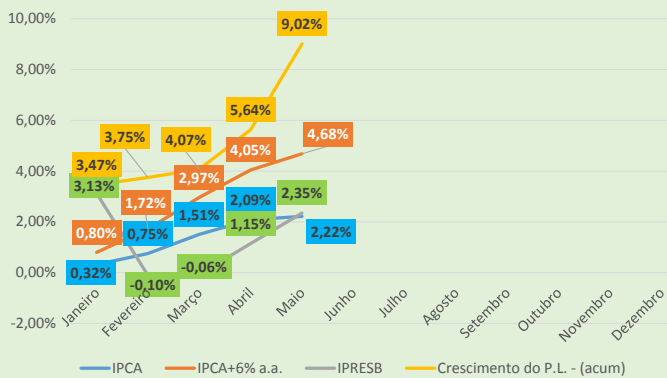
DESEMPENHO E INDICADORES

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%	0,91%	1,72%	-0,10%	3,02%	1,51%
Março	0,75%	1,51%	1,23%	2,97%	-0,06%	2,95%	0,99%
Abril	0,57%	2,09%	1,05%	4,05%	1,15%	4,14%	1,03%
Maio	0,13%	2,22%	0,61%	4,68%	2,35%	6,59%	1,29%
Junho							
Julho							
Agosto							
Setembro							
Outubro							
Novembro							
Dezembro							

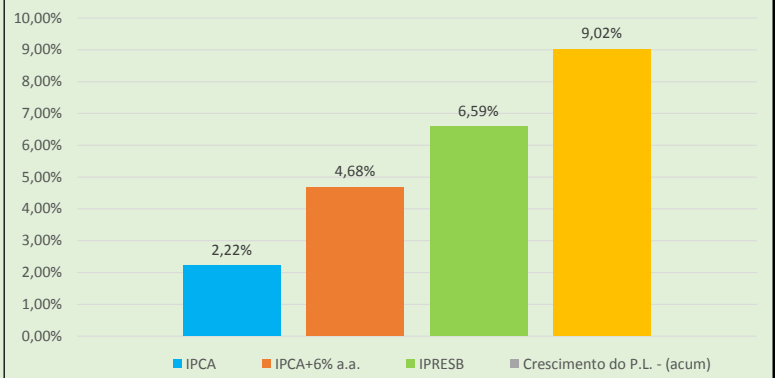
INDICADORES DE REFERÊNCIA

INDICADOR	MÊS	ACUMULADO	ANO (Previsto)
IBOVESPA	1,33%	11,73%	-
CDI	0,54%	2,59%	-
IPCA+6% a.a.	0,61%	4,68%	10,03%

Comparativo de Rentabilidades



Acompanhamento de Variação



RESUMO DAS INFORMAÇÕES

RECURSO INICIAL EM JANEIRO 2019	R\$ 1.803.186.674,91
TOTAL DE RECURSOS INVESTIDOS	R\$ 1.965.750.596,06
TOTAL DAS CONTRIBUIÇÕES 2019	R\$ 75.363.487,08
TOTAL DE RENDIMENTOS 2019	R\$ 119.644.123,68
VARIAÇÃO AUMENTATIVA DO P.L.	9,02%
META ATUARIAL IPCA+6% a.a.	10,03%
RENDIMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS EM % 2019	6,59%
CUMPRIMENTO DA META ATUARIAL EM 2019	65,66%

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