

Relatório de Análise, Enquadramento, Rentabilidade e Risco - 30/09/2018
Retorno e Meta Atuarial - Setembro de 2018

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)	14.576.494,23	0,59%	83.219,22	14.691.118,31	Art. 7º, I, b
10.740.670/0001-06	22 - CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF (BENEF)	47.444.461,53	0,59%	290.686,67	49.238.993,86	
21.919.953/0001-28	96 - CAIXA TITULOS PUBLICOS 2020	22.062.786,66	1,22%	269.017,84	22.331.804,50	
18.687.230/0001-36	97 - ITAU INSTITUCIONAL TITULOS PUBLICOS RF FI	6.370.081,13	0,90%	57.399,08	6.427.480,21	
14.386.926/0001-71	98 - CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	138.400.958,74	1,15%	1.594.811,02	139.995.769,76	
13.327.340/0001-73	100 - BB PREVID RF IMA-B 5+	87.806.448,65	-1,03%	(900.455,30)	86.905.993,35	
10.396.381/0001-23	115 - ITAÚ INSTITUCIONAL RF PRE LP FICFI	30.458.342,18	1,26%	383.400,92	30.841.743,10	
10.577.519/0001-90	116 - CAIXA FI BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	172.152.406,14	1,42%	2.447.657,29	174.600.063,43	
07.111.384/0001-69	119 - BB PREV. IRF-M	313.224.299,70	1,28%	4.011.910,20	317.236.209,90	
10.577.503/0001-88	122 - CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ TP RF LP	101.123.426,93	-1,04%	(1.046.866,34)	100.076.560,59	
13.455.197/0001-03	128 - SANTANDER FI IRF-M TITULOS PUBLICOS RF	86.022.875,91	1,28%	1.102.294,79	87.125.170,70	
SUBTOTAL		1.019.642.581,80		8.293.075,39	1.029.470.907,71	
13.594.673/0001-69	94 - TMJ IMA-B FI RF	12.702.396,68	-0,75%	(95.289,46)	12.607.107,22	
21.838.150/0001-49	103 - ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FIC FI	18.571.046,31	0,42%	77.410,29	18.648.456,60	
25.306.703/0001-73	109 - ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA II RF FIC FI	165.274.035,73	0,42%	689.602,34	165.963.638,07	
03.399.411/0001-90	125 - BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	36.020.924,36	0,47%	167.554,05	36.188.478,41	
19.418.031/0001-95	134 - ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RF LP	17.545.801,89	1,89%	331.816,59	18.877.618,48	
10.922.432/0001-03	135 - ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RF	20.376.592,32	0,85%	172.250,17	20.548.842,49	
SUBTOTAL		270.490.797,29		1.343.343,98	267.834.141,27	
13.344.834/0001-66	62 - INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II	6.562.549,32	0,00%	-	6.562.549,32	Art. 7º, VII, a
23.431.871/0001-65	93 - TRX FIDC SENIOR	315.174,06	0,46%	1.451,01	316.625,07	
17.013.985/0001-92	106 - FIDC GGR Prime I	33.687.635,16	-3,56%	(1.197.763,51)	32.489.871,65	
SUBTOTAL		40.565.358,54		(1.196.312,50)	39.369.046,04	
TOTAL RENTA FIXA		1.330.698.737,63		8.440.106,87	1.336.674.095,02	

RENTA VARIÁVEL

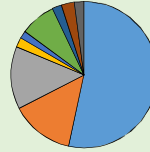
Ativo		Rentabilidade				Enquadramento
CNPJ	FUNDO	Valor Anterior (R\$)	Mês	Rentabilidade (R\$)	Valor do Mês (R\$)	
01.699.688/0001-02	129 - SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL AÇÕES	13.972.130,58	4,25%	594.073,72	19.566.204,30	Art. 8º, I, a
03.394.711/0001-86	132 - BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	13.155.108,02	3,48%	457.215,25	13.612.323,27	
SUBTOTAL		27.127.238,60		1.051.288,97	33.178.527,57	
17.073.556/0001-00	68 - KINEA PIPE FIA	4.307.256,67	-7,05%	(303.669,13)	1.828.636,61	Art. 8º, II, a
11.392.165/0001-72	123 - AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	30.632.781,90	-0,59%	(180.457,14)	30.452.324,76	
06.916.384/0001-73	126 - BRADESCO FIA DIVIDENDOS	20.601.502,24	3,47%	714.228,72	21.315.730,96	
02.436.763/0001-05	130 - SANTANDER FIC FI SELEÇÃO TOP AÇÕES	13.917.786,14	2,09%	291.014,29	9.208.800,42	
07.279.657/0001-89	131 - AZ QUEST AÇÕES FIC FIA	29.464.657,57	3,09%	911.629,67	30.376.287,24	
23.731.629/0001-07	133 - ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES PHOENIX FIC DE FI	24.645.079,93	-1,28%	(315.980,76)	24.329.099,17	
11.628.883/0001-03	138 - BRASIL PLURAL FIC DE FIA	20.086.517,69	4,05%	813.802,28	20.900.319,97	
03.168.062/0001-03	141 - ARX INCOME FIA	-	4,69%	562.535,65	12.562.535,65	
SUBTOTAL		143.655.582,14		2.493.103,58	150.973.734,78	
03.737.188/0001-43	137 - CAIXA FI MULTIMERCADO RV30 L P	20.228.361,82	1,24%	251.003,90	20.479.365,72	Art. 8º, III
10.418.362/0001-50	139 - BB PREV MULTIMERCADO FDO DE INVEST LONGO PRAZO	15.008.449,29	1,16%	174.179,73	15.182.629,02	
26.680.228/0001-63	140 - ICATU VANGUARDA ESTRATEGIA FIM	4.003.837,37	0,12%	4.986,09	4.008.823,46	
SUBTOTAL		39.240.648,48		430.169,72	39.670.818,20	
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	4.124.317,98	-0,09%	(3.760,36)	4.120.557,62	
14.584.094/0001-06	67 - BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC FIP	5.722.785,19	33,62%	1.923.926,89	7.005.489,25	
15.711.367/0001-90	88 - W7 FIP	15.781.431,19	-0,15%	(24.069,82)	15.757.361,37	
14.721.044/0001-15	121 - INFRA SETORIAL FUNDO DE INVESTIMENTOS EM PARTICIPAÇÃO	15.506.654,69	-0,14%	(21.998,89)	15.484.655,80	
27.782.774/0001-78	136 - KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP ML	162.414,92	-12,28%	(19.951,39)	142.463,53	
SUBTOTAL		53.127.788,74		1.854.146,43	54.340.712,34	
12.887.506/0001-43	37 - CAIXA FII CX TRX	501.700,00	25,10%	125.910,00	627.610,00	Art. 8º, IV, b
14.423.780/0001-97	44 - ITAU - FII KII REAL	3.736.497,76	-0,92%	(34.526,16)	3.701.971,60	
18.369.510/0001-04	80 - FII INFRA REAL ESTATE FII	21.146.133,58	-0,23%	(48.688,51)	21.097.445,07	
15.461.076/0001-91	105 - FII BR HOTEIS	17.254.271,56	-0,05%	(9.343,36)	17.244.928,20	
SUBTOTAL		42.638.602,90		33.351,97	42.671.954,87	
TOTAL RENTA VARIÁVEL		305.789.860,86		5.862.060,67	320.835.747,76	

CONTA CORRENTE

Número	Descrição	Saldo Anterior (R\$)	Saldo Atual (R\$)
16-9	Caixa Econômica Federal - 00.360.305/0001-04	9.708,45	9.739,97
15-0	Caixa Econômica Federal - 00.360.305/0001-04	23.636,37	100,00
79680-7	Itaú Unibanco - 60.701.190/0001-04	27,02	90,69
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	100,00	100,01
TOTAL RENTA CONTA CORRENTE		33.571,84	10.130,67
Total de Recursos (Mês Anterior)		1.636.522.170,33	CRESCIMENTO DA CARTEIRA NO MÊS DE SETEMBRO/2018 1,28%
Total de Recursos (Mês Atual)		1.657.519.973,45	

Enquadramento da Resolução CMN nº 3.922	Enquadramento	% da Carteira
Fundo RF - 100% Títulos do Tesouro Nacional	Artigo 7º, I, "b"	62,11%
Fundo RF - Referenciado	Artigo 7º, III, "a"	16,16%
Fundo RF - Geral	Artigo 7º, IV, "a"	16,16%
Fundo RF - FIDC - Direitos Creditórios	Artigo 7º, VII, "a"	2,38%
Fundo RV - Ações 50+ Ativos	Artigo 8º, I, "a"	2,00%
Fundo RV - Ações Geral	Artigo 8º, II, "a"	9,11%
Fundo RV - Multimercado	Artigo 8º, III	2,39%
Fundo RV - FIP - Participações	Artigo 8º, IV, "a"	3,28%
Fundo RV - FII - Imobiliário	Artigo 8º, IV, "b"	2,57%

% 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	1.586.739.885,31	13.592.996,14	42.022.803,20	3,20%	2,73%	1,48%	0,21%
Fevereiro	1.608.993.805,47	13.536.101,34	12.629.375,08	1,40%	0,80%		
Março	1.631.531.770,75	13.622.008,83	14.836.603,65	1,40%	0,92%		
Abril	1.638.570.820,18	13.585.329,21	698.295,44	0,43%	-0,04%	-1,06%	
Maió	1.602.507.091,18	13.630.859,51	43.769.390,61	-2,20%	-2,67%		
Junho	1.602.812.560,78	13.575.953,79	7.503.769,44	0,02%	-0,47%		
Julho	1.645.266.496,89	13.842.563,70	22.612.508,32	2,65%	1,41%	0,43%	
Agosto	1.636.522.170,53	13.581.690,03	16.371.761,18	-0,53%	-1,00%		
Setembro	1.657.519.973,45	13.584.489,15	14.302.167,54	1,28%	0,87%		
Outubro							
Novembro							
Dezembro							

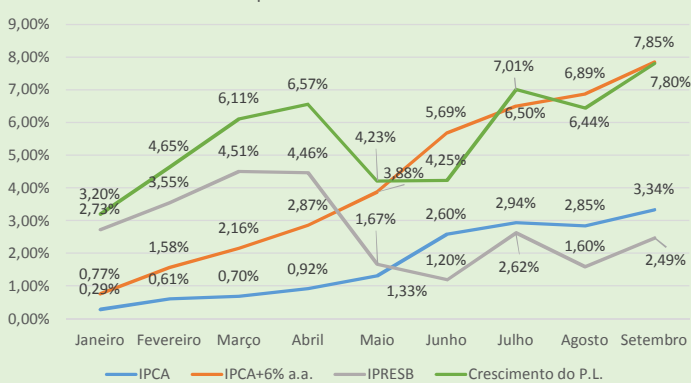
DESEMPENHO E INDICADORES

MÊS	IPCA		IPCA+6% a.a.		IPRESB		
	MENSAL	ACUMULADO	MENSAL	ACUMULADO	MENSAL	ACUMULADO	RENTAB. MÉDIA
Janeiro	0,29%	0,29%	0,77%	0,77%	2,73%	2,73%	2,73%
Fevereiro	0,32%	0,61%	0,80%	1,58%	0,80%	3,55%	1,77%
Março	0,09%	0,70%	0,57%	2,16%	0,92%	4,51%	1,48%
Abril	0,22%	0,92%	0,70%	2,87%	-0,04%	4,46%	1,10%
Maió	0,40%	1,33%	0,98%	3,88%	-2,67%	1,67%	0,35%
Junho	1,26%	2,60%	1,74%	5,69%	-0,47%	1,20%	0,21%
Julho	0,33%	2,94%	0,81%	6,50%	1,41%	2,62%	0,38%
Agosto	-0,09%	2,85%	0,39%	6,89%	-1,00%	1,60%	0,21%
Setembro	0,48%	3,34%	0,96%	7,85%	0,87%	2,49%	0,28%
Outubro							-
Novembro							-
Dezembro							-

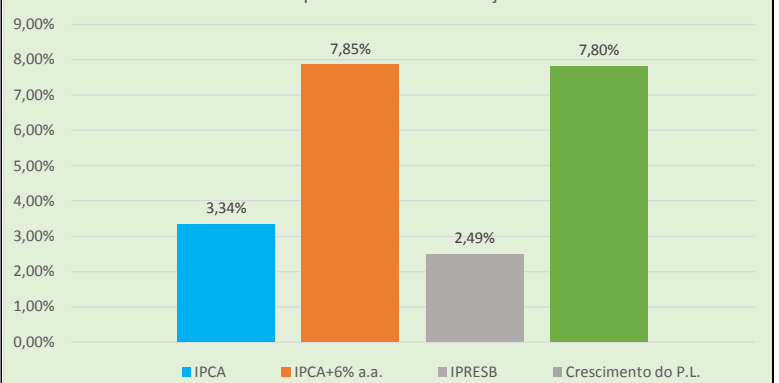
INDICADORES DE REFERÊNCIA

INDICADOR	MÊS	ACUMULADO	ANO (Previsto)
IBOVESPA	3,47%	3,85%	-
CDI	0,47%	4,81%	-
IPCA+6% a.a.	0,96%	7,85%	10,30%

Comparativo de Rentabilidades



Acompanhamento de Variação



RESUMO DAS INFORMAÇÕES

RECURSO INICIAL EM JANEIRO 2018	R\$ 1.537.489.252,41
TOTAL DE RECURSOS INVESTIDOS	R\$ 1.657.519.973,45
TOTAL DAS CONTRIBUIÇÕES 2018	R\$ 122.551.991,70
TOTAL DE RENDIMENTOS 2018	R\$ 38.060.241,12
VARIAÇÃO AUMENTATIVA DO P.L.	7,81%
META ATUARIAL IPCA+6% a.a.	7,85%
RENDIMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS EM % 2018	2,49%
CUMPRIMENTO DA META ATUARIAL EM 2018	31,67%

Observação: Este relatório visa dar publicidade a Carteira de Investimentos do IPRESB, contendo as informações referentes ao mês de Setembro/2018.

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