



**Relatório de Análise, Enquadramento, Rentabilidade e Risco - 30/09/2019**  
**Retorno e Meta Atuarial - Setembro 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)	17.037.444,40	0,63%	105.318,68	17.603.515,48	Art. 7º, I, b
10.740.670/0001-06	22 - CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF (BENEF)	11.600.780,20	0,63%	180.012,68	11.933.540,74	
21.919.953/0001-28	96 - CAIXA TITULOS PUBLICOS 2020	22.910.446,67	0,70%	160.490,49	23.070.937,16	
14.386.926/0001-71	98 - CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	77.616.033,55	1,33%	1.034.061,84	-	
13.327.340/0001-73	100 - BB PREVID RF IMA-B 5+	284.795.245,10	3,71%	10.558.742,75	295.353.987,85	
10.396.381/0001-23	115 - ITAÚ INSTITUCIONAL RF PRE LP FICFI	24.333.442,46	1,42%	345.601,56	24.679.044,02	
10.577.519/0001-90	116 - CAIXA FI BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	195.806.855,87	1,85%	3.631.962,65	199.438.818,52	
07.111.384/0001-69	119 - BB PREV. IRF-M	159.435.346,33	1,23%	1.959.628,38	-	
10.577.503/0001-88	122 - CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ TP RF LP	281.027.180,52	3,81%	10.712.484,00	421.739.664,52	
10.922.432/0001-03	135 - ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RF	44.813.619,28	1,74%	781.695,56	45.595.314,84	
10.756.541/0001-06	144 - ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO LONGA FI RF	80.880.672,43	3,73%	3.020.730,82	83.901.403,25	
<b>SUBTOTAL</b>		<b>1.200.257.066,81</b>		<b>32.490.729,41</b>	<b>1.123.316.226,38</b>	
13.594.673/0001-69	94 - TMJ IMA-B FI RF	12.936.495,71	1,92%	248.558,04	13.185.053,75	
21.838.150/0001-49	103 - ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FIC FI	222.102.283,42	0,78%	1.738.466,93	223.840.750,35	
19.418.031/0001-95	134 - ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RF LP	29.028.564,80	2,25%	654.408,86	29.682.973,66	
<b>SUBTOTAL</b>		<b>264.067.343,93</b>		<b>2.641.433,83</b>	<b>266.708.777,76</b>	
13.344.834/0001-66	62 - INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II	6.675.235,71	0,77%	51.290,64	6.726.526,35	Art. 7º, VII, a
23.431.871/0001-65	93 - TRX FIDC SENIOR	314.184,17	11,94%	37.505,96	-	
17.013.985/0001-92	106 - FIDC GGR Prime I	31.957.056,93	0,72%	229.502,90	32.186.559,83	
<b>SUBTOTAL</b>		<b>38.946.476,81</b>		<b>318.299,50</b>	<b>38.913.086,18</b>	
<b>TOTAL RENTA FIXA</b>		<b>1.503.270.887,55</b>		<b>35.450.462,74</b>	<b>1.428.938.090,32</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	53.731.813,53	2,43%	1.306.398,08	95.046.502,15	Art. 8º, I, a
03.394.711/0001-86	132 - BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	29.231.894,45	3,52%	1.029.564,69	30.261.459,14	
06.224.719/0001-92	146 - ICATU VANGUARDA AÇÕES IBX FUNDO DE INVESTIMENTO	-	-0,49%	(73.968,29)	14.926.031,71	
<b>SUBTOTAL</b>		<b>82.963.707,98</b>		<b>2.261.994,48</b>	<b>140.233.993,00</b>	
11.392.165/0001-72	123 - AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	78.566.350,09	0,76%	594.178,89	79.160.528,98	Art. 8º, II, a
02.436.763/0001-05	130 - SANTANDER FIC FI SELEÇÃO TOP AÇÕES	12.311.189,99	2,06%	253.553,89	12.564.743,88	
07.279.657/0001-89	131 - AZ QUEST AÇÕES FIC FIA	57.898.344,57	1,94%	1.126.023,20	59.024.367,77	
23.731.629/0001-07	133 - ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES PHOENIX FIC DE FI	88.436.481,73	-0,48%	(420.421,34)	88.016.060,39	
11.628.883/0001-03	138 - OCCAM FIC FIA	29.320.142,86	1,13%	330.181,64	39.650.324,50	
03.168.062/0001-03	141 - ARX INCOME FIA	29.491.819,66	0,95%	280.008,08	-	
08.279.304/0001-41	145 - ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	38.173.759,12	2,64%	1.006.826,06	107.180.585,18	
<b>SUBTOTAL</b>		<b>334.198.088,02</b>		<b>3.170.350,42</b>	<b>385.596.610,70</b>	
03.737.188/0001-43	137 - CAIXA FI MULTIMERCADO RV30 L P	22.876.660,06	1,56%	356.683,67	38.233.343,73	Art. 8º, III
10.418.362/0001-50	139 - BB PREV MULTIMERCADO FDO DE INVEST LONGO PRAZO	16.249.719,80	1,30%	211.153,00	16.460.872,80	
15.578.417/0001-03	142 - OCCAM INSTITUCIONAL FIM II	5.370.955,44	0,48%	25.565,97	5.396.521,41	
26.269.692/0001-61	143 - ITAÚ PRIVATE MULTIMERCADO S&P500	20.982.888,76	2,21%	464.404,48	21.447.293,24	
<b>SUBTOTAL</b>		<b>65.480.224,06</b>		<b>1.057.807,12</b>	<b>81.538.031,18</b>	
12.312.767/0001-35	63 - BRASIL FLORESTAL - FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIP	7.131.866,02	-0,26%	(18.727,80)	7.113.138,22	Art. 8º, IV, a
16.676.620/0001-85	66 - FIP CAIXA CYRELA	4.128.915,66	-11,43%	(472.032,04)	3.714.034,46	
14.584.094/0001-06	67 - BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC FIP	8.038.383,76	-0,11%	(9.197,55)	7.278.974,15	
15.711.367/0001-90	88 - W7 FIP	15.473.139,41	-0,16%	(25.514,99)	15.447.624,42	
14.721.044/0001-15	121 - INFRA SETORIAL FUNDO DE INVESTIMENTOS EM PARTICIP	15.342.707,85	-0,17%	(25.542,21)	15.317.165,64	
27.782.774/0001-78	136 - KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP M	3.347.594,92	-0,46%	(15.434,01)	3.332.160,91	
<b>SUBTOTAL</b>		<b>53.462.607,62</b>		<b>(566.448,60)</b>	<b>52.203.097,80</b>	
12.887.506/0001-43	37 - CAIXA FII CX TRX	384.000,00	-0,54%	(2.070,00)	381.930,00	Art. 8º, IV, b
14.423.780/0001-97	44 - ITAÚ - FII KII REAL	2.405.322,48	-1,21%	(29.187,42)	2.355.451,36	
18.369.510/0001-04	80 - FII INFRA REAL ESTATE FII	20.381.185,51	0,00%	494,33	20.381.679,84	
15.461.076/0001-91	105 - FII BR HOTEIS	16.408.037,25	-0,08%	(12.323,34)	16.395.713,91	
<b>SUBTOTAL</b>		<b>39.578.545,24</b>		<b>(43.086,43)</b>	<b>39.514.775,11</b>	
<b>TOTAL RENTA VARIÁVEL</b>		<b>575.683.172,92</b>		<b>5.880.616,99</b>	<b>699.086.507,79</b>	

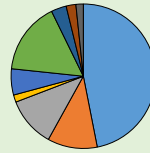
**CONTA CORRENTE**

Número	Descrição	Saldo Anterior (R\$)	Saldo Atual (R\$)
16-9	Caixa Econômica Federal - 00.360.305/0001-04	10.490,60	10.560,38
15-0	Caixa Econômica Federal - 00.360.305/0001-04	249.096,78	206,57
33888-1	Itaú Unibanco - 60.701.190/0001-03	-	-
79680-7	Itaú Unibanco - 60.701.190/0001-04	11.921,21	32.722,32
40104-8	Banco do Brasil - 00.000.000/0001-91	89,87	10,45
98300-4	Banco Bradesco - 60.746.948/0001-12	100,00	100,00
130003250-0	Banco Santander - 90.400.888/0001-42	100,01	100,01
		<b>271.798,47</b>	<b>43.699,73</b>
<b>Total de Recursos (Mês Anterior)</b>		<b>2.079.225.858,94</b>	<b>CRESCIMENTO DA CARTEIRA NO MÊS DE Setembro/2019</b> <b>2,35%</b>
<b>Total de Recursos (Mês Atual)</b>		<b>2.128.068.297,84</b>	

Retorno e Meta Atuarial - Setembro de 2019

Enquadramento da Resolução CMN nº 3.922	Enquadramento	% da Carteira
Fundo RF - 100% Títulos do Tesouro Nacional	Artigo 7º, I, "b"	52,79%
Fundo RF - Referenciado	Artigo 7º, III, "a"	12,53%
Fundo RF - Geral	Artigo 7º, IV, "a"	12,53%
Fundo RF - FIDC - Direitos Creditórios	Artigo 7º, VII, "a"	1,83%
Fundo RV - Ações 50+ Ativos	Artigo 8º, I, "a"	6,59%
Fundo RV - Ações Geral	Artigo 8º, II, "a"	18,12%
Fundo RV - Multimercado	Artigo 8º, III	3,83%
Fundo RV - FIP - Participações	Artigo 8º, IV, "a"	2,45%
Fundo RV - FII - Imobiliário	Artigo 8º, IV, "b"	1,86%

% 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%	1,60%
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%	2,22%	
Maio	1.965.750.596,06	15.767.068,09	44.754.306,35	9,02%	2,35%		
Junho	2.029.694.551,94	15.806.546,61	62.274.572,36	12,56%	3,17%		
Julho	2.070.186.683,91	15.910.891,98	33.889.194,86	14,81%	1,67%	1,25%	
Agosto	2.079.225.858,94	15.896.865,51	1.867.461,61	15,31%	0,09%		
Setembro	2.128.068.297,84	15.915.968,29	41.331.079,73	18,02%	1,99%		
Outubro							
Novembro							
Dezembro							

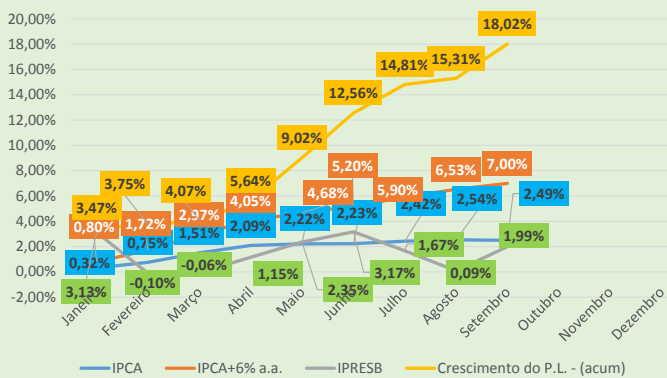
DESEMPENHO E INDICADORES

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	0,01%	2,23%	0,49%	5,20%	3,17%	9,96%	1,60%
Julho	0,19%	2,42%	0,67%	5,90%	1,67%	11,80%	1,61%
Agosto	0,11%	2,54%	0,59%	6,53%	0,09%	11,90%	1,42%
Setembro	-0,04%	2,49%	0,44%	7,00%	1,99%	14,13%	1,49%
Outubro							
Novembro							
Dezembro							

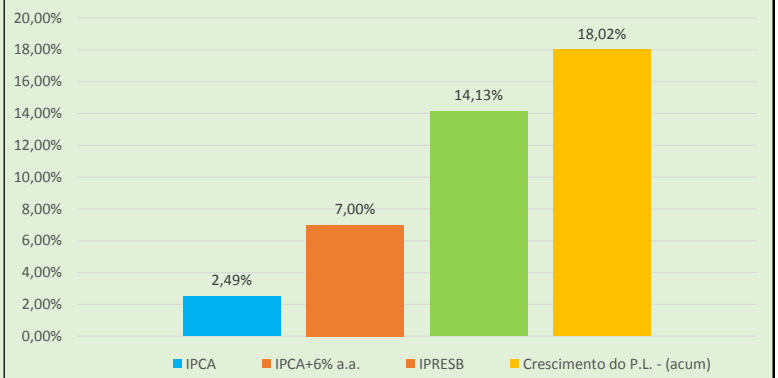
INDICADORES DE REFERÊNCIA

INDICADOR	MÊS	ACUMULADO	ANO (Previsto)
IBOVESPA	3,57%	19,18%	-
CDI	0,47%	4,67%	-
IPCA+6% a.a.	-0,04%	6,53%	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\$ 2.128.068.297,84
TOTAL DAS CONTRIBUIÇÕES 2019	R\$ 138.893.759,47
TOTAL DE RENDIMENTOS 2019	R\$ 259.006.432,24
VARIAÇÃO AUMENTATIVA DO P.L.	18,02%
META ATUARIAL IPCA+6% a.a.	10,03%
RENDIMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS EM % 2019	11,90%
CUMPRIMENTO DA META ATUARIAL EM 2019	118,66%

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

Informo que recebemos da Caixa Econômica Federal, que houve um reprocessamento dos extratos do período de 03/2019 à 09/2019, referente ao fundo de investimento 66 - FIP CAIXA CYRELA, sob CPNJ 16.676.620/0001-85. Gerando uma diferença de saldo NEGATIVA DE R\$ 467.984,61