

Relatório de Análise, Enquadramento, Rentabilidade e Risco - 31/10/2020

Retorno e Meta Atuarial - Outubro de 2020

RENTA FIXA

Ativo			Rentabilidade							Enquad.
CNPJ	FUNDO	Valor Anterior	Mês	Aplicação	Resgate	CUPOM/DIVIDEN/ AMORTIZ COTA	Rentabilidade	Valor do Mês		
10.740.670/0001-06	21 - CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF (ADM)	R\$ 24.775.220,19	0,14%	R\$ 1.363.547,45	R\$ 670.905,82	R\$ -	R\$ 34.834,94	R\$ 25.502.696,76	Art. 7º, I, b	
10.740.670/0001-06	22 - CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF (BENEF)	R\$ 25.641.163,80	0,14%	R\$ 66.008.603,61	R\$ 9.786.170,27	R\$ -	R\$ 96.885,78	R\$ 81.960.482,92		
13.327.340/0001-73	100 - BB PREVID RF IMA-B 5+	R\$ 110.700.504,53	0,20%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 226.728,34	R\$ 110.927.232,87		
10.577.503/0001-88	122 - CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ TP RF LP	R\$ 159.491.110,83	0,22%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 347.431,74	R\$ 159.838.542,57		
10.922.432/0001-03	135 - ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA	R\$ 70.016.745,81	0,15%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 105.828,04	R\$ 70.122.573,85		
10.756.541/0001-06	144 - ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO LONGA	R\$ 144.119.180,99	0,19%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 272.692,64	R\$ 144.391.873,63		
19.418.031/0001-95	134 - ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RF	R\$ 39.491.446,99	-0,37%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (147.187,86)	R\$ 39.344.259,13		
10.577.519/0001-90	116 - CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP	R\$ 198.554.778,39	-0,56%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (1.113.627,14)	R\$ 197.441.151,25		
23.215.097/0001-55	113 - CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATEGICA	R\$ 199.346.718,01	-0,11%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (214.918,65)	R\$ 199.131.799,36		
10.979.025/0001-32	152 - SANTANDER FI IRF-M 1 TP RF	R\$ -	0,02%	R\$ 117.877.090,41	R\$ -	R\$ -	R\$ 27.766,64	R\$ 117.904.857,05		
SUBTOTAL		R\$ 972.136.869,54		R\$ 185.249.241,47	R\$ 10.457.076,09	R\$ -	R\$ (363.565,53)	R\$ 1.146.565.469,39		
13.594.673/0001-69	94 - TMJ IMA-B FI RF	R\$ 7.624.241,81	0,59%	R\$ -	R\$ 305.403,48	R\$ -	R\$ 44.852,81	R\$ 7.363.691,14	Art. 7º IV, a	
21.838.150/0001-49	103 - ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAM	R\$ 325.014.853,95	0,08%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 252.218,21	R\$ 325.267.072,16		
26.507.132/0001-06	147 - SANTANDER RENDA FIXA ATIVO FIC FI	R\$ 60.634.962,97	0,00%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 1.749,90	R\$ 60.636.712,87		
SUBTOTAL		R\$ 393.274.058,73		R\$ -	R\$ 305.403,48	R\$ -	R\$ 298.820,92	R\$ 393.267.476,17		
13.344.834/0001-66	62 - INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II	R\$ (8.435.283,00)	-0,38%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (32.001,90)	R\$ (8.467.284,90)	Art. 7º, VII, a	
17.013.985/0001-92	106 - FIDC GGR Prime I	R\$ 24.931.844,01	0,10%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 23.969,83	R\$ 24.955.813,84		
SUBTOTAL		R\$ 16.496.561,01		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (8.032,07)	R\$ 16.488.528,94		
TOTAL RENDA FIXA		R\$ 1.381.907.489,28		R\$ 185.249.241,47	R\$ 10.762.479,57	R\$ -	R\$ (72.776,68)	R\$ 1.556.321.474,50		



Relatório de Análise, Enquadramento, Rentabilidade e Risco - 31/10/2020

Retorno e Meta Atuarial - Outubro de 2020

RENDA VARIÁVEL

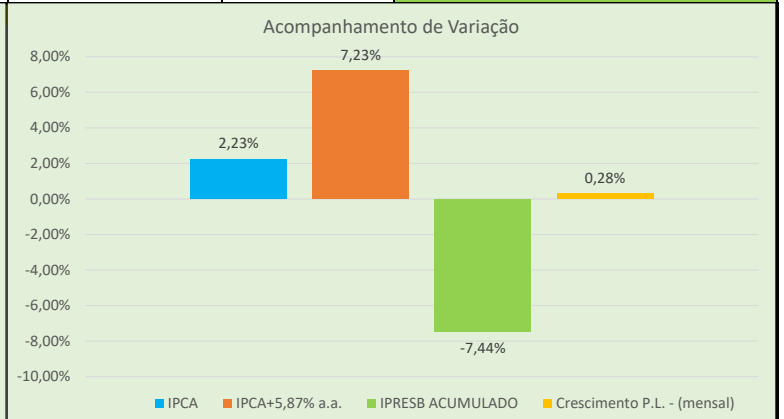
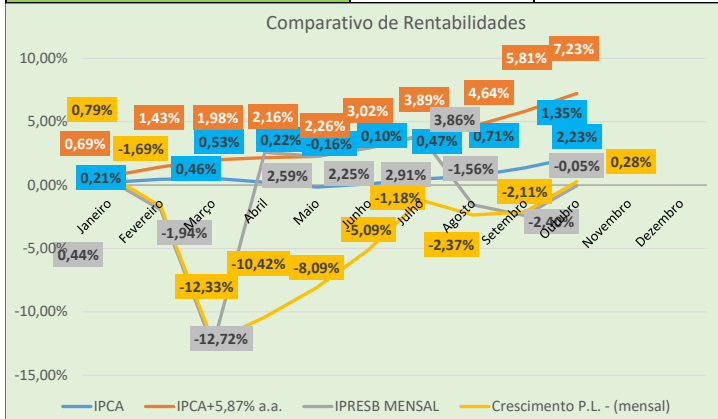
Ativo		Rentabilidade							Enquad.
CNPJ	FUNDO	Valor Anterior (R\$)	Mês	Aplicação	Resgate	CUPOM/DIVIDEN/	Rentabilidade (R\$)	Valor do Mês (R\$)	Enquad.
01.699.688/0001-02	129 - SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTIT	R\$ 111.299.842,80	5,91%	R\$ -	R\$ 117.877.090,41	R\$ -	R\$ 6.577.247,61	R\$ -	Art. 8º, I, a
03.394.711/0001-86	132 - BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	R\$ 27.261.441,89	6,25%	R\$ -	R\$ 28.964.651,06	R\$ -	R\$ 1.703.209,17	R\$ -	
06.224.719/0001-92	146 - ICATU VANGUARDA AÇÕES IBX FUNDO	R\$ 19.306.297,21	6,24%	R\$ -	R\$ 20.511.253,43	R\$ -	R\$ 1.204.956,22	R\$ -	
SUBTOTAL		R\$ 157.867.581,90		R\$ -	R\$ 167.352.994,90	R\$ -	R\$ 9.485.413,00	R\$ -	
11.392.165/0001-72	123 - AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	R\$ 78.404.568,05	-2,00%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (1.571.777,52)	R\$ 76.832.790,53	Art. 8º, II, a
23.731.629/0001-07	133 - ITAU INSTITUCIONAL AÇÕES PHOENIX F	R\$ 67.366.490,27	-4,17%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (2.808.854,49)	R\$ 64.557.635,78	
11.628.883/0001-03	138 - OCCAM FIC FIA	R\$ 94.680.310,67	-0,31%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (293.619,54)	R\$ 94.386.691,13	
08.279.304/0001-41	145 - ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 130.050.485,16	-2,02%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (2.621.309,13)	R\$ 127.429.176,03	
34.791.108/0001-61	148 - AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCI	R\$ 36.042.421,28	-2,01%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (725.828,53)	R\$ 35.316.592,75	
11.977.794/0001-64	149 - BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCION	R\$ 4.907.202,09	-1,73%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (84.913,31)	R\$ 4.822.288,78	
08.621.010/0001-56	150 - BRASIL PLURAL ESTRATÉGIA FIC FIA	R\$ 4.670.347,23	-0,61%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (28.388,85)	R\$ 4.641.958,38	
SUBTOTAL		R\$ 416.121.824,75		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (8.134.691,37)	R\$ 407.987.133,38	
03.737.188/0001-43	137 - CAIXA FI MULTIMERCADO RV30 LP	R\$ 38.569.796,95	-0,38%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (145.005,80)	R\$ 38.424.791,15	Art. 8º, III
10.418.362/0001-50	139 - BB PREV MULTIMERCADO FDO DE INVE	R\$ 16.866.616,84	-0,21%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (34.703,71)	R\$ 16.831.913,13	
15.578.417/0001-03	142 - OCCAM INSTITUCIONAL FIM II	R\$ 5.586.753,35	0,13%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 7.065,52	R\$ 5.593.818,87	
26.269.692/0001-61	143 - ITAU PRIVATE MULTIMERCADO S&P500	R\$ 43.820.820,88	-2,47%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (1.084.545,66)	R\$ 42.736.275,22	
35.637.151/0001-30	151 - ICATU VANGUARDA LONG BIASED FIM	R\$ 941.723,74	-1,34%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (12.574,70)	R\$ 929.149,04	
SUBTOTAL		R\$ 105.785.711,76		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (1.269.764,35)	R\$ 104.515.947,41	
12.312.767/0001-35	63 - BRASIL FLORESTAL - FUNDO DE INVESTI	R\$ 9.455.300,77	-0,13%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (12.516,86)	R\$ 9.442.783,91	Art. 8º, IV, a
16.676.620/0001-85	66 - FIP CAIXA CYRELA	R\$ 1.636.424,34	-0,14%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (2.310,94)	R\$ 1.634.113,40	
14.584.094/0001-06	67 - BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC FI	R\$ 10.582.271,46	-0,11%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (11.833,48)	R\$ 10.570.437,98	
15.711.367/0001-90	88 - W7 FIP	R\$ 15.132.810,07	-0,18%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (26.714,92)	R\$ 15.106.095,15	
14.721.044/0001-15	121 - INFRA SETORIAL FUNDO DE INVESTIME	R\$ 15.074.066,56	-0,07%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (10.622,75)	R\$ 15.063.443,81	
27.782.774/0001-78	136 - KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INST	R\$ 5.605.161,27	-17,74%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (994.555,07)	R\$ 4.610.606,20	
SUBTOTAL		R\$ 57.486.034,47		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (1.058.554,02)	R\$ 56.427.480,45	
12.887.506/0001-43	37 - CAIXA FII CX TRX	R\$ 338.640,00	3,74%	R\$ -	R\$ -	R\$ 971,51	R\$ 13.633,02	R\$ 350.330,00	Art. 8º, IV, b
14.423.780/0001-97	44 - ITAU - FII KII REAL	R\$ 1.603.548,32	-4,78%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (76.724,80)	R\$ 1.526.823,52	
18.369.510/0001-04	80 - FII INFRA REAL ESTATE FII	R\$ 14.881.243,42	0,71%	R\$ -	R\$ 69.994,10	R\$ -	R\$ 105.365,51	R\$ 14.916.614,83	
15.461.076/0001-91	105 - FII BR HOTEIS	R\$ 16.198.152,14	-0,13%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (21.154,67)	R\$ 16.176.997,47	
SUBTOTAL		R\$ 33.021.583,88		R\$ -	R\$ 69.994,10	R\$ 971,51	R\$ 20.147,55	R\$ 32.970.765,82	
SUBTOTAL									Art. 9º, II
SUBTOTAL									Art. 9º, III
SUBTOTAL									
TOTAL RENDA VARIÁVEL		R\$ 770.282.736,76		R\$ -	R\$ 167.422.989,00	R\$ 971,51	R\$ (957.449,19)	R\$ 601.901.327,06	
CONTA CORRENTE									
Número	Descrição	Saldo Ant						Saldo Atual	
15-0	Caixa Econômica Federal - 00.360.305/0001-4	R\$ 100,00						R\$ 100,00	
16-9	Caixa Econômica Federal - 00.360.305/0001-1	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\$ 28,16	0,00%					R\$ 5.341,83	
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	
SUBTOTAL		R\$ 10.354,02						R\$ 15.667,69	
Total de Recursos (Mês Anterior)		R\$ 2.152.200.580,06		CRESCIMENTO DA CARTEIRA NO MÊS DE OUTUBRO/2020					
Total de Recursos (Mês Atual)		R\$ 2.158.238.469,25		0,28%					

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"	53,13%	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 50+ Ativos 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"	18,22%	40% / 14%	
Fundo RF - FIDC - Direitos Creditórios	Artigo 7º, VII, "a"	0,76%	5% / 2%	
Fundo RV - Ações 50+ Ativos	Artigo 8º, I, "a"	0,00%	20% / 9%	
Fundo RV - Ações Geral	Artigo 8º, II, "a"	18,90%	20% / 21%	
Fundo RV - Multimercado	Artigo 8º, III	4,84%	20% / 5%	
Fundo RV - FIP - Participações	Artigo 8º, IV, "a"	2,61%	20% / 3%	
Fundo RV - FII - Imobiliário	Artigo 8º, IV, "b"	1,53%	20% / 2%	
Fundo RV - Investimentos no Exterior	Artigo 9º, II	0,00%	10% / 6%	
Fundo RV - Investimentos no Exterior	Artigo 9º, III	0,00%	10% / 4%	

ACOMPANHAMENTO DE RECURSOS NO ANO DE 2020						
Período	Recursos	Contribuição	Rentabilidade Mês	Crescimento P.L. - (mensal)	Rendimento Mensal	Rend. Medio Trimestral
Janeiro	R\$ 2.285.100.608,11	R\$ 15.916.944,65	R\$ 10.000.854,69	0,79%	0,44%	-4,74%
Fevereiro	R\$ 2.246.388.562,38	R\$ 15.848.374,30	R\$ (44.385.033,04)	-1,69%	-1,94%	
Março	R\$ 1.969.668.286,36	R\$ 15.917.531,29	R\$ (285.736.404,74)	-12,33%	-12,72%	
Abril	R\$ 2.031.066.499,43	R\$ 15.831.484,26	R\$ 50.920.404,78	-10,42%	2,59%	2,58%
Maió	R\$ 2.083.822.283,35	R\$ 15.796.467,75	R\$ 45.791.587,96	-8,09%	2,25%	
Junho	R\$ 2.151.843.412,66	R\$ 15.586.723,63	R\$ 60.672.098,57	-5,09%	2,91%	
Julho	R\$ 2.240.528.869,77	R\$ 15.701.143,37	R\$ 83.157.659,02	-1,18%	3,86%	-0,03%
Agosto	R\$ 2.213.587.909,12	R\$ 15.809.176,58	R\$ (34.900.241,18)	-2,37%	-1,56%	
Setembro	R\$ 2.152.200.580,06	R\$ 16.533.757,44	R\$ (53.174.395,71)	-2,11%	-2,40%	
Outubro	R\$ 2.158.238.469,25	R\$ 15.830.228,49	R\$ (1.029.254,36)	0,28%	-0,05%	-
Novembro						
Dezembro						

MÊS	IPCA		IPCA+5,87% a.a.		IPRESB MENSAL		RENTAB. MÉDIA
	MENSAL	ACUMULADO	MENSAL	ACUMULADO	MENSAL	ACUMULADO	
Janeiro	0,21%	0,21%	0,69%	0,69%	0,44%	0,44%	0,44%
Fevereiro	0,25%	0,46%	0,73%	1,43%	-1,94%	-1,51%	-0,75%
Março	0,07%	0,53%	0,55%	1,98%	-12,72%	-14,04%	-4,74%
Abril	-0,31%	0,22%	0,17%	2,16%	2,59%	-11,82%	-2,91%
Maió	-0,38%	-0,16%	0,10%	2,26%	2,25%	-9,83%	-1,88%
Junho	0,26%	0,10%	0,74%	3,02%	2,91%	-7,20%	-1,08%
Julho	0,37%	0,47%	0,85%	3,89%	3,86%	-3,62%	-0,37%
Agosto	0,24%	0,71%	0,72%	4,64%	-1,56%	-5,12%	-0,52%
Setembro	0,64%	1,35%	1,12%	5,81%	-2,40%	-7,40%	-0,73%
Outubro	0,86%	2,23%	1,34%	7,23%	-0,05%	-7,44%	-0,66%
Novembro							
Dezembro							

INDICADORES DE REFERÊNCIA				
INDICADOR	MÊS	ACUMULADO	ANO (Previsto)	
IBOVESPA	-0,69%	-18,76%	-	
CDI	0,16%	2,45%	-	
IPCA+5,87% a.a.	1,34%	7,23%	7,50%	



RESUMO DAS INFORMAÇÕES		Obs: Este relatório visa dar publicidade a Carteira de Investimentos do IPRESB, contendo as informações referentes ao mês de Outubro/2020.	
RECURSO INICIAL EM JANEIRO 2020	R\$ 2.267.267.269,68		
TOTAL DE RECURSOS INVESTIDOS + SALDO EM CONTA CORRENTE	R\$ 2.158.238.469,25		
TOTAL DAS CONTRIBUIÇÕES 2020	R\$ 158.771.831,76		
TOTAL DE RENDIMENTOS 2020	R\$ (168.682.724,01)		
VARIAÇÃO AUMENTATIVA DO P.L.	-4,81%		
META ATUARIAL 1,63% (PROJEÇÃO BOLETIM FOCUS, 03/07)+ 5,87% DRAA	7,50%		
RENDIMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS EM % 2020	-7,44%		
CUMPRIMENTO DA META ATUARIAL EM 2020	-99,21%		