

Relatório de Análise, Enquadramento, Rentabilidade e Risco - 31/10/2021

Retorno e Meta Atuarial - Outubro de 2021

RENTA FIXA

Ativo			Rentabilidade						Enquad.
CNPJ	FUNDO	Valor Anterior	Mês	Aplicação	Resgate	CUPOM/DIV	Rentabilidade	Valor do Mês	
10.740.670/0001-06	21 - CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF (ADM)	R\$ 33.420.674,44	-0,53%	R\$ 1.410.645,66	R\$ 679.045,36	R\$ -	R\$ (177.454,68)	R\$ 33.974.820,06	Art. 7º, I, b
10.740.670/0001-06	22 - CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF (BENEF)	R\$ 28.645.075,99	-0,53%	R\$ 216.598.729,77	R\$ 11.630.532,01	R\$ -	R\$ (1.388.071,59)	R\$ 232.225.202,16	
11.060.913/0001-10	56 - FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	R\$ 101.525.608,20	-1,24%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (1.263.020,64)	R\$ 100.262.587,56	
13.322.205/0001-35	58 - BB PREVID RF IDKA 2 TP FI	R\$ 132.961.624,22	-1,25%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (1.665.688,90)	R\$ 131.295.935,32	
14.386.926/0001-71	98 - FI CAIXA BRASIL IDKA 2A TIT RF LONGO P	R\$ 102.382.602,55	-1,29%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (1.323.039,33)	R\$ 101.059.563,22	
23.215.097/0001-55	113 - CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 220.884.262,85	0,01%	R\$ -	R\$ 200.000.000,00	R\$ -	R\$ 23.053,77	R\$ 20.907.316,62	
10.577.519/0001-90	116 - CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP	R\$ 191.821.721,81	-3,49%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (6.700.780,97)	R\$ 185.120.940,84	
19.418.031/0001-95	134 - ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RF L	R\$ 22.864.392,94	-5,59%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (1.277.090,66)	R\$ 21.587.302,28	
10.922.432/0001-03	135 - ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA F	R\$ 102.391.254,78	-1,24%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (1.268.786,94)	R\$ 101.122.467,84	
17.517.577/0001-78	161 - WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RF	R\$ 81.337.633,17	-1,82%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (1.477.352,92)	R\$ 79.860.280,25	
13.455.117/0001-01	163 - SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC F	R\$ 94.244.437,28	-1,25%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (1.178.046,76)	R\$ 93.066.390,52	
SUBTOTAL		R\$ 1.112.479.288,23		R\$ 218.009.375,43	R\$ 212.309.577,37	R\$ -	R\$ (17.696.279,62)	R\$ 1.100.482.806,67	
13.594.673/0001-69	94 - TMJ IMA-B FI RF	R\$ 4.077.725,85	0,30%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 12.358,06	R\$ 4.090.083,91	Art. 7º IV, a
21.838.150/0001-49	103 - ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂM	R\$ 307.936.906,02	-0,36%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (1.094.099,95)	R\$ 306.842.806,07	
26.507.132/0001-06	147 - SANTANDER RENDA FIXA ATIVO FIC FI	R\$ 62.089.227,25	-0,55%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (339.624,22)	R\$ 61.749.603,03	
SUBTOTAL		R\$ 374.103.859,12		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (1.421.366,11)	R\$ 372.682.493,01	
13.344.834/0001-66	62 - INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II	R\$ (9.719.528,45)	0,13%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 12.830,41	R\$ (9.706.698,04)	Art. 7º, VII, a
17.013.985/0001-92	106 - FIDC GGR PRIME I	R\$ 23.961.380,12	1,24%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 296.754,27	R\$ 23.297.338,47	
SUBTOTAL		R\$ 14.241.851,67		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 309.584,68	R\$ 13.590.640,43	
TOTAL RENDA FIXA		R\$ 1.500.824.999,02		R\$ 218.009.375,43	R\$ 212.309.577,37	R\$ -	R\$ (18.808.061,05)	R\$ 1.486.755.940,11	

Relatório de Análise, Enquadramento, Rentabilidade e Risco - 31/10/2021

Retorno e Meta Atuarial - Outubro de 2021

RENDA VARIÁVEL									
Ativo			Rentabilidade						
CNPJ	FUNDO	Valor Anterior (R\$)	Mês	Aplicação	Resgate	CUPOM/DIV	Rentabilidade (R\$)	Valor do Mês (R\$)	Enquad.
11.392.165/0001-72	123 - AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	R\$ 90.287.720,70	-6,61%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (5.972.383,23)	R\$ 84.315.337,47	Art. 8º, II, a
11.628.883/0001-03	138 - OCCAM FIC FIA	R\$ 105.914.794,72	-4,90%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (5.187.803,38)	R\$ 100.726.991,34	
34.791.108/0001-61	148 - AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCION	R\$ 41.511.746,27	-6,79%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (2.816.748,75)	R\$ 38.694.997,52	
11.977.794/0001-64	149 - BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCION	R\$ 4.670.254,65	-13,06%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (609.916,23)	R\$ 4.060.338,42	
08.621.010/0001-56	150 - BRASIL PLURAL ESTRATÉGIA FIC FIA	R\$ 5.166.180,41	-6,92%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (357.722,93)	R\$ 4.808.457,48	
30.068.169/0001-44	160 - FIC FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUA	R\$ 44.650.068,10	-6,02%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (2.690.140,76)	R\$ 41.959.927,34	
09.005.805/0001-00	162 - BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	R\$ 42.004.476,00	-8,50%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (3.569.302,62)	R\$ 38.435.173,38	
SUBTOTAL		R\$ 334.205.240,85		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (21.204.017,90)	R\$ 313.001.222,95	
26.269.692/0001-61	143 - ITAU PRIVATE MULTIMERCADO S&P500	R\$ 78.044.405,98	7,63%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 5.955.759,89	R\$ 84.000.165,87	Art. 8º III
30.036.235/0001-02	158 - FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA M	R\$ 83.234.916,30	7,64%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 6.361.213,01	R\$ 89.596.129,31	
17.453.850/0001-48	159 - WESTERN ASSET US INDEX 500 FIM	R\$ 80.640.112,19	7,66%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 6.175.835,82	R\$ 86.815.948,01	
SUBTOTAL		R\$ 241.919.434,47		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 18.492.808,72	R\$ 260.412.243,19	
12.312.767/0001-35	63 - BRASIL FLORESTAL - FUNDO DE INVESTIM	R\$ 9.345.530,89	-0,08%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (7.475,84)	R\$ 9.338.055,05	Art. 8º, IV, a
14.584.094/0001-06	67 - BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC FI	R\$ 9.388.814,68	-0,10%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (8.963,87)	R\$ 9.379.850,81	
15.711.367/0001-90	88 - W7 FIP	R\$ 15.416.769,53	-0,12%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (18.108,91)	R\$ 15.398.660,62	
14.721.044/0001-15	121 - INFRA SETORIAL FUNDO DE INVESTIME	R\$ 22.399.871,74	-0,12%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (25.994,34)	R\$ 22.373.877,40	
27.782.774/0001-78	136 - KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INST	R\$ 9.119.885,93	-0,86%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (78.342,09)	R\$ 9.041.543,84	
SUBTOTAL		R\$ 65.670.872,77		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (138.885,05)	R\$ 65.531.987,72	
12.887.506/0001-43	37 - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	R\$ 399.970,00	-19,99%	R\$ -	R\$ -	R\$ 825,57	R\$ (79.970,00)	R\$ 320.000,00	Art. 8º, IV, b
14.423.780/0001-97	44 - ITAU - FII KII REAL	R\$ 836.300,32	-3,21%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (26.853,68)	R\$ 809.446,64	
18.369.510/0001-04	80 - FII INFRA REAL ESTATE FII	R\$ 16.079.644,22	0,23%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 36.888,43	R\$ 16.055.287,81	
15.461.076/0001-91	105 - FII BR HOTÉIS	R\$ 15.626.233,56	-0,12%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (19.020,64)	R\$ 15.607.212,92	
SUBTOTAL		R\$ 32.942.148,10		R\$ -	R\$ -	R\$ 825,57	R\$ (88.955,89)	R\$ 32.791.947,37	
34.246.525/0001-23	154 - SANTANDER GO NORTH AMERICAN EQ	R\$ 35.129.518,23	5,31%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 1.866.386,64	R\$ 36.995.904,87	Art. 9º, II
37.308.394/0001-50	155 - SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES	R\$ 62.304.357,05	7,56%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 4.711.006,61	R\$ 67.015.363,66	
37.331.365/0001-09	156 - GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 91.922.567,87	10,90%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 10.017.068,19	R\$ 101.939.636,06	
SUBTOTAL		R\$ 189.356.443,15		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 16.594.461,44	R\$ 205.950.904,59	
17.502.937/0001-68	153 - CAIXA FI AÇÕES INSTITUCIONAL BDR NI	R\$ 49.567.134,74	10,93%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 5.417.114,30	R\$ 54.984.249,04	Art. 9º, III
SUBTOTAL		R\$ 49.567.134,74		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 5.417.114,30	R\$ 54.984.249,04	
TOTAL RENDA VARIÁVEL		R\$ 913.661.274,08		R\$ -	R\$ -	R\$ 825,57	R\$ 19.072.525,62	R\$ 932.672.554,86	

CONTA CORRENTE				
Número	Descrição	Saldo Anterior	Saldo Atual	
15-0	Caixa Econômica Federal - 00.360.305/0001-0	R\$ 100,00	R\$ 100,00	Este relatório visa dar publicidade à Carteira de Investimentos do IPRESB, contendo as informações do mês.
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\$ -	
79680-7	Itaú Unibanco - 60.701.190/0001-04	R\$ 76,40	R\$ 61,45	
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	
Total Conta Corrente		R\$ 10.402,26	R\$ 10.387,31	
Total de Recursos		R\$ 2.414.496.675,36	R\$ 2.419.438.882,28	
				CRESCIMENTO DA CARTEIRA NO MÊS .
				0,20%

Retorno e Meta Atuarial - Outubro de 2021

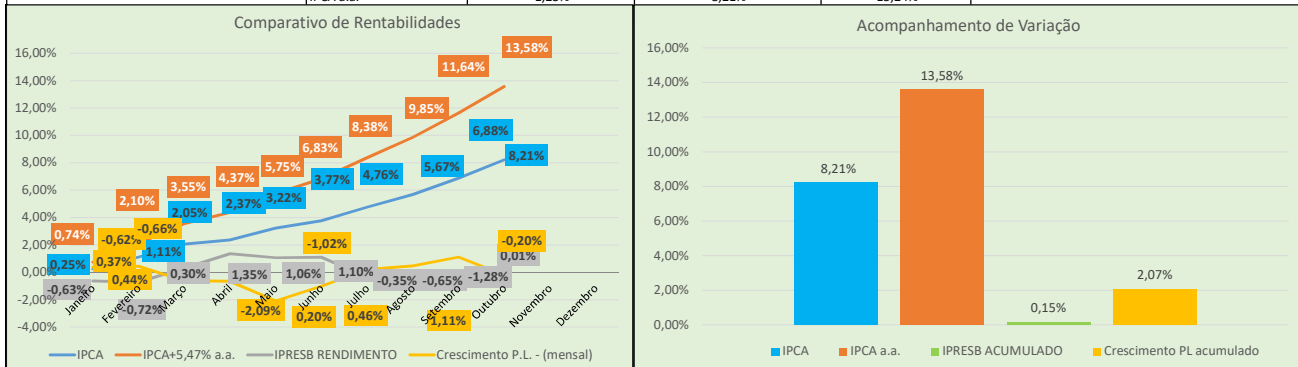
Enquadramento da Resolução CMN nº 3.922	Enquadramento	% da Carteira	Limites por Política	Enquadramento
Fundo RF - 100% Títulos do Tesouro Nacional	Artigo 7º, I, "b"	45,49%	100,00% / 20,00%	
Fundo RF - Geral	Artigo 7º, IV, "a"	15,40%	40,00% / 2,00%	
Fundo RF - FIDC - Direitos Creditórios	Artigo 7º, VII, "a"	0,56%	5,00% / 1,00%	
Fundo RV - Ações Geral	Artigo 8º, II, "a"	12,94%	20,00% / 15,20%	
Fundo RV - Multimercado	Artigo 8º, III	10,76%	10,00% / 10,00%	
Fundo RV - FIP - Participações	Artigo 8º, IV, "a"	2,71%	5,00% / 2,50%	
Fundo RV - FII - Imobiliário	Artigo 8º, IV, "b"	1,36%	5,00% / 1,30%	
Fundo RV - Investimentos no Exterior	Artigo 9º, II	8,51%	10,00% / 8,00%	
Fundo RV - Investimentos no Exterior	Artigo 9º, III	2,27%	10,00% / 2,00%	



- 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

Período	Recursos	Contribuição	Comprev	Rentabilidade Mensal	Crescimento P.L. - (mensal)	Rend Médio Trimestral	Rendim. Semestral
Janeiro	R\$ 2.361.470.713,09	R\$ 15.811.023,69	R\$ -	R\$ (15.026.025,73)	0,37%		
Fevereiro	R\$ 2.351.118.718,70	R\$ 15.659.553,52	R\$ 354.915,42	R\$ (17.033.150,43)	0,44%	-0,35%	
Março	R\$ 2.365.780.939,98	R\$ 15.783.964,81	R\$ 43.515,39	R\$ 7.131.575,37	-0,62%		-0,60%
Abril	R\$ 2.381.475.613,39	R\$ 15.784.391,13	R\$ 43.515,39	R\$ 31.989.002,77	-0,66%	1,17%	
Maio	R\$ 2.432.375.827,20	R\$ 15.907.497,19	R\$ 43.515,39	R\$ 25.280.977,46	-2,09%		
Junho	R\$ 2.457.379.432,04	R\$ 15.855.902,47	R\$ 43.515,39	R\$ 26.684.657,85	-1,02%		
Julho	R\$ 2.452.442.013,19	R\$ 15.886.213,81	R\$ 43.515,39	R\$ (8.503.595,08)	0,20%		
Agosto	R\$ 2.441.242.583,77	R\$ 15.823.341,28	R\$ 43.515,39	R\$ (15.836.362,75)	0,46%	-0,76%	
Setembro	R\$ 2.414.496.675,36	R\$ 15.803.972,65	R\$ 42.943,81	R\$ (31.352.635,47)	1,11%		
Outubro	R\$ 2.419.438.897,23	R\$ 15.876.054,89	R\$ 42.829,50	R\$ 265.290,14	-0,20%		
Novembro							
Dezembro							

DESEMPENHO E INDICADORES							
MÊS	IPCA		IPCA+5,47% a.a.		IPRESB RENDIMENTO		
	MENSAL	ACUMULADO	MENSAL	ACUMULADO	RENDIMENTO MENSAL	ACUMULADO	RENTAB. MÉDIA
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%	-1,36%	-0,99%
Março	0,93%	2,05%	1,42%	3,55%	0,30%	-1,05%	-1,01%
Abril	0,31%	2,37%	0,80%	4,37%	1,35%	0,30%	-0,69%
Maio	0,83%	3,22%	1,32%	5,75%	1,06%	1,36%	-0,28%
Junho	0,53%	3,77%	1,02%	6,83%	1,10%	2,46%	0,18%
Julho	0,96%	4,76%	1,45%	8,38%	-0,35%	2,13%	0,46%
Agosto	0,87%	5,67%	1,36%	9,85%	-0,65%	1,47%	0,58%
Setembro	1,14%	6,88%	1,63%	11,64%	-1,28%	0,14%	0,54%
Outubro	1,25%	8,21%	1,74%	13,58%	0,01%	0,15%	0,50%
Novembro							
Dezembro							



RESUMO DAS INFORMAÇÕES	
RECURSO INICIAL EM JANEIRO 2021	R\$ 2.370.321.994,20
TOTAL DE RECURSOS INVESTIDOS + SALDO EM CONTA CORRENTE	R\$ 2.419.438.882,28
TOTAL DAS CONTRIBUIÇÕES	R\$ 158.191.915,44
TOTAL DE RENDIMENTOS	R\$ 3.599.734,13
VARIÇÃO AUMENTATIVA DO P.L.	2,07%
META ATUARIAL 5,47% + 9,77% (Boletim Focus 16/11/21)	15,24%
RENDIMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS EM %	0,15%
CUMPRIMENTO DA META ATUARIAL	1,00%

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

O Instituto possui contrato com a empresa LDB Consultoria Financeira Ltda – EPP, para prestação de serviços de consultoria em investimentos, vigência: 06/2021 a 01/2022. Valor: R\$ 8.875,00 mensal (oito mil oitocentos e setenta e cinco reais). Processo: nº 015/2020.