

Relatório de Análise, Enquadramento, Rentabilidade e Risco - 30/11/2021

Retorno e Meta Atuarial - Novembro de 2021

RENTA FIXA

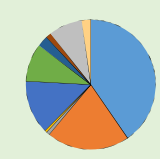
Ativo			Rentabilidade						Enquad.
CNPJ	FUNDO	Valor Anterior	Mês	Aplicação	Resgate	CUPOM/DIV	Rentabilidade	Valor do Mês	
	LFT - SET/2022	R\$ -	0,33%	R\$ 444.382.564,54	R\$ -	R\$ -	R\$ 1.468.068,84	R\$ 445.850.633,38	Art. 7º, I, a
	NTN-B (IPCA + 5,3%)	R\$ -	0,81%	R\$ 538.015.537,83	R\$ -	R\$ 8.815.710,00	R\$ 4.337.225,05	R\$ 533.537.052,88	
	SUBTOTAL	R\$ -		R\$ 982.398.102,37	R\$ -	R\$ 8.815.710,00	R\$ 5.805.293,89	R\$ 979.387.686,26	
10.740.670/0001-06	21 - CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF (ADM)	R\$ 33.974.820,06	0,77%	R\$ 373,35	R\$ 873.295,38	R\$ -	R\$ 262.119,15	R\$ 33.364.017,18	Art. 7º, I, b
10.740.670/0001-06	22 - CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF (BENEF)	R\$ 232.225.202,16	0,77%	R\$ 328.317,09	R\$ -	R\$ -	R\$ 1.813.475,77	R\$ 234.366.995,02	
11.060.913/0001-10	56 - FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	R\$ 100.262.587,56	0,97%	R\$ -	R\$ 101.232.006,85	R\$ -	R\$ 969.419,29	R\$ -	
13.322.205/0001-35	58 - BB PREVID RF IDKA 2 TP FI	R\$ 131.295.935,32	1,42%	R\$ -	R\$ 133.166.670,10	R\$ -	R\$ 1.870.734,78	R\$ -	
14.386.926/0001-71	98 - FI CAIXA BRASIL IDKA 2A TIT RF LONGO P	R\$ 101.059.563,22	0,84%	R\$ -	R\$ 101.912.255,05	R\$ -	R\$ 852.691,83	R\$ -	
23.215.097/0001-55	113 - CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 20.907.316,62	0,91%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 189.407,03	R\$ 21.096.723,65	
10.577.519/0001-90	116 - CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP	R\$ 185.120.940,84	2,19%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 4.056.468,91	R\$ 189.177.409,75	
19.418.031/0001-95	134 - ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RF L	R\$ 21.587.302,28	3,66%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 789.185,72	R\$ 22.376.488,00	
10.922.432/0001-03	135 - ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA F	R\$ 101.122.467,84	1,71%	R\$ -	R\$ 102.847.494,67	R\$ -	R\$ 1.725.026,83	R\$ -	
17.517.577/0001-78	161 - WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RF	R\$ 79.860.280,25	0,98%	R\$ -	R\$ 80.641.468,55	R\$ -	R\$ 781.188,30	R\$ -	
13.455.117/0001-01	163 - SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC F	R\$ 93.066.390,52	0,98%	R\$ -	R\$ 93.975.779,24	R\$ -	R\$ 909.388,72	R\$ -	
	SUBTOTAL	R\$ 1.100.482.806,67		R\$ 328.690,44	R\$ 614.648.969,84	R\$ -	R\$ 14.219.106,33	R\$ 500.381.633,60	Art. 7º IV, a
13.594.673/0001-69	94 - TMJ IMA-B FI RF	R\$ 4.090.083,91	1,00%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 40.830,35	R\$ 4.098.589,59	
21.838.150/0001-49	103 - ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂ	R\$ 306.842.806,07	0,58%	R\$ -	R\$ 308.610.724,28	R\$ -	R\$ 1.767.918,21	R\$ -	
26.507.132/0001-06	147 - SANTANDER RENDA FIXA ATIVO FIC FI	R\$ 61.749.603,03	0,37%	R\$ -	R\$ 61.979.546,46	R\$ -	R\$ 229.943,43	R\$ -	
05.164.358/0001-73	165 - FI CAIXA ALIANÇA TIT PUB RF - BENEF (	R\$ -	0,07%	R\$ 304.900.923,04	R\$ 289.962.146,29	R\$ -	R\$ 198.373,50	R\$ 15.137.150,25	
05.164.358/0001-73	183 - FI CAIXA ALIANÇA TIT PUB RF - ADM (16	R\$ -	0,07%	R\$ 1.417.304,36	R\$ 37.595,10	R\$ -	R\$ 43,84	R\$ 1.379.753,10	
	SUBTOTAL	R\$ 372.682.493,01		R\$ 306.318.227,40	R\$ 370.590.270,74	R\$ -	R\$ 2.237.109,33	R\$ 20.615.492,94	Art. 7º, VII, a
13.344.834/0001-66	62 - INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II	R\$ (9.706.698,04)	-0,15%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (14.616,23)	R\$ (9.721.314,27)	
17.013.985/0001-92	106 - FIDC GGR PRIME I	R\$ 23.297.338,47	-0,19%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (43.397,02)	R\$ 23.253.941,45	
	SUBTOTAL	R\$ 13.590.640,43		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (58.013,25)	R\$ 13.532.627,18	
	TOTAL RENTA FIXA	R\$ 1.486.755.940,11		R\$ 1.289.045.020,21	R\$ 985.239.240,58	R\$ 8.815.710,00	R\$ 22.203.496,30	R\$ 1.513.917.439,98	

Relatório de Análise, Enquadramento, Rentabilidade e Risco - 30/11/2021

Retorno e Meta Atuarial - Novembro de 2021

RENTA 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\$ 84.315.337,47	-3,98%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (3.357.146,10)	R\$ 80.958.191,37	Art. 8º, II, a
11.628.883/0001-03	138 - OCCAM FIC FIA	R\$ 100.726.991,34	-2,67%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (2.689.494,71)	R\$ 98.037.496,63	
34.791.108/0001-61	148 - AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONA	R\$ 38.694.997,52	-3,79%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (1.468.466,91)	R\$ 37.226.530,61	
11.977.794/0001-64	149 - BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONA	R\$ 4.060.338,42	-6,71%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (272.302,28)	R\$ 3.788.036,14	
08.621.010/0001-56	150 - BRASIL PLURAL ESTRATÉGIA FIC FIA	R\$ 4.808.457,48	-2,74%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (131.924,66)	R\$ 4.676.532,82	
30.068.169/0001-44	160 - FIC FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUA	R\$ 41.959.927,34	-0,52%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (219.606,18)	R\$ 41.740.321,16	
09.005.805/0001-00	162 - BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	R\$ 38.435.173,38	-3,26%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (1.251.856,02)	R\$ 37.183.317,36	
36.178.569/0001-99	167 - BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	R\$ -	-1,52%	R\$ 20.000.000,00	R\$ -	R\$ -	R\$ (304.222,92)	R\$ 19.695.777,08	
SUBTOTAL		R\$ 313.001.222,95		R\$ 20.000.000,00	R\$ -	R\$ -	R\$ (9.695.019,78)	R\$ 323.306.203,17	
26.269.692/0001-61	143 - ITAU PRIVATE MULTIMERCADO S&P500	R\$ 84.000.165,87	-0,51%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (427.598,67)	R\$ 83.572.567,20	Art. 8º III
30.036.235/0001-02	158 - FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA M	R\$ 89.596.129,31	-0,49%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (438.997,78)	R\$ 89.157.131,53	
17.453.850/0001-48	159 - WESTERN ASSET US INDEX 500 FIM	R\$ 86.815.948,01	0,50%	R\$ -	R\$ 40.000.000,00	R\$ -	R\$ 435.083,57	R\$ 47.251.031,58	
36.499.594/0001-74	166 - BTG PACTUAL S&P 500 BRL FIM	R\$ -	-2,05%	R\$ 10.000.000,00	R\$ -	R\$ -	R\$ (205.372,97)	R\$ 9.794.627,03	
SUBTOTAL		R\$ 260.412.243,19		R\$ 10.000.000,00	R\$ 40.000.000,00	R\$ -	R\$ (636.885,85)	R\$ 229.775.357,34	
12.312.767/0001-35	63 - BRASIL FLORESTAL - FUNDO DE INVESTIM	R\$ 9.338.055,05	-0,11%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (10.363,41)	R\$ 9.327.691,64	Art. 8º, IV, a
14.584.094/0001-06	67 - BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC FIP	R\$ 9.379.850,81	-0,09%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (8.268,61)	R\$ 9.371.582,20	
15.711.367/0001-90	88 - W7 FIP	R\$ 15.398.660,62	-0,12%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (17.820,54)	R\$ 15.380.840,08	
14.721.044/0001-15	121 - INFRA SETORIAL FUNDO DE INVESTIME	R\$ 22.373.877,40	0,00%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 2,74	R\$ 22.373.880,14	
27.782.774/0001-78	136 - KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTI	R\$ 9.041.543,84	-0,10%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (8.833,32)	R\$ 9.032.710,52	
SUBTOTAL		R\$ 65.531.987,72		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (45.283,14)	R\$ 65.486.704,58	
12.887.506/0001-43	37 - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	R\$ 320.000,00	9,07%	R\$ -	R\$ -	R\$ 776,81	R\$ 29.030,00	R\$ 349.030,00	Art. 8º, IV, b
14.423.780/0001-97	44 - ITAU - FII KII REAL	R\$ 809.446,64	-16,59%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (134.268,40)	R\$ 675.178,24	
18.369.510/0001-04	80 - FII INFRA REAL ESTATE FII	R\$ 16.055.287,81	-0,08%	R\$ -	R\$ -	R\$ 26.247,79	R\$ (13.552,37)	R\$ 15.971.741,34	
15.461.076/0001-91	105 - FII BR HOTÉIS	R\$ 15.607.212,92	-0,12%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (18.164,45)	R\$ 15.589.048,47	
SUBTOTAL		R\$ 32.791.947,37		R\$ -	R\$ -	R\$ 27.024,60	R\$ (136.955,22)	R\$ 32.584.998,05	
34.246.525/0001-23	154 - SANTANDER GO NORTH AMERICAN EQU	R\$ 36.995.904,87	-3,76%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (1.389.947,57)	R\$ 35.605.957,30	Art. 9º, II
37.308.394/0001-50	155 - SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES C	R\$ 67.015.363,66	-2,33%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (1.560.798,06)	R\$ 65.454.565,60	
37.331.365/0001-09	156 - GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 101.939.636,06	0,15%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 152.775,65	R\$ 102.092.411,71	
SUBTOTAL		R\$ 205.950.904,59		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (2.797.969,98)	R\$ 203.152.934,61	
17.502.937/0001-68	153 - CAIXA FI AÇÕES INSTITUCIONAL BDR NÍ	R\$ 54.984.249,04	-0,89%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (490.494,57)	R\$ 54.493.754,47	Art. 9º, III
SUBTOTAL		R\$ 54.984.249,04		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (490.494,57)	R\$ 54.493.754,47	
TOTAL RENDA VARIÁVEL		R\$ 932.672.554,86		R\$ 30.000.000,00	R\$ 40.000.000,00	R\$ 27.024,60	R\$ (13.802.608,54)	R\$ 908.799.952,22	

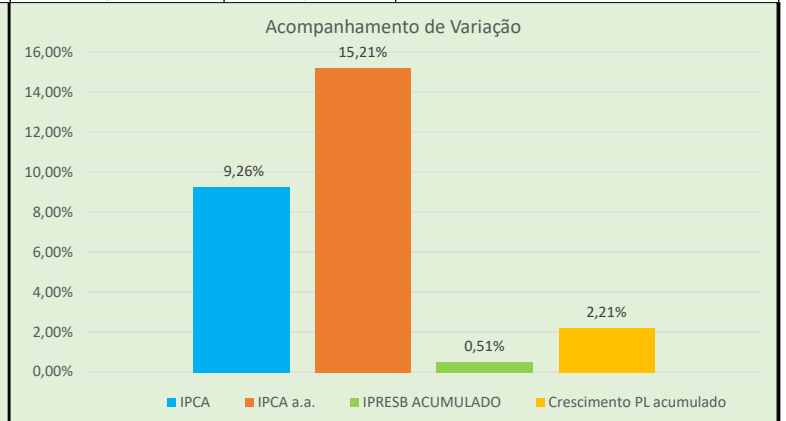
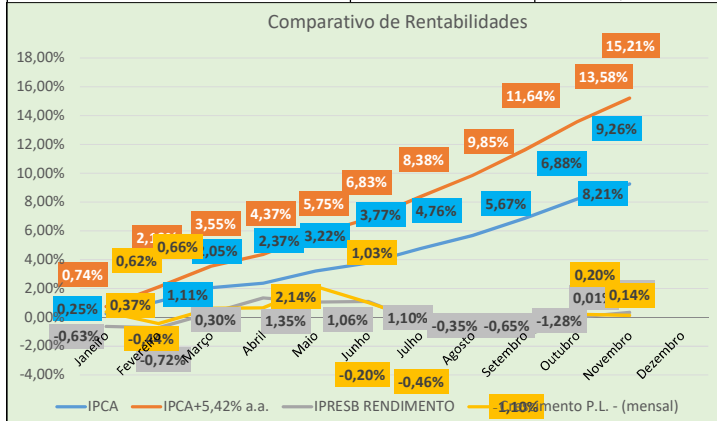
CONTA CORRENTE				Este relatório visa dar publicidade à Carteira de Investimentos do IPRESB, contendo as informações do mês.
Número	Descrição	Saldo Anterior	Saldo Atual	
15-0	Caixa Econômica Federal - 00.360.305/0001-0	R\$ 100,00	R\$ 100,00	
16-9	Caixa Econômica Federal - 00.360.305/0001-0	R\$ 10.000,00	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\$ 61,45	R\$ 4.596,90	
40104-8	Banco do Brasil - 00.000.000/0001-91	R\$ 47,75	R\$ 27,30	
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\$ 78,06	
843404	CONTA CORRENTE - XP	R\$ -	R\$ 100,00	
Total Conta Corrente		R\$ 10.387,31	R\$ 14.980,31	
Total de Recursos		R\$ 2.419.438.882,28	R\$ 2.422.732.372,51	
CRESCIMENTO DA CARTEIRA NO MÊS				0,14%

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, "a"	40,42%	100,00% / 25,00%	 - Fundo RF - 100% Títulos do Tesouro Nacional - 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
Fundo RF - 100% Títulos do Tesouro Nacional	Artigo 7º, I, "b"	20,65%	100,00% / 25,00%	
Fundo RF - Geral	Artigo 7º, IV, "a"	0,85%	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"	13,34%	20,00% / 15,20%	
Fundo RV - Multimercado	Artigo 8º, III	9,48%	10,00% / 10,00%	
Fundo RV - FIP - Participações	Artigo 8º, IV, "a"	2,70%	5,00% / 2,50%	
Fundo RV - FII - Imobiliário	Artigo 8º, IV, "b"	1,34%	5,00% / 1,30%	
Fundo RV - Investimentos no Exterior	Artigo 9º, II	8,39%	10,00% / 8,00%	
Fundo RV - Investimentos no Exterior	Artigo 9º, III	2,25%	10,00% / 2,00%	

ACOMPANHAMENTO DE RECURSOS NO ANO DE 2021							
Período	Recursos	Contribuições	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%	-0,35%	0,73%
Fevereiro	R\$ 2.351.118.718,70	R\$ 15.659.553,52	R\$ 354.915,42	R\$ (17.033.150,43)	-0,44%		
Março	R\$ 2.365.780.939,98	R\$ 15.783.964,81	R\$ 43.515,39	R\$ 7.131.575,37	0,62%		
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	2,14%		
Junho	R\$ 2.457.379.432,04	R\$ 15.855.902,47	R\$ 43.515,39	R\$ 26.684.657,85	1,03%		
Julho	R\$ 2.452.442.013,19	R\$ 15.886.213,81	R\$ 43.515,39	R\$ (8.503.595,08)	-0,20%	-0,76%	
Agosto	R\$ 2.441.242.583,77	R\$ 15.823.341,28	R\$ 43.515,39	R\$ (15.836.362,75)	-0,46%		
Setembro	R\$ 2.414.496.675,36	R\$ 15.803.972,65	R\$ 42.943,81	R\$ (31.352.635,47)	-1,10%		
Outubro	R\$ 2.419.438.897,23	R\$ 15.876.054,89	R\$ 42.829,50	R\$ 265.290,14	0,20%	-	
Novembro	R\$ 2.422.732.372,51	R\$ 31.290.727,93	R\$ 42.829,50	R\$ 8.400.887,76	0,14%		
Dezembro							

DESEMPENHO E INDICADORES							
MÊS	IPCA		IPCA+5,42% 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	0,95%	9,26%	1,44%	15,21%	0,35%	0,51%	0,50%
Dezembro							

INDICADORES DE REFERÊNCIA				
INDICADOR	MÊS	ACUMULADO	ANO (Previsto)	
IBOVESPA	-1,53%	-14,37%	IPCA+5,42% a.a.	
CDI	0,59%	3,60%		
IPCA a.a.	0,95%	9,26%		15,44%



RESUMO DAS INFORMAÇÕES	
RECURSO INICIAL EM JANEIRO 2021	R\$ 2.370.321.994,20
TOTAL DE RECURSOS INVESTIDOS + SALDO EM CONTA CORRENTE	R\$ 2.422.732.372,51
TOTAL DAS CONTRIBUIÇÕES	R\$ 189.482.643,37
TOTAL DE RENDIMENTOS	R\$ 12.000.621,89
VARIAÇÃO AUMENTATIVA DO P.L.	2,21%
META ATUARIAL 5,42% + 10,02% (Boletim Focus 27/12/21)	15,44%
RENDIMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS EM %	0,51%
CUMPRIMENTO DA META ATUARIAL	3,28%

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.