

**Relatório de Análise, Enquadramento, Rentabilidade e Risco - 31/12/2020**

**Retorno e Meta Atuarial - Dezembro de 2020**

**RENTA FIXA**

Ativo			Rentabilidade						
CNPJ	FUNDO	Valor Anterior	Mês	Aplicação	Resgate	CUPOM/DIVIDEN/	Rentabilidade	Valor do Mês	Enquad.
10.740.670/0001-06	21 - CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF (ADM)	R\$ 26.034.367,25	0,28%	R\$ 1.355.604,82	R\$ 1.202.451,69	R\$ -	R\$ 73.341,31	R\$ 26.260.861,69	Art. 7º, I, b
10.740.670/0001-06	22 - CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF (BENEF)	R\$ 826.205,92	0,14%	R\$ 45.441.474,79	R\$ 11.004.245,02	R\$ -	R\$ 64.749,59	R\$ 35.328.185,28	
13.327.340/0001-73	100 - BB PREVID RF IMA-B 5+	R\$ 113.693.897,72	7,47%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 8.498.219,54	R\$ 122.192.117,26	
10.577.503/0001-88	122 - CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ TP RF LP	R\$ 163.938.989,64	7,56%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 12.398.672,29	R\$ 176.337.661,93	
10.922.432/0001-03	135 - ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA	R\$ 71.037.653,72	1,95%	R\$ 18.000.000,00	R\$ -	R\$ -	R\$ 1.383.409,67	R\$ 90.421.063,39	
10.756.541/0001-06	144 - ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO LONGA	R\$ 130.824.643,20	7,50%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 9.817.176,16	R\$ 140.641.819,36	
19.418.031/0001-95	134 - ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RF LP	R\$ 39.537.034,34	5,12%	R\$ 15.000.000,00	R\$ -	R\$ -	R\$ 2.022.712,15	R\$ 56.559.746,49	
10.577.519/0001-90	116 - CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP	R\$ 198.297.046,94	3,04%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 6.023.466,50	R\$ 204.320.513,44	
23.215.097/0001-55	113 - CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATEGICA	R\$ 200.764.643,79	1,35%	R\$ 20.000.000,00	R\$ -	R\$ -	R\$ 2.718.568,22	R\$ 223.483.212,01	
<b>SUBTOTAL</b>		<b>R\$ 944.954.482,52</b>		<b>R\$ 99.797.079,61</b>	<b>R\$ 12.206.696,71</b>	<b>R\$ -</b>	<b>R\$ 43.000.315,43</b>	<b>R\$ 1.075.545.180,85</b>	
13.594.673/0001-69	94 - TMJ IMA-B FI RF	R\$ 7.408.117,43	0,32%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 23.912,07	R\$ 7.432.029,50	Art. 7º IV, a
21.838.150/0001-49	103 - ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA	R\$ 250.567.496,90	0,20%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 506.546,79	R\$ 251.074.043,69	
26.507.132/0001-06	147 - SANTANDER RENDA FIXA ATIVO FIC FI	R\$ 60.719.808,13	0,61%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 371.166,77	R\$ 61.090.974,90	
<b>SUBTOTAL</b>		<b>R\$ 318.695.422,46</b>		<b>R\$ -</b>	<b>R\$ -</b>	<b>R\$ -</b>	<b>R\$ 901.625,63</b>	<b>R\$ 319.597.048,09</b>	
13.344.834/0001-66	62 - INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II	R\$ (8.493.733,15)	100,00%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 8.493.733,15	R\$ -	Art. 7º, VII, a
17.013.985/0001-92	106 - FIDC GGR Prime I	R\$ 24.972.644,63	3,79%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 945.659,02	R\$ 25.918.303,65	
<b>SUBTOTAL</b>		<b>R\$ 16.478.911,48</b>		<b>R\$ -</b>	<b>R\$ -</b>	<b>R\$ -</b>	<b>R\$ 9.439.392,17</b>	<b>R\$ 25.918.303,65</b>	
<b>TOTAL RENDA FIXA</b>		<b>R\$ 1.280.128.816,46</b>		<b>R\$ 99.797.079,61</b>	<b>R\$ 12.206.696,71</b>	<b>R\$ -</b>	<b>R\$ 53.341.333,23</b>	<b>R\$ 1.421.060.532,59</b>	



Relatório de Análise, Enquadramento, Rentabilidade e Risco - 31/12/2020

Retorno e Meta Atuarial - Dezembro de 2020

RENDA VARIÁVEL											
Ativo			Rentabilidade								Enquad.
CNPJ	FUNDO	Valor Anterior (R\$)	Mês	Aplicação	Resgate	CUPOM/DIVIDEN	Rentabilidade (R\$)	Valor do Mês (R\$)			
11.392.165/0001-72	123 - AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	R\$ 85.751.186,97	6,93%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 5.938.760,34	R\$ 91.689.947,31		Art. 8º, II, a	
23.731.629/0001-07	133 - ITÁU INSTITUCIONAL AÇÕES PHOENIX F	R\$ 73.544.328,97	7,26%	R\$ -	R\$ 78.887.125,14	R\$ -	R\$ 5.342.796,17	R\$ -			
11.628.883/0001-03	138 - OCCAM FIC FIA	R\$ 105.605.833,40	10,11%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 10.675.796,16	R\$ 116.281.629,56			
08.279.304/0001-41	145 - ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 144.729.614,19	7,96%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 11.527.346,13	R\$ 156.256.960,32			
34.791.108/0001-61	148 - AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIO	R\$ 39.429.919,78	6,93%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 2.731.043,33	R\$ 42.160.963,11			
11.977.794/0001-64	149 - BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONA	R\$ 5.240.845,81	5,23%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 274.330,04	R\$ 5.515.175,85			
08.621.010/0001-56	150 - BRASIL PLURAL ESTRATÉGIA FIC FIA	R\$ 5.286.924,52	8,53%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 450.967,79	R\$ 5.737.892,31			
29.549.642/0001-26	157 - SANTANDER SELEÇÃO 30 AÇÕES FIC FI	R\$ 90.300.194,76	7,62%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 6.883.064,19	R\$ 97.183.258,95			
	<b>SUBTOTAL</b>	<b>R\$ 549.888.848,40</b>		<b>R\$ -</b>	<b>R\$ 78.887.125,14</b>	<b>R\$ -</b>	<b>R\$ 43.824.104,15</b>	<b>R\$ 514.825.827,41</b>			
03.737.188/0001-43	137 - CAIXA FI MULTIMERCADO RV30 LP	R\$ 39.968.175,84	2,56%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 1.023.453,67	R\$ 40.991.629,51		Art. 8º, III	
10.418.362/0001-50	139 - BB PREV MULTIMERCADO FDO DE INVE	R\$ 17.002.194,36	1,15%	R\$ 3.000.000,00	R\$ -	R\$ -	R\$ 195.949,19	R\$ 20.198.143,55			
15.578.417/0001-03	142 - OCCAM INSTITUCIONAL FIM II	R\$ 5.598.030,33	0,36%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 20.156,19	R\$ 5.618.186,52			
26.269.692/0001-61	143 - ITAU PRIVATE MULTIMERCADO S&P500	R\$ 47.353.224,89	3,06%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 1.447.140,53	R\$ 48.800.365,42			
35.637.151/0001-30	151 - ICATU VANGUARDA LONG BIASED FIM	R\$ 1.028.744,46	6,22%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 64.007,49	R\$ 1.092.751,95			
	<b>SUBTOTAL</b>	<b>R\$ 110.950.369,88</b>		<b>R\$ 3.000.000,00</b>	<b>R\$ -</b>	<b>R\$ -</b>	<b>R\$ 2.750.707,07</b>	<b>R\$ 116.701.076,95</b>			
12.312.767/0001-35	63 - BRASIL FLORESTAL - FUNDO DE INVESTIM	R\$ 9.431.229,81	-0,14%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (13.053,68)	R\$ 9.418.176,13		Art. 8º, IV, a	
16.676.620/0001-85	66 - FIP CAIXA CYRELA	R\$ 14.881,31	-8,79%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (1.308,24)	R\$ 13.573,07			
14.584.094/0001-06	67 - BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC FI	R\$ 10.557.519,54	2,37%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 250.495,61	R\$ 10.808.015,15			
15.711.367/0001-90	88 - W7 FIP	R\$ 15.080.684,55	-0,19%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (28.723,05)	R\$ 15.051.961,50			
14.721.044/0001-15	121 - INFRA SETORIAL FUNDO DE INVESTIME	R\$ 18.204.982,93	-0,17%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (30.829,14)	R\$ 18.174.153,79			
27.782.774/0001-78	136 - KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTI	R\$ 5.554.780,78	0,95%	R\$ 1.143.125,00	R\$ -	R\$ -	R\$ 52.550,81	R\$ 6.750.456,59			
	<b>SUBTOTAL</b>	<b>R\$ 58.844.078,92</b>		<b>R\$ 1.143.125,00</b>	<b>R\$ -</b>	<b>R\$ -</b>	<b>R\$ 229.132,31</b>	<b>R\$ 60.216.336,23</b>			
12.887.506/0001-43	37 - CAIXA FII CX TRX	R\$ 330.040,00	14,03%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 46.290,00	R\$ 376.330,00		Art. 8º, IV, b	
14.423.780/0001-97	44 - ITAU - FII KII REAL	R\$ 1.381.046,40	0,00%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 1.381.046,40			
18.369.510/0001-04	80 - FII INFRA REAL ESTATE FII	R\$ 14.884.500,31	-0,73%	R\$ -	R\$ 87.984,41	R\$ -	R\$ (108.135,82)	R\$ 14.688.380,08			
15.461.076/0001-91	105 - FII BR HOTEIS	R\$ 16.153.720,50	-2,06%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (332.007,39)	R\$ 15.821.713,11			
	<b>SUBTOTAL</b>	<b>R\$ 32.749.307,21</b>		<b>R\$ -</b>	<b>R\$ 87.984,41</b>	<b>R\$ -</b>	<b>R\$ (393.853,21)</b>	<b>R\$ 32.267.469,59</b>			
34.246.525/0001-23	154 - SANTANDER GO NORTH AMERICAN EQ	R\$ 32.457.994,48	4,61%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 1.496.430,03	R\$ 33.954.424,51		Art. 9º, II	
37.308.394/0001-50	155 - SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES C	R\$ 29.857.307,72	0,57%	R\$ 4.000.000,00	R\$ -	R\$ -	R\$ 170.071,90	R\$ 34.027.379,62			
37.331.365/0001-09	156 - GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 69.847.225,42	0,04%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 26.198,98	R\$ 69.873.424,40			
	<b>SUBTOTAL</b>	<b>R\$ 132.162.527,62</b>		<b>R\$ 4.000.000,00</b>	<b>R\$ -</b>	<b>R\$ -</b>	<b>R\$ 1.692.700,91</b>	<b>R\$ 137.855.228,53</b>			
17.502.937/0001-68	153 - CAIXA FI AÇÕES INSTITUCIONAL BDR NI	R\$ 81.742.514,82	0,79%	R\$ 5.000.000,00	R\$ -	R\$ -	R\$ 642.623,54	R\$ 87.385.138,36		Art. 9º, III	
							R\$ -	R\$ -			
							R\$ -	R\$ -			
	<b>SUBTOTAL</b>			<b>R\$ 5.000.000,00</b>	<b>R\$ -</b>	<b>R\$ -</b>	<b>R\$ 642.623,54</b>	<b>R\$ 87.385.138,36</b>			
	<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b>	<b>R\$ 966.337.646,85</b>		<b>R\$ 13.143.125,00</b>	<b>R\$ 78.975.109,55</b>	<b>R\$ -</b>	<b>R\$ 48.745.414,77</b>	<b>R\$ 949.251.077,07</b>			
CONTA CORRENTE											
Número	Descrição	Saldo Ant						Saldo Atual			
15-0	Caixa Econômica Federal - 00.360.305/0001-0	R\$ 100,00						R\$ 100,00		0,00%	
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\$ 81,03						R\$ 81,03			
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			
		<b>R\$ 10.406,89</b>						<b>R\$ 10.384,54</b>			
	<b>Total de Recursos (Mês Anterior)</b>	<b>R\$ 2.246.476.870,20</b>								CRESCIMENTO DA CARTEIRA NO MÊS DE DEZEMBRO/2020 5,51%	
	<b>Total de Recursos (Mês Atual)</b>	<b>R\$ 2.370.321.994,20</b>									

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"	45,38%	100% / 44%	<ul style="list-style-type: none"> <li>Fundo RF - 100% Títulos do Tesouro Nacional</li> <li>Fundo RF - Geral</li> <li>Fundo RF - FIDC - Direitos Creditórios</li> <li>Fundo RV - Ações Geral</li> <li>Fundo RV - Multimercado</li> <li>Fundo RV - FIP - Participações</li> <li>Fundo RV - FII - Imobiliário</li> <li>Fundo RV - Investimentos no Exterior</li> <li>Fundo RV - Investimentos no Exterior</li> </ul>
Fundo RF - Geral	Artigo 7º, IV, "a"	13,48%	40% / 14%	
Fundo RF - FIDC - Direitos Creditórios	Artigo 7º, VII, "a"	1,09%	5% / 2%	
Fundo RV - Ações Geral	Artigo 8º, II, "a"	21,72%	20% / 21%	
Fundo RV - Multimercado	Artigo 8º, III	4,92%	20% / 5%	
Fundo RV - FIP - Participações	Artigo 8º, IV, "a"	2,54%	20% / 3%	
Fundo RV - FII - Imobiliário	Artigo 8º, IV, "b"	1,36%	20% / 2%	
Fundo RV - Investimentos no Exterior	Artigo 9º, II	5,82%	10% / 6%	
Fundo RV - Investimentos no Exterior	Artigo 9º, III	3,69%	10% / 4%	

**ACOMPANHAMENTO DE RECURSOS NO ANO DE 2020**

Período	Recursos	Contribuição	Rentabilidade Mês	Crescimento P.L. - (mensal)	Rendimento Mensal	Rend Medio Trimestral	Rendim. Semestral
Janeiro	R\$ 2.285.100.608,11	R\$ 15.916.944,65	R\$ 10.000.854,69	0,79%	0,44%		
Fevereiro	R\$ 2.246.388.562,38	R\$ 15.848.374,30	R\$ (46.787.022,86)	-1,69%	-2,05%	-4,78%	
Março	R\$ 1.969.668.286,36	R\$ 15.917.531,29	R\$ (285.736.404,74)	-12,32%	-12,72%		-1,08%
Abril	R\$ 2.031.066.499,43	R\$ 15.831.484,26	R\$ 50.920.404,78	3,12%	2,59%		
Mai	R\$ 2.083.822.283,35	R\$ 15.796.467,75	R\$ 47.198.368,71	2,60%	2,32%	2,61%	
Junho	R\$ 2.151.843.412,66	R\$ 15.586.723,63	R\$ 60.671.861,69	3,26%	2,91%		
Julho	R\$ 2.240.528.869,77	R\$ 15.701.143,37	R\$ 81.703.558,08	4,12%	3,80%		
Agosto	R\$ 2.213.587.909,12	R\$ 15.809.176,58	R\$ (48.964.032,64)	-1,20%	-2,19%	-0,26%	
Setembro	R\$ 2.152.200.580,06	R\$ 16.533.757,44	R\$ (53.247.163,07)	-2,77%	-2,41%		1,24%
Outubro	R\$ 2.159.119.065,57	R\$ 15.830.228,49	R\$ (150.601,06)	0,32%	-0,01%		
Novembro	R\$ 2.246.505.407,97	R\$ 31.465.853,79	R\$ 87.877.567,66	4,05%	4,07%	2,74%	
Dezembro	R\$ 2.370.321.994,20	R\$ 15.789.473,82	R\$ 93.565.467,84	5,51%	4,16%		

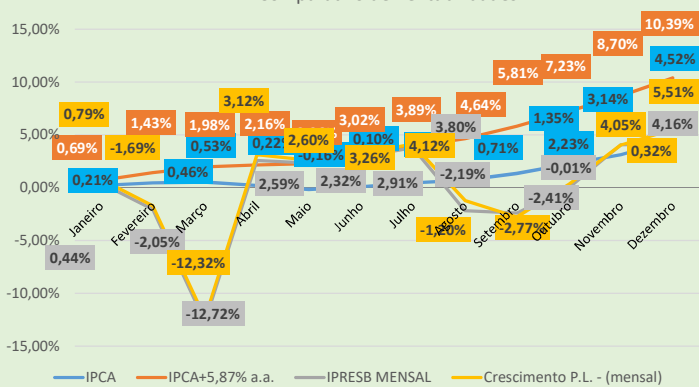
**DESEMPENHO E INDICADORES**

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%	-2,05%	-1,62%	-0,80%
Março	0,07%	0,53%	0,55%	1,98%	-12,72%	-14,13%	-4,78%
Abril	-0,31%	0,22%	0,17%	2,16%	2,59%	-11,91%	-2,94%
Mai	-0,38%	-0,16%	0,10%	2,26%	2,32%	-9,86%	-1,88%
Junho	0,26%	0,10%	0,74%	3,02%	2,91%	-7,24%	-1,08%
Julho	0,37%	0,47%	0,85%	3,89%	3,80%	-3,72%	-0,39%
Agosto	0,24%	0,71%	0,72%	4,64%	-2,19%	-5,82%	-0,61%
Setembro	0,64%	1,35%	1,12%	5,81%	-2,41%	-8,09%	-0,81%
Outubro	0,86%	2,23%	1,34%	7,23%	-0,01%	-8,09%	-0,73%
Novembro	0,89%	3,14%	1,37%	8,70%	4,07%	-4,35%	-0,29%
Dezembro	1,35%	4,52%	1,83%	10,39%	4,16%	0,25%	0,08%

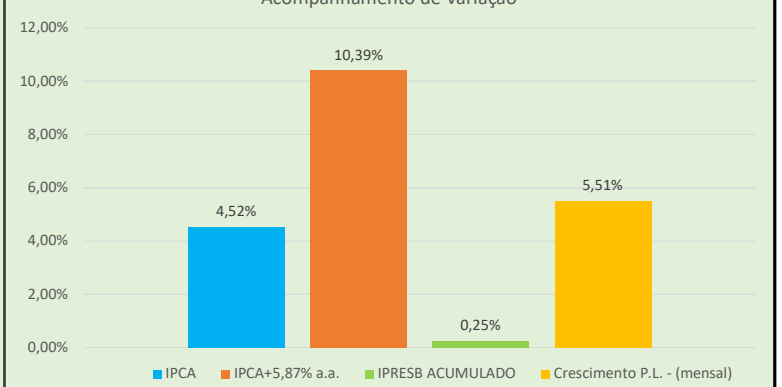
**INDICADORES DE REFERÊNCIA**

INDICADOR	MÊS	ACUMULADO	ANO (Previsto)
IBOVESPA	16,21%	-5,30%	-
CDI	0,15%	2,50%	-
IPCA+5,87% a.a.	1,83%	10,39%	7,50%

**Comparativo de Rentabilidades**



**Acompanhamento de Variação**



**RESUMO DAS INFORMAÇÕES**

RECURSO INICIAL EM JANEIRO 2020	R\$ 2.267.267.269,68
TOTAL DE RECURSOS INVESTIDOS + SALDO EM CONTA CORRENTE	R\$ 2.370.321.994,20
TOTAL DAS CONTRIBUIÇÕES 2020	R\$ 206.027.159,37
TOTAL DE RENDIMENTOS 2020	R\$ 5.574.139,14
VARIÇÃO AUMENTATIVA DO P.L.	4,55%
META ATUARIAL IPCA + 5,87% DRAA	10,39%
RENDIMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS EM % 2020	0,25%
CUMPRIMENTO DA META ATUARIAL EM 2020	2,37%

**Obs: Este relatório visa dar publicidade a Carteira de Investimentos do IPRESB, contendo as informações referentes ao mês de Dezembro/2020.**

Valor de recolhimento de contribuições creditados em Janeiro/2020 referente a Dezembro/19 no valor de R\$ 15.415.045,37 e o valor de R\$ 15.233.536,43 é referente a Dez/20 creditados em Jan/2021

Fetamos acertos nas informações de rentabilidade pois tivemos um lançamento de rentabilidade negativa no fundo 62 - INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II no mês de Agosto/2020 alterando a rentabilidade do ano.

O Instituto possui contrato com a empresa LDB Consultoria Financeira Ltda – EPP, para prestação de serviços de consultoria em investimentos, vigência: 06/2020 a 06/2021. Valor: R\$ 106.500,00 anual (cento e seis mil e quinhentos reais). Empenho: nº 321 de 15/06/2020.Processo: nº 015/2020.