

Relatório de Análise, Enquadramento, Rentabilidade e Risco - 31/12/2021

Retorno e Meta Atuarial - Dezembro de 2021

RENDA FIXA

Ativo			Rentabilidade						Enquad.
CNPJ	FUNDO	Valor Anterior	Mês	Aplicação	Resgate	CUPOM/DIV	Rentabilidade	Valor do Mês	Enquad.
	LFT - SET/2022	R\$ 445.850.633,38	0,38%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 1.708.488,46	R\$ 66.014.950,49	Art. 7º, I, a
	NTN-B (IPCA + 5,34%)	R\$ 533.537.052,88	0,97%	R\$ 643.964.638,36	R\$ -	R\$ -	R\$ 11.413.476,34	R\$ 1.188.915.167,58	
	SUBTOTAL	R\$ -		R\$ 643.964.638,36	R\$ -	R\$ -	R\$ 13.121.964,80	R\$ 1.254.930.118,07	
10.740.670/0001-06	21 - CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF (ADM)	R\$ 33.364.017,18	0,85%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 283.110,44	R\$ 33.647.127,62	Art. 7º, I, b
10.740.670/0001-06	22 - CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF (BENEF)	R\$ 234.366.995,02	0,85%	R\$ -	R\$ 234.735.800,38	R\$ -	R\$ 368.805,36	R\$ -	
23.215.097/0001-55	113 - CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 21.096.723,65	0,83%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 174.192,61	R\$ 21.270.916,26	
10.577.519/0001-90	116 - CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP	R\$ 189.177.409,75	2,27%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 4.289.579,36	R\$ 193.466.989,11	
19.418.031/0001-95	134 - ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RF L	R\$ 22.376.488,00	3,50%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 782.330,18	R\$ 23.158.818,18	
05.164.358/0001-73	165 - FI CAIXA ALIANÇA TIT PUB RF - BENEF (I	R\$ 15.137.150,25	0,74%	R\$ 51.232.309,78	R\$ 46.294.345,46	R\$ -	R\$ 194.665,07	R\$ 20.269.779,64	
05.164.358/0001-73	183 - FI CAIXA ALIANÇA TIT PUB RF - ADM (I	R\$ 1.379.753,10	0,74%	R\$ 1.411.779,51	R\$ 918.391,84	R\$ -	R\$ 9.108,10	R\$ 1.882.248,87	
	SUBTOTAL	R\$ 516.898.536,95		R\$ 52.644.089,29	R\$ 281.948.537,68	R\$ -	R\$ 6.101.791,12	R\$ 293.695.879,68	
13.594.673/0001-69	94 - TMJ IMA-B FI RF	R\$ 4.098.589,59	0,74%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 30.130,06	R\$ 4.128.719,65	Art. 7º IV, a
	SUBTOTAL	R\$ 4.098.589,59		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 30.130,06	R\$ 4.128.719,65	
13.344.834/0001-66	62 - INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II	R\$ (9.721.314,27)	0,36%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 34.848,40	R\$ (9.686.465,87)	Art. 7º,
17.013.985/0001-92	106 - FIDC GGR PRIME I	R\$ 23.253.941,45	-0,21%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (48.808,06)	R\$ 23.205.133,39	VII, a
	SUBTOTAL	R\$ 13.532.627,18		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (13.959,66)	R\$ 13.518.667,52	
	TOTAL RENDA FIXA	R\$ 1.513.917.439,98		R\$ 696.608.727,65	R\$ 281.948.537,68	R\$ -	R\$ 19.239.926,32	R\$ 1.566.273.384,92	

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\$ 80.958.191,37	2,31%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 1.873.794,57	R\$ 82.831.985,94	Art. 8º, II, a	
11.628.883/0001-03	138 - OCCAM FIC FIA	R\$ 98.037.496,63	3,49%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 3.424.209,50	R\$ 101.461.706,13		
34.791.108/0001-61	148 - AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONA	R\$ 37.226.530,61	2,22%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 826.524,27	R\$ 38.053.054,88		
11.977.794/0001-64	149 - BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONA	R\$ 3.788.036,14	-0,69%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (25.963,24)	R\$ 3.762.072,90		
08.621.010/0001-56	150 - BRASIL PLURAL ESTRATÉGIA FIC FIA	R\$ 4.676.532,82	2,34%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 109.393,92	R\$ 4.785.926,74		
30.068.169/0001-44	160 - FIC FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUA	R\$ 41.740.321,16	5,78%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 2.413.015,36	R\$ 44.153.336,52		
09.005.805/0001-00	162 - BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	R\$ 37.183.317,36	1,50%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 559.057,48	R\$ 37.742.374,84		
36.178.569/0001-99	167 - BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	R\$ 19.695.777,08	5,28%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 1.039.080,68	R\$ 20.734.857,76		
SUBTOTAL		R\$ 323.306.203,17		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 10.219.112,54	R\$ 333.525.315,71		
26.269.692/0001-61	143 - ITAU PRIVATE MULTIMERCADO S&P500	R\$ 83.572.567,20	5,54%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 4.634.034,59	R\$ 88.206.601,79		Art. 8º III
30.036.235/0001-02	158 - FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA M	R\$ 89.157.131,53	5,56%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 4.958.483,71	R\$ 94.115.615,24		
17.453.850/0001-48	159 - WESTERN ASSET US INDEX 500 FIM	R\$ 47.251.031,58	5,49%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 2.593.864,53	R\$ 49.844.896,11		
36.499.594/0001-74	166 - BTG PACTUAL S&P 500 BRL FIM	R\$ 9.794.627,03	5,48%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 536.572,33	R\$ 10.331.199,36		
SUBTOTAL		R\$ 229.775.357,34		R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 12.722.955,16	R\$ 242.498.312,50		
12.312.767/0001-35	63 - BRASIL FLORESTAL - FUNDO DE INVESTIM	R\$ 9.327.691,64	-0,08%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (7.899,58)	R\$ 9.319.792,06	Art. 8º, IV, a	
14.584.094/0001-06	67 - BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC FIA	R\$ 9.371.582,20	-0,10%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (9.001,42)	R\$ 9.362.580,78		
15.711.367/0001-90	88 - W7 FIP	R\$ 15.380.840,08	-0,13%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (20.615,37)	R\$ 15.360.224,71		
14.721.044/0001-15	121 - INFRA SETORIAL FUNDO DE INVESTIME	R\$ 22.373.880,14	16,34%	R\$ -	R\$ 3.835.816,23	R\$ -	R\$ 3.656.364,68	R\$ 22.194.428,59		
27.782.774/0001-78	136 - KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTI	R\$ 9.032.710,52	0,35%	R\$ 500.292,00	R\$ -	R\$ -	R\$ 31.685,11	R\$ 9.564.687,63		
SUBTOTAL		R\$ 65.486.704,58		R\$ 500.292,00	R\$ 3.835.816,23	R\$ -	R\$ 3.650.533,42	R\$ 65.801.713,77		
12.887.506/0001-43	37 - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	R\$ 349.030,00	-15,19%	R\$ -	R\$ -	R\$ 649,31	R\$ (53.020,00)	R\$ 296.010,00	Art. 8º, IV, b	
14.423.780/0001-97	44 - ITAU - FII KII REAL	R\$ 675.178,24	-2,84%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (19.181,20)	R\$ 655.997,04		
18.369.510/0001-04	80 - FII INFRA REAL ESTATE FII	R\$ 15.971.741,34	-52,23%	R\$ -	R\$ -	R\$ 20.998,23	R\$ (8.342.569,88)	R\$ 7.559.177,36		
15.461.076/0001-91	105 - FII BR HOTÉIS	R\$ 15.589.048,47	-2,10%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ (326.698,96)	R\$ 15.262.349,51		
SUBTOTAL		R\$ 32.584.998,05		R\$ -	R\$ -	R\$ 21.647,54	R\$ (8.741.470,04)	R\$ 23.773.533,91		
34.246.525/0001-23	154 - SANTANDER GO NORTH AMERICAN EQU	R\$ 35.605.957,30	-10,06%	R\$ -	R\$ 32.023.258,17	R\$ -	R\$ (3.582.699,13)	R\$ -	Art. 9º, II	
37.308.394/0001-50	155 - SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES C	R\$ 65.454.565,60	1,64%	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 1.073.848,11	R\$ 66.528.413,71		
37.331.365/0001-09	156 - GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 102.092.411,71	-13,16%	R\$ -	R\$ 30.000.000,00	R\$ -	R\$ (13.436.207,15)	R\$ 58.656.204,56		
17.804.792/0001-50	196 - SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR N	R\$ -	-1,14%	R\$ 32.023.336,23	R\$ -	R\$ -	R\$ (364.728,18)	R\$ 31.658.608,05		
SUBTOTAL		R\$ 203.152.934,61		R\$ 32.023.336,23	R\$ 62.023.258,17	R\$ -	R\$ (16.309.786,35)	R\$ 156.843.226,32		
17.502.937/0001-68	153 - CAIXA FI AÇÕES INSTITUCIONAL BDR NI	R\$ 54.493.754,47	0,55%	R\$ 20.000.000,00	R\$ -	R\$ -	R\$ 301.246,45	R\$ 74.795.000,92	Art. 9º, III	
SUBTOTAL		R\$ 54.493.754,47		R\$ 20.000.000,00	R\$ -	R\$ -	R\$ 301.246,45	R\$ 74.795.000,92		
TOTAL RENDA VARIÁVEL			R\$ 908.799.952,22	R\$ 52.523.628,23	R\$ 65.859.074,40	R\$ 21.647,54	R\$ 1.842.591,18	R\$ 897.237.103,13		

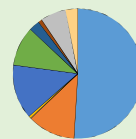
CONTA CORRENTE			
Número	Descrição	Saldo Anterior	Saldo Atual
15-0	Caixa Econômica Federal - 00.360.305/0001-0	R\$ 100,00	R\$ 100,00
16-9	Caixa Econômica Federal - 00.360.305/0001-0	R\$ 10.000,00	R\$ 10.000,00
33888-1	Itaú Unibanco - 60.701.190/0001-03	R\$ -	R\$ -
79680-7	Itaú Unibanco - 60.701.190/0001-04	R\$ 4.596,90	R\$ 33,75
40104-8	Banco do Brasil - 00.000.000/0001-91	R\$ 27,30	R\$ 47,75
98300-4	Banco Bradesco - 60.746.948/0001-12	R\$ 78,05	R\$ 51,10
130003250-0	Banco Santander - 90.400.888/0001-42	R\$ 78,06	R\$ 100,00
843404	CONTA CORRENTE - XP	R\$ 100,00	R\$ 100,02
Total Conta Corrente		R\$ 14.980,31	R\$ 10.432,62
Total de Recursos		R\$ 2.422.732.372,51	R\$ 2.463.520.920,67

Este relatório visa dar publicidade à Carteira de Investimentos do IPRESB, contendo as informações do mês. OBS.: No dia 30/11/2021 Nos foi comunicado que haveria uma remarcação a mercado do Fundo: 80 - FII INFRA REAL ESTATE FII Como consequência da determinação da CVM, a marcação da Rio Jacutinga Participações S.A. que estava registrada na carteira a valor de mercado, conforme laudo de avaliação feito por empresa independente, deverá, agora, ser registrada a valor de custo. Gerando a necessidade de lançamento de rentabilidade negativa para ajuste de saldo no período de Dezembro/21.

CRESCIMENTO DA CARTEIRA NO MÊS
1,68%

Enquadramento da Resolução CMN nº 3.922	Enquadramento	% da Carteira	Limites por Enquadramento / Política
Fundo RF - 100% Títulos do Tesouro Nacional	Artigo 7º, I, "a"	50,94%	100,00% / 25,00%
Fundo RF - 100% Títulos do Tesouro Nacional	Artigo 7º, I, "b"	11,92%	100,00% / 25,00%
Fundo RF - Geral	Artigo 7º, IV, "a"	0,17%	40,00% / 2,00%
Fundo RF - FIDC - Direitos Creditórios	Artigo 7º, VII, "a"	0,55%	5,00% / 1,00%
Fundo RV - Ações Geral	Artigo 8º, II, "a"	13,54%	20,00% / 15,20%
Fundo RV - Multimercado	Artigo 8º, III	9,84%	10,00% / 10,00%
Fundo RV - FIP - Participações	Artigo 8º, IV, "a"	2,67%	5,00% / 2,50%
Fundo RV - FII - Imobiliário	Artigo 8º, IV, "b"	0,97%	5,00% / 1,30%
Fundo RV - Investimentos no Exterior	Artigo 9º, II	6,37%	10,00% / 8,00%
Fundo RV - Investimentos no Exterior	Artigo 9º, III	3,04%	10,00% / 2,00%

% da Carteira



- 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

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\$ 354.462,28	R\$ (17.033.150,43)	-0,44%		
Março	R\$ 2.365.780.939,98	R\$ 15.783.964,81	R\$ 43.037,57	R\$ 7.131.575,37	0,62%		
Abril	R\$ 2.381.475.613,39	R\$ 15.784.391,13	R\$ 43.037,57	R\$ 31.989.002,77	0,66%	1,17%	
Maio	R\$ 2.432.375.827,20	R\$ 15.907.497,19	R\$ 43.037,57	R\$ 25.280.977,46	2,14%		
Junho	R\$ 2.457.379.432,04	R\$ 15.855.902,47	R\$ 43.037,57	R\$ 26.684.657,85	1,03%		
Julho	R\$ 2.452.442.013,19	R\$ 15.886.213,81	R\$ 43.037,57	R\$ (8.503.595,08)	-0,20%	-0,76%	
Agosto	R\$ 2.441.242.583,77	R\$ 15.823.341,28	R\$ 43.037,57	R\$ (15.836.362,75)	-0,46%		
Setembro	R\$ 2.414.496.675,36	R\$ 15.803.972,65	R\$ 42.465,99	R\$ (31.352.635,47)	-1,10%		
Outubro	R\$ 2.419.438.897,23	R\$ 15.876.054,89	R\$ 42.351,68	R\$ 265.290,14	0,20%	0,41%	
Novembro	R\$ 2.422.732.372,51	R\$ 31.290.727,93	R\$ 42.351,68	R\$ 8.427.912,36	0,14%		
Dezembro	R\$ 2.463.569.728,73	R\$ 15.584.015,90	R\$ 84.703,36	R\$ 21.104.165,04	1,68%		

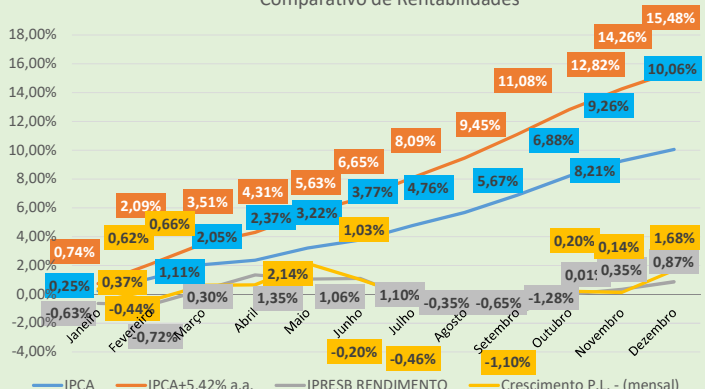
DESEMPENHO E INDICADORES

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%	2,09%	-0,72%	-1,36%	-0,99%
Março	0,93%	2,05%	1,42%	3,51%	0,30%	-1,05%	-1,01%
Abril	0,31%	2,37%	0,80%	4,31%	1,35%	0,30%	-0,69%
Maio	0,83%	3,22%	1,32%	5,63%	1,06%	1,36%	-0,28%
Junho	0,53%	3,77%	1,02%	6,65%	1,10%	2,46%	0,18%
Julho	0,96%	4,76%	1,45%	8,09%	-0,35%	2,13%	0,46%
Agosto	0,87%	5,67%	1,36%	9,45%	-0,65%	1,47%	0,58%
Setembro	1,14%	6,88%	1,63%	11,08%	-1,28%	0,14%	0,54%
Outubro	1,25%	8,21%	1,74%	12,82%	0,01%	0,15%	0,50%
Novembro	0,95%	9,26%	1,44%	14,26%	0,35%	0,51%	0,50%
Dezembro	0,73%	10,06%	1,22%	15,48%	0,87%	1,40%	0,57%

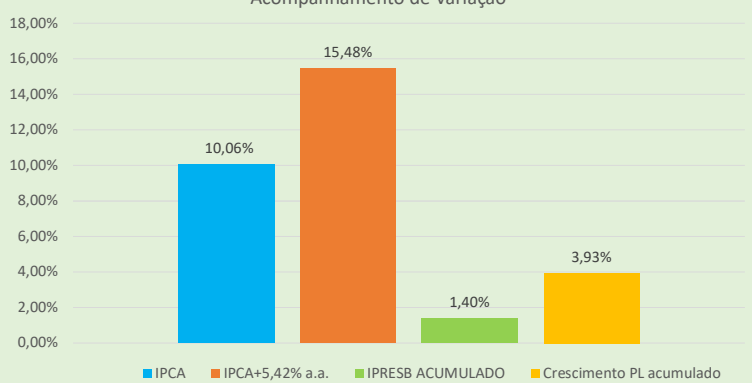
INDICADORES DE REFERÊNCIA

INDICADOR	MÊS	ACUMULADO	ANO (Previsto)
IBOVESPA	2,85%	-11,93%	IPCA+5,42% a.a.
CDI	0,77%	4,42%	
IPCA a.a.	0,73%	10,06%	

Comparativo de Rentabilidades



Acompanhamento de Variação



RESUMO DAS INFORMAÇÕES

RECURSO INICIAL EM JANEIRO 2021	R\$ 2.370.321.994,20
TOTAL DE RECURSOS INVESTIDOS + SALDO EM CONTA CORRENTE	R\$ 2.463.520.920,67
TOTAL DAS CONTRIBUIÇÕES	R\$ 205.066.659,27
TOTAL DE RENDIMENTOS	R\$ 33.131.811,53
VARIAÇÃO AUMENTATIVA DO P.L.	3,93%
META ATUARIAL	15,48%
RENDIMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS EM %	1,40%
CUMPRIMENTO DA META ATUARIAL	9,03%

Este relatório visa dar publicidade à Carteira de Investimentos do IPRESB, contendo as informações do mês. OBS.: No dia 30/11/2021 Nos foi comunicado que haveria uma remarcação a mercado do Fundo: 80 - FII INFRA REAL ESTATE FII Como consequência da determinação da CVM, a marcação da Rio Jacutinga Participações S.A. que estava registrada na carteira a valor de mercado, conforme laudo de avaliação feito por empresa independente, deverá, agora, ser registrada a valor de custo. Gerando a necessidade de lançamento de rentabilidade negativa para ajuste de saldo no período de Dezembro/21.

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.