

Relatório Analítico dos Investimentos em maio de 2016



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BRODOWSKI
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/05/2016

Carteira consolidada de investimentos - base (maio / 2016)

| Produto / Fundo | Disponibilidade Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Qtde. Cotistas | % S/ PL Fundo | RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014 |
|--|-------------------------|----------------|----------------------|-----------------------|-------------------|------------------|--------------------------------------|
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | D+0 | Não há | 8.550.296,93 | 19,69% | 1.331 | 0,09% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+1 | Não há | 11.435.109,49 | 26,33% | 728 | 0,19% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | Não há | 1.909.280,65 | 4,40% | 1.176 | 0,02% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA | D+1 | Não há | 462.525,43 | 1,07% | 12 | 0,14% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " |
| TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA | D+1471 | Não há | 284.174,59 | 0,65% | 38 | 0,23% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " |
| TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA | D+1471 | Não há | 967.296,94 | 2,23% | 39 | 0,23% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | Não há | 2.710.637,41 | 6,24% | 828 | 0,04% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 6.489.713,97 | 14,94% | 472 | 0,31% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI | D+0 | Não há | 1.132.860,47 | 2,61% | 8 | 0,27% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | Não há | 1.121.955,39 | 2,58% | 579 | 0,11% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| LEME IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR | D+1260 | 90 dias | 2.007.041,14 | 4,62% | | 1,01% | Artigo 7º, Inciso VI |
| GBX PRIME I FIDC | D+1201 | 29 dias | 1.109.999,80 | 2,56% | 31 | 0,50% | Artigo 7º, Inciso VI |
| SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO | D+91 ou D+1441 | Não há | 1.288.897,58 | 2,97% | 12 | 1,84% | Artigo 8º, Inciso IV |
| LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO | D+1 | Não há | 459.271,68 | 1,06% | 13 | 1,16% | Artigo 8º, Inciso IV |
| W7 FIP | Não se aplica | Não se aplica | 2.022.472,30 | 4,66% | 18 | 2,61% | Artigo 8º, Inciso V |
| ÁTICO RENDA FII - ATCR11 | Não se aplica | Não se aplica | 1.439.893,43 | 3,32% | | 10,47% | Artigo 8º, Inciso VI |
| CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO | D+0 | Não há | 37.397,69 | 0,09% | 14.534 | 0,00% | Desenquadrado - RF |
| | | TOTAL - | 43.428.824,89 | | | | |

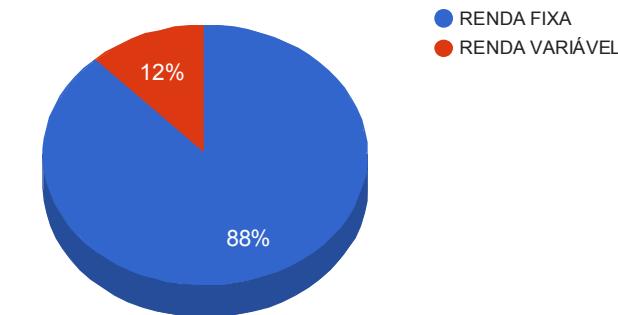


INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BRODOWSKI
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/05/2016

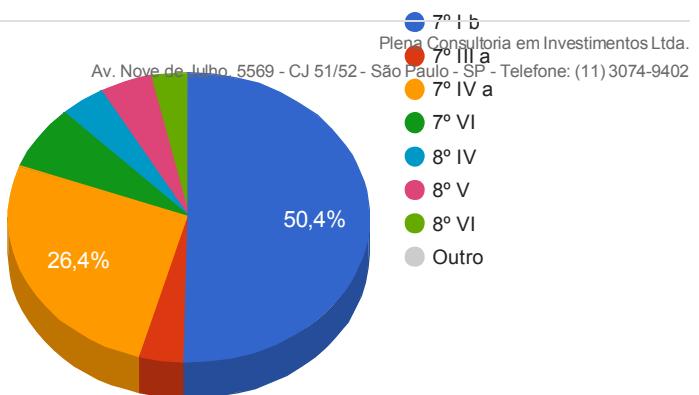
Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (maio / 2016)

| Artigos - Renda Fixa | Limite Resolução | Limite Política | Total Artigo | % Carteira | GAP Política |
|-------------------------------------|------------------|-----------------|----------------------|---------------|-------------------|
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " | 100,00% | 100,00% | 21.894.687,07 | 50,42% | 21.534.137,82 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 80,00% | 30,00% | 1.713.996,96 | 3,95% | 11.314.650,51 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " | 30,00% | 30,00% | 11.455.167,24 | 26,38% | 1.573.480,23 |
| Artigo 7º, Inciso VI | 15,00% | 15,00% | 3.117.040,94 | 7,18% | 3.397.282,79 |
| Desenquadrado - RF | 0,00% | 0,00% | 37.397,69 | 0,09% | -37.397,69 |
| Total Renda Fixa | 100,00% | 175,00 | 38.218.289,90 | 88,00% | |

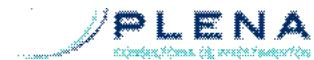
Distribuição por Segmento



| Artigos - Renda Variável | Limite Resolução | Limite Política | Total Artigo | % Carteira | GAP Política |
|-----------------------------|------------------|-----------------|---------------------|---------------|--------------|
| Artigo 8º, Inciso IV | 5,00% | 5,00% | 1.748.169,26 | 4,03% | 423.271,98 |
| Artigo 8º, Inciso V | 5,00% | 5,00% | 2.022.472,30 | 4,66% | 148.968,94 |
| Artigo 8º, Inciso VI | 5,00% | 5,00% | 1.439.893,43 | 3,32% | 731.547,81 |
| Artigo 8º, Inciso III | 15,00% | 15,00% | 0,00 | 0,00% | 6.514.323,73 |
| Total Renda Variável | 30,00% | 30,00 | 5.210.534,99 | 12,00% | |

Distribuição por Artigo / Resolução

Página 2



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BRODOWSKI

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/05/2016

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (maio / 2016)

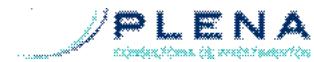
| | Mês | Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|--|-------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------|-----------|-------------------------|
| IPCA + 7,00% ao ano | 1,35% | 6,94% | 3,57% | 8,61% | 16,94% | 35,73% | - | - | - |
| LEME IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR | 1,35% | -46,36% | -45,66% | -46,66% | -43,11% | -34,10% | 1,50% | - | - |
| GBX PRIME I FIDC | 1,24% | 6,58% | 3,57% | 8,31% | 16,02% | - | 0,15% | - | 0,75% |
| CDI | 1,11% | 5,50% | 3,36% | 6,72% | 13,98% | 27,14% | - | - | - |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,14% | 5,37% | 3,27% | 6,61% | 13,95% | 27,37% | 0,20% | 0,043% | 0,17% |
| SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 1,09% | 5,39% | 3,29% | 6,60% | 13,74% | 26,66% | 0,10% | 0,036% | 0,01% |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,08% | 5,62% | 3,38% | 6,81% | 13,75% | 26,63% | 0,20% | 0,010% | 0,23% |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,07% | 5,04% | 3,08% | 6,18% | 12,96% | 25,07% | 1,00% | 0,039% | 0,08% |
| CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO | 0,69% | 3,38% | 2,08% | 4,13% | 8,44% | 15,10% | 5,00% | 0,000% | 0,01% |
| IRF-M 1 | 1,07% | 6,27% | 3,43% | 7,53% | 14,79% | 27,53% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1,05% | 6,26% | 3,42% | 7,49% | 14,65% | 27,05% | 0,20% | 0,084% | 0,49% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,04% | 6,24% | 3,41% | 7,47% | 14,52% | 26,76% | 0,10% | 0,086% | 0,51% |
| SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA | 1,00% | 5,74% | 3,44% | 7,05% | 13,98% | 27,60% | 0,50% | 0,228% | 0,50% |
| IMA-B 5 | 0,80% | 7,82% | 3,13% | 10,11% | 16,83% | 31,29% | - | - | - |
| TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA | 1,20% | - | - | - | - | - | 0,70% | 1,201% | - |
| TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA | 0,74% | 1,06% | 1,47% | -6,74% | -3,03% | 8,05% | 0,70% | 4,472% | 13,01% |
| IDKA IPCA 2 Anos | 0,63% | 7,57% | 2,45% | 9,61% | 16,89% | 32,04% | - | - | - |



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BRODOWSKI
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/05/2016

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (maio / 2016)

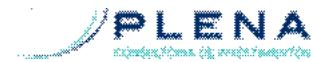
| | Mês | Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|---|-------|-------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,75% | 7,48% | 2,96% | 9,61% | 16,59% | 30,65% | 0,20% | 1,316% | 3,23% |



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BRODOWSKI
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/05/2016

Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (maio / 2016)

| | Mês | Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|--|-------|--------|---------|---------|----------------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| IFIX | 3,73% | 14,41% | 18,44% | 11,02% | 13,76% | 17,75% | - | - | - |
| ÁTICO RENDA FII - ATCR11 | 0,00% | - | 0,00% | 0,00% | - | - | 1,20% | - | - |
| CDI | 1,11% | 5,50% | 3,36% | 6,72% | 13,98% | 27,14% | - | - | - |
| LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO | 1,10% | 6,55% | 3,42% | 8,11% | -27,24% | 7,46% | 0,00% | 2,390% | 17,31% |
| IPCA | 0,78% | 4,05% | 1,83% | 5,05% | 9,32% | 18,58% | - | - | - |
| SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO | 0,46% | 4,01% | 2,51% | 5,79% | 11,99% | 25,19% | 1,70% | 0,644% | 1,97% |
| Não Informado | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| W7 FIP | - | - | - | - | - | - | 1,50% | 0,151% | 28,15% |



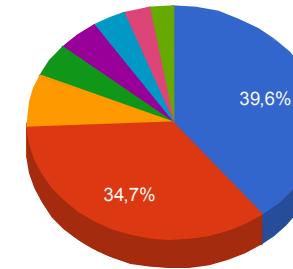
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BRODOWSKI

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/05/2016

Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (maio / 2016)

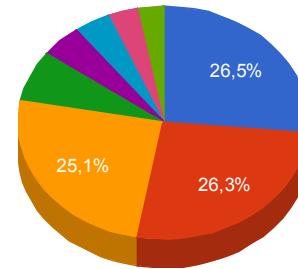
| Administrador | Valor | % |
|-------------------------------|---------------|--------|
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 17.176.982,94 | 39,55% |
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | 15.077.408,59 | 34,72% |
| GRADUAL INVESTIMENTOS | 3.188.062,69 | 7,34% |
| Santander Securities Services | 2.022.472,30 | 4,66% |
| Gradual Asset Management | 2.007.041,14 | 4,62% |
| JS Administradora Fiduciária | 1.595.385,90 | 3,67% |
| Bridge Trust | 1.251.471,53 | 2,88% |
| CM Capital Markets DTVM | 1.109.999,80 | 2,56% |

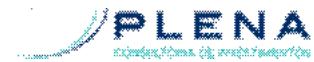
- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
- GRADUAL INVESTIMENTOS
- Santander Securities Services
- Gradual Asset Management
- JS Administradora Fiduciária
- Bridge Trust
- CM Capital Markets DTVM



| Sub-segmento | Valor | % |
|-------------------|---------------|--------|
| CDI | 11.492.564,93 | 26,46% |
| IDKA IPCA 2A | 11.435.109,49 | 26,33% |
| IRF-M 1 | 10.922.103,01 | 25,15% |
| FIDC - ABERTO | 3.117.040,94 | 7,18% |
| FIP | 2.022.472,30 | 4,66% |
| MULTIMERCADO | 1.748.169,26 | 4,03% |
| FUNDO IMOBILIÁRIO | 1.439.893,43 | 3,32% |
| IMA-B 5 | 1.251.471,53 | 2,88% |

- CDI
- IDKA IPCA 2A
- IRF-M 1
- FIDC - ABERTO
- FIP
- MULTIMERCADO
- FUNDO IMOBILIÁRIO
- IMA-B 5

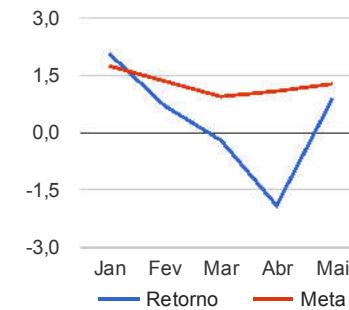
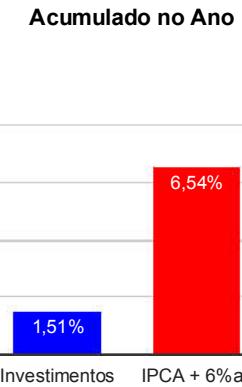




INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BRODOWSKI
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/05/2016

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

| Mês | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (\$) | Retorno (%) | Meta (%) | Gap (%) | VaR (%) |
|------------------|----------------|--------------|--------------|---------------|--------------|-------------|----------|----------|---------|
| Janeiro | 40.520.412,07 | 1.219.652,09 | 111.837,45 | 42.488.658,81 | 860.432,10 | 2,07% | 1,74% | 118,83% | 3,31% |
| Fevereiro | 42.488.658,81 | 4.637.101,41 | 4.222.136,82 | 43.201.114,16 | 297.490,76 | 0,69% | 1,34% | 51,58% | 0,83% |
| Março | 43.201.114,16 | 796.633,59 | 521.790,05 | 43.388.598,11 | -87.359,59 | -0,20% | 0,94% | -21,33% | 1,09% |
| Abril | 43.388.598,11 | 250.187,92 | 11.634,29 | 42.795.881,92 | -831.269,82 | -1,91% | 1,08% | -177,02% | 0,58% |
| Maio | 42.795.881,92 | 509.750,74 | 259.294,73 | 43.428.824,89 | 382.486,96 | 0,89% | 1,27% | 69,93% | 0,60% |
| Acumulado no ano | | | | | 621.780,41 | 1,51% | 6,54% | 23,07% | |





INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BRODOWSKI

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/05/2016

Retorno dos Investimentos apóas as movimentações (aplicações e resgates) no mês de maio / 2016

| Ativos de Renda Fixa | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | VaR - Mês (%) | Instituição(%) |
|--|----------------|------------|------------|------------------|---------------|-------------|---------------|----------------|
| LEME IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR | 1.978.893,61 | 0,00 | 0,00 | 2.007.041,14 | 28.147,53 | 1,42% | - | - |
| GBX PRIME I FIDC | 1.096.372,43 | 0,00 | 0,00 | 1.109.999,80 | 13.627,37 | 1,24% | - | 1,24% |
| TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA | 280.813,04 | 0,00 | 0,00 | 284.174,59 | 3.361,55 | 1,20% | 1,20% | 1,20% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2.680.057,46 | 0,00 | 0,00 | 2.710.637,41 | 30.579,95 | 1,14% | 0,04% | 1,14% |
| SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 1.120.660,70 | 0,00 | 0,00 | 1.132.860,47 | 12.199,77 | 1,09% | 0,04% | 1,09% |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 6.420.441,89 | 0,00 | 0,00 | 6.489.713,97 | 69.272,08 | 1,08% | 0,01% | 1,08% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 8.461.229,59 | 0,00 | 0,00 | 8.550.296,93 | 89.067,34 | 1,05% | 0,08% | 1,05% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1.889.636,07 | 0,00 | 0,00 | 1.909.280,65 | 19.644,58 | 1,04% | 0,09% | 1,04% |
| SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA | 457.967,63 | 0,00 | 0,00 | 462.525,43 | 4.557,80 | 1,00% | 0,23% | 1,00% |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 885.642,24 | 379.748,56 | 153.423,19 | 1.121.955,39 | 9.987,78 | 0,79% | 0,04% | 1,07% |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 11.349.692,66 | 0,00 | 0,00 | 11.435.109,49 | 85.416,83 | 0,75% | 1,32% | 0,75% |
| TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA | 960.158,75 | 0,00 | 0,00 | 967.296,94 | 7.138,19 | 0,74% | 4,47% | 0,74% |
| CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO | 13.164,35 | 130.002,18 | 105.871,54 | 37.397,69 | 102,70 | 0,07% | 0,00% | 0,69% |
| | | | | Total Renda Fixa | 373.103,47 | 0,99% | 0,60% | |



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BRODOWSKI
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/05/2016

Retorno dos Investimentos apóas as movimentações (aplicações e resgates) no mês de maio / 2016

| Ativos de Renda Variável | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | VaR - Mês (%) | Instituição(%) |
|--|----------------|------------|----------|----------------------|---------------|-------------|---------------|----------------|
| LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO | 454.281,00 | 0,00 | 0,00 | 459.271,68 | 4.990,68 | 1,10% | 2,39% | 1,10% |
| SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO | 1.282.973,48 | 0,00 | 0,00 | 1.288.897,58 | 5.924,10 | 0,46% | 0,64% | 0,46% |
| ÁTICO RENDA FII - ATCR11 | 1.437.991,03 | 0,00 | 0,00 | 1.439.893,43 | 1.902,40 | 0,13% | - | 0,00% |
| W7 FIP | 2.025.905,99 | 0,00 | 0,00 | 2.022.472,30 | -3.433,69 | -0,17% | 0,15% | -0,17% |
| | | | | Total Renda Variável | 9.383,49 | 0,18% | 0,59% | |

