

Relatório Analítico dos Investimentos  
em julho 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 - 29/07/2016

Carteira consolidada de investimentos - base (julho / 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	9.185.490,04	20,82%	1.325	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	11.650.712,08	26,41%	744	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.948.855,32	4,42%	1.170	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	473.073,82	1,07%	13	0,14%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+147 1	Não há	272.675,16	0,62%			Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+147 1	Não há	995.655,76	2,26%	39	0,22%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.636.195,83	15,04%	470	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	83.349,72	0,19%	576	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.158.332,29	2,63%	7	0,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.770.475,25	6,28%	811	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
GBX PRIME I FIDC	D+120 1	29 dias	1.845.497,04	4,18%	33	0,70%	Artigo 7º, Inciso VI
LEME IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+126 0	90 dias	1.977.457,02	4,48%	71	1,01%	Artigo 7º, Inciso VI
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	469.013,52	1,06%	13	1,16%	Artigo 8º, Inciso IV
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+91 ou D+144 1	Não há	1.315.008,24	2,98%	12	1,52%	Artigo 8º, Inciso IV
W7 FIP	Não se aplica	Não se aplica	2.010.555,60	4,56%	20	2,36%	Artigo 8º, Inciso V
ÁTICO RENDA FII - ATCR11	Não se aplica	Não se aplica	1.310.429,41	2,97%		9,53%	Artigo 8º, Inciso VI
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	10.230,17	0,02%	14.686	0,00%	Desenquadrado - RF
		TOTAL -	44.113.006,27				





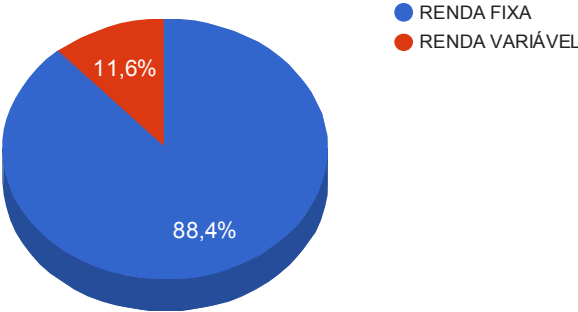
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BRODOWSKI  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 29/07/2016

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

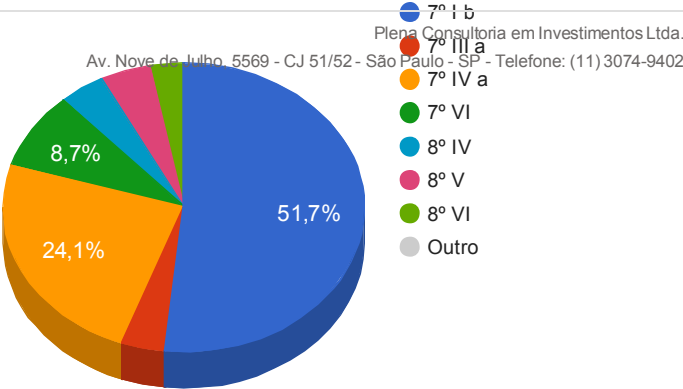
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	22.785.057,44	51,65%	21.327.948,83
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	1.741.404,74	3,95%	11.492.497,14
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	10.648.353,09	24,14%	2.585.548,79
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	15,00%	3.822.954,06	8,67%	2.793.996,88
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00%	10.230,17	0,02%	-10.230,17
Total Renda Fixa	100,00%	175,00	39.007.999,50	88,43%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	1.784.021,76	4,04%	421.628,55
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	2.010.555,60	4,56%	195.094,71
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	1.310.429,41	2,97%	895.220,90
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	6.616.950,94
Total Renda Variável	30,00%	30,00	5.105.006,77	11,57%	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução





INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BRODOWSKI  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 29/07/2016

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5	1,21%	10,15%	2,97%	6,97%	16,28%	31,52%	-	-	-
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,46%	4,02%	3,70%	1,15%	-1,35%	8,98%	0,70%	0,700%	13,03%
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-5,31%	-	-2,90%	-	-	-	0,70%	-	-

CDI	1,11%	7,90%	3,41%	6,78%	14,01%	27,78%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,13%	7,69%	3,37%	6,57%	13,85%	27,91%	0,20%	0,011%	0,17%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,10%	8,01%	3,36%	6,77%	13,78%	27,21%	0,20%	0,012%	0,22%
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,09%	7,76%	3,36%	6,65%	13,78%	27,30%	0,10%	0,000%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,05%	7,39%	3,33%	6,34%	13,09%	25,82%	1,00%	0,011%	0,08%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,69%	4,84%	2,11%	4,16%	8,50%	15,67%	5,00%	0,000%	0,00%

IPCA + 7,00% ao ano	1,09%	9,13%	3,42%	7,18%	16,29%	36,36%	-	-	-
LEME IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1,92%	-47,23%	-0,29%	-47,12%	-45,55%	-36,25%	1,50%	-	-
GBX PRIME I FIDC	1,07%	9,05%	3,59%	7,56%	15,73%	-	0,15%	0,097%	0,75%

IRF-M 1	1,04%	8,53%	3,22%	6,78%	14,68%	27,91%	-	-	-
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	1,11%	8,15%	3,30%	6,93%	14,09%	28,27%	0,50%	0,099%	0,49%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,03%	8,49%	3,17%	6,75%	14,55%	27,44%	0,20%	0,110%	0,47%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,03%	8,44%	3,13%	6,71%	14,41%	27,14%	0,10%	0,111%	0,49%

IDKA IPCA 2 Anos	0,91%	9,56%	2,49%	5,59%	15,90%	31,44%	-	-	-
------------------	-------	-------	-------	-------	--------	--------	---	---	---







INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BRODOWSKI  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 29/07/2016

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (julho / 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	1,06%	9,50%	2,65%	6,30%	15,78%	30,31%	0,20%	0,748%	3,15%





INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BRODOWSKI  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 29/07/2016

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	5,92%	23,14%	11,65%	31,24%	18,03%	23,14%	-	-	-
ÁTICO RENDA FII - ATCR11	0,00%	-	0,00%	0,00%	-	-	1,20%	-	-
CDI	1,11%	7,90%	3,41%	6,78%	14,01%	27,78%	-	-	-
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,87%	8,81%	3,24%	7,26%	-20,45%	-7,18%	0,00%	3,101%	16,26%
IPCA	0,52%	4,96%	1,66%	3,64%	8,74%	19,13%	-	-	-
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,94%	6,12%	2,50%	5,36%	12,03%	25,92%	1,70%	1,013%	2,06%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
W7 FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	0,030%	28,30%



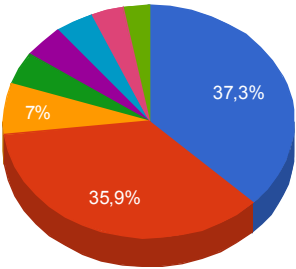


INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BRODOWSKI  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 29/07/2016

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

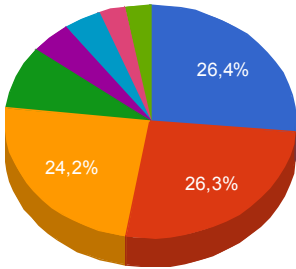
Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	16.453.392,37	37,30%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	15.831.916,04	35,89%
GRADUAL INVESTIMENTOS	3.094.451,17	7,01%
Santander Securities Services	2.010.555,60	4,56%
Gradual Asset Management	1.977.457,02	4,48%
CM Capital Markets DTVM	1.845.497,04	4,18%
JS Administradora Fiduciária	1.631.406,11	3,70%
BRIDGE TRUST	1.268.330,92	2,88%

- BB GESTÃO DE RECUR...
- CAIXA ECONÔMIC...
- GRADUAL INVESTIME...
- Santander Securities S...
- Gradual Asset Management
- CM Capital Markets DT...
- JS Administrad...
- BRIDGE TR...



Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	11.650.712,08	26,41%
IRF-M 1	11.607.419,18	26,31%
CDI	10.658.583,26	24,16%
FIDC - ABERTO	3.822.954,06	8,67%
FIP	2.010.555,60	4,56%
MULTIMERCADO	1.784.021,76	4,04%
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.310.429,41	2,97%
IMA-B 5	1.268.330,92	2,88%

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



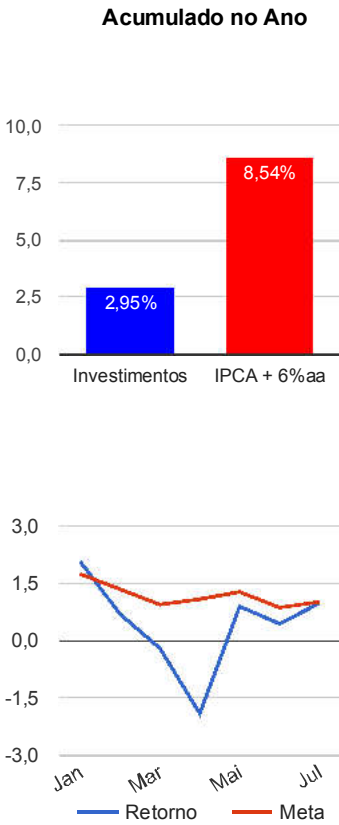




INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BRODOWSKI  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 29/07/2016

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%
Mai	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%
Junho	43.428.824,89	1.399.227,82	1.365.947,24	43.652.732,17	190.626,70	0,44%	0,86%	50,90%	1,05%
Julho	43.652.732,17	277.946,77	243.597,79	44.113.006,27	425.925,12	0,97%	1,01%	96,60%	0,34%
Acumulado no ano					1.238.332,23	2,95%	8,54%	34,52%	









INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BRODOWSKI  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 29/07/2016

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de julho / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
LEME IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.935.962,78	0,00	0,00	1.977.457,02	41.494,24	2,14%	-	-
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	981.300,22	0,00	0,00	995.655,76	14.355,54	1,46%	0,70%	1,46%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.739.509,61	0,00	0,00	2.770.475,25	30.965,64	1,13%	0,01%	1,13%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	467.871,76	0,00	0,00	473.073,82	5.202,06	1,11%	0,10%	1,11%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.564.215,78	0,00	0,00	6.636.195,83	71.980,05	1,10%	0,01%	1,10%
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.145.817,20	0,00	0,00	1.158.332,29	12.515,09	1,09%	0,00%	1,09%
GBX PRIME I FIDC	1.825.927,27	0,00	0,00	1.845.497,04	19.569,77	1,07%	0,10%	1,07%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.528.933,58	0,00	0,00	11.650.712,08	121.778,50	1,06%	0,75%	1,06%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.091.709,34	0,00	0,00	9.185.490,04	93.780,70	1,03%	0,11%	1,03%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.929.026,61	0,00	0,00	1.948.855,32	19.828,71	1,03%	0,11%	1,03%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	38.582,71	177.946,77	134.067,13	83.349,72	887,37	0,41%	0,01%	1,05%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	14.596,94	100.000,00	104.492,79	10.230,17	126,02	0,11%	0,00%	0,69%
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	287.970,47	0,00	0,00	272.675,16	-15.295,31	-5,31%	-	-
Total Renda Fixa					417.188,38	1,08%	0,30%	





INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BRODOWSKI  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 29/07/2016

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de julho / 2016

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.302.784,45	0,00	0,00	1.315.008,24	12.223,79	0,94%	1,01%	0,94%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	464.957,61	0,00	0,00	469.013,52	4.055,91	0,87%	3,10%	0,87%
W7 FIP	2.013.745,14	0,00	0,00	2.010.555,60	-3.189,54	-0,16%	0,03%	-0,16%
ÁTICO RENDA FII - ATR11	1.319.820,70	0,00	5.037,87	1.310.429,41	-4.353,42	-0,33%	-	0,00%
Total Renda Variável					8.736,74	0,17%	0,75%	

