

Relatório Analítico dos Investimentos
em agosto 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 - 31/08/2016

Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	11.800.120,51	26,45%	753	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.971.516,28	4,42%	1.176	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	9.293.415,28	20,83%	1.336	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	478.719,41	1,07%	13	0,15%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.007.888,10	2,26%	1	0,22%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	275.578,89	0,62%	35	0,24%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.805.217,47	6,29%	808	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	266.438,28	0,60%	583	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.715.429,98	15,05%	467	0,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.172.141,52	2,63%	8	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
GBX PRIME I FIDC	D+1201	29 dias	1.866.109,83	4,18%		0,70%	Artigo 7º, Inciso VI
LEME IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	1.865.226,25	4,18%	71	0,93%	Artigo 7º, Inciso VI
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+91 ou D+1441	Não há	1.306.771,49	2,93%	13	1,38%	Artigo 8º, Inciso IV
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	473.942,19	1,06%	13	1,16%	Artigo 8º, Inciso IV
W7 FIP	Não se aplica	Não se aplica	2.006.347,23	4,50%	20	2,36%	Artigo 8º, Inciso V
ÁTICO RENDA FII - ATCR11	Não se aplica	Não se aplica	1.311.645,43	2,94%		9,54%	Artigo 8º, Inciso VI
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	2.050,20	0,00%	14.737	0,00%	Desenquadrado - RF
		TOTAL -	44.618.558,34				



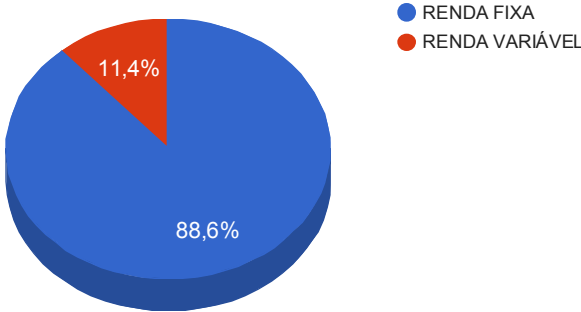
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BRODOWSKI
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/08/2016

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

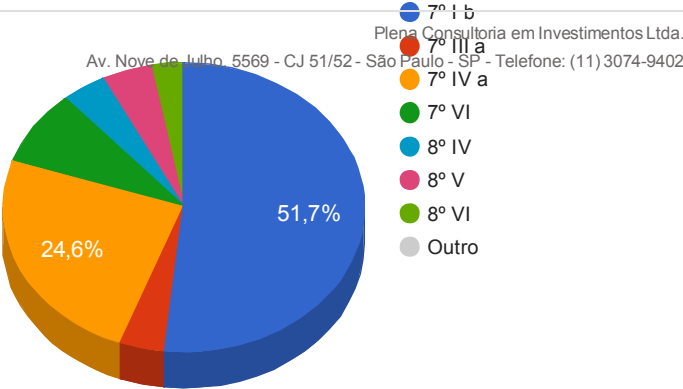
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	23.065.052,07	51,69%	21.553.506,27
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	1.762.186,40	3,95%	11.623.381,10
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	10.959.227,25	24,56%	2.426.340,25
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	15,00%	3.731.336,08	8,36%	2.961.447,67
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00%	2.050,20	0,00%	-2.050,20
Total Renda Fixa	100,00%	175,00	39.519.852,00	88,57%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	1.780.713,68	3,99%	450.214,24
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	2.006.347,23	4,50%	224.580,69
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	1.311.645,43	2,94%	919.282,49
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	6.692.783,75
Total Renda Variável	30,00%	30,00	5.098.706,34	11,43%	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução





INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BRODOWSKI
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/08/2016

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	1,29%	10,97%	3,16%	5,69%	17,70%	31,48%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,28%	10,91%	3,19%	6,25%	17,70%	30,36%	0,20%	0,755%	3,06%

CDI	1,21%	9,21%	3,52%	7,00%	14,13%	28,23%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,25%	9,04%	3,49%	6,87%	14,01%	28,38%	0,20%	0,021%	0,17%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,19%	9,30%	3,48%	6,97%	13,97%	27,77%	0,20%	0,011%	0,21%
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,19%	9,05%	3,47%	6,88%	13,89%	27,74%	0,10%	0,003%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	8,63%	3,42%	6,60%	13,22%	26,27%	1,00%	0,016%	0,08%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,75%	5,63%	2,18%	4,30%	8,57%	16,02%	5,00%	0,000%	0,00%

IRF-M 1	1,19%	9,83%	3,35%	6,89%	14,87%	28,36%	-	-	-
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	1,19%	9,44%	3,50%	7,06%	14,42%	28,64%	0,50%	0,156%	0,48%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,17%	9,76%	3,30%	6,83%	14,74%	27,89%	0,20%	0,051%	0,45%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	9,70%	3,26%	6,78%	14,60%	27,58%	0,10%	0,051%	0,47%

IMA-B 5	1,09%	11,35%	3,27%	6,50%	18,11%	31,19%	-	-	-
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,23%	5,30%	4,20%	5,73%	0,60%	8,71%	0,70%	0,776%	12,95%
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,06%	-	-3,02%	-	-	-	0,70%	0,688%	-

IPCA + 7,00% ao ano	1,06%	10,29%	3,13%	6,81%	16,60%	36,69%	-	-	-
LEME IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	2,32%	-46,01%	0,67%	-45,30%	-44,74%	-35,22%	1,50%	-	-



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BRODOWSKI
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/08/2016

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
GBX PRIME I FIDC	1,12%	10,27%	3,46%	7,16%	15,87%	-	0,15%	0,390%	0,79%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BRODOWSKI
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/08/2016

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	1,84%	25,41%	9,62%	29,83%	21,19%	25,05%	-	-	-
ÁTICO RENDA FII - ATCR11	0,00%	-	0,00%	0,00%	-	-	1,20%	-	-
CDI	1,21%	9,21%	3,52%	7,00%	14,13%	28,23%	-	-	-
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,05%	9,96%	3,19%	6,72%	-13,51%	-9,09%	0,00%	0,590%	13,19%
IPCA	0,44%	5,42%	1,32%	3,17%	8,97%	19,36%	-	-	-
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,63%	5,45%	1,39%	3,93%	10,96%	24,17%	1,70%	4,061%	3,23%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
W7 FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	0,047%	28,18%

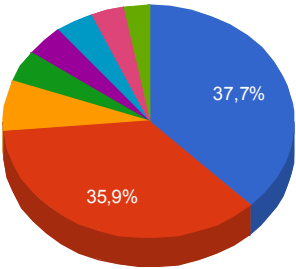


INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BRODOWSKI
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/08/2016

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

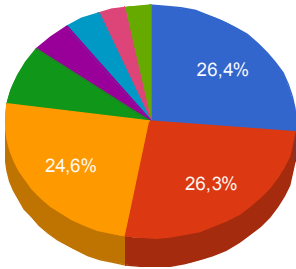
Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	16.843.292,54	37,75%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	16.010.895,46	35,88%
GRADUAL INVESTIMENTOS	3.092.359,11	6,93%
Santander Securities Services	2.006.347,23	4,50%
CM Capital Markets DTVM	1.866.109,83	4,18%
Gradual Asset Management	1.865.226,25	4,18%
JS Administradora Fiduciária	1.650.860,93	3,70%
Bridge Trust	1.283.466,99	2,88%

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



Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	11.800.120,51	26,45%
IRF-M 1	11.743.650,97	26,32%
CDI	10.961.277,45	24,57%
FIDC - ABERTO	3.731.336,08	8,36%
FIP	2.006.347,23	4,50%
MULTIMERCADO	1.780.713,68	3,99%
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.311.645,43	2,94%
IMA-B 5	1.283.466,99	2,88%

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

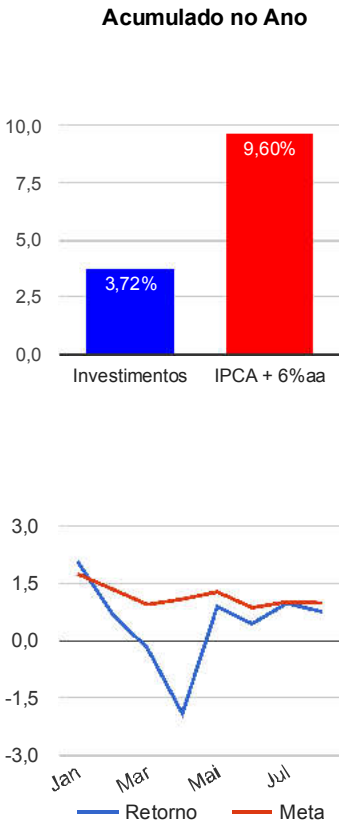




INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BRODOWSKI
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/08/2016

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%
Agosto	44.113.006,27	182.510,86	9.099,48	44.618.558,34	332.140,69	0,75%	0,98%	76,88%	0,41%
Acumulado no ano					1.570.472,92	3,72%	9,60%	38,75%	





INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BRODOWSKI
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/08/2016

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.650.712,08	0,00	0,00	11.800.120,51	149.408,43	1,28%	0,75%	1,28%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.770.475,25	0,00	0,00	2.805.217,47	34.742,22	1,25%	0,02%	1,25%
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	995.655,76	0,00	0,00	1.007.888,10	12.232,34	1,23%	0,78%	1,24%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.636.195,83	0,00	0,00	6.715.429,98	79.234,15	1,19%	0,01%	1,19%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	473.073,82	0,00	0,00	478.719,41	5.645,59	1,19%	0,16%	1,19%
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.158.332,29	0,00	0,00	1.172.141,52	13.809,23	1,19%	0,00%	1,19%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.185.490,04	0,00	0,00	9.293.415,28	107.925,24	1,17%	0,05%	1,17%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.948.855,32	0,00	0,00	1.971.516,28	22.660,96	1,16%	0,05%	1,16%
GBX PRIME I FIDC	1.845.497,04	0,00	0,00	1.866.109,83	20.612,79	1,12%	0,39%	1,12%
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	272.675,16	0,00	0,00	275.578,89	2.903,73	1,06%	0,69%	1,06%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	83.349,72	182.114,05	485,59	266.438,28	1.460,10	0,55%	0,02%	1,16%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	10.230,17	396,81	8.613,89	2.050,20	37,11	0,35%	0,00%	0,75%
LEME IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.977.457,02	0,00	0,00	1.865.226,25	-112.230,77	-5,68%	-	-
Total Renda Fixa					338.441,12	0,86%	0,30%	



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BRODOWSKI
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/08/2016

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	469.013,52	0,00	0,00	473.942,19	4.928,67	1,05%	0,59%	1,05%
ÁTICO RENDA FII - ATCR11	1.310.429,41	0,00	0,00	1.311.645,43	1.216,02	0,09%	-	0,00%
W7 FIP	2.010.555,60	0,00	0,00	2.006.347,23	-4.208,37	-0,21%	0,05%	-0,21%
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.315.008,24	0,00	0,00	1.306.771,49	-8.236,75	-0,63%	4,06%	2,78%
Total Renda Variável					-6.300,43	-0,12%	1,50%	

