

Relatório Analítico dos Investimentos
em setembro e 3º Trimestre 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 - 30/09/2016

Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.994.357,86	4,45%	1.171	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	9.280.953,58	20,70%	1.331	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	11.959.231,90	26,68%	754	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	278.498,39	0,62%	34	0,24%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	484.375,10	1,08%	12	0,15%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.020.326,93	2,28%	38	0,22%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	297.364,46	0,66%	587	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.184.838,43	2,64%	9	0,25%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.836.485,21	6,33%	801	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.774.057,21	15,11%	463	0,31%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
LEME IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	1.696.262,41	3,78%	71	0,90%	Artigo 7º, Inciso VI
GBX PRIME I FIDC	D+1201	29 dias	1.881.961,15	4,20%			Artigo 7º, Inciso VI
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	478.301,51	1,07%	13	1,16%	Artigo 8º, Inciso IV
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+91 ou D+1441	Não há	1.318.626,03	2,94%	14	0,89%	Artigo 8º, Inciso IV
W7 FIP	Não se aplica	Não se aplica	2.002.957,46	4,47%	20	2,36%	Artigo 8º, Inciso V
ÁTICO RENDA FII - ATCR11	Não se aplica	Não se aplica	1.311.645,43	2,93%		9,54%	Artigo 8º, Inciso VI
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	26.991,53	0,06%	14.773	0,00%	Desenquadrado - RF
		TOTAL -	44.827.234,59				



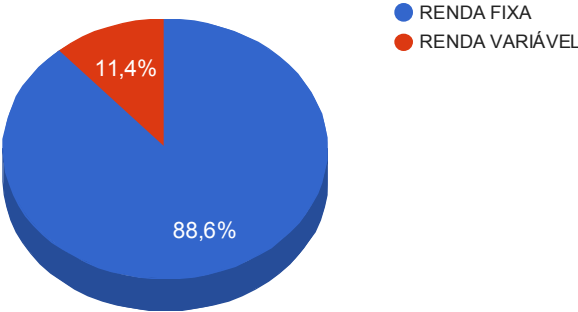
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BRODOWSKI
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/09/2016

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

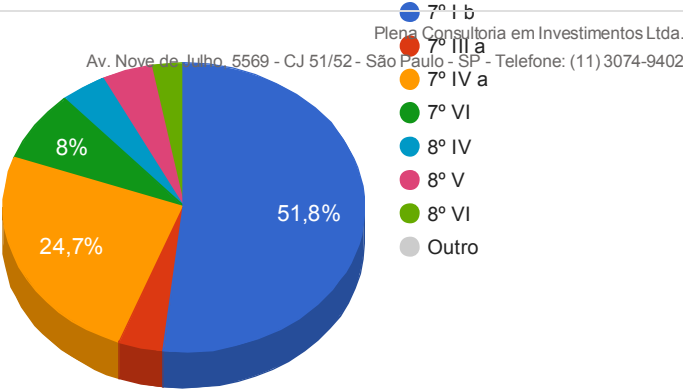
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	23.234.543,34	51,83%	21.592.691,25
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	1.783.200,42	3,98%	11.664.969,96
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	11.092.745,31	24,75%	2.355.425,07
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	15,00%	3.578.223,56	7,98%	3.145.861,63
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00%	26.991,53	0,06%	-26.991,53
Total Renda Fixa	100,00%	175,00	39.715.704,16	88,60%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	1.796.927,54	4,01%	444.434,19
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	2.002.957,46	4,47%	238.404,27
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	1.311.645,43	2,93%	929.716,30
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	6.724.085,19
Total Renda Variável	30,00%	30,00	5.111.530,43	11,40%	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução





INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BRODOWSKI
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/09/2016

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	1,50%	12,64%	3,74%	7,11%	18,43%	33,53%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,35%	12,40%	3,73%	7,12%	18,25%	32,16%	0,20%	0,558%	2,63%

IMA-B 5	1,41%	12,92%	3,76%	7,19%	18,83%	33,03%	-	-	-
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,23%	6,60%	3,98%	8,26%	1,38%	10,35%	0,70%	0,819%	12,74%
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,06%	-	-3,29%	-	-	-	0,70%	0,846%	-

IRF-M 1	1,19%	11,14%	3,46%	6,82%	15,14%	28,83%	-	-	-
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	1,18%	10,73%	3,53%	7,00%	14,60%	28,98%	0,50%	0,228%	0,39%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,17%	11,05%	3,42%	6,78%	14,99%	28,37%	0,20%	0,075%	0,40%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	10,97%	3,39%	6,72%	14,91%	28,05%	0,10%	0,076%	0,39%

CDI	1,11%	10,42%	3,47%	6,94%	14,13%	28,50%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11%	10,26%	3,54%	6,88%	14,00%	28,66%	0,20%	0,027%	0,17%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,10%	10,50%	3,43%	6,90%	14,12%	27,99%	0,20%	0,016%	0,14%
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,08%	10,23%	3,41%	6,82%	13,88%	27,98%	0,10%	0,005%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04%	9,76%	3,29%	6,59%	13,23%	26,53%	1,00%	0,016%	0,08%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,69%	6,36%	2,14%	4,26%	8,57%	16,28%	5,00%	0,000%	0,00%

IPCA + 7,00% ao ano	0,65%	11,00%	2,82%	6,41%	16,07%	35,98%	-	-	-
GBX PRIME I FIDC	0,85%	11,21%	3,07%	6,67%	15,78%	32,39%	0,15%	-	-



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BRODOWSKI
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/09/2016

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
LEME IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-6,01%	-49,25%	-1,98%	-41,86%	-48,61%	-39,75%	1,50%	-	-



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BRODOWSKI
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/09/2016

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	2,77%	28,89%	10,87%	22,29%	29,71%	27,80%	-	-	-
ÁTICO RENDA FII - ATCR11	0,00%	-	0,00%	0,00%	0,00%	-	1,20%	-	-
CDI	1,11%	10,42%	3,47%	6,94%	14,13%	28,50%	-	-	-
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,92%	10,97%	2,87%	6,28%	-4,36%	-9,02%	0,00%	0,655%	10,42%
IPCA	0,08%	5,51%	1,04%	2,81%	8,48%	18,77%	-	-	-
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,91%	6,41%	1,22%	3,85%	11,34%	24,94%	1,70%	0,433%	4,83%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
W7 FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	0,000%	28,18%

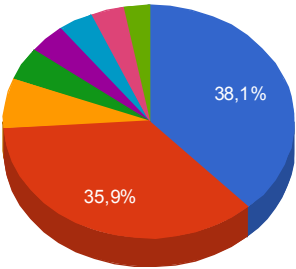


INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BRODOWSKI
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/09/2016

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

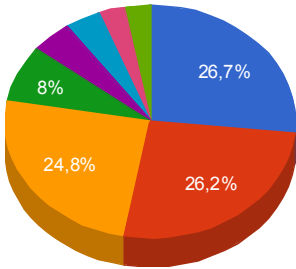
Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	17.087.439,43	38,12%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	16.082.002,32	35,88%
GRADUAL INVESTIMENTOS	3.108.572,97	6,93%
Santander Securities Services	2.002.957,46	4,47%
CM Capital Markets DTVM	1.881.961,15	4,20%
Gradual Asset Management	1.696.262,41	3,78%
JS Administradora Fiduciária	1.669.213,53	3,72%
Bridge Trust	1.298.825,32	2,90%

- 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	11.959.231,90	26,68%
IRF-M 1	11.759.686,54	26,23%
CDI	11.119.736,84	24,81%
FIDC - ABERTO	3.578.223,56	7,98%
FIP	2.002.957,46	4,47%
MULTIMERCADO	1.796.927,54	4,01%
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.311.645,43	2,93%
IMA-B 5	1.298.825,32	2,90%

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

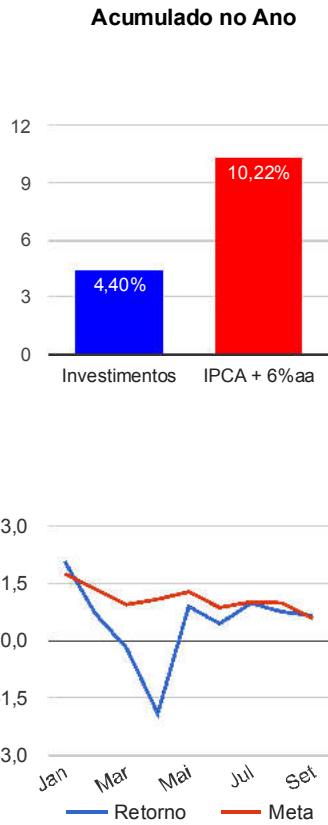




INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BRODOWSKI
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/09/2016

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%
Setembro	44.618.558,34	431.894,33	514.183,97	44.827.234,59	290.965,89	0,65%	0,57%	114,98%	0,24%
Acumulado no ano					1.861.438,81	4,40%	10,22%	43,02%	
Acumulado no 3º Trimestre					1.049.031,70	2,40%	2,57%	93,10%	





INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BRODOWSKI
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/09/2016

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de setembro / 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	11.800.120,51	0,00	0,00	11.959.231,90	159.111,39	1,35%	0,56%	1,35%
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.007.888,10	0,00	0,00	1.020.326,93	12.438,83	1,23%	0,82%	1,23%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	478.719,41	0,00	0,00	484.375,10	5.655,69	1,18%	0,23%	1,18%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.971.516,28	0,00	0,00	1.994.357,86	22.841,58	1,16%	0,08%	1,16%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.293.415,28	0,00	120.000,00	9.280.953,58	107.538,30	1,16%	0,08%	1,17%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.805.217,47	0,00	0,00	2.836.485,21	31.267,74	1,11%	0,03%	1,11%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.715.429,98	0,00	15.000,00	6.774.057,21	73.627,23	1,10%	0,02%	1,10%
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.172.141,52	0,00	0,00	1.184.838,43	12.696,91	1,08%	0,00%	1,08%
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	275.578,89	0,00	0,00	278.498,39	2.919,50	1,06%	0,85%	1,06%
GBX PRIME I FIDC	1.866.109,83	0,00	0,00	1.881.961,15	15.851,32	0,85%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	266.438,28	179.343,21	151.398,41	297.364,46	2.981,38	0,67%	0,02%	1,04%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	2.050,20	252.551,12	227.785,56	26.991,53	175,77	0,07%	0,00%	0,69%
LEME IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.865.226,25	0,00	0,00	1.696.262,41	-168.963,84	-9,06%	-	-
Total Renda Fixa					278.141,80	0,70%	0,25%	



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BRODOWSKI
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/09/2016

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	473.942,19	0,00	0,00	478.301,51	4.359,32	0,92%	0,65%	0,92%
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.306.771,49	0,00	0,00	1.318.626,03	11.854,54	0,91%	0,43%	0,91%
ÁTICO RENDA FII - ATCR11	1.311.645,43	0,00	0,00	1.311.645,43	0,00	0,00%	-	0,00%
W7 FIP	2.006.347,23	0,00	0,00	2.002.957,46	-3.389,77	-0,17%	0,00%	-0,17%
Total Renda Variável					12.824,09	0,25%	0,23%	



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BRODOWSKI
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/09/2016

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.528.933,58	0,00	0,00	11.959.231,90	430.298,32	3,73%	3,73%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.091.709,34	0,00	120.000,00	9.280.953,58	309.244,24	3,40%	3,42%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.564.215,78	0,00	15.000,00	6.774.057,21	224.841,43	3,43%	3,43%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.739.509,61	0,00	0,00	2.836.485,21	96.975,60	3,54%	3,54%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.929.026,61	0,00	0,00	1.994.357,86	65.331,25	3,39%	3,39%
GBX PRIME I FIDC	1.825.927,27	0,00	0,00	1.881.961,15	56.033,88	3,07%	3,07%
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	981.300,22	0,00	0,00	1.020.326,93	39.026,71	3,98%	3,98%
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.145.817,20	0,00	0,00	1.184.838,43	39.021,23	3,41%	3,41%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	467.871,76	0,00	0,00	484.375,10	16.503,34	3,53%	3,53%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	38.582,71	539.404,03	285.951,13	297.364,46	5.328,85	1,64%	3,29%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	14.596,94	352.947,93	340.892,24	26.991,53	338,90	0,53%	2,14%
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	287.970,47	0,00	0,00	278.498,39	-9.472,08	-3,29%	-3,29%
LEME IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.935.962,78	0,00	0,00	1.696.262,41	-239.700,37	-12,38%	-1,98%
Total Renda Fixa					1.033.771,30	2,67%	



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BRODOWSKI
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/09/2016

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.302.784,45	0,00	0,00	1.318.626,03	15.841,58	1,22%	1,22%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	464.957,61	0,00	0,00	478.301,51	13.343,90	2,87%	2,87%
ÁTICO RENDA FII - ATCR11	1.319.820,70	0,00	5.037,87	1.311.645,43	-3.137,40	-0,24%	0,00%
W7 FIP	2.013.745,14	0,00	0,00	2.002.957,46	-10.787,68	-0,54%	-
Total Renda Variável					15.260,40	0,30%	

