

Relatório Analítico dos Investimentos em abril de 2018



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



Carteira consolidada de investimentos - base (abril / 2018)

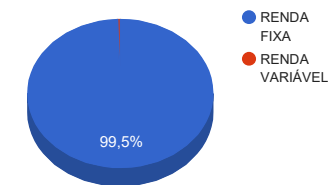
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.105,07	0,00%	589	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	938.520,81	0,31%	33	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	58.331.109,58	19,29%	740	0,91%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	58.666.329,78	19,40%	208	6,60%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	37.956.785,99	12,55%	23	10,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	10.227,10	0,00%	177	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	28.143.857,26	9,31%	59	11,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.484,15	0,00%	111	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	953.937,80	0,32%	204	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	6.990.701,50	2,31%	1.222	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	40.639.926,16	13,44%	1.411	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	28.792.819,92	9,52%	742	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	10.095.766,46	3,34%	119	0,74%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	29.411.454,57	9,73%	699	0,59%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	D+4	Não há	1.473.404,41	0,49%	903	6,41%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
TOTAL -			302.408.430,56				



Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (abril / 2018)

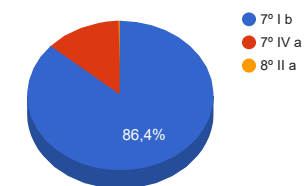
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	261.427.805,12	86,45%	60,00%	79,00%	90,00%	10.739.782,38
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	39.507.221,03	13,06%	5,00%	19,00%	40,00%	81.456.151,19
Total Renda Fixa	100,00%	300.935.026,15	99,51%	65,00	98,00	130,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	1.473.404,41	0,49%	0,00%	2,00%	5,00%	13.647.017,12
Total Renda Variável	30,00%	1.473.404,41	0,49%	0,00	2,00	5,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução





Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: abril / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	261.427.805,12	86,45%	60,00%	90,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	39.507.221,03	13,06%	5,00%	40,00%
Total Renda Fixa	300.935.026,15	99,51%	65,00	130,00

Artigos - Renda Variável	Base: abril / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	1.473.404,41	0,49%	0,00%	5,00%
Total Renda Variável	1.473.404,41	0,49%	0,00	5,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (abril / 2018)

Artigo 14º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	71.860.088,29	23,76%	0,02%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	67.378.467,66	22,28%	0,02%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	65.323.916,15	21,60%	0,00%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	58.667.813,93	19,40%	0,01%
ITAÚ UNIBANCO	39.178.144,53	12,96%	0,00%


 INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE LENÇÓIS PAULISTA - IPREM
 Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/04/2018

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (abril / 2018)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	0,82%	3,86%	3,07%	5,34%	12,30%	27,17%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,69%	3,75%	2,76%	4,94%	11,42%	25,59%	0,20%	0,324%	2,70%
CDI	0,52%	2,11%	1,52%	3,25%	8,10%	22,64%	-	-	-
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,51%	2,09%	1,50%	3,21%	8,20%	23,08%	0,20%	0,003%	0,11%
IRF-M 1	0,51%	2,32%	1,71%	3,53%	8,94%	24,04%	-	-	-
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,50%	2,24%	1,67%	3,44%	8,75%	23,48%	0,20%	0,065%	0,63%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,50%	2,26%	1,67%	3,45%	8,77%	23,56%	0,20%	0,069%	0,65%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,49%	2,25%	1,67%	3,44%	8,76%	23,60%	0,20%	0,067%	0,63%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,48%	2,23%	1,66%	3,42%	8,80%	23,83%	0,00%	0,067%	0,64%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,48%	2,24%	1,65%	3,42%	8,71%	23,41%	0,10%	0,068%	0,64%
IMA-B 5	0,42%	3,97%	2,60%	4,99%	11,65%	26,36%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,41%	3,89%	2,55%	4,89%	11,44%	25,88%	0,20%	0,481%	3,46%
IMA Geral	0,32%	3,80%	2,01%	4,72%	10,82%	28,36%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,26%	3,64%	1,93%	4,52%	10,50%	28,01%	0,20%	0,699%	4,31%
IPCA	0,22%	0,92%	0,63%	1,65%	2,76%	6,96%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,33%	3,64%	2,12%	4,60%	10,01%	-	0,40%	0,511%	5,50%
IMA-B	-0,14%	4,79%	1,34%	4,85%	10,93%	29,34%	-	-	-



Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (abril / 2018)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,15%	4,71%	1,28%	4,74%	10,66%	28,76%	0,20%	1,342%	8,97%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-0,16%	4,71%	1,30%	4,73%	10,44%	28,35%	0,20%	1,355%	8,99%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	-0,16%	4,71%	1,29%	4,74%	10,72%	28,92%	0,20%	1,354%	9,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	-0,17%	4,63%	1,23%	4,63%	10,43%	28,14%	0,40%	1,343%	8,96%

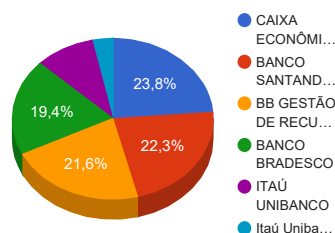
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (abril / 2018)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMOB	-5,62%	-6,61%	-10,06%	-2,42%	-0,34%	18,23%	-	-	-
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	-5,77%	-7,24%	-10,49%	-2,83%	-0,91%	13,35%	2,00%	7,820%	23,09%

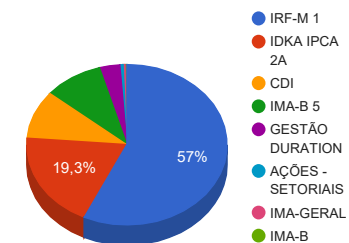


Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (abril / 2018)

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	71.860.088,29	23,76%
BANCO SANTANDER	67.378.467,66	22,28%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	65.323.916,15	21,60%
BANCO BRADESCO	58.667.813,93	19,40%
ITAÚ UNIBANCO	29.082.378,07	9,62%
Itaú Unibanco S.A.	10.095.766,46	3,34%



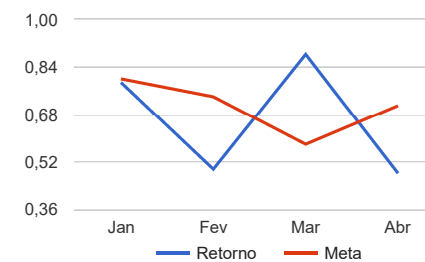
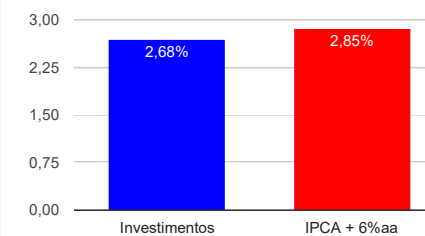
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	172.397.600,69	57,01%
IDKA IPCA 2A	58.331.109,58	19,29%
CDI	29.411.454,57	9,73%
IMA-B 5	28.792.819,92	9,52%
GESTÃO DURATION	10.095.766,46	3,34%
AÇÕES - SETORIAIS	1.473.404,41	0,49%
IMA-GERAL	953.937,80	0,32%
IMA-B	952.337,13	0,31%




Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	294.438.611,59	68.873,26	3.605.568,87	293.222.268,03	2.320.352,05	0,79%	0,80%	98,33%	0,26%
Fevereiro	293.222.268,03	4.170.004,82	1.504.664,19	297.357.068,86	1.469.460,20	0,50%	0,74%	67,26%	0,30%
Março	297.357.068,86	59.336.947,88	58.872.771,37	300.447.399,08	2.626.153,71	0,88%	0,58%	152,77%	0,43%
Abril	300.447.399,08	2.092.946,77	1.585.032,25	302.408.430,56	1.453.116,96	0,48%	0,71%	68,21%	0,21%
Acumulado no ano					7.869.082,92	2,68%	2,85%	93,71%	

Acumulado no Ano





Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de abril / 2018

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	57.219.583,44	712.946,77	0,00	58.331.109,58	398.579,37	0,69%	0,32%	0,69%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	30.840.440,16	0,00	1.585.032,25	29.411.454,57	156.046,66	0,51%	0,00%	0,51%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	58.377.276,96	0,00	0,00	58.666.329,78	289.052,82	0,50%	0,07%	0,50%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	26.626.908,07	1.380.000,00	0,00	28.143.857,26	136.949,19	0,49%	0,07%	0,50%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	40.442.599,08	0,00	0,00	40.639.926,16	197.327,08	0,49%	0,07%	0,49%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	37.774.619,17	0,00	0,00	37.956.785,99	182.166,82	0,48%	0,07%	0,48%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.957.309,01	0,00	0,00	6.990.701,50	33.392,49	0,48%	0,07%	0,48%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	28.676.598,37	0,00	0,00	28.792.819,92	116.221,55	0,41%	0,48%	0,41%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	10.062.992,89	0,00	0,00	10.095.766,46	32.773,57	0,33%	0,51%	0,33%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	951.456,38	0,00	0,00	953.937,80	2.481,42	0,26%	0,70%	0,26%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.108,24	0,00	0,00	2.105,07	-3,17	-0,15%	1,34%	-0,15%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.486,59	0,00	0,00	1.484,15	-2,44	-0,16%	1,35%	-0,16%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	10.243,98	0,00	0,00	10.227,10	-16,88	-0,16%	1,35%	-0,16%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	940.158,03	0,00	0,00	938.520,81	-1.637,22	-0,17%	1,34%	-0,17%
Total Renda Fixa					1.543.331,26	0,52%	0,17%	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de abril / 2018

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	1.563.618,71	0,00	0,00	1.473.404,41	-90.214,30	-5,77%	7,82%	-5,77%
Total Renda Variável					-90.214,30	-5,77%	7,82%	

Relatório Analítico dos Investimentos em abril de 2018



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



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE LENÇÓIS PAULISTA - IPREM
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/04/2018

Carteira consolidada de investimentos - base (abril / 2018)

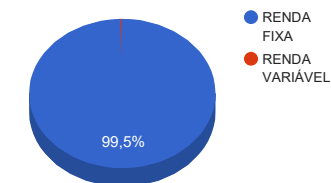
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	6.990.701,50	2,31%	1.222	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	28.792.819,92	9,52%	742	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	40.639.926,16	13,44%	1.411	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.105,07	0,00%	589	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	938.520,81	0,31%	33	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	58.666.329,78	19,40%	208	6,60%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	58.331.109,58	19,29%	740	0,91%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	37.956.785,99	12,55%	23	10,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	10.227,10	0,00%	177	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	28.143.857,26	9,31%	59	11,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.484,15	0,00%	111	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	953.937,80	0,32%	204	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	10.095.766,46	3,34%	119	0,74%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	29.411.454,57	9,73%	699	0,59%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	D+4	Não há	1.473.404,41	0,49%	903	6,41%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
		TOTAL -	302.408.430,56				



Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (abril / 2018)

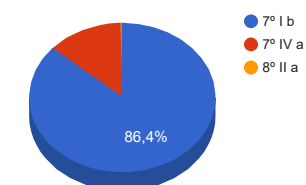
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	261.427.805,12	86,45%	60,00%	79,00%	90,00%	10.739.782,38
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	39.507.221,03	13,06%	5,00%	19,00%	40,00%	81.456.151,19
Total Renda Fixa	100,00%	300.935.026,15	99,51%	65,00	98,00	130,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	1.473.404,41	0,49%	0,00%	2,00%	5,00%	13.647.017,12
Total Renda Variável	30,00%	1.473.404,41	0,49%	0,00	2,00	5,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução





Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: abril / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	261.427.805,12	86,45%	60,00%	90,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	39.507.221,03	13,06%	5,00%	40,00%
Total Renda Fixa	300.935.026,15	99,51%	65,00	130,00

Artigos - Renda Variável	Base: abril / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	1.473.404,41	0,49%	0,00%	5,00%
Total Renda Variável	1.473.404,41	0,49%	0,00	5,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (abril / 2018)

Artigo 14º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	71.860.088,29	23,76%	0,02%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	67.378.467,66	22,28%	0,02%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	65.323.916,15	21,60%	0,00%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	58.667.813,93	19,40%	0,01%
ITAÚ UNIBANCO	39.178.144,53	12,96%	0,00%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE LENÇÓIS PAULISTA - IPREM
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/04/2018

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (abril / 2018)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	0,82%	3,86%	3,07%	5,34%	12,30%	27,17%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,69%	3,75%	2,76%	4,94%	11,42%	25,59%	0,20%	0,324%	2,70%
CDI	0,52%	2,11%	1,52%	3,25%	8,10%	22,64%	-	-	-
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,51%	2,09%	1,50%	3,21%	8,20%	23,08%	0,20%	0,003%	0,11%
IRF-M 1	0,51%	2,32%	1,71%	3,53%	8,94%	24,04%	-	-	-
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,50%	2,24%	1,67%	3,44%	8,75%	23,48%	0,20%	0,065%	0,63%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,50%	2,26%	1,67%	3,45%	8,77%	23,56%	0,20%	0,069%	0,65%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,49%	2,25%	1,67%	3,44%	8,76%	23,60%	0,20%	0,067%	0,63%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,48%	2,23%	1,66%	3,42%	8,80%	23,83%	0,00%	0,067%	0,64%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,48%	2,24%	1,65%	3,42%	8,71%	23,41%	0,10%	0,068%	0,64%
IMA-B 5	0,42%	3,97%	2,60%	4,99%	11,65%	26,36%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,41%	3,89%	2,55%	4,89%	11,44%	25,88%	0,20%	0,481%	3,46%
IMA Geral	0,32%	3,80%	2,01%	4,72%	10,82%	28,36%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,26%	3,64%	1,93%	4,52%	10,50%	28,01%	0,20%	0,699%	4,31%
IPCA	0,22%	0,92%	0,63%	1,65%	2,76%	6,96%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,33%	3,64%	2,12%	4,60%	10,01%	-	0,40%	0,511%	5,50%
IMA-B	-0,14%	4,79%	1,34%	4,85%	10,93%	29,34%	-	-	-


Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (abril / 2018)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,15%	4,71%	1,28%	4,74%	10,66%	28,76%	0,20%	1,342%	8,97%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-0,16%	4,71%	1,30%	4,73%	10,44%	28,35%	0,20%	1,355%	8,99%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	-0,16%	4,71%	1,29%	4,74%	10,72%	28,92%	0,20%	1,354%	9,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	-0,17%	4,63%	1,23%	4,63%	10,43%	28,14%	0,40%	1,343%	8,96%

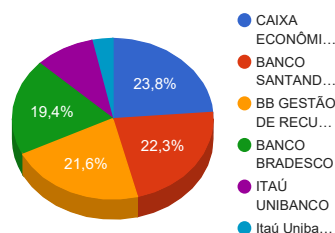

Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (abril / 2018)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMOB	-5,62%	-6,61%	-10,06%	-2,42%	-0,34%	18,23%	-	-	-
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	-5,77%	-7,24%	-10,49%	-2,83%	-0,91%	13,35%	2,00%	7,820%	23,09%

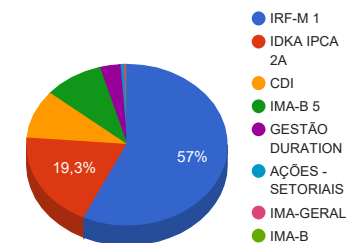


Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (abril / 2018)

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	71.860.088,29	23,76%
BANCO SANTANDER	67.378.467,66	22,28%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	65.323.916,15	21,60%
BANCO BRADESCO	58.667.813,93	19,40%
ITAÚ UNIBANCO	29.082.378,07	9,62%
Itaú Unibanco S.A.	10.095.766,46	3,34%



Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	172.397.600,69	57,01%
IDKA IPCA 2A	58.331.109,58	19,29%
CDI	29.411.454,57	9,73%
IMA-B 5	28.792.819,92	9,52%
GESTÃO DURATION	10.095.766,46	3,34%
AÇÕES - SETORIAIS	1.473.404,41	0,49%
IMA-GERAL	953.937,80	0,32%
IMA-B	952.337,13	0,31%

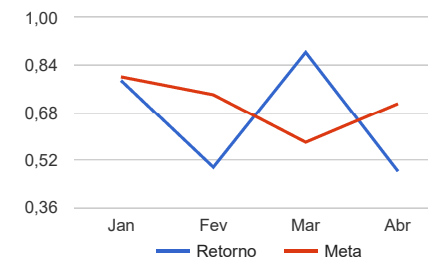
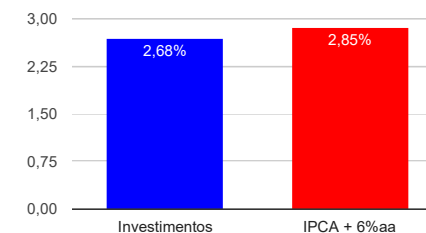




Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	294.438.611,59	68.873,26	3.605.568,87	293.222.268,03	2.320.352,05	0,79%	0,80%	98,33%	0,26%
Fevereiro	293.222.268,03	4.170.004,82	1.504.664,19	297.357.068,86	1.469.460,20	0,50%	0,74%	67,26%	0,30%
Março	297.357.068,86	59.336.947,88	58.872.771,37	300.447.399,08	2.626.153,71	0,88%	0,58%	152,77%	0,43%
Abril	300.447.399,08	2.092.946,77	1.585.032,25	302.408.430,56	1.453.116,96	0,48%	0,71%	68,21%	0,21%
Acumulado no ano					7.869.082,92	2,68%	2,85%	93,71%	

Acumulado no Ano





Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de abril / 2018

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	57.219.583,44	712.946,77	0,00	58.331.109,58	398.579,37	0,69%	0,32%	0,69%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	30.840.440,16	0,00	1.585.032,25	29.411.454,57	156.046,66	0,51%	0,00%	0,51%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	58.377.276,96	0,00	0,00	58.666.329,78	289.052,82	0,50%	0,07%	0,50%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	26.626.908,07	1.380.000,00	0,00	28.143.857,26	136.949,19	0,49%	0,07%	0,50%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	40.442.599,08	0,00	0,00	40.639.926,16	197.327,08	0,49%	0,07%	0,49%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	37.774.619,17	0,00	0,00	37.956.785,99	182.166,82	0,48%	0,07%	0,48%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.957.309,01	0,00	0,00	6.990.701,50	33.392,49	0,48%	0,07%	0,48%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	28.676.598,37	0,00	0,00	28.792.819,92	116.221,55	0,41%	0,48%	0,41%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	10.062.992,89	0,00	0,00	10.095.766,46	32.773,57	0,33%	0,51%	0,33%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	951.456,38	0,00	0,00	953.937,80	2.481,42	0,26%	0,70%	0,26%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.108,24	0,00	0,00	2.105,07	-3,17	-0,15%	1,34%	-0,15%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.486,59	0,00	0,00	1.484,15	-2,44	-0,16%	1,35%	-0,16%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	10.243,98	0,00	0,00	10.227,10	-16,88	-0,16%	1,35%	-0,16%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	940.158,03	0,00	0,00	938.520,81	-1.637,22	-0,17%	1,34%	-0,17%
Total Renda Fixa					1.543.331,26	0,52%	0,17%	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de abril / 2018

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	1.563.618,71	0,00	0,00	1.473.404,41	-90.214,30	-5,77%	7,82%	-5,77%
Total Renda Variável					-90.214,30	-5,77%	7,82%	