

## Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2017



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 - 31/01/2017

## Carteira consolidada de investimentos - base (janeiro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	55.185,97	0,02%	114	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	53.545.611,64	20,81%	714	0,97%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	54.402.727,88	21,15%	193	8,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	54.372.934,02	21,14%	728	1,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	55.225,73	0,02%	604	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	55.254,93	0,02%	133	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	23.622,34	0,01%	1.181	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	831.872,38	0,32%	200	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	842.576,92	0,33%	54	0,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	28.356,75	0,01%	1.347	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	14.819.318,42	5,76%	23	4,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.341.941,93	0,52%	38	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	34.122.347,33	13,26%	125	2,43%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	37.773.497,87	14,68%	1.331	0,65%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	D+4	Não há	1.396.916,58	0,54%	601	13,76%	Artigo 8º, Inciso III
SANTANDER SMALL CAP FI AÇÕES	D+4	Não há	1.891.452,37	0,74%	1.099	5,71%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.686.479,89	0,66%	276	6,35%	Artigo 8º, Inciso III
		<b>TOTAL -</b>	<b>257.245.322,95</b>				

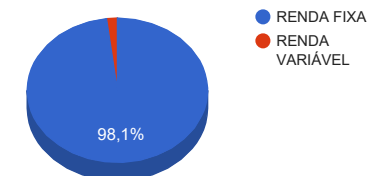


## Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (janeiro / 2017)

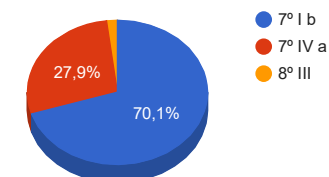
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	180.374.628,91	70,12%	50,00%	78,00%	90,00%	51.146.161,75
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	71.895.845,20	27,95%	1,00%	20,00%	30,00%	5.277.751,69
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>252.270.474,11</b>	<b>98,07%</b>	<b>51,00</b>	<b>98,00</b>	<b>120,00</b>	<b>-</b>

Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	4.974.848,84	1,93%	0,00%	2,00%	3,00%	2.742.510,85
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>4.974.848,84</b>	<b>1,93%</b>	<b>0,00</b>	<b>2,00</b>	<b>3,00</b>	<b>-</b>

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução




Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: janeiro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	180.374.628,91	70,12%	50,00%	90,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	71.895.845,20	27,95%	1,00%	30,00%
Total Renda Fixa	252.270.474,11	98,07%	51,00	120,00

Artigos - Renda Variável	Base: janeiro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso III	4.974.848,84	1,93%	0,00%	3,00%
Total Renda Variável	4.974.848,84	1,93%	0,00	3,00



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE LENÇÓIS PAULISTA - IPREM  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/01/2017

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (janeiro / 2017)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	1,87%	1,87%	3,55%	6,79%	24,76%	34,25%	-	-	-
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	1,85%	1,85%	3,49%	6,76%	24,63%	33,92%	0,20%	3,341%	7,49%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,84%	1,84%	3,47%	6,69%	24,54%	33,54%	0,20%	3,342%	7,49%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	1,83%	1,83%	3,42%	6,52%	24,13%	32,99%	0,40%	3,339%	7,47%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,81%	1,81%	3,51%	6,68%	24,49%	33,16%	0,20%	3,355%	7,50%
IMA Geral	1,80%	1,80%	3,72%	7,35%	20,74%	31,83%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,76%	1,76%	3,74%	7,51%	20,69%	31,16%	0,20%	1,571%	3,69%
IRF-M 1	1,29%	1,29%	3,58%	7,06%	14,32%	29,93%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,26%	1,26%	3,49%	6,90%	14,07%	29,23%	0,10%	0,297%	0,32%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,26%	1,26%	3,50%	6,95%	14,17%	29,47%	0,20%	0,288%	0,31%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,26%	1,26%	3,53%	6,97%	14,20%	29,57%	0,00%	0,295%	0,35%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,26%	1,26%	3,49%	6,90%	13,96%	29,19%	0,20%	0,294%	0,32%
BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,25%	1,25%	3,48%	6,93%	14,08%	29,39%	0,20%	0,297%	0,32%
IMA-B 5	1,16%	1,16%	2,97%	6,05%	13,45%	32,16%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,14%	1,14%	2,92%	5,95%	13,21%	31,19%	0,20%	1,254%	2,49%
IDKA IPCA 2 Anos	1,09%	1,09%	2,97%	6,30%	12,25%	32,94%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,08%	1,08%	2,89%	6,06%	12,74%	31,45%	0,20%	1,089%	2,32%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE LENÇÓIS PAULISTA - IPREM  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/01/2017

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (janeiro / 2017)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	1,08%	1,08%	3,28%	6,80%	14,03%	29,29%	-	-	-
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,10%	1,10%	3,31%	6,84%	14,09%	29,50%	0,20%	0,013%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	1,08%	1,08%	3,28%	6,81%	14,10%	29,50%	0,18%	0,015%	0,03%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE LENÇÓIS PAULISTA - IPREM  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/01/2017

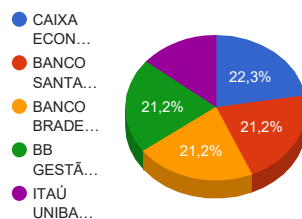
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (janeiro / 2017)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMOB	16,67%	16,67%	4,84%	1,36%	51,01%	33,86%	-	-	-
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	15,99%	15,99%	4,40%	0,05%	42,02%	27,23%	2,00%	13,320%	24,31%
SMLL	11,42%	11,42%	1,47%	8,88%	60,49%	29,60%	-	-	-
SANTANDER SMALL CAP FI AÇÕES	9,36%	9,36%	-0,56%	3,80%	34,92%	29,26%	3,00%	8,563%	19,25%
Ibovespa	7,38%	7,38%	-0,39%	12,85%	60,05%	37,87%	-	-	-
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	5,56%	5,56%	-3,22%	-0,08%	51,11%	11,55%	2,00%	8,357%	22,93%

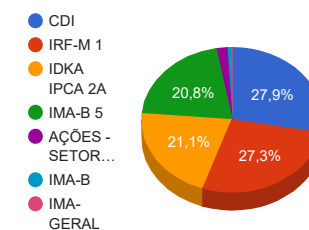


Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (janeiro / 2017)

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	57.489.237,24	22,35%
BANCO SANTANDER	54.539.523,59	21,20%
BANCO BRADESCO	54.457.913,85	21,17%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	54.451.782,09	21,17%
ITAÚ UNIBANCO	36.306.866,18	14,11%



Sub-segmento	Valor	%
CDI	71.895.845,20	27,95%
IRF-M 1	70.116.602,31	27,26%
IDKA IPCA 2A	54.372.934,02	21,14%
IMA-B 5	53.545.611,64	20,81%
AÇÕES - SETORIAIS	4.974.848,84	1,93%
IMA-B	1.507.608,56	0,59%
IMA-GERAL	831.872,38	0,32%



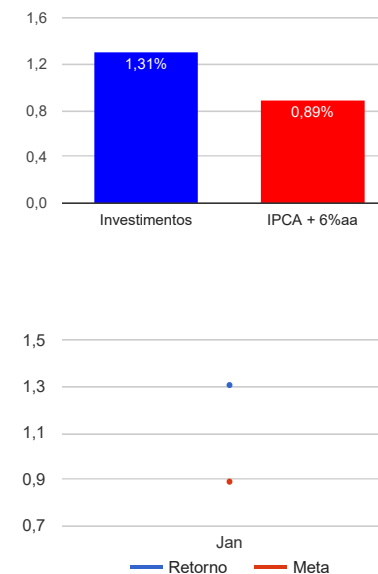




Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	253.999.149,20	1.138.042,80	1.209.982,56	257.245.322,95	3.318.113,51	1,31%	0,89%	146,78%	0,79%
Acumulado no ano					3.318.113,51	1,31%	0,89%	146,78%	

**Acumulado no Ano**





## Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de janeiro / 2017

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	54.249,00	0,00	0,00	55.254,93	1.005,93	1,85%	3,34%	1,85%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	54.225,64	0,00	0,00	55.225,73	1.000,09	1,84%	3,34%	1,84%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	1.317.840,24	0,00	0,00	1.341.941,93	24.101,69	1,83%	3,34%	1,83%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	54.203,96	0,00	0,00	55.185,97	982,01	1,81%	3,35%	1,81%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	817.522,21	0,00	0,00	831.872,38	14.350,17	1,76%	1,57%	1,76%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	23.328,40	0,00	0,00	23.622,34	293,94	1,26%	0,30%	1,26%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	28.004,25	0,00	0,00	28.356,75	352,50	1,26%	0,29%	1,26%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.635.403,51	0,00	0,00	14.819.318,42	183.914,91	1,26%	0,30%	1,26%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	832.126,46	0,00	0,00	842.576,92	10.450,46	1,26%	0,29%	1,26%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	53.731.236,72	0,00	0,00	54.402.727,88	671.491,16	1,25%	0,30%	1,25%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	52.943.343,55	0,00	0,00	53.545.611,64	602.268,09	1,14%	1,25%	1,14%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	37.363.966,06	0,00	0,00	37.773.497,87	409.531,81	1,10%	0,01%	1,10%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	34.954.205,12	0,00	1.209.982,56	34.122.347,33	378.124,77	1,08%	0,01%	1,08%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	52.657.986,23	1.138.042,80	0,00	54.372.934,02	576.904,99	1,07%	1,09%	1,08%
Total Renda Fixa					2.874.772,52	1,15%	0,61%	



## Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de janeiro / 2017

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	1.204.300,30	0,00	0,00	1.396.916,58	192.616,28	15,99%	13,32%	15,99%
SANTANDER SMALL CAP FI AÇÕES	1.729.502,32	0,00	0,00	1.891.452,37	161.950,05	9,36%	8,56%	9,36%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	1.597.705,23	0,00	0,00	1.686.479,89	88.774,66	5,56%	8,36%	5,56%
Total Renda Variável					443.340,99	9,78%	9,83%	