

Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2017



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 (fevereiro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.284.373,35	0,49%	624	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	57.287,55	0,02%	117	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	54.336.824,16	20,77%	712	0,97%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	11.706.574,44	4,47%	36	1,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	23.855,48	0,01%	1.177	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	28.638,72	0,01%	1.341	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	10.372.870,04	3,96%	143	1,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	14.975.007,77	5,72%	18	6,66%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	850.905,78	0,33%	54	0,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	55.779.404,33	21,32%	722	1,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	54.950.622,89	21,00%	194	8,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	850.487,97	0,33%	203	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	24.341.995,88	9,30%	125	1,89%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	26.811.477,86	10,25%	1.336	0,45%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER SMALL CAP FI AÇÕES	D+4	Não há	2.009.731,11	0,77%	1.074	5,75%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	D+4	Não há	1.447.784,04	0,55%	698	12,10%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.785.159,41	0,68%	342	5,79%	Artigo 8º, Inciso III
		TOTAL -	261.613.000,78				

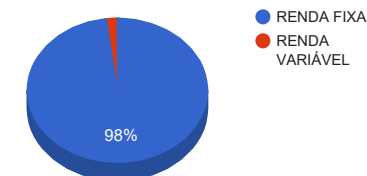


Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (fevereiro / 2017)

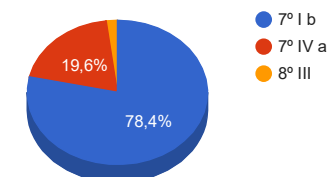
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	205.216.852,48	78,44%	50,00%	78,00%	90,00%	30.234.848,22
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	51.153.473,74	19,55%	1,00%	20,00%	30,00%	27.330.426,49
Total Renda Fixa	100,00%	256.370.326,22	98,00%	51,00	98,00	120,00	-

Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	5.242.674,56	2,00%	0,00%	2,00%	3,00%	2.605.715,46
Total Renda Variável	30,00%	5.242.674,56	2,00%	0,00	2,00	3,00	-

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução





Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: fevereiro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	205.216.852,48	78,44%	50,00%	90,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	51.153.473,74	19,55%	1,00%	30,00%
Total Renda Fixa	256.370.326,22	98,00%	51,00	120,00

Artigos - Renda Variável	Base: fevereiro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso III	5.242.674,56	2,00%	0,00%	3,00%
Total Renda Variável	5.242.674,56	2,00%	0,00	3,00



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE LENÇÓIS PAULISTA - IPREM
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 24/02/2017

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	3,85%	5,79%	8,86%	9,92%	26,69%	38,66%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,85%	5,76%	8,82%	9,81%	26,50%	37,94%	0,20%	1,855%	7,39%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	3,83%	5,76%	8,82%	9,84%	26,57%	38,31%	0,20%	1,754%	7,38%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	3,81%	5,69%	8,74%	9,83%	26,39%	37,57%	0,20%	1,861%	7,40%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	3,81%	5,71%	8,74%	9,65%	26,06%	37,36%	0,40%	1,865%	7,36%
IMA Geral	2,26%	4,11%	6,07%	8,66%	21,43%	34,20%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,24%	4,03%	6,02%	8,81%	21,40%	33,51%	0,20%	0,910%	3,63%
IMA-B 5	1,49%	2,67%	4,10%	6,47%	13,40%	32,51%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,48%	2,63%	4,05%	6,38%	13,17%	31,63%	0,20%	0,715%	2,39%
IDKA IPCA 2 Anos	1,35%	2,45%	3,77%	6,37%	12,42%	33,17%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,33%	2,42%	3,70%	6,10%	12,74%	31,60%	0,20%	0,609%	2,20%
IRF-M 1	1,01%	2,31%	3,53%	6,86%	14,23%	30,27%	-	-	-
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,05%	2,32%	3,53%	6,82%	14,16%	29,99%	0,00%	0,123%	0,35%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,01%	2,27%	3,47%	6,75%	14,02%	29,82%	0,20%	0,075%	0,31%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,99%	2,27%	3,47%	6,76%	14,05%	29,83%	0,20%	0,083%	0,30%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,99%	2,26%	3,45%	6,71%	13,91%	29,61%	0,20%	0,068%	0,30%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,99%	2,26%	3,45%	6,72%	13,95%	29,58%	0,10%	0,083%	0,31%



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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,86%	1,96%	3,10%	6,43%	13,88%	29,35%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	0,87%	1,96%	3,11%	6,44%	13,96%	29,56%	0,18%	0,016%	0,03%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,87%	1,97%	3,12%	6,47%	13,96%	29,54%	0,20%	0,006%	0,03%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE LENÇÓIS PAULISTA - IPREM
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 24/02/2017

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

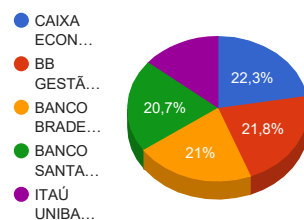
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	5,73%	17,81%	17,17%	14,91%	62,13%	29,70%	-	-	-
SANTANDER SMALL CAP FI AÇÕES	6,25%	16,20%	13,08%	11,20%	42,06%	32,44%	3,00%	7,583%	18,94%
IMOB	3,72%	21,01%	22,71%	13,52%	39,68%	26,04%	-	-	-
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	3,64%	20,22%	22,25%	12,34%	34,77%	19,74%	2,00%	9,298%	24,41%
Ibovespa	3,08%	10,68%	7,68%	15,13%	55,78%	29,23%	-	-	-
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	5,85%	11,73%	11,34%	7,03%	52,75%	11,68%	2,00%	6,618%	22,14%



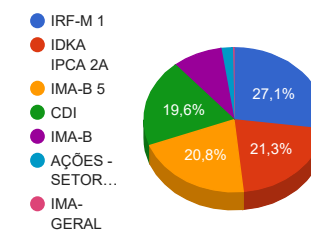
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE LENÇÓIS PAULISTA - IPREM
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 24/02/2017

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	58.448.894,30	22,34%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	57.087.633,16	21,82%
BANCO BRADESCO	55.007.910,44	21,03%
BANCO SANTANDER	54.169.086,78	20,71%
ITAÚ UNIBANCO	36.899.476,10	14,10%

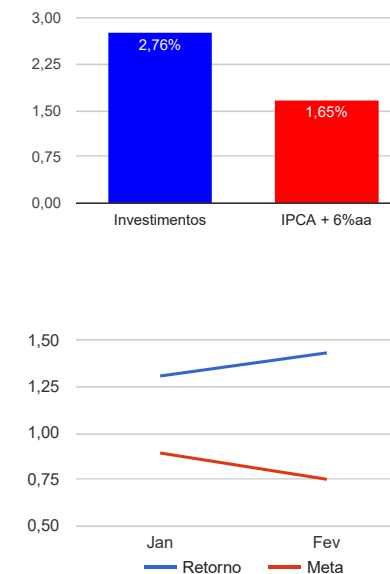


Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	70.829.030,64	27,07%
IDKA IPCA 2A	55.779.404,33	21,32%
IMA-B 5	54.336.824,16	20,77%
CDI	51.153.473,74	19,55%
IMA-B	23.421.105,38	8,95%
AÇÕES - SETORIAIS	5.242.674,56	2,00%
IMA-GERAL	850.487,97	0,33%




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%
Fevereiro	257.245.322,95	21.890.819,49	21.211.574,03	261.613.000,78	3.688.432,37	1,43%	0,75%	190,67%	0,62%
Acumulado no ano					7.006.545,88	2,76%	1,65%	167,31%	

Acumulado no Ano




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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	55.185,97	0,00	0,00	57.287,55	2.101,58	3,81%	1,86%	3,81%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	1.341.941,93	10.000.000,00	0,00	11.706.574,44	364.632,51	3,21%	1,86%	3,81%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	55.254,93	10.000.000,00	0,00	10.372.870,04	317.615,11	3,16%	1,75%	3,83%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	831.872,38	0,00	0,00	850.487,97	18.615,59	2,24%	0,91%	2,24%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	55.225,73	1.210.000,00	0,00	1.284.373,35	19.147,62	1,51%	1,85%	3,85%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	53.545.611,64	0,00	0,00	54.336.824,16	791.212,52	1,48%	0,72%	1,48%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	54.372.934,02	680.819,49	0,00	55.779.404,33	725.650,82	1,32%	0,61%	1,33%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.819.318,42	0,00	0,00	14.975.007,77	155.689,35	1,05%	0,12%	1,05%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	54.402.727,88	0,00	0,00	54.950.622,89	547.895,01	1,01%	0,08%	1,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	28.356,75	0,00	0,00	28.638,72	281,97	0,99%	0,08%	0,99%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	842.576,92	0,00	0,00	850.905,78	8.328,86	0,99%	0,07%	0,99%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	23.622,34	0,00	0,00	23.855,48	233,14	0,99%	0,08%	0,99%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	37.773.497,87	0,00	11.211.574,03	26.811.477,86	249.554,02	0,66%	0,01%	0,87%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	34.122.347,33	0,00	10.000.000,00	24.341.995,88	219.648,55	0,64%	0,02%	0,87%
Total Renda Fixa					3.420.606,65	1,35%	0,48%	



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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
SANTANDER SMALL CAP FI AÇÕES	1.891.452,37	0,00	0,00	2.009.731,11	118.278,74	6,25%	7,58%	6,25%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	1.686.479,89	0,00	0,00	1.785.159,41	98.679,52	5,85%	6,62%	5,85%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	1.396.916,58	0,00	0,00	1.447.784,04	50.867,46	3,64%	9,30%	3,64%
Total Renda Variável					267.825,72	5,38%	7,73%	