

## Relatório Analítico dos Investimentos em abril 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 - 28/04/2017

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

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	57.672,56	0,02%	118	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	56.029.051,33	20,93%	193	8,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	15.271.963,78	5,70%	17	10,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.494.585,12	0,93%	627	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	863.298,18	0,32%	206	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	58.370.889,88	21,80%	717	1,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	867.496,29	0,32%	57	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	11.783.237,62	4,40%	34	1,95%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	55.468.819,84	20,72%	720	0,92%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	10.443.847,87	3,90%	65	1,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.331.102,86	0,50%	1.168	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	29.207,56	0,01%	1.339	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	27.313.854,70	10,20%	1.329	0,46%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	22.133.703,44	8,27%	131	1,78%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER SMALL CAP FI AÇÕES	D+4	Não há	2.027.561,92	0,76%	1.330	5,36%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	D+4	Não há	1.486.943,05	0,56%	726	9,99%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.783.957,87	0,67%	393	4,44%	Artigo 8º, Inciso III
		<b>TOTAL -</b>	<b>267.757.193,87</b>				

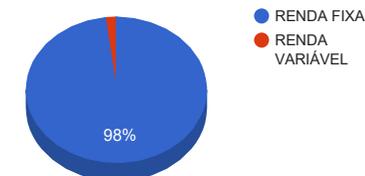


## Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (abril / 2017)

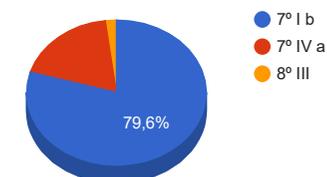
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	213.011.172,89	79,55%	50,00%	78,00%	90,00%	27.970.301,59
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	49.447.558,14	18,47%	1,00%	20,00%	30,00%	30.879.600,02
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>262.458.731,03</b>	<b>98,02%</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%	5.298.462,84	1,98%	0,00%	2,00%	3,00%	2.734.252,98
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>5.298.462,84</b>	<b>1,98%</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: abril / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	213.011.172,89	79,55%	50,00%	90,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	49.447.558,14	18,47%	1,00%	30,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>262.458.731,03</b>	<b>98,02%</b>	<b>51,00</b>	<b>120,00</b>

Artigos - Renda Variável	Base: abril / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso III	5.298.462,84	1,98%	0,00%	3,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>5.298.462,84</b>	<b>1,98%</b>	<b>0,00</b>	<b>3,00</b>


 INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE LENÇÓIS PAULISTA - IPREM  
 Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 28/04/2017

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	0,92%	5,08%	3,95%	7,03%	13,24%	34,55%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,76%	4,66%	3,54%	6,53%	12,72%	32,84%	0,20%	0,481%	1,83%
IRF-M 1	0,87%	4,36%	3,04%	6,72%	13,86%	30,56%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,86%	4,30%	3,00%	6,61%	13,65%	30,13%	0,20%	0,157%	0,29%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,86%	4,35%	3,05%	6,69%	13,82%	30,28%	0,00%	0,159%	0,33%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,86%	4,27%	2,97%	6,56%	13,53%	29,85%	0,10%	0,162%	0,29%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,85%	4,25%	2,96%	6,55%	13,54%	29,71%	0,20%	0,158%	0,29%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,85%	4,28%	2,99%	6,58%	13,60%	29,86%	0,20%	0,162%	0,29%
CDI	0,79%	3,84%	2,72%	6,09%	13,45%	29,16%	-	-	-
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,79%	3,88%	2,76%	6,16%	13,58%	29,35%	0,20%	0,014%	0,05%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	0,79%	3,85%	2,74%	6,11%	13,53%	29,38%	0,18%	0,016%	0,06%
IMA-B 5	0,71%	4,83%	3,63%	6,72%	13,17%	33,32%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,70%	4,77%	3,59%	6,62%	12,96%	32,50%	0,20%	0,516%	2,06%
IMA Geral	0,29%	5,68%	3,80%	7,66%	15,83%	34,03%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,31%	5,60%	3,78%	7,66%	15,85%	33,40%	0,20%	0,997%	2,96%
IMA-B	-0,32%	6,55%	4,60%	8,31%	16,59%	36,72%	-	-	-
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	-0,34%	6,48%	4,54%	8,20%	16,43%	36,40%	0,20%	1,900%	5,84%



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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-0,34%	6,40%	4,51%	8,18%	16,22%	35,59%	0,20%	1,902%	5,85%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,34%	6,47%	4,54%	8,17%	16,36%	35,97%	0,20%	1,900%	5,85%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	-0,35%	6,40%	4,49%	8,06%	16,04%	35,45%	0,40%	1,893%	5,83%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE LENÇÓIS PAULISTA - IPREM  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 28/04/2017

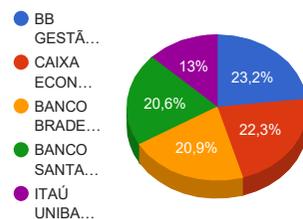
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (abril / 2017)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	3,41%	20,05%	7,75%	9,34%	40,53%	27,14%	-	-	-
SANTANDER SMALL CAP FI AÇÕES	3,09%	17,23%	7,20%	6,59%	28,88%	28,82%	3,00%	6,828%	17,64%
IMOB	2,00%	23,78%	6,10%	11,23%	18,64%	26,42%	-	-	-
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	1,90%	23,47%	6,44%	11,13%	14,39%	20,65%	2,00%	9,562%	22,24%
Ibovespa	0,64%	8,59%	1,13%	0,74%	21,32%	16,32%	-	-	-
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	0,79%	11,66%	5,78%	2,38%	25,08%	11,92%	2,00%	6,492%	20,08%

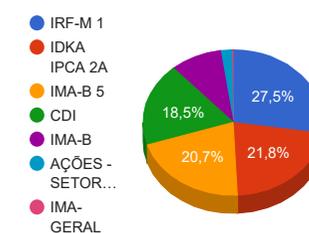


## Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (abril / 2017)

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	62.196.577,86	23,23%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	59.632.226,50	22,27%
BANCO BRADESCO	56.086.723,89	20,95%
BANCO SANTANDER	55.057.228,27	20,56%
ITAÚ UNIBANCO	34.784.437,35	12,99%

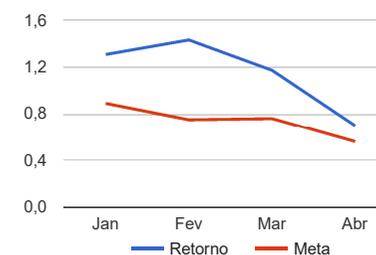
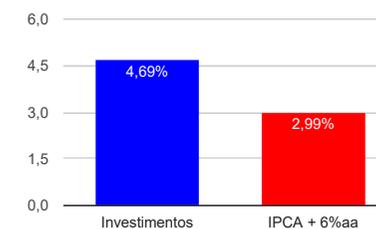


Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	73.528.821,82	27,46%
IDKA IPCA 2A	58.370.889,88	21,80%
IMA-B 5	55.468.819,84	20,72%
CDI	49.447.558,14	18,47%
IMA-B	24.779.343,17	9,25%
AÇÕES - SETORIAIS	5.298.462,84	1,98%
IMA-GERAL	863.298,18	0,32%




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%
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%
Março	261.613.000,78	1.880.819,49	1.310.645,50	265.255.459,88	3.072.285,11	1,17%	0,76%	153,29%	0,70%
Abril	265.255.459,88	1.980.819,49	1.336.893,95	267.757.193,87	1.857.808,45	0,70%	0,56%	125,29%	0,59%
Acumulado no ano					11.936.639,44	4,69%	2,99%	156,45%	

**Acumulado no Ano**




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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	28.957,83	0,00	0,00	29.207,56	249,73	0,86%	0,16%	0,86%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.141.605,72	0,00	0,00	15.271.963,78	130.358,06	0,86%	0,16%	0,86%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	860.155,29	0,00	0,00	867.496,29	7.341,00	0,85%	0,16%	0,85%
BRANDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	55.556.803,39	0,00	0,00	56.029.051,33	472.247,94	0,85%	0,16%	0,85%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	27.098.685,32	0,00	0,00	27.313.854,70	215.169,38	0,79%	0,01%	0,79%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	23.288.329,01	0,00	1.336.893,95	22.133.703,44	182.268,38	0,78%	0,02%	0,79%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	57.250.471,20	680.819,49	0,00	58.370.889,88	439.599,19	0,76%	0,48%	0,76%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	55.085.205,37	0,00	0,00	55.468.819,84	383.614,47	0,70%	0,52%	0,70%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24.118,12	1.300.000,00	0,00	1.331.102,86	6.984,74	0,53%	0,16%	0,86%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	860.594,66	0,00	0,00	863.298,18	2.703,52	0,31%	1,00%	0,31%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	10.478.997,16	0,00	0,00	10.443.847,87	-35.149,29	-0,34%	1,90%	-0,34%
BRANDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	57.868,53	0,00	0,00	57.672,56	-195,97	-0,34%	1,90%	-0,34%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.503.206,29	0,00	0,00	2.494.585,12	-8.621,17	-0,34%	1,90%	-0,34%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	11.824.483,16	0,00	0,00	11.783.237,62	-41.245,54	-0,35%	1,89%	-0,35%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>1.755.324,44</b>	<b>0,67%</b>	<b>0,45%</b>	



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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
SANTANDER SMALL CAP FI AÇÕES	1.966.829,46	0,00	0,00	2.027.561,92	60.732,46	3,09%	6,83%	3,09%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	1.459.158,96	0,00	0,00	1.486.943,05	27.784,09	1,90%	9,56%	1,90%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	1.769.990,41	0,00	0,00	1.783.957,87	13.967,46	0,79%	6,49%	0,79%
Total Renda Variável					102.484,01	1,97%	7,48%	