

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.

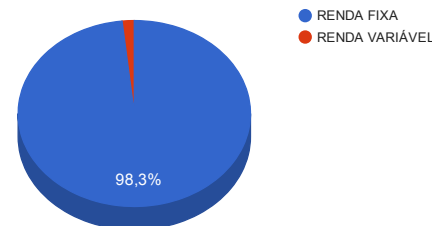
Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	853.206,20	3,16%	33	1,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	263.428,05	0,98%	237	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.657.018,03	6,14%	1.331	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.045.295,76	15,00%	299	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.376.990,04	12,52%	639	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.600.319,69	20,77%	728	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.548.442,94	9,45%	754	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	957.073,72	3,55%	248	0,08%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.599.872,60	13,35%	86	0,30%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.731.832,99	10,13%	801	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	878.635,19	3,26%	385	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER SMALL CAP FI AÇÕES	D+4	Não há	212.361,80	0,79%	1.216	0,61%	Artigo 8º, Inciso III
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	241.606,87	0,90%	350	0,07%	Artigo 8º, Inciso III
		TOTAL -	26.966.083,88				

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%	85,00%	18.344.700,71	68,03%	4.576.470,59
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	4.556.946,32	16,90%	6.229.487,23
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	3.610.468,18	13,39%	4.479.356,98
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.348.304,19
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.348.304,19
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.348.304,19
Total Renda Fixa	100,00%	170,00	26.512.115,21	98,32%	

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	2,00%	0,00	0,00%	530.321,63

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

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE SANTA ALBERTINA - IPRESA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/09/2016

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	1,67%	28,05%	5,98%	13,71%	34,70%	38,62%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,64%	27,87%	5,97%	13,71%	34,39%	38,07%	0,20%	3,129%	10,20%
IMA-B	1,57%	22,00%	5,04%	11,16%	28,36%	35,87%	-	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1,67%	21,70%	5,15%	11,39%	27,86%	35,65%	0,20%	2,399%	7,14%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,64%	21,66%	5,17%	11,11%	27,79%	35,14%	0,30%	2,270%	6,99%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,58%	21,72%	4,97%	11,04%	27,66%	33,42%	0,20%	2,300%	7,11%
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%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,33%	12,42%	3,70%	7,14%	18,28%	32,52%	0,20%	0,545%	2,55%
IMA-B 5	1,41%	12,92%	3,76%	7,19%	18,83%	33,03%	-	-	-
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,39%	12,70%	3,70%	7,08%	18,58%	32,50%	0,10%	0,770%	2,70%
IRF-M 1	1,19%	11,14%	3,46%	6,82%	15,14%	28,00%	-	-	-
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%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,12%	10,84%	3,39%	6,70%	14,73%	27,83%	0,40%	0,078%	0,42%
Selic	1,11%	10,44%	3,47%	6,95%	14,15%	28,56%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,10%	10,44%	3,49%	6,99%	14,15%	28,71%	0,20%	0,005%	0,02%
CDI	1,11%	10,42%	3,47%	6,94%	14,13%	28,50%	-	-	-

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
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11%	10,26%	3,54%	6,88%	14,00%	28,66%	0,20%	0,027%	0,17%

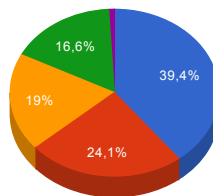
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (setembro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	0,09%	35,19%	14,90%	26,78%	32,37%	-4,76%	-	-	-
SANTANDER SMALL CAP FI AÇÕES	0,97%	25,42%	12,51%	23,85%	29,96%	3,79%	3,00%	8,694%	17,96%
IDIV	-0,27%	44,15%	14,52%	22,19%	36,47%	-14,52%	-	-	-
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	-1,19%	27,02%	9,01%	13,62%	24,58%	4,95%	1,50%	11,618%	21,41%

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

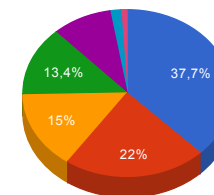
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	10.634.327,76	39,44%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	6.500.777,70	24,11%
BANCO SANTANDER	5.110.863,76	18,95%
BANCO BRADESCO	4.478.507,79	16,61%
BEM DTVM	241.606,87	0,90%

- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- BANCO SANTANDER
- BANCO BRADESCO
- BEM DTVM



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	10.157.266,01	37,67%
IDKA IPCA 2A	5.925.432,98	21,97%
IMA-B 5	4.045.295,76	15,00%
CDI	3.610.468,18	13,39%
IRF-M 1	2.510.224,23	9,31%
AÇÕES - SETORIAIS	453.968,67	1,68%
IMA-B 5+	263.428,05	0,98%

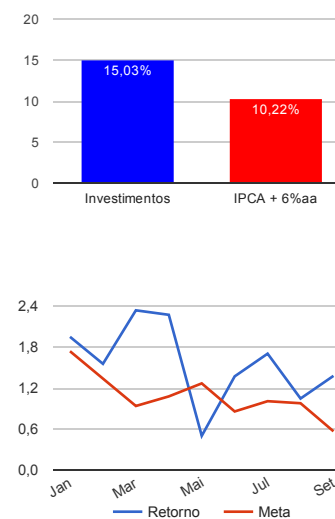
- IMA-B
- IDKA IPCA 2A
- IMA-B 5
- CDI
- IRF-M 1
- AÇÕES - SETORIAIS
- IMA-B 5+



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	22.931.390,90	2.880.402,08	2.806.000,00	23.454.519,07	448.726,09	1,95%	1,74%	112,14%	1,49%
Fevereiro	23.454.519,07	237.699,85	106.000,00	23.953.208,89	366.989,97	1,56%	1,34%	115,75%	1,62%
Março	23.953.208,89	250.000,00	107.000,00	24.659.512,74	563.303,85	2,34%	0,94%	248,12%	3,02%
Abril	24.659.512,74	250.908,60	111.000,00	25.362.951,91	563.530,57	2,27%	1,08%	211,12%	1,92%
Mai	25.362.951,91	250.000,00	116.000,00	25.625.414,62	128.462,71	0,50%	1,27%	39,65%	1,75%
Junho	25.625.414,62	50.000,00	124.000,00	25.903.214,60	351.799,98	1,37%	0,86%	159,31%	1,36%
Julho	25.903.214,60	3.429.264,89	3.277.760,50	26.498.833,23	444.114,24	1,70%	1,01%	168,89%	1,11%
Agosto	26.498.833,23	52.000,00	138.000,00	26.690.741,75	277.908,52	1,05%	0,98%	107,50%	1,14%
Setembro	26.690.741,75	42.972,36	136.000,00	26.966.083,88	368.369,77	1,38%	0,57%	243,35%	1,33%
Acumulado no ano					3.513.205,70	15,03%	10,22%	147,10%	

Acumulado no Ano



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(%)
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3.540.820,98	0,00	0,00	3.599.872,60	59.051,62	1,67%	2,40%	1,67%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	941.602,70	0,00	0,00	957.073,72	15.471,02	1,64%	2,27%	1,64%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.513.029,36	0,00	0,00	5.600.319,69	87.290,33	1,58%	2,30%	1,58%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	216.464,23	42.972,36	0,00	263.428,05	3.991,46	1,54%	3,13%	1,64%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	3.989.894,10	0,00	0,00	4.045.295,76	55.401,66	1,39%	0,78%	1,39%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.514.537,22	0,00	0,00	2.548.442,94	33.905,72	1,35%	0,56%	1,35%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.332.629,54	0,00	0,00	3.376.990,04	44.360,50	1,33%	0,55%	1,33%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.637.835,05	0,00	0,00	1.657.018,03	19.182,98	1,17%	0,08%	1,17%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	978.271,15	0,00	136.000,00	853.206,20	10.935,05	1,12%	0,08%	1,12%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.701.718,87	0,00	0,00	2.731.832,99	30.114,12	1,11%	0,03%	1,11%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	869.094,30	0,00	0,00	878.635,19	9.540,89	1,10%	0,01%	1,10%
Total Renda Fixa					369.245,35	1,41%	1,18%	

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(%)
SANTANDER SMALL CAP FI AÇÕES	210.327,09	0,00	0,00	212.361,80	2.034,71	0,97%	8,69%	0,97%
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	244.517,16	0,00	0,00	241.606,87	-2.910,29	-1,19%	11,62%	-1,19%
Total Renda Variável					-875,58	-0,19%	10,25%	

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 (%)
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.335.195,24	0,00	0,00	5.600.319,69	265.124,45	4,97%	4,97%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	3.900.854,25	0,00	0,00	4.045.295,76	144.441,51	3,70%	3,70%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.256.574,46	0,00	0,00	3.376.990,04	120.415,58	3,70%	3,70%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,00	3.481.264,89	0,00	3.599.872,60	118.607,71	3,42%	5,15%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.638.435,30	0,00	0,00	2.731.832,99	93.397,69	3,54%	3,54%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.456.748,86	0,00	0,00	2.548.442,94	91.694,08	3,73%	3,73%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.602.287,20	0,00	0,00	1.657.018,03	54.730,83	3,42%	3,42%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	910.017,91	0,00	0,00	957.073,72	47.055,81	5,17%	5,17%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.218.660,09	0,00	402.000,00	853.206,20	36.546,11	3,37%	3,39%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	3.117.420,50	0,00	3.149.760,50	0,00	32.340,00	1,04%	4,57%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	849.004,90	0,00	0,00	878.635,19	29.630,29	3,49%	3,49%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	207.630,55	42.972,36	0,00	263.428,05	12.825,14	5,86%	5,97%
				Total Renda Fixa	1.046.809,20	4,09%	

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 (%)
SANTANDER SMALL CAP FI AÇÕES	188.747,60	0,00	0,00	212.361,80	23.614,20	12,51%	12,51%
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	221.637,74	0,00	0,00	241.606,87	19.969,13	9,01%	9,01%
Total Renda Variável					43.583,33	10,62%	