

Comitê de Investimentos

Ata n° 60

Em 15/05/2017, às 10h00 horas, na sede do IPRESB, deu-se início à 60ª Reunião do Comitê de Investimentos do IPRESB, com agenda de todos comumente acertada:

Membros:

Eliezer Antonio da Silva
Fernando Tadeu Valente
Humberto Foltran Fernandes
Igor Jefferson Lima Clemente
Marcelo Lopes dos Santos

Convidado:

Waine Amaro Billafon

Pauta para a reunião: a) Apresentação do Relatório de Atividades do Comitê do ano de 2016 (Relatório Anual de Investimentos)

a) Apresentação do Relatório de Atividades do Comitê do ano de 2016 (Relatório Anual de Investimentos)

Foi discutida e elaborado o Relatório de Atividades do Comitê do ano de 2016, ou Relatório Anual de Investimentos, incluindo o desempenho, as alterações na Carteira, o monitoramento de riscos e os resultados alcançados no ano de 2016, inclusive comparado aos anos anteriores. Outrossim, foi Anexado o Relatório de Auditoria da Secretaria da Previdência e Promoção Social, que atestou a regularidade integral acerca dos investimentos do Instituto.

Por unanimidade, foi deliberada a publicação do presente Relatório para conhecimentos dos servidores acerca dos bons resultados apresentados.

Sem mais temas na pauta, foi encerrada a reunião às 12h00. Assinam abaixo os membros presentes:

Membros:

Eliezer Antonio da Silva

Fernando Tadeu Valente

Igor Jefferson Lima Clemente

Humberto Foltran Fernandes

Marcelo Lopes dos Santos

Convidado:

Waine Amaro Billafon

RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS 2016

**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL
DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE
BARUERI – IPRESB**



SUMÁRIO

1.	INTRODUÇÃO	3
2.	HISTÓRICO MACROECONÔMICO	3
EUA	5	
	CENÁRIO INTERNACIONAL – PERSPECTIVAS- 2017	7
	CENÁRIO NACIONAL – 2016	9
3.	DESEMPENHO DA CARTEIRA NO ANO DE 2016.....	13
3.1	RESUMO DO ANO DE 2016.....	13
3.2	DESEMPENHO HISTÓRICO.....	29
3.3	ANÁLISE DE RISCO DA CARTEIRA	32
4.	DESEMPENHO DO IPRESB	42
5.	ANEXOS.....	45



1. INTRODUÇÃO

Atendendo à Resolução do Conselho Monetário Nacional - CMN nº 3.922, de 25 de novembro de 2010, alterada pela Resolução CMN nº 4.392, de 19 de dezembro de 2014, doravante denominada simplesmente “Resolução CMN nº 3.922/2010”, o Comitê de Investimentos do IPRESB - INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE BARUERI, apresenta see Relatório Anual da Carteira, ou Relatório de Investimentos, sobre o ano de 2016.

Ressaltamos que todas as atividades realizadas pelo Comitê de Investimentos, e seus respectivos membros, estão pautadas estritamente ao arcabouço legal aplicável, bem como à Política de Investimentos. Lembramos que a elaboração da Política de Investimentos representa uma formalidade legal que fundamenta e norteia todos os processos de tomada de decisões relativo aos investimentos dos Regimes Próprios de Previdência Social – RPPS’s, empregada como instrumento necessário para garantir a consistência da gestão dos recursos em busca do equilíbrio econômico-financeiro.

Os fundamentos para a elaboração da presente Política de Investimentos estão centrados em critérios técnicos de grande relevância. Ressalta-se que o principal a ser observado, para que se trabalhe com parâmetros sólidos, é aquele referente à análise do fluxo de caixa atuarial da entidade, ou seja, o equilíbrio entre ativo e passivo, levando-se em consideração as reservas técnicas atuariais (ativos) e as reservas matemáticas (passivo) projetadas pelo cálculo atuarial.

2. HISTÓRICO MACROECONÔMICO

CENÁRIO INTERNACIONAL

EUROPA

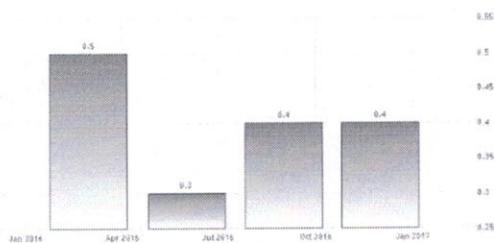
De acordo com a última revisão da agência de estatísticas da União Europeia,

Eurostat, a economia da zona do euro, composta por 19 países, evoluiu 0,3% no terceiro trimestre de 2016, em relação ao anterior, cujo crescimento também havia sido de 0,4%. Na base anual, a expansão do PIB foi de 1,7%.

Entre as economias mais importantes da zona do euro, a da Alemanha evoluiu 0,2% na base trimestral e 1,5% na anual, a da França 0,2% e 1,0%, a da Itália 0,3% e 1,0% e a da Espanha 0,7% e 3,2%, respectivamente. Já o PIB do Reino Unido, membro da UE, avançou 0,6% no terceiro trimestre e 2,2% em um ano, mesmo com a decisão de saída da União Europeia, o Brexit. O PIB da Rússia, que não integra nenhum dos dois blocos econômicos, caiu 0,57% e 0,40%, respectivamente.

Em relação ao ano de 2016, como um todo, o FMI estima que a atividade econômica na zona do euro tenha crescido 1,7% e que a maior taxa de expansão, entre as nações desenvolvidas do continente, tenha sido a da Espanha, de 3,1% e a pior a da Rússia, de -0,8%.

Taxa de crescimento PIB – Zona do Euro



Quanto ao desemprego na zona do euro, a taxa ficou em 9,8% em novembro, menor que os 10,5% apurados no mesmo mês do ano anterior. Enquanto na Alemanha ele foi de 4,1% também em novembro, na França foi de 10,0%, na Itália de 11,9% e na Espanha de 18,9%.

A melhor notícia para a região é a de que a ameaça da deflação parece ter sido realmente afastada. Em dezembro a inflação do consumidor acelerou e atingiu a marca anualizada de 1,1%, depois de ter registrado alta de 0,6% no mês anterior. Embora ainda distante da meta de 2%, o movimento recente foi de alívio.

Em sua última reunião do ano, o Banco Central Europeu – BCE anunciou a manutenção da taxa básica de juros em 0% e da taxa de depósitos bancários em -0,4% aa. Também comunicou que o seu programa de estímulos quantitativos será prorrogado de março para até o final de 2017, mas a partir de abril as compras de ativos pelo BCE cairão dos atuais 80 bilhões de euros para 60 bilhões mensais.

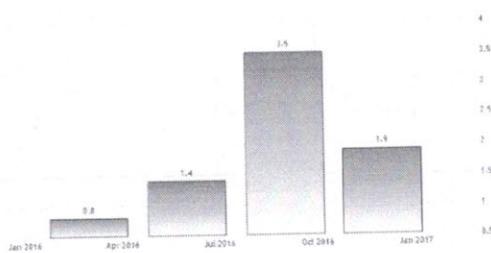


EUA

A economia americana evoluiu 3,5% no terceiro trimestre de 2016, em relação ao mesmo período do ano anterior. Esse avanço superou a previsão dos analistas, em um ano que começou com um crescimento frágil, de apenas 0,8% entre janeiro e março. As despesas dos consumidores, que representam quase 70% da economia, acrescentaram dois pontos percentuais ao PIB e aumentaram a uma taxa anual de 3%, ao passo que os investimentos das empresas cresceram 1,4%. Em relação ao último trimestre do ano, embora seja difícil a manutenção do ritmo do terceiro, sabe-se que a atividade industrial em dezembro, por exemplo, atingiu a máxima de dois anos com aumento das novas encomendas e do emprego no setor.

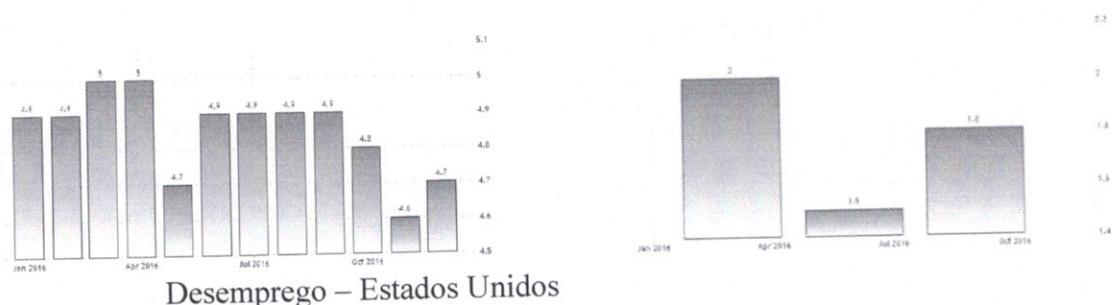
Para o ano de 2016, como um todo, o FMI estima que a evolução do PIB dos EUA tenha sido de 2,2%.

Taxa de crescimento PIB – Estados Unidos



Outro desempenho a ser destacado foi o do mercado de trabalho. No ano foram criadas 2,16 milhões de novas vagas de trabalho fora do setor agrícola e o salário médio por hora avançou 2,9%, a maior alta desde junho de 2009. A taxa de desemprego foi de apenas 4,7% no encerramento do ano.

Taxa de crescimento PIB – Índia



Dante desse cenário, como era esperado, a banda da taxa básica de juros foi elevada de entre 0,25% e 0,50% a.a. para entre 0,50% e 0,75% a.a. Em comunicado, a

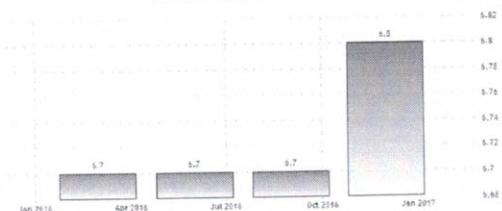


presidente do banco central, o FED disse que a decisão de aumentar os juros reflete a confiança no progresso da economia e nos recentes indicadores positivos.

ÁSIA

Segundo o Bureau Nacional de Estatísticas da China, o PIB do país registrou no terceiro trimestre de 2016 um avanço de anualizado de 6,7%, o mesmo ritmo do primeiro e do segundo trimestres, o que refletiu uma estabilização da segunda economia do mundo. Para o governo a economia avançou de maneira firme e a qualidade do crescimento melhorou, com o emprego no geral melhor que o esperado, quando o país vive um delicado processo de transformação. Para o FMI, no ano, a economia chinesa deve ter crescido 6,6%, ligeiramente acima da meta governamental de 6,5%.

Taxa de crescimento PIB – China



Já o PIB do Japão, evoluiu 0,3% no terceiro trimestre de 2016, ou 1,1% em base anual, graças às despesas das famílias e ao investimento em capital fixo das empresas. A economia da Índia, por sua vez avançou 1,8% no terceiro trimestre, em relação ao anterior ou 7,3% anualizado.

RENDA FIXA

Foi um ano de fortes contrastes para o mercado internacional de renda fixa. Enquanto no Japão e na zona do euro a prática das taxas de juros negativas se consolidou por conta da lentidão no crescimento econômico, nos EUA, depois da inesperada eleição de Donald Trump para a presidência do país, as taxas de juros avançaram com a perspectiva de maior crescimento do PIB e da inflação.

Nesse contexto, o rendimento dos títulos de 10 anos emitidos pelo governo britânico (UK Gilt) passou de 0,89% a.a., no final do terceiro trimestre, para 1,38% a.a., no final do ano e o dos títulos do governo alemão (Bund) de 0,01% a.a., para 0,29% a.a. Por sua vez, os títulos de 10 anos do governo americano (Treasury Bonds) tiveram o seu rendimento alterado, no mesmo período, de 1,69% a.a., para 2,43% a.a. e os de 30 anos de 2,45% a.a., para 3.10% a.a.

RENDA VARIÁVEL

Para as ações internacionais o ano de 2016 acabou sendo bom, graças aos estímulos quantitativos na zona do euro e no Japão e ao vigor da economia americana.

O índice Dax 30 (Alemanha) subiu 6,87% no ano e o FTSE 100 (Grã-Bretanha), apesar do Brexit subiu 14,43%. Nos EUA, atingindo novos recordes o índice S&P 500 apresentou alta de 9,54%, em 2016.

Na Ásia, o índice Shanghai SE Composite (China) caiu 12,30% no ano e o índice Nikkei 225 (Japão) subiu 0,42%.

No mercado de commodities o destaque foi o petróleo, sendo que o preço do tipo Brent, por exemplo, teve alta superior a 50% em 2016, também favorecido pelo primeiro acordo de corte de produção firmado no âmbito da Opep, desde 2008.

CENÁRIO INTERNACIONAL – PERSPECTIVAS- 2017

Em seu relatório denominado Perspectivas Econômicas Globais, divulgado logo no início de 2017, o Banco Mundial estima que o crescimento global se eleve de 2,3% em 2016, para 2,7% em 2017. A leve aceleração deve ser estimulada pela recuperação nos preços do petróleo e das commodities em geral, que deverão aliviar as pressões sobre os mercados emergentes exportadores de matéria-prima. Já as economias avanças deverão crescer 1,8% enquanto as emergentes 4,2%. Entre as incertezas inclui-se as propostas de política econômica de Donald Trump e seus efeitos em termos globais.

Para o FMI, em relatório publicado em outubro último, a economia mundial crescerá 3,4% em 2017.

EUROPA

Em relação à zona do euro, o Banco Mundial espera que o crescimento caia de 1,6% em 2016, para 1,5% em 2017. Para o FMI a projeção é a mesma. Após a vitória de Trump, temendo um acirramento do protecionismo e da atração de capitais para os EUA, o BCE decidiu também estender o programa de estímulos quantitativos até o final de 2017, ou até quando for necessário. Resta-nos aguardar se os sinais de melhora emitidos no final de 2016 se consolidarão de forma a permitir ao longo do ano a normalização da política monetária.

Para o Reino Unido, membro da União Europeia, o FMI estimou a evolução do PIB em 2017 em 1,1%. Para a Rússia, país emergente do continente europeu, o Banco Mundial estimou uma alta do PIB de 1,5% em 2017, enquanto o FMI 1,15%.

EUA

O Banco Mundial e o FMI acreditam que a economia americana crescerá 2,2% em 2017. No entanto, a projeção não incorpora os efeitos das políticas propostas pelo novo governo que assumirá o país, que poderão propiciar um aumento maior do PIB americano e mundial. Pelo que já se comentou, Donald Trump poderá conduzir a maior economia do mundo com base em três pilares. 1). Política fiscal expansionista, apoiada no corte de impostos para as empresas e para os indivíduos. 2). Protecionismo comercial e migratório, com a renegociação das relações comerciais com importantes parceiros dos EUA, além da revogação de tratados, como o transpacífico, por exemplo. 3). Desregulamentação de setores, como o de energia, o financeiro e o de saúde, por exemplo. Outro aspecto importante diz respeito à promessa de campanha, dos EUA investirem maciçamente em infraestrutura. Embora o país deva ser o maior beneficiário, haverá também estímulo para a economia mundial, se ações mais protecionistas não forem adotadas.

No âmbito fiscal, muitas medidas podem ser aprovadas num Congresso de maioria republicana, por maioria simples. Se implementadas, o déficit fiscal do governo poderá aumentar de forma importante e a economia crescer com vigor ainda maior, o que deverá levar o FED a apertar mais a sua política monetária em contrapartida. Os juros podem subir de forma mais rápida que o previsto e com maior intensidade.

ÁSIA

Para a China, o Banco Mundial projetou a evolução do PIB de 2017 em 6,5%, enquanto o Fundo Monetário Internacional, 6,2%. Ou seja, em ambos os casos uma queda em relação a 2016. Para o Centro de Informação do Estado chinês, além do avanço do consumo interno, o impulso de novas tecnologias continuará a estimular o crescimento econômico, mas não vai impedir a tendência mais ampla de desaceleração. A produção industrial crescerá menos e a moeda yuan poderá se desvalorizar mais para manter a competitividade do comércio externo e enfraquecer a saídas de capital que têm diminuído de forma significativa as reservas cambiais do país.

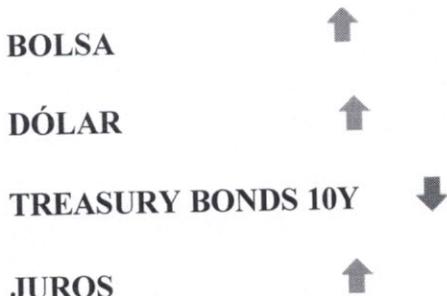
Em relação ao Japão, o Banco Mundial estima um crescimento de 0,9% em 2017 e o FMI de 0,6%. Depois de todos os estímulos adotados, inclusive com os juros negativos, os preços resistem em subir e o consumo das famílias não dá sinal de deslanchar. O banco central do país já adiou para 2019 atingir a meta de inflação de 2%, embora para 2017 vá manter a atual política econômica.

RENDA FIXA

Para diversos estrategistas americanos, está chegando ao fim o longo ciclo de ganhos com os títulos do tesouro dos EUA. Acreditam que o FED terá que apertar mais agressivamente a política monetária e que o mercado de US\$ 13,9 trilhões de títulos públicos federais está em um ponto de inflexão e próximo de quebrar a tendência de três décadas de taxas de juros decrescentes. Também com Trump é esperada maior volatilidade no mercado financeiro internacional, até porque ele nunca exerceu cargos públicos anteriormente, o que deixa o mercado sem referência do seu modelo de gestão.

RENDAS VARIÁVEL

Para as bolsas de valores americanas pode ser boa a presidência de Trump. Com mais recursos injetados na economia através da diminuição da carga fiscal, deve crescer a lucratividade das empresas, mesmo com os juros mais altos. Também o dólar tende a se valorizar internacionalmente por conta da política monetária mais restritiva. Para as commodities o ano também pode ser melhor. Se as commodities agrícolas ainda enfrentam uma situação de estoques mundiais de grãos elevados, as metálicas e o petróleo, com o acordo da Opep podem alcançar preços melhores. Para os mercados emergentes, o dólar mais valorizado, a elevação dos juros nos EUA e eventuais medidas protecionistas representam uma ameaça. Salvo para as economias melhor estruturadas que poderão lidar com a conjuntura de melhor forma.



CENÁRIO NACIONAL – 2016

ATIVIDADE ECONÔMICA

Conforme o último dado divulgado pelo IBGE, o PIB do Brasil teve queda de 0,8% no terceiro trimestre de 2016, em relação ao segundo, registrando o sétimo recuo trimestral seguido. Em relação ao ano anterior, a queda foi de 4,4% e de janeiro a setembro foi de 4%, maior recuo desde 1996.

Sob a ótica da produção, a agropecuária encolheu 1,4%, a indústria 1,3% e os serviços 0,6%. Sob a ótica da demanda, o consumo do governo encolheu 0,3%, o das famílias 0,6% e a Formação Bruta de Capital Fixo – FBCP (investimentos) 3,1%.

Para o Banco Mundial, a queda do PIB no ano de 2016 deve ter sido de 3,4%, para o FMI de 3,3% e para o mercado financeiro local de 3,49%.

Para o Banco Central, medida através do IBC-Br, a queda da atividade em doze meses, até novembro foi de 4,96% em números dessazonalizados.

De uma série de medidas adotadas pelo governo, em dezembro, para estimular a economia, cabe destaque para a liberação do saque total de contas inativas do FGTS que poderá injetar R\$ 30 bilhões na economia.

EMPREGO E RENDA

De acordo com a Pesquisa Nacional por Amostra de Domicílios Contínua (Pnad), do IBGE, a taxa de desemprego no país subiu para 11,9% no trimestre encerrado em novembro, quando no ano anterior havia sido de 9,0%. O contingente de desempregados chegou a 12,1 milhões de pessoas.

O rendimento médio real (corrigido pela inflação) foi de R\$ 2.032,00, quando no ano anterior havia sido de R\$ 2.041,00.

SETOR PÚBLICO

Até o mês de novembro, o setor público consolidado registrou um déficit primário de R\$ 85,1 bilhões, sendo que no mesmo período de 2015 havia sido de R\$ 39,5 bilhões. As despesas com juros totalizaram no ano R\$ 372,5 bilhões, enquanto no ano anterior haviam sido de R\$ 449,7 bilhões. O resultado nominal, que inclui oprimário mais os juros, foi deficitário em R\$ 457,6 bilhões, frente a R\$ 489,2 bilhões de um ano antes. A Dívida Bruta do Governo Geral alcançou R\$ 4,4 trilhões ou o equivalente a 70,5% do PIB.

Importante mencionar que com o reforço de R\$ 50,9 bilhões no caixa, graças a Lei da Repatriação, que permitiu a regularização de dinheiro enviado ilegalmente ao exterior, o mês de outubro apresentou superávit de R\$ 39,6 bilhões, amenizando o déficit previsto para o ano, cuja meta é de R\$ 170,5 bilhões.

Fato de importância ímpar foi a aprovação pelo Congresso da PEC 241, que limita a evolução das despesas do governo pelos próximos vinte anos à evolução da inflação nos doze meses anteriores, matéria prioritária do governo Temer para a recuperação da confiança nas contas do país.

INFLAÇÃO

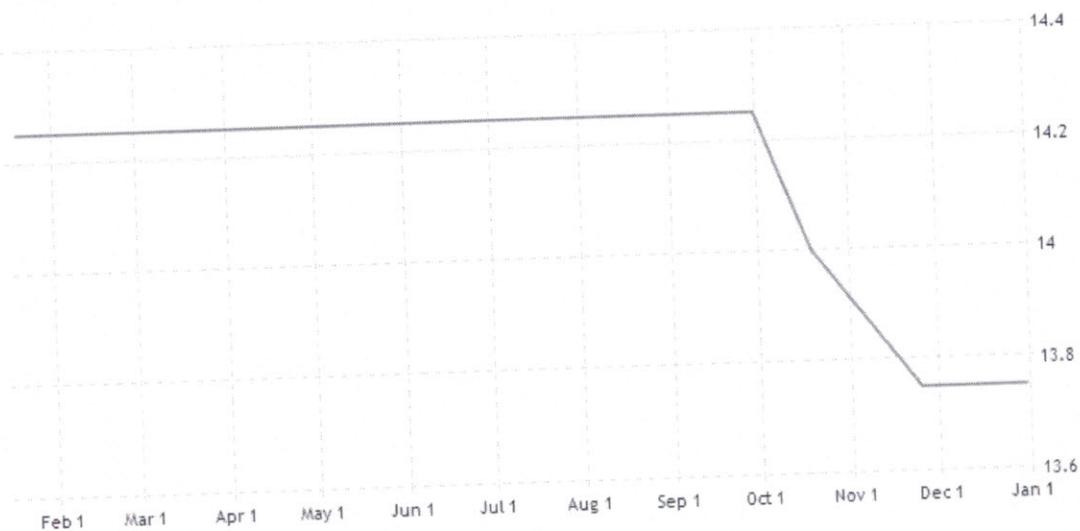
Com o aumento de 0,30% em dezembro, a inflação medida através do Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo (IPCA), calculado pelo IBGE e que abrange as famílias com renda mensal entre um e quarenta salários mínimos, acumulou alta de 6,297% no ano, ficando abaixo do teto da meta do Banco Central. As maiores pressões sobre o índice de preços vieram dos alimentos, que ficaram 8,62% mais caros, além dos planos de saúde e dos transportes públicos.

Já a inflação medida pelo Índice Nacional de Preços ao Consumidor (INPC), também calculado pelo IBGE abrangendo famílias com renda mensal entre um e cinco salários mínimos, subiu 0,14% em dezembro, acumulando uma alta de 6,58% no ano.

JUROS

Depois de ter iniciado o ciclo de redução da taxa Selic em outubro último, baixando-a de 14,25% para 14% aa. o Comitê de Política Monetária do Banco Central – Copom voltou a reduzi-la em sua última reunião de 2016. Desta feita a taxa caiu para 13,75% aa. Em comunicado após a reunião a autoridade monetária afirmou que é razoável esperar uma intensificação do processo de flexibilização monetária caso a atividade econômica não dê sinais claros de retomada, posto que nesse caso as projeções de inflação devem se reduzir.

Taxa de Juros – Brasil



CÂMBIO E SETOR EXTERNO

A taxa de câmbio dólar x real, denominada P-Tax 800, que é calculada pelo Banco Central do Brasil, fechou o ano cotada a R\$ 3,2591, acumulando uma desvalorização de 16,54% em 2016.

O dólar alto, que favoreceu as exportações, além da forte redução das importações, permitiu ao Brasil encerrar o ano com um superávit na Balança Comercial de US\$ 47,7 bilhões, o maior da história.

Ainda em relação ao Balanço de Pagamentos, as transações correntes apresentaram, até novembro, um déficit acumulado em 12 meses, de US\$ 20,3 bilhões, ou o equivalente a 1,12% do PIB, que foi amplamente financiado pelos investimentos diretos no país (IED), que totalizaram US\$ 78,9 bilhões em 12 meses, ou 4,38% do PIB. As reservas internacionais, ao final de novembro, pelo conceito de liquidez eram de US\$ 372,8 bilhões e a dívida externa bruta US\$ 333,8 bilhões.

RENDA FIXA

Assim como o mercado de renda variável, o mercado de renda fixa foi altamente influenciado pelos eventos políticos que culminaram no impeachment de Dilma Rousseff. Desde as primeiras indicações de que a ex-presidente e sua base de apoio não se sustentariam no poder, as taxas de juros negociadas nos mercados futuros, bem como aquelas que remuneravam os títulos de renda fixa começaram a ceder antecipando os fatos.

Assim, o ano de 2016 ficou marcado por uma forte valorização dos títulos prefixados, e também dos títulos públicos atrelados ao IPCA, como a NTN-B.

Embora a volatilidade do mercado tenha sido alta durante o ano, também reforçada pela eleição de Donald Trump nos EUA, para os RPPS, alcançar a meta atuarial com o rendimento da carteira de renda fixa foi tarefa plenamente possível. O melhor desempenho entre os indicadores referenciais dos fundos de renda fixa compostos por títulos públicos foi o do IDkA 20, que acumulou alta de 53,19% em 2016, seguido do IMA-B 5+ que subiu 31,04%, enquanto a meta atuarial baseada no IPCA + 6% a.a. acumulou alta de 12,64% no mesmo período.

Nas tabelas abaixo, podemos constatar o desempenho dos principais indicadores de renda fixa que referenciam os fundos de investimento disponíveis para os RPPS, no ano e em vinte e quatro meses.

Rentabilidade dos Indicadores		
BENCHMA RK	2016	24M
IPCA + 6,00%	12,67%	32,17%
AO ANO		
INPC + 6,00%	12,97%	33,26%
AO ANO		
IBOVESPA	38,93%	20,44%
CDI	14,00%	29,09%
IRF-M 1	14,72%	29,64%
IRF-M 1+	29,64%	33,87%
IRF-M	23,37%	32,16%
IMA-B 5	15,48%	33,33%
IMA-B 5+	31,04%	38,52%
IMA-B	24,81%	35,90%
IMA-GERAL	21,00%	32,27%
IDKA 2A	15,21%	34,09%
IDKA 20A	53,19%	46,38%
POUPANÇA	8,31%	17,05%

RENDA VARIÁVEL

Para a bolsa brasileira também foi um ano de expressiva valorização. O índice Bovespa terminou 2016 com uma valorização de 38,93%, atingindo a marca de 60.227 pontos.

Cabe destacar a importante participação do investidor estrangeiro, que foi responsável pela metade das transações no mercado e pelo ingresso líquido de R\$ 14,32 bilhões destinados à compra de ações brasileiras.

Outro desempenho que cabe destacar no segmento de renda variável foi o dos fundos imobiliários, cujo índice de referência, o Ifix, teve valorização nominal de 32,33% no ano.

3. DESEMPENHO DA CARTEIRA NO ANO DE 2016

3.1 RESUMO DO ANO DE 2016

CLASSE DE ATIVOS	ADMINISTRADOR	CNPJ	FUNDO	31/12/2015	31/12/2016	Variação Nominal	Variação %
RENDAS FIXAS							
Títulos do Tesouro Nacional							%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	10740670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M1 TP FI	R\$ 401.512.156,79	R\$ 246.636.334,70	-R\$ 154.875.822,09	-	62,80
JS ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA	10.787.647/0001-69	SAFRA EXECUTIVE 2	R\$ 20.432.406,26	R\$ 23.372.142,72	R\$ 2.939.736,46		12,58
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	19768733/0001-07	FI BRASIL 2018 II TP RF	R\$ -	R\$ 41.033.803,62	R\$ 41.033.803,62		100,00
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	21919861/0001-28	FI BRASIL 2020 IV TP RF	R\$ -	R\$ 20.671.138,73	R\$ 20.671.138,73		100,00
Referenciado (IMA ou IDKA)							
BRL TRUST SERVIÇOS FIDUCIÁRIOS	11212322/0001-10	ULTRA RI RF CREDITO PRIVA	R\$ 4.053.935,04	R\$ 4.610.561,74	R\$ 556.626,70		12,07
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	13594673/0001-69	TMJ IMA-B FI RF	R\$ 9.670.750,36	R\$ 11.141.280,14	R\$ 1.470.529,78		13,20
BB GESTÃO DE RECURSOS DTV	13077418/0001-49	BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 20.245.441,41	R\$ 104.099.369,15	R\$ 83.853.927,74		80,55
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	14386926/0001-71	CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA	R\$ -	R\$ 164.210.506,51	R\$ 164.210.506,51		100,00
BRIDGE ADM DE RECURSOS LTD	23954899/0001-87	TOWER BRIDGE RENDA FIXA	R\$ -	R\$ 13.311.139,56	R\$ 13.311.139,56		100,00
BRIDGE ADM DE RECURSOS LTD	12845801/0001-37	TOWER BRIDGE RENDA FIXA	R\$ 57.825.971,57	R\$ 48.832.708,08	-R\$ 8.993.263,49	-	18,42
INTRAG DTVM LTDA	14298826/0001-93	KINEA II REAL ESTATE EQUI	R\$ 528.608,89	R\$ -	-R\$ 528.608,89	-	
BB GESTÃO DE RECURSOS DTV	13077418/0001-49	BB PERFIL FI RF PREVIDENCI	R\$ 173.282.802,67	R\$ 90.720.838,62	-R\$ 82.561.964,05	-	91,01
BANCO BNP PARIBAS	05862906/0001-39	BNPP TARGUS DI FIC REFER	R\$ -	R\$ 10.039.885,95	R\$ 10.039.885,95		100,00
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	23215097/0001-55	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO	R\$ -	R\$ 20.153.173,26	R\$ 20.153.173,26		100,00
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	03737206/0001-97	FI CAIXA BRASIL REFERENC	R\$ 35.254.600,27	R\$ 53.506.052,86	R\$ 18.251.452,59		34,11
BANCO ITAUCARD S/A	21838150/0001-49	ITAU INSTITUCIONAL ALOCA	R\$ -	R\$ 15.691.741,30	R\$ 15.691.741,30		100,00
BANCO ITAUCARD S/A	25306703/0001-73	ITAU INSTITUCIONAL ALOCA	R\$ -	R\$ 5.120.878,89	R\$ 5.120.878,89		100,00
BANCO ITAUCARD S/A	00832435/0001-00	ITAU INSTITUCIONAL FI REFE	R\$ 49.489.659,34	R\$ 107.534.959,67	R\$ 58.045.300,33		53,98
INTRAG DTVM LTDA	18687230/0001-36	ITAU INSTITUCIONAL TITULO	R\$ 5.039.532,48	R\$ 5.887.059,27	R\$ 847.526,79		14,40
GRADUAL CCTVM S/A	23431871/0001-65	TRX FIDC SENIOR	R\$ -	R\$ 5.696.827,51	R\$ 5.696.827,51		100,00
SANTANDER	17013985/0001-92	GBX PRIME I FIDC	R\$ 22.448.434,61	R\$ 41.457.219,63	R\$ 19.008.785,22		45,85
GRADUAL CCTVM S/A	13344834/0001-66	INCENTIVO II FIDC MULTISSE	R\$ 14.984.815,33	R\$ 15.231.326,70	R\$ 246.511,37		1,62
SOCIEDADE CORRETORA PAULIS	62285390/0001-40	FIDC BMC	R\$ -	R\$ 4.458.564,56	R\$ 4.458.564,56		100,00
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	12321820/0001-64	CAIXA BRASIL VIII RF IPCA	R\$ 3.848.950,00	R\$ -	-R\$ 3.848.950,00	-	
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	13058820/0001-86	CAIXA BRASIL XV RF IPCA	R\$ 4.546.600,00	R\$ -	-R\$ 4.546.600,00	-	

CLASSE DE ATIVOS	ADMINISTRADOR	CNPJ	FUNDO	31/12/2015	31/12/2016
------------------	---------------	------	-------	------------	------------

RENDA VARIÁVEL					
	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	14120148/0001-74	CAIXA BRASIL IPCA III FI MUL	R\$ 21.284.887,50	R\$ -
	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	14120277/0001-62	CAIXA BRASIL IPCA V FI MU	R\$ 4.270.070,00	R\$ -
	JS ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA	17.253.869/0001-40	SAFRA CARTEIRA PREMIUM	R\$ -	R\$ 10.166.721,75
	XP INVESTIMENTOS	21.827.663/0001-54	XP LONG SHORT 60 FIC FIM	R\$ -	R\$ 10.687.816,78
	BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEROS	12430167/0001-71	CAPITANIA MULTI CREDITO F	R\$ 10.391.053,15	R\$ 21.979.785,95
FIA indexado					
	BANCO ITAUCARD S/A	17073556/0001-00	KINEA PIPE FIA	R\$ 6.153.983,51	R\$ 11.681.414,45
	BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	02895694/0001-06	FRANKLIN TEMPLETON FVL	R\$ 25.827.429,47	R\$ 16.442.369,36
	BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	17368239/0001-11	APEX AÇÕES FIC DE FIA INS	R\$ -	R\$ 25.237.641,89
	BEM DTVM	08621010/0001-56	JPM AÇÕES FIC DE FIA	R\$ -	R\$ 28.301.196,96
	BEM DTVM	09289072/0001-72	QUELUZ VL FIA	R\$ -	R\$ 6.247.083,51
	BEM DTVM	14550994/0001-24	AZ LEGAN BRASIL FIA	R\$ -	R\$ 6.194.443,84
	BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	11182064/0001-77	CONSTANCIA FUNDAMENTO	R\$ -	R\$ 2.492.658,37
	BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	14083797/0001-42	PACÍFICO AÇÕES FIC FI	R\$ 27.571.356,44	R\$ 42.185.439,18
	BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	12312767/0001-35	ÁTICO FLORESTAL FIP	R\$ 12.299.214,57	R\$ 12.107.746,48
	PLANNER CORRETORA	15711367/0001-90	W7 FIP	R\$ 6.518.985,34	R\$ 14.456.204,45
	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	16676620/0001-85	CAIXA FIP CYRELA	R\$ 3.495.939,32	R\$ 3.645.290,77
	CITIBANK DTVM S/A	14584094/0001-06	BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA	R\$ 8.946.916,47	R\$ 4.160.250,80
	PLANNER CORRETORA	18369510/0001-04	INFRA FII	R\$ 5.993.219,98	R\$ 5.971.698,97
	INTRAG DTVM LTDA	14723780/0001-97	KINEA II REAL ESTATE EQUIPMENT	R\$ 4.553.224,01	R\$ 4.766.280,29
	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	12887506/0001-43	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO CAIXA TRX	R\$ 490.000,00	R\$ 535.000,00
	ELITE DTVM	15461076/0001-91	FII BR HOTEIS	R\$ 24.014.617,97	R\$ 19.346.279,84
				R\$ 985.017.931,75	R\$ 1.300.022.837,01
					R\$ 315.047.274,26
					40,25

Indicadores

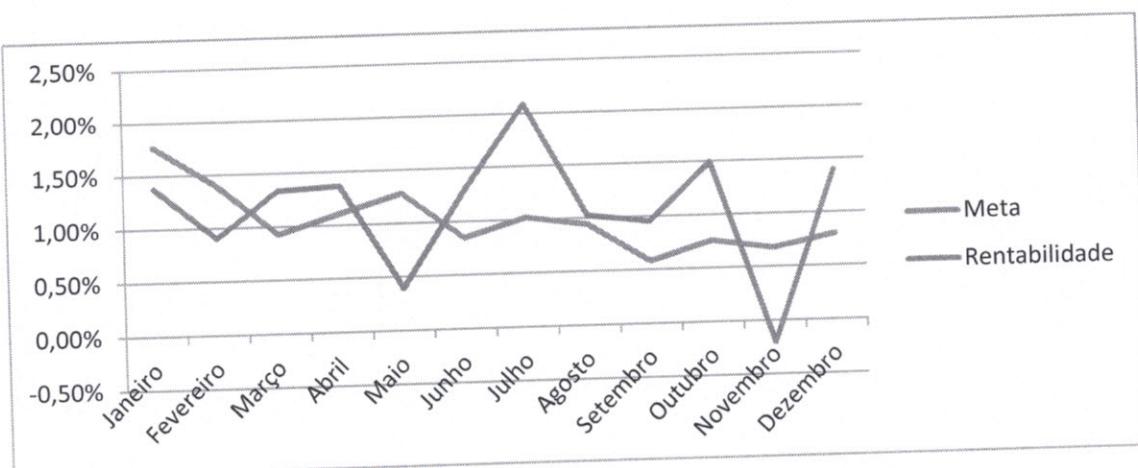
Meta do Ano	16,67%
CDI acumulado 2016	14,00%
IBOVESPA de 2016	38,94%
IRF-m1 2016	14,72%
IMA-B 2016	24,80%
IMA-B 5 2016	15,78%
IPCA	6,29%

Fonte Relatórios Banco do Brasil

Provisão de Perdas- Dez /2015(VaR 252 d.u.)

36.541.602,26

Janeiro	1,77%	1,38%
Fevereiro	1,40%	0,90%
Março	0,93%	1,34%
Abril	1,11%	1,37%
Maio	1,28%	0,39%
Junho	0,85%	1,28%
Julho	1,02%	2,09%
Agosto	0,94%	1,03%
Setembro	0,58%	0,95%
Outubro	0,76%	1,49%
Novembro	0,68%	-0,20%
Dezembro	0,80%	1,40%
Total	12,67%	14,26%



Ao longo do ano, podemos verificar que o patrimônio do Ipresb cresceu cerca de R\$ 315.047.274,26, rentabilizando 14,26%, fazendo frente à meta atuarial de 12,67%.

Como paradigma, os Fundos de pensão, de acordo com a Revista Investidor Institucional, edição de março, fecharam com média de 14,56%, considerando que a legislação lhes inserem num campo mais abrangente de autorizações para investimentos.

Os meses de maior desafio para a carteira foram maio e novembro, sendo o primeiro reflexo do contexto político nacional, e o segundo, o resultado das eleições norte-americanas. Mesmo nestas situações, a carteira refletiu a estratégia enraizada nos últimos anos, que é a pouca volatilidade e a resiliência em momentos de instabilidade no mercado financeiro.

CLASSE DE ATIVOS	ADMINISTRADOR	OPF	FONDO	RENTABILIDADE			
				31/12/2015	REVALUAÇÃO NOMES	31/12/2015	% DA CARTEIRA
CLASSE DE ATIVOS	ADMINISTRADOR	CNPJ	VALOR	30/11/2015	REVALUAÇÃO NOMES	31/12/2015	% DA CARTEIRA
RENDA FSA							
Títulos do Tesouro Nacional				R\$ 401.512.195,19	R\$ 412.298.910,99	R\$ 40.302,7	R\$ 6.689.975,32
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	10140570001-96	CAIXA BRASIL REFINATRIE	R\$ 20.432.405,26	R\$ 20.564.947,35	2.024,9	R\$ 232.541,09	1.130.000,05
SAFRA EXECUTIVE 2				R\$ 4.053.505,04	R\$ 4.198.487,55	R\$ 401,6	R\$ 44.592,51
Referencial (Mário IBSA)				R\$ 9.670.750,36	R\$ 9.685.112,08	R\$ 19.962,92	R\$ 219.470,50
BR TRUST SERVIÇOS FINANCEIROS E (11723220001-10	ULTRAFIRE CREDITO FINANCI			R\$ 20.245.441,41	R\$ 20.245.441,41	R\$ 20.245.441,41	R\$ 1.961,5
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS (15946730001-59	BNY MELLON			R\$ 5.785.911,57	R\$ 5.945.761,57	R\$ 5.827,0	R\$ 15.937.90,00
BB GESTAO DE RECURSOS DE IMAGA				R\$ 528.868,99	R\$ 534.168,59	R\$ 0,5023	R\$ 5.499,70
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS (1285010001-37	TOWER BRIDGE REFINATRIA			R\$ 173.832.802,57	R\$ 175.108.362,14	R\$ 1.252.559,47	R\$ 1.053.451
INTRAG DIVERSIFIDA				R\$ 35.622.896,78	R\$ 36.020.295,51	R\$ 380.295,51	R\$ 99.783.139,1
BB GESTAO DE RECURSOS DE IMAGA (13017460001-46	BB FUNDAMENTAL PREVISÃO			R\$ 25.754.800,27	R\$ 26.247.111,17	R\$ 522.271,83	R\$ 1.053.150,04
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS (1046210001-00	BNY MELLON INSTITUCIONAL			R\$ 49.469.669,34	R\$ 50.011.931,17	R\$ 4.906,0	R\$ 1.15,5
BANCO ITAÚ UNIBRASIL	(008324350001-00	ITAU INSTITUCIONAL MILLOS PLENOS OF	R\$ 5.708.532,48	R\$ 5.258.048,79	0,5130	R\$ 39.522,46	
INTRAG DIVERSIFIDA				R\$ 22.759.376,61	R\$ 22.332,02	R\$ 310.942,00	R\$ 1.365.386,69
BB GESTAO DE RECURSOS DE IMAGA (13017460001-46	BB FUNDAMENTAL PREVISÃO			R\$ 14.948.815,33	R\$ 15.146.500,95	R\$ 1.494,2	R\$ 161.355,33
GRUPO DIVERSIFIDA				R\$ 3.946.900,00	R\$ 3.966.460,00	R\$ 6.322,00	R\$ 67.956,00
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	12321830001-64	CAIXA BRASIL VLR FCA - OP	R\$ 4.546.600,00	R\$ 4.699.392,50	0,6517	R\$ 62.992,50	
Total da carteira previdenciária			R\$ 985.017.980,75	R\$ 1.020.538.375,59	100.000,00	R\$ 85	R\$ 11.842.370,08
Total do fundo previdenciário			R\$ 653.785.066,04	R\$ 366.780.678,75			
Aporte líquido do mês no fundo previdenciário							
Saldo Patrimonial da carteira previdenciária							

RENDIMENTO											
CLASSE DE ATIVOS	ADMINISTRADOR	CNPJ	FUNDO	31/01/2016	RELOCACAO NOME	28/07/2016	% DA CARTERA	RENT. MÉS.	CUPOM	% RENT.	% DO ÍNDICE
REND. FÍXIA											MES
(Itens do Tesouro da Cetec)											
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	102406700001-46	CAUCA BRASIL FIC-AM 1P-FIISF	RS 411.260,970,99	-RS 75.000,000,00	RS 363.630,195,33	33,9174	RS 4.581.282,46			1.113854311	18,84654266
SAITRA EXECUTIVE 2			RS 20.864,947,35		RS 20.886,344,25	2.0002	RS 221.395,90			1.071394452	98,29031673
BRL TRUST SERVICOS FINANCIEROS E PART. II 112123220001-10	ULTRA RI RI CRÉDITO PRIVADO	RS 4.088.487,55			RS 4.098.420,97	0,9301	-RS 57,58	-0,001404069	-0,002618493	0,866798615	-0,103906603
BNY MELLON SERVICOS FINANCIEROS D'VM 139946700001-99	LIMA BRAZIL FIC-2A-CP LP	RS 9.985,713,28			RS 9.954,255,15	0,9547	RS 85.541,72	1.9810	128,6698312	141,35371	141,35371
BB GESTAO DE RECURSOS DIVINSA	BB PREVIDE FIC-2	RS 20.856,369,78	RS 20.000,000,00	RS 41.164,240,66	3,9461	RS 245.441,41	0	0	0	0	0
CAJAR FIC BRASIL FIC-2A-CP LP		RS 50.000,000,00	RS 50.000,000,00	RS 47.956,46	RS 57,520,241,89	5,5232	RS 1.615,19,68	-3,153248311	-204,80,18,08	0,91732457	-225,76,18,08
BNY MELLON SERVICOS FINANCIEROS D'VM 129458010001-37	TOWER BRIDGE FIC-2A-CP	RS 59,465,761,57			RS 53,981,42	0,9517	RS 4,872,83	0,9659376	96,533,7756	68,16589	68,16589
BB GESTAO DE RECURSOS DIVINSA	BB PESO FIC FIC REFERENCIADO	RS 175.108,362,14			RS 176.769,799,33	16,6572	RS 1.661,437,79	0,9659376	96,533,7756	68,16589	68,16589
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	FI CAIXA BRASIL REFERENCIAO CI	RS 36,923,886,78			RS 35,971,831,07	3,4617	RS 38,349,729	0,9659376	96,534,7913	70,96,69	70,96,69
BANCO ITAU/CARD SA	ITAL INSTITUCIONAL FIC REFERENCIADO CI	RS 50.017,93,17			RS 50.508,98,92	4,8444	RS 50.567,95,09	0,9659376	96,534,7913	70,96,69	70,96,69
INTRAG DIVIMLTA	ITAU INSTITUCIONAL TITULOS PUBLICOS FIC	RS 5,230,048,79			RS 5,329,898,32	0,5112	RS 39,532,48	1,75	28,61,02,91	125	125
GRADUAL OCTVMSA	GBA PRAE FIC	RS 22.759,376,61			RS 23,102,645,16	2,2136	RS 341,286,55	1,489346322	1,489346322	19,533,117640	17,107,1054
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	INCENTIVO FIC MULTISECTORIAL	RS 15,447,500,56			RS 15,297,169,42	1,4612	RS 15,195,43	1,489346322	1,489346322	19,533,117640	17,107,1054
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 3,000,146,00			RS 3,988,810,00	0,3605	RS 60,864,00	1,553039748	155,3039748	110,33,041	110,33,041
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	130565200001-96	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 4,905,592,50		RS 4,671,827,50	0,4467	RS 68,235,00	1,482022093	148,2022093	105,37,348	105,37,348
Total da carteira previdenciária											
RENTABILIDADE											
REND. VARIAVEL	ADMINISTRADOR	CNPJ	FUNDO	31/01/2016	RELOCACAO NOME	28/07/2016	% DA CARTERA	RENT. MÉS.	CUPOM	% RENT.	% DO ÍNDICE
RENDIMENTO											
Mercado											
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 21.800,362,50	RS 21.969,800,00	2,1072	RS 362.437,50	1,677394943	167,7394943	119,51,283	119,51,283
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 4,330,382,50	RS 4,408,420,50	0,4229	RS 181.767,90	1,677394943	167,7394943	119,51,283	119,51,283
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	107,179,62
BRG FIC	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	141201480001-74	CAUCA BRASIL FIC-2A-CP	RS 10.446,196,08	RS 10.603,727,79	1,0710	RS 157.591,11	1,500860225	150,0860225	107,179,62	

18

Aporte líquido do mês no fundo previdenciário
Saldo patrimonial da carteira previdenciária

CLASSE DE ATIVOS	ADMINISTRADOR	CNPJ	FUNDO	29/02/2016	RELOCACAO/NOMÉS	31/03/2016	RENTRABILIDADE					
							% DA CARTERA	RENT. MÉS	CUPOM	% RENT.	% DO ÍNDICE	% DA META
RENDA FIXA												
Títulos do Tesouro Nacional												
CÂMADA ECONOMICA FEDERAL	107406700001-06	CÂMADA BRASIL RF-MT-TP-FI-RF	R\$ 355.630.952,33	R\$ 140.000.000,00	R\$ 199.334.794,70	R\$ 18.465,90	R\$ 3.391.988,76	0,959186275	16.22986928	103,3862		
SAFRÁ EXECUTIVE 2			R\$ 20.886.344,25		R\$ 21.144.424,59	1.954,48	R\$ 250.080,34	1,235641513	113,3616067	132,86468		
Referência do IM/Anu (DI/A)												
BRL TRUST SERVICOS FIDUCIARIOS E PART	112123220001-10	ULTRA RI-F CREDITO PRIVADO	R\$ 4.098.423,97		R\$ 4.169.524,29	0,3955	R\$ 10.989,418,77	0,9337	16,163,02	1,73467207	76.79540133	186,52398
BNL MELLON SERVOS FINANCIEROS DTVM	135946730001-69	LARX-MA-B FI-F	R\$ 9.954.250,15		R\$ 50.000.000,00	R\$ 50.046.301,05	R\$ 4.626,99	R\$ 46.301,05	0,72	46.75324675	77,419355	
INTRAG DIVERSITATIA	0609538190001-15	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFOLAGA 015 FIC	R\$ 41.164.240,86		R\$ 41.380.776,15	3.825,75	R\$ 216.528,49	0,526011136	43.83426135	56.560337		
BB GESTAO DE RECURSOS DTVM SA		CÂMADA BRASIL DIAMETRA 24 RF-LP	R\$ 50.000.000,00	R\$ 100.000.000,00	R\$ 149.988.886,07	13.9584	R\$ 101.131,93	-0,202053898	-14,76378546	-21,748602	#DIV/0!	
CÂMADA ECONOMICA FEDERAL	1438972600001-71	TOWER BRIDGE RENDA FIXA II	R\$ 57.590.241,89		R\$ 12.538.103,24	1.196,95	R\$ 65.240,48	-1,125259816	-73,34414777	-121,8278		
BRODE ALTAIR DE RECURSOS LTDA	1985648990001-87	TOWER BRIDGE RENDA FIXA	R\$ 56.397.986,40		R\$ 541.777,29	0,0501	R\$ 2.745,67	0,5094656408	50.94559494	54.780152		
INTRAG DIVERSITATIA	141288260001-93	TOWER BRIDGE RENDA FIXA REFERENCIADO	R\$ 53.981,942		R\$ 178.766.483,73	16,527,2	R\$ 1.966.683,60	1,11237874	111,237874	111,237874		
BB GESTAO DE RECURSOS DTVM SA	150714180001-49	BBL PTEFL FI-F PREVISÃO	R\$ 176.996.799,53		R\$ 35.777.837,07	3.766,46	R\$ 423.899,39	1,178228964	126,98072			
BB e BB referencial credito privado		CÂMADA BRASIL REFERENCIADO	R\$ 51.065,411,13		R\$ 4.7229	R\$ 565,12,21	R\$ 1,75	1,15940317	15,940317	124,66701		
BANCO ITAU/CAIXA SIA	0098524350001-00	ITAU INSTITUCIONAL ITAU REFERENCIA DO	R\$ 5.329.889,32		R\$ 5.383.748,35	0,4859	R\$ 39.532,48	1,307034661	119,9864736	188,17704		
INTRAG DIVERSITATIA	1698772300001-36	GEBX PRIME I FIC	R\$ 23.000.645,16		R\$ 23.287.771,18	2.163,96	R\$ 302.072,50	1,274860104	127,4860104	137,09147		
GRADUAL OCTUM SIA	1134948340001-66	INCREMENTO I FIC MULTISSETORIAL	R\$ 15.482.342,24		R\$ 15.482.342,24	0,3123	R\$ 49.338,00	4,016446,00	4,016446,00	4,016446,00		
CÂMADA ECONOMICA FEDERAL	1423182000001-64	CÂMADA BRASIL VII RF POA - CP	R\$ 3.968.810,00		R\$ 4.016,00	R\$ 4.016,00	R\$ 62.460,00	1,30525213	133,525213	134,525213		
CÂMADA ECONOMICA FEDERAL	1505986200001-86	CÂMADA BRASIL XII RF POA - CP	R\$ 4.677.287,50		R\$ 4.740.287,50	0,4382	R\$ 62.460,00					
RENTRABILIDADE												
CLASSE DE ATIVOS	ADMINISTRADOR	CNPJ	FUNDO	29/02/2016	RELOCACAO/NOMÉS	31/03/2016	% DA CARTERA	RENT. MÉS	CUPOM	% RENT.	% DO ÍNDICE	% DA META
Mercado de capitais												
CÂMADA ECONOMICA FEDERAL	1412014900001-74	CÂMADA BRASIL POA-FI-MULTIMERCADO - CP	R\$ 21.980.800,00		R\$ 22.293.675,00	2,3611	R\$ 323.775,00	1,4732751	147,32751	158,46533		
CÂMADA ECONOMICA FEDERAL	141202770001-62	CÂMADA BRASIL POA-FI-MULTIMERCADO - CP	R\$ 4.019.142,50		R\$ 4.477.005,00	0,4139	R\$ 67.867,50	1,59313475	153,913475	165,48901		
BTG PACTUAL SERVIOS FINANCIEROS SIA	124301670001-71	CAPTIVA MULTICREDITO PRIVADO	R\$ 10.930.727,79		R\$ 10.734.984,45	0,9025	R\$ 131.256,66	1,237139058	123.7636058	133.10504		
(Fls. não exibido)												
BANCO ITAU/CARD SA	170735660001-00	KINEA SPE-FA	R\$ 6.056,310,02		R\$ 7.056.961,10	0,16534	R\$ 981.270,18	16,34270766	276.5598285	175,7409		
BNY MELLON SERVOS FINANCIEROS DTVM	173882290001-01	FRANKLIN TEMPESTO FUNDAMENTAÇÕES	R\$ 25.847.879,00		R\$ 26.589.740,63	2,6106	R\$ 2.560.740,63	10,9920864	170,8502916	108,5301		
Fundo de Ações												
BANCO ITAU	096210100001-56	APEN ACQS FIC DE FA- RISI II	R\$ 10.470.573,61		R\$ 10.500.000,00	0,5	R\$ 21.570.12,13	1,93942	R\$ 620.859,52	7,636062228	7,636062228	
BANCO ITAU/CARD SA	1408307970001-42	PAULISTAO ACQS FIC-FI	R\$ 10.601.194,17		R\$ 10.000.000,00	0,5	R\$ 20.502.868,14	1,88955	R\$ 98,338,03	-0,92271782	-41,0481246	-59,7433087
BTG PACTUAL SERVIOS FINANCIEROS SIA	1408307970001-42	PAULISTAO ACQS FIC-FI	R\$ 28.349.927,15		R\$ 30.339.561,28	0,8040	R\$ 1.981.634,13	7,025076172	R\$ 18,877802	75,44927		
BNY MELLON SERVOS FINANCIEROS DTVM	121276570001-25	A TCO B-PRESTA FIP	R\$ 12.289.417,11		R\$ 12.252.831,99	1,1328	R\$ 48,78	16,785,12	-0,36304553	-8,88341188	-14,701066	
Fundo de investimento em Participações												
CÂMADA ECONOMICA FEDERAL	186785620001-85	WTF FP	R\$ 12.642.934,49		R\$ 12.613.530,66	1,1682	R\$ 28.994,63	-0,22839625	-14,88196334	-24,68561		
CTEBANK DTVM SIA	145840540001-06	CÂMADA FIC-YELA	R\$ 3.501.304,07		R\$ 3.501.504,07	0,0002	R\$ 3.521.506,65	0,3256	R\$ 3.590,74	-0,1020398	-6,623467528	-6,623467528
Fundo de investimento imobiliário												
CÂMADA ECONOMICA FEDERAL	147237800001-97	CTEBANK DTVM SIA	R\$ 4.565.447,04		R\$ 4.557.316,81	0,4213	R\$ 7.828,23	-0,171478157	#DIV/0!	-18,438511	11861,002	
BNY MELLON SERVOS FINANCIEROS	154610760001-91	CTEBANK DTVM SIA	R\$ 4.935.560,00		R\$ 4.967.950,00	0,0405	R\$ 467.950,00	R\$ 8.730,17	108,447343	108,447343	108,447343	
Total da carteira previdenciária			R\$ 1.042.623.017,67		R\$ 1.081.643.686,40	100,0000	R\$ 13.526.002,77	R\$ 5.730,17	1,339507%	97,58%	143,21%	
Aporte líquido do mês no fundo previdenciário			R\$ 653.735.696,96									
Saldo patrimonial da carteira previdenciária			R\$ 653.735.696,96									

CLASSE DE ATIVOS	ADMINISTRADOR	CNPJ	FUNDO	29/02/2016	REALOCAÇÃO MÊS	31/03/2016	% DA CARTERA	RENTABILIDADE											
				29/02/2016	REALOCAÇÃO MÊS	31/03/2016	% DA CARTERA	RENT. MÊS	CUPOM	% RENT.	% DO INDICE	% DA META MÊS							
ITENS DE PAGAMENTO																			
Multimercado																			
CIA/CA ECONOMICA FEDERAL	107406700001-06	CAUSA BRASIL FIF-MI TPF FIF	RS 211.000.986,76	-R\$ 156.889.584,04	RS 72.257.318,10	6.5244	RS 2.005.566,46	0,950482823	-1,23456277	74,256471	0,990522741	118,4788978 77,775777							
TRUST/INTERNAU																			
BRL TRUST SERVIÇOS FINANCEIROS E PART	112123220001-10	LTDA-FIPE-CREDITO PRIVADO	RS 4.273.086,44		RS 4.112.915,11	0,3714	RS 100.183,39	-2,377801476	-44,178157206	-165,77555	-1,29510563	-23,11707628 98,391435							
BRY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTV	159546739001-69	LUM-MB-B-FI	RS 10.243.987,49		RS 10.114.971,65	0,9134	RS 120.013,84	0,72	46,7524675	56,25	416,598,91								
INTRAG DTM LTDA	0090381190001-15	MAU INSTITUCIONAL REDE FVA INFILTRACAO 5 FIC	RS 51.350.580,24		RS 75.000.000,00	RS 126.767,177,15	11.447,3	RS 175.000,00	175,028,41	84,224/281	56,45027	0,7576530342	81,98027182 62,278688						
CIA/CA ECONOMICA FEDERAL	110609130001-10	CAUSA BRASIL B-A-B TPF-LP	RS 42.067.247,95		RS 80.000.000,00	RS 122.372.797,96	11.0564	RS 305.549,71	1,311.000,00	1,311.000,00	1,311.000,00	1,311.000,00	93,527174						
BB GESTAO DE RECURSOS DTM S/A	988 PREV-FI EKA-2	BB PREV-FI EKA-2	RS 152.323,175,52		RS 153.534,50	0,83	13.894,44	RS 152.291,20	1,19107827	1,19107827	1,19107827	1,19107827							
CAVA ECONOMICA FEDERAL	1438652690001-71	CAVA FIFRAIS INPC 24-NF LP	RS 13.310.591,95		RS 13.310.591,95	RS 1,2601	RS 65	13.260,1	0,501166281	48,7102615	58,089,41	0,501166281	48,7102615 58,089,41						
BRIDGE FIDM DE RECURSOS LTDA	2395459900001-37	TOWER BRIDGE REDE FVA I	RS 44.224,04		RS 44.224,04	RS 0,47	RS 45.261,02	RS 0,47	331,004,88	1,017210682	82,0197411	1,017210682	82,0197411						
BRIDGE FIDM DE RECURSOS LTDA	130774110001-49	BBE PERPETRIFIRE PREVIDENCIARIO	RS 180.521,42		RS 180.521,42	RS 1,0966	RS 62.348,306,90	RS 1,0966	1,827,284,43	0,659850892	87,5171982	75,261015	0,659850892	87,5171982 75,261015					
BB GESTAO DE RECURSOS DTM S/A	037372000001-97	FI CAUSA BRASIL REFERENCIAL D	RS 51.539,60		RS 36.000.000,00	RS 12.423.904,41	RS 12.423.904,41	RS 502.06,32	RS 502.06,32	0,77178593	68,30513954	75,650204	0,77178593	68,30513954 75,650204					
CIA/CA ECONOMICA FEDERAL	1322718600001-84	SOCIODE CORRETORA PAULISTA S.A.	RS 62.285.580,00		RS 7.046.494,00	RS 0,0000	RS 0,0000	RS 0,0000	1,75	22,777773	38,17615	22,777773	38,17615						
CIA/CA ECONOMICA FEDERAL	1322718600001-84	CAVA EBA SL VLR FCP - CP	RS 4.784,795,00		RS 4.837.352,50	0,4368	RS 52.557,50	RS 4.837.352,50	1,09427414	98,8573767	85,814842	98,8573767	85,814842						
CAVA ECONOMICA FEDERAL	130585200001-46	CAVA BRASIL XVR REFRENCPA - CP	RS 11.098.409,10		RS 11.098.409,10	RS 0,0000	RS 0,0000	RS 0,0000	0,43691569	100,8040408	89,230114	100,8040408	89,230114						
Total da carteira prevista/ganha																			
CLASSE DE ATIVOS				RENDIMENTO				RENTABILIDADE											
CLASSE DE ATIVOS		ADMINISTRADOR		CNPJ		FUNDO		29/02/2016		REALOCAÇÃO MÊS		31/03/2016							
								% DA CARTERA		% DA CARTERA									
								% DA CARTERA		% DA CARTERA									
								% DA CARTERA		% DA CARTERA									
RENDIMENTO VARIÁVEL				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
ITENS DE PAGAMENTO				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
Multimercado				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
CIA/CA ECONOMICA FEDERAL				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
TRUST/INTERNAU				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
BRL TRUST SERVIÇOS FINANCEIROS E PART				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
BRY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTV				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
INTRAG DTM LTDA				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
CIA/CA ECONOMICA FEDERAL				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
BB GESTAO DE RECURSOS DTM S/A				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
CIA/CA ECONOMICA FEDERAL				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
BRIDGE FIDM DE RECURSOS LTDA				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
BRIDGE FIDM DE RECURSOS LTDA				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
BRIDGE FIDM DE RECURSOS LTDA				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
BB GESTAO DE RECURSOS DTM S/A				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
BB GESTAO DE RECURSOS DTM S/A				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
CIA/CA ECONOMICA FEDERAL				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
INTRAG DTM LTDA				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
CIA/CA ECONOMICA FEDERAL				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
Fundo de Investimento Imobiliário				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
CIA/CA ECONOMICA FEDERAL				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
CIA/CA ECONOMICA FEDERAL				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
CIA/CA ECONOMICA FEDERAL				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
CIA/CA ECONOMICA FEDERAL				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
CIA/CA ECONOMICA FEDERAL				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
CIA/CA ECONOMICA FEDERAL				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
CIA/CA ECONOMICA FEDERAL				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
CIA/CA ECONOMICA FEDERAL				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
CIA/CA ECONOMICA FEDERAL				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
CIA/CA ECONOMICA FEDERAL				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
CIA/CA ECONOMICA FEDERAL				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
CIA/CA ECONOMICA FEDERAL				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
CIA/CA ECONOMICA FEDERAL				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
CIA/CA ECONOMICA FEDERAL				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
CIA/CA ECONOMICA FEDERAL				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
CIA/CA ECONOMICA FEDERAL				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
CIA/CA ECONOMICA FEDERAL				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
CIA/CA ECONOMICA FEDERAL				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
CIA/CA ECONOMICA FEDERAL				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
CIA/CA ECONOMICA FEDERAL				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
CIA/CA ECONOMICA FEDERAL				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
CIA/CA ECONOMICA FEDERAL				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
CIA/CA ECONOMICA FEDERAL				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
CIA/CA ECONOMICA FEDERAL				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
CIA/CA ECONOMICA FEDERAL				RENDIMENTO VARIÁVEL				RENTABILIDADE											
CIA/CA ECONOMICA FEDERAL				RENDIMENTO VARIÁVEL															

Aporte líquido do mês no fundo previdenciário

Saldo Patrimonial da carteira previdêncial



卷中四
三〇

IPRESB

RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTO
JUNHO DE 2016

Aporte líquido do mês no fundo previdenciário

R\$



**MUNICÍPIO DE
BARUERI**



**RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTO:
AGOSTO DE 2016**

CLASSE DE ATIVOS	ADMINISTRADOR	CNPJ	FIMDO	RENDA NOMES	31/07/2016	RENDA NOMES	30/08/2016	% DA CARTERA	RENDIMENTO						
									RENDA MÉS	CUPOM	% REN.	% DOMÍNIO	% DA META		
Italia do Tijucano															
SAÚDE	CIA/ ECONOMICA FEDERAL	1074607100001-06	CIA/ BFR/ BFR/ FCA/ FCA/ FPI/ FPE	RS 20.306.021,17	RS 30.018.048,08	RS 22.091.021,30	RS 22.591.753,73	1.562,9	RS 280.130,22		1.03,1	100.000/000,14	101.078,43		
									RS 22.591.753,98	RS 263.702,43	1.163.310,53	1.056,965/000,13	100.264,112,08		
	CIA/ ECONOMICA FEDERAL	197697330001-07	F/ BFR/ SA/ 2018/ IP-PE	RS 30.296.594,72	RS 10.000.000,00	RS 19.951.871,11	1.064,6	-RS 367.567,92	RS 613.071,40			1.200,62/000,14	110.351,32,33		
	CIA/ ECONOMICA FEDERAL	219196910001-28	F/ BFR/ SA/ 2020/ N/ IP-PE	RS 319.429,03											
Setor de Indústria/Manuf.															
IBA/ TRAB/ SERV/OS FIN/ COM/ BANCO	1191232/0001-10	I/ TRAB/ F/ CREDITO/ PRV/AD	RS 4.343.820,51		RS 4.398.984,93	0,567,1	RS 56.164,42		1.20/20/2054	145.277/84,87	126.762,04				
IBA/ TRAB/ SERV/OS FIN/ COM/ BANCO	13094673/0001-60	TRAB/ MA/ F/ TRAB/	RS 10.580.580,43		RS 10.580.580,43				RS 84.750,52	RS 84.750,52		0,30/192,1554	90.103,54/05	78.619,04	
IBR/ MELLON SERV/OS FIN/ COM/ BANCO	130774/850001-40	IBR/ PTE/VO/ D/ F/ MA/ 5+	RS -	RS 49.880.000,00	RS 49.199.380,34	4,097,93	-RS 690.510,06		RS 617.333,56/04,08	0,57/260/04,08	61.7,333,56/04,08				
IBR/ GESTAO DE FICULOS/OS ITAM/SA	000003819/0001-15	ITAM/ INSTITUCIONAL/ FIC/ FIA/ INFELACAO/ 5 FIC	RS 12.911.267,95		RS 12.758.810,28	12,758,810,28			RS 674.167,72						
INTERG/ DIV/ M/ TDA									RS 25.000.000,00		21.758,65				
IBR/ GESTAO DE FICULOS/OS ITAM/SA	130774/850001-10	IBR/ PTE/VO/ D/ F/ MA/ 5	RS 17.981.797,05		RS 18.045,547,85	15,063,4	RS 1.868.648,77					1.01/1884,78/06	88.002/0051	90.205,37	
IBR/ GESTAO DE FICULOS/OS ITAM/SA	11060913/0001-10	CIA/ BFR/ SA/ 2018/ 5 IP-PE	RS 12.480.068,27	-RS 25.000.000,00	RS 100.488.012,96	8,383,9	RS 1.607.971,59					1.2/159,05/1	106.605,95/0,33	119.248,87	
CIA/ ECONOMICA FEDERAL	130774/850001-40	IBR/ PTE/VO/ D/ F/ MA/ 5	RS 15.499.177,54		RS 15.499.177,54	13,22/29	RS 1.994.161,47					1.2/159,05/1	106.605,95/0,33	119.248,87	
IBR/ GESTAO DE FICULOS/OS ITAM/SA	1433692/260001-71	CIA/ BFR/ SA/ 2018/ 5 IP-PE	RS 165.594,96/07		RS 12.994.671,51	12.994.671,51			RS 1.35.690,23				1.064,05/05,68	84,00/01	104.402,47
CIA/ ECONOMICA FEDERAL	1433692/260001-71	TOMER/ BROK/ FID/ FIA/ 1	RS 46.587,00	RS 73,50	RS 47.160.33,93	3,934,7	RS 572.380,43					1.2/205/12/11	112.712/56/51	120.448,16	
IBR/ GESTAO DE FICULOS/OS ITAM/SA	12845801/0001-37	TOMER/ BROK/ FID/ FIA/	RS 69.728,67/35	RS 49.000,00	RS 14.378.048,35	1.1986	RS 453.380,52					1.1/118,96/16	58.000/03/16	69.752,09	
IBR/ GESTAO DE FICULOS/OS ITAM/SA	130774/850001-40	IBR/ PTE/VO/ D/ F/ MA/ 5	RS 12.420.427,09		RS 12.498,159,52	1.0488	RS 1.49.923,43					1.2/207/14/45	99.75/191,19	118.343,4	
IBA/ ECONOMICA FEDERAL	03737085/0001-97	IBR/ CABA/ BFR/ SA/ REFERENDACAO/ D	RS 15.000.000,00		RS 15.000.000,00	15.000,00			RS 1.479,00/0,97	1.24/06	RS 21.600,03		0,774,38/00/08	63.598,99/0,53	75.002,03
BANCO ITAU/BRAS/SA	216591/500001-40	IBR/ INSTITUCIONAL/ ALUGO/ QD/ DINAMICA/ 75 FIC	RS 17.558.938,49	-RS 15.000.000,00	RS 2.714.757,73	0,22/23	RS 159.819,24					1.1/32,42/04,38	108.926,56/0,51	111.003,96	
BANCO ITAU/BRAS/SA	000573/24/0001-06	IBR/ INSTITUCIONAL/ ALUGO/ QD/ DINAMICA/ 75 FIC	RS 5.604.239,76		RS 5.608.186,50	0,4729	RS 5.608.186,50					1.2/22,15/07/27	102.641,67/16	110.765,62	
INTERG/ BANCA/ITAM/DA	23243187/0001-65	IBR/ CABA/ BFR/ SA/ REFERENDACAO/ D	RS 10.121.910,26		RS 10.245.893,51	0,05548	RS 125.639,95					1.1/22,15/07/21/61	126.468,87/21	105.502,17	
GRADUAL/ CTVM/SA	17013086/0001-92	IBR/ CABA/ BFR/ SA/ REFERENDACAO/ D	RS 16.306.056,00		RS 15.498.603,00	1.3,906	RS 1.474,15					1.0/97,00/0,95	60.591,56/0,15	65.591,68	
SANTANDER	1324483/0001-06	IBR/ CABA/ BFR/ SA/ REFERENDACAO/ D	RS 16.160.387,80		RS 16.210.321,19	0,2011	RS 115.912,06					1.0/50,00/0,95	139.43/00/01	194,493	
GRADUAL/ CTVM/SA	1324483/0001-06	IBR/ CABA/ BFR/ SA/ REFERENDACAO/ D	RS 7.317.179,13		RS 4.942.145,00	0,4125	RS 2.100,00					0,0240/0,97/	3,51/17/00/05	4.055,01	
CIA/ ECONOMICA FEDERAL	110585/200001-86	CIA/ BFR/ SA/ 2018/ IP- FIC/ CP	RS 1.917.210,00		RS 1.944,215,00	0,4125	RS 2.100,00								
CLASSE DE ATIVOS	ADMINISTRADOR	CNPJ	FIMDO	RENDA VAR/UEL	RENDIMENTO					RENDIMENTO					
					RENDA MÉS	CUPOM	% REN.	% DOMÍNIO	% DA META	RENDA MÉS	CUPOM	% REN.	% DOMÍNIO	% DA META	
Italia do Tijucano															
SAÚDE	CIA/ ECONOMICA FEDERAL	14150277/0001-62	CIA/ BFR/ SA/ 2018/ IP-MA/ FIC/ FPI	RS 4.965.805,00		RS 50.180,00	0,363,3	RS 50.180,00		1.0/94,05/37/56,5	80.03/04/00/01	106.33/02			
	IBR/ PRACTICAL SERV/OS FIN/ COM/ BANCO	12430167/0001-71	CIA/ BFR/ SA/ 2018/ IP-MA/ FIC/ FPI	RS 11.298.000,23		RS 11.431.798,65	0,9358	RS 12.809,42		1.0/80/05/01/01	80.02/05/27/08	80.02/05/01/01			
	IBR/ GESTAO DE FICULOS/OS ITAM/SA	1707536/0001-06	IBR/ PTE/VO/ D/ F/ MA/ 5	RS 12.584.681,90		RS 12.231.267,81	1.20/25	RS 2.2786	2.2786	2.2786	2.2786	1.1/15,54/19/17,77	98.77/10/05/16	115.205,34	
	IBR/ GESTAO DE FICULOS/OS ITAM/SA	1707536/0001-06	IBR/ PTE/VO/ D/ F/ MA/ 5	RS 27.528.220,27		RS 24.819.468,95	5,000,000,00	RS 2.2786	2.2786	2.2786	2.2786	2.2786	2.2786	2.2786	
	IBR/ GESTAO DE FICULOS/OS ITAM/SA	1707536/0001-06	IBR/ PTE/VO/ D/ F/ MA/ 5	RS 5.000.000,00		RS 27.528.220,27	2.2786	RS 47.166,71	47.166,71	0,2059/05/01/01	23.18/01/10/24	23.18/01/10/24			
	IBR/ GESTAO DE FICULOS/OS ITAM/SA	1707536/0001-06	IBR/ PTE/VO/ D/ F/ MA/ 5	RS 37.253.345,35		RS 5.000.000,00	RS 42.258.988,19	3,9481	RS 273.412,42	0,7339/05/23/13	71.1/26/01/26	71.1/26/01/26			
	IBR/ GESTAO DE FICULOS/OS ITAM/SA	1707536/0001-06	IBR/ PTE/VO/ D/ F/ MA/ 5	RS 12.190.023,17		RS 12.470.455,00	1.1942	RS 26.718,05	26.718,05	0,092/14/00/08	19.82/01/23/1	19.82/01/23/1			
	IBR/ GESTAO DE FICULOS/OS ITAM/SA	1707536/0001-06	IBR/ PTE/VO/ D/ F/ MA/ 5	RS 3.843.603,10		RS 3.868.000,05	0,0363	RS 3.578,23	3.578,23	0,207,39/02/24/41	4.92/30/04/27/32	4.92/30/04/27/32			
	IBR/ PRACTICAL SERV/OS FIN/ COM/ BANCO	15111306/0001-90	IBR/ PTE/VO/ D/ F/ MA/ 5	RS 4.258.804,00		RS 4.258.804,00	0,0000	RS 46.938,00	46.938,00	0,207,39/02/24/41	4.91/30/04/20/49	4.92/30/04/20/49			
	CIA/ ECONOMICA FEDERAL	106706/0001-06	CIA/ PTE/VO/ D/ F/ MA/ 5	RS 4.547.477,95		RS 5.987.167,18	0,4985	RS 475,00	475,00	0,1122/04/54/2	0,1122/04/54/2	0,1122/04/54/2			
	CHEN/ DIV/ M/ TDA	144594/0001-06	IBR/ PTE/VO/ D/ F/ MA/ 5	RS 4.607.180,71		RS 4.622.386,77	0,3857	RS 15.218,00	15.218,00	0,0429	0,1122/04/07/04	0,1122/04/07/04			
	IBR/ MELLON SERV/OS FIN/ COM/ BANCO	14472378/0001-07	IBR/ PTE/VO/ D/ F/ MA/ 5	RS 5.18.980,00		RS 5.13.980,00	0,0429	RS 1.601,72	1.601,72	0,0429	0,1122/04/07/04	0,1122/04/07/04			
	Fundo de investimento imobiliário														
	CIA/ ECONOMICA FEDERAL	12887506/0001-43	IBR/ PTE/VO/ D/ F/ MA/ 5	RS 19.725.189,35		RS 19.192.156,44	1.601,2	RS 16.985,00	16.985,00	0,0363	0,088/17/17/12	0,088/17/17/12			
	IBR/ MELLON SERV/OS FIN/ COM/ BANCO	151491/0001-91	IBR/ PTE/VO/ D/ F/ MA/ 5	RS 1.171.210,00		RS 1.944.800,33/2,08	0,65	RS 54.800,00	54.800,00	0,0363	0,1122/04/07/04	0,1122/04/07/04			

Aperte lìquido do mês no fundo previdenciário

Saldo patrimonial da carteira previdenciária

R\$ 653.285,69/0,64



**MUNICÍPIO DE
BARUERI**



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS
SETEMBRO DE 2016

CLASSE DE ATIVOS	ADMINISTRADOR	CNPJ	FUNDO	RENTABILIDADE					RENTA FIXA
				31/08/2016	RELOCACÃO NOMÉS	30/09/2016	% DA CARTEIRA	RENT. MÊS	
RENTABILIDADE									
TRABALHO DO TESOURO								-1,00%	R\$ 31.392.024,19
NACIONAL								-2,93%	R\$ 2.593,22
CÂMADA ECONÔMICA FEDERAL	107405700001-06	049110000001-06	CÂMADA ECONÔMICA FEDERAL	107405700001-06	SATYRA EXECUTIVE 2	R\$ 18.172,754,53	R\$ 250.139,22	-1,75%	R\$ 10.091.094,14
CÂMADA ECONÔMICA FEDERAL	197887350001-07	049110000001-07	CÂMADA ECONÔMICA FEDERAL	197887350001-07	FI BRASIL 2013 N° 194	R\$ 32.580.723,73	R\$ 22.248.197,81	-1,96%	R\$ 56.278.962,25
CÂMADA ECONÔMICA FEDERAL	2719198510001-28	049110000001-28	CÂMADA ECONÔMICA FEDERAL	2719198510001-28	FI BRASIL 2013 N° 194	R\$ 39.634.629,08	R\$ 20.411.803,13	-1,66%	R\$ 150.710.006,25
REFINANCIAMENTO DA CÂMADA									R\$ 19.451.871,11
REFINANCIAMENTO DA CÂMADA									R\$ 291.932,02
BRL TRUST SERVIÇOS FINANCEIROS	112122220001-10	049110000001-10	BRL TRUST SERVIÇOS FINANCEIROS	112122220001-10	LTU BRAZIL FII F	R\$ 10.654.449,35	R\$ 4.730.200,31	-0,39%	R\$ 331.279,59
BRL MEL (ON) SERVIÇOS FINANCEIROS	115946170001-08	049110000001-08	BRL MEL (ON) SERVIÇOS FINANCEIROS	115946170001-08	TRAMBAW B FII	R\$ 10.654.449,34	R\$ 607.559,25	-0,91%	R\$ 180.105,92
BRL GESTÃO DE RECURSOS FINANCIEROS	130774180001-49	049110000001-49	BRL GESTÃO DE RECURSOS FINANCIEROS	130774180001-49	TRAU B FII F	R\$ 132.658.967,75	R\$ 10.912.002,02	-9,78%	R\$ 1.756.977,44
INTRAGASTO D'ALTAIDA	090933190001-15	049110000001-15	INTRAGASTO D'ALTAIDA	090933190001-15	TRAU INSTITUCIONAL FII FIA INFLAÇÃO 5 FIC	R\$ 26.137.942.856,53	R\$ 1.756.977,44	-1,02%	R\$ 1.756.977,44
BB GESTÃO DE RECURSOS FINANCIEROS	109774180001-10	049110000001-10	BB GESTÃO DE RECURSOS FINANCIEROS	109774180001-10	TRAU B FII F	R\$ 183.173.963,70	R\$ 15.073,11	-0,82%	R\$ 1.756.977,44
CÂMADA ECONÔMICA FEDERAL	110609132001-10	049110000001-10	CÂMADA ECONÔMICA FEDERAL	110609132001-10	BB FREDERICO D'ALTAIDA	R\$ 100.498.046,86	R\$ 101.843.011,41	-8,38%	R\$ 1.756.977,44
BB GESTÃO DE RECURSOS FINANCIEROS	107713190001-49	049110000001-49	BB GESTÃO DE RECURSOS FINANCIEROS	107713190001-49	TRAU B FII F	R\$ 150.658.502,40	R\$ 12.363,13	-0,82%	R\$ 1.756.977,44
CÂMADA ECONÔMICA FEDERAL	144865260001-11	049110000001-11	CÂMADA ECONÔMICA FEDERAL	144865260001-11	TRAU C B BRAZIL INSTITUCIONAL FII F	R\$ 12.894.268,51	R\$ 1.072,73	-0,76%	R\$ 1.756.977,44
BRIDGE ALTAIR DE RECURSOS LÍQUIDOS	128454010001-37	049110000001-37	BRIDGE ALTAIR DE RECURSOS LÍQUIDOS	128454010001-37	TOWER BRIDGE RENDA FIXA II	R\$ 47.742.948,04	R\$ 3.508,06	-7,57%	R\$ 502.028,11
BRIDGE ALTAIR DE RECURSOS LÍQUIDOS	128454010001-37	049110000001-37	BRIDGE ALTAIR DE RECURSOS LÍQUIDOS	128454010001-37	TOWER BRIDGE RENDA FIXA II	R\$ 14.598.310,12	R\$ 1.196,53	-9,21%	R\$ 1.756.977,44
BB GESTÃO DE RECURSOS FINANCIEROS	109774180001-49	049110000001-49	BB GESTÃO DE RECURSOS FINANCIEROS	109774180001-49	TRAU B FII F	R\$ 14.738.046,35	R\$ 12.709.435,62	-15,03%	R\$ 1.756.977,44
CÂMADA ECONÔMICA FEDERAL	03737260001-59	049110000001-59	CÂMADA ECONÔMICA FEDERAL	03737260001-59	TRAU C B BRAZIL REFERENCIADO D	R\$ 14.748.049,79	R\$ 2.710,43	-5,24%	R\$ 1.756.977,44
BANCO ITAÚ UNIBANCA	0088740001-48	049110000001-48	BANCO ITAÚ UNIBANCA	0088740001-48	TRAU INSTITUCIONAL ALTAVALORADA II	R\$ 2.674.757,73	R\$ 69.682,85	-0,44%	R\$ 1.756.977,44
INSTRADOTM VITÓRIA	10897200001-36	049110000001-36	INSTRADOTM VITÓRIA	10897200001-36	TRAU INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FII	R\$ 5.056.198,49	R\$ 10.382.814,37	-0,85%	R\$ 105.261,97
GRADUAL OCTUBRA	234318710001-85	049110000001-85	GRADUAL OCTUBRA	234318710001-85	TRAU FII SONAR	R\$ 40.131.548,92	R\$ 3.327,11	-0,82%	R\$ 340.542,82
SANTAFER	171019850001-92	049110000001-92	SANTAFER	171019850001-92	TRAU FII SONAR	R\$ 12.956.659,31	R\$ 9.053,-16	-2,71%	R\$ 2.712.477,89
SPAREDA CORRETORA PARALISTA	133448340001-69	049110000001-69	SPAREDA CORRETORA PARALISTA	133448340001-69	TRAU FII SONAR	R\$ 7.342.092,95	R\$ 6.621,05	-0,70%	R\$ 107.181,86
RENTABILIDADE									
RENTABILIDADE									
CLASSE DE ATIVOS	ADMINISTRADOR	CNPJ	FUNDÔ	RENTABILIDADE					RENT. MÊS
				31/08/2016	RELOCACÃO NOMÉS	30/09/2016	% DA CARTEIRA	RENT. MÊS	
RENTABILIDADE									
TRABALHO DO TESOURO								0,93%	R\$ 23.676.137,50
NACIONAL								-0,39%	R\$ 4.730.200,31
CÂMADA ECONÔMICA FEDERAL	1414202770001-62	049110000001-62	CÂMADA ECONÔMICA FEDERAL	1414202770001-62	LTU BRAZIL FII F	R\$ 10.654.449,35	R\$ 43.667,50	-0,91%	R\$ 1.756.977,44
XPI INVESTIMENTOS								-0,91%	R\$ 10.654.449,35
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	124031670001-71	049110000001-71	BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	124031670001-71	CHARTANIA MULTIPROPRIETÁRIO FII	R\$ 11.431.179,95	R\$ 115.456.986,11	-0,91%	R\$ 1.756.977,44
WANDERLAND								-0,91%	R\$ 1.756.977,44
BANCO ITAÚ UNIBANCA	110735560001-00	049110000001-00	BANCO ITAÚ UNIBANCA	110735560001-00	KNEA SPREFA	R\$ 28.500.530,15	R\$ 20.796.941,04	-7,57%	R\$ 6.560.070,83
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	171585230001-11	049110000001-11	BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	171585230001-11	TRAU AÇÕES REFERENCIAIS II	R\$ 24.334.333,80	R\$ 26.307.943,73	-2,30%	R\$ 1.756.977,44
Fundo de Ações								-3,40%	R\$ 1.756.977,44
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	144863750001-42	049110000001-42	BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	144863750001-42	TRAU AÇÕES REFERENCIAIS II	R\$ 42.250.986,19	R\$ 41.933.706,64	-0,76%	R\$ 1.756.977,44
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	121317670001-35	049110000001-35	BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	121317670001-35	A1 CO FLORES FII F	R\$ 12.455.371,92	R\$ 12.046.371,92	-3,07%	R\$ 1.756.977,44
Fundo de Investimento em Participações	151713810001-50	049110000001-50	Fundo de Investimento em Participações	151713810001-50	MT FF	R\$ 3.655.546,13	R\$ 3.508.095,00	-3,90%	R\$ 1.756.977,44
CAAMA ECONÔMICA FEDERAL	166716620001-06	049110000001-06	CAAMA ECONÔMICA FEDERAL	166716620001-06	TRAU FII CTFRELA	R\$ 4.226.193,50	R\$ 3.061.766,10	-38,06%	R\$ 1.756.977,44
CBTANK D'ALTAIDA	145840440001-05	049110000001-05	CBTANK D'ALTAIDA	145840440001-05	TRAU FII D'ALTAIDA	R\$ 5.961.197,19	R\$ 5.950.000,00	-0,49%	R\$ 1.756.977,44
Fundo de Investimento Imobiliário	128877650001-43	049110000001-43	Fundo de Investimento Imobiliário	128877650001-43	TRAU FII HOTELS	R\$ 5.119.980,00	R\$ 4.922.396,77	-4,44%	R\$ 1.756.977,44
CAAMA ECONÔMICA FEDERAL	154710760001-91	049110000001-91	CAAMA ECONÔMICA FEDERAL	154710760001-91	TRAU FII HOTELS	R\$ 19.112.154,44	R\$ 19.216.292,37	0,53%	R\$ 1.756.977,44
Total da carteira puro dividendo									
Saldo Patrimonial da carteira previdenciária									
Aporte líquido da carteira puro dividendo									
Saldo Patrimonial da carteira previdenciária									



CLASSE DE ATIVOS	ADMINISTRAÇÃO	CNPJ	RÚNDO	RENDIMENTO FÍXO					RENTABILIDADE					
				30/09/2016	REALIZAÇÃO/NOMES	31/10/2016	% DA CARTEIRA	RENT. MÉS.	CURROMA	% RENT.	% DOMÍNIO	% DA META		
RENDIMENTO FÍXO														
Títulos do Tesouro								R\$ 69.755.941,50	5.263,00	4,06% (4,40)	1,03%	0,10756906	13,67799	
Nacional				107.467.070.001-109	ONDA FINANC. FCP - MTF/FI		R\$ 31.592.026,38							
ONDA ECONÔMICA FEDERAL							R\$ 22.651.293,69	1.989,77	R\$ 226.386,08	1.900,029978	106,44% (44,45)	13,65988		
ONDA ECONÔMICA FEDERAL				19.766.753.0001-107	FIBRAIS - 2018-TP-FE		R\$ 40.160.295,21	3.192,00	R\$ 160.726,84	0,430159023	62,24% (65,96)	52,55153		
ONDA ECONÔMICA FEDERAL				21.519.986.10001-28	FIBRAIS - 2020-TP-FE		R\$ 20.334.236,51	1.650,65	R\$ 90.435,38	0,344721287	97,132054	56,77318		
Reinvestimento Fávora														
DEA														
BRAZ TRUST SERVIÇOS FINANCEIROS E PARC. LTDA	11212.532.0001-10	LJ. LIMA R. F. CREDITO PRIMARIAL		R\$ 4.459.948,55	0,3502	R\$ 233.431,76	-4,5011712147	-7,70,580223	-59,300443					
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DIVISA	13.934.673.0001-59	TRIL. NAMB. FIF		R\$ 10.340.211,10	0,6500	R\$ 5.765.575,53	1,628263252	0,72484433	157,557464	56,309583				
BB GESTÃO DE RECURSOS DIVISA	13.071.141.00001-149	BB PROD. ODF. MAR-15		R\$ 49.114.455,17	R\$ 3.979,77	R\$ 381.730,59	0,4426925191	93,17398048	50,309655					
BBR GESTÃO DE RECURSOS DIVISA	13.092.018.00001-149	BB PROD. ODF. MAR-15		R\$ 132.884.982,75	10,5996	R\$ 598.282,25	0,4426925191	106,02427051	59,276251					
BBR GESTÃO DE RECURSOS DIVISA	13.077.418.00001-10	BB PROD. ODF. MAR-15		R\$ 26.137.242,60	2,0760	R\$ 115.761,17	0,4426925191	53,65161139	59,599434					
BBB GESTÃO DE RECURSOS DIVISA	13.077.418.00001-10	BB PROD. ODF. MAR-15		R\$ 184.059.096,88	14,5640	R\$ 685.180,18	0,4426925191	101,8892279	59,282657					
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	11.089.913.0001-10	CAIXA FISICAL MAR-5 STR-FLP		R\$ 185.775,96	R\$ 1.961,75	R\$ 192.392,497,20	8,0164	R\$ 4,2445,79	0,4426925191	50,41031933	55,999573			
BBB GESTÃO DE RECURSOS DIVISA	13.077.418.00001-149	BB PROD. ODF. MAR-15		R\$ 160.089.905,48	R\$ 1.767,2	R\$ 689.271,35	2,05562819	29,92426677	67,79819					
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	13.092.018.00001-171	CAIXA FISICAL MAR-15 CAIXA-NP-LP		R\$ 13.931.286,35	R\$ 1.0525	R\$ 13.296.695,87	0,4426925191	106,723055	50,409096					
BBR GESTÃO DE RECURSOS LTDA	21.056.697.00001-147	TOQUE BRASIL PENDA FPA-1		R\$ 47.996.065,73	3,7961	R\$ 254.497,59	101,8894812	40,4354						
BBR GESTÃO DE RECURSOS LTDA	17.184.951.00001-37	TOQUE BRASIL PENDA FPA-1		R\$ 14.532.301,12	R\$ 1.1830	R\$ 155.984,70	1,1830	R\$ 1.1830	1,1830					
BBB GESTÃO DE RECURSOS DIVISA	10.077.418.00001-40	BB PROD. PREVEXCARDO		R\$ 12.708.157,70	R\$ 1.0165	R\$ 13.212,11	1,0165	R\$ 1.1830	1,1830	1,04848289	59,88697045	38,01933		
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	03.171.266.0001-37	CAIXA FISICAL REFERENDADO DI		R\$ 15.248.874,05	1.2190	R\$ 152.290,45	1,2190	R\$ 152.290,45	1,2190	0,98619822	8,88930191	13,147065		
BANDO ITALIANO SA	21.058.500.0001-149	ITAU INSTITUCIONAL FINTECENCIADA		R\$ 2.732.860,20	2,0263	R\$ 28.485,78	2,0263	R\$ 28.485,78	2,0263	1,05334334	109,318434	38,597671		
BANDO ITALIANO SA	16.667.220.0001-56	ITAU INSTITUCIONAL TILS. PUBL. OS. RE		R\$ 5.761.081,54	R\$ 4,9653	R\$ 5.761.081,54	0,49653	R\$ 22.540,30	0,49653	0,3868334749	51,719867			
INTRAGOMMATIA	23.041.167.00001-65	ITAFIC. SENAC		R\$ 10.500.765,76	R\$ 8,6247	R\$ 67.941,89	0,8247	R\$ 67.941,89	0,8247	0,66559174	68,82890892	10,57882261		
GRADUAL OTIM SA	10.051.586.0001-92	ITAFIC. SENAC		R\$ 40.121.946,02	R\$ 40.737.653,26	R\$ 3.2246	R\$ 3.2246	R\$ 309.055,74	R\$ 309.055,74	0,26574421	27,22935355	37,226217		
SANTANER	13.344.94.00001-51	INVESTIMENTO FOC. M. TES. SETORIAL		R\$ 12.595.270,07	R\$ 9,9001	R\$ 12.139.220,08	0,9001	R\$ 60.000,00	R\$ 60.000,00	1,56178646	14,22623264	210,2217		
GRADUAL OTIM SA	13.344.94.00001-51	INVESTIMENTO FOC. M. TES. SETORIAL		R\$ 7.540.002,95	R\$ 6,0653	R\$ 7.660.408,34	0,60653	R\$ 120.405,49	R\$ 120.405,49					
SOCIEDADE CORRETORA PNL LTDAS A	622853900001-40	FEFC-BAC												
RENDIMENTO VARIAVEL														
CLASSE DE ATIVOS	ADMINISTRAÇÃO	CNPJ	RÚNDO	RENDIMENTO VARIAVEL					RENTABILIDADE					
				30/09/2016	REALIZAÇÃO/NOMES	31/10/2016	% DA CARTEIRA	RENT. MÉS.	CUPOM	% RENT.	% DOMÍNIO	% DA META		
RENDIMENTO VARIAVEL														
Administrado								R\$ 23.289.367,50	1.9862	R\$ 153.950,00	0,645890562	81,950129253	85,30217	
ONDA ECONÔMICA FEDERAL	14.014.165.0001-74	ONDA FINANC. FCP - MTF/FI		R\$ 23.676.151,50							0,6565905673	53,51054573	73,271975	
ONDA ECONÔMICA FEDERAL	14.020.227.0001-62	ONDA FINANC. FCP - MTF/FI		R\$ 4.757.485,00	0,3587	R\$ 28.482,50					3,077042222	40,473448		
ONDA INVESTIMENTOS				R\$ 10.282.986,19							1,071925693	114,8144673	142,007173	
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS SA DIVISA	12.431.167.0001-71	CARTA MAR. MUL. CREDITO PRIMARIO		R\$ 11.545.590,11							3,191450017	28,41078911	4,192925	
FAI (Invest) SA														
BANDO ITALIANO SA	17.021.559.0001-90	KNEA FEPRA		R\$ 12.263.590,00							8,57519438	76,389333108	1120,7086	
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DIVISA	02.986.694.0001-96	FRANKLIN TEMPEST FUND. FIA. FRC. FIA.		R\$ 26.387.938,05	2,0791	R\$ 2.720.355,04					11,7317603	728,676,9264	154,44217	
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DIVISA	17.196.230.0001-11	APRENDADES FIC. SEITA. NET II		R\$ 24.207.650,75	R\$ 2,1715	R\$ 2.1463					9,3301276038	1456,017891	1227,7985	
Fundo de Ações	0062710100001-46	PRATICOS FIC-FIA		R\$ 28.307.941,71	R\$ 30.946.456,10	R\$ 2,4407	R\$ 2,941.402,17				9,605195728	95,50186915	1265,3962	
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS SA DIVISA	14.085.787.0001-42	PRATICOS ACES FIC-FIA		R\$ 4.153.705,94	R\$ 46.920.111,62	R\$ 3,63179	R\$ 4.126.410,58				-0,124055346	28,9881981	18,822650	
BBM (Div) SA														
INTRAGOMMATIA	14.723.700.0001-37	ITAFIC. SENAC		R\$ 12.154.327,73	R\$ 2,9060	R\$ 15.077,85					-0,19197173	38,0198488	-21,98285	
BBM MEL. ON SERVIÇOS FINANCEIROS DIVISA	12.121.767.0001-35	ATUO FLUSTRAL FPF		R\$ 12.458.377,12	R\$ 12.488.371,91	R\$ 0,9845	R\$ 20.069,41				0,29867363	-19,55255374	-11,133,23	
Fundo de Investimentos em Participantes														
ONDA ECONÔMICA FEDERAL	14.071.95.0001-85	ONDA FIC-FI		R\$ 3.555.569,13	R\$ 2,0801	R\$ 3.289,21								
CITIBAN DIVERSA SA	14.950.070.0001-96	BTG PACTUAL INFRAEST. FUT. FCF-FP		R\$ 4.228.853,49	R\$ 0,3550	R\$ 42.698,00					-0,078464874	-16,83932794	-14,89709	
INTRA FFI				R\$ 5.590.001,10	R\$ 5,985.877,49	R\$ 0,4106	R\$ 23,33				-0,1364055835	420,01	-13,659876	
Fundo de Investimento Industrial												0		
ONDA ECONÔMICA FEDERAL	13.344.94.00001-43	ONDA FINANC. FCP. M. TES. SETORIAL		R\$ 1.287.250.000,00	R\$ 530.000,00	R\$ 0,0427	R\$ 10.000,00				0,3610435			
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	194.107.0001-40	FEFC-BAC		R\$ 1.235.237.099,70	R\$ 100.000,00	R\$ 1.163,374.386,47					4,5467100	1,24945056	196,650%	
Total da carteira previdenciária														
Saldo Patrimonial da carteira previdenciária														
				R\$ 1.235.237.099,70	R\$ 100.000,00	R\$ 1.163,374.386,47					4,5467100	1,24945056	196,650%	



BARUERI

IPRESB
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL
DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE BARUERI

RELATÓRIO ANALÍTICO MENSAL DE INVESTIMENTOS

NOVEMBRO DE 2016

CLASSE DE ATIVOS				RENTABILIDADE								
	ADMINISTRADOR	CNPJ	FUNDO	31/10/2016	RELOCACÕES/NOMES	30/11/2016	% DA CARTERA	RENT. MÉS	CUPOM	% RENT.	% DODINHO	% DA META
RENDIMENTO FIXO												
Títulos do Governo												
Nacional												
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL		10.74.05/70001-06	CAIXA BRASIL, PFP-31 TFP-17F	R\$ 65.755,941,50		R\$ 63.459,221,79	6,52% ⁷	R\$ 13	94,48/7268		1,03%	-72,17/264,01
LE ADMINISTRAÇÃO FEDERATIVA		10.87.84/70001-49	SAFRA EXECUTIVE 2	R\$ 22.485,205,89		R\$ 23.068,421,19	1,50% ¹⁰	R\$ 13	21,15/47,49		0,95%	49,49/1,51/28
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL		10.76/65/330001-07	FP/BRASIL 2020/11 TFP	R\$ 40.205,979,51		R\$ 40.575,635,77	1,06% ¹⁰	R\$ 13	24,70/13,96		0,619/18,26%	-50,79/6,57/43
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL		21.19/96/110001-26	FP/BRASIL 2020/11 TFP	R\$ 20.334,236,51		R\$ 20.554,416,14	1,50% ¹⁰	R\$ 13	21,17/9,63		0,194/15,48%	26,03/63,72/26
Referenciais Básicos												
IBRA		11.21/23/20001-10	LI TRA RIE/ CREDITO PROVADO	R\$ 4.450,948,45		R\$ 4.541,973,80	0,36% ⁵²	R\$ 13	48,12/5,26		1,09/4,45/59,4	-57,50/2,76/44
IBRASIL SERVIÇOS FINANCEIROS DIVISA		10.59/45/73/20001-49	TRALUMA B/F/P	R\$ 10.940,211,10		R\$ 10.951,351,53	0,05% ⁵²	R\$ 13	10,07/22,92		-0,44/0,07,19	36,07/14,19
BB GESTÃO DE RECURSOS DIVISA		10.07/74/18/0001-19	BB/PREV/D/MA/5-5	R\$ 13,151,185,00		R\$ 13,342,202,83	10,43% ¹¹	R\$ 13	48,49/97,83		0,3671/19,66%	91,93/9,16/57
INVESTIMENTOS												
IBR GESTÃO DE RECURSOS DIVISA		10.07/19/18/0001-10	BB/PREC/D/MA/5-5	R\$ 26,250,004,61		R\$ 26,351,677,96	1,04% ¹¹	R\$ 13	67,77/73,5		0,3843/7,38%	67,77/0,75/55
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL		11.06/09/13/0001-10	CAIXA BRASIL MA/5-5 TFP	R\$ 184.000,000,00		R\$ 184.700,941,96	14,42% ¹⁰	R\$ 13	69,42/5,10		0,77/18,59,6	69,42/29,16
IBR GESTÃO DE RECURSOS DIVISA		10.07/74/18/0001-49	BB/PREV/D/MA/5-5	R\$ 102,261,497,20		R\$ 102,311,861,46	0,02% ⁵²	R\$ 13	54,77/54,26		0,53/22,90,1	60,56/0,44/7,7
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL		10.07/74/18/0001-17	CAIXA BRASIL CA/POA-2	R\$ 161,257,174,81		R\$ 162,437,833,73	0,76% ¹⁰	R\$ 13	92,07/59,90		0,70/70,84/26,9	83,93/86,3
BB GESTÃO DE RECURSOS DIVISA		10.08/26/0001-01	CAIXA BRASIL CA/POA-2	R\$ 13,295,976,33		R\$ 13,307,151,54	0,73% ¹⁰	R\$ 13	12,92/12,17		0,21/18,30/4	53,29/75,11/1
BB GESTÃO DE RECURSOS ITA		10.08/24/99/0001-87	TRIUMER BRIDGE REDE/ RIBA	R\$ 47,599,865,73		R\$ 48,699,986,50	3,76% ¹⁰	R\$ 13	14,50/18,66		0,40/65,96/8,6	16,2/19,5
BB GESTÃO DE RECURSOS DIVISA		10.07/19/18/0001-49	TRIUMER BRIDGE REDE/ RIBA	R\$ 14,651,478,92		R\$ 14,687,166,58	0,20% ⁴⁶	R\$ 13	13,04/10,46		1,04/40/5,98	10,9/28/0,02/
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL		01.03/37/26/0001-47	BB/PREV/ FPF/ PRE/PROVADOO	R\$ 15,42/24,48/		R\$ 15,42/24,48/	1,20% ²⁰⁰	R\$ 13	35,26/26,62		-0,22/0,07/1,81	4,46/0,46/69,64
BANCO ITAU/CARDOSO S/A		10.08/19/15/0001-43	TRAI INSTITUCIONAL ALGODÃO/ DINAMICA/ TFP	R\$ 5.000,000,00		R\$ 5.015,341,30	0,01% ¹⁷	R\$ 13	15,24/2,3		1,04/94/6,46	100,0/0/94,6
BANDO ITAU/CARDOSO S/A		10.08/24/8/0001-73	TRAI INSTITUCIONAL ALGODÃO/ DINAMICA/ TFP	R\$ 2,75/20,05/		R\$ 2,76/21,05/	0,01% ¹⁶	R\$ 13	28,84/3,05		0,43/10/6,18	-9,28/0,62/29,7
BANDO ITAU/CARDOSO S/A		10.08/24/8/0001-00	TRAI INSTITUCIONAL TITULOS/ BOLAS/ FP	R\$ 5.789,487,94		R\$ 5.814,437,80	0,45% ¹¹	R\$ 13	10,95/7,70		0,83/10/4,65	79,72/75,95/6
INFRATEL/ALVILA		10.08/17/20/0001-48	TRAI FDC/ SENIOR	R\$ 10,48/156,16		R\$ 10,48/156,16	0,00% ¹⁰	R\$ 13	41,10/4,61/1,61		0,69/95,01	-77,79/19,55/
GRADAL/ COTYNSA		10.07/19/05/0001-92	GRK FDC/ FDC	R\$ 12,15/220,06		R\$ 12,16/245,39	1,61% ¹³	R\$ 13	2,05/16,51		24,69/98,32	23,74/98,99/98,99
GANTANKEE		10.07/19/05/0001-65	INCERITY FDC/ MUL/ TSE/SETORIAL	R\$ 4,394,533,16		R\$ 4,394,533,16	0,02% ⁴⁴	R\$ 13	100,15/2,58		14,49/82,67	-30,69/84/23
GRACIOL/ COTYNSA		10.07/19/05/0001-40	FP/CAC	R\$ 7,60/465,34		R\$ 7,60/465,34	0,00% ⁴⁴	R\$ 13	0,00/0,00		0,00/0,00/0,00	20,9/51/0
RENDIMENTO VARIÁVEL												
CLASSIF. DE ATIVOS	ADMINISTRADOR	CNPJ	FUNDO	31/10/2016	RELOCACÕES/NOMES	30/11/2016	% DA CARTERA	RENT./MÊS	CUPOM	% RENT.	% DODINHO	% DA META
Materias-primas												
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS DA/IVM		10.40/07/0001-71	BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS DA/IVM	R\$ 23,029,787,50		R\$ 23,029,787,50	1,00% ¹⁰	R\$ 13	-	0	0	0
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS DA/IVM		14.20/14/0001-74	CAIXA BRASIL POF/B/MULTIMERCADO - GP	R\$ 4.454,340,00		R\$ 4.496,130,00	0,37% ⁵²	R\$ 13	11,73/0,00		0,26/4,26/7,5	23,06/0,03/37
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS DA/IVM		14.20/27/11/001-92	CAIXA BRASIL POF/ VIT/MLI/TIM/EXB/ - GP	R\$ 10.200,000,00		R\$ 10.205,449,37	0,76% ⁵²	R\$ 13	25,43/0,07		0,68/39/60/60/65	10,04/4,95/31
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS DA/IVM		17.26/3/86/0001-50	CAIXA CARTUCHO PREMIUM/ALTA/EXB/	R\$ 10,55/16,61		R\$ 10,56/16,79/1	0,00% ⁵²	R\$ 13	49,45/58,90		0,80/4,71/3,26	17,18/50,87
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS DA/IVM		17.26/3/86/0001-54	DELT LONG SHORT 60 POF/ PFM	R\$ 11,01/10,19/24		R\$ 11,16/11,11/22	0,91% ¹⁰	R\$ 13	9,3/16,48		0,72/26,87/1,64	1,72/26,87/1,64
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS DA/IVM		17.26/3/86/0001-71	DELT LONG SHORT 60 POF/ PFM	R\$ 12,15/4,51/20		R\$ 12,15/4,51/20	0,91% ¹⁰	R\$ 13	1,11/4,49		0,90/17/1,19	1,72/26,87/1,64
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS DA/IVM		17.07/55/0001-40	KOREA PPE/ PA	R\$ 26,267,160,05		R\$ 26,267,160,05	0,00% ⁵²	R\$ 13	1,31/95		1,37/19,1/52	1,37/19,1/52
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS DA/IVM		10.08/24/99/0001-11	TRAKIN/INTER/ETON/PA/FAZ/ AÇÕES	R\$ 27,115,47/77		R\$ 27,115,47/77	0,00% ⁵²	R\$ 13	1,9/17		1,61/20/4,54	5,94/20/4,54
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS DA/IVM		09/05/10/0001-55	TRAKIN/INTER/PA/FAZ/ AÇÕES	R\$ 30,940,436,10		R\$ 30,956,081,79	0,02% ¹⁰	R\$ 13	2,0/21/4,14		5,84/40/51,98	52,3/26/90/10/16
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS DA/IVM		10/07/07/0001-71	TRAKIN/INTER/PA/FAZ/ AÇÕES	R\$ 45,960,11/52		R\$ 45,726,469,77	0,33% ¹⁰	R\$ 13	2,3/33/11/55		-7,03/03/18/99	10,34/60/0
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS DA/IVM		12/12/27/0001-73	TRAKIN/INTER/PA/FAZ/ AÇÕES	R\$ 45,960,11/52		R\$ 45,22/26/77	0,33% ¹⁰	R\$ 13	15,22/9,8		-0,12/25/52/52	-30,63/89/44/7
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS DA/IVM		12/12/27/0001-74	TRAKIN/INTER/PA/FAZ/ AÇÕES	R\$ 45,960,11/52		R\$ 45,22/26/77	0,33% ¹⁰	R\$ 13	15,22/9,8		-0,12/25/52/52	-30,63/89/44/7
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS DA/IVM		15/11/57/0001-90	WE/TFP	R\$ 12,452,301,91		R\$ 12,452,301,91	0,00% ⁴⁶	R\$ 13	37,89/1,66		0,00/0,00/0,00	-22,77/11/60/63
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS DA/IVM		16/16/06/0001-56	CAIXA CPT/ CPTA	R\$ 3,684,926,93		R\$ 3,684,926,93	0,00% ⁵²	R\$ 13	4,26/50,9		-1,09/11/33,49	-20,88/89/75/75
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS DA/IVM		16/16/06/0001-54	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	R\$ 4,207,650,38		R\$ 4,185,221,40	0,26% ⁵²	R\$ 13	4,53/93/0		-1,09/05/30/07	11,3/18/77/77
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS DA/IVM		16/16/06/0001-54	PLANNER CORRETORA	R\$ 5,978,622,48		R\$ 5,978,622,48	0,00% ⁵²	R\$ 13	5,4/69		0,00/0,00/0,00	10/30/20/20/20
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS DA/IVM		16/16/06/0001-57	KINFA/ REAL/ BTP/ TEF/ REAL/ F	R\$ 4,769,196,48		R\$ 4,769,196,48	0,00% ⁵²	R\$ 13	8,7/10,4/		0,00/0,00/0,00	10/30/20/20/20
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS DA/IVM		12/12/27/0001-97	NET/ BTP/ TEF/ REAL/ F	R\$ 54,670,00		R\$ 54,670,00	0,00% ⁴⁶	R\$ 13	4,34/22		4,67/0,00/0	4,67/0,00/0
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS DA/IVM		12/12/27/0001-93	PLANO/ LIGA/ TEF/ REAL/ F	R\$ 19,50/303,06		R\$ 19,50/303,06	0,00% ⁵²	R\$ 13	1,77/6		-1,11/21/21/21	-28,25%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS DA/IVM		15/11/57/0001-91	PR/ BTP/ TEF/ REAL/ F	R\$ 1,263,139,056,47		R\$ 1,263,139,056,47	0,00% ⁴⁶	R\$ 13	626,674,413,66		653,785,69/6,84	653,785,69/6,84
Total da carteira previdenciária												
Saldo Patrimonial da carteira previdenciária												



**MUNICÍPIO DE
BARUERI**

IPRESB
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL
DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE BARUERI

RELATÓRIO ANALÍTICO MENSAL DE INVESTIMENTOS
DEZEMBRO DE 2016

Aporte líquido do mês no fundo previdenciário

Saldo Patrimonial da carteira previdenciária

R\$ 653.295.694,94

CLASSE PATRIMÔNIO	ADMINISTRADOR	CNPJ	FUNDO	30/11/2016	RELAÇÃO GROWTHS	31/12/2016	% DA CARTERA	RENTABILIDADE					
								REND. MÉS	CUPOM	% RENT.	% DOMÍNIO	% DA MTR/MES	
Fundo de Tesouro													
Nacional													
CAMA ECONÔMICA FEDERAL		16746570001-06	CAMA ENSAUL-FP-AN-TP-FP	RS 113.185.159,29	RS 144.517.002,46	RS 246.635.334,70	18,97%	RS 2.722.305,00		2.426,62%	0,00	-0,5602%	
US ADMINISTRAÇÃO TELECARA		10.787.647.0001-69	SACARIA EXECUTIVE 2	RS 21.008.421,38		RS 22.372.422,75	1,79%	RS 303.721,34		1,16	19,68%	110,63%	
CAMA ECONÔMICA FEDERAL		19787130001-07	BRASIL 2016 11 FP-OF	RS 40.536.363,27	RS 41.033.910,62	RS 3.594	RS 456.910,35		1,20	0,00	38,05%	389,91%	
CAMA ECONÔMICA FEDERAL		219198615001-28	BRASIL 2020 11 TP-OF	RS 20.395.410,14		RS 20.511.186,73	1,56%	RS 315.722,59		1,25	0,00	111,59%	288,62%
Indumentaria (Varejo)													
BRL TRUST SERVIÇOS FOLHARDOS LEPART LTOA		11212320001-10	L.T.R.A. REDE ORIENTE PRAZO	RS 4.547.073,95		RS 4.610.561,74	0,54%	RS 62.567,94		1,76	11,98%	47,7911,25%	202,2702,68%
BRL MELON SERVIÇOS FINANCEIROS DYNIA		15946173001-69	INMA BRI 01 RE	RS 10.891.351,33		RS 11.141.280,14	0,35%	RS 205.070,61		2,25	0,00	78,85%	337,34%
BB GESTÃO DE RECURSOS DYNIA		130774190001-49	BB FRENTE DE MAR-85	RS 40.507.951,58	RS 40.207.981,65	RS 3.594	-	RS 300.000,00		1,13	0,00	-0,98%	-0,00
NITRAG DYNIA LTDA		009538190001-15	TRAMUNDO FINANCIÁRIA INFILIAÇÃO 5% C	RS 13.342.268,65	RS 13.342.184,15	RS 13,50	-	RS 37.512,46		0,15	0,00	0,00	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DYNIA		159724190001-10	BB PRESTACIONAL 85	RS 26.383.671,95	RS 26.391.180,42	RS 3.500	-	RS 133.060,48		0,07	0,00	0,00	0,00
CAMA ECONÔMICA FEDERAL		11069150001-10	CAMOBRAZIL MASTERS FP	RS 194.837.002,46		RS 194.837.002,46	0,00%	RS 130.060,48		1,24	0,00	0,00	0,00
BBG GESTÃO DE RECURSOS DYNIA		190774190001-10	BB PREVOCAM 2	RS 102.114.661,46		RS 104.000.000,00	1,83%	RS 164.110.561,51		1,20	0,00	109,54%	167,2731,06
CAMA ECONÔMICA FEDERAL		142096260001-71	CAMAR BRAZIL MASTERS FP	RS 162.317.803,71		RS 162.317.803,71	0,00%	RS 140.161,23		1,08	0,00	0,00	0,00
BBG ADME REO PROSOLITA		1298469510001-87	TOWER BRASIL REVIA FIA	RS 48.699.198,90		RS 48.699.198,90	0,00%	RS 73.521,18		1,52	0,00	0,00	0,00
BBG ADME REO PROSOLITA		129845910001-37	TOWER BRASIL REVIA FIA	RS 14.847.568,28		RS 15.040.000,00	0,80%	RS 90.720.828,62		5,60	0,00	500,720,00	500,720,00
BBG GESTÃO DE RECURSOS DYNIA		130774190001-49	BBPE FPI 11 FP-PREVIDENAR	RS 26.000.000,00		RS 26.000.000,00	0,00%	RS 77.723,18		0,00	0,00	0,00	0,00
BANCO BANIF PARABÉS		069626700001-39	BBPP FPI 01 FP-PREVIDENAR	RS -		RS 20.151.173,36	1,59%	RS 153.173,36		4,07	0,00	0,00	0,00
CAMA ECONÔMICA FEDERAL		232156710001-51	CAMAR BRAZIL GESTÃO INSTRATÉGICA	RS 53.508.052,96		RS 53.508.052,96	4,11%	RS 529.822,65		3,63	0,00	0,00	0,00
CAMA ECONÔMICA FEDERAL		037326910001-91	CAMAR BRAZIL REPRENDENDO D	RS 12.977.230,41		RS 12.977.230,41	0,00%	RS 15.801.741,20		2,12	0,00	0,00	0,00
BANDO ITAUORO SIA		215039170001-73	ITAU INSTITUCIONAL ALIANÇA DYNIA REOF	RS 5.015.267,33		RS 5.120.878,60	0,39%	RS 106.331,95		0,00	0,00	0,00	0,00
BANDO ITAUORO SIA		006230850001-06	ITAU INSTITUCIONAL RE-PRENDENDO D	RS 2.381.253,34		RS 2.013.814.94,18	0,74%	RS 72.461,67		1,20	0,00	0,00	0,00
INTRAG DYNIA		198872000001-36	ITAU INSTITUCIONAL MILITOS PARODUS-AP	RS 10.505.973,70	RS 4.804.46,19	RS 5.909.827,51	0,43%	RS 65.732,92		4,83	0,00	146,19	46,47%
GRACIAL OCTAVIA		1243130001-45	TRICORPO SENIOR	RS 41.104.562,61		RS 41.104.562,61	0,00%	RS 3.168,60		3,62	0,00	132,92	28,483,13,32
SANTANDER		170198619001-92	SEX-FRAME FPC	RS 15.276.326,70		RS 15.276.326,70	0,00%	RS 104.960,31		0,00	0,00	0,00	0,00
GRACIAL OCTAVIA		133446150001-66	INVESTIMENTO FPC- MULTISETORIAL	RS 4.428.594,56		RS 4.428.594,56	0,00%	RS 74.031,40		1,68	0,00	0,00	0,00
SOCIOSIDE CORRETORA PAULISTA S.A.		622875300001-40	FDC/BAC	RS 4.394.523,16		RS 4.394.523,16	0,00%	RS 74.031,40		0,00	0,00	0,00	0,00
RENTABILIDADE													
CLASSE PATRIMÔNIO	ADMINISTRADOR	CNPJ	FUNDO	30/11/2016	RELAÇÃO GROWTHS	31/12/2016	% DA CARTERA	REND. MÉS	CUPOM	% RENT.	% DOMÍNIO	% DA MTR/MES	
RENDIMENTO VARIAVEL													
IS ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA		17.253.890001-40	SAFET CARBESA FREMAMAL INVERSAO	RS 10.025.497,07		RS 10.166.724,75	0,70%	RS 141.277,69		1,04	0,00	0,00	0,00
AP INVESTIMENTOS		21.852.683.001-54	XIPLONG BANK 60%CPBM	RS 10.598.671,91		RS 10.689.171,95	0,82%	RS 179.088,37		1,02	0,00	0,00	0,00
BFG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS SA/DTVM		12430167001-71	CAITANIA MULTICREDITO PRAZO	RS 11.784.111,02		RS 10.000.000,00	21,99%	RS 21.997.985,95		2,15	6,74	9,35	1.803.329,04
FLA Carteira													
BANCO ITAUORO SIA		1707759610001-00	KINZA FEPRA	RS 11.714.547,10		RS 11.681.414,45	0,89%	RS 33.421,56		-0,05	0,00	0,00	0,00
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DYNIA		028965940001-06	FRANKLIN TEMPEST FFI FOCES	RS 16.442.595,35		RS 16.442.595,35	0,00%	RS 453.228,67		-2,08	0,00	0,00	0,00
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DYNIA		1715823910001-11	ALFA ACES FOCES II INST II	RS 28.500.823,13		RS 29.237.644,69	2,59%	RS 1.941,33		2,05	700,24	9,13	1.049.173,97
BBM DYNIA		0082089070001-98	PAK AGENCE DE FA	RS 28.195.381,79		RS 28.301.198,56	0,71%	RS 1.770,13		2,07	596,83	115,00	1.040.266,07
BBM DYNIA		0082089070001-72	QASIL & VIEIRA	RS -	RS 6.000.000,00	RS 6.207.985,51	0,00%	RS 247.000,51		0,00	0,00	0,00	0,00
BBM DYNIA		165395640001-24	AZ LEONAR BRAZ S.A.	RS -	RS 6.000.000,00	RS 6.194.423,94	0,00%	RS 194.443,94		0,00	0,00	0,00	0,00
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DYNIA		111820460001-77	CONSELADORA RUMANGON FIA	RS -	RS 2.600.000,00	RS 2.482.058,37	0,01%	RS 17.341,63		-1,04	0,00	0,00	0,00
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DYNIA		146937170001-42	FRALOGO AÇÕES FOCF	RS 42.735.266,77		RS 54.000.000,00	5,45%	RS 541.000,00		-1,20	0,00	0,00	0,00
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DYNIA		12121700001-55	ALTO DO FLUVESTAL FP	RS 12.124.228,77		RS 12.107.745,48	0,33%	RS 16.482,39		-0,02	0,00	0,00	0,00
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DYNIA		1240014519,95	12.400.145,95	RS 14.489.206,45		RS 14.489.206,45	1,12%	RS 2.055.500,00		2,11	0,00	0,00	0,00
Fundo de Investimento em Participações		167156200001-90	WTFP	RS 3.686.303,33		RS 3.686.303,33	0,00%	RS 3.614,66		-0,01	0,00	0,00	0,00
CAMA ECONÔMICA FEDERAL		196756200001-85	CAMA FICHEIR	RS 4.185.221,02		RS 4.052.256,90	0,20%	RS 45.958,00		-0,01	0,00	0,00	0,00
CBANK DYNIA S.A.		165205040001-96	BBT PACTUAL INFRAESTRUTURA INC FPC	RS 5.571.980,97		RS 5.452.456,34	0,00%	RS 6.709,56		-0,01	0,00	0,00	0,00
PLANNER CORRETORA		163681000001-94	KINEA REAL ESTATUTARY FI	RS 4.293.196,44		RS 4.196.280,29	0,00%	RS 22.716,15		-0,01	0,00	0,00	0,00
ATRIM DYNIA LTDA		147273700001-97	KINEA REAL ESTATUTARY FI	RS 4.040.000,00		RS 4.040.000,00	0,00%	RS 4.040.000,00		-0,01	0,00	0,00	0,00
CAMA ECONÔMICA FEDERAL		124817000001-43	FUND. DE INVESTIMENTO MULHERLAND CAMA TIX	RS 18.040.000,00		RS 18.040.000,00	0,00%	RS 18.040.000,00		0,00	0,00	0,00	0,00
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS		154017000001-91	FIRE-PORTES	RS 1.289.466.108,50		RS 1.300.422.817,01	1,00%	RS 13.000,00		1,30	0,00	0,00	0,00
Total da carteira previdenciária				RS 646.327.180,17		RS 653.295.694,94	1,00%	RS 646.327.180,17		1,00	0,00	0,00	0,00

As alterações relacionadas aos gestores, administradores e fundos seguem na tabela abaixo:

DIVIDENDOS:	MÊS
BTG INFRAESTRUTURA II FIP	Janeiro, Julho, Agosto
TRX FIDC I	Dezembro

INTEGRALIZAÇÕES:	MÊS
CYRELA FIP	Janeiro, Março, Abril, Maio, Junho, Julho, Agosto
KINEA PIPE FIA	Junho

RESGATES	MESES
FRANKLIN TEMPLETOM	Julho, Outubro, Novembro

COTAS:	EVENTO	DATA	LANÇAMENTO
BR HOTÉIS	Reprocessamento de Cotas por reavaliação do Administrador	31/12/2015	23/05/201
W7 FIP	Reprocessamento de Cotas por determinação do Administrador	28/02/2016	30/04/201
INCENTIVO FIDC	PDD	31/10/2016	20/11/201

ADMINISTRADORES	ANTERIOR	NOVO	DATA
BR HOTÉIS	BNY MELLON	ELITE DTVM	01/07/201
GGR FIDC PRIME I	SANTANDER DTVM	CM CAPITAL MARKET	19/08/201
W7 FIP	SANTANDER DTVM	PLANNER DTVM	17/11/201

GESTORES:	ANTERIOR:	NOVO	DATA
BR HOTÉIS	DRACHMA INVESTIMENTOS	BRIDGE TRUST	01/07/201
BMC FIDC	RIVIERA INVESTIMENTOS	ARTESANAL INVESTIMENTOS	23/09/201

FUNDOS	EVENTO	NOVO	DATA
TOWER BRIDGE RF	CISÃO	TOWER BRIDGE I e II	Março

Logo abaixo, podemos verificar mês a mês as reformulações da carteira e constatar a atuação ativa no acompanhamento do mercado financeiro, bem como no monitoramento do cenário externo e doméstico em todos os seus desdobramentos.

3.2 DESEMPENHO HISTÓRICO

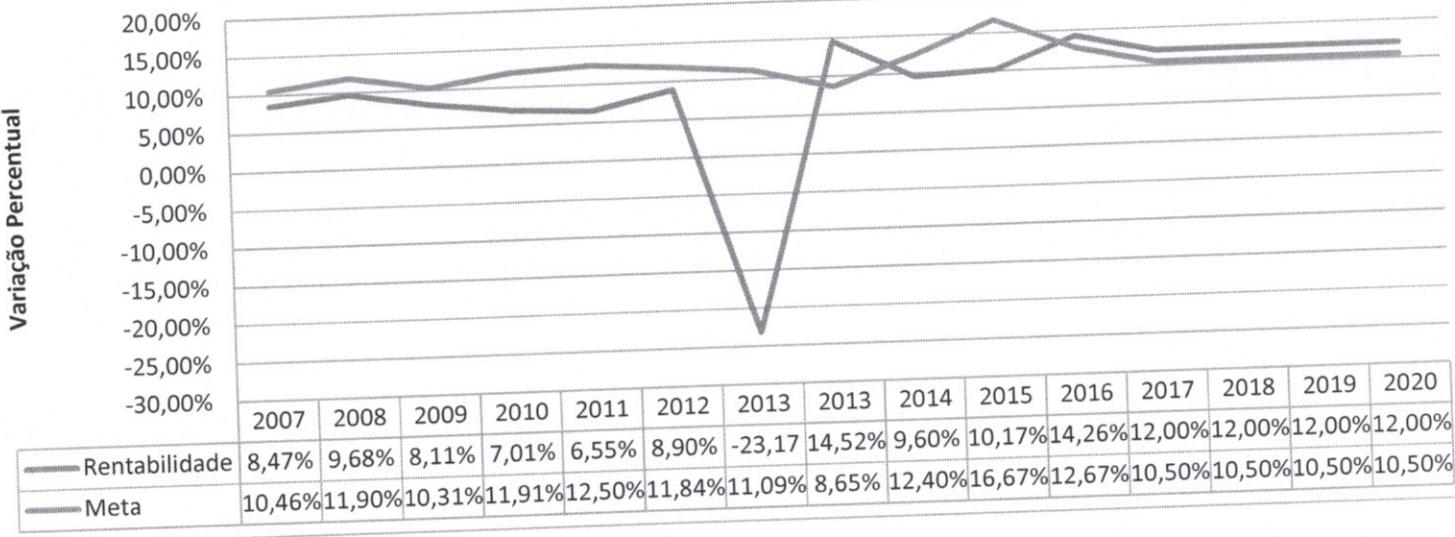
O ano de 2016 foi o ano que representou o maior crescimento para o patrimônio do Ipresb, de forma sustentável, evidenciando os resultados da reestruturação implementada nos últimos anos.

Pela primeira vez em sua história, conforme dados resgatados, o Ipresb superou a meta



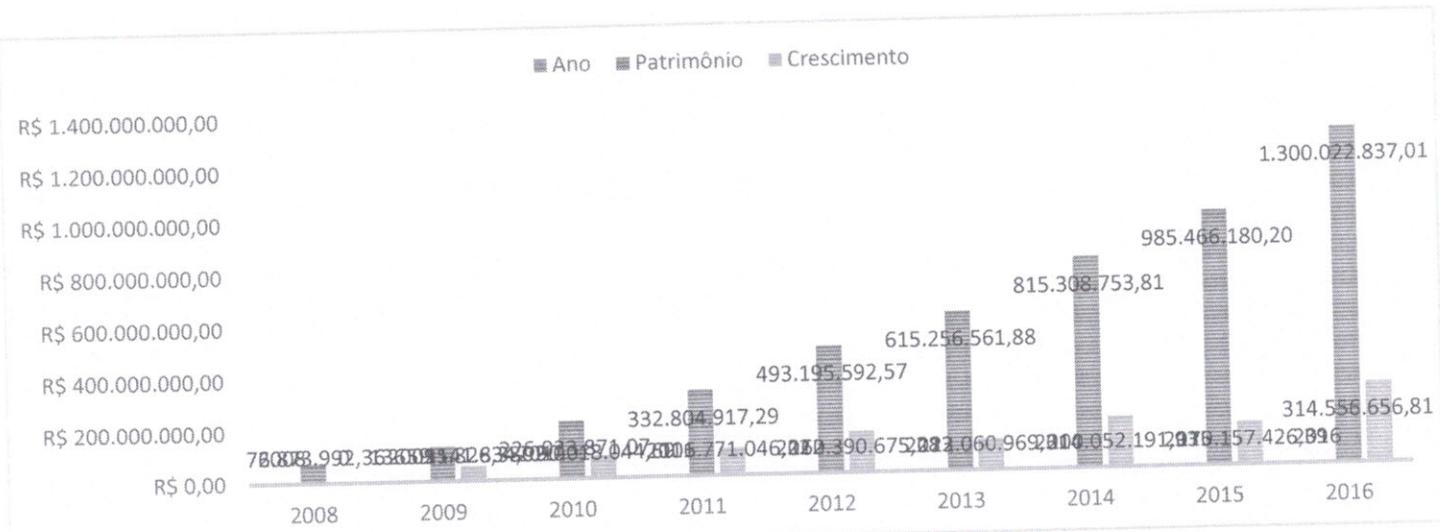
atuarial, atingindo 14,26%, contra 12,67%.

Rentabilidade



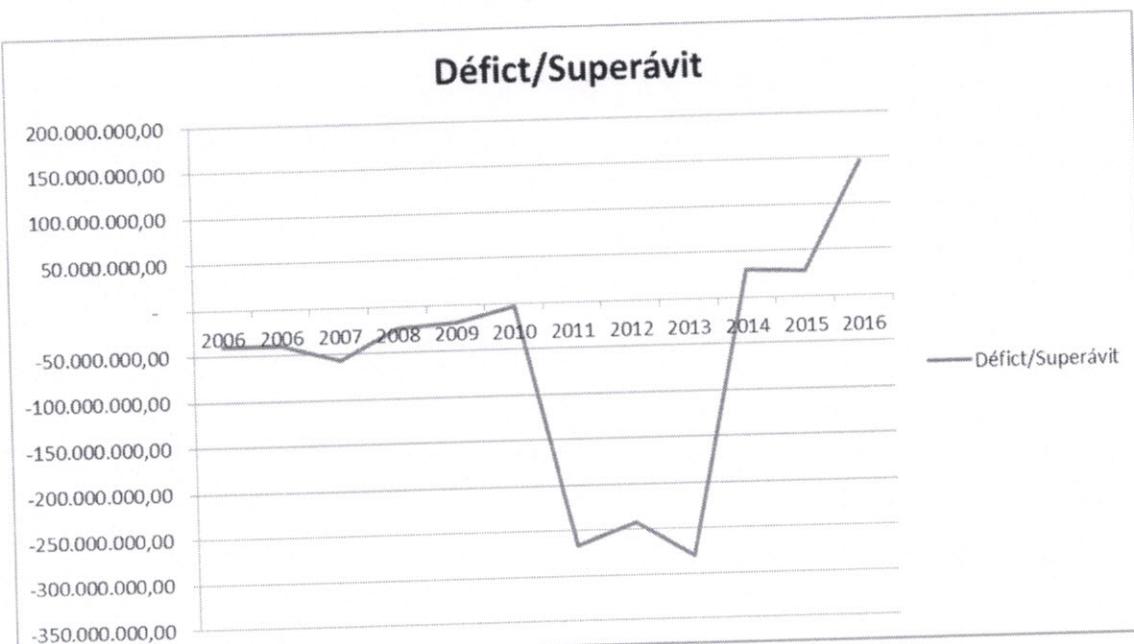
Neste ano, o crescimento do patrimônio e seu respectivo crescimento apresentaram o seguinte desempenho em relação aos anos anteriores.

Ano	Patrimônio	Crescimento
2008	76.873.992,36	0
2009	136.015.826,38	59.141.834,02
2010	226.033.871,07	90.018.044,69
2011	332.804.917,29	106.771.046,22
2012	493.195.592,57	160.390.675,28
2013	615.256.561,88	122.060.969,31
2014	815.308.753,81	200.052.191,93
2015	985.466.180,20	170.157.426,39
2016	1.300.022.837,01	314.556.656,81



Tal desempenho vêm refetendo positivamente em nosso resultado atuarial, cuja base de dados mantém-se sem significativas alterações:

Ano Confecção	Ano Referência	Déficit/Superávit
2006	2006	- 40.396.461,54
2007	2006	- 40.396.461,54
2008	2007	- 56.825.996,07
2009	2008	- 23.520.183,03
2010	2009	- 19.579.610,88
2011	2010	- 3.329.761,44
2012	2011	- 266.354.480,71
2013	2012	- 241.780.174,81
2014	2013	- 279.779.290,10
2015	2014	30.481.515,28
2016	2015	27.936.473,55
2017	2016	146.745.947,43



Desde o início da reestruturação do Ipresb, mudou-se a consultoria que elabora tal estudo para a Caixa Econômica Federal e, ao longo dos anos, de forma criteriosa e cautelosa, de acordo com o contexto macro, vêm se discutindo as premissas a serem adotadas na elaboração do Estudo.

Tal Estudo apresenta adesão à gestão que atua de forma estrita à legislação e se harmoniza com o Asset Liability Management (ALM), elaborado em novembro, com base na posição de Agosto, cujos cenários apresentados evidenciam os seguintes resultados:

Hipótese	Taxa de Retorno (Real ao ano)	Superávit/Déficit
1) Carteira Atual com 6,00% ao ano	6,0%	R\$ 367 milhões
2) Carteira Atual com Cenário Base	5,2%	R\$ 41 milhões
3) Carteira Atual com Cenário Alternativo	5,3%	R\$ 100 milhões

Desta forma, podemos verificar que, historicamente, este ano de 2016 evidenciou o melhor ano do Ipresb, no que atine ao desempenho da Carteira, ao resultado atuarial, crescimento do patrimônio e ALM.

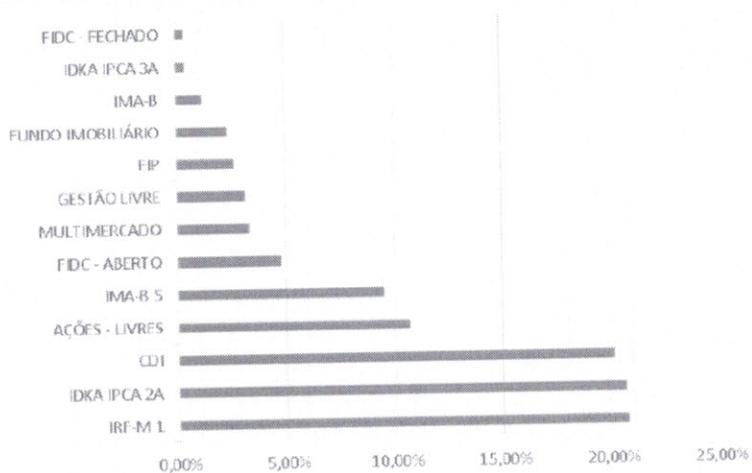
3.3 ANÁLISE DE RISCO DA CARTEIRA

	Meta	Rentabilidade	VaR
Janeiro	1,77%	1,38%	1,76%
Fevereiro	1,40%	0,90%	1,49%
Março	0,93%	1,34%	2,33%
Abril	1,11%	1,37%	1,79%
Maio	1,28%	0,39%	1,77%
Junho	0,85%	1,28%	2,15%
Julho	1,02%	2,09%	1,25%
Agosto	0,94%	1,03%	1,69%
Setembro	0,58%	0,95%	1,84%
Outubro	0,76%	1,49%	1,39%
Novembro	0,68%	-0,20%	2,70%
Dezembro	0,80%	1,40%	1,87%
Total	12,67%	14,26%	1,75%

- RISCO DE MERCADO

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	270.008.477,43	20,77%
IDKA IPCA 2A	268.309.875,66	20,64%
CDI	261.801.737,10	20,14%
AÇÕES - LIVRES	138.878.772,92	10,68%
IMA-B 5	123.848.789,99	9,53%
FIDC - ABERTO	62.385.374,04	4,80%
MULTIMERCADO	42.834.324,48	3,29%
GESTÃO LIVRE	40.965.793,44	3,15%
FIP	34.369.492,28	2,64%
FUNDO IMOBILIÁRIO	30.619.259,10	2,36%
IMA-B	15.751.841,88	1,21%
IDKA IPCA 3A	5.887.059,25	0,45%
FIDC - FECHADO	4.458.564,56	0,34%

Distribuição dos Ativos por Sub-Segmento

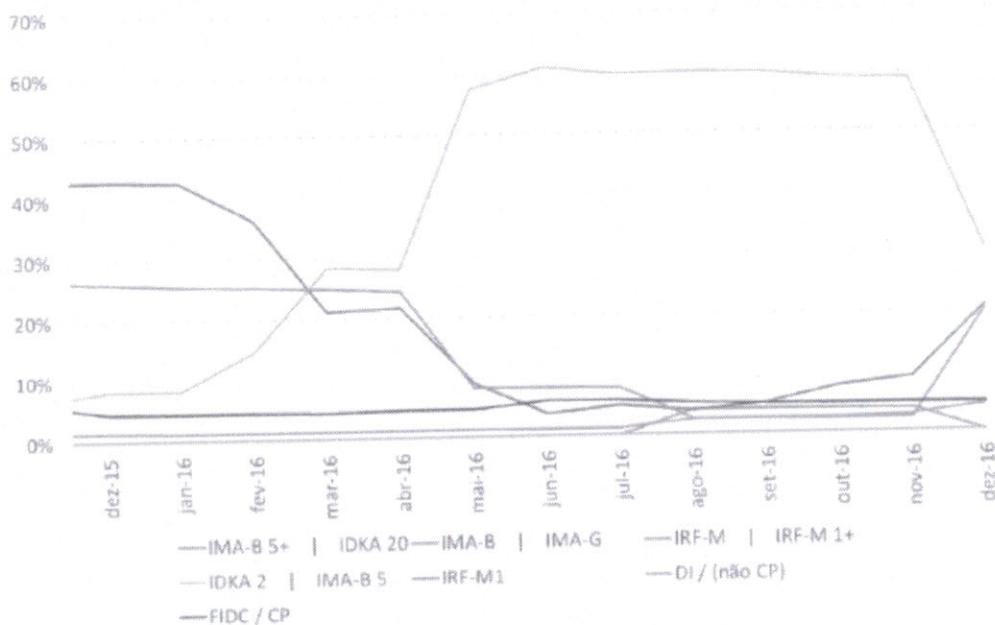


Value At Risk

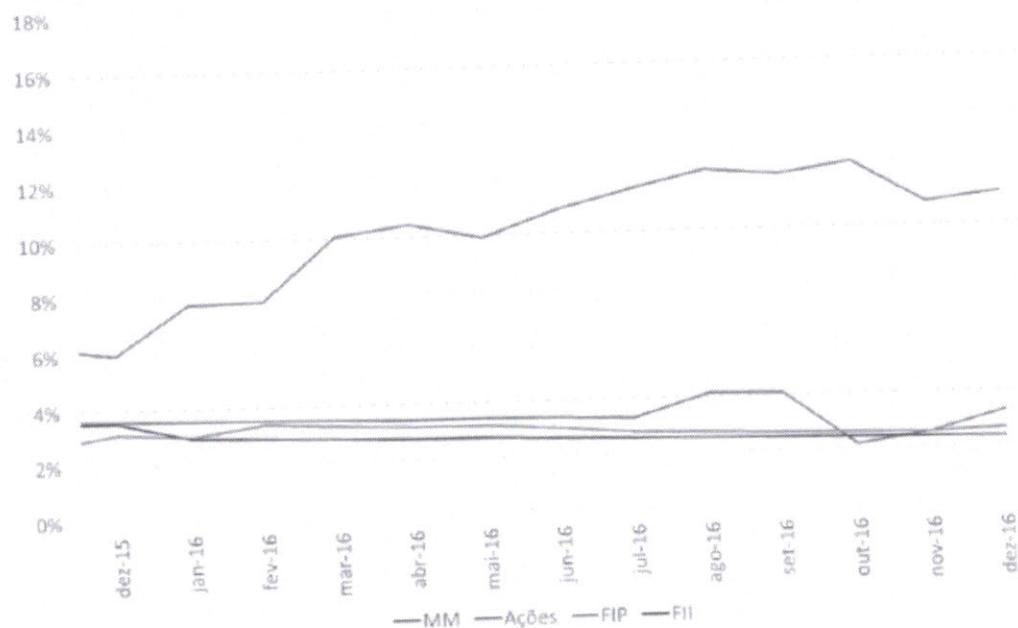
VaR	22.771.290,88
VaR (%)	1,75%

VaR (I.C. 5%) 252 DU - VaR Paramétrico. Indica que há 5% de probabilidade de que a perda em 252 dias úteis seja superior ao VaR indicado

Alocação em Renda Fixa



Alocacão em Renda Variável



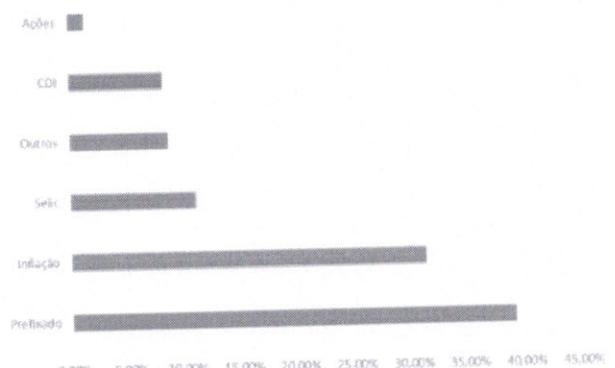
RISCO DE CRÉDITO

Tipo de Ativo (%)	Fator de Risco (%)
Títulos Federais	49,70% Prefixado 39,20%
Operação compromissada	31,90% Inflação 31,29%
Títulos Privados	10,28% Selic 11,09%
Outros	2,79% Outros 8,70%
Fundos de Investimento	1,54% CDI 8,24%
Ações	1,45% Ações 1,46%
Debêntures	1,33% Cambial 0,02%
Direito Creditório	0,97%
Derivativos	0,03%

Distribuição por Tipo de Ativo



Distribuição por Fator de Risco



Total da Carteira	(milhões)
PL em dezembro/2015	153.325.467,56
PL em dezembro/2016	187.573.952,60
Variação	22.3371%

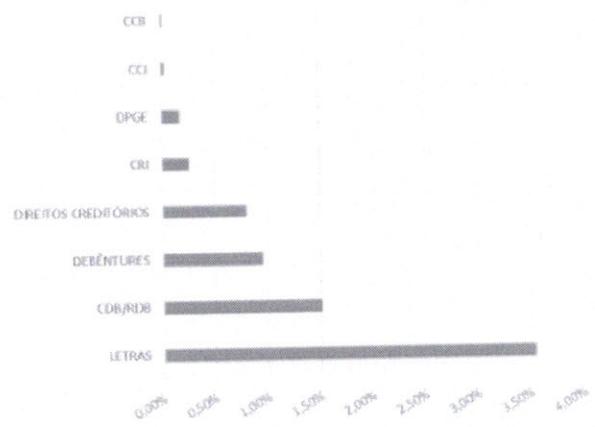
Risco do Ativo (%)	
Rating AAA	51,31%
Outros	42,87%
Rating AA	3,86%
Risco de mercado	1,35%
Rating A	0,41%
Rating BBB	0,10%
Risco de mercado imobiliário	0,08%

Total da Carteira em Ativos de Crédito	(%)
LETROS	3,54%
CDB/RDB	1,51%
DEBÉNTURES	0,95%
DIREITOS CREDITÓRIOS	0,80%
CRI	0,25%
DPGE	0,18%
CCI	0,03%
CCB	0,02%

Distribuição por Risco de Ativo



Distribuição por Ativo de Crédito Privado



- RISCO DE LIQUIDEZ

Total da Carteira	(milhões)
PL em dezembro/2015	983.950.318,65
PL em dezembro/2016	1.300.119.362,13
Variação	32,13%

Total da Carteira	(milhões)	(%)
D+0 à D+1	893.517.120,39	68,73%
D+1 à D+33	142.484.959,11	10,96%
Acima de D+33	264.117.282,63	20,31%

Total da Carteira Renda Fixa	(milhões)
PL em dezembro/2015	806.820.684,82
PL em dezembro/2016	1.027.044.906,51
Variação	27,30%

Total da Carteira Renda Fixa	(milhões)	(%)
D+0 à D+1	893.517.120,39	68,73%
D+1 à D+33	5.120.878,89	0,39%
Acima de D+33	154.779.514,07	11,91%

Total da Carteira Renda Variável	(milhões)
PL em dezembro/2015	156.448.791,99
PL em dezembro/2016	246.701.848,78
Variação	57,69%

Total da Carteira Renda Variável	(milhões)	(%)
D+0 à D+1	-	0,00%
D+1 à D+33	137.364.080,22	10,57%
Acima de D+33	109.337.768,56	8,41%

DESENQUADRADO - RF

ARTIGO 7º, INCISO VII, ALÍNEA " A "

ARTIGO 7º, INCISO VI

ARTIGO 7º, INCISO IV, ALÍNEA " A "

ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA " A "

ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA " B "

0,00% 10,00% 20,00% 30,00% 40,00% 50,00%

Distribuição por Enquadramento em Renda Variável

ARTIGO 8º, INCISO VI

ARTIGO 8º, INCISO V

ARTIGO 8º, INCISO IV

ARTIGO 8º, INCISO III

0,00% 2,00% 4,00% 6,00% 8,00% 10,00% 12,00%

- RISCO LEGAL – RESOLUÇÃO Nº3.922/2010

Artigos - Renda Fixa	Límite Resolução	Límite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Político
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	22,00%	582.538.211,97	44,81%	-296.511.952,30
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	8,00%	101.267.832,24	7,79%	2.741.716,73
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	25,00%	302.767.530,54	23,29%	22.262.309,99
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	13,00%	62.385.374,04	4,80%	106.630.143,04
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	2,00%	4.458.564,56	0,34%	21.543.822,68
Total Renda Fixa	100,00%	70,00%	1.053.417.513,35	81,02%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	12,00%	138.878.772,92	10,68%	17.135.550,54
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	42.834.324,48	3,29%	22.171.643,63
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	34.369.492,28	2,64%	30.636.475,83
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	30.619.259,10	2,36%	34.386.709,01
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	3,00%	0,00	0,00%	39.003.580,86
Total Renda Variável	30,00%	30,00%	246.701.848,78	18,98%	

- MÉTRICAS DE DESEMPENHO

JULHO/2016

SHARPE	BETA	R2	TREYNOR	MODIGLIANI / M2	SORTINO	ALPHA DE JENSEN	TRACKING ERROR	INFORMATION RATIO	DOWNSIDE DEVIATION
0,35	0,94	0,83	-0,03	11,08%	11,12	-0,26%	0,16%	-17,44	2,93%

SETEMBRO/2016

SHARPE	BETA	R2	TREYNOR	MODIGLIANI / M2	SORTINO	ALPHA DE JENSEN	TRACKING ERROR	INFORMATION RATIO	DOWNSIDE DEVIATION
0,23	0,84	0,74	-0,31	11,06%	6,55	-0,54%	0,20%	-17,93	3,60%

DEZEMBRO/2016

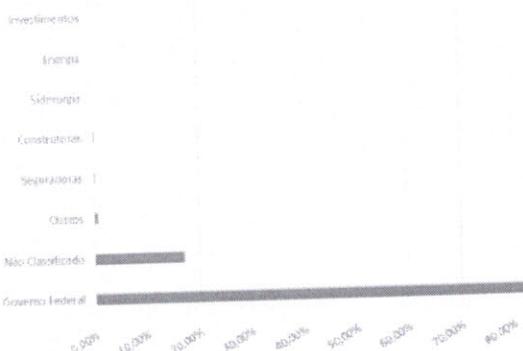
SHARPE	BETA	R2	TREYNOR	MODIGLIANI / M2	SORTINO	ALPHA DE JENSEN	TRACKING ERROR	INFORMATION RATIO	DOWNSIDE DEVIATION
0,25	0,87	0,79	-1,58	10,70%	20,39	-0,31%	0,15%	-12,07	2,36%

- EXPOSIÇÃO

Setor dos Ativos	(%)
Governo Federal	82,26%
Não Classificado	17,03%
Outros	0,68%
Seguradoras	0,01%
Construtoras	0,01%
Siderurgia	0,00%
Energia	0,00%
Investimentos	0,00%

Títulos Públicos - LFT	(%)
LFT - Venc.: 01/09/2018	1,24%
Op. Compr. LFT - Venc.: 01/09/2020	1,23%
LFT - Venc.: 01/03/2020	1,20%
Op. Compr. - LFT - Venc.: 01/09/2021	1,20%
Op. Compr. - LFT - Venc.: 01/03/2020	1,07%
LFT - Venc.: 01/09/2021	0,97%
LFT - Venc.: 01/03/2018	0,86%
LFT - Venc.: 07/09/2017	0,76%
LFT - Venc.: 01/03/2021	0,69%
LFT - Venc.: 01/03/2019	0,47%
LFT - Venc.: 01/09/2020	0,45%
LFT - Venc.: 01/03/2022	0,33%
LFT - Venc.: 01/09/2022	0,22%
LFT - Venc.: 07/03/2017	0,19%
Op. Compr. - LFT - Venc.: 01/09/2022	0,12%
LFT	0,03%

Exposição por Setor de Ativo

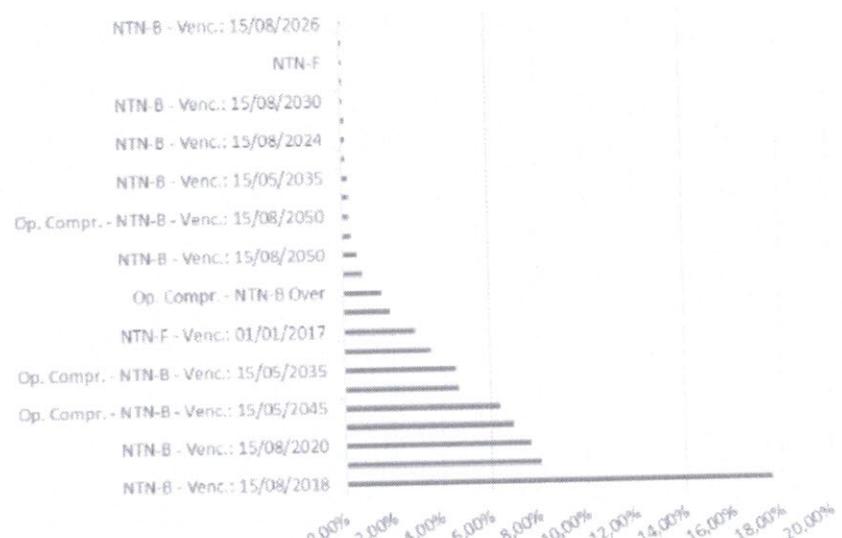


Exposição por Títulos Públicos - LFT



Títulos Públicos - NTN-B / NTN-F	(%)
NTN-B - Venc.: 15/08/2018	17,54%
NTN-B - Venc.: 15/05/2019	8,05%
NTN-B - Venc.: 15/08/2020	7,62%
Op. Compr. - NTN-B - Venc.: 15/08/2022	6,92%
Op. Compr. - NTN-B - Venc.: 15/05/2045	6,38%
NTN-B - Venc.: 15/05/2021	4,74%
Op. Compr. - NTN-B - Venc.: 15/05/2035	4,59%
NTN-B - Venc.: 15/05/2017	3,57%
NTN-F - Venc.: 01/01/2017	2,93%
Op. Compr. - NTN-F - Venc.: 01/01/2025	1,94%
Op. Compr. - NTN-B Over	1,57%
NTN-B	0,83%
NTN-B - Venc.: 15/08/2050	0,60%
NTN-B - Venc.: 15/05/2045	0,37%
Op. Compr. - NTN-B - Venc.: 15/08/2050	0,29%
NTN-B - Venc.: 15/08/2022	0,29%
NTN-B - Venc.: 15/05/2035	0,24%
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	0,22%
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	0,20%
NTN-B - Venc.: 15/08/2040	0,18%
NTN-B - Venc.: 15/08/2030	0,14%
NTN-F - Venc.: 01/01/2021	0,13%
NTN-F	0,11%
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	0,10%
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	0,10%

Exposição por Títulos Públicos – NTN-B / NTN-F



Ações	(%)
Ações (omitidas)	1,00%
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo	0,03%

Exposição: as maiores participações - Ações

Ações e outros TVM cedidos em empréstimo
(omitidas)

Ações (omitidas)



4. DESEMPENHO DO IPRESB

Desempenho dos fundos investidos

- RPPS com melhores notas:

Nome do RPPS	Nota final	Média de Fundos Investidos	% Da carteira de RF avaliada
RPPS DO MUNICÍPIO DE PIRES DO RIO / GO (PIRESPREV)	0,118	1	100%
RPPS DO MUNICÍPIO DE ALTINHO / PE	0,180	3	100%
RPPS DO MUNICÍPIO DE BARUERI / SP (IPRESB)	0,265	11	88%
RPPS DO MUNICÍPIO DE PRAIA GRANDE / SP (IPMPG)	0,280	10	97%
RPPS DO MUNICÍPIO DE SEROPÉDICA / RJ (SEROPREVI)	0,293	3	100%
RPPS DO MUNICÍPIO DE MONTE ALEGRE / PA (PMMONTEALEGRE)	0,298	4	86%
RPPS DO MUNICÍPIO DO RIO DE JANEIRO / RJ (PREVIRIO)	0,299	5	100%
RPPS DO MUNICÍPIO DE CASINHAS / PE (FUNPRECA)	0,300	1	100%
RPPS DO MUNICÍPIO DE PORTO ALEGRE / RS (PREVIMPA)	0,301	6	100%
RPPS DO MUNICÍPIO DE BOA SAÚDE (ANTIGO JANUÁRIO CICCO) / RN (IPBS)	0,304	2	100%
RPPS DO MUNICÍPIO DE CERQUEIRAS / SP	0,310	13	91%
RPPS DO MUNICÍPIO DE ARROIO TRINTA / SC	0,312	9	100%
RPPS DO MUNICÍPIO DE TRINDADE / GO	0,313	5	100%
RPPS DO MUNICÍPIO DE VILA FLORES / RS	0,318	13	92%
RPPS DO MUNICÍPIO DE SÃO ROQUE / SP	0,319	9	92%

Fonte: Quantum Axis

RPPS DO MUNICÍPIO DE PIRES DO RIO / GO (PIRESPREV):

Investe 100% no BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO, é o 11 melhor fundo de CDI.

Performou 102% do CDI.

RELATÓRIO DE APLICAÇÕES E INVESTIMENTOS POR ENTE
BIMESTRE: MAIO/JUNHO - 2016

UF	NOME DO ENTE	TOTAL DE APLICAÇÕES	TOTAL DE DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	TOTAL GERAL	Pesquisa própria DAIR 6º Bim
RJ	Governo do Estado do Rio de Janeiro	30.613.546.844,85	391.835.391,51	31.005.382.236,36	
PR	Governo do Estado do Paraná	7.690.670.588,83	765.518,10	7.691.436.106,93	
PA	Governo do Estado do Pará	4.283.932.201,98	7.834.236,86	4.291.766.438,84	
TO	Governo do Estado do Tocantins	3.812.820.244,00	56.533.850,78	3.869.354.094,78	
DF	Governo do Distrito Federal	3.062.849.333,99	167.148,43	3.063.016.482,42	
AM	Governo do Estado do Amazonas	2.738.490.562,79	41.531,97	2.738.532.094,76	
ES	Governo do Estado do Espírito Santo	2.266.084.102,00	27.359,38	2.266.111.461,38	
PR	Curitiba	2.121.210.435,92	0,00	2.121.210.435,92	
SP	São José dos Campos	2.029.804.621,37	170.165,12	2.029.974.786,49	2.127.409.224,24
RJ	Macacá	1.840.705.005,69	8.456,81	1.840.713.462,50	1.986.802.812,51
SC	Joinville	1.705.588.292,83	373,31	1.705.588.666,14	1.824.133.702,35
RO	Governo do Estado de Rondônia	1.605.095.176,86	0,00	1.605.095.176,86	
RJ	Rio de Janeiro	1.184.985.012,84	239.536.460,22	1.424.521.473,06	
PE	Recife	1.275.669.024,03	0,00	1.275.669.024,03	
BA	Governo do Estado da Bahia	1.241.448.092,40	0,00	1.241.448.092,40	
SP	Jundiaí	1.211.755.539,76	1.738.125,35	1.213.493.665,11	1.278.977.142,98
RS	Porto Alegre	1.211.269.369,80	8.485,02	1.211.277.854,82	
RJ	Campos dos Goytacazes	1.207.408.778,92	0,00	1.207.408.778,92	1.047.000.000,00
SP	Barueri	1.143.197.931,99	11.690,97	1.143.209.622,96	1.300.033.651,99
MA	Governo do Estado do Maranhão	1.117.749.724,39	23.771,39	1.117.773.495,78	

Fonte: CADPREV, da Secretaria de Previdência e Promoção Social, do Ministério da Fazenda,
base de Janeiro de 2017.

CLASSIFICAÇÃO DOS VENCEDORES

Este ano, a disputa pelo 7º Prêmio Boas Práticas de Gestão Previdenciária se deu entre 44 RPPS, divididos em três categorias: grande, médio e pequeno porte. Destes, 30 foram classificados e receberam o troféu.

GRANDE PORTE		MÉDIO PORTE		PEQUENO PORTE	
	Fundo/Instituto		Fundo/Instituto		Fundo/Instituto
1º	Cabo de Santo Agostinho	PE	1º	Navegantes	SC
1º	Indaiatuba	SP	2º	Viçosa do Ceará	CE
2º	Praia Grande	SP	3º	Garanhuns	PE
3º	Estado do Amazonas	AM	4º	Ubatuba	SP
4º	Mogi das Cruzes	SP	5º	Birigui	SP
5º	Betim	MG	6º	Cariacica	ES
6º	Porto Alegre	RS	7º	Divinópolis	MG
7º	Manaus	AM	8º	Leme	SP
8º	Barueri	SP			
9º	São José do Rio Preto	SP			
10º	Camaçari	BA			
11º	Jaboatão dos Guararapes	PE			

Fonte: Associação Nacional das Entidades de Previdência dos Estados e Municípios, pesquisa no site oficial em Janeiro de 2017.



Igo Jefferson Lima Clemente
Diretor Financeiro
IPRESB