

# Relatório Analítico dos Investimentos em março e 1º Trimestre de 2017



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.950.260,13	9,71%	628	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.975.111,80	2,41%	719	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.434.833,72	7,86%	273	0,41%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	10.294.934,40	12,57%	116	1,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	4.629.202,45	5,65%	303	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.314.528,03	6,49%	609	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	10.822.582,87	13,21%	766	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	709.867,39	0,87%	70	0,27%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.025.391,68	1,25%	35	0,19%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	10.697.146,43	13,06%	58	2,19%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.497,76	0,01%	103	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	283.825,18	0,35%	31	0,25%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.191.531,69	3,90%	762	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	336.733,73	0,41%	419	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	611.443,81	0,75%	4.966	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MASTER II FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	8.364,97	0,01%	28	1,10%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	2.248.727,14	2,75%	98	2,14%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	D+90 ou D+150 a D+450	18 meses	907.601,96	1,11%	14	8,35%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.847.608,97	2,26%	21.337	0,34%	Artigo 8º, Inciso I
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.997.764,04	3,66%	2.802	1,15%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	1.287.252,16	1,57%	116	0,35%	Artigo 8º, Inciso III
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	D+4382	Não há	1.070.214,39	1,31%	5	0,75%	Artigo 8º, Inciso IV

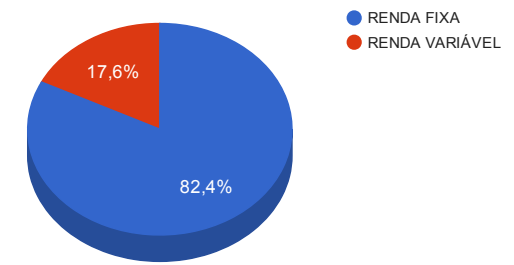
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CONQUEST FIP - FCCQ11	Não se aplica	Não se aplica	3.802.571,69	4,64%			Artigo 8º, Inciso V
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se aplica	Não se aplica	3.445.306,60	4,21%		8,11%	Artigo 8º, Inciso VI
<b>TOTAL -</b>			<b>81.897.302,99</b>				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	

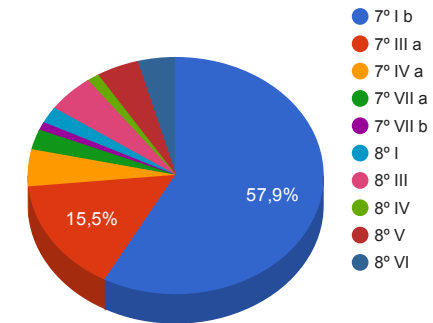
Distribuição por Segmento

Artigo	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	47.421.453,40	57,90%	30,00%	35,00%	70,00%	9.906.658,69
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	12.720.728,44	15,53%	15,00%	20,00%	60,00%	36.417.653,35
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	4.139.709,23	5,05%	5,00%	5,00%	30,00%	20.429.481,67
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	12.284.595,45
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	2.257.092,11	2,76%	0,00%	3,00%	5,00%	1.837.773,04
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	907.601,96	1,11%	0,00%	2,00%	5,00%	3.187.263,19
Total Renda Fixa	100,00%	67.446.585,14	82,36%	55,00%	75,00%	185,00%	-



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	1.847.608,97	2,26%	0,00%	2,00%	5,00%	2.247.256,18
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	4.285.016,20	5,23%	5,00%	9,00%	15,00%	7.999.579,25
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	1.070.214,39	1,31%	2,00%	5,00%	5,00%	3.024.650,76
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	3.802.571,69	4,64%	2,00%	4,50%	5,00%	292.293,46
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	3.445.306,60	4,21%	2,00%	4,50%	5,00%	649.558,55
Total Renda Variável	30,00%	14.450.717,85	17,64%	11,00%	25,00%	35,00%	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: março / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)	Artigos - Renda Variável	Base: março / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)				Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	47.421.453,40	57,90%	30,00%	70,00%	Artigo 8º, Inciso I	1.847.608,97	2,26%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	12.720.728,44	15,53%	15,00%	60,00%	Artigo 8º, Inciso III	4.285.016,20	5,23%	5,00%	15,00%

Artigo 7º, Inciso III, Alínea "a"	12.720.726,44	15,55%	15,00%	50,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea "a"	4.139.709,23	5,05%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea "a"	2.257.092,11	2,76%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea "b"	907.601,96	1,11%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>67.446.585,14</b>	<b>82,36%</b>	<b>55,00</b>	<b>185,00</b>

Artigo 8º, Inciso III	4.285.016,20	5,25%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	1.070.214,39	1,31%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	3.802.571,69	4,64%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	3.445.306,60	4,21%	2,00%	5,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>14.450.717,85</b>	<b>17,64%</b>	<b>11,00</b>	<b>35,00</b>

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	1,62%	4,11%	4,11%	6,49%	14,06%	33,81%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,42%	3,82%	3,82%	6,15%	13,74%	32,33%	0,20%	0,660%	1,88%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,41%	3,87%	3,87%	6,17%	13,72%	32,21%	0,20%	0,680%	1,94%

IMA-R 5	1,39%	4,09%	4,09%	6,45%	14,11%	32,99%	-	-	-
---------	-------	-------	-------	-------	--------	--------	---	---	---

IMB-B	1,03%	4,03%	4,03%	6,43%	17,11%	32,33%	-	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1,45%	4,29%	4,29%	6,64%	14,22%	32,34%	0,20%	0,840%	2,38%
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,13%	3,53%	3,53%	5,75%	-	-	0,70%	5,740%	8,28%
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,49%	1,95%	1,95%	4,28%	12,90%	9,20%	0,70%	0,960%	2,83%

CDI + 3,50% ao ano	1,37%	3,92%	3,92%	8,20%	17,75%	38,56%	-	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-9,73%	-92,90%	-92,90%	-82,44%	-85,64%	-86,87%	0,20%	11,230%	1.005,50%

Selic	1,05%	3,03%	3,03%	6,38%	13,77%	29,41%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,05%	3,05%	3,05%	6,61%	14,06%	29,75%	0,20%	0,000%	0,06%

CDI	1,05%	3,03%	3,03%	6,37%	13,75%	29,37%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,07%	3,09%	3,09%	6,47%	13,79%	29,52%	0,20%	0,010%	0,17%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,07%	3,05%	3,05%	6,41%	13,83%	29,61%	0,25%	0,020%	0,06%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,54%	1,51%	1,51%	3,08%	-5,49%	-26,26%	1,00%	0,040%	11,34%

IMA-B	1,04%	6,89%	6,89%	9,36%	21,56%	40,51%	-	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1,06%	7,08%	7,08%	9,67%	22,16%	40,35%	0,20%	2,130%	6,37%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,03%	6,83%	6,83%	9,33%	21,40%	38,26%	0,20%	2,050%	6,15%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,02%	6,84%	6,84%	9,22%	21,32%	39,81%	0,20%	2,050%	6,16%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,01%	6,76%	6,76%	9,23%	21,22%	39,47%	0,20%	2,060%	6,17%

IMA-B 5+	0,88%	8,35%	8,35%	10,88%	26,07%	45,95%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,84%	8,15%	8,15%	10,63%	25,55%	44,50%	0,20%	2,720%	8,47%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,82%	8,16%	8,16%	10,58%	25,74%	45,84%	0,20%	2,740%	8,46%

BB IMA-B 5+ TITULOS PUBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIARIO	0,83%	8,16%	8,16%	10,58%	23,14%	45,01%	0,20%	2,740%	8,46%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	0,80%	8,37%	8,37%	10,82%	25,83%	44,87%	0,20%	2,770%	8,60%
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,75%	2,36%	2,36%	4,52%	10,50%	27,70%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,45%	-1,32%	-1,32%	-3,77%	-13,20%	-19,19%	0,25%	0,350%	2,12%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE QUEIMADOS  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/03/2017

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 8,00% ao ano	0,96%	2,92%	2,92%	5,67%	12,97%	33,38%	-	-	-
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	3,37%	-34,72%	-34,72%	-32,80%	-25,91%	-22,37%	0,12%	1,240%	40,38%
IFIX	0,20%	9,01%	9,01%	11,89%	36,84%	50,85%	-	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,00%	0,00%	0,00%	-32,65%	-32,65%	-70,90%	1,50%	0,000%	32,59%
Ibovespa	-2,52%	7,90%	7,90%	11,34%	29,83%	27,05%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	-2,26%	4,67%	4,67%	11,27%	23,53%	13,12%	4,00%	9,150%	21,12%

IDIV	-1,85%	14,03%	14,03%	26,96%	55,13%	41,56%	-	-	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-1,03%	6,28%	6,28%	5,77%	14,97%	16,91%	1,72%	7,090%	15,79%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	-1,96%	4,48%	4,48%	5,03%	13,81%	3,71%	3,00%	8,680%	20,21%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CONQUEST FIP - FCCQ11	-	-	-	-	-	-	0,30%	-	-

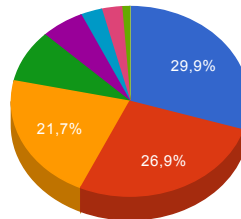


INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE QUEIMADOS  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/03/2017

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

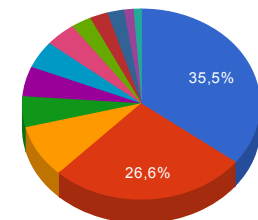
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	24.470.640,59	29,88%
BANCO BRADESCO Administrador	22.043.179,71	26,92%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	17.746.106,07	21,67%
Foco DTVM	7.247.878,29	8,85%
GERAÇÃO FUTURO	4.845.373,01	5,92%
BRIDGE TRUST	2.379.431,25	2,91%
PETRA Corretora	2.248.727,14	2,75%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	907.601,96	1,11%
Socopa	8.364,97	0,01%

- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
- BANCO BRADESCO
- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- Foco DTVM
- GERAÇÃO FUTURO
- BRIDGE TRUST
- PETRA Corretora
- BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS
- Outro



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	29.072.275,16	35,50%
IMA-B 5+ Sub-segmento	21.761.182,60	26,67%
IDKA IPCA 2A	7.289.639,83	8,90%
AÇÕES - SETORIAIS	4.285.016,20	5,23%
CDI	4.139.709,23	5,05%
FIP	3.802.571,69	4,64%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.445.306,60	4,21%
FIDC - FECHADO	2.257.092,11	2,76%
IMA-B 5	2.019.084,25	2,47%
AÇÕES - INDEXADO	1.847.608,97	2,26%

- IMA-B
- IMA-B 5+
- IDKA IPCA 2A
- AÇÕES - SETORIAIS
- CDI
- FIP
- FUNDO IMOBILIÁRIO
- FIDC - FECHADO
- IMA-B 5
- AÇÕES - INDEXADO
- MULTIMER...
- CRÉDITO PRIVADO





AÇÕES - INCLUIDO	1.077.000,97	2,20%
MULTIMERCADO	1.070.214,39	1,31%
CRÉDITO PRIVADO	907.601,96	1,11%

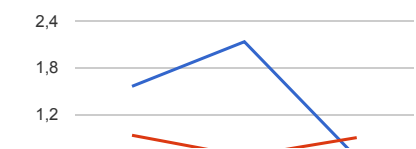
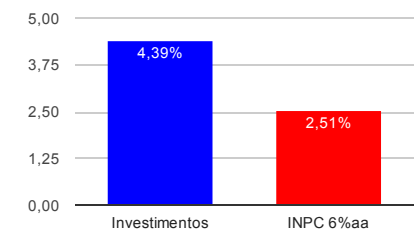


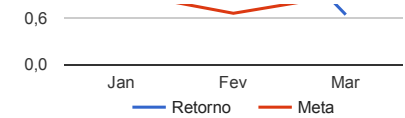
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE QUEIMADOS  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/03/2017

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	80.243.090,02	465.586,99	1.496.916,24	80.462.675,95	1.250.915,18	1,56%	0,93%	167,62%	2,51%
Fevereiro	80.462.675,95	900.000,00	20.603.556,22	62.474.568,52	1.715.448,79	2,13%	0,66%	323,03%	1,96%
Março	62.474.568,52	20.269.735,67	1.369.893,58	81.897.302,99	522.892,38	0,64%	0,90%	71,78%	2,33%
Acumulado no ano					3.489.256,35	4,39%	2,51%	175,23%	

Acumulado no Ano





INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE QUEIMADOS  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/03/2017

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	754.057,39	0,00	54.986,21	709.867,39	10.796,21	1,43%	0,84%	1,45%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.294.500,47	0,00	54.986,21	5.314.528,03	75.013,77	1,42%	0,66%	1,42%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.947.684,86	0,00	0,00	1.975.111,80	27.426,94	1,41%	0,68%	1,41%
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	280.662,74	0,00	0,00	283.825,18	3.162,44	1,13%	5,74%	1,13%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.157.850,48	0,00	0,00	3.191.531,69	33.681,21	1,07%	0,01%	1,07%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	604.999,94	0,00	0,00	611.443,81	6.443,87	1,07%	0,02%	1,07%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.450,37	0,00	0,00	4.497,76	47,39	1,06%	2,13%	1,06%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	333.230,18	0,00	0,00	336.733,73	3.503,55	1,05%	0,00%	1,05%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.335.388,34	0,00	629.960,58	10.822.582,87	117.155,11	1,03%	2,05%	1,03%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.870.067,54	0,00	0,00	7.950.260,13	80.192,59	1,02%	2,05%	1,02%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	10.815.324,75	0,00	629.960,58	10.294.934,40	109.570,23	1,01%	2,06%	1,01%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	550.014,97	5.839.296,61	0,00	6.434.833,72	45.522,14	0,71%	2,72%	0,84%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	46.642,27	4.550.521,16	0,00	4.629.202,45	32.039,02	0,70%	2,74%	0,83%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	743.826,29	9.879.917,90	0,00	10.697.146,43	73.402,24	0,69%	2,77%	0,80%

SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	902.759,28	0,00	0,00	907.601,96	4.842,68	0,54%	0,04%	0,54%
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.020.352,51	0,00	0,00	1.025.391,68	5.039,17	0,49%	0,96%	0,49%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.258.974,89	0,00	0,00	2.248.727,14	-10.247,75	-0,45%	0,35%	-0,45%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	9.266,87	0,00	0,00	8.364,97	-901,90	-9,73%	11,23%	-9,73%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>616.688,91</b>	<b>0,92%</b>	<b>1,91%</b>	



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE QUEIMADOS  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/03/2017

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	1.035.341,56	0,00	0,00	1.070.214,39	34.872,83	3,37%	1,24%	3,37%
CONQUEST FIP - FCCQ11	3.807.548,70	0,00	0,00	3.802.571,69	-4.977,01	-0,13%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	3.452.974,45	0,00	0,00	3.445.306,60	-7.667,85	-0,22%	0,00%	0,00%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.300.697,40	0,00	0,00	1.287.252,16	-13.445,24	-1,03%	7,09%	-1,03%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	3.057.551,92	0,00	0,00	2.997.764,04	-59.787,88	-1,96%	8,68%	-1,96%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	1.890.400,35	0,00	0,00	1.847.608,97	-42.791,38	-2,26%	9,15%	-2,26%
				<b>Total Renda Variável</b>	<b>-93.796,53</b>	<b>-0,64%</b>	<b>5,01%</b>	



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE QUEIMADOS  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/03/2017

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre / 2017

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.923.964,94	0,00	1.873.575,87	10.822.582,87	772.193,80	6,78%	6,83%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	11.356.092,97	0,00	1.790.693,69	10.294.934,40	729.535,12	6,74%	6,76%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.441.319,63	0,00	0,00	7.950.260,13	508.940,50	6,84%	6,84%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	9.476.365,65	0,00	9.032.727,10	709.867,39	266.228,84	4,18%	4,29%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.713.963,52	0,00	2.646.674,43	5.314.528,03	247.238,94	3,69%	3,82%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.811.377,86	0,00	4.000.000,00	1.975.111,80	163.733,94	3,79%	3,87%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	427.076,48	10.151.681,23	0,00	10.697.146,43	118.388,72	7,17%	8,37%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	427.015,87	5.927.222,68	0,00	6.434.833,72	80.595,17	7,57%	8,15%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.212.737,42	900.000,00	0,00	3.191.531,69	78.794,27	2,85%	3,09%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.945.757,57	0,00	1.989.296,61	0,00	43.539,04	2,24%	4,05%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	43.483,36	4.550.521,16	0,00	4.629.202,45	35.197,93	8,01%	8,16%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.175.949,42	0,00	1.201.068,25	0,00	25.118,83	2,14%	3,39%
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.005.737,06	0,00	0,00	1.025.391,68	19.654,62	1,95%	1,95%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	593.347,76	0,00	0,00	611.443,81	18.096,05	3,05%	3,05%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	894.138,56	0,00	0,00	907.601,96	13.463,40	1,51%	1,51%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	546.605,54	0,00	558.306,46	0,00	11.700,92	2,14%	3,40%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	326.773,14	0,00	0,00	336.733,73	9.960,59	3,05%	3,05%
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	274.150,40	0,00	0,00	283.825,18	9.674,78	3,53%	3,53%

BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	142.560,41	105.897,59	253.342,37	0,00	4.884,37	1,97%	4,05%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.200,29	0,00	0,00	4.497,76	297,47	7,08%	7,08%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	117.794,02	0,00	105.891,07	8.364,97	-3.537,98	-39,72%	-92,90%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.278.764,35	0,00	0,00	2.248.727,14	-30.037,21	-1,32%	-1,32%
Total Renda Fixa					3.123.662,11	4,79%	



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE QUEIMADOS  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/03/2017

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre / 2017

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.869.194,37	0,00	0,00	2.997.764,04	128.569,67	4,48%	4,48%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.211.230,03	0,00	18.790,19	1.287.252,16	94.812,32	7,88%	6,28%
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	980.970,87	0,00	0,00	1.070.214,39	89.243,52	9,10%	-34,72%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	1.765.101,99	0,00	0,00	1.847.608,97	82.506,98	4,67%	4,67%
ÁQUILLA FII - AQLL11	3.459.142,22	0,00	0,00	3.445.306,60	-13.835,62	-0,40%	0,00%
CONQUEST FIP - FCCQ11	3.818.274,32	0,00	0,00	3.802.571,69	-15.702,63	-0,41%	-
Total Renda Variável					365.594,24	2,59%	

