

Relatórios da Carteira de Investimentos RECIPEV

Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores

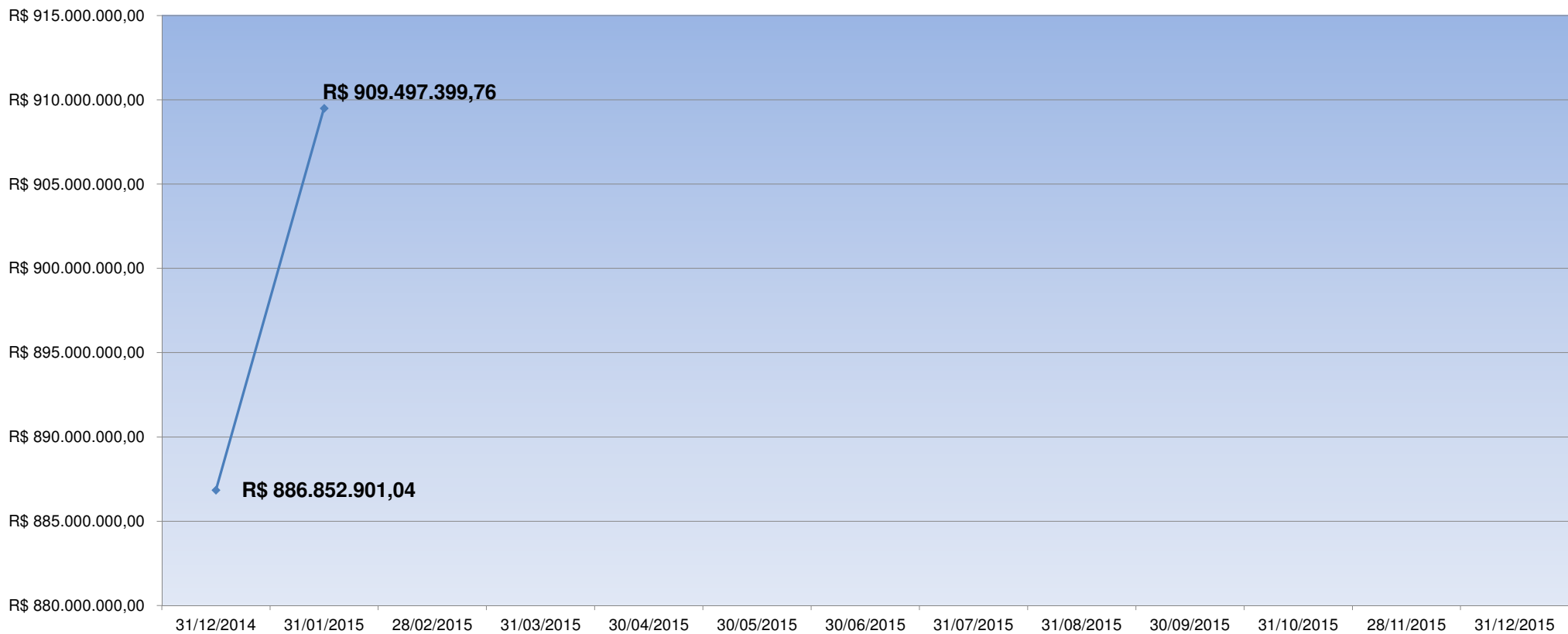
Data da Posição:

30/01/2015

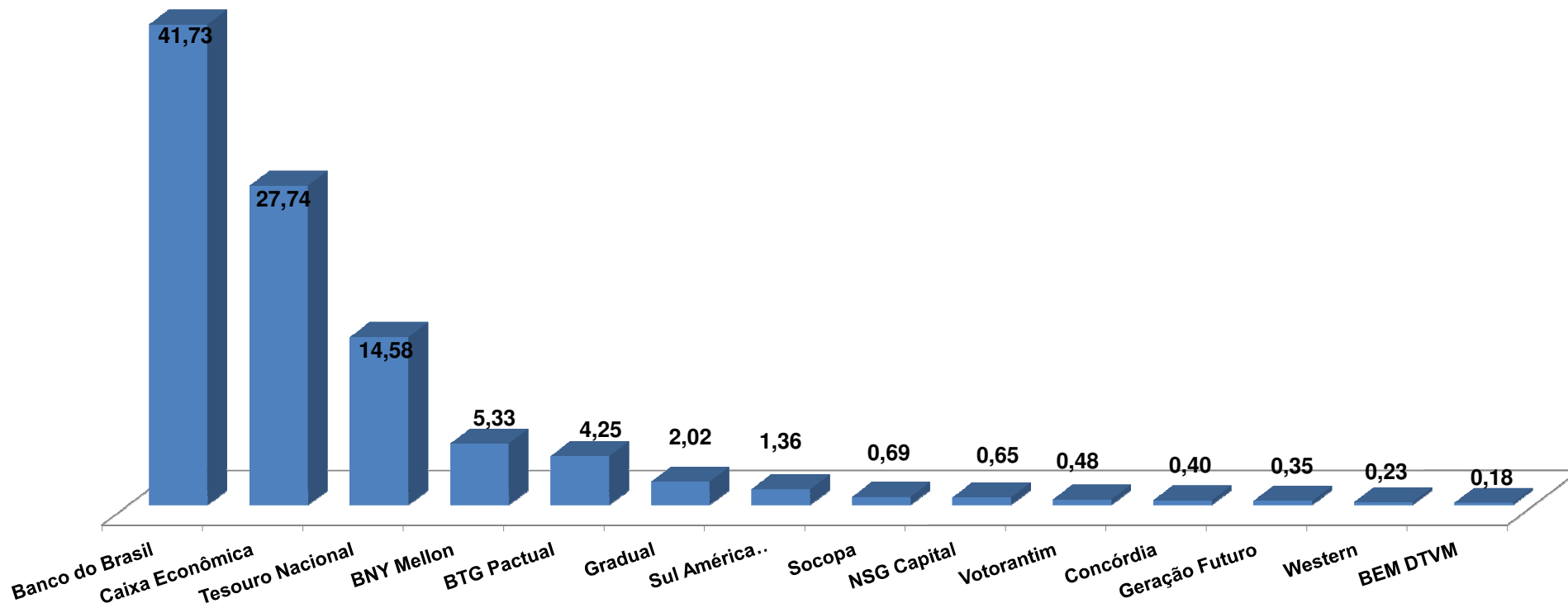
Composição da Carteira de Investimentos RECIPEV (Gestores)		
Renda Fixa		
Banco do Brasil	R\$	363.871.284,86
Caixa Econômica	R\$	240.978.077,58
Tesouro Nacional	R\$	132.625.492,01
Gradual	R\$	13.764.647,49
Nova S.R.M.	R\$	4.586.757,40
Multinvest Capital	R\$	1.400.165,21
Sul América Investimentos	R\$	6.609.466,42
Riviera	R\$	6.260.045,81
TOTAL RF	R\$	770.095.936,78
Renda Variável		
Caixa Econômica	R\$	11.311.732,50
Ático	R\$	16.485.818,55
BTG Pactual	R\$	22.114.550,08
Franklin Templeton	R\$	5.939.772,41
Quest	R\$	5.236.589,61
Xp Investimentos	R\$	10.978.200,15
Banco do Brasil	R\$	7.566.236,24
Set Investimentos	R\$	3.651.857,67
Perfin	R\$	7.653.362,22
Riviera	R\$	6.244.405,75
Humaitá	R\$	5.118.410,44
MHFT	R\$	5.915.440,83
Votorantim	R\$	3.407.884,81
Geração Futuro	R\$	3.208.514,61
ARX	R\$	988.138,15
RB Capital	R\$	917.055,00
BRZ Investimentos	R\$	4.505.032,66
Gávea Investimentos	R\$	1.674.450,22
Western	R\$	2.126.055,06
AZ Legan	R\$	3.611.982,46
Sul América Investimentos	R\$	5.787.437,67
Rio Bravo	R\$	4.958.535,90
TOTAL RV	R\$	139.401.462,99
PATRIMÔNIO	R\$	909.497.399,76

Composição da Carteira de Investimentos RECIPEV (Administradores)		
Renda Fixa		
Banco do Brasil	R\$	363.871.284,86
Caixa Econômica	R\$	240.978.077,58
Tesouro Nacional	R\$	132.625.492,01
Gradual	R\$	18.351.404,89
Sul América Investimentos	R\$	6.609.466,42
BNY Mellon	R\$	1.400.165,21
Socopa	R\$	6.260.045,81
TOTAL RF	R\$	770.095.936,78
Renda Variável		
BNY Mellon	R\$	47.079.518,82
BTG Pactual	R\$	38.616.484,36
Caixa Econômica	R\$	11.311.732,50
Banco do Brasil	R\$	15.705.031,44
Concórdia	R\$	3.651.857,67
NSG Capital	R\$	5.915.440,83
Votorantim	R\$	4.324.939,81
Geração Futuro	R\$	3.208.514,61
Sul América Investimentos	R\$	5.787.437,67
BEM DTVM	R\$	1.674.450,22
Western	R\$	2.126.055,06
TOTAL RV	R\$	139.401.462,99
PATRIMÔNIO	R\$	909.497.399,76

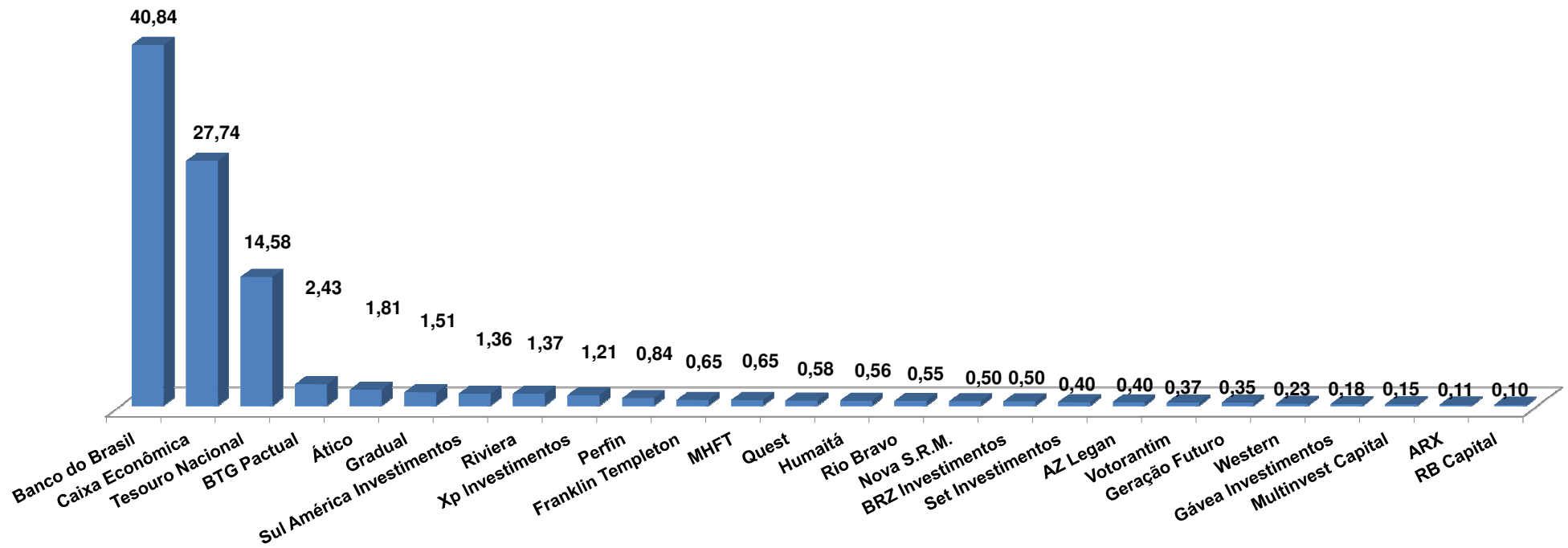
Evolução Mensal do Patrimônio Líquido da Carteira de Investimentos RECIPREV



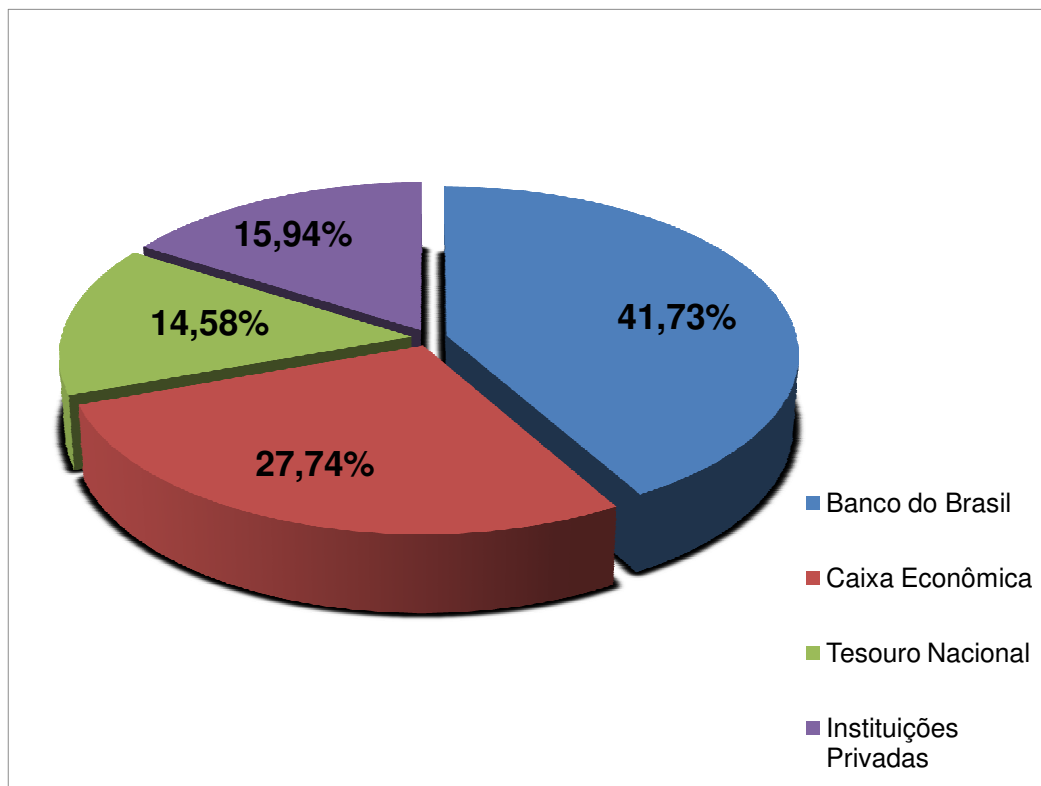
Percentual de Participação das Instituições Administradoras na Carteira RECIPREV



Percentual de Participação das Instituições Gestoras na Carteira RECIPREV

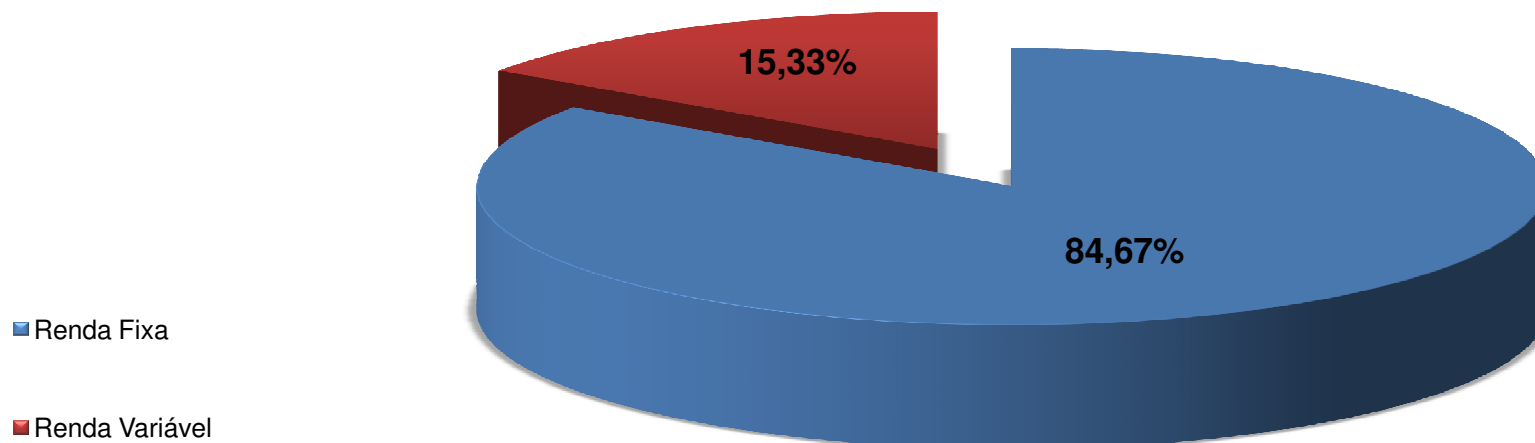


Resumo do Percentual de Participação das Instituições Administradoras na Carteira RECIPREV

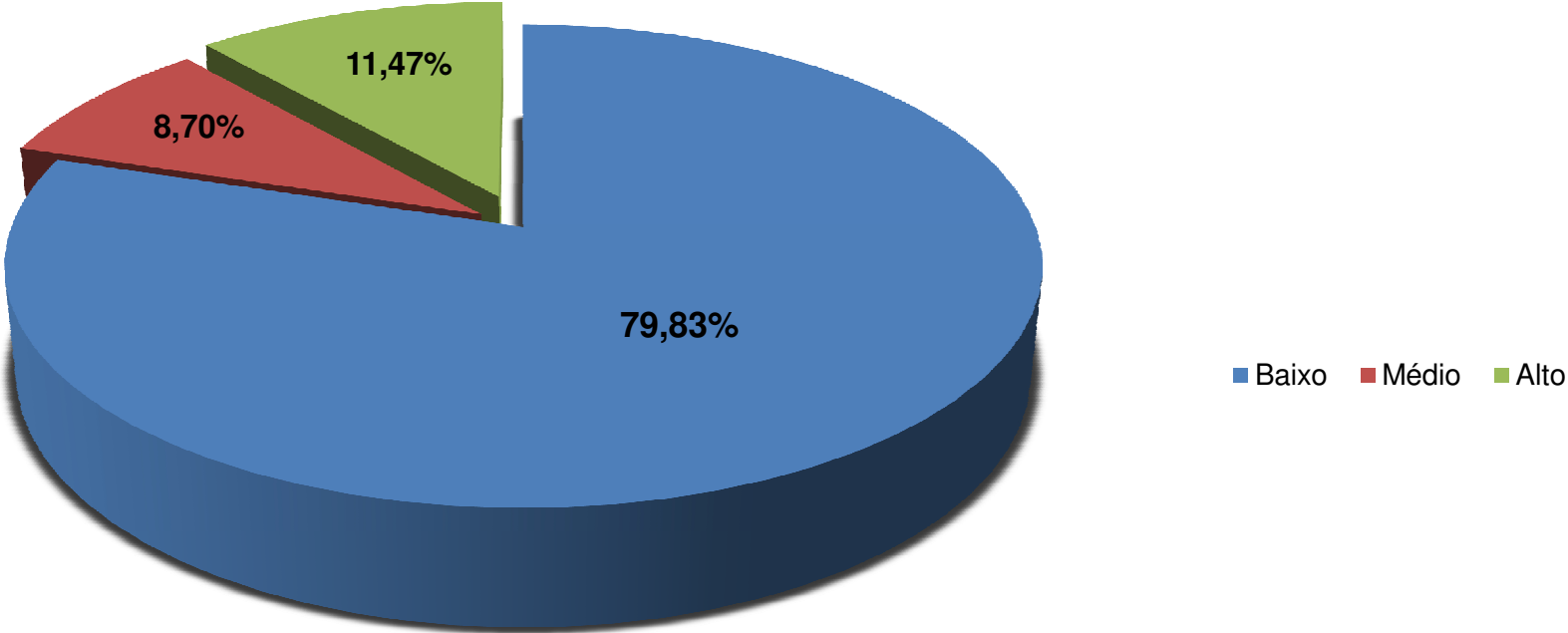


Administrador	
Banco do Brasil	41,73%
Caixa Econômica	27,74%
Tesouro Nacional	14,58%
Instituições Privadas	15,94%
TOTAL	100,00%

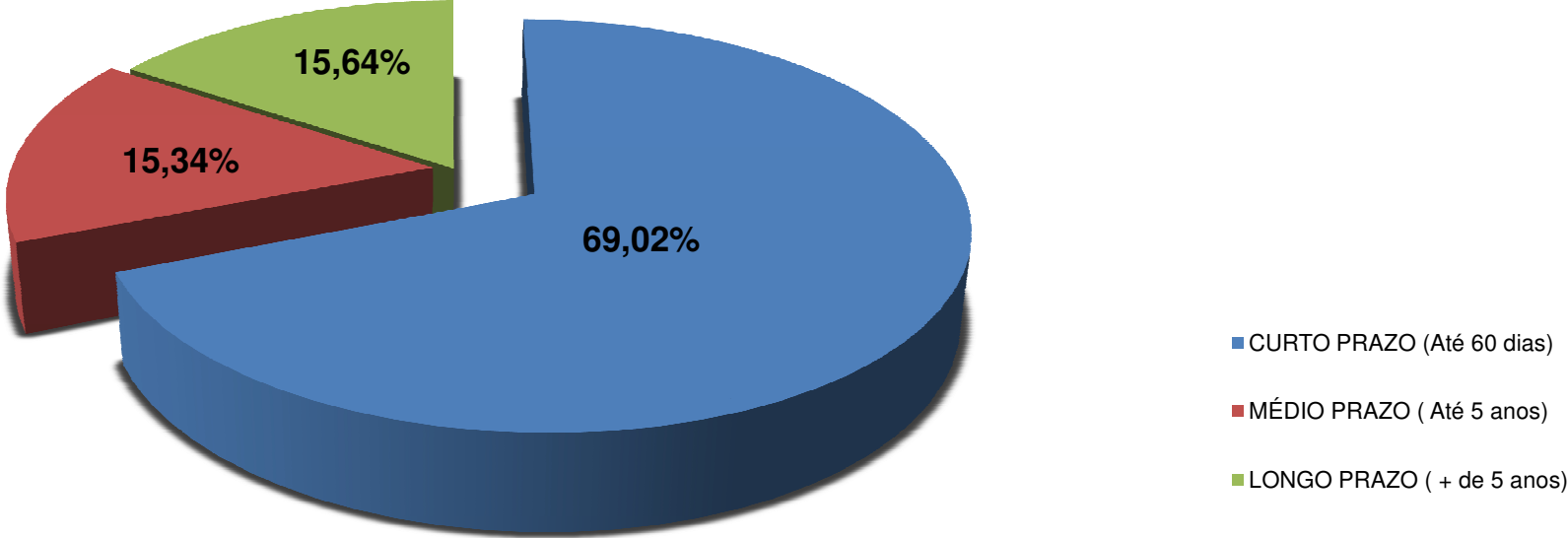
Composição da Carteira de Investimentos RECIPREV Renda Fixa X Renda Variável



Composição por Nível de Risco da Carteira de Investimentos da RECIPREV

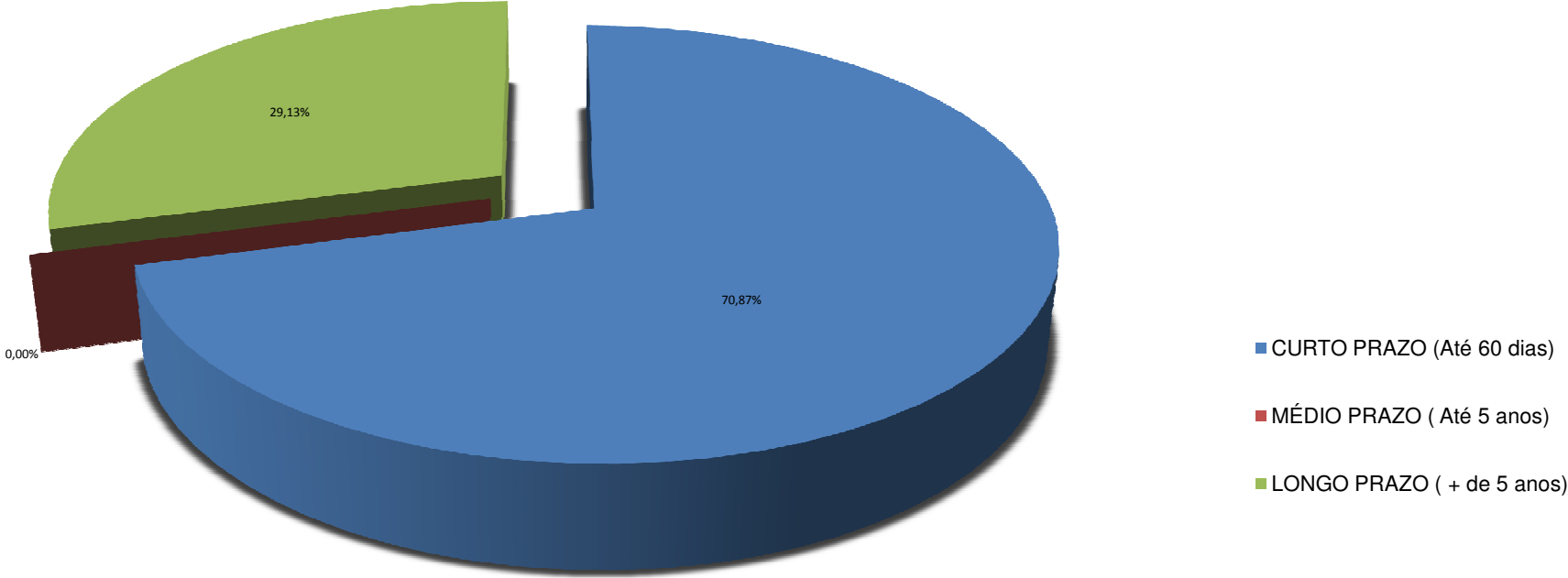


Prazos Gerais de Liquidação da Carteira de Investimentos RECIPREV

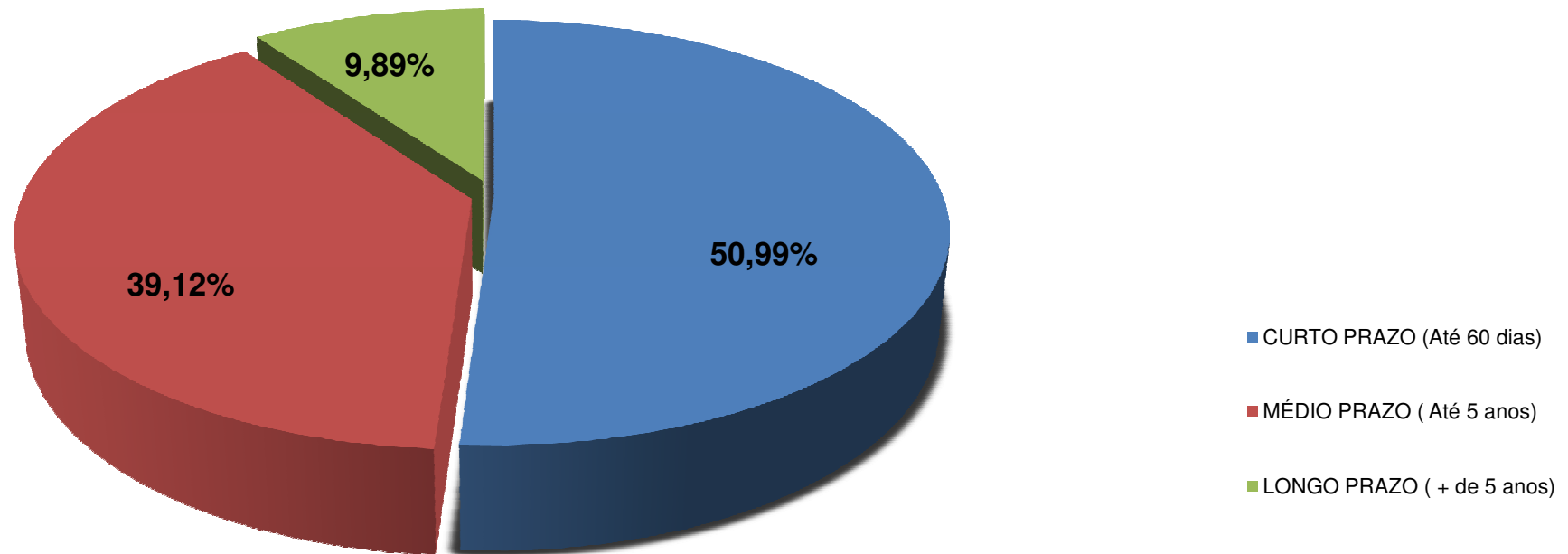


Obs: O prazo de liquidação de cada produto pode ser o mesmo prazo de resgate do produto, depende do regulamento do mesmo. Há produto em que o prazo de resgate pode ser, por exemplo, de 10 anos, no entanto, pode existir a possibilidade de se vender a preço de mercado em pouco tempo, como é o caso dos fundos imobiliários ou NTN-B, etc.

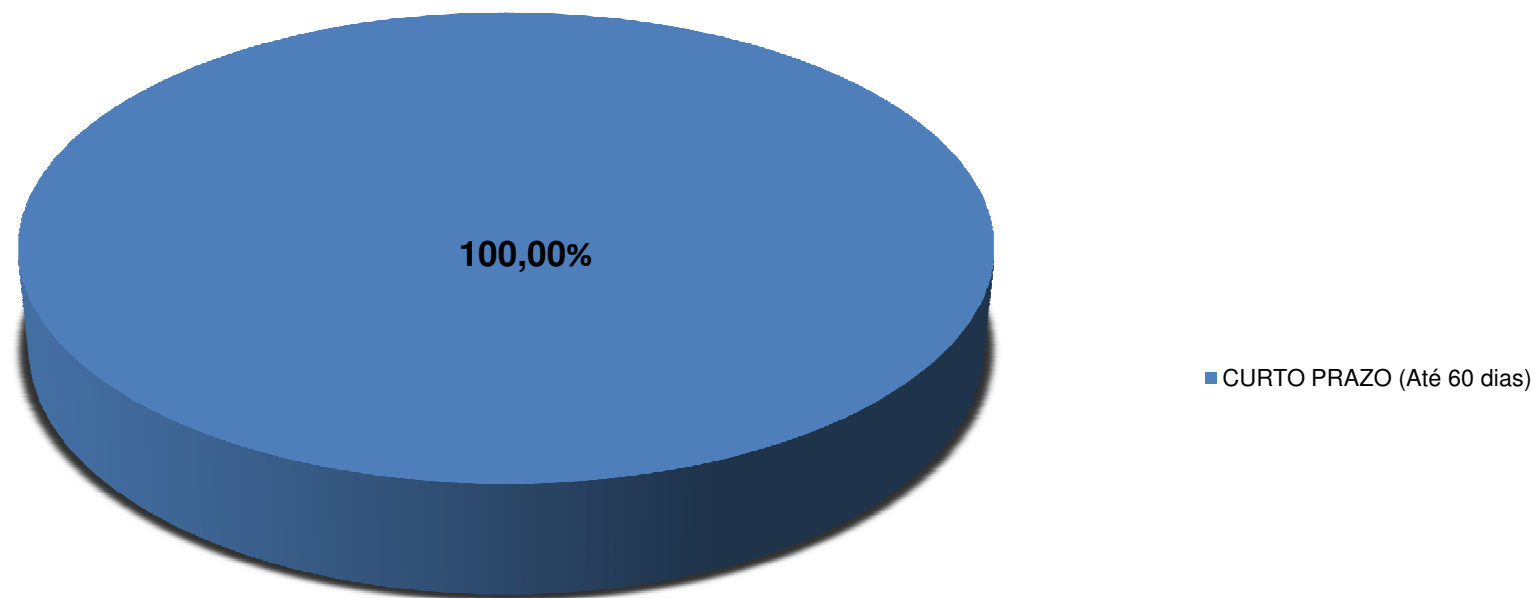
Prazos de Liquidação dos Investimentos: Banco do Brasil S.A.



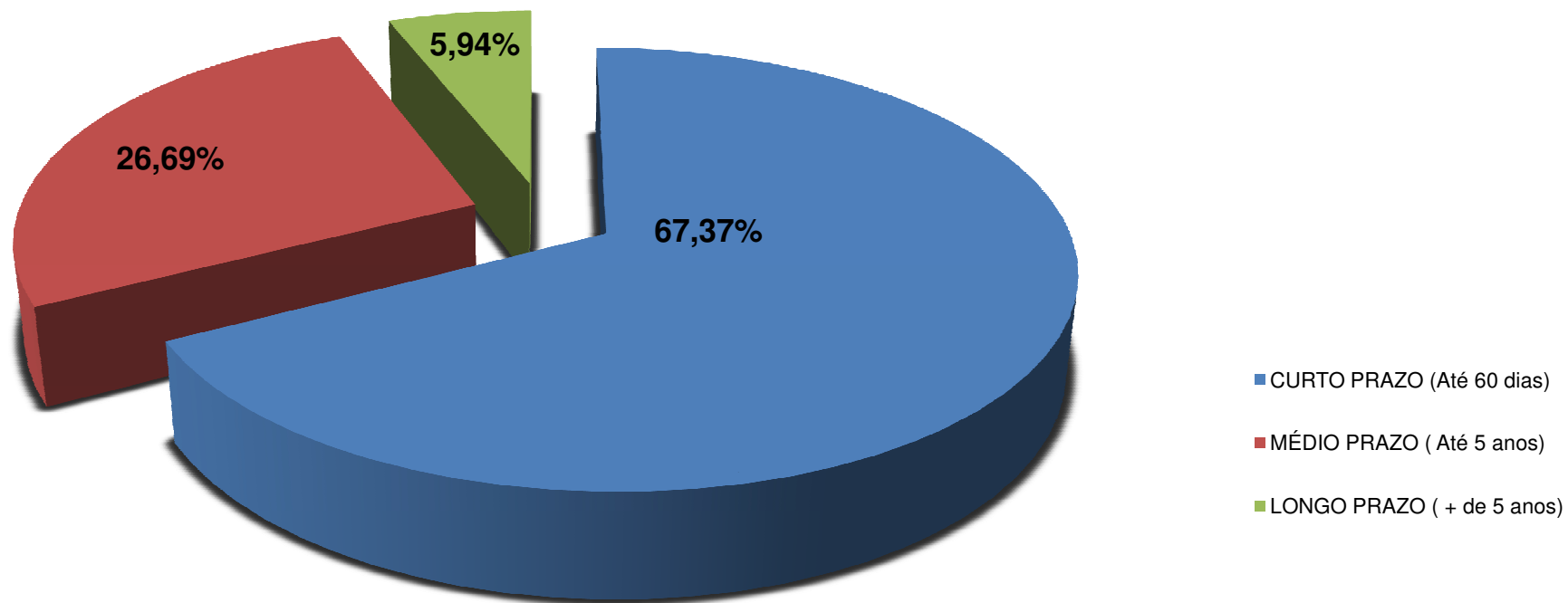
Prazos de Liquidação dos Investimentos : Caixa Econômica Federal



Prazos de Liquidação dos Investimentos : Tesouro Nacional



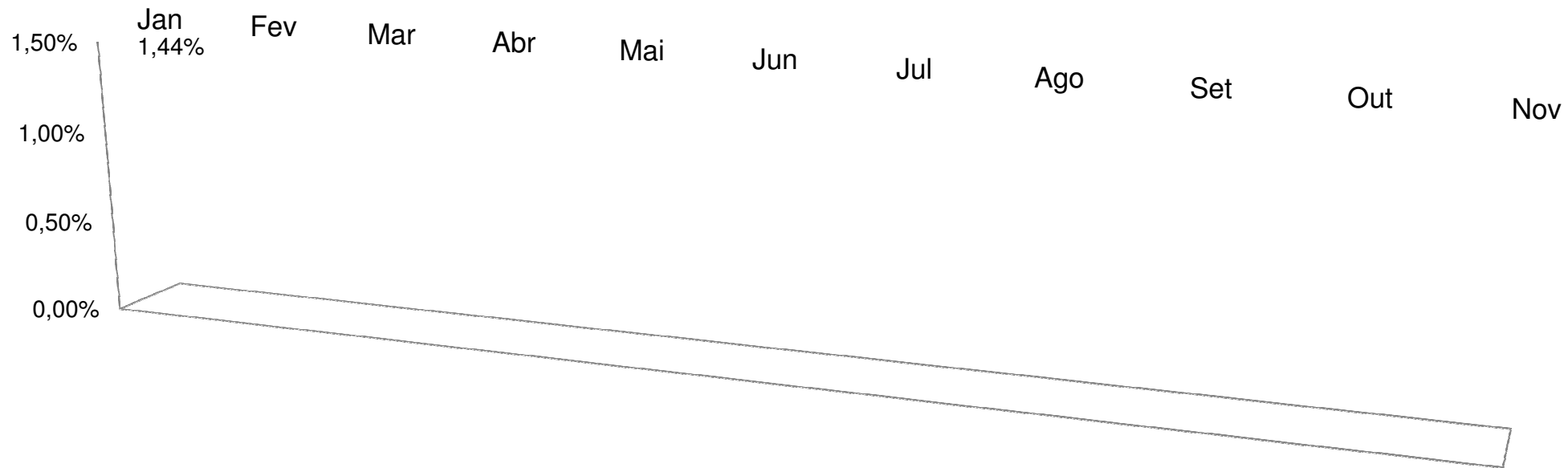
Prazos de Liquidação dos Investimentos : Instituições Privadas



Política de Investimentos

	LIMITES DAS RESOLUÇÕES	CARTEIRA – RECIPREV	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO
RENDA FIXA – ART 7º			
Títulos Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I, "a"	100,00%	14,58%	17,00%
FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b"	100,00%	44,59%	20,00%
Operações Compromissadas - Art. 7º, II	15,00%	0,00%	0,00%
FI Renda Fixa/Referenciados (IMA, IDKA, IRFM,etc) - Art. 7º, III, "a"	80,00%	0,00%	0,00%
FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, "a"	30,00%	20,66%	24,00%
Poupança - Art. 7º, V, "a"	20,00%	0,00%	0,00%
FI em Direitos Creditórios (Cotas Sênior) – Aberto - Art. 7º, VI	15,00%	0,69%	4,00%
FI em Direitos Creditórios (Cotas Sênior) – Fechado - Art. 7º, VII, "a"	5,00%	2,35%	2,80%
FI Renda Fixa "Crédito Privado" - Art. 7º, VII, "b"	5,00%	1,80%	2,20%
TOTAL RENDA FIXA	100,00%	84,67%	70,00%
RENDA VARIÁVEL – ART 8º			
FI Ações referenciados - Art. 8º, I	30,00%	0,21%	3,00%
FI de Índices Referenciados em Ações - Art. 8º, II	20,00%	0,00%	0,00%
FI em Ações - Art. 8º, III	15,00%	6,41%	12,00%
FI Multimercado - aberto - Art. 8º, IV	5,00%	4,20%	5,00%
FI em Participações - fechado - Art. 8º, V	5,00%	2,81%	5,00%
FI Imobiliário - cotas negociadas em bolsa - Art. 8º, VI	5,00%	1,69%	5,00%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	30,00%	15,33%	30,00%
TOTAL		100,00%	100,00%

Rentabilidade Acumulada da Carteira de Investimentos RECIPREV no Período



Acumulado Janeiro a Dezembro 2015: Rentabilidade Carteira X Índices

