

## Relatórios da Carteira de Investimentos RECIPREV

Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores

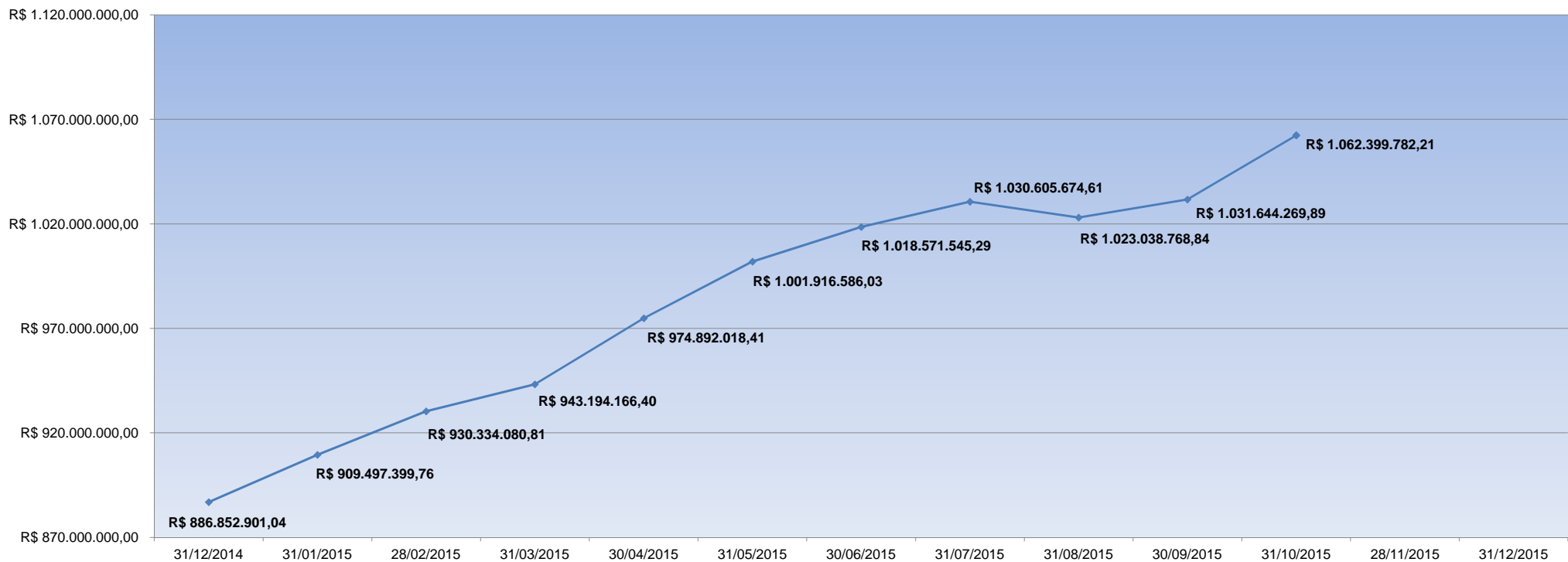
Data da Posição:

30/10/2015

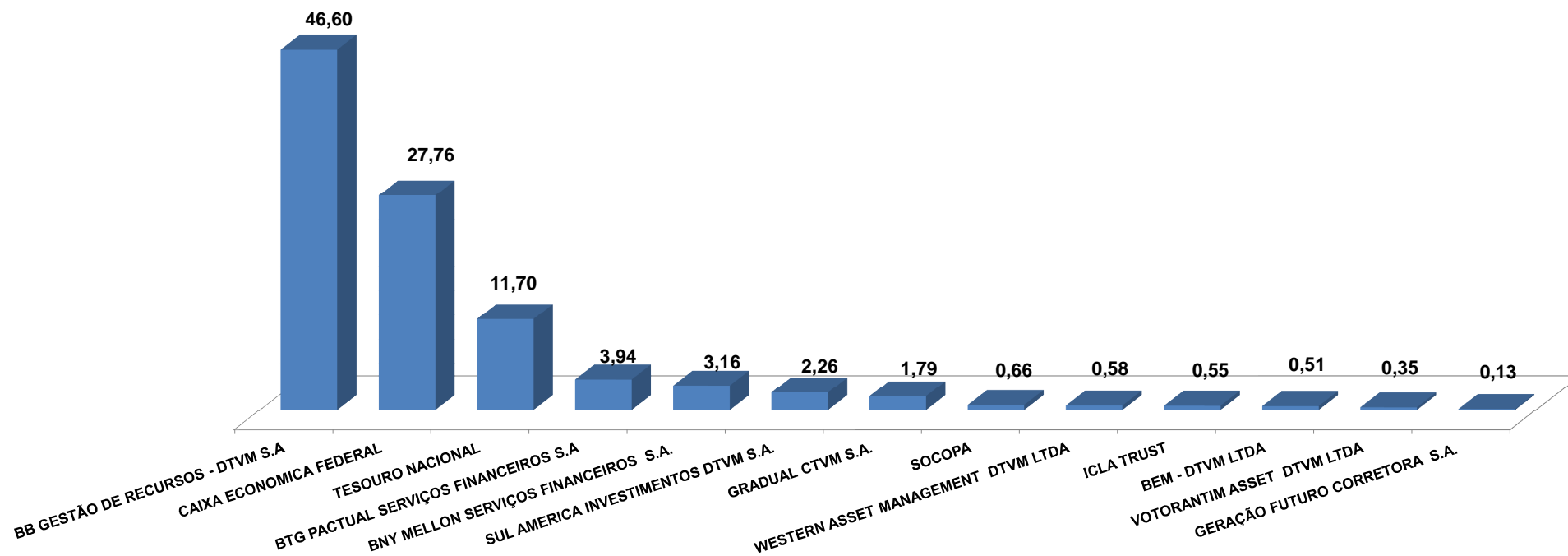
<b>Composição da Carteira de Investimentos RECIPREV (Gestores)</b>			
<b>Renda Fixa</b>			
BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	R\$	482.753.549,17	
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$	282.837.094,80	
TESOURO NACIONAL	R\$	124.301.893,86	
GRADUAL CTVM S.A.	R\$	13.914.928,92	
SUL AMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA S.A.	R\$	11.518.521,41	
RIVIERA GESTORA DE RECURSOS LTDA	R\$	7.001.180,67	
NOVA S R M ADM DE RECURSOS S.A.	R\$	5.128.062,25	
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S.A.	R\$	3.494.538,14	
<b>TOTAL RF</b>	<b>R\$</b>	<b>932.968.243,19</b>	
<b>Renda Variável</b>			
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S.A.	R\$	25.126.548,29	
ÁTICO ADM DE RECURSOS LTDA	R\$	19.128.463,48	
SUL AMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA S.A.	R\$	12.528.901,68	
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$	12.135.169,50	
RIVIERA GESTORA DE RECURSOS LTDA	R\$	6.675.252,19	
XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$	6.445.891,22	
MHFT INVESTIMENTOS S.A.	R\$	5.849.250,93	
WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	R\$	6.111.377,15	
PERFIN ADM DE RECURSOS LTDA	R\$	4.868.516,33	
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	R\$	5.038.318,73	
BRZ INVESTIMENTOS LTDA	R\$	4.491.667,19	
BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	R\$	4.115.531,05	
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$	3.715.679,32	
VOTORANTIM ASSET DTVM LTDA	R\$	3.695.285,05	
AZ LEGAN ADM DE RECURSOS LTDA	R\$	3.362.326,44	
QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	R\$	3.037.647,27	
GÁVEA INVESTIMENTOS LTDA	R\$	1.676.424,86	
GERAÇÃO FUTURO GESTÃO DE RECURSOS S.A.	R\$	1.429.288,34	
<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b>	<b>R\$</b>	<b>129.431.539,02</b>	
<b>PATRIMÔNIO</b>	<b>R\$</b>	<b>1.062.399.782,21</b>	

<b>Composição da Carteira de Investimentos RECIPREV (Administradores)</b>			
<b>Renda Fixa</b>			
BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	R\$	482.753.549,17	
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$	282.837.094,80	
TESOURO NACIONAL	R\$	124.301.893,86	
GRADUAL CTVM S.A.	R\$	19.042.991,17	
SUL AMERICA INVESTIMENTOS DTVM S.A.	R\$	11.518.521,41	
SOCOPA	R\$	7.001.180,67	
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS S.A	R\$	5.513.012,11	
<b>TOTAL RF</b>	<b>R\$</b>	<b>932.968.243,19</b>	
<b>Renda Variável</b>			
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS S.A	R\$	36.395.038,33	
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS S.A.	R\$	33.597.836,55	
BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	R\$	12.297.287,31	
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$	12.135.169,50	
SUL AMERICA INVESTIMENTOS DTVM S.A.	R\$	12.528.901,68	
ICLA TRUST	R\$	5.849.250,93	
WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	R\$	6.111.377,15	
BEM - DTVM LTDA	R\$	5.392.104,18	
VOTORANTIM ASSET DTVM LTDA	R\$	3.695.285,05	
GERAÇÃO FUTURO CORRETORA S.A.	R\$	1.429.288,34	
<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b>	<b>R\$</b>	<b>129.431.539,02</b>	
<b>PATRIMÔNIO</b>	<b>R\$</b>	<b>1.062.399.782,21</b>	

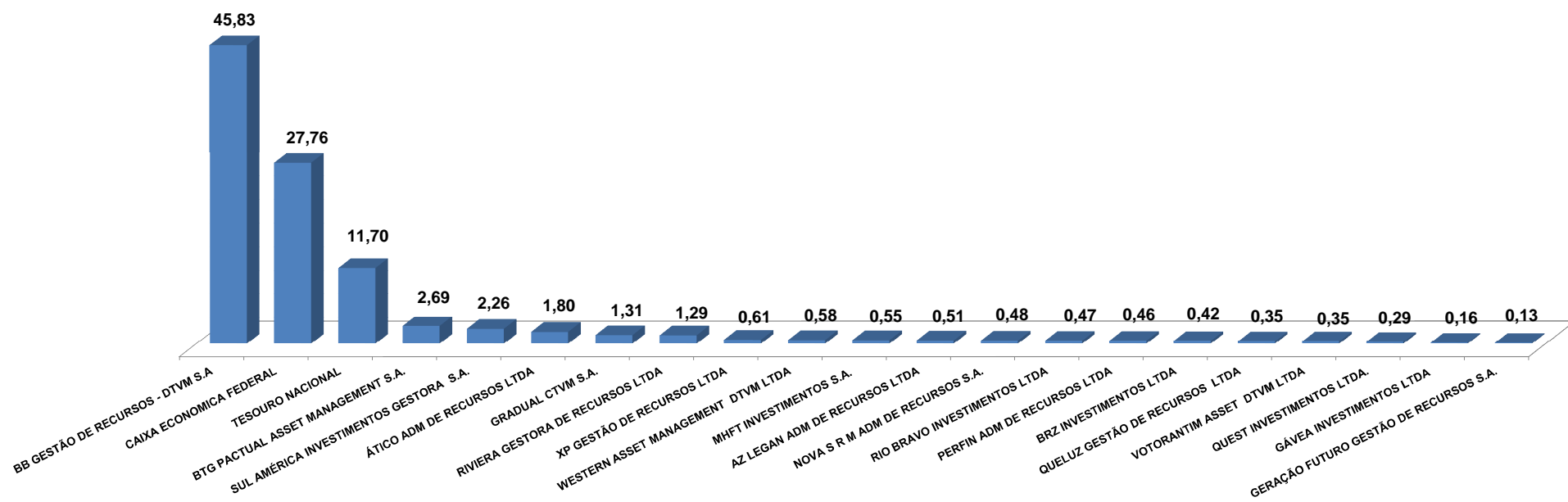
## Evolução Mensal do Patrimônio Líquido da Carteira de Investimentos RECIPREV



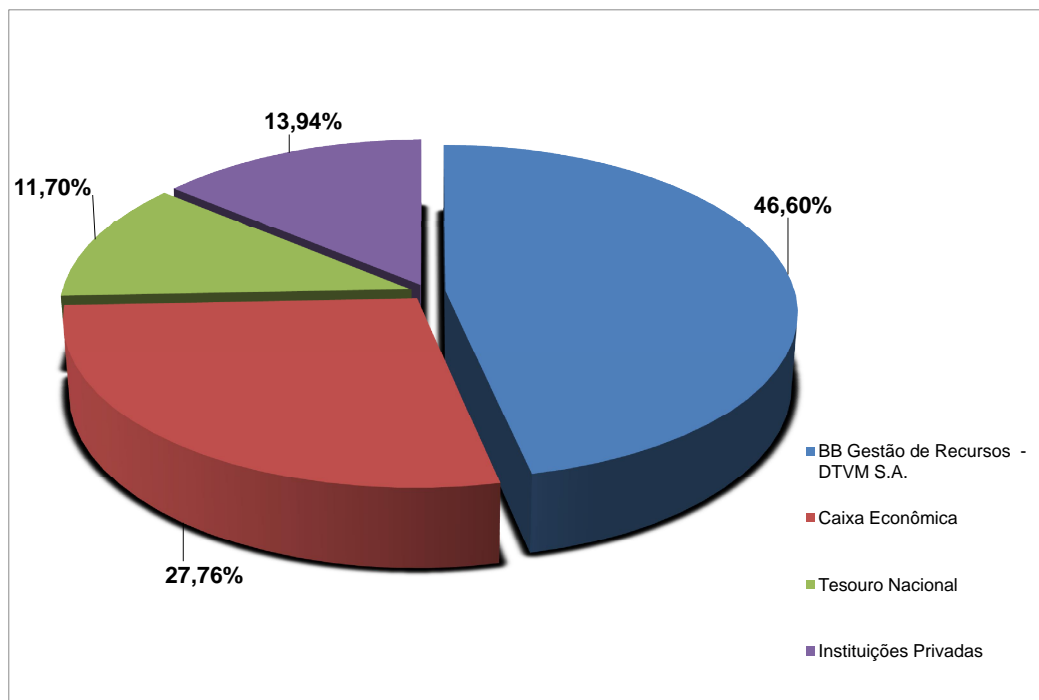
## Percentual de Participação das Instituições Administradoras na Carteira RECIPREV



## Percentual de Participação das Instituições Gestoras na Carteira RECIPEV



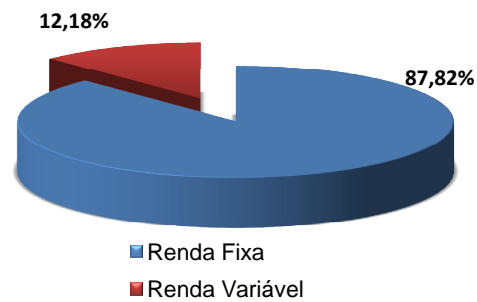
## Resumo do Percentual de Participação das Instituições Administradoras na Carteira RECIPREV



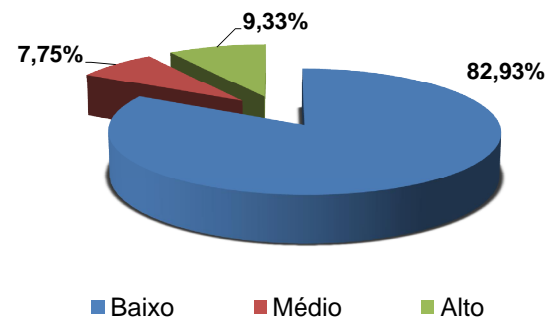
Administrador	
BB Gestão de Recursos - DTVM S.A.	46,60%
Caixa Econômica	27,76%
Tesouro Nacional	11,70%
Instituições Privadas	13,94%
<b>TOTAL</b>	<b>100,00%</b>

## Composição da Carteira de Investimentos RECIPREV

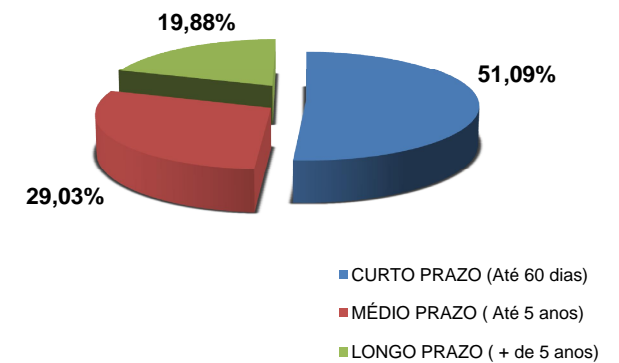
### Renda Fixa X Renda Variável



### Composição por Nível de Risco



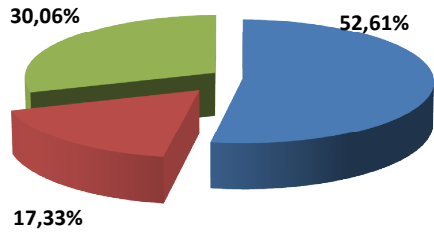
### Prazos Gerais de Liquidação



Prazo de Liquidação: O prazo de liquidação de um produto pode ou não ser igual ao prazo de resgate do mesmo. O prazo de resgate consta do regulamento do produto, já o prazo de liquidação leva em conta a venda do mesmo no mercado secundário, a preço de mercado. Por exemplo, um produto com prazo de resgate de 10 anos, pode ser vendido a preço de mercado em pouco tempo, como é o caso dos fundos imobiliários ou NTN-B, etc.

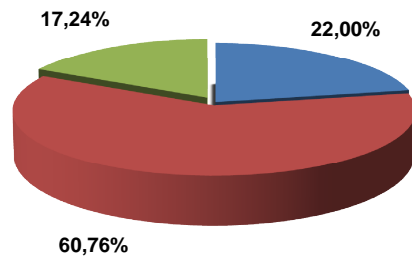
## Prazos de Liquidação da Carteira de Investimentos

BB Gestao de Recursos - DTVM S.A.



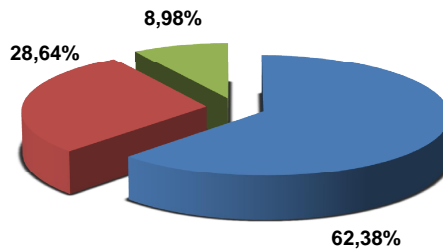
- CURTO PRAZO (Até 60 dias)
- MÉDIO PRAZO (Até 5 anos)
- LONGO PRAZO (+ de 5 anos)

Caixa Econômica Federal



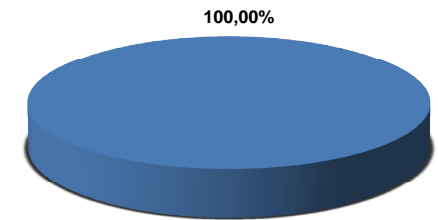
- CURTO PRAZO (Até 60 dias)
- MÉDIO PRAZO (Até 5 anos)
- LONGO PRAZO (+ de 5 anos)

Instituições Privadas



- CURTO PRAZO (Até 60 dias)
- MÉDIO PRAZO (Até 5 anos)
- LONGO PRAZO (+ de 5 anos)

Tesouro Nacional



- CURTO PRAZO (Até 60 dias)

## Política de Investimentos

	LIMITES DAS RESOLUÇÕES	CARTEIRA Ë RECIPREV	ESTRATÉGINA DE ALOCAÇÃO
<b>RENDA FIXA Ë ART 7º</b>			
Títulos Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I, "a"	100,00%	11,70%	17,00%
FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b"	100,00%	44,18%	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%	9,69%	0,00%
FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, "a"	30,00%	17,35%	24,00%
Poupança - Art. 7º, V, "a"	20,00%	0,00%	0,00%
FI em Direitos Creditórios (Cotas Sênior) Ë Aberto - Art. 7º, VI	15,00%	0,66%	4,00%
FI em Direitos Creditórios (Cotas Sênior) Ë Fechado - Art. 7º, VII, "a"	5,00%	2,08%	2,50%
FI Renda Fixa "Crédito Privado" - Art. 7º, VII, "b"	5,00%	2,15%	2,50%
<b>TOTAL RENDA FIXA</b>	<b>100,00%</b>	<b>87,82%</b>	<b>70,00%</b>
<b>RENDA VARIÁVEL Ë ART 8º</b>			
FI Ações referenciados - Art. 8º, I	30,00%	0,00%	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%	4,44%	12,00%
FI Multimercado - aberto - Art. 8º, IV	5,00%	3,70%	5,00%
FI em Participações - fechado - Art. 8º, V	5,00%	2,65%	5,00%
FI Imobiliário - cotas negociadas em bolsa - Art. 8º, VI	5,00%	1,40%	5,00%
<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b>	<b>30,00%</b>	<b>12,18%</b>	<b>30,00%</b>
<b>TOTAL</b>		<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>



## Rentabilidade Acumulada da Carteira de Investimentos RECIPREV

