

Relatórios da Carteira de Investimentos RECIPREV
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores

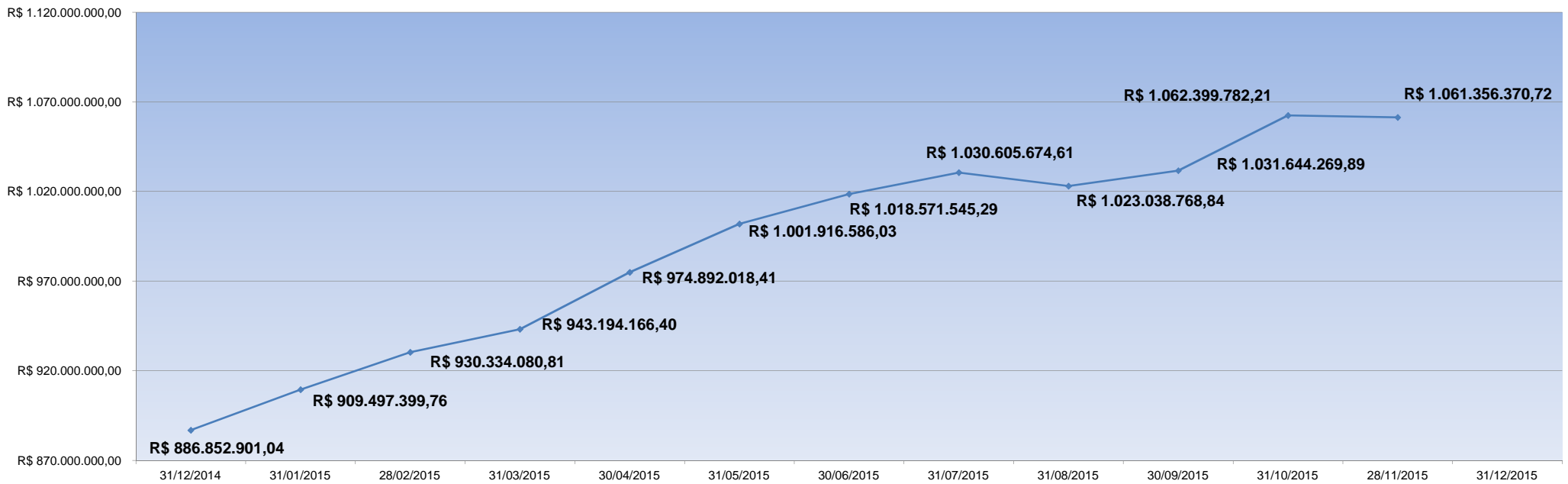
Data da Posição:

30/11/2015

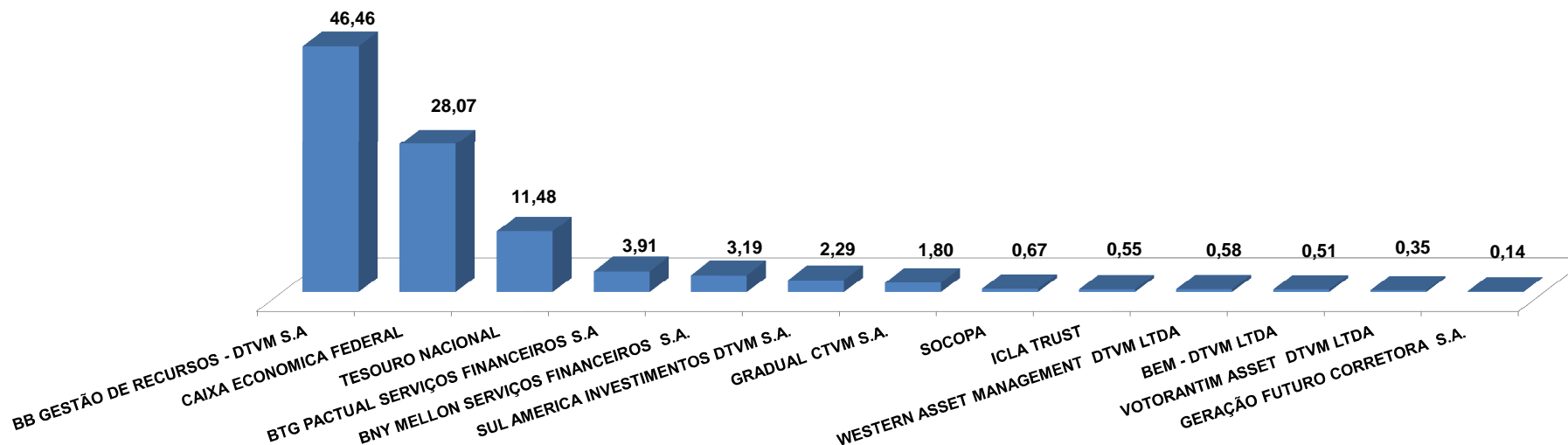
Composição da Carteira de Investimentos RECIPREV (Gestores)		
Renda Fixa		
BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	R\$	480.897.689,73
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$	285.924.393,61
TESOURO NACIONAL	R\$	121.848.713,66
GRADUAL CTVM S.A.	R\$	13.872.605,89
SUL AMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA S.A.	R\$	11.630.188,02
RIVIERA GESTORA DE RECURSOS LTDA	R\$	7.089.943,24
NOVA S R M ADM DE RECURSOS S.A.	R\$	5.193.059,21
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S.A.	R\$	5.062.239,65
TOTAL RF	R\$	933.559.783,15
Renda Variável		
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S.A.	R\$	23.138.648,94
ÁTICO ADM DE RECURSOS LTDA	R\$	19.095.373,13
SUL AMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA S.A.	R\$	12.652.284,60
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$	12.046.470,00
RIVIERA GESTORA DE RECURSOS LTDA	R\$	6.804.154,98
XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$	6.546.865,51
MHFT INVESTIMENTOS S.A.	R\$	5.842.918,01
WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	R\$	6.194.986,15
PERFIN ADM DE RECURSOS LTDA	R\$	4.858.977,57
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	R\$	5.052.756,92
BRZ INVESTIMENTOS LTDA	R\$	4.499.185,98
BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	R\$	4.027.093,71
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$	3.752.705,14
VOTORANTIM ASSET DTVM LTDA	R\$	3.726.965,03
AZ LEGAN ADM DE RECURSOS LTDA	R\$	3.318.622,46
QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	R\$	3.069.188,93
GÁVEA INVESTIMENTOS LTDA	R\$	1.697.317,89
GERAÇÃO FUTURO GESTÃO DE RECURSOS S.A.	R\$	1.472.072,59
TOTAL RV	R\$	127.796.587,57
PATRIMÔNIO	R\$	1.061.356.370,72

Composição da Carteira de Investimentos RECIPREV (Administradores)		
Renda Fixa		
BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	R\$	480.897.689,73
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$	285.924.393,61
TESOURO NACIONAL	R\$	121.848.713,66
GRADUAL CTVM S.A.	R\$	19.065.665,10
SUL AMERICA INVESTIMENTOS DTVM S.A.	R\$	11.630.188,02
SOCOPA	R\$	7.089.943,24
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS S.A	R\$	7.103.189,79
TOTAL RF	R\$	933.559.783,15
Renda Variável		
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS S.A	R\$	34.385.437,91
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS S.A.	R\$	33.805.985,54
BB GESTÃO DE RECURSOS - DTVM S.A	R\$	12.219.444,69
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$	12.046.470,00
SUL AMERICA INVESTIMENTOS DTVM S.A.	R\$	12.652.284,60
ICLA TRUST	R\$	5.842.918,01
WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA	R\$	6.194.986,15
BEM - DTVM LTDA	R\$	5.450.023,04
VOTORANTIM ASSET DTVM LTDA	R\$	3.726.965,03
GERAÇÃO FUTURO CORRETORA S.A.	R\$	1.472.072,59
TOTAL RV	R\$	127.796.587,57
PATRIMÔNIO	R\$	1.061.356.370,72

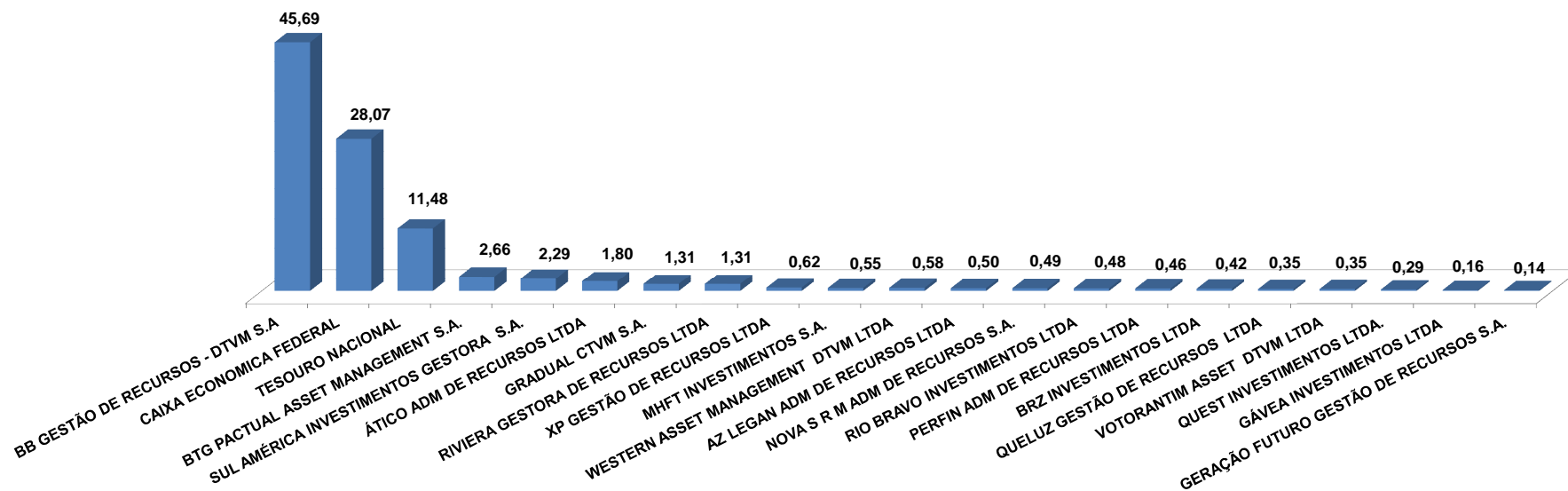
Evolução Mensal do Patrimônio Líquido da Carteira de Investimentos RECIPREV



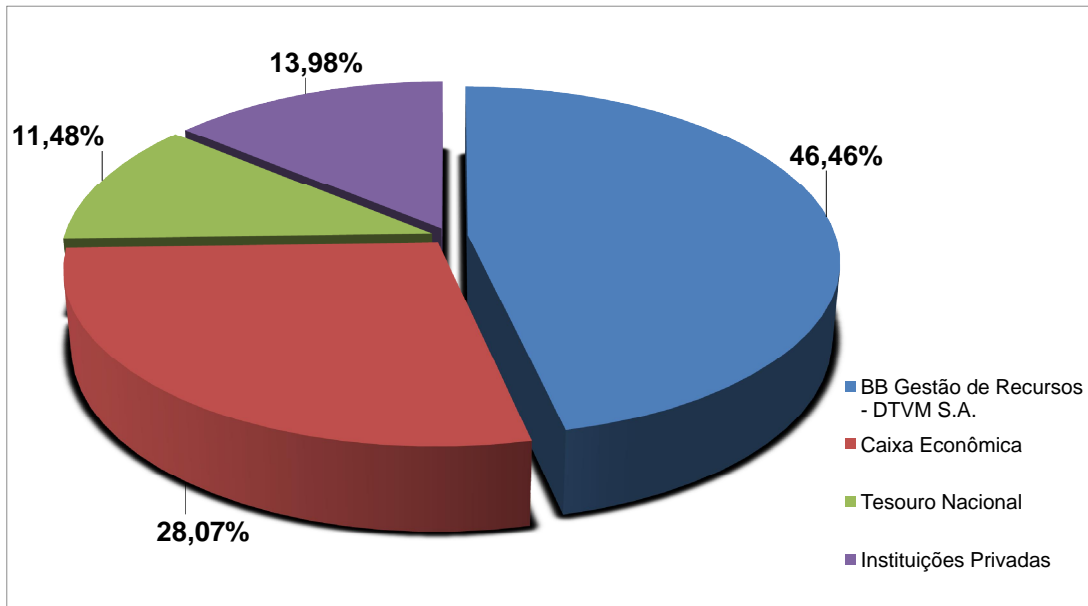
Percentual de Participação das Instituições Administradoras na Carteira RECIPREV



Percentual de Participação das Instituições Gestoras na Carteira RECIPREV



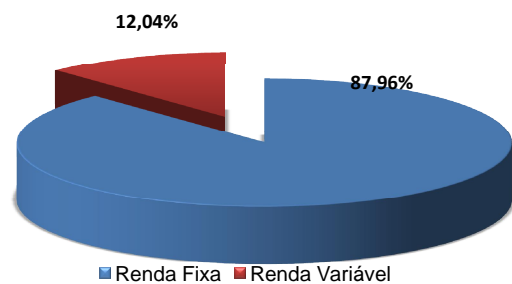
Resumo do Percentual de Participação das Instituições Administradoras na Carteira RECIPREV



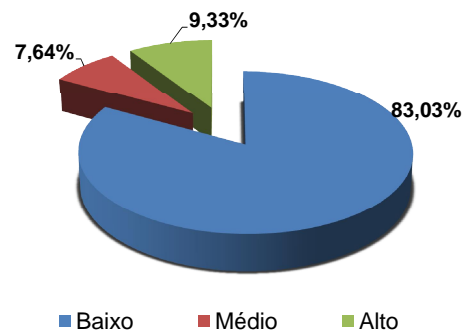
Administrador	
BB Gestão de Recursos - DTVM S.A.	46,46%
Caixa Econômica	28,07%
Tesouro Nacional	11,48%
Instituições Privadas	13,98%
TOTAL	100,00%

Composição da Carteira de Investimentos RECIPREV

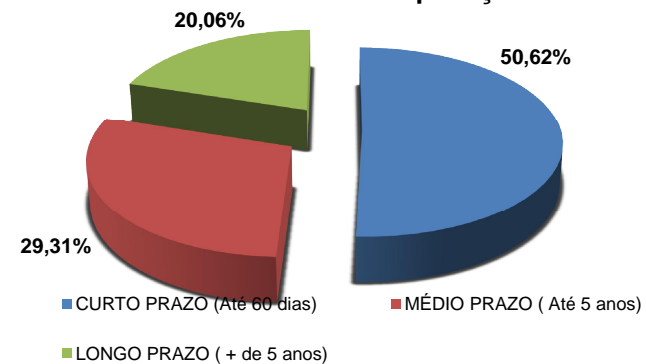
Renda Fixa X Renda Variável



Composição por Nível de Risco



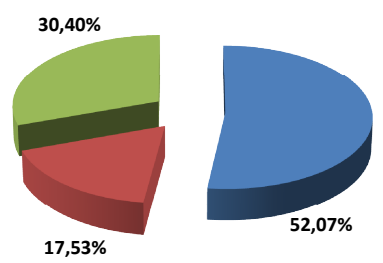
Prazos Gerais de Liquidação



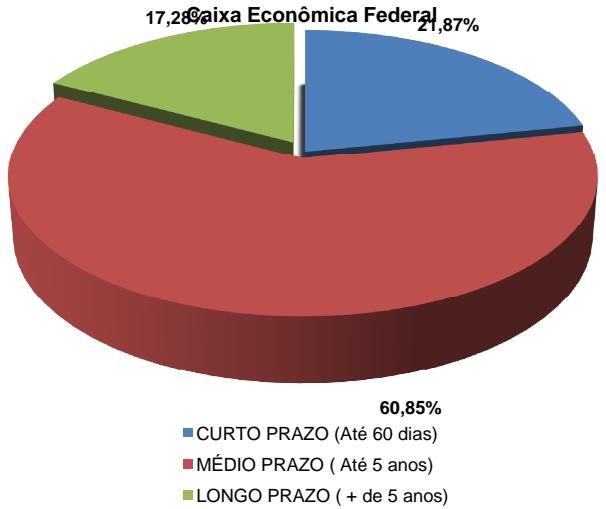
Prazo de Liquidação: O prazo de liquidação de um produto pode ou não ser igual ao prazo de resgate do mesmo. O prazo de resgate consta do regulamento do produto, já o prazo de liquidação leva em conta a venda do mesmo no mercado secundário, a preço de mercado. Por exemplo, um produto com prazo de resgate 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

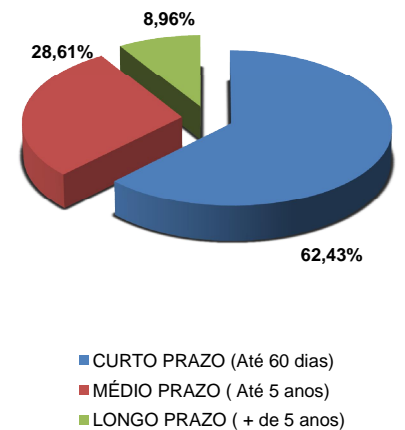
BB Gestão de Recursos - DTVM S.A



Caixa Econômica Federal



Instituições Privadas



Tesouro Nacional



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

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

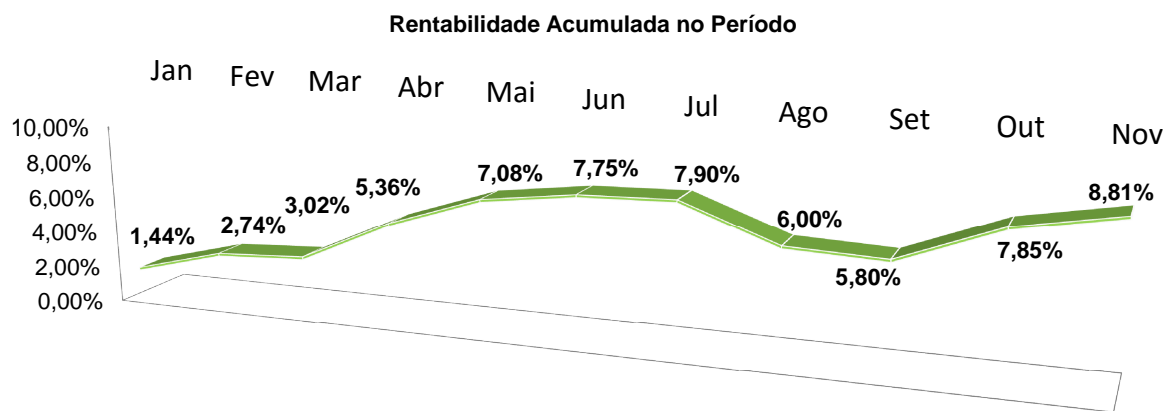
- CURTO PRAZO (Até 60 dias)
- MÉDIO PRAZO (Até 5 anos)
- LONGO PRAZO (+ de 5 anos)

- CURTO PRAZO (Até 60 dias)

Política de Investimentos

	LIMITES DAS RESOLUÇÕES	CARTEIRA Ë RECIPREV	ESTRATÉGINA DE ALOCAÇÃO
RENDA FIXA Ë ART 7º			
Títulos Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I, "a"	100,00%	11,48%	17,00%
FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b"	100,00%	46,26%	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%	8,57%	0,00%
FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, "a"	30,00%	16,72%	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%	0,67%	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%	2,18%	2,50%
TOTAL RENDA FIXA	100,00%	87,96%	70,00%
RENDA VARIÁVEL Ë ART 8º			
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%	4,40%	12,00%
FI Multimercado - aberto - Art. 8º, IV	5,00%	3,60%	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%	1,39%	5,00%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	30,00%	12,04%	30,00%
TOTAL		100,00%	100,00%

Rentabilidade Acumulada da Carteira de Investimentos RECIPREV



Acumulado Janeiro a Dezembro 2015:
Rentabilidade Carteira X Índices

