

Relatórios da Carteira de Investimentos RECIPIREV

Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores

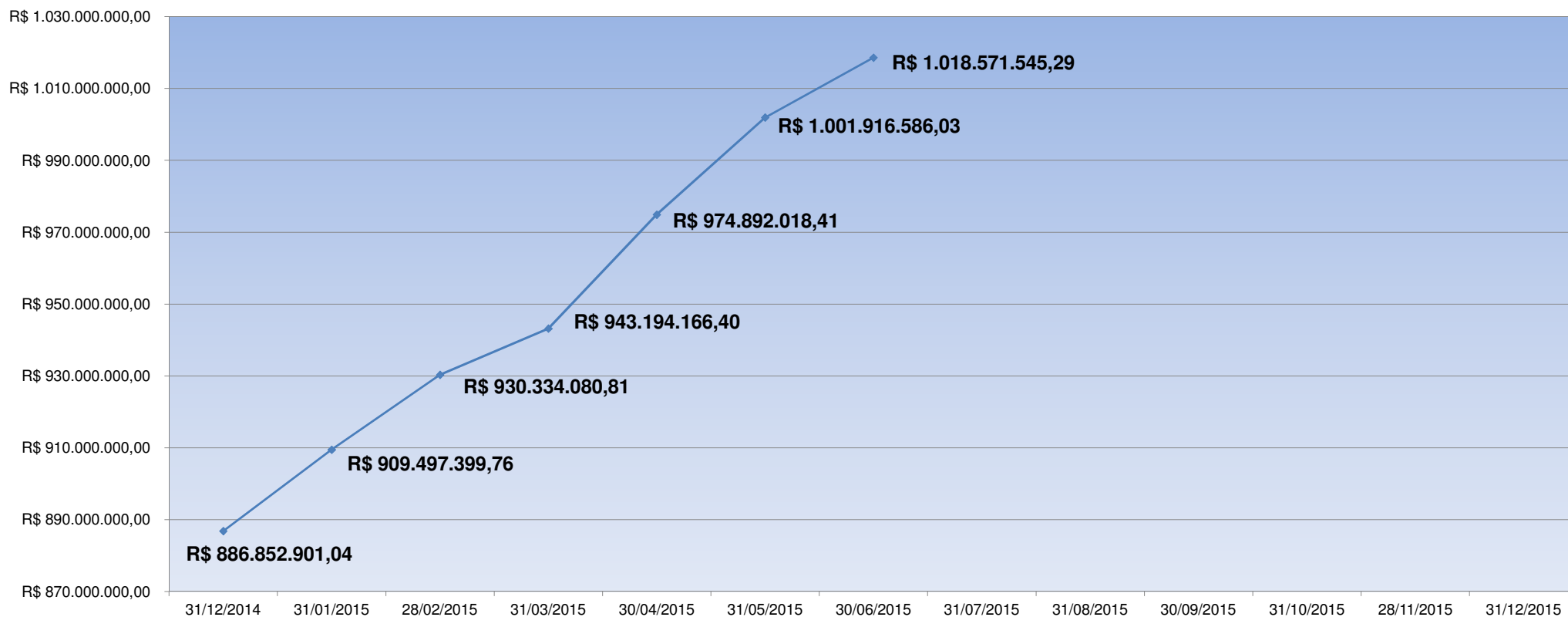
Data da Posição:

30/06/2015

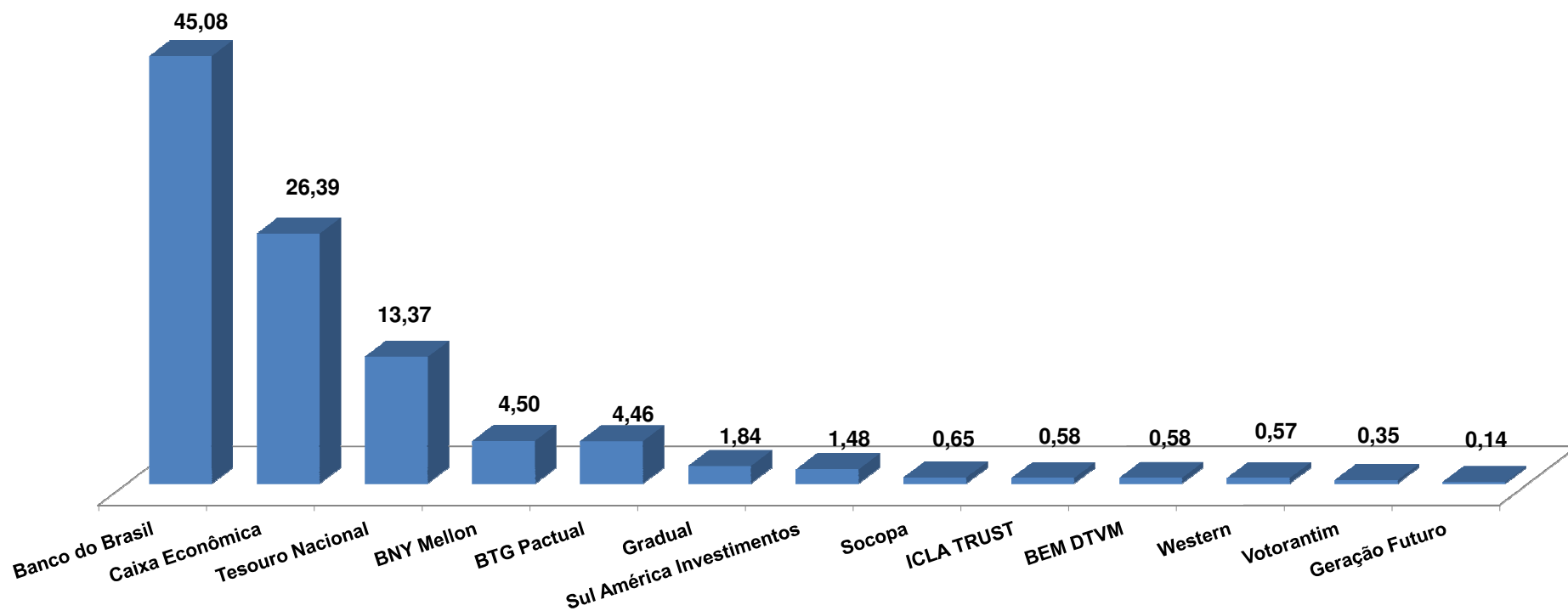
Composição da Carteira de Investimentos RECIPIREV (Gestores)		
Renda Fixa		
Banco do Brasil	R\$	446.553.534,23
Caixa Econômica	R\$	256.979.897,98
Tesouro Nacional	R\$	136.142.352,64
Gradual	R\$	13.872.360,84
Sul América Investimentos	R\$	9.033.052,35
Riviera	R\$	6.633.786,80
Nova S.R.M.	R\$	4.860.070,61
BTG Pactual	R\$	3.572.211,92
Multinvest Capital	R\$	1.469.363,74
TOTAL RF	R\$	879.116.631,13
Renda Variável		
BTG Pactual	R\$	27.104.734,77
Ático	R\$	19.500.997,15
Caixa Econômica	R\$	11.780.419,50
Franklin Templeton	R\$	6.376.289,67
Riviera	R\$	6.418.466,57
Xp Investimentos	R\$	6.147.803,07
Sul América Investimentos	R\$	6.091.490,42
MHFT	R\$	5.876.176,35
Western	R\$	5.826.856,49
Quest	R\$	5.497.191,71
Perfin	R\$	5.334.268,17
Rio Bravo	R\$	5.017.940,06
BRZ Investimentos	R\$	4.613.944,11
Banco do Brasil	R\$	4.473.701,74
Queluz Gestão e Recursos	R\$	4.060.807,50
AZ Legan	R\$	3.933.358,09
Votorantim	R\$	3.594.627,56
Humaitá	R\$	3.384.734,12
Gávea Investimentos	R\$	1.871.663,29
Geração Futuro	R\$	1.456.175,49
ARX	R\$	1.093.268,32
TOTAL RV	R\$	139.454.914,17
PATRIMÔNIO	R\$	1.018.571.545,29

Composição da Carteira de Investimentos RECIPIREV (Administradores)		
Renda Fixa		
Banco do Brasil	R\$	446.553.534,23
Caixa Econômica	R\$	256.979.897,98
Tesouro Nacional	R\$	136.142.352,64
Gradual	R\$	18.732.431,45
Sul América Investimentos	R\$	9.033.052,35
Socopa	R\$	6.633.786,80
BTG Pactual	R\$	3.572.211,92
BNY Mellon	R\$	1.469.363,74
TOTAL RF	R\$	879.116.631,13
Renda Variável		
BNY Mellon	R\$	44.374.838,07
BTG Pactual	R\$	41.869.552,74
Banco do Brasil	R\$	12.652.306,75
Caixa Econômica	R\$	11.780.419,50
Sul América Investimentos	R\$	6.091.490,42
BEM DTVM	R\$	5.932.470,78
ICLA TRUST	R\$	5.876.176,35
Western	R\$	5.826.856,49
Votorantim	R\$	3.594.627,56
Geração Futuro	R\$	1.456.175,49
TOTAL RV	R\$	139.454.914,17
PATRIMÔNIO	R\$	1.018.571.545,29

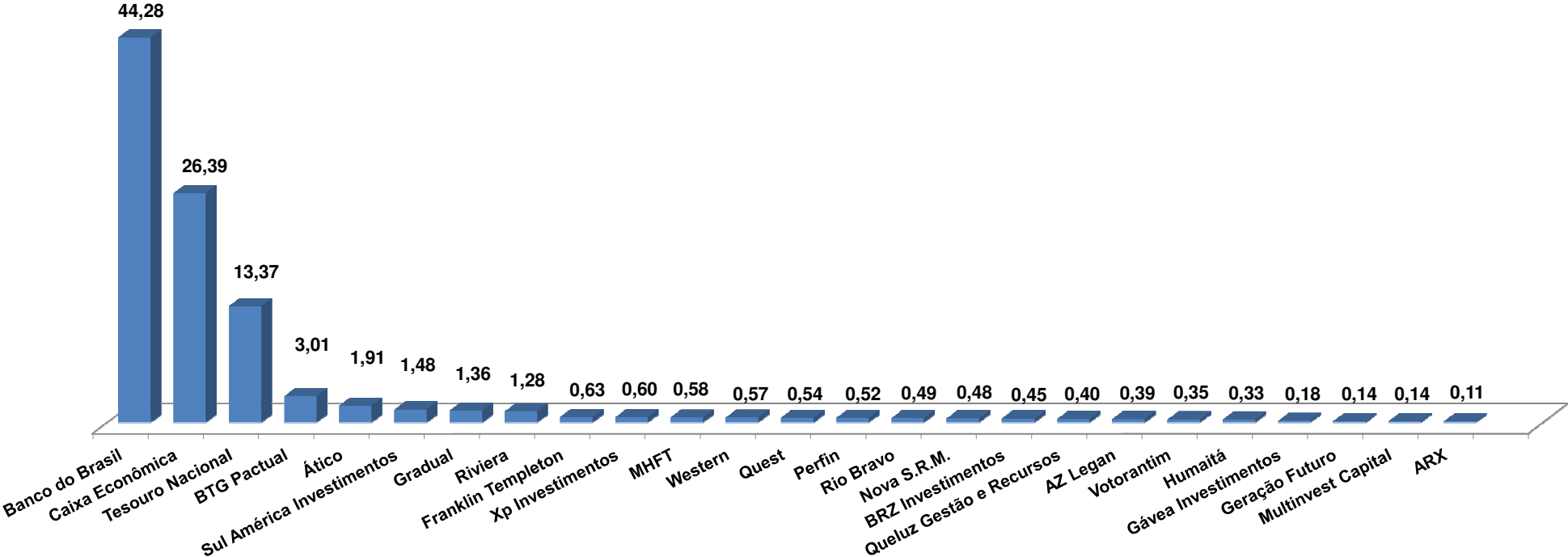
Evolução Mensal do Patrimônio Líquido da Carteira de Investimentos RECIPREV



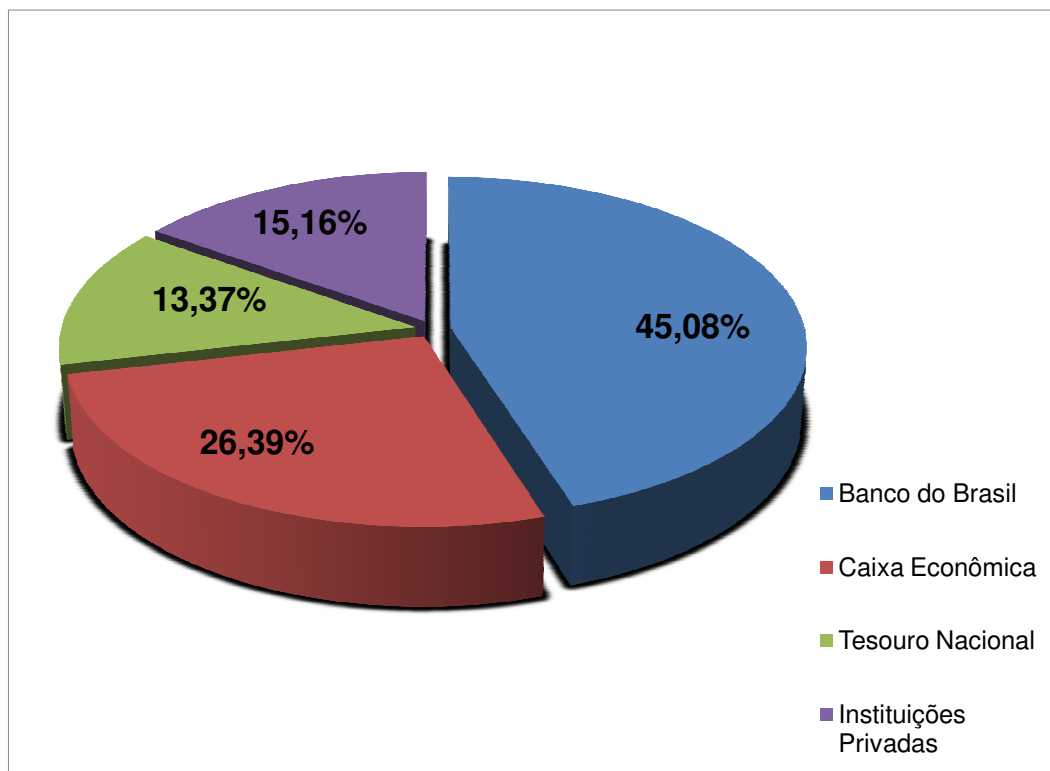
Percentual de Participação das Instituições Administradoras na Carteira RECIPREV



Percentual de Participação das Instituições Gestoras na Carteira RECIPREV



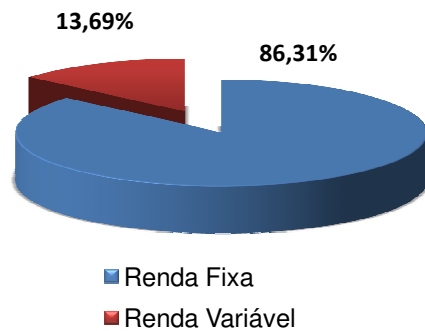
Resumo do Percentual de Participação das Instituições Administradoras na Carteira RECIPREV



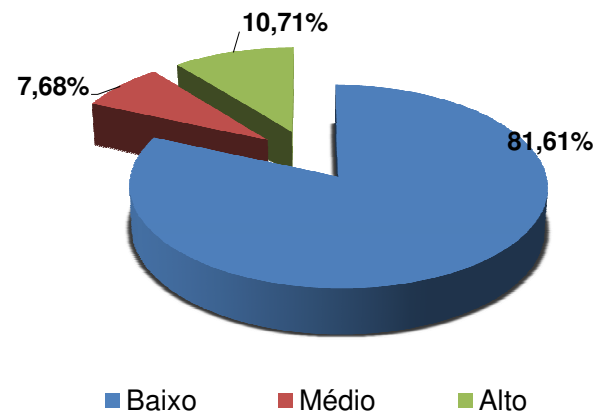
Administrador	
Banco do Brasil	45,08%
Caixa Econômica	26,39%
Tesouro Nacional	13,37%
Instituições Privadas	15,16%
TOTAL	100,00%

Composição da Carteira de Investimentos RECIPREV

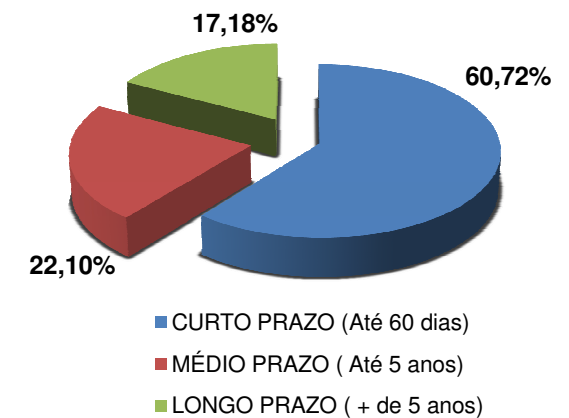
Renda Fixa X Renda Variável



Composição por Nível de Risco

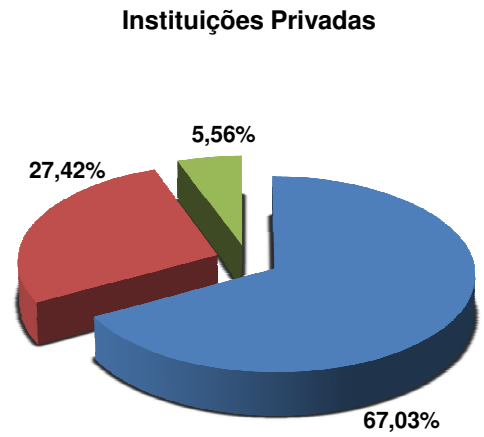
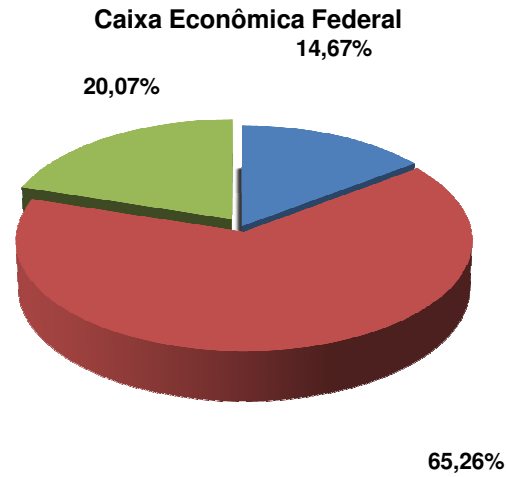
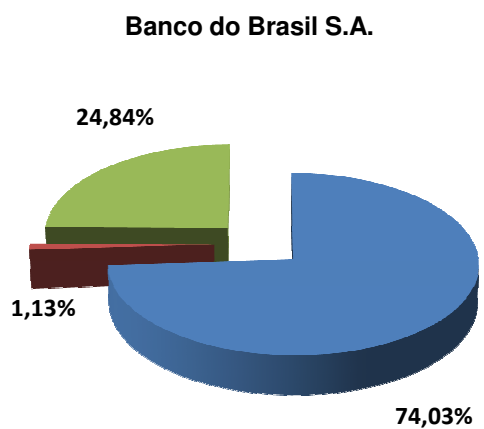


Prazos Gerais de Liquidação



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



■ 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)

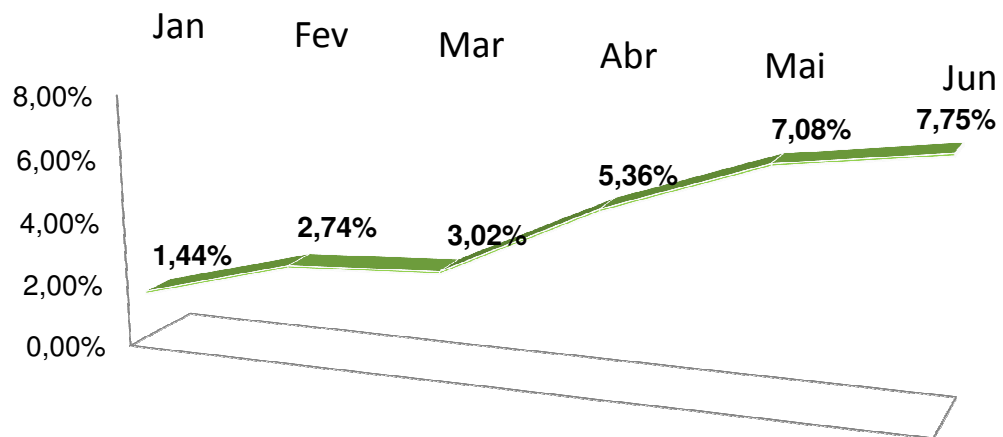
■ CURTO PRAZO (Até 60 dias)

Política de Investimentos

	LIMITES DAS RESOLUÇÕES	CARTEIRA – RECIPREV	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO
RENDA FIXA – ART 7º			
Títulos Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I, "a"	100,00%	13,37%	17,00%
FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b"	100,00%	51,22%	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%	17,02%	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%	0,65%	4,00%
FI em Direitos Creditórios (Cotas Sênior) – Fechado - Art. 7º, VII, "a"	5,00%	2,14%	2,80%
FI Renda Fixa "Crédito Privado" - Art. 7º, VII, "b"	5,00%	1,91%	2,20%
TOTAL RENDA FIXA	100,00%	86,31%	70,00%
RENDA VARIÁVEL – 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%	6,01%	12,00%
FI Multimercado - aberto - Art. 8º, IV	5,00%	3,45%	5,00%
FI em Participações - fechado - Art. 8º, V	5,00%	2,80%	5,00%
FI Imobiliário - cotas negociadas em bolsa - Art. 8º, VI	5,00%	1,43%	5,00%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	30,00%	13,69%	30,00%
TOTAL		100,00%	100,00%

Rentabilidade Acumulada da Carteira de Investimentos RECIPREV

Rentabilidade Acumulada no Período



Acumulado Janeiro a Dezembro 2015:
Rentabilidade Carteira X Índices

