



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE PALMAS - PREVIPALMAS

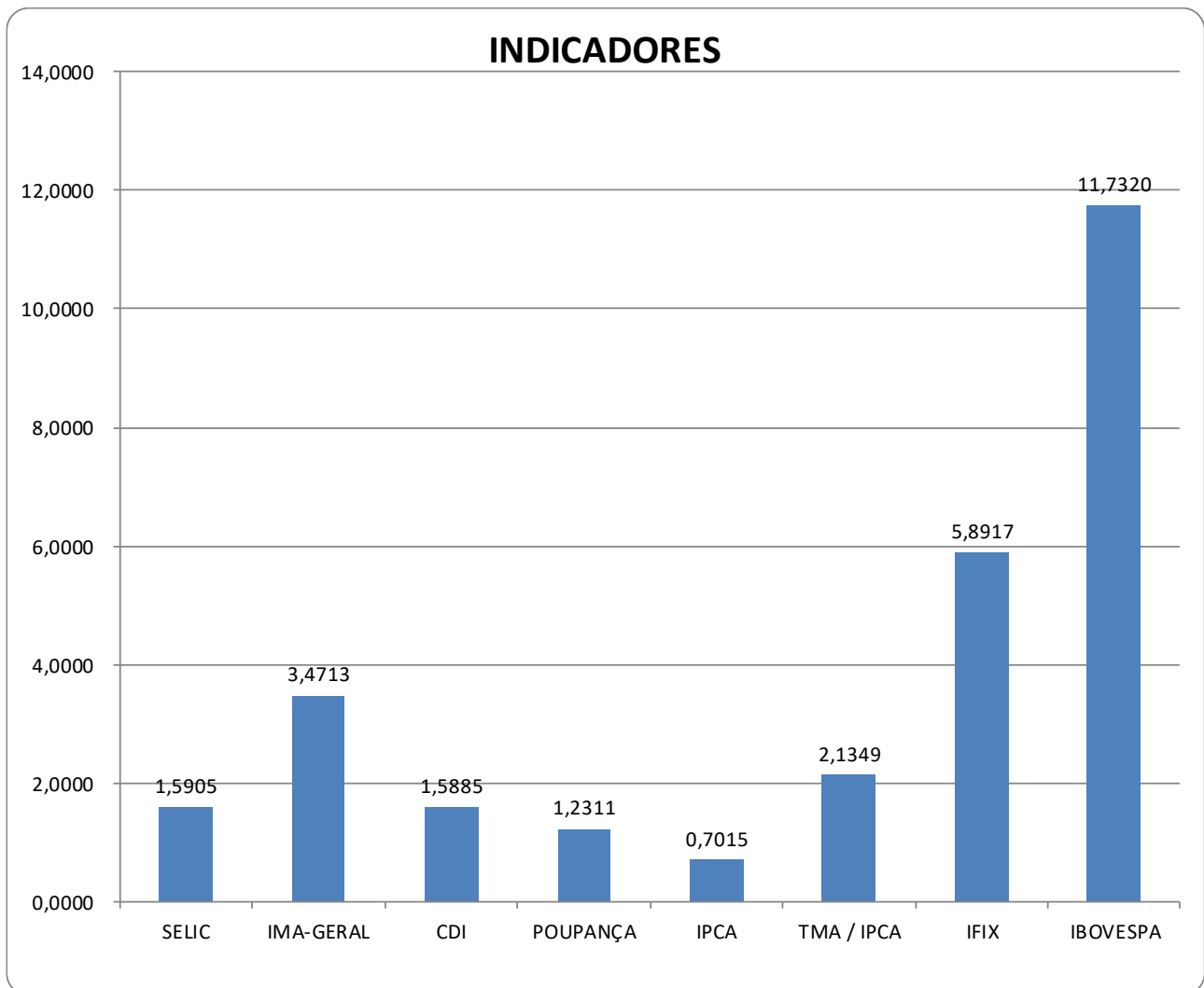
PREVIPALMAS

RELATÓRIO MENSAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS – MARÇO/2018

Palmas - Tocantins

INDICADORES FINANCEIROS

REFERÊNCIA	SELIC	IMA-GERAL	CDI	POUPANÇA	IPCA	TMA / IPCA	IFIX	IBOVESPA
jan/18	0,5842	1,7560	0,5833	0,4273	0,2900	0,8000	2,6396	11,1393
fev/18	0,4656	0,7164	0,4649	0,3994	0,3200	0,7400	1,1456	0,5192
mar/18	0,5323	0,9624	0,5320	0,3994	0,0900	0,5800	2,0000	0,0140
abr/18								
mai/18								
jun/18								
jul/18								
ago/18								
set/18								
out/18								
nov/18								
dez/18								
Acumulado 2018	1,5905	3,4713	1,5885	1,2311	0,7015	2,1349	5,8917	11,7320



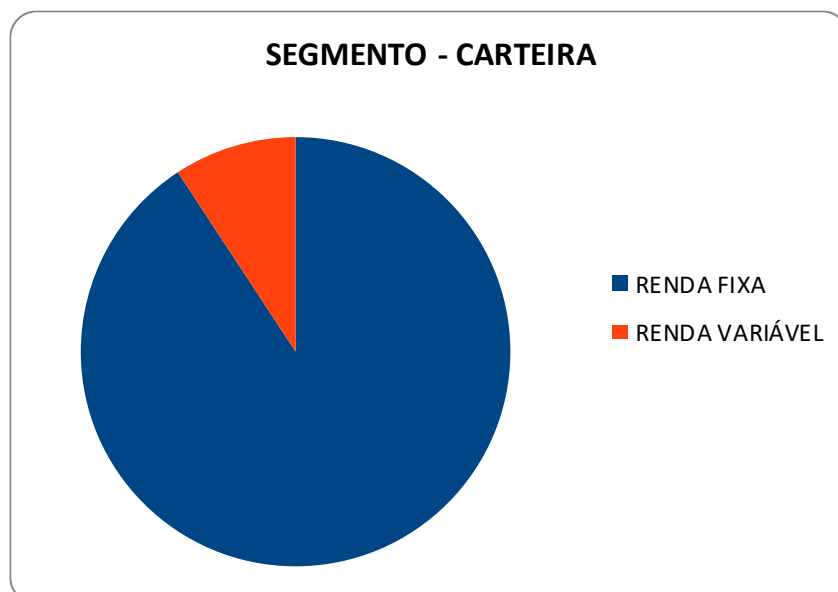
RELATÓRIO MENSAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

MARÇO – DATA BASE 29/03/2018.

Ativos em R\$	Carteira %	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	15,80%	104.312.866,03	154.470,30	0,00	105.134.662,22
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	1,03%	6.841.577,49	0,00	0,00	6.885.305,58
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	2,68%	17.552.032,18	0,00	0,00	17.818.115,83
CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TP RF	21,43%	140.367.861,94	0,00	0,00	142.613.157,10
CAIXA FI BRASIL 2024 IV TP RF	2,17%	14.105.622,84	0,00	0,00	14.414.739,42
BB PREVID RF IDKA 2A	17,54%	114.974.782,37	0,00	0,00	116.678.968,87
BB PREVID RF IMA-B 5	10,26%	67.193.201,52	0,00	0,00	68.269.852,66
FIC CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RF LP	4,95%	32.632.940,21	0,00	0,00	32.929.803,73
FIC CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RF LP	0,40%	2.646.407,98	0,00	0,00	2.670.482,49
BB PREVID RF PERFIL FIC	12,30%	81.364.210,08	0,00	0,00	81.803.227,11
BB PREVID RF FLUXO FIC	2,20%	3.179.631,96	13.298.169,57	1.857.454,36	14.669.269,16
CX FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA	1,24%	8.092.813,85	0,00	0,00	8.249.225,19
TERCON FIC FI MM CP	3,14%	20.649.795,82	0,00	0,00	20.877.018,38
FIP CAIS MAUA DO BRASIL	4,49%	29.914.804,91	0,00	0,00	29.887.948,53
RB CAPITAL RENDA II FI IMOBILIÁRIO	0,37%	2.307.586,16	0,00	13.262,14	2.428.470,00
Total	100,00%	646.136.135,34	13.452.639,87	1.870.716,50	665.330.246,27
FUNDO ADMINISTRATIVO		1.321.162,74	0,00	408.403,77	918.329,64

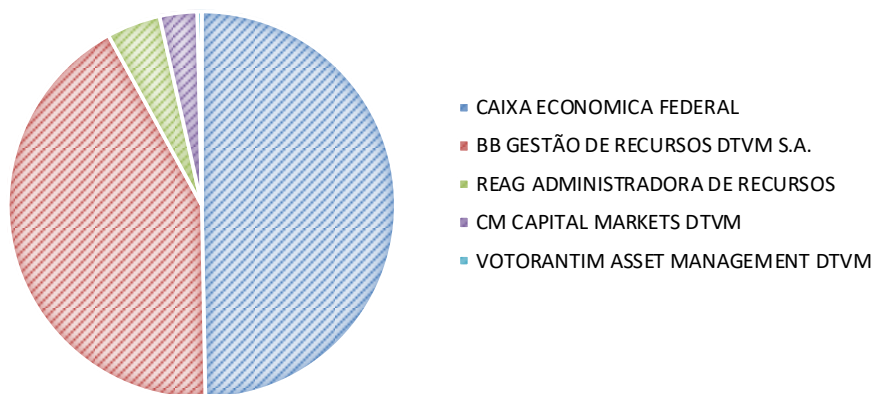
DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR SEGMENTO:

SEGMENTO	SALDO EM 29/03/2018 (R\$)	PARTICIPAÇÃO (%)
RENDA FIXA	603.887.584,17	90,77
RENDA VARIÁVEL	61.442.662,10	9,23
TOTAL	665.330.246,27	100,00

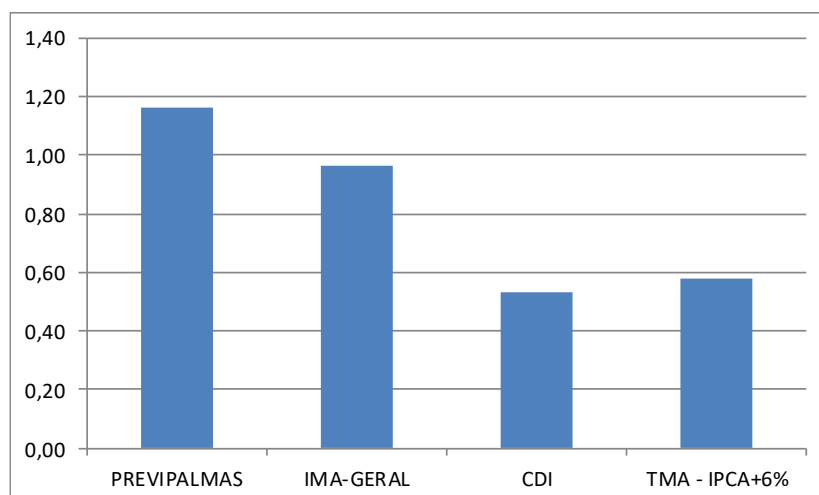


DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ADMINISTRADOR:

ADMINISTRADORES	SALDO EM 29/03/2018 (R\$)	PARTICIPAÇÃO (%)
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	330.715.491,56	49,71
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.	281.421.317,80	42,30
REAG ADMINISTRADORA DE RECURSOS	29.887.948,53	4,49
CM CAPITAL MARKETS DTVM	20.877.018,38	3,14
VOTORANTIM ASSET MANAGEMENT DTVM	2.428.470,00	0,37
TOTAL	665.330.246,27	100,00

ADMINISTRADORES - CARTEIRA

RENTABILIDADE DA CARTEIRA:
CARTEIRA CONSOLIDADA

Rentabilidades (Em % - TIR)	No Mês	% IMA-G	% CDI	% TMA	No ano	% IMA-G	% CDI	% TMA
Carteira	1,16	120,92	218,74	200,64	2,84	81,68	178,50	132,81
IMA-GERAL	0,96	100,00	180,90	165,93	3,47	100,00	218,53	162,60
CDI	0,53	55,28	100,00	91,72	1,59	45,76	100,00	74,41
TMA - IPCA + 6%	0,58	60,27	109,02	100,00	2,13	61,50	134,40	100,00



RENTABILIDADE DA CARTEIRA – MENSAIS 2018:

Carteira x TMA		
	Carteira (%)	TMA (%)
janeiro	1,13	0,80
fevereiro	0,52	0,74
março	1,16	0,58



RENTABILIDADE DA CARTEIRA – MENSAIS ACUMULADO 2018:

Carteira x TMA (Acumulado no Ano)		
	Carteira (%)	TMA (%)
janeiro	1,13	0,80
fevereiro	1,65	1,55
março	2,84	2,13



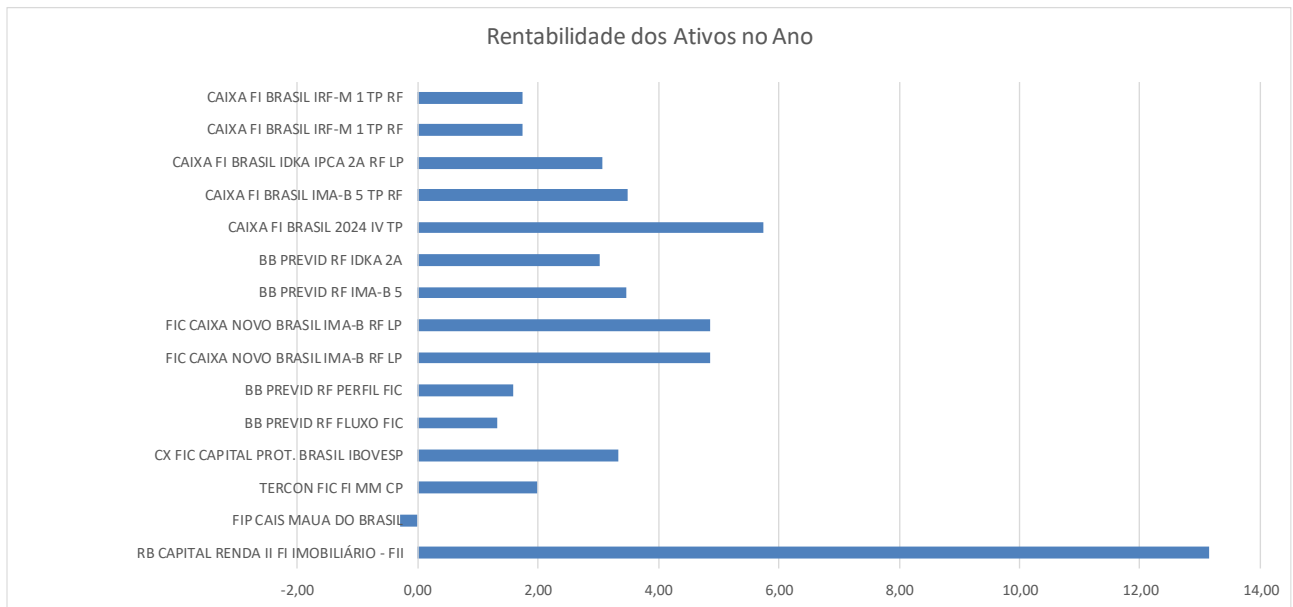
RENTABILIDADE ABSOLUTA DOS ATIVOS DA CARTEIRA NO MÊS:

RENDA FIXA

Carteira	Enquadramento CMN 3.922/2010		MAR.	FEV.	JAN.	RENT. 2018
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	Art. 7º, Inciso I, "b"	FI 100% títulos TN	0,64	0,53	0,57	1,75
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	Art. 7º, Inciso I, "b"	FI 100% títulos TN	0,64	0,53	0,57	1,75
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	Art. 7º, Inciso I, "b"	FI 100% títulos TN	1,52	0,57	0,95	3,06
CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TP RF	Art. 7º, Inciso I, "b"	FI 100% títulos TN	1,60	0,53	1,31	3,48
CAIXA FI BRASIL 2024 IV TP	Art. 7º, Inciso I, "b"	FI 100% títulos TN	2,19	0,46	3,05	5,74
BB PREVID RF IDKA 2A	Art. 7º, Inciso I, "b"	FI 100% títulos TN	1,48	0,56	0,96	3,03
BB PREVID RF IMA-B 5	Art. 7º, Inciso III, "a"	FI RENDA FIXA IMA/IDkA	1,60	0,52	1,31	3,47
FIC CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RF LP	Art. 7º, Inciso III, "a"	FI RENDA FIXA IMA/IDkA	0,91	0,59	3,30	4,86
FIC CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RF LP	Art. 7º, Inciso III, "a"	FI RENDA FIXA IMA/IDkA	0,91	0,59	3,30	4,86
BB PREVID RF PERFIL FIC	Art. 7º, Inciso IV, "a"	FI RENDA FIXA OU REF	0,54	0,47	0,57	1,59
BB PREVID RF FLUXO FIC	Art. 7º, Inciso IV, "a"	FI RENDA FIXA OU REF	0,44	0,39	0,49	1,32

RENDA VARIÁVEL

Carteira	Enquadramento CMN 3.922/2010		MAR.	FEV.	JAN.	RENT. 2018
CX FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESP	Art. 8º, Inciso III	FI MULTIMERCADO	1,93	1,18	0,19*	3,34
TERCON FIC FI MM CP	Art. 8º, Inciso III	FI MULTIMERCADO	1,10	0,32	0,55	1,98
FIP CAIS MAUA DO BRASIL	Art. 8º, Inciso IV, "a"	FI PARTICIPAÇÃO	-0,09	-0,10	-0,10	-0,29
RB CAPITAL RENDA II FI IMOBILIÁRIO	Art. 8º, Inciso IV, "b"	FI IMOBILIÁRIO	5,83	4,96	1,85	13,14

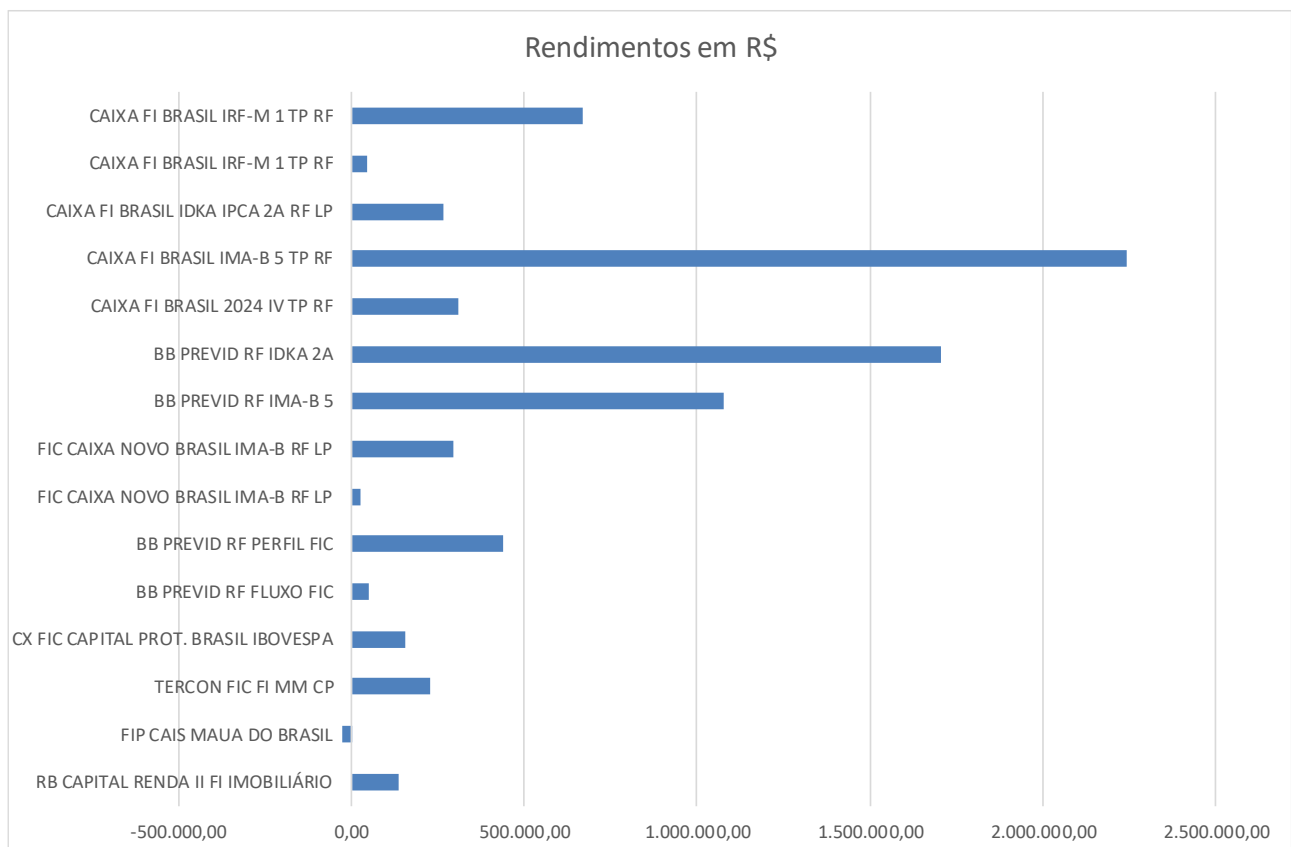


RESUMO DE RENDIMENTOS DA CARTEIRA NO MÊS:

RENDA FIXA					
Ativos em R\$	Carteira %	Saldo Anterior	Apli./Resg.	Rendimentos	Saldo Atual
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	15,80%	104.312.866,03	154.470,30	667.325,89	105.134.662,22
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	1,03%	6.841.577,49	0,00	43.728,09	6.885.305,58
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	2,68%	17.552.032,18	0,00	266.083,65	17.818.115,83
CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TP RF	21,43%	140.367.861,94	0,00	2.245.295,16	142.613.157,10
CAIXA FI BRASIL 2024 IV TP RF	2,17%	14.105.622,84	0,00	309.116,58	14.414.739,42
BB PREVID RF IDKA 2A	17,54%	114.974.782,37	0,00	1.704.186,50	116.678.968,87
BB PREVID RF IMA-B 5	10,26%	67.193.201,52	0,00	1.076.651,14	68.269.852,66
FIC CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RF LP	4,95%	32.632.940,21	0,00	296.863,52	32.929.803,73
FIC CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RF LP	0,40%	2.646.407,98	0,00	24.074,51	2.670.482,49
BB PREVID RF PERFIL FIC	12,30%	81.364.210,08	0,00	439.017,03	81.803.227,11
BB PREVID RF FLUXO FIC	2,20%	3.179.631,96	11.440.715,21	48.921,99	14.669.269,16
TOTAL	90,77%	585.171.134,60	11.595.185,51	7.121.264,06	603.887.584,17

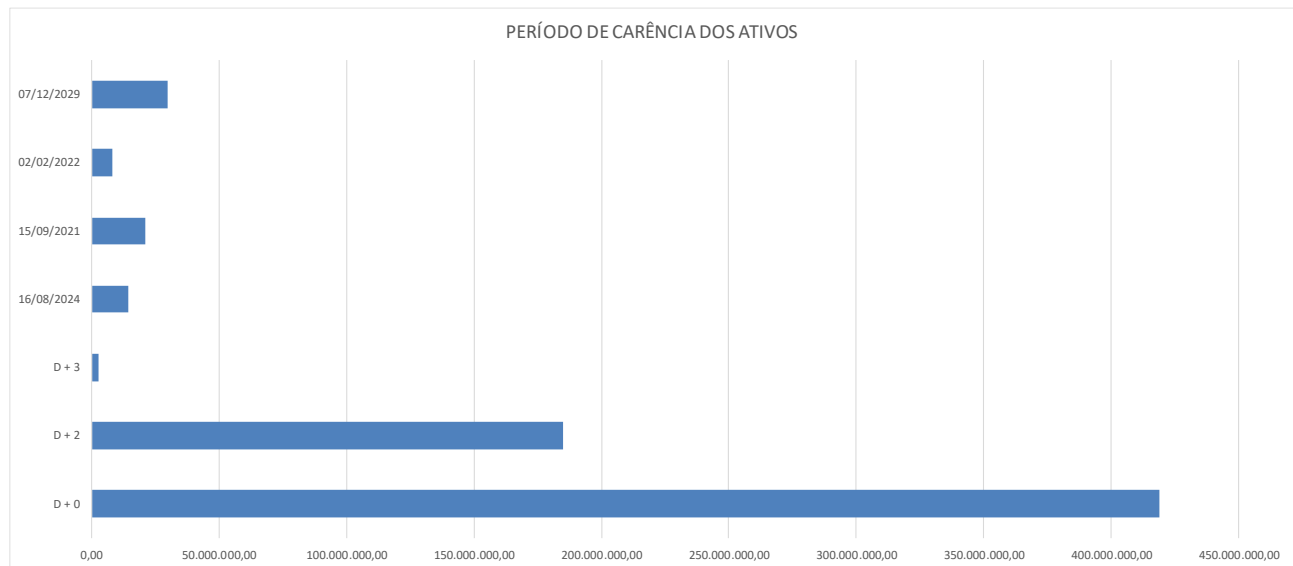
RENDA VARIÁVEL					
Ativos em R\$	Carteira %	Saldo Anterior	Apli./Resg.	Rendimentos	Saldo Atual
CX FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA	1,24%	8.092.813,85	0,00	156.411,34	8.249.225,19
TERCON FIC FI MM CP	3,14%	20.649.795,82	0,00	227.222,56	20.877.018,38
FIP CAIS MAUA DO BRASIL	4,49%	29.914.804,91	0,00	-26.856,38	29.887.948,53
RB CAPITAL RENDA II FI IMOBILIÁRIO	0,37%	2.307.586,16	0,00	134.145,98	2.428.470,00
TOTAL	0,37%	60.965.000,74	0,00	490.923,50	61.442.662,10

TOTAL CARTEIRA	100,00%	646.136.135,34	11.595.185,51	7.612.187,56	665.330.246,27
FUNDO ADMINISTRATIVO	-	1.321.162,74	-408.403,77	5.570,67	918.329,64



RESUMO DO PERÍODO DE CARÊNCIA DA CARTEIRA:

CARÊNCIA DOS INVESTIMENTOS								
Ativos em R\$	Saldo Atual	D + 0	D + 2	D + 3	16/08/2024	15/09/2021	02/02/2022	07/12/2029
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	105.134.662,22	105.134.662,22						
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	6.885.305,58	6.885.305,58						
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	17.818.115,83	17.818.115,83						
CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TP RF	142.613.157,10	142.613.157,10						
CAIXA FI BRASIL 2024 IV TP RF	14.414.739,42	14.414.739,42			14.414.739,42			
BB PREVID RF IDKA 2A	116.678.968,87		116.678.968,87					
BB PREVID RF IMA-B 5	68.269.852,66		68.269.852,66					
FIC CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RF LP	32.929.803,73	32.929.803,73						
FIC CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RF LP	2.670.482,49	2.670.482,49						
BB PREVID RF PERFIL FIC	81.803.227,11	81.803.227,11						
BB PREVID RF FLUXO FIC	14.669.269,16	14.669.269,16						
CX FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA	8.249.225,19						8.249.225,19	
TERCON FIC FI MM CP	20.877.018,38					20.877.018,38		
FIP CAIS MAUA DO BRASIL	29.887.948,53							29.887.948,53
RB CAPITAL RENDA II FI IMOBILIÁRIO - FII	2.428.470,00			2.428.470,00				
Total	665.330.246,27	418.938.762,64	184.948.821,53	2.428.470,00	14.414.739,42	20.877.018,38	8.249.225,19	29.887.948,53



POLÍTICA DE INVESTIMENTOS / RESOLUÇÃO CMN 3.922/2010

RECURSOS/DIVERSIFICAÇÃO	RESOLUÇÃO CMN 3922/2010	% Limite da 3.922	% Limite Alvo 2018	Carteira em 29/03/18	Situação PI
RENDA FIXA					
Títulos Públicos registrado no Selic	ART. 7º INCISO I, "a"	100,00%	0,00%	0,00%	OK
FI condominioaberto, 100% TPF	ART. 7º INCISO I, "b"	100,00%	52,00%	60,65%	OK
OperaçõesCompromissadaatreladas TPF	ART. 7º INCISO II	5,00%	0,00%	0,00%	OK
FI Renda Fixa ou Referenciado	ART. 7º INCISO III, "a"	60,00%*	20,00%	15,61%	OK
FI de Índice Referenciados em RF - Subíndice ANBIMA	ART. 7º INCISO III, "b"	60,00%*	0,00%	0,00%	OK
FI de Renda Fixa	ART. 7º INCISO IV, "a"	40,00%*	20,00%	14,50%	OK
FI de Índice Referenciados em RF	ART. 7º INCISO IV, "b"	40,00%*	0,00%	0,00%	OK
Letras Imobiliárias Garantidas	ART. 7º INCISO V, "b"	20,00%	0,00%	0,00%	OK
Certificado de Depósito Bancário - CDB	ART. 7º INCISO VI, "a"	15,00%*	0,00%	0,00%	OK
Poupança	ART. 7º INCISO VI, "b"	15,00%*	0,00%	0,00%	OK
FI em Diretos Creditórios, aberto - Cota Sênior	ART. 7º INCISO VII, "a"	5,00%	0,00%	0,00%	OK
FI de Renda Fixa ou Referenciado - Credito Privado	ART. 7º INCISO VII, "b"	5,00%	0,00%	0,00%	OK
Cotas de FI que trata Art. 3º da Lei nº12.431/2011	ART. 7º INCISO VII, "c"	5,00%	0,00%	0,00%	OK
RENDA VARIÁVEL					
FI em Ações Referenciados, Condomínio Aberto	ART. 8º INCISO I, "a"	30,00%	0,00%	0,00%	OK
FI de Índices Referenciados em Ações,	ART. 8º INCISO I, "b"	30,00%	0,00%	0,00%	OK
FI em Ações, Condomínio Aberto	ART. 8º INCISO II, "a"	20,00%	6,00%	0,00%	OK
FI em Ações de Índice, Condomínio Aberto	ART. 8º INCISO II, "b"	20,00%	0,00%	0,00%	OK
FI Multimercados, Condomínio Aberto	ART. 8º INCISO III	10,00%	0,00%	4,38%	Desenquadrado
FI em Participações, Condomínio Fechado	ART. 8º INCISO IV, "a"	5,00%	0,00%	4,49%	Desenquadrado
FI Imobiliários	ART. 8º INCISO VI, "b"	5,00%	2,00%	0,37%	OK

RESUMO DOS ATIVOS DESENQUADRADOS DA CARTEIRA:

ATIVOS DESENQUADRADOS				
	Valor Atual	PL FUNDO (R\$)	(%) do PL	(%) Permitida Resolução CMN
TERCON FIC FI MM CP	20.877.018,38	77.621.875,30	26,90%	5,00%
FIP CAIS MAUA DO BRASIL	29.887.948,53	191.807.614,25	15,58%	5,00%

RESUMO SITUAÇÃO PROCESSOS DE CREDENCIAMENTOS:

INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS		PROCESSO DE CREDENCIAMENTO
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	ADM/GESTORA	EM ANDAMENTO P/ COMITÊ
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.	ADM/GESTORA	EM ANDAMENTO P/ COMITÊ
BANCO BRADESCO S.A.	ADM/GESTORA	ABERTURA DE PROCESSO
ITAU UNIBANCO S.A.	ADM/GESTORA	ABERTURA DE PROCESSO
REAG ADMINISTRADORA DE RECURSOS - "CAIS MAUA"	ADMINISTRAÇÃO	CREDENCIADA*
REAG GESTORA DE RECURSOS - "CAIS MAUA"	GESTORA	NÃO CREDENCIADA
CM CAPITAL MARKETS DTVM - "TERCON"	ADMINISTRAÇÃO	NÃO CREDENCIADA
TERCON INVESTIMENTOS LTDA - "TERCON"	GESTORA	CREDENCIADA*
VOTORANTIM ASSET MANAGEMENT DTVM	ADMINISTRAÇÃO	AGUARDANDO DOC

(*) Instituições Financeiras credenciadas irregularmente.

Kauwe Eidi Torres Ueda
Diretor de Investimentos