



# INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE PALMAS- PREVIPALMAS

PREVIPALMAS

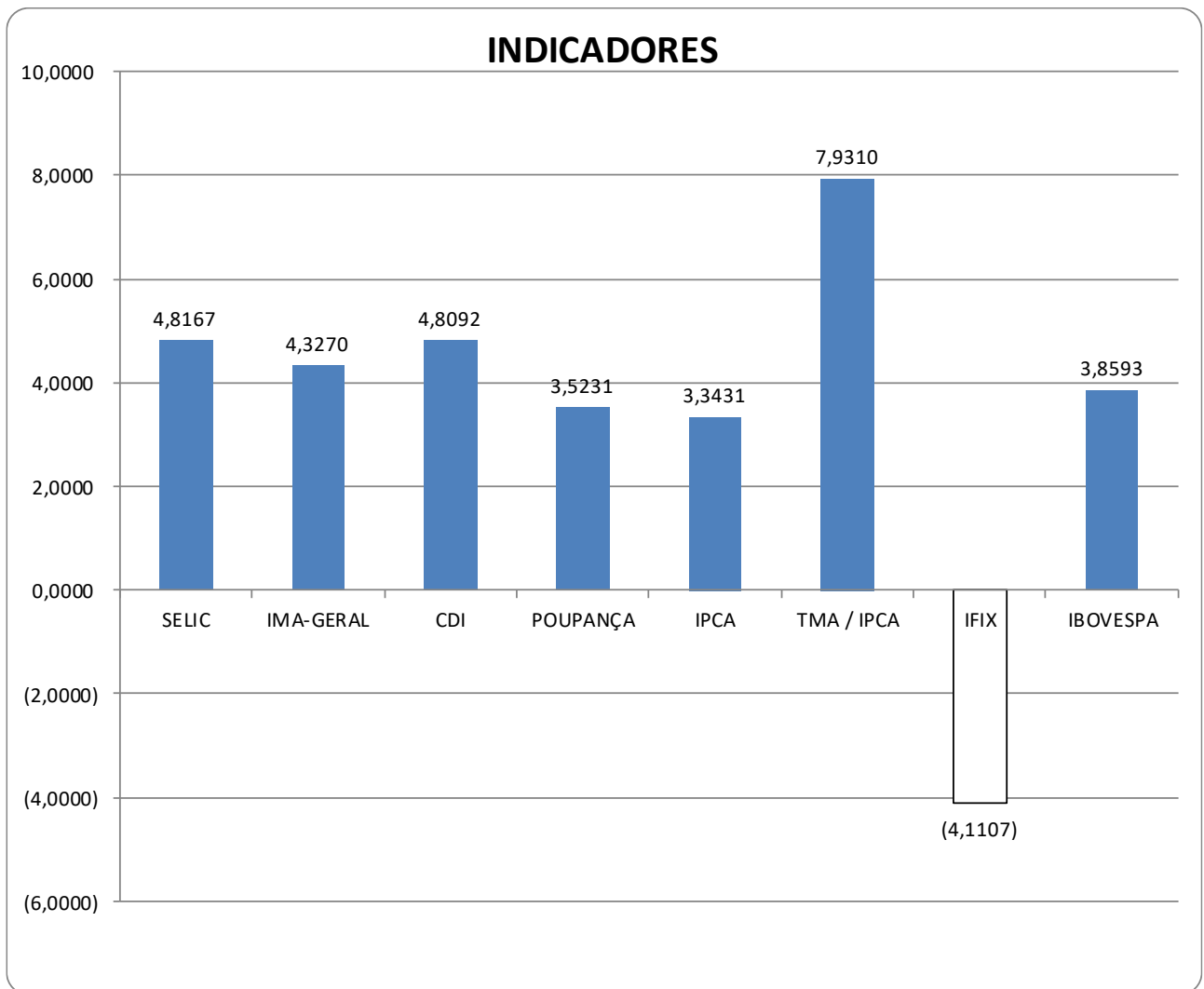
---

## RELATÓRIO MENSAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS – SETEMBRO/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	0,5315	0,3994	0,0900	0,5800	2,0000	0,0140
abr/18	0,5183	0,3200	0,5175	0,3855	0,2200	0,7100	(0,8600)	0,8790
mai/18	0,5183	(1,4263)	0,5175	0,3715	0,4000	0,8900	(5,2700)	(10,8700)
jun/18	0,5183	0,1199	0,5175	0,3715	1,2600	1,7500	(4,0100)	(5,2000)
jul/18	0,5430	1,4100	0,5422	0,3715	0,3300	0,8400	1,3700	8,8800
ago/18	0,5678	(0,2149)	0,5669	0,3715	(0,0900)	0,4400	(0,7000)	(3,2100)
set/18	0,4688	0,6379	0,4681	0,3715	0,4800	0,9200	(0,2100)	3,4800
out/18								
nov/18								
dez/18								
<b>Acumulado 2018</b>	<b>4,8167</b>	<b>4,3270</b>	<b>4,8092</b>	<b>3,5231</b>	<b>3,3431</b>	<b>7,9310</b>	<b>(4,1107)</b>	<b>3,8593</b>



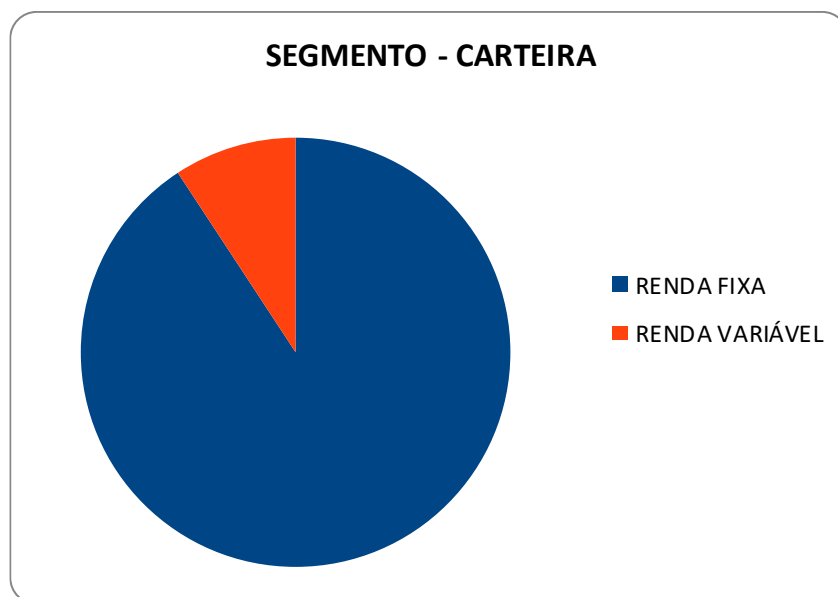
# RELATÓRIO MENSAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

SETEMBRO – DATA BASE 28/09/2018.

Ativos em R\$	Carteira %	Saldo Anterior	Aportes	Aplicações	Pgt Benef	Dividendos	Saldo Atual
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	15,75%	108.725.418,46	139.080,00	0,00	0,00	0,00	109.505.130,53
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	1,02%	7.050.811,09	0,00	0,00	0,00	0,00	7.092.320,74
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	2,63%	18.066.435,93	0,00	0,00	0,00	0,00	18.274.617,67
CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TP RF	20,77%	143.192.226,37	0,00	0,00	0,00	0,00	144.419.070,00
CAIXA FI BRASIL 2024 IV TP RF	1,97%	13.741.194,42	0,00	0,00	0,00	0,00	13.705.163,82
BB PREVID RF IDKA 2A	17,20%	118.178.472,26	0,00	0,00	0,00	0,00	119.562.641,71
BB PREVID RF IMA-B 5	9,95%	68.572.833,10	0,00	0,00	0,00	0,00	69.166.243,20
FIC CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RF LP	4,65%	32.344.319,92	0,00	0,00	0,00	0,00	32.303.630,47
FIC CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RF LP	0,38%	2.623.001,97	0,00	0,00	0,00	0,00	2.619.702,21
BB PREVID RF PERFIL FIC	12,13%	83.952.802,61	0,00	0,00	0,00	0,00	84.365.484,75
BB PREVID RF FLUXO FIC	4,72%	29.750.624,46	5.688.437,47	13.844,97	2.746.470,77	0,00	32.833.295,54
CX FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA	1,20%	8.258.860,20	0,00	0,00	0,00	0,00	8.335.046,27
WINGS FIC FIM MULTICRÉDITO CP	3,04%	21.166.013,35	0,00	0,00	0,00	0,00	21.157.716,56
FIP CAIS MAUA DO BRASIL	4,27%	29.695.227,35	0,00	0,00	0,00	0,00	29.665.832,59
RB CAPITAL RENDA II FI IMOBILIÁRIO	0,33%	2.311.363,78	0,00	0,00	0,00	13.844,97	2.293.015,34
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>687.629.605,27</b>	<b>5.827.517,47</b>	<b>13.844,97</b>	<b>2.746.470,77</b>	<b>13.844,97</b>	<b>695.298.911,40</b>
FUNDO ADMINISTRATIVO		4.017.233,84	611.385,17			166.245,93	4.478.554,64

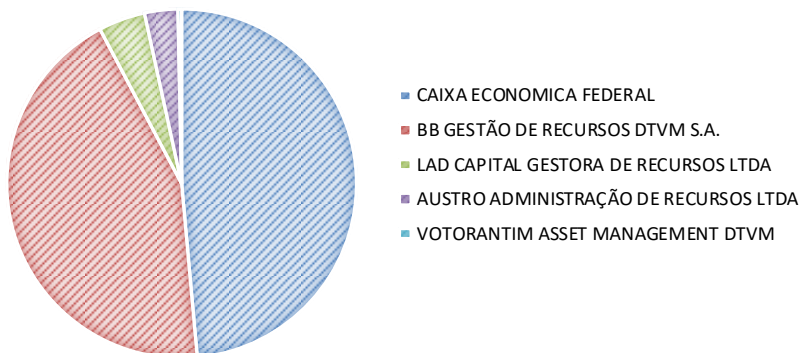
## DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR SEGMENTO:

SEGMENTO	SALDO EM 28/09/2018 (R\$)	PARTICIPAÇÃO (%)
RENDA FIXA	633.847.300,64	91,16
RENDA VARIÁVEL	61.451.610,76	8,84
<b>TOTAL</b>	<b>695.298.911,40</b>	<b>100,00</b>

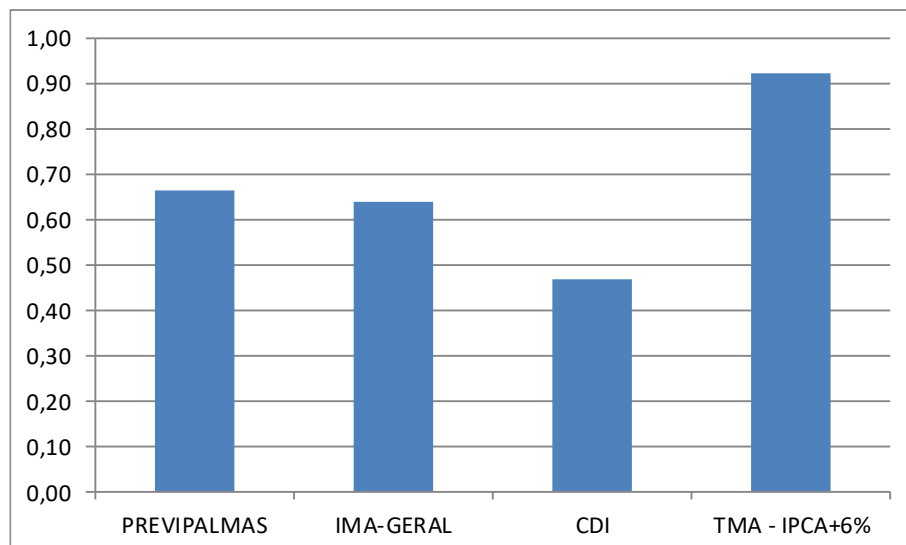


**DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ADMINISTRADOR:**

<b>ADMINISTRADORES</b>	<b>SALDO EM 28/09/2018 (R\$)</b>	<b>PARTICIPAÇÃO (%)</b>
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	336.254.681,71	48,36
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.	305.927.665,20	44,00
LAD CAPITAL GESTORA DE RECURSOS LTDA	29.665.832,59	4,27
AUSTRO ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS LTDA	21.157.716,56	3,04
VOTORANTIM ASSET MANAGEMENT DTVM	2.293.015,34	0,33
<b>TOTAL</b>	<b>695.298.911,40</b>	<b>100,00</b>

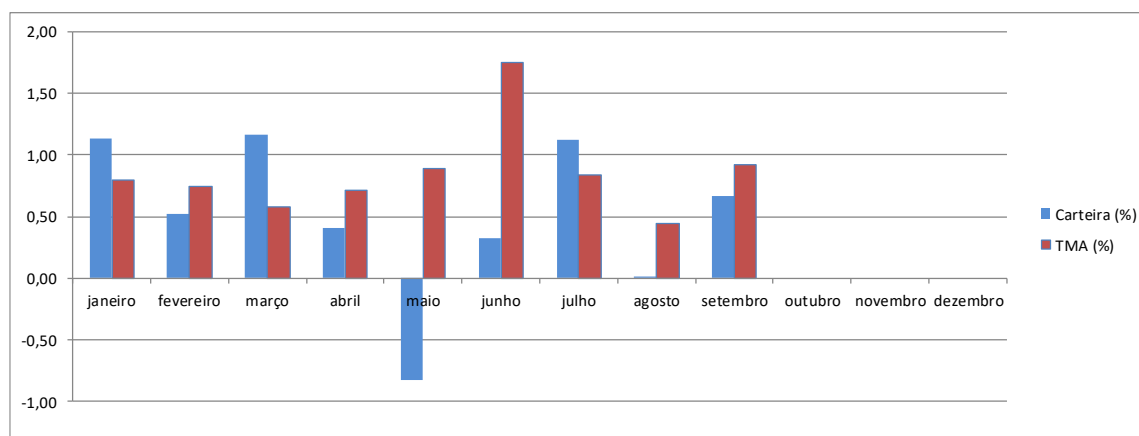
**ADMINISTRADORES - CARTEIRA**

**RENTABILIDADE DA CARTEIRA:**
**CARTEIRA CONSOLIDADA**

<b>Rentabilidades (Em % - TIR)</b>	<b>No Mês</b>	<b>% IMA-G</b>	<b>% CDI</b>	<b>% TMA</b>	<b>No ano</b>	<b>% IMA-G</b>	<b>% CDI</b>	<b>% TMA</b>
<b>Carteira</b>	<b>0,66</b>	104,14	141,91	72,21	<b>4,60</b>	106,21	95,56	57,94
<b>IMA-GERAL</b>	<b>0,64</b>	100,00	136,27	69,34	<b>4,33</b>	100,00	89,97	54,56
<b>CDI</b>	<b>0,47</b>	73,38	100,00	50,88	<b>4,81</b>	111,14	100,00	60,64
<b>TMA - IPCA + 6%</b>	<b>0,92</b>	144,22	196,54	100,00	<b>7,93</b>	183,29	164,91	100,00

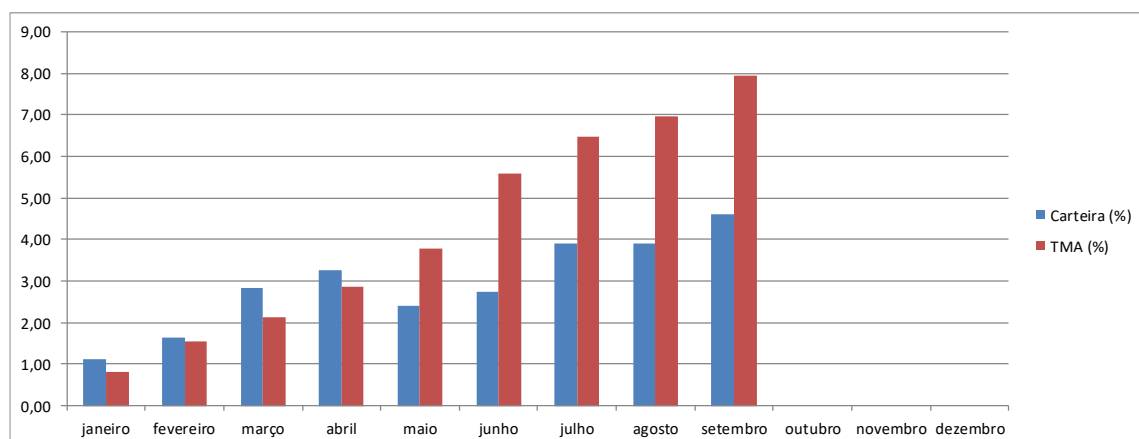


**RENTABILIDADE DA CARTEIRA – MENSAIS 2018:**

<b>Carteira x TMA</b>		
	<b>Carteira (%)</b>	<b>TMA (%)</b>
janeiro	1,13	0,80
fevereiro	0,52	0,74
março	1,16	0,58
abril	0,41	0,71
maio	-0,83	0,89
junho	0,32	1,75
julho	1,12	0,84
agosto	0,01	0,44
setembro	0,66	0,92


**RENTABILIDADE DA CARTEIRA – MENSAIS ACUMULADO 2018:**

<b>Carteira x TMA (Acumulado no Ano)</b>		
	<b>Carteira (%)</b>	<b>TMA (%)</b>
janeiro	1,13	0,80
fevereiro	1,65	1,55
março	2,84	2,13
abril	3,26	2,86
maio	2,41	3,78
junho	2,74	5,59
julho	3,90	6,48
agosto	3,91	6,95
setembro	4,60	7,93

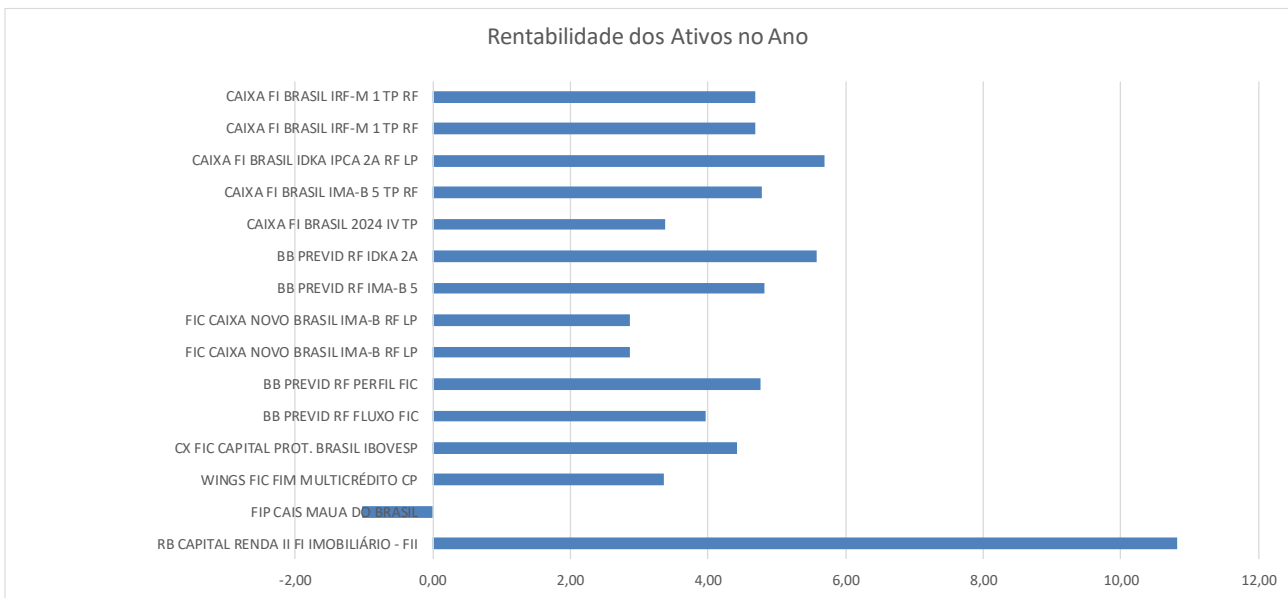


**RENTABILIDADE ABSOLUTA DOS ATIVOS DA CARTEIRA NO MÊS:**
**RENDA FIXA**

Carteira	Enquadramento CMN 3.922/2010		JUN.	JUL.	AGO.	SET.	RENT. 2018
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	Art. 7º, Inciso I, "b"	FI 100% títulos TN	0,50	0,68	0,41	0,59	4,69
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	Art. 7º, Inciso I, "b"	FI 100% títulos TN	0,50	0,68	0,41	0,59	4,69
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	Art. 7º, Inciso I, "b"	FI 100% títulos TN	0,21	1,19	0,01	1,15	5,71
CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TP RF	Art. 7º, Inciso I, "b"	FI 100% títulos TN	0,42	1,46	-0,27	0,86	4,79
CAIXA FI BRASIL 2024 IV TP	Art. 7º, Inciso I, "b"	FI 100% títulos TN	-0,01	2,22	-0,60	-0,26	3,37
BB PREVID RF IDKA 2A	Art. 7º, Inciso I, "b"	FI 100% títulos TN	0,43	1,23	-0,08	1,17	5,58
BB PREVID RF IMA-B 5	Art. 7º, Inciso III, "a"	FI RENDA FIXA IMA/IDKa	0,29	1,46	-0,26	0,87	4,83
FIC CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RF LP	Art. 7º, Inciso III, "a"	FI RENDA FIXA IMA/IDKa	-0,36	2,29	-0,45	-0,13	2,87
FIC CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RF LP	Art. 7º, Inciso III, "a"	FI RENDA FIXA IMA/IDKa	-0,36	2,29	-0,45	-0,13	2,87
BB PREVID RF PERFIL FIC	Art. 7º, Inciso IV, "a"	FI RENDA FIXA OU REF	0,50	0,52	0,55	0,49	4,77
BB PREVID RF FLUXO FIC	Art. 7º, Inciso IV, "a"	FI RENDA FIXA OU REF	0,43	0,45	0,47	0,39	3,97

**RENDA VARIÁVEL**

Carteira	Enquadramento CMN 3.922/2010		JUN.	JUL.	AGO.	SET.	RENT. 2018
CX FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESP	Art. 8º, Inciso III	FI MULTIMERCADO	-0,26	1,13	-0,42	0,92	4,42
WINGS FIC FIM MULTICRÉDITO CP	Art. 8º, Inciso III	FI MULTIMERCADO	0,15	1,40	-0,36	-0,04	3,35
FIP CAIS MAUA DO BRASIL	Art. 8º, Inciso IV, "a"	FI PARTICIPAÇÃO	-0,18	-0,12	-0,12	-0,10	-1,03
RB CAPITAL RENDA II FI IMOBILIÁRIO	Art. 8º, Inciso IV, "b"	FI IMOBILIÁRIO	-0,68	5,27	-1,20	-0,20	10,82

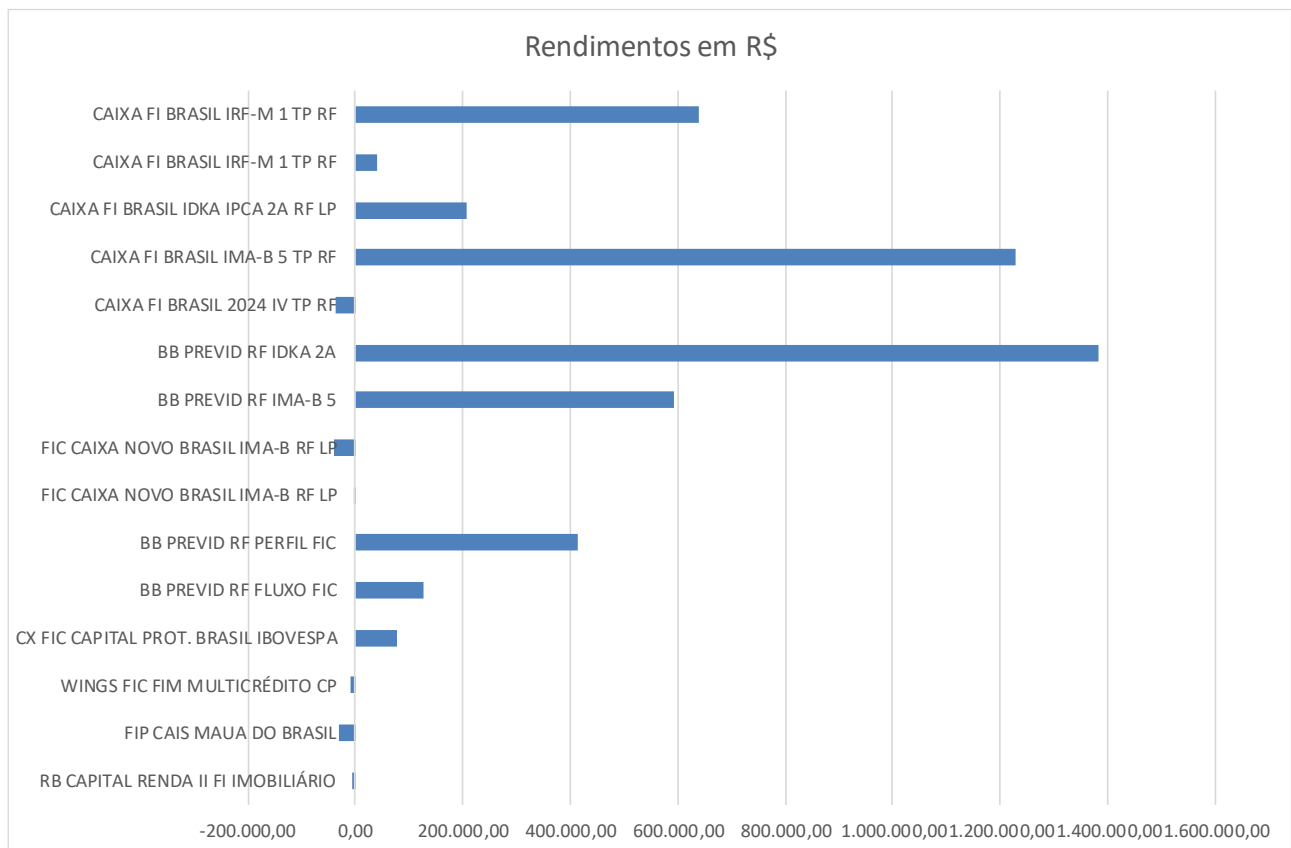


## RESUMO DE RENDIMENTOS DA CARTEIRA NO MÊS:

RENDA FIXA					
Ativos em R\$	Carteira %	Saldo Anterior	Apli./Resg.	Rendimentos	Saldo Atual
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	15,75%	108.725.418,46	139.080,00	640.632,07	109.505.130,53
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	1,02%	7.050.811,09	0,00	41.509,65	7.092.320,74
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	2,63%	18.066.435,93	0,00	208.181,74	18.274.617,67
CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TP RF	20,77%	143.192.226,37	0,00	1.226.843,63	144.419.070,00
CAIXA FI BRASIL 2024 IV TP RF	1,97%	13.741.194,42	0,00	-36.030,60	13.705.163,82
BB PREVID RF IDKA 2A	17,20%	118.178.472,26	0,00	1.384.169,45	119.562.641,71
BB PREVID RF IMA-B 5	9,95%	68.572.833,10	0,00	593.410,10	69.166.243,20
FIC CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RF LP	4,65%	32.344.319,92	0,00	-40.689,45	32.303.630,47
FIC CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RF LP	0,38%	2.623.001,97	0,00	-3.299,76	2.619.702,21
BB PREVID RF PERFIL FIC	12,13%	83.952.802,61	0,00	412.682,14	84.365.484,75
BB PREVID RF FLUXO FIC	4,72%	29.750.624,46	2.955.811,67	126.859,41	32.833.295,54
<b>TOTAL</b>	<b>91,16%</b>	<b>626.198.140,59</b>	<b>3.094.891,67</b>	<b>4.554.268,38</b>	<b>633.847.300,64</b>

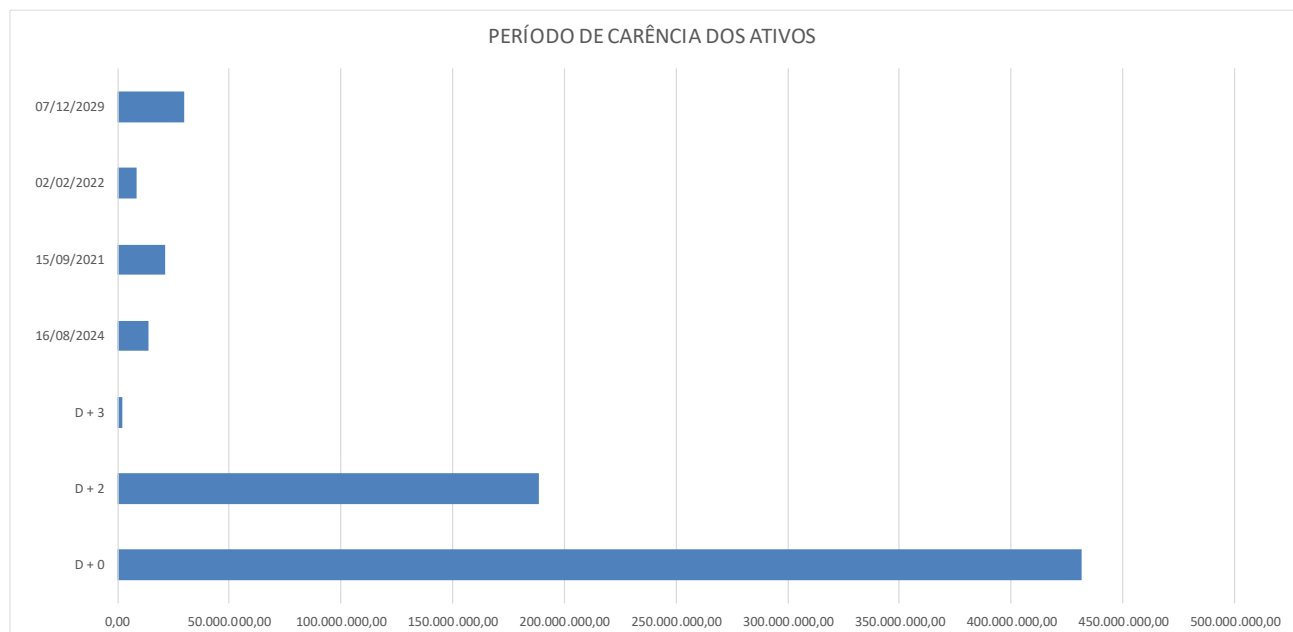
RENDA VARIÁVEL					
Ativos em R\$	Carteira %	Saldo Anterior	Apli./Resg.	Rendimentos	Saldo Atual
CX FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA	1,20%	8.258.860,20	0,00	76.186,07	8.335.046,27
WINGS FIC FIM MULTICRÉDITO CP	3,04%	21.166.013,35	0,00	-8.296,79	21.157.716,56
FIP CAIS MAUA DO BRASIL	4,27%	29.695.227,35	0,00	-29.394,76	29.665.832,59
RB CAPITAL RENDA II FI IMOBILIÁRIO	0,33%	2.311.363,78	0,00	-4.503,47	2.293.015,34
<b>TOTAL</b>	<b>8,84%</b>	<b>61.431.464,68</b>	<b>0,00</b>	<b>33.991,05</b>	<b>61.451.610,76</b>

<b>TOTAL CARTEIRA</b>	<b>100,00%</b>	<b>687.629.605,27</b>	<b>3.094.891,67</b>	<b>4.588.259,43</b>	<b>695.298.911,40</b>
FUNDO ADMINISTRATIVO	-	4.017.233,84	445.139,24	16.181,56	4.478.554,64



## 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	109.505.130,53	109.505.130,53						
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	7.092.320,74	7.092.320,74						
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	18.274.617,67	18.274.617,67						
CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TP RF	144.419.070,00	144.419.070,00						
CAIXA FI BRASIL 2024 IV TP RF	13.705.163,82				13.705.163,82			
BB PREVID RF IDKA 2A	119.562.641,71		119.562.641,71					
BB PREVID RF IMA-B 5	69.166.243,20		69.166.243,20					
FIC CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RF LP	32.303.630,47	32.303.630,47						
FIC CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RF LP	2.619.702,21	2.619.702,21						
BB PREVID RF PERFIL FIC	84.365.484,75	84.365.484,75						
BB PREVID RF FLUXO FIC	32.833.295,54	32.833.295,54						
CX FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA	8.335.046,27						8.335.046,27	
WINGS FIC FIM MULTICRÉDITO CP	21.157.716,56					21.157.716,56		
FIP CAIS MAUA DO BRASIL	29.665.832,59							29.665.832,59
RB CAPITAL RENDA II FI IMOBILIÁRIO - FII	2.293.015,34			2.293.015,34				
<b>Total</b>	<b>695.298.911,40</b>	<b>431.413.251,91</b>	<b>188.728.884,91</b>	<b>2.293.015,34</b>	<b>13.705.163,82</b>	<b>21.157.716,56</b>	<b>8.335.046,27</b>	<b>29.665.832,59</b>





**POLÍTICA DE INVESTIMENTOS / RESOLUÇÃO CMN 3.922/2010**

<b>RECURSOS/DIVERSIFICAÇÃO</b>	<b>RESOLUÇÃO CMN 3922/2010</b>	<b>% Limite da 3.922</b>	<b>% Limite Alvo 2018</b>	<b>Carteira em 28/09/18</b>	<b>Situação PI</b>
<b>RENDA FIXA</b>					
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%	59,34%	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%	14,97%	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%	16,86%	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
<b>RENDA VARIÁVEL</b>					
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%	4,24%	Desenquadrado
FI em Participações, Condomínio Fechado	ART. 8º INCISO IV, "a"	5,00%	0,00%	4,27%	Desenquadrado
FI Imobiliários	ART. 8º INCISO VI, "b"	5,00%	2,00%	0,33%	OK

**RESUMO DOS ATIVOS DESENQUADRADOS DA CARTEIRA:**

<b>ATIVOS DESENQUADRADOS</b>				
	Valor Atual	PL FUNDO (R\$)	(%) do PL	(%) Permitida Resolução CMN
WINGS FIC FIM MULTICRÉDITO CP	21.157.716,56	78.665.526,23	26,90%	5,00%
FIP CAIS MAUA DO BRASIL	29.665.832,59	190.494.389,21	15,57%	5,00%

**RESUMO SITUAÇÃO PROCESSOS DE CREDENCIAMENTOS:**

<b>INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</b>		<b>PROCESSO DE CREDENCIAMENTO</b>
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	ADM/GESTORA	CRENCIADO
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.	ADM/GESTORA	CRENCIADO
BANCO BRADESCO S.A.	ADM/GESTORA	ANÁLISE DE DOCUMENTO
ITAU UNIBANCO S.A.	ADM/GESTORA	CRENCIADO
LAD CAPITAL GEST. DE REC. LTDA - "CAIS MAUA"	ADM/GESTORA	NÃO CRENCIADO
AUSTRO ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS LTDA - "TERCON/WINGS"	ADMINISTRAÇÃO	NÃO CRENCIADO
REAG GESTORA DE RECURSOS LTDA - "TERCON/WINGS"	GESTORA	CRENCIADO*
VOTORANTIM ASSET MANAGEMENT DTVM	ADMINISTRAÇÃO	ANÁLISE DE DOCUMENTO
RB CAPITAL ASSET MANAGEMENT LTDA	GESTORA	ANÁLISE DE DOCUMENTO

(\*) Instituições Financeiras credenciadas irregularmente.

**Kauwe Eidi Torres Ueda**  
**Diretor de Investimentos**