

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

IPREMB

AGOSTO/2017





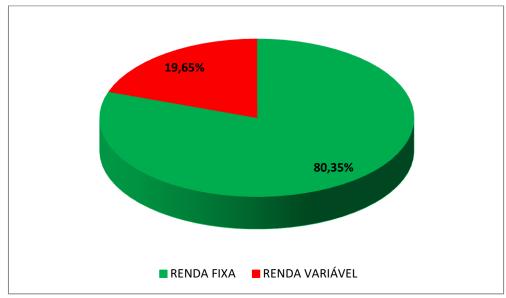


1. POSIÇÃO DOS INVESTIMENTOS

AGOSTO - 2017						
VALOR APLICADO	R\$ 1.055.885.817,84					
VALOR EM CONTA	R\$ 29.267,68					
TOTAL	R\$ 1.055.915.085,52					

1.1 POR TIPO DE INVESTIMENTO

INVESTIMENTO	VALOR - R\$	PERCENTUAL - %
RENDA FIXA	848.397.187,54	80,35%
RENDA VARIÁVEL	207.488.630,30	19,65%
TOTAL	1.055.885.817,84	100,00%



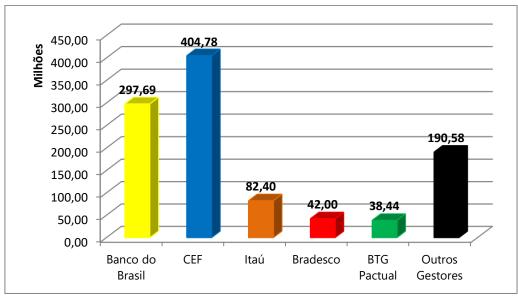
1.2 POR INSTITUIÇÕES

INSTITUIÇÃO	VALOR - R\$	PERCENTUAL
Banco do Brasil	297.687.005,07	28,19%
Caixa Econômica	404.781.827,24	38,34%
Itaú	82.396.554,64	7,80%
Bradesco	42.000.245,94	3,98%
BTG Pactual	38.438.386,22	3,64%
Outros Gestores	190.581.798,72	18,05%
TOTAL	1.055.885.817,84	100,00%









1.3 POR ENQUADRAMENTO

Legenda	Modalidades de Aplicações	Limite % Resolução 3922/2010	Carteira do IPREMB - AGOSTO/2017
Α	Renda Fixa - Art. 7°	100%	80,35%
A1	Títulos Tesouro Nacional - Art. 7º, I, "a"	100%	6,90%
A2	FI 100% títulos TN - Art. 7°, I, "b"	100%	45,25%
A3	Operações Compromissadas - Art. 7º, II	15%	0,00%
A4	FI Renda Fixa/Referenciados RF - Art. 7º, III "a"	80%	1,35%
A5	FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV "a"	30%	23,03%
A6	Poupança - Art. 7°, V	20%	0,00%
A7	FI em Direitos Creditórios - aberto - Art. 7º, VI	15%	2,07%
A8	FI em Direitos Creditórios - fechado - Art. 7º, VII, "a"	5%	0,30%
A9	FI Renda Fixa "Crédito Privado"- Art. 7º, VII, "b"	5%	1,45%
В	Renda Variável - Art. 8°	30%	19,65%
B1	FI Ações Referenciados - Art. 8º, I	30%	0,73%
B2	FI de Índices Referenciados em Ações - Art. 8º, II	20%	0,00%
В3	FI em Ações - Art. 8º, III	15%	8,55%
B4	FI Multimercado - Art. 8°, IV	5%	4,16%
B5	FI em Participações - fechado - Art. 8º, V	5%	3,11%
В6	FI Imobiliário - cotas negociadas em bolsa - Art. 8º, VI	5%	3,10%



2 – RENTABILIDADE

2.1 FUNDOS ARTIGO 7º I "a"

AGOSTO 2017									
ARTIGO 7º I A - TÍTULOS TESOURO NACIONAL - LIMITE DE APLICAÇÃO: 100%									
Percentual da Rentabilidade CDI %CDI Meta Carteira Rentabilidade CDI %CDI Atuarial									
NTN-F 10.000 Títulos Públicos 2023	0,98%	1,20%	0,80%	150,32%	0,68%	176,84%			
NTN-B 2110 - Títulos Públicos 2024	0,65%	-1,00%	0,80%	-124,92%	0,68%	-146,97%			
NTN-B 3055 - Títulos Públicos 2024	0,94%	-1,00%	0,80%	-124,92%	0,68%	-146,97%			
NTN-B 3405 - Títulos Públicos 2024	1,04%	-1,00%	0,80%	-124,92%	0,68%	-146,97%			
NTN-B 1709 - Títulos Públicos 2022	0,52%	-1,15%	0,80%	-144,32%	0,68%	-169,79%			
NTN-B 1698 - Títulos Públicos 2020	0,51%	-1,69%	0,80%	-211,74%	0,68%	-249,11%			
NTN-B 7753 - Títulos Públicos 2018	2,27%	-2,12%	0,80%	-265,06%	0,68%	-311,84%			
6,90%									

2.2 FUNDOS ARTIGO 7º I "b"

AGOSTO 2017									
ARTIGO 7º I B - FUNDOS 100% TÍTULOS PÚBLICOSL - LIMITE DE APLICAÇÃO: 100%									
Fundo	Percentual da Carteira	Rentabilidade	CDI	%CDI	Meta Atuarial	%Meta Atuarial			
CAIXA FI BRASIL 2024 V TP RF	2,40%	1,70%	0,80%	212,05%	0,68%	249,48%			
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP	2,52%	1,33%	0,80%	166,28%	0,68%	195,63%			
BRADESCO FI RF IMA-B TP	2,95%	1,31%	0,80%	163,42%	0,68%	192,26%			
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	14,77%	1,24%	0,80%	154,96%	0,68%	182,30%			
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 + TP RF LP	1,73%	1,05%	0,80%	130,94%	0,68%	154,05%			
CAIXA FI BRASIL IRF-M RF LP	8,04%	1,01%	0,80%	125,87%	0,68%	148,09%			
BB PREVID TP VII	5,67%	0,99%	0,80%	124,03%	0,68%	145,92%			
BB PREVID RF IDKA2	4,68%	0,98%	0,80%	123,04%	0,68%	144,75%			
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	1,61%	0,89%	0,80%	111,21%	0,68%	130,83%			
BB PREVIDÊNCIA RF IRF-M 1	0,88%	0,88%	0,80%	109,68%	0,68%	129,04%			
	45 25%								

2.3 FUNDOS ARTIGO 7º III "a"

AGOSTO 2017								
ARTIGO 7º III A	ARTIGO 7º III A - FUNDOS DE RENDA FIXA REFERENCIADOS - LIMITE DE APLICAÇÃO: 80%							
Fundo	Percentual da Carteira	Rentabilidade	CDI	%CDI	Meta Atuarial	%Meta Atuarial		
SULAMERICA ÍNDICES FI RF LP	0,33%	1,41%	0,80%	176,25%	0,68%	207,35%		
BRADESCO FI RF IRF-M 1	1,02%	0,88%	0,80%	110,00%	0,68%	129,41%		

1,35%



2.4 FUNDOS ARTIGO 7º IV "a"

AGOSTO 2017									
ARTIGO 7º IV A - FUNDOS DE RENDA FIXA - LIMITE DE APLICAÇÃO: 30%									
Percentual da Rentabilidade CDI %CDI Meta S Carteira Rentabilidade CDI %CDI Atuarial A									
ITAÚ I ALOCAÇÃO DINÂMICA	6,61%	1,18%	0,80%	147,56%	0,68%	173,60%			
ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA II	0,41%	1,18%	0,80%	147,39%	0,68%	173,40%			
BB PREVID TP IPCA III	6,11%	0,97%	0,80%	120,90%	0,68%	142,23%			
BTG PACTUAL NTNB FI RF	1,19%	0,95%	0,80%	118,71%	0,68%	139,66%			
CAIXA FI BRASIL REF DI LP	1,44%	0,79%	0,80%	98,96%	0,68%	116,42%			
BB PREVID RF FLUXO	2,42%	0,70%	0,80%	88,08%	0,68%	103,62%			
FI FIC CAIXA FÁCIL RF SIMPLES	0,00%	0,62%	0,80%	76,98%	0,68%	90,56%			
CAIXA FI BRASIL 2018 I TP	4,86%	-1,86%	0,80%	-232,13%	0,68%	-273,09%			
	23,03%								

2.5 FUNDOS ARTIGO 7° VI

AGOSTO 2017							
ARTIGO 7º VI - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS - FIDC ABERTO - LIMITE DE APLICAÇÃO: 15%							
Fundo	Percentual da Carteira	Rentabilidade	CDI	%CDI	Meta Atuarial	%Meta Atuarial	
FIDC GBX PRIME I - SUB JUNIOR	2,07%	-0,21%	0,80%	-26,59%	0,68%	-31,29%	
	2,07%						

2.6 FUNDOS ARTIGO 7° VII "a"

AGOSTO 2017								
ARTIGO 7º VII A - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS - FIDC FECHADO - LIMITE DE APLICAÇÃO: 5%								
Fundo	Percentual da Carteira	Rentabilidade	CDI	%CDI	Meta Atuarial	%Meta Atuarial		
FIDC MASTER III	0,02%	515,58%	0,80%	64447,42%	0,68%	75820,50%		
FIDC PREMIUM-SR	0,28%	-1,33%	0,80%	-165,78%	0,68%	-195,04%		
	0,30%							

2.7 FUNDOS ARTIGO 7º VII "b"

AGOSTO 2017								
ARTIGO 7º VII B - FUNDO DE RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO - LIMITE DE APLICAÇÃO: 5%								
Percentual da Fundo Percentual da Rentabilidade CDI					Meta Atuarial	%Meta Atuarial		
BB PREVID IPCA III	0,81%	1,37%	0,80%	171,75%	0,68%	202,06%		
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CP	0,64%	0,58%	0,80%	72,52%	0,68%	85,32%		
	1 45%							



2.8 FUNDOS ARTIGO 8º I

AGOSTO 2017 ARTIGO 8º I - FUNDOS DE AÇÕES REFERENCIADOS - LIMITE DE APLICAÇÃO: 30%								
Fundo	Percentual da Carteira	Rentabilidade	Ibovespa	% Ibovespa	Meta Atuarial	%Meta Atuarial		
GF PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO	0,73%	1,62%	7,46%	21,69%	0,68%	237,95%		
	0,73%							

2.9 FUNDOS ARTIGO 8º III

AGOSTO 2017										
ARTIGO 8º III - FUNDO DE AÇÕES - LIMITE DE APLICAÇÃO: 15%										
Fundo	Percentual da Carteira	Rentabilidade	Ibovespa	% Ibovespa	Meta Atuarial	%Meta Atuarial				
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC FIA	0,58%	8,47%	7,46%	113,60%	0,68%	1246,24%				
AZ QUEST AÇÕES FIQ FIA	0,64%	8,03%	7,46%	107,68%	0,68%	1181,30%				
BB AÇÕES PIPE FIC FI	0,73%	6,93%	7,46%	92,89%	0,68%	1019,09%				
FIC AÇÕES VINCI VALOR DIVIDENDOS	1,21%	6,51%	7,46%	87,23%	0,68%	956,99%				
BTG ABSOLUTO INS FIQ FIA	2,33%	6,21%	7,46%	83,29%	0,68%	913,72%				
RIO SMALL CAPS FIA	0,47%	5,65%	7,46%	75,70%	0,68%	830,47%				
OCEANA SELECTION FIA	0,87%	5,34%	7,46%	71,61%	0,68%	785,65%				
KINEA PIPE FIA	0,57%	4,19%	7,46%	56,14%	0,68%	615,89%				
FIC CX AÇÔES VALOR SMALL CAP RPPS	0,00%	3,13%	7,46%	41,95%	0,68%	460,22%				
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	1,15%	0,93%	7,46%	12,50%	0,68%	137,08%				
8,55%										

2.10 FUNDOS ARTIGO 8º IV

AGOSTO 2017									
ARTIGO 8º VI - FUNDO DE INVESTIMENTO EM MULTIMERCADO - LIMITE DE APLICAÇÃO: 5%									
Fundo	Rentabilidade CDI		%CDI	Meta Atuarial	%Meta Atuarial				
ITAÚ CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA	0,79%	1,78%	0,80%	222,36%	0,68%	261,60%			
FI MULTIMERCADO SCULPTOR CP	3,37%	0,50%	0,80%	61,88%	0,68%	72,80%			
	4,16%								







2.11 FUNDOS ARTIGO 8° V

AGOSTO 2017									
ARTIGO 8° V - FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES - FIP - LIMITE DE APLICAÇÃO: 5%									
Percentual da Rentabilidade CDI %CDI Meta Carteira Rentabilidade CDI %CDI Atuarial									
FIP LA SHOPPING CENTERS	0,61%	-0,002%	0,80%	-0,21%	0,68%	-0,24%			
CAM THRONE FIP	0,66%	-0,11%	0,80%	-14,34%	0,68%	-16,87%			
CONQUEST FIP	0,45%	-0,12%	0,80%	-14,94%	0,68%	-17,58%			
ATICO FLORESTAL FIP	0,94%	-0,145%	0,80%	-18,07%	0,68%	-21,26%			
FIP CX INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA	0,33%	-0,15%	0,80%	-19,32%	0,68%	-22,73%			
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIP	0,12%	-0,75%	0,80%	-93,30%	0,68%	-109,76%			
	3,11%								

2.12 FUNDOS ARTIGO 8° VI

AGOSTO 2017										
ARTIGO 8° VI - FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII - LIMITE DE APLICAÇÃO: 5%										
Fundo	Percentual da Carteira	Rentabilidade	CDI	%CDI	Meta Atuarial	%Meta Atuarial				
SÃO DOMINGOS FUNDO IMOBILIÁRIO	0,62%	0,09%	0,80%	11,26%	0,68%	13,25%				
ÁQUILLA FII	1,58%	-0,21%	0,80%	-25,83%	0,68%	-30,39%				
BB RPPS FII RB CAPITAL II	0,13%	-2,58%	0,80%	-321,99%	0,68%	-378,81%				
CAIXA RIO BRAVO FII	0,77%	-7,28%	0,80%	-909,92%	0,68%	-1070,49%				
	3,10%									

3- QUADRO COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Janeiro- 2017	Fevereiro- 2017	Março- 2017	Abril- 2017	Maio- 2017	Junho- 2017	Julho- 2017	Agosto- 2017	ACUMULADO	Projeção 12 meses
IPCA (%)	0,38%	0,33%	0,25%	0,14%	0,31%	-0,23%	0,24%	0,19%	1,62%	2,43%
Meta Atuarial (%)	0,87%	0,82%	0,74%	0,63%	0,80%	0,26%	0,73%	0,68%	5,66%	8,50%
Rentabilidade Média										
da Carteira(%)	1,49%	1,43%	0,92%	0,54%	-0,15%	0,76%	2,09%	1,01%	8,36%	12,54%
% Atingida da Meta										
Atuarial	171,26%	174,39%	124,32%	85,71%	-18,75%	290,85%	286,30%	148,53%	147,61%	147,62%









