



**DI BLASI**  
Consultoria Financeira

# INSTITUTO DE SEGURIDADE DO SERVIDOR MUNICIPAL CAMAÇARI

## Relatório Competência

### 07/2016

Alterar competência:  / 2016

## VISÃO GERAL

FUNDO	DISP. DE RESGATE	SALDO R\$	PARTICIPAÇÃO	QTDE. COTISTAS	% SOBRE PL DO FUNDO	PL DO FUNDO R\$	RESOLUÇÃO	GRAU DE RISCO
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 0	15.238.293,54	7,28 %	235	1,56 %	979.215.484,53	Art 7º, III "a"	Médio
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D + 0	51.266.055,53	24,48 %	1170	0,69 %	7.445.740.477,31	Art 7º ,I, "b"	Baixo
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO DI PREMIUM	D + 0	385.745,62	0,18 %	382	0,01 %	6.069.540.839,85	Art 7º , IV "a"	Baixo
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO DI PREMIUM	D + 0	11.147.657,52	5,32 %	382	0,18 %	6.069.540.839,85	Art 7º , IV "a"	Baixo
FIC FI LONGO PRAZO RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D + 902	11.766.465,01	5,62 %	3	60,71 %	19.381.988,67	Art 7º , VII, "b"	Alto
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	4.003.398,16	1,91 %	199	0,38 %	1.051.895.772,69	Art 7º ,I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	1.864.887,90	0,89 %	707	0,03 %	5.389.170.257,20	Art 7º ,I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	12.270.712,89	5,86 %	652	0,31 %	3.975.981.533,89	Art 7º ,I, "b"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	7.400.247,77	3,53 %	652	0,19 %	3.975.981.533,89	Art 7º ,I, "b"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	6.299.415,32	3,01 %	652	0,16 %	3.975.981.533,89	Art 7º ,I, "b"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	596.059,07	0,28 %	1325	0,01 %	9.339.414.827,38	Art 7º ,I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	32.069.588,40	15,31 %	1325	0,34 %	9.339.414.827,38	Art 7º ,I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	D + 0	4.470.629,00	2,13 %	748	0,10 %	4.387.677.840,35	Art 7º , IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	22.346.788,85	10,67 %	470	1,07 %	2.086.605.453,02	Art 7º , IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	8.071.531,95	3,85 %	470	0,39 %	2.086.605.453,02	Art 7º , IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	0,00	0,00 %	470	0,00 %	2.086.605.453,02	Art 7º , IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	D + 0	2.776.213,52	1,33 %	335	0,12 %	2.355.481.144,47	Art 7º, III "a"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	D + 0	5.394.861,49	2,58 %	335	0,23 %	2.355.481.144,47	Art 7º, III "a"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO SECURITY REFERENCIADO DI LONGO PRAZO CRÉDITO PRIVADO	D + 91	921.122,87	0,44 %	14	8,84 %	10.420.195,32	Art 7º , VII, "b"	Alto
NTN-F20170101	D + 270	11.123.701,34	5,31 %	1	1.112.370.134,00 %	1,00	Art 7º , I, "a"	Alto

**TOTAL SALDO:** R\$ 209.413.375,75

## ENQUADRAMENTO

RENDA FIXA - ARTIGOS	LIMITE DA RESOLUÇÃO	LIMITE POLÍTICA	TOTAL	% CARTEIRA
Art 7º, I, "a"	100 %	100 %	11.123.701,34	5,31
Art 7º, I, "b"	100 %	100 %	115.770.365,04	55,28
Art 7º, III "a"	80 %	80 %	23.409.368,55	11,18
Art 7º, IV "a"	30 %	30 %	46.422.352,94	22,17
Art 7º, VII, "b"	5 %	5 %	12.687.587,88	6,06

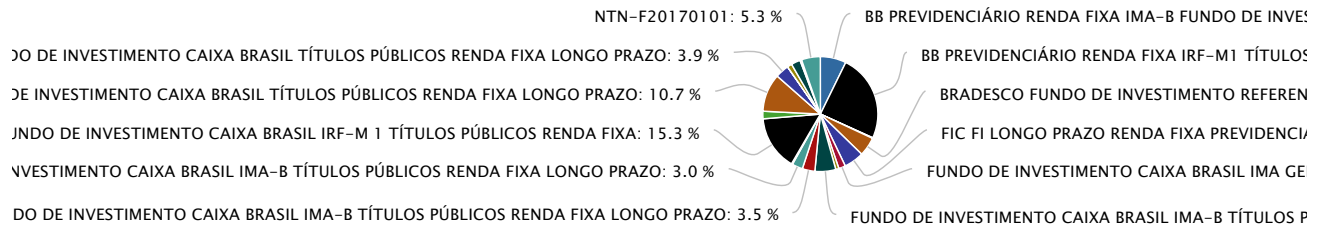
RENDA VARIÁVEL - ARTIGOS	LIMITE DA RESOLUÇÃO	LIMITE POLÍTICA	TOTAL	% CARTEIRA
--------------------------	---------------------	-----------------	-------	------------

DISTRIBUIÇÃO POR PARÂMETRO DE RENTABILIDADE	TOTAL	% CARTEIRA
CDI	46.422.352,94	22,17
CREDITO PRIVADO	12.687.587,88	6,06
IMA-B	49.379.744,53	23,58
IMA-B 5	1.864.887,90	0,89
IMA-GERAL	4.003.398,16	1,91
IRF-M1	83.931.703,00	40,08
NTN-F	11.123.701,34	5,31

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	TOTAL	% CARTEIRA
CNPJ:	11.123.701,34	5,31
BNY MELLON SERVICOS FINANCEIROS DTVM S.A.   CNPJ: 2201501000161	921.122,87	0,44
BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A   CNPJ: 30822936000169	66.504.349,07	31,76
GRADUAL CCTVM S/A   CNPJ: 33918160000173	11.766.465,01	5,62
CAIXA ECONOMICA FEDERAL   CNPJ: 360305000104	107.564.334,32	51,36
BANCO BRADESCO S.A.   CNPJ: 60746948000112	11.533.403,14	5,51

## DISTRIBUIÇÃO

## Visão Geral – Fundos de Investimento



Highcharts.com

## RETORNOS

FUNDO	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO R\$	RETORNO %	EFETIVO %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 14.872.104,95	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 15.238.293,54	R\$ 366.188,59	2,46225 %	2,46225 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 49.181.794,84	R\$ 1.567.894,84	R\$ 0,00	R\$ 51.266.055,53	R\$ 516.365,85	1,02792 %	1,02658 %
BRDESCO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 679.178,64	R\$ 17.609,38	R\$ 317.931,85	R\$ 385.745,62	R\$ 6.889,45	1,13440 %	1,15299 %
BRDESCO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 11.015.780,34	R\$ 11.862,97	R\$ 5.000,00	R\$ 11.147.657,52	R\$ 125.014,21	1,13440 %	1,32438 %
FIC FI LONGO PRAZO RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	R\$ 11.744.267,46	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 11.766.465,01	R\$ 22.197,55	0,18901 %	0,18901 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 3.938.682,73	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 4.003.398,16	R\$ 64.715,43	1,64307 %	1,64307 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 1.842.940,81	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 1.864.887,90	R\$ 21.947,09	1,19087 %	1,19087 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 11.973.587,69	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 12.270.712,89	R\$ 297.125,20	2,48151 %	2,48151 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 7.221.056,87	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 7.400.247,77	R\$ 179.190,90	2,48151 %	2,48151 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 6.146.880,18	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 6.299.415,32	R\$ 152.535,14	2,48151 %	2,48151 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	R\$ 589.973,51	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 596.059,07	R\$ 6.085,56	1,03150 %	1,03150 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	R\$ 31.742.168,94	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 32.069.588,40	R\$ 327.419,46	1,03150 %	1,03150 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	R\$ 6.173.526,90	R\$ 4.434.940,01	R\$ 6.234.357,45	R\$ 4.470.629,00	R\$ 96.519,54	1,10893 %	1,02726 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 22.104.402,54	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 22.346.788,85	R\$ 242.386,31	1,09655 %	1,09655 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 7.983.983,39	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 8.071.531,95	R\$ 87.548,56	1,09655 %	1,09655 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	1,09655 %	0,00000 %
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	R\$ 2.711.436,69	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 2.776.213,52	R\$ 64.776,83	2,38902 %	2,38902 %
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	R\$ 5.268.984,25	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 5.394.861,49	R\$ 125.877,24	2,38902 %	2,38902 %
FUNDO DE INVESTIMENTO SECURITY REFERENCIADO DI LONGO PRAZO CRÉDITO PRIVADO	R\$ 915.978,17	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 921.122,87	R\$ 5.144,70	0,56166 %	0,56166 %
NTN-F20170101	R\$ 11.554.070,35	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 11.123.701,34	R\$ -430.369,01	1,04394 %	1,04394 %
TOTAIS	R\$ 207.660.799,25	R\$ 6.032.307,20	R\$ 6.557.289,30	R\$ 209.413.375,75	R\$ 2.277.558,60	1,3487 %	1,3567 %

## RETORNOS ACUMULADO

MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO R\$	RETORNO %	META %	ATINGIMENTO %
JANEIRO	R\$ 184.655.366,80	R\$ 8.168.580,73	R\$ 6.512.159,45	R\$ 188.528.084,26	R\$ 2.216.296,18	1,2002 %	1,76 %	68,08 %
FEVEREIRO	R\$ 188.528.084,26	R\$ 10.202.348,80	R\$ 7.070.271,33	R\$ 194.073.615,78	R\$ 2.413.454,05	1,2802 %	1,39 %	92,02 %
MARÇO	R\$ 194.073.615,78	R\$ 8.536.127,91	R\$ 7.005.505,76	R\$ 199.405.078,53	R\$ 3.800.840,60	1,9585 %	0,92 %	213,14 %
ABRIL	R\$ 199.405.078,53	R\$ 6.727.706,59	R\$ 7.027.136,65	R\$ 202.458.421,21	R\$ 3.352.772,74	1,6814 %	1,10 %	152,88 %
MAIO	R\$ 202.458.421,21	R\$ 6.598.321,60	R\$ 6.313.819,37	R\$ 204.248.292,64	R\$ 1.505.369,20	0,7435 %	1,27 %	58,52 %
JUNHO	R\$ 204.248.292,64	R\$ 13.312.396,52	R\$ 12.443.967,06	R\$ 207.660.799,25	R\$ 2.544.077,15	1,2456 %	0,84 %	148,55 %
JULHO	R\$ 207.660.799,25	R\$ 6.032.307,20	R\$ 6.557.289,30	R\$ 209.413.375,75	R\$ 2.277.558,60	1,0968 %	1,01 %	108,67 %
AGOSTO	R\$ 209.413.375,75	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	0,0000 %	0,00 %	0,00 %
SETEMBRO	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	0,0000 %	0,00 %	0,00 %
OUTUBRO	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	0,0000 %	0,00 %	0,00 %
NOVEMBRO	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	0,0000 %	0,00 %	0,00 %
DEZEMBRO	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	0,0000 %	0,00 %	0,00 %
TOTAIS		R\$ 59.577.789,35	R\$ 52.930.148,92		R\$ 18.110.368,52	9,57	8,59	111,46

## CAPITAL PROTEGIDO

TIPO DE PRODUTO E PERCENTUAL DO CAPITAL INVESTIDO PROTEGIDO	
TIPO DE PRODUTO	PERCENTUAL DO CAPITAL
INVESTIDO PROTEGIDO	INVESTIDO PROTEGIDO (Até)
Títulos Públicos Federais/ Carteira Própria	100%
Fundos de Investimento Referenciado e Renda Fixa 100% Títulos Públicos Federais (previsto no regulamento do fundo)	100%
Fundos de Investimento Referenciado e Renda Fixa (50% de títulos públicos federais)	50%
Fundos de Investimentos Crédito Privado	0%
FIDC	0%
Fundos de Ações	0%
Fundos de Índices - ETF	0%
Fundos Multimercados	0%
Fundos Imobiliários	0%
Fundos de Participação	0%

PERCENTUAL MÍNIMO DE ALOCAÇÃO DA CARTEIRA TOTAL DO RPPS EM PRODUTOS COM CAPITAL INVESTIDO PROTEGIDO: 80% do Patrimônio Líquido do RPPS, apurado concomitantemente na data de fechamento dos dados para envio do DAIR ao Ministério da Previdência Social - MPS.