

RELATORIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS AGOSTO - 2016



Instituto de Previdência Social dos Servidores Públicos do Município de Antônio Carlos - SC



O Relatório de Gestão de Investimentos do Instituto de Previdência Social dos Servidores Públicos do Município de Antônio Carlos foi elaborado pela SMI Consultoria de Investimentos com o objetivo de apresentar de forma detalhada as informações relativas à carteira de investimentos do RPPS e, assim, auxiliar em seu processo de Gestão nas decisões mais importantes. As informações utilizadas neste relatório são obtidas pelos extratos oficiais das instituições financeiras em que o RPPS aloca seus recursos - além disso, são utilizados diversos softwares padrões do mercado financeiro.

Este Relatório também apresenta diversos indicadores de suma importância para o controle dos Gestores, Diretores e Conselheiros do Instituto, além de fornecer informações resumidas aos órgãos fiscalizadores, como a composição atual da carteira do Instituto, sua rentabilidade consolidada e detalhada por ativo, a comparação com a meta atuarial, seu enquadramento em relação à Resolução 3.922/2010 do Conselho Monetário Nacional, além de apresentar de forma minuciosa a composição de seus ativos e sua composição consolidada. Por fim, apresentamos um texto que analisa os principais eventos econômicos do mês.

Este relatório foi elaborado pela SMI Consultoria de Investimentos, para uso exclusivo do IPREANCARLOS, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa ou instituição sem a expressa autorização da SMI Consultoria. As informações contidas neste relatório são consideradas confiáveis na data na qual este relatório foi apresentado. Entretanto, as informações aqui contidas não representam por parte da SMI Consultoria garantia de exatidão das informações prestadas ou julgadas sobre a qualidade das mesmas. As opiniões contidas neste relatório são baseadas em julgamento e estimativas e são, portanto, sujeitas a mudança.

RELATORIO GERENCIAL

Distribuição da Carteira de Investimentos.....	4
Análise de Rentabilidade	5
Retorno da Carteira por Ativo (em Reais).....	6
Rentabilidade da Carteira (em %)	7
Distribuição da Carteira por Índices	8
Relatório de Movimentações	9

DEMONSTRATIVO DAS APLICAÇÕES E RELATÓRIO DE ENQUADRAMENTO

Demonstrativo das Aplicações e Investimentos dos Recursos.....	11
Enquadramento da Carteira em Relação à Resolução 3.922 e à Política de Investimento	12

RELATORIOS DE CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA

Consolidação das Carteiras de Fundos	14
Consolidação dos Ativos	18

TEXTO DE ECONOMIA MENSAL

Comentários do Mês	20
--------------------------	----

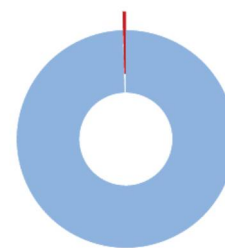
EXTRATOS BANCÁRIOS



ATIVOS	%	AGOSTO	JULHO
FUNDOS DE RENDA FIXA	99,5%	19.865.934,07	19.526.990,25
BB FIC Previdenciário Títulos Públicos IRF-M 1	11,5%	2.298.214,86	1.217.289,51
BB Previdenciário IPCA II Títulos Públicos	4,2%	845.329,33	1.150.005,99
BB Previdenciário IPCA III Títulos Públicos	13,9%	2.770.029,94	2.819.094,32
BB Previdenciário VII Títulos Públicos	3,1%	617.031,85	1.230.845,17
BNY Mellon Credit Master	0,1%	18.538,81	18.390,82
BNY Mellon Virtual Credit Yield	0,0%	7.154,46	7.035,33
Caixa Brasil Referenciado	4,9%	971.345,92	751.079,35
Caixa Brasil Títulos Públicos 2018 I	6,5%	1.307.267,85	1.329.930,00
Caixa Brasil Títulos Públicos 2020 III	4,0%	790.320,30	802.882,50
Caixa Brasil Títulos Públicos IRF-M 1	51,3%	10.240.700,75	10.200.437,26
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	0,5%	95.597,92	96.570,67
Caixa Ações Infraestrutura	0,2%	49.075,10	49.665,01
Caixa Small Caps Ativo	0,2%	46.522,82	46.905,66
CONTAS CORRENTES	0,0%	1.195,58	5.567,65
Banco do Brasil	0,0%	-	13,90
Caixa Econômica Federal	0,0%	1.195,58	5.553,75
TOTAL DA CARTEIRA	100%	19.962.727,57	19.629.128,57

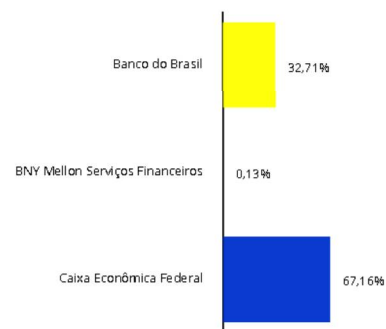
Distribuição da Carteira

Por Segmento



Fundos de Renda Fixa 99,52%
 Fundos de Renda Variável 0,48%
 Contas Correntes 0,01%

Por Instituição Financeira



Entrada de Recursos
 Saída de Recursos
 Nova Aplicação
 Resgate Total

Obs.: Não recebemos os extratos dos fundos BNY Mellon Credit Master e BNY Mellon Virtual Credit Yield. Portanto, o saldo atual foi calculado multiplicando a cota do dia 31/08/2016 pela quantidade de cotas do fechamento do mês de julho de 2016.



RENTABILIDADE POR INVESTIMENTO		NOM S		NO ANO		EM 252 DIAS ÚTEIS	
FUNDOS DE RENDA FIXA	Bench	Rent. %	% Meta	Rent. %	% Meta	Rent. %	% Meta
BB FIC Previdenciário Títulos Públicos IRF-M 1	IRF-M 1	1,16	146%	9,70	95%	14,60	90%
BB Previdenciário IPCA II Títulos Públicos	IDKa IPCA 3A	1,05	132%	11,73	114%	18,38	114%
BB Previdenciário IPCA III Títulos Públicos	IPCA + 6%	1,13	141%	10,15	99%	15,90	98%
BB Previdenciário VII Títulos Públicos	IMA-B	0,86	108%	11,11	108%	17,72	110%
Caixa Brasil Referenciado	CDI	1,21	151%	9,21	90%	14,14	88%
Caixa Brasil Títulos Públicos 2018 I	IPCA + 6%	1,08	136%	9,92	97%	15,54	96%
Caixa Brasil Títulos Públicos 2020 III	IMA-B	1,20	151%	14,26	139%	20,41	126%
Caixa Brasil Títulos Públicos IRF-M 1	IRF-M 1	1,17	147%	9,76	95%	14,74	91%

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	Bench	Rent. %	% Meta	Rent. %	% Meta	Rent. %	% Meta
Caixa Ações Infraestrutura	Sem bench	-1,19	-149%	40,66	396%	28,69	178%
Caixa Small Caps Ativo	SMLL	-0,82	-102%	21,82	213%	23,24	144%

Observação: Os fundos que não possuem histórico completo não apresentaram rentabilidade no respectivo período.

BENCHMARKS		NOM S		NO ANO		EM 252 DIAS ÚTEIS	
PRINCIPAIS INDICADORES		Rent. %	% Meta	Rent. %	% Meta	Rent. %	% Meta
CDI		1,21	152%	9,21	90%	14,13	88%
IMA Geral		1,03	129%	15,92	155%	19,78	122%
IMA-B		0,89	111%	20,11	196%	25,51	158%
IRF-M		0,98	122%	17,01	166%	18,72	116%
Ibovespa		1,03	130%	33,57	327%	24,18	150%
IBrX		1,12	140%	32,53	317%	23,14	143%
IBrX-50		0,93	116%	31,86	310%	21,26	132%
META ATUARIAL - INPC + 6 %		0,80		10,26		16,15	

