

ATA Nº 47 DE 10 JANEIRO DE 2017

COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Ata de reunião realizada na sede do PREVIG, ao dia 10 do mês de janeiro de 2017, às 10:30, dado início a reunião, com a palavra o Sr. Allan Simonaci – Presidente do Instituto, agradece a presença de todos presentes e pela atenção que tem dado ao PREVIG, foi apresentado o extrato consolidado de ativos atualizados totalizando o patrimônio da Autarquia em R\$ 45.939.422,03 para apreciação de todos os presentes. Sobre a composição do Comitê, sendo o Sr. Allan Simonaci eleito Presidente do Comitê de Investimento pela maioria absoluta e Gestor de Recursos do PREVIG por possuir certificado CPA-10 conforme exigência do MTPS, Secretária a Senhora Vanessa da Silva Ferreira dos Santos, membros a Senhora Rosana Aparecida Rodrigues Alves e o Senhor Rogério Maia Vieira. Nada mais havendo a tratar eu Vanessa da Silva Ferreira dos Santos, lavrei e assino a presente Ata juntamente com os demais presentes que assim quiseram assinar, Iguaba Grande/RJ, 10 de janeiro de 2017.

Vanessa da Silva Ferreira dos Santos - Secretária

Rosana Aparecida Rodrigues Alves – Membro Comitê de Investimento.

Rogério Maia Vieira – Membro Comitê de Investimento.

Allan Simonaci – Presidente do Comitê de Investimento.

Cliente: Iguaçu Grande RJ
Data Início: 31/12/2015

Data Extrato: 02/01/2017

Índice de comparação: INPC + 6%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos												
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (02/01/2017)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo		
Renda Fixa												
BB DTVM	CEF	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	7,35%	0,64%	0,00%	0,64%	8.724.860,88	18,99%	5.066.081.669,19	0,17%		
		FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP	7,33%	0,62%	-0,01%	0,62%	2.332.774,90	5,08%	4.746.026.595,96	0,05%		
		FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	2,60%	0,22%	-0,00%	0,22%	8.083.092,91	17,60%	5.471.615.674,59	0,15%		
		BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI	10,46%	0,84%	1,665,83%	0,84%	4.835.591,81	10,53%	1.061.060.393,62	0,46%		
		BB DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B5+ TP RF LP	10,43%	0,84%	-0,01%	0,84%	6.843.415,80	14,90%	749.915.742,26	0,91%
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FUNDOS 100% TP (IMA ou IDKA)						30.819.736,30	67,09%			
		BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,78%	0,25%	0,02%	0,25%	75.838,44	0,17%	281.880.778,00	0,03%
		CEF	CEF	CAIXA NOVO BRASIL FIC IMA-B RF LP	6,85%	0,62%	-0,01%	0,62%	4.409.879,86	9,60%	2.301.304.664,77	0,19%
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a - FUNDOS DE INVEST RENDA FIXA REF (IMA ou IDKA)						4.485.718,30	9,76%			
		INFINITY ADM REC	BRB DTVM	INFINITY LOTUS FI RF	5,49%	-0,16%	-310,47%	-0,16%	2.808.180,32	6,11%	72.086.593,66	3,90%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - RF e REFERENCIAL LIVRE						2.808.180,32	6,11%					
PETRA CTVM	PETRA CTVM	FIDC PREMIUM SEN 1	9,64%	-0,00%	-0,04%	-0,00%	299.068,44	0,65%	106.547.242,70	0,28%		
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a - FIDC FECHADO						299.068,44	0,65%					
Sub-total Renda Fixa - FIDC FECHADO						38.412.703,37	83,62%					
Renda Variável												
CEF	CEF	FIA CAIXA DIVIDENDOS	23,27%	-0,60%	0,46%	-0,60%	56.534,65	0,12%	32.165.351,43	0,18%		
		GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FIA	23,30%	-1,48%	-0,42%	-1,48%	269.094,52	0,59%	260.133.036,55	0,10%		
GER FUT GEST REC	GER FUT GEST REC	AZ LEGAN BRASIL FIA	22,64%	-1,06%	0,00%	-1,06%	3.218.826,26	7,01%	52.695.250,92	6,11%		
AZ LEGAN ADM REC	BEM DTVM	Sub-total Artigo 8º III - FUNDO DE AÇÕES						3.544.455,43	7,72%			
MORE INVEST	BRB DTVM	FIP LSH	15,35%	-0,00%	-0,04%	-0,00%	1.997.805,36	4,35%	417.189.747,80	0,48%		
		Sub-total Artigo 8º V - FUNDO INVEST EM PARTICIPAÇÕES						1.997.805,36	4,35%			
ÁTICO ADM REC	GRADUAL CCTVM	ATICO RENDA FII	9,05%	-0,02%	-34,86%	-0,02%	1.984.457,88	4,32%	88.360.293,85	2,25%		
Sub-total Artigo 8º VI - FUNDO INVEST IMOBILIÁRIO						1.984.457,88	4,32%					



Cliente: Iguaíba Grande RJ
Data Início: 31/12/2015

Data Extrato: 02/01/2017
Índice de comparação: INPC + 6%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

		Posição de Ativos								
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (02/01/2017)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
		Sub-total Renda Variável								
		7.526.718,67							16,38%	
		45.939.422,03								100%
Total										



Cliente: Iguaba Grande RJ
Data Início: 31/12/2015

Data Extrato: 02/01/2017
Índice de comparação: INPC + 6%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira				
Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Política Investimento
Renda Fixa				
Artigo 7º I, Alínea b	FUNDOS 100% TP (IMA ou IDKA)	30.819.736,30	67,09%	90,00%
Artigo 7º III, Alínea a	FUNDOS DE INVEST RENDA FIXA REF (IMA ou IDKA)	4.485.718,30	9,76%	50,00%
Artigo 7º IV, Alínea a	RF e REFERENCIAL LIVRE	2.808.180,32	6,11%	30,00%
Artigo 7º VII, Alínea a	FIDC FECHADO	299.068,44	0,65%	2,00%
Total Renda Fixa		38.412.703,37	83,61%	
Renda Variável				
Artigo 8º III	FUNDO DE AÇÕES	3.544.455,43	7,72%	15,00%
Artigo 8º V	FUNDO INVEST EM PARTICIPAÇÕES	1.997.805,36	4,35%	5,00%
Artigo 8º VI	FUNDO INVEST IMOBILIÁRIO	1.984.457,88	4,32%	5,00%
Total Renda Variável		7.526.718,67	16,39%	



Ciente: Iguaba Grande RJ

Data Início: 31/12/2015

Data Extrato: 02/01/2017

Índice de comparação: INPC + 6%

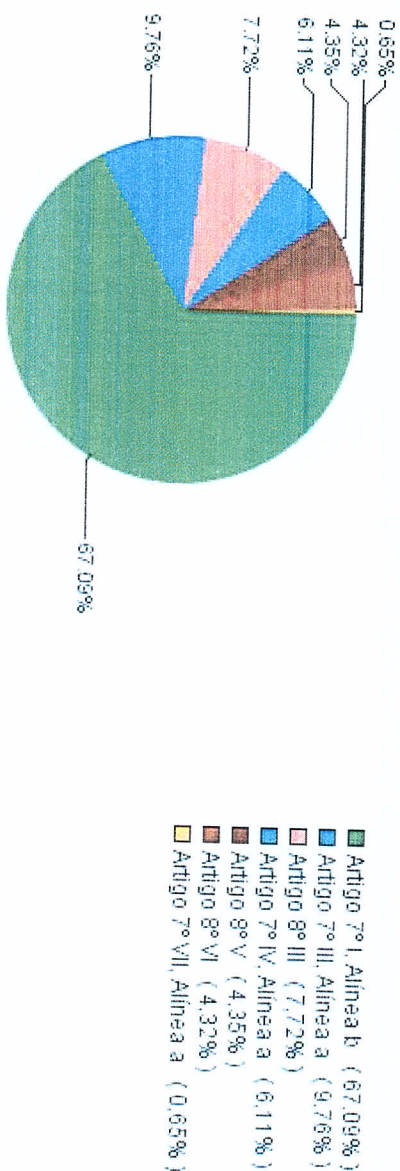
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)					Ganhos Financeiros	
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses	Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b	0,60	0,60	21,19	--	Artigo 7º I, Alínea b	184.683,72
% do CDI	1.188,6	1.188,6	150,7	--		
Artigo 7º III, Alínea a	0,61	0,61	22,80	--	Artigo 7º III, Alínea a	27.403,35
% do CDI	1.211,9	1.211,9	162,2	--		
Artigo 7º IV, Alínea a	-0,16	-0,16	14,33	--	Artigo 7º IV, Alínea a	-4.428,91
% do CDI	-310,5	-310,5	101,9	--		
Artigo 7º VII, Alínea a	-0,00	-0,00	-4,56	--	Artigo 7º VII, Alínea a	-9,70
% do CDI	-6,4	-6,4	-32,4	--		
Artigo 8º III	-1,08	-1,08	6,13	--	Artigo 8º III	-38.791,72
Var. IBOVESPA p.p	-0,0	-0,0	-31,3	--		
Artigo 8º V	-0,00	-0,00	--	--	Artigo 8º V	-19,39
Var. IBOVESPA p.p	1,1	1,1	--	--		
Artigo 8º VI	0,00	0,00	--	--	Artigo 8º VI	-350,91
Var. IBOVESPA p.p	1,1	1,1	--	--		
Total					Total	168.486,45

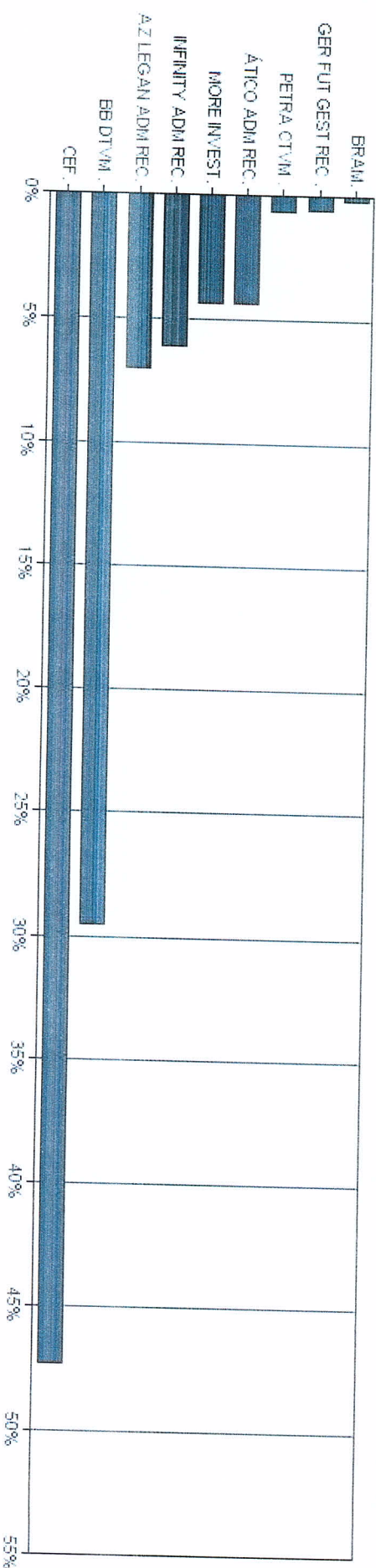


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia



Alocação por Gestor



[Handwritten signature]

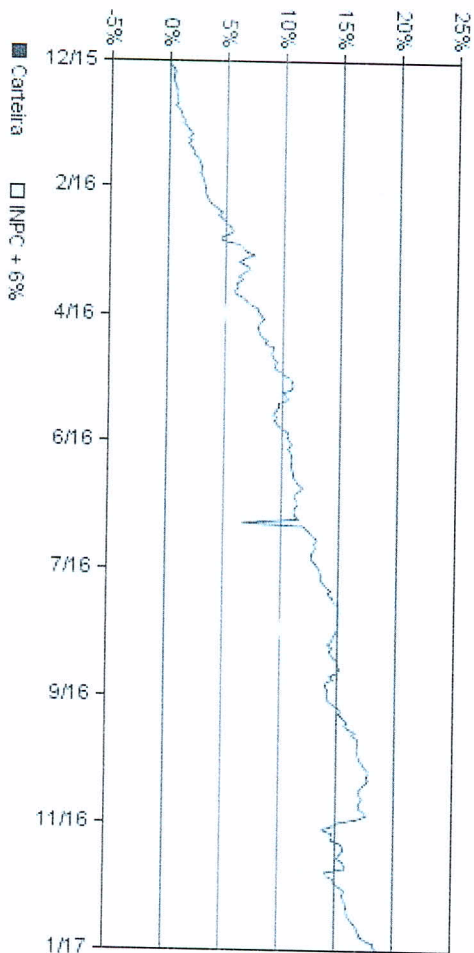
Cliente: Iguaçu Grande RJ
Data Início: 31/12/2015

Data Extrato: 02/01/2017
Índice de comparação: INPC + 6%

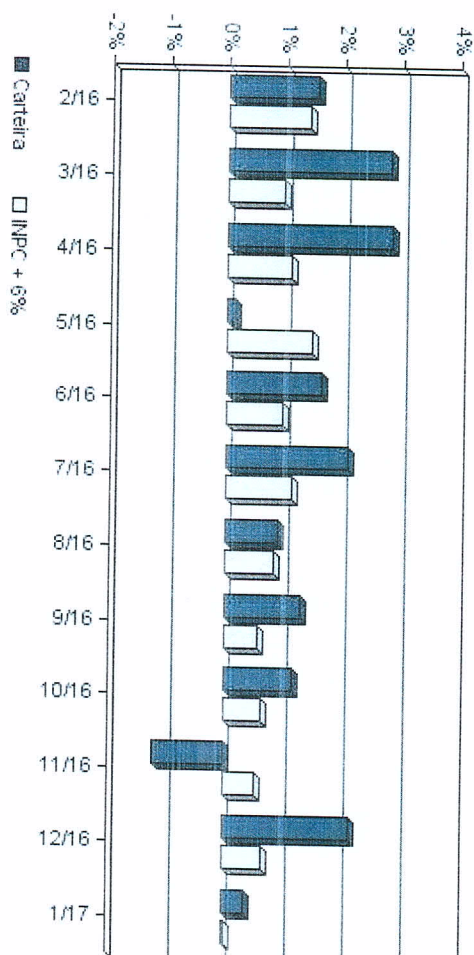
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira													
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2016													
INPC + 6%	1,72	1,55	2,79	2,83	0,13	1,62	2,11	0,89	1,30	1,17	-1,22	2,17	18,38
P.P. Índx	1,98	1,39	0,95	1,11	1,47	0,98	1,13	0,84	0,57	0,63	0,53	0,65	12,95
	-0,26	0,15	1,83	1,73	-1,34	0,64	0,98	0,04	0,73	0,54	-1,75	1,52	5,43
2017													
INPC + 6%	0,37	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	0,37
P.P. Índx	0,02	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	0,02
	0,34	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	0,34

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Cliente: Iguaba Grande RJ
Data Início: 31/12/2015

Data Extrato: 02/01/2017
Índice de comparação: INPC + 6%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco / Retorno da Carteira

Meses acima do Benchmark	Meses abaixo do Benchmark	Qtd.	Perct.	Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
					Carteira	INPC + 6%	P.P. Índx.	
10	76,9%	3	23,1%	03 meses	2,48	1,85	0,6	6,266
				06 meses	6,65	4,41	2,2	10,543
				12 meses	18,82	12,97	5,8	8,248
				24 meses	--	--	--	--
				36 meses	--	--	--	--
				Desde o início	18,82	12,97	5,8	8,248

Maior rentabilidade da Carteira
Menor rentabilidade da Carteira

2,83%
-1,22%

abr/16
nov/16

Análise dos Fundos & Ativos da Carteira

Fundo / Indexador	Rentabilidades em Períodos Fechados (%)						
	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	0,64	0,64	2,88	7,72	25,31	25,31	25,31
Var. do IMA-B TOTAL P.P.	0,00	0,00	-0,07	-0,08	-0,30	-0,30	-0,30
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP	0,62	0,62	2,97	7,75	17,04	17,04	17,04
Var. do IMA-B TOTAL P.P.	-0,01	-0,01	0,02	-0,05	-0,11	-0,11	-0,11
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	0,22	0,22	2,45	5,89	15,45	15,45	15,45
Var. do IMA-B 5 P.P.	-0,00	-0,00	-0,04	-0,10	-0,29	-0,29	-0,29
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5 + TP FI	0,84	0,84	3,10	8,93	31,84	31,84	31,84
% do CDI	1,665,83	1,665,83	94,17	130,93	226,48	226,48	226,48
FI CAIXA BRASIL IMA-B5 + TP RF LP	0,84	0,84	3,14	8,93	31,65	31,65	31,65
Var. do IMA-B 5 + P.P.	-0,01	-0,01	-0,06	-0,12	-0,50	-0,50	-0,50
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	0,25	0,25	2,50	5,88	14,17	14,17	14,17
Var. do IMA-B 5 P.P.	0,02	0,02	0,01	-0,11	-0,13	-0,13	-0,13
CAIXA NOVO BRASIL FIC IMA-B RF LP	0,62	0,62	3,11	7,92	24,91	24,91	24,91
Var. do IMA-B TOTAL P.P.	-0,01	-0,01	0,16	0,11	-0,69	-0,69	-0,69
INFINITY LOTUS FI RF	-0,16	-0,16	3,33	7,53	15,33	15,33	15,33
% do CDI	-310,47	-310,47	101,03	110,39	109,07	109,07	109,07

Cliente: Iguaba Grande RJ
Data Início: 31/12/2015

Data Extrato: 02/01/2017
Índice de comparação: INPC + 6%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise dos Fundos & Ativos da Carteira							
Rentabilidades em Períodos Fechados (%)							
Fundo / Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FIDC PREMIUM SEN I	-0,00	-0,00	-2,49	-9,98	-13,49	-13,49	-13,49
Var. do IPCA + 6% p.p.	-0,04	-0,04	-4,73	-14,80	-26,17	-26,17	-26,17
FIA CAIXA DIVIDENDOS	-0,60	-0,60	-3,34	1,98	14,14	14,14	14,14
Var. do IBOVESPA p.p.	0,46	0,46	-5,43	-12,10	-23,32	-23,32	-23,32
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FIA	-1,48	-1,48	-0,96	8,97	-3,09	-3,09	-3,09
Var. do IBOVESPA p.p.	-0,42	-0,42	-3,05	-5,11	-40,55	-40,55	-40,55
AZ LEGAN BRASIL FIA	-1,06	-1,06	2,37	12,16	17,24	17,24	17,24
Var. do IBOVESPA p.p.	0,00	0,00	0,28	-1,92	-3,33	-3,33	-3,33
FIP LSH	-0,00	-0,00	-0,04	-0,11	-0,11	-0,11	-0,11
Var. do IPCA + 6% p.p.	-0,04	-0,04	-2,28	-4,48	-4,48	-4,48	-4,48
ATICO RENDA FII	-0,02	-0,02	-0,20	-0,77	-0,78	-0,78	-0,78
% do CDI	-34,86	-34,86	-5,95	-11,35	-11,30	-11,30	-11,30
CDI	0,05	0,05	3,29	6,82	14,06	29,09	43,05
IMA-B 5	0,22	0,22	2,49	5,99	15,74	33,52	49,32
IMA-B 5+	0,85	0,85	3,20	9,05	32,15	39,56	63,46
IMA-B TOTAL	0,63	0,63	2,95	7,80	25,60	36,64	57,03
IMA-GERAL TOTAL	0,34	0,34	3,15	7,40	21,41	32,60	49,25
IRF-M 1	0,06	0,06	3,28	6,79	14,79	29,66	43,38
IRF-M 1+	0,44	0,44	3,97	8,81	30,21	34,26	50,50
IRF-M TOTAL	0,33	0,33	3,76	8,15	23,78	32,44	47,74
IBOVESPA	-1,06	-1,06	2,09	14,08	37,46	22,83	18,37

Cliente: Iguaçu Grande RJ
Data Início: 31/12/2015

Data Extrato: 02/01/2017
Índice de comparação: INPC + 6%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise dos Fundos & Ativos da Carteira								
Rentabilidades em Períodos Fechados (%)								
Fundo / Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	
IFIX	0,43	0,43	3,08	13,66	32,86	39,08	36,05	
SMALL CAP	-0,45	-0,45	-2,98	11,48	31,16	4,24	-13,58	
INPC + 6%	0,02	0,02	1,85	4,41	12,97	33,07	49,94	
IPCA + 6%	0,04	0,04	2,24	4,82	12,68	32,03	49,00	

