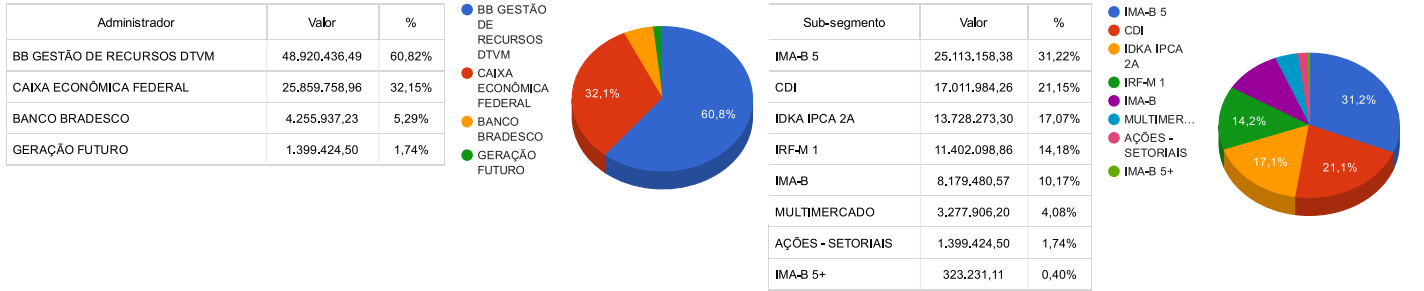




FUNDO DE APOSENTADORIA E PENSÕES DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE PATY DO ALFERES

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/06/2016

Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (junho / 2016)

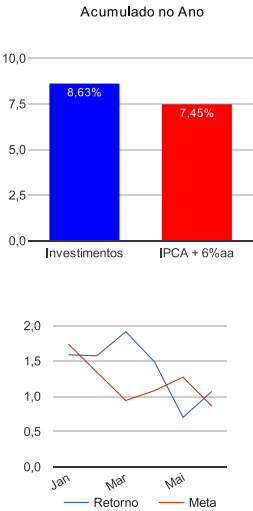


FUNDO DE APOSENTADORIA E PENSÕES DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE PATY DO ALFERES

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/06/2016

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	73.806.486,02	1.721.103,00	1.637.423,55	75.063.575,93	1.173.410,46	1,59%	1,74%	91,30%	1,46%
Fevereiro	75.063.575,93	9.597.592,55	9.535.621,95	76.308.291,77	1.182.745,24	1,57%	1,34%	117,12%	1,53%
Março	76.308.291,77	17.487.895,83	17.395.524,34	77.863.862,01	1.463.198,75	1,92%	0,94%	203,27%	1,61%
Abril	77.863.862,01	3.969.627,66	3.906.952,84	79.087.639,71	1.161.102,88	1,49%	1,08%	138,43%	1,12%
Maio	79.087.639,71	2.396.014,64	2.508.342,35	79.529.740,28	554.428,28	0,70%	1,27%	55,18%	1,03%
Junho	79.529.740,28	1.287.270,72	1.230.902,94	80.435.557,18	849.449,12	1,07%	0,86%	123,85%	0,99%
Acumulado no ano					6.384.334,73	8,63%	7,45%	115,73%	
Acumulado no 2º Trimestre					2.564.980,28	3,29%	3,24%	101,53%	





FUNDO DE APOSENTADORIA E PENSÕES DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE PATY DO ALFERES

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/06/2016

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de junho / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1.685.750,25	0,00	0,00	1.718.523,54	32.773,29	1,94%	2,41%	1,94%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	2.491.205,47	0,00	0,00	2.537.413,69	46.208,22	1,85%	2,35%	1,85%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.269.806,66	0,00	0,00	4.319.518,76	49.712,10	1,16%	0,02%	1,16%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.465.092,26	0,00	0,00	2.492.763,00	27.670,74	1,12%	0,09%	1,12%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.958.554,37	0,00	0,00	6.021.476,42	62.922,05	1,06%	0,12%	1,06%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.902.735,02	56.700,00	408.966,49	12.686.800,94	136.332,41	1,05%	0,27%	1,07%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.325.545,12	0,00	0,00	5.380.622,44	55.077,32	1,03%	0,12%	1,03%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.100.078,11	29.718,51	0,00	12.240.857,58	111.060,96	0,92%	1,11%	0,92%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	12.702.630,25	54.116,49	0,00	12.872.300,80	115.554,06	0,91%	1,11%	0,91%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.616.550,68	0,00	0,00	13.728.273,30	111.722,62	0,82%	1,18%	0,82%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.422.854,18	0,00	0,00	1.430.780,34	7.926,16	0,56%	3,00%	0,56%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	321.852,83	0,00	323.231,11	1.378,28	0,43%	3,15%	2,55%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.203,70	824.882,89	821.936,45	5.664,56	1.514,42	0,18%	0,11%	1,17%
Total Renda Fixa					759.852,63	1,01%	0,85%	



FUNDO DE APOSENTADORIA E PENSÕES DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE PATY DO ALFERES

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/06/2016

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de junho / 2016

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.346.818,01	0,00	0,00	1.399.424,50	52.606,49	3,91%	10,83%	3,91%
CAIXA BRASIL IPCA I FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	3.240.916,20	0,00	0,00	3.277.906,20	36.990,00	1,14%	0,09%	1,14%
Total Renda Variável					89.596,49	1,93%	3,30%	



FUNDO DE APOSENTADORIA E PENSÕES DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE PATY DO ALFERES

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/06/2016

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	16.973.378,82	54.116,49	4.645.000,00	12.872.300,80	489.805,49	3,28%	3,28%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.212.958,91	110.816,49	1.051.666,49	12.686.800,94	414.692,03	3,20%	3,22%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.624.025,81	3.729.226,04	0,00	13.728.273,30	375.021,45	2,83%	3,26%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.360.581,72	1.529.718,51	0,00	12.240.857,58	350.557,35	3,15%	3,26%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.832.005,79	0,00	0,00	6.021.476,42	189.470,63	3,25%	3,25%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.244.503,75	0,00	32.043,77	5.380.622,44	168.162,46	3,22%	3,22%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.177.923,19	0,00	0,00	4.319.518,76	141.595,57	3,39%	3,39%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	2.400.993,42	0,00	0,00	2.537.413,69	136.420,27	5,68%	5,68%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1.622.232,83	0,00	0,00	1.718.523,54	96.290,71	5,94%	5,94%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.413.390,80	0,00	0,00	2.492.763,00	79.372,20	3,29%	3,29%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.369.853,80	0,00	0,00	1.430.780,34	60.926,54	4,45%	4,45%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.942,66	1.907.182,66	1.917.487,87	5.664,56	3.027,11	0,46%	3,20%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	321.852,83	0,00	323.231,11	1.378,28	0,43%	7,31%
Total Renda Fixa					2.506.720,09	3,42%	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IPCA I FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	3.175.151,40	0,00	0,00	3.277.906,20	102.754,80	3,24%	3,24%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.443.919,11	0,00	0,00	1.399.424,50	-44.494,61	-3,08%	-3,08%
Total Renda Variável					58.260,19	1,26%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.511.671,24	0,00	11.521.926,07	0,00	1.010.254,83	9,61%	15,96%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.275.573,77	210.816,49	2.634.511,77	12.686.800,94	834.922,45	6,42%	6,49%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.569.228,31	5.362.240,18	0,00	13.728.273,30	796.804,81	7,70%	8,36%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.625.809,01	10.012.726,70	0,00	12.240.857,58	602.321,87	8,29%	8,66%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.869.085,64	0,00	5.335.862,54	0,00	466.776,90	9,59%	15,68%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	438.919,98	16.613.722,75	4.645.000,00	12.872.300,80	464.658,07	7,65%	8,75%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.607.639,97	0,00	0,00	6.021.476,42	413.836,45	7,38%	7,38%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.229.848,47	830.501,41	32.043,77	5.380.622,44	352.316,33	7,18%	7,34%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	2.188.753,63	0,00	0,00	2.537.413,69	348.660,06	15,93%	15,93%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.019.142,38	27.173,62	0,00	4.319.518,76	273.202,76	6,75%	6,75%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1.484.749,64	0,00	0,00	1.718.523,54	233.773,90	15,75%	15,75%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	8.293.176,38	2.544,89	8.483.008,19	0,00	187.286,92	2,26%	15,44%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.382.054,44	0,00	70.569,49	2.492.763,00	181.278,05	7,74%	7,77%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.305.983,85	0,00	40.641,77	1.430.780,34	165.438,26	12,90%	12,94%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	374.176,96	3.077.925,53	3.451.204,37	5.664,56	4.766,44	0,80%	6,27%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	321.852,83	0,00	323.231,11	1.378,28	0,43%	20,67%
Total Renda Fixa					6.337.676,38	9,13%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 2016

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IPCA I FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	3.031.608,60	0,00	0,00	3.277.906,20	246.297,60	8,12%	8,12%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.599.063,75	0,00	0,00	1.399.424,50	-199.639,25	-12,48%	-12,48%
Total Renda Variável					46.658,35	1,01%	

PATY PREVI

FUNDO MUNICIPAL DE APOSENTADORIAS E PENSÕES

O Diretor-Presidente do Paty Previ, atendendo a exigência da Portaria No. 440/2013 MPS, vem através deste demonstrar a composição da carteira de investimentos do Fundo de Previdência, conforme abaixo.

Referência Junho de 2016

Total da Carteira: 80.435.557,18

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922/2010 - 4.392/2014
<u>BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO</u>	D+1	Não há	13.728.273,30	17,07%	738	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
<u>CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP</u>	D+0	Não há	12.240.857,58	15,22%	701	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
<u>BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO</u>	D+2	Não há	323.231,11	0,40%	215	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
<u>BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA</u>	D+1	Não há	2.537.413,69	3,15%	111	0,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
<u>CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA</u>	D+0	Não há	6.021.476,42	7,49%	1.331	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
<u>BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO</u>	D+0	Não há	5.380.622,44	6,69%	1.175	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
<u>BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP</u>	D+1	Não há	12.872.300,80	16,00%	288	0,73%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
<u>BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA</u>	D+1	Não há	1.718.523,54	2,14%	77	0,17%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922/2010 - 4.392/2014
<u>BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO</u>	D+0	Não há	12.686.800,94	15,77%	824	0,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
<u>BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO</u>	D+0	Não há	5.664,56	0,01%	573	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
<u>BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO</u>	D+0	15/08/2022	2.492.763,00	3,10%	116	0,52%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
<u>BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO</u>	D+0	15/08/2022	1.430.780,34	1,78%	95	0,40%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
<u>CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP</u>	D+0	Não há	4.319.518,76	5,37%	3.283	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
<u>GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES</u>	D+4	Não há	1.399.424,50	1,74%	3.282	0,59%	Artigo 8º, Inciso III
<u>CAIXA BRASIL IPCA I FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO</u>	D+0	24/10/2016	3.277.906,20	4,08%	21	3,60%	Artigo 8º, Inciso IV