

CENÁRIO ECONÔMICO

INFLAÇÃO E POLÍTICA MONETÁRIA

Em março de 2016, o IPCA registrou taxa de 0,43%, abaixo da variação de 0,90% no mês anterior, o menor para o mês desde 2012. Nos últimos 12 meses, o índice avançou 9,39%, abaixo do acumulado de 10,36% nos 12 meses imediatamente anteriores. O destaque para o mês foi a divulgação pelo BC do Relatório Trimestral de Inflação. O relatório reiterou que “as condições atuais não permitem trabalhar com a hipótese de flexibilização monetária” e reforçou a mensagem de que faria o necessário para que a inflação permanecesse dentro do limite da meta em 2016. No entanto, o BC ressalta que há incertezas associadas ao balanço de riscos, principalmente, em relação ao comportamento das expectativas inflacionárias e das taxas observadas dos índices de preços.

BOLSA

No trimestre de Janeiro a Março/16, a bolsa subiu 15,47%, maior valorização em um trimestre desde 1999. A maior parte da valorização trimestral ocorreu em Março e os investidores responderam aos desdobramentos do cenário político. Além disso, só em março o fluxo de investimento estrangeiro na bolsa foi positivo de R\$ 8 bilhões. No trimestre, a entrada de fluxo de investimento estrangeiro na renda variável foi em torno de 10 bilhões. As maiores altas no mês de março foram as ações USIM5 (104,54%), GOAU4 (100,83%) e GGBR4 (84,70%). As maiores baixas ficaram com as ações FIBR3 (-34,05%), SUZB5 (-23,27%) e EMBR3 (-20,89%).

ECONOMIA BRASILEIRA

O nível de atividade permaneceu fraco no primeiro trimestre de 2016, com a mediana das projeções, segundo o Focus, apontando recessão de 3,7% nesse ano. Uma das variáveis que mais tem impactado o PIB é a produção industrial, que em fevereiro recuou 2,5%, após esboçar um pequeno avanço em janeiro. O setor de veículos automotivos teve a maior contribuição para a queda, seguido pelo setor de equipamentos de informática e produtos eletrônicos. Pela mediana das projeções Focus, a expectativa já é de queda de 5,6% na produção industrial em 2016. Concomitantemente, a taxa de desemprego medida pela PME aumentou para 8,2% em fevereiro, a maior para o mês desde 2009. Neste mês, o número de desempregados chegou a 2 milhões de brasileiros, um aumento de 7,2% em relação ao mês anterior, ou 136 mil pessoas a mais.

CENÁRIO EXTERNO

Nos EUA a taxa de desemprego teve leve alta, para 5,0% (ante 4,9% no mês anterior). A expectativa era que a taxa se mantivesse no mesmo patamar de fevereiro. O CPI registrou deflação de -0,2% em fevereiro, sendo o setor de energia o maior responsável pelo recuo. Em março, o FED decidiu pela manutenção da taxa de juros em 0,5% a.a. e sinalizou mais dois aumentos de taxa até o final do ano, sendo que a expectativa para o fim de 2016 é a taxa fechar em 0,875% a.a.. Na China, o destaque é para o aumento do PMI industrial, que registrou a primeira alta após oito meses. Na Europa, o pacote lançado para estimular a economia foi maior que o esperado pelo mercado. Entre as medidas estão o corte na taxa de juros para 0,0% a.a., a expansão do afrouxamento monetário (QE) e incentivos para os bancos aumentarem a concessão de crédito.

COMPOSIÇÃO DA AMOSTRA E MÉTODO DO ESTUDO

A amostra utilizada no estudo é composta por planos de benefícios da modalidade benefício definido que somados possuem um patrimônio superior à R\$ 17 bilhões. As rentabilidades apresentadas neste estudo consideram apenas os ativos integrantes dos segmentos de renda fixa e variável e são estimadas com base nas carteiras de investimentos no fechamento de cada mês.

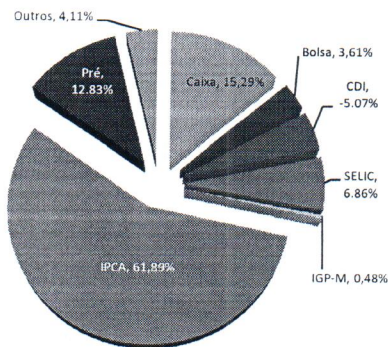
Este relatório foi elaborado através da composição das carteiras próprias dos RPPS e das carteiras abertas de cada um dos fundos de investimentos nos quais possuem aplicação.

DESEMPENHO EM RELAÇÃO AOS ÍNDICES DE MERCADO

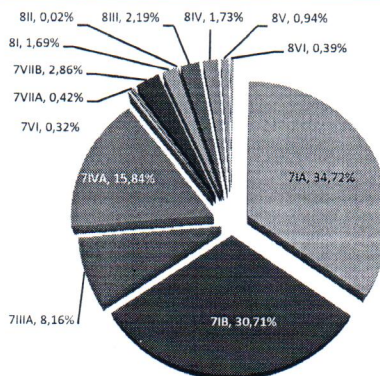
Na tabela abaixo, apresentamos o índice de sucesso dos planos da amostra, ou seja, o percentual dos planos cujo desempenho no mês ou no ano, em cada segmento de aplicação, conseguiu superar um benchmark “geral”, para fins comparativos.

Planos BD	Renda Fixa		Renda Variável		Consolidado	
	30% CDI + 70% IMA-B (Benchmark “Geral”)		IBOVESPA (Benchmark “Geral”)		INPC + 6% a.a. (Benchmark “Geral”)	
	mar-16	2016	mar-16	2016	mar-16	2016
	6%	8%	19%	16%	97%	78%

EXPOSIÇÃO AOS FATORES DE RISCO

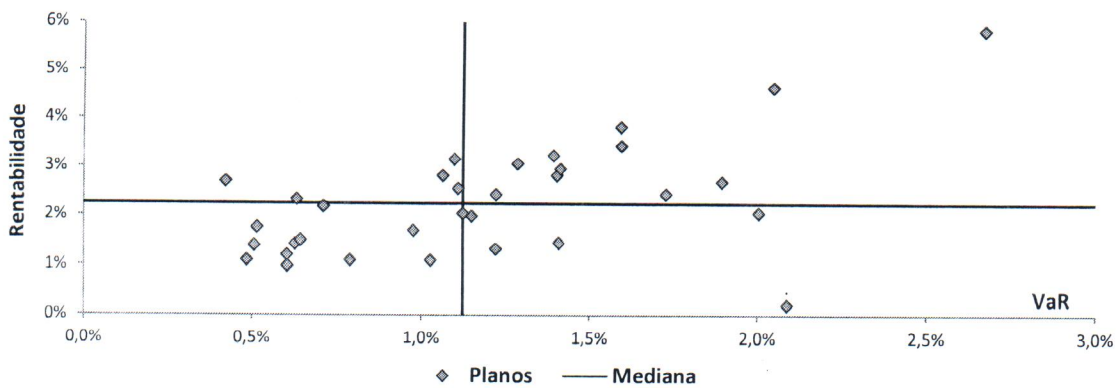
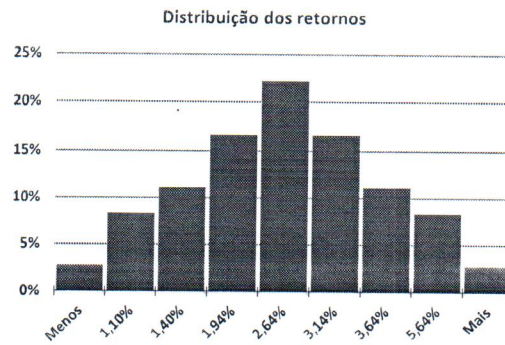
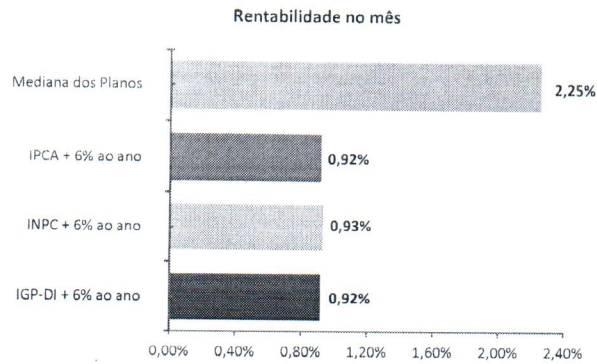


EXPOSIÇÃO RESOLUÇÃO CMN 3.922/10

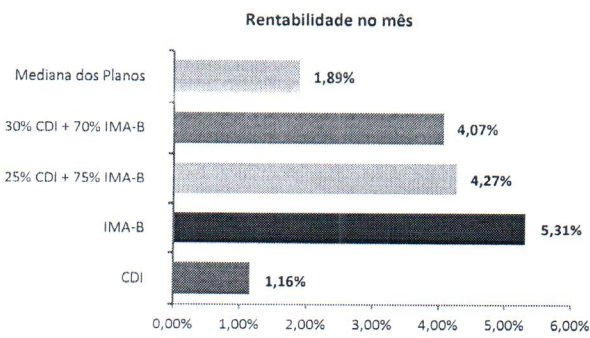


DESEMPENHO DOS PLANOS

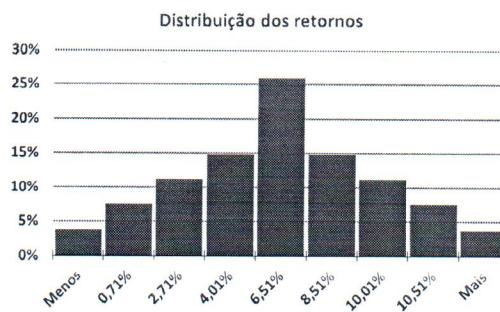
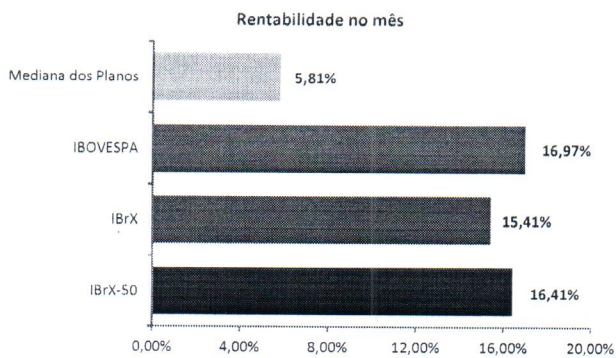
CONSOLIDADO



RENDA FIXA

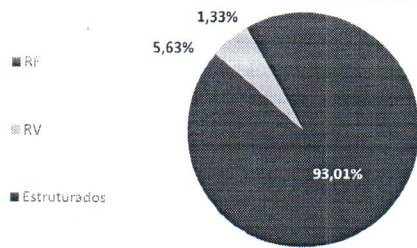


RENDA VARIÁVEL

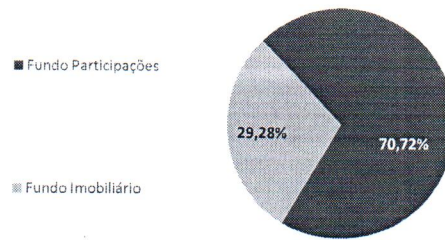


COMPOSIÇÕES

FUNDOS DE INVESTIMENTO + CARTEIRAS PRÓPRIAS

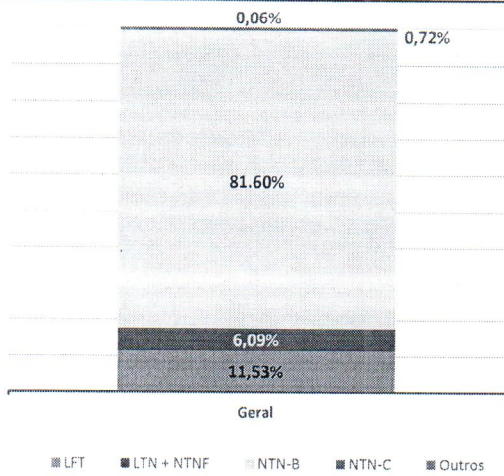


INVESTIMENTOS ALTERNATIVOS (FIP + FII)

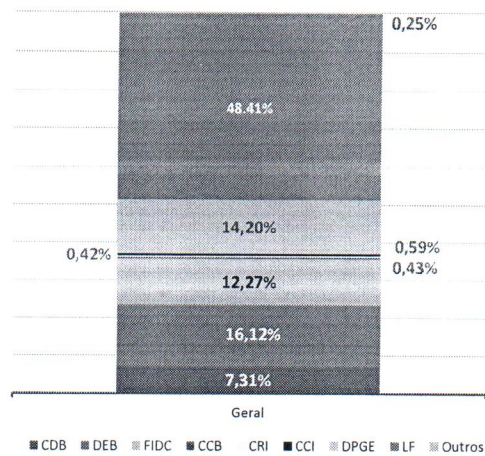


COMPOSIÇÃO DOS TÍTULOS DE RENDA FIXA

TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

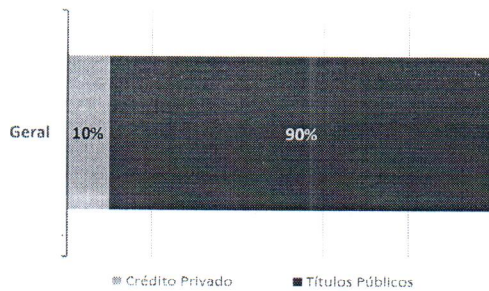


TÍTULOS DE EMISSÃO PRIVADA



RISCOS FINANCEIROS

ALOCAÇÃO EM ATIVOS DE RENDA FIXA



DURATION MÉDIA DA CARTEIRA DOS PLANOS

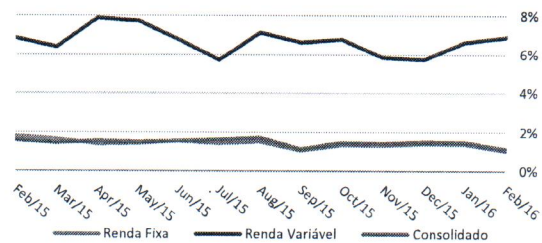
Duration	Dias Uteis
Cupom de IPCA	1036
Cupom Juros	265
Cupom de IGP-M	1170
Cupom SELIC	923

VALUE AT RISK

Mar-16

SEGMENTO DE APLICAÇÃO	Var MÉDIO
RENDA FIXA	1,03%
RENDA VARIÁVEL	7,29%
CONSOLIDADO	1,18%

EVOLUÇÃO DO VaR (VALUE AT RISK)



ANEXO ESTATÍSTICO

RPPS - MEDIANA DOS RETORNOS

Renda Fixa	Apr-15	May-15	Jun-15	Jul-15	Aug-15	Sep-15	Oct-15	Nov-15	Dec-15	Jan-16	Feb-16	Mar-16	12 meses	2016
Todos os planos	1,30%	1,75%	0,41%	0,69%	-1,11%	0,37%	2,03%	0,96%	1,52%	1,90%	1,37%	1,89%	14,24%	5,30%
Renda Variável	Apr-15	May-15	Jun-15	Jul-15	Aug-15	Sep-15	Oct-15	Nov-15	Dec-15	Jan-16	Feb-16	Mar-16	12 meses	2016
Todos os planos	4,51%	-3,21%	0,64%	-0,73%	-5,29%	-1,01%	1,18%	0,00%	-0,95%	-2,86%	2,63%	5,81%	1,16%	5,65%
Consolidado	Apr-15	May-15	Jun-15	Jul-15	Aug-15	Sep-15	Oct-15	Nov-15	Dec-15	Jan-16	Feb-16	Mar-16	12 meses	2016
Todos os planos	1,63%	1,31%	0,43%	0,51%	-1,37%	0,21%	1,87%	0,89%	1,38%	1,64%	1,42%	2,25%	12,66%	5,25%

INDICADORES DE MERCADO

Renda Fixa	Apr-15	May-15	Jun-15	Jul-15	Aug-15	Sep-15	Oct-15	Nov-15	Dec-15	Jan-16	Feb-16	Mar-16	12 meses	2016
IMA-B	2,44%	2,57%	-0,27%	-0,73%	-3,11%	-0,68%	2,58%	1,03%	1,52%	1,91%	2,26%	5,31%	15,59%	9,75%
IMA-B5	0,46%	1,63%	0,85%	1,78%	-0,47%	0,79%	2,49%	0,55%	2,12%	2,97%	1,54%	0,76%	16,55%	5,35%
IMA-B5+	3,55%	3,14%	-0,73%	-1,80%	-4,59%	-1,63%	2,63%	1,35%	1,13%	1,21%	2,75%	8,30%	15,77%	12,62%
IMA-C	2,50%	1,82%	-0,22%	-1,15%	-2,19%	0,21%	4,19%	2,24%	0,76%	1,92%	3,41%	4,99%	19,85%	10,66%
IMA-S	0,95%	0,99%	1,06%	1,18%	1,11%	1,11%	1,11%	1,06%	1,16%	1,05%	0,98%	1,12%	13,67%	3,18%
IRF-M	1,09%	1,63%	0,32%	1,23%	-0,85%	-0,94%	0,92%	0,92%	0,57%	2,79%	1,54%	3,42%	13,32%	7,95%
IRF-M 1	0,84%	0,95%	0,93%	1,28%	1,02%	0,96%	1,31%	1,07%	1,18%	1,64%	1,09%	1,26%	14,41%	4,04%
IRF-M 1+	1,23%	2,03%	-0,04%	1,21%	-2,14%	-2,29%	0,67%	0,83%	0,16%	3,79%	1,93%	5,21%	13,09%	11,31%
IMA	1,59%	1,83%	0,27%	0,51%	-1,15%	-0,37%	1,60%	1,05%	1,01%	2,02%	1,69%	3,42%	14,24%	7,28%
SELIC	0,95%	0,99%	1,06%	1,18%	1,11%	1,11%	1,11%	1,06%	1,16%	1,06%	1,00%	1,16%	13,74%	3,20%
CDI	0,95%	0,98%	1,06%	1,18%	1,11%	1,11%	1,11%	1,06%	1,16%	1,05%	1,00%	1,16%	13,72%	3,25%
Inflação	Apr-15	May-15	Jun-15	Jul-15	Aug-15	Sep-15	Oct-15	Nov-15	Dec-15	Jan-16	Feb-16	Mar-16	12 meses	2016
IPCA	0,71%	0,74%	0,79%	0,62%	0,22%	0,54%	0,82%	1,01%	0,96%	1,27%	0,90%	0,43%	9,39%	2,62%
INPC	0,71%	0,99%	0,77%	0,58%	0,25%	0,51%	0,77%	1,11%	0,90%	1,51%	0,95%	0,44%	9,91%	2,93%
IGP-M	1,17%	0,41%	0,67%	0,69%	0,28%	0,95%	1,89%	1,52%	0,49%	1,14%	1,29%	0,51%	11,57%	2,97%
IGP-DI	0,92%	0,40%	0,68%	0,58%	0,40%	1,42%	1,76%	1,19%	0,44%	1,53%	0,79%	0,43%	11,05%	2,77%
IPC-Fipe	1,10%	0,62%	0,47%	0,85%	0,56%	0,66%	0,88%	1,06%	0,82%	1,37%	0,89%	0,97%	10,74%	3,26%
IPC-DI	0,61%	0,72%	0,82%	0,69%	0,22%	0,42%	0,76%	1,00%	0,88%	1,78%	0,76%	0,50%	9,55%	3,07%
Moedas	Apr-15	May-15	Jun-15	Jul-15	Aug-15	Sep-15	Oct-15	Nov-15	Dec-15	Jan-16	Feb-16	Mar-16	12 meses	2016
DOLAR (PTAX)	-6,68%	6,19%	-2,40%	9,39%	7,45%	8,95%	-2,87%	-0,22%	1,41%	3,53%	-1,56%	-10,57%	10,94%	8,86%
EURO	-3,02%	4,56%	-0,97%	8,17%	9,07%	8,63%	-3,81%	-4,51%	4,34%	3,11%	-1,35%	-6,23%	17,65%	-4,62%
Bolsas	Apr-15	May-15	Jun-15	Jul-15	Aug-15	Sep-15	Oct-15	Nov-15	Dec-15	Jan-16	Feb-16	Mar-16	12 meses	2016
IBOVESPA	9,93%	-6,17%	0,61%	-4,17%	-8,33%	-3,36%	1,80%	-1,63%	-3,93%	-6,79%	5,91%	16,97%	-2,14%	15,47%
IBrX	9,12%	-5,47%	0,76%	-3,44%	-8,25%	-3,11%	1,36%	-1,66%	-3,79%	-6,25%	5,29%	15,41%	-2,53%	13,92%
IBrX-50	9,66%	-6,05%	0,64%	-3,75%	-7,98%	-3,25%	1,06%	-1,98%	-4,04%	-6,47%	5,65%	16,41%	-2,86%	15,03%
SMLL	3,04%	-2,38%	-1,17%	-3,75%	-9,13%	-2,71%	5,45%	-1,98%	-5,27%	-8,53%	4,66%	11,39%	-11,68%	6,64%
DOW JONES	0,36%	0,95%	-2,17%	0,40%	-6,57%	-1,47%	8,47%	0,32%	-1,66%	-5,50%	0,30%	7,08%	-0,51%	1,49%
NASDAQ	0,83%	2,60%	-1,64%	2,84%	-6,86%	-3,27%	9,38%	1,09%	-1,98%	-7,85%	-1,21%	6,84%	-0,62%	-2,74%
Fundos	Apr-15	May-15	Jun-15	Jul-15	Aug-15	Sep-15	Oct-15	Nov-15	Dec-15	Jan-16	Feb-16	Mar-16	12 meses	2016
IFM-I	0,77%	1,16%	0,86%	1,57%	0,44%	1,03%	0,59%	1,13%	1,20%	0,98%	0,81%	0,83%	12,00%	2,64%
IFM	-0,50%	1,45%	0,12%	3,09%	-0,36%	0,90%	1,20%	1,57%	0,93%	1,63%	0,39%	-0,06%	10,81%	1,96%
IMM	-0,16%	1,74%	-0,31%	3,08%	-0,48%	1,03%	1,09%	1,52%	1,05%	1,32%	0,67%	-0,30%	10,67%	1,69%
ILS	-0,36%	0,88%	1,60%	2,65%	0,63%	0,71%	1,05%	1,56%	1,16%	1,62%	-0,37%	0,11%	11,79%	1,35%
IFIX	2,05%	1,43%	3,03%	0,68%	-0,82%	-3,98%	2,14%	1,57%	-2,96%	-6,17%	2,95%	9,11%	8,51%	5,39%

NÚCLEO DE PREVIDÊNCIA

Atendimento ao Cliente

rpps@riskoffice.net
www.riskoffice.net
(11) 3707-9000

1. Este documento é de propriedade exclusiva do Risk Office e somente pode ser reproduzido mediante sua expressa autorização. 2. Este documento tem caráter meramente informativo, cabendo única e exclusivamente ao usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização que faça ou venha a fazer das informações nele contidas. 3. O conteúdo deste documento não deve ser entendido e nem interpretado como recomendação e nem garantia de resultados.

Análise de Investimentos



PRAIA GRANDE CONSOLIDADO

31/Mar/2016

Risco de Mercado

Patrimônio Líquido

PL Calculado	370.783.550,05
PL Informado	370.619.545,78
PL Calculado a Mercado	370.783.550,05

Value At Risk

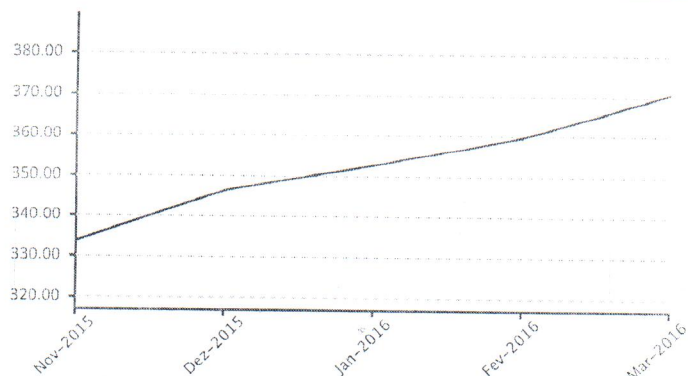
Value-at-Risk	4.897.410,55
Value-at-Risk (%)	1,3208

Parâmetros Para Cálculo Do VaR

Modelo	Non-Parametric
Nível de Confiança	95%
Horizonte de Tempo	21

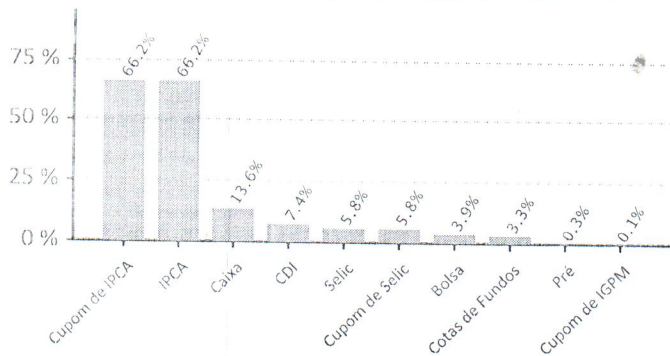
Evolução do PL

(em milhões)



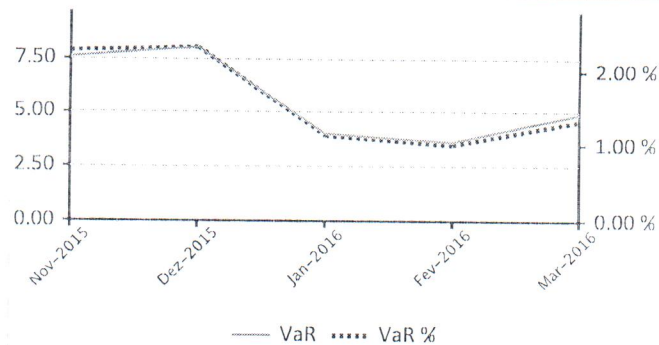
Distribuição Percentual da Carteira por Fator de Risco

(% sobre PL Calculado)

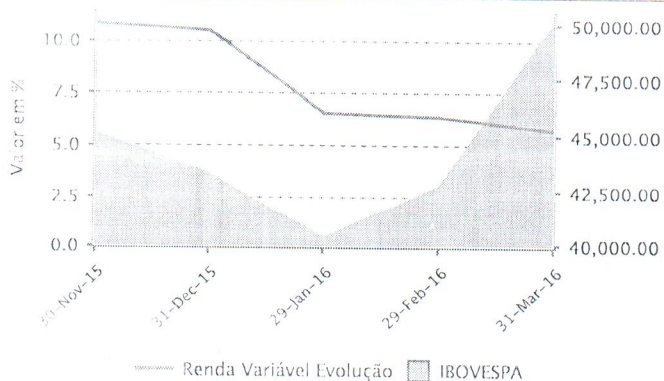


Evolução do VaR

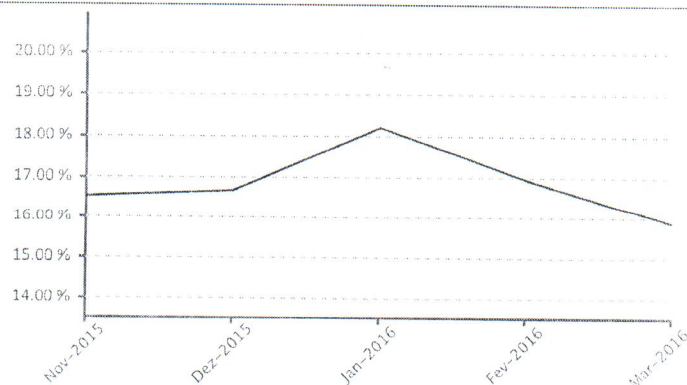
(em milhões)



Alocação em Renda Variável



Evolução de Crédito Privado



Análise de Investimentos

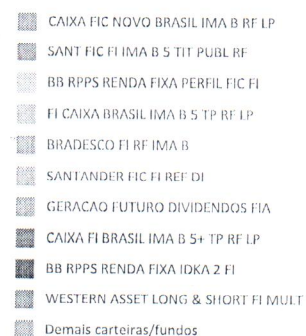
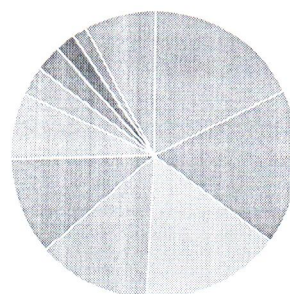


PRAIA GRANDE CONSOLIDADO

31/Mar/2016

Composição do Plano

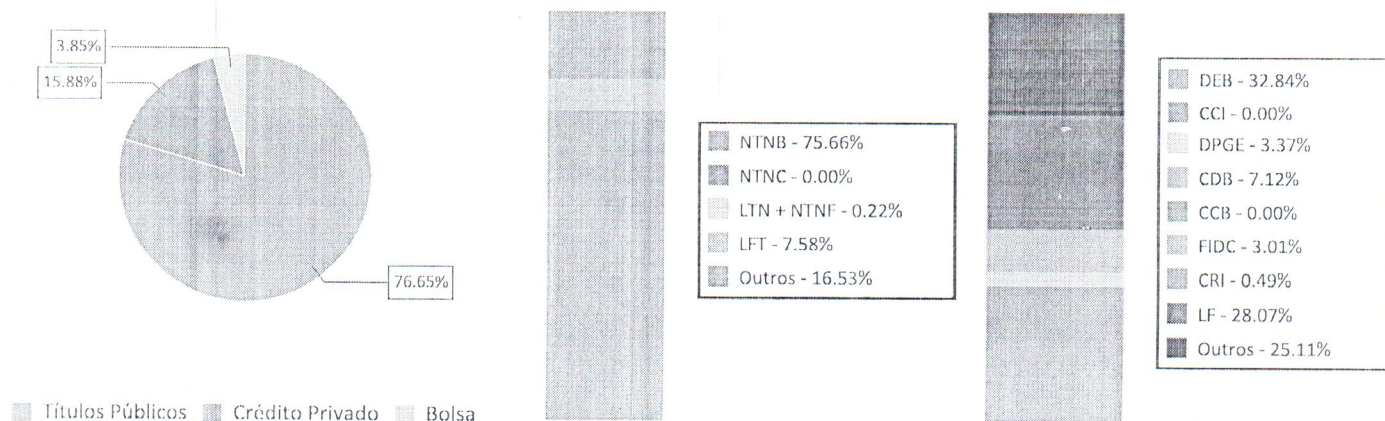
Book	Valor
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	65.162.702,70
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	64.357.349,94
BB RPPS RENDA FIXA PERFIL FIC FI	58.441.920,18
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	47.231.441,53
BRDESCO FI RF IMA B	41.085.865,50
SANTANDER FIC FI REF DI	27.025.523,14
GERACAO FUTURO DIVIDENDOS FIA	12.014.377,73
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	10.673.234,55
BB RPPS RENDA FIXA IDKA 2 FI	8.578.742,22
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULT	6.113.489,04
Demais carteiras/fundos	30.006.024,84



Participação por Classe de Ativos

Fatores de Risco	(%)			Dur. Ativa (du)			Dur. Passiva (du)		
	31/03/2016	29/02/2016	29/01/2016	31/03/2016	29/02/2016	29/01/2016	31/03/2016	29/02/2016	29/01/2016
Bolsa	3,88%	4,49%	4,63%	-	-	-	-	-	-
CDI	7,39%	8,22%	8,16%	-	-	-	-	-	-
Caixa	13,61%	14,69%	13,21%	-	-	-	-	-	-
Cotas de Fundos	3,28%	3,02%	3,47%	-	-	-	-	-	-
Cupom de IGPM	0,07%	0,07%	0,07%	1.000,51	1.016,96	1.029,92	0,00	0,00	0,00
Cupom de IPCA	66,19%	63,89%	64,92%	1.154,61	1.127,60	1.119,09	0,00	0,00	0,00
Cupom de Selic	5,81%	6,28%	6,13%	839,89	852,53	856,09	0,00	0,00	0,00
IGPM	0,07%	0,07%	0,07%	-	-	-	-	-	-
IPCA	66,19%	63,89%	64,92%	-	-	-	-	-	-
Pré	0,32%	(0,08)%	0,01%	516,75	361,99	354,72	136,59	274,29	337,07
Selic	5,81%	6,28%	6,13%	-	-	-	-	-	-

Alocação em Títulos Públicos e Privados





PRAIA GRANDE CONSOLIDADO

31/Mar/2016

Maiores Exposições Consolidado 10+

Contraparte	MtM Info	MtM Info (%)
SECRETARIA TESOUREO NACIONAL	237.192.223,31	64,00
BCO BRADESCO SA	7.742.800,32	2,09
ITAUSA INVESTS ITAU SA	6.194.029,47	1,67
BCO BRASIL SA	6.108.041,75	1,65
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	5.314.486,39	1,43
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	4.479.057,65	1,21
BCO SAFRA SA	3.781.695,30	1,02
KLABIN SA	3.773.040,10	1,02
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	3.130.715,07	0,84
CIA ENERGETICA MINAS GERAIS	2.925.840,30	0,79

Basiléia Emissores

Contraparte	Basiléia	MtM Info
BCO ORIGINAL SA	46,20	2.422,81
BCO BMG SA	26,70	32.555,71
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL	19,80	134.955,78
BCO CNH CAPITAL SA	18,20	22.849,72
BCO DAYCOVAL SA	17,80	113.229,75
BCO DESENVOLVIMENTO MINAS	17,60	2.137,56
BCO BTG PACTUAL SA	17,50	820.902,47
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	17,50	5.314.486,39
ITAUSA INVESTS ITAU SA	16,90	6.194.029,47
BCO INDL BRASIL SA	16,80	11.307,97
BCO BRADESCO SA	16,50	7.742.800,32
HAITONG BANCO INVESTIMENTO	16,30	588.165,79
BCO SOFISA SA	16,30	13.803,45
BCO FIDIS INVEST SA (EX BCO FIAT	16,10	13.590,77
BCO BRASIL SA	16,10	6.108.041,75
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	16,10	4.479.057,65
BCO FIBRA SA	15,90	207.310,87
BRB BCO BRASILIA SA	15,30	24.907,83
BCO VOTORANTIM SA	15,00	1.384.770,85
BCO VOLKSWAGEN SA	14,90	120.331,30
BCO CITIBANK SA	14,70	1.881,20
BCO ABC BRASIL SA (EX BCO ABC	14,40	46.117,91
BCO GMAC SA	14,20	37.427,04
BCO SAFRA SA	14,00	3.781.695,30
BCO PINE SA	13,90	70.050,01
BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA	13,60	16.787,69
BCO INDL COML SA BICBANCO	13,60	271.921,83
BCO TOYOTA BRASIL SA	13,20	43.820,46
BCO BNP PARIBAS BRASIL SA	13,10	42.371,09
BCO INDUSVAL SA	13,10	16.534,26
HSBC BANK BRASIL SA BANCO	13,10	1.438.991,32
BCO SCHAHIN SA	10,97	301.803,76



PRAIA GRANDE CONSOLIDADO

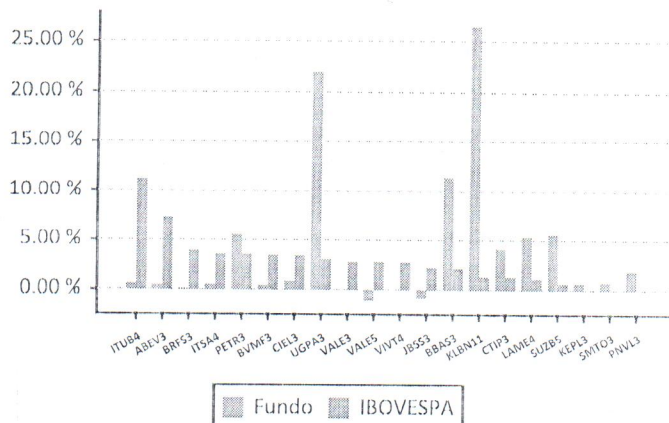
31/Mar/2016

Exposições

Exposição Individual (10+) / Total Ações

Deslocamento do Benchmark

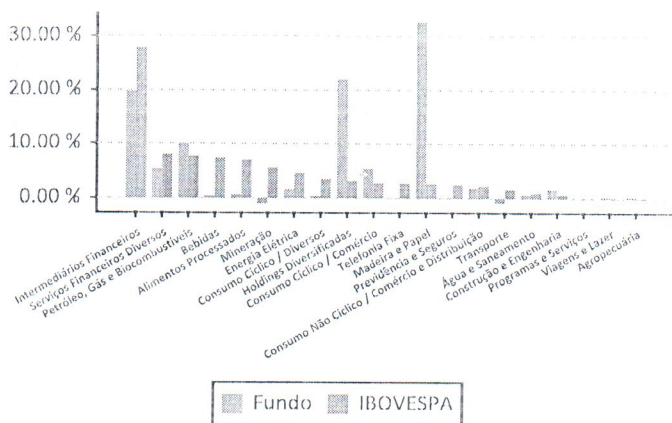
ATIVO	FUNDO	IBOVESPA	Diferença	Rentabilidade
Positivos				
1 KLBN11	26,47%	1,24%	25,23%	(9,91)%
2 UGPA3	21,96%	2,99%	18,97%	11,04%
3 BBAS3	11,39%	2,06%	9,33%	46,91%
4 SUZB5	5,59%	0,61%	4,98%	(23,27)%
5 LAME4	5,34%	1,08%	4,26%	0,36%
6 CIIP3	4,10%	1,23%	2,87%	6,16%
7 PETR3	5,55%	3,50%	2,05%	44,63%
8 PNVL3	1,84%	-	-	5,25%
9 SMT03	0,72%	-	-	(0,98)%
10 KEPL3	0,64%	-	-	22,53%
Total	83,60%	12,71%	70,89%	
Negativos				
1 ITUB4	0,54%	11,20%	(10,66)%	22,87%
2 ABEL3	0,43%	7,26%	(6,83)%	6,69%
3 BRFS3	0,11%	3,92%	(3,81)%	(0,18)%
4 VALES	(0,99)%	2,75%	(3,74)%	32,94%
5 ITSA4	0,47%	3,54%	(3,07)%	19,79%
6 BVVF3	0,40%	3,37%	(2,97)%	32,36%
7 JBSS3	(0,77)%	2,15%	(2,92)%	(3,95)%
8 VALE3	0,00%	2,76%	(2,76)%	28,28%
9 VIV14	0,00%	2,67%	(2,67)%	18,43%
10 CIEL3	0,80%	3,35%	(2,55)%	13,74%
Total	0,99%	42,97%	(41,98)%	



Exposição Setorial (10+)

Deslocamento do Benchmark

ATIVO	FUNDO	IBOVESPA	Diferença
Positivos			
1 Madeira e Papel	32,59%	2,69%	29,90%
2 Holdings Diversificadas	21,96%	3,15%	18,81%
3 Consumo Cíclico / Comércio	5,33%	2,76%	2,57%
4 Petróleo, Gás e Biocombustíveis	9,97%	7,62%	2,34%
5 Construção e Engenharia	1,69%	0,70%	0,99%
6 Agropecuária	0,28%	0,00%	0,28%
7 Viagens e Lazer	0,25%	0,00%	0,25%
8 Programas e Serviços	(0,04)%	0,00%	(0,04)%
9 Água e Saneamento	0,75%	1,00%	(0,24)%
10 Consumo Não Cíclico / Comércio e	1,91%	2,22%	(0,31)%
Total	74,69%	20,15%	54,54%
Negativos			
1 Intermediários Financeiros	19,75%	27,89%	(8,14)%
2 Bebidas	0,43%	7,26%	(6,83)%
3 Mineração	(0,99)%	5,51%	(6,50)%
4 Alimentos Processados	0,74%	6,94%	(6,19)%
5 Consumo Cíclico / Diversos	0,41%	3,46%	(3,06)%
6 Energia Elétrica	1,66%	4,52%	(2,86)%
7 Telefonia Fixa	0,00%	2,74%	(2,74)%
8 Serviços Financeiros Diversos	5,30%	7,95%	(2,65)%
9 Transporte	(0,80)%	1,70%	(2,51)%
10 Previdência e Seguros	(0,01)%	2,47%	(2,49)%
Total	26,49%	70,45%	(43,96)%





Aquisições durante o Mês

Títulos Privados

Produto	Emissor	Inf.	Taxa (%)	Vencimento	Rating	Agência	Fundo de Origem
CDB_cdi - BCEF	BCEF	274.143,63	0,00	102.50	24/09/2019	brAA-	SP SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
CDB_cdi - BCEF	BCEF	40.344,67	0,00	102.50	27/08/2019	brAA-	SP SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
CDB_cdi - BCEF	BCEF	163.289,93	0,00	102.50	15/08/2019	brAA-	SP SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
CDB_cdi - HSBC	HSBC	112.850,98	0,22	100.00	20/12/2016	BR-1	MOODY SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
LF CDI - BBAS	BBAS	692,63	0,72	111.50	29/01/2018	Aa2.br	MOODY BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BBAS	BBAS	527,32	0,79	111.00	06/04/2017	Aa2.br	MOODY BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BBAS	BBAS	461,75	0,72	111.50	29/01/2018	Aa2.br	MOODY BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	762,22	0,29	106.50	22/12/2016	brA-1	SP BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	1.143,33	0,29	106.50	22/12/2016	brA-1	SP BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	1.143,33	0,29	106.50	22/12/2016	brA-1	SP BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	1.715,00	0,29	106.50	22/12/2016	brA-1	SP BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	2.075,01	0,31	106.25	12/09/2016	brA-1	SP BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	1.524,45	0,29	106.50	22/12/2016	brA-1	SP BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	1.543,89	0,01	104.75	10/04/2017	brAA-	SP BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	10.976,75	0,31	107.00	31/01/2017	brA-1	SP BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	319,07	0,23	104.50	11/04/2016	brA-1	SP BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	91,54	0,10	104.50	12/09/2016	brA-1	SP BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	7.473,53	0,31	107.00	31/01/2017	brA-1	SP BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	608,60	0,01	103.75	16/09/2016	brA-1	SP BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BBDC	BBDC	57.795,32	(0,46)	106.50	21/11/2016	brA-1	SP SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
LF CDI - BCEF	BCEF	375,31	0,59	107.00	15/07/2016	brA-1	SP BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BCEF	BCEF	1.125,92	0,59	107.00	15/07/2016	brA-1	SP BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BCEF	BCEF	16.013,09	0,59	107.00	15/07/2016	brA-1	SP BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BCEF	BCEF	499,23	0,49	106.00	15/07/2016	brA-1	SP BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BCGM	BCGM	4.304,73	0,58	115.00	30/10/2016	F1+(bra)	FR BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BITA	BITA	518,47	0,82	100.00	23/01/2018	brAA-	SP BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BITA	BITA	153,51	351,39	112.00	19/08/2016	brA-1	SP BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BITA	BITA	153,51	351,39	112.00	19/08/2016	brA-1	SP BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BITA	BITA	1.228,12	351,39	112.00	19/08/2016	brA-1	SP BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BITA	BITA	18.114,72	1,18	112.00	19/08/2016	brA-1	SP BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BITA	BITA	1.842,18	351,39	112.00	19/08/2016	brA-1	SP BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BITA	BITA	12.741,71	351,39	112.00	19/08/2016	brA-1	SP BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BITA	BITA	767,57	351,39	112.00	19/08/2016	brA-1	SP BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BITA	BITA	1.228,12	351,39	112.00	19/08/2016	brA-1	SP BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BITA	BITA	307,03	351,39	112.00	19/08/2016	brA-1	SP BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BMGB	BMGB	156,56	0,69	119.00	26/09/2016	BR-3	MOODY BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BSAF	BSAF	3.596,68	0,37	106.30	28/11/2016	brA-1	SP BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - BSAF	BSAF	3.373,12	0,47	106.50	15/07/2016	brA-1	SP BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - DAYC	DAYC	638,12	0,39	112.00	13/06/2016	brA-2	SP BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - DCLS	DCLS	3.928,21	0,00	105.70	09/01/2017	F1+(bra)	FR BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - HSBC	HSBC	958,05	0,40	107.00	26/08/2016	BR-1	MOODY BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - HSBC	HSBC	547,46	0,40	107.00	26/08/2016	BR-1	MOODY BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - HSBC	HSBC	1.231,78	0,40	107.00	26/08/2016	BR-1	MOODY BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV
LF CDI - HSBC	HSBC	1.094,91	0,40	107.00	26/08/2016	BR-1	MOODY BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIRF CRED PRIV



PRAIA GRANDE CONSOLIDADO

31/Mar/2016

Produto	Emissor	Inf.	Taxa	(%)	Vencimento	Rating	Agência	Fundo de Origem
LF CDI - HSBC	HSBC	821,19	0,40	107,00	26/08/2016	BR-1	MOODY	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIF CRED PRIV
LF CDI - HSBC	HSBC	410,59	0,40	107,00	26/08/2016	BR-1	MOODY	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIF CRED PRIV
LF CDI - HSBC	HSBC	273,73	0,40	107,00	26/08/2016	BR-1	MOODY	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIF CRED PRIV
LF CDI - HSBC	HSBC	3.016,23	0,54	107,00	09/05/2016	BR-1	MOODY	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIF CRED PRIV
LF CDI - SANB	SANB	87,94	0,37	106,50	06/02/2017	brA-1	SP	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIF CRED PRIV
LF CDI - SANB	SANB	4.221,20	0,37	106,50	06/02/2017	brA-1	SP	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIF CRED PRIV
LF CDI - SANB	SANB	1.846,78	0,37	106,50	06/02/2017	brA-1	SP	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIF CRED PRIV
LF CDI - SANB	SANB	791,48	0,37	106,50	06/02/2017	brA-1	SP	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIF CRED PRIV
LF CDI - SANB	SANB	87,94	0,37	106,50	06/02/2017	brA-1	SP	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIF CRED PRIV
LF CDI - SANB	SANB	179,11	0,37	106,75	12/12/2016	brA-1	SP	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIF CRED PRIV
LF CDI - SANB	SANB	2.328,42	0,37	106,75	12/12/2016	brA-1	SP	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIF CRED PRIV
LF CDI - SANB	SANB	3.264,22	0,72	106,75	25/04/2016	brA-1	SP	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIF CRED PRIV
LF CDI - ZYFZ	ZYFZ	2.559,57	0,57	108,50	20/06/2016	brA-1	SP	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIF CRED PRIV
LF CDI - ZYFZ	ZYFZ	947,99	0,57	108,50	20/06/2016	brA-1	SP	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIF CRED PRIV

Debêntures

Produto	Emissor	Inf.	Taxa	(%)	Vencimento	Rating	Agência	Fundo de Origem
BNDP16	BNDP	7,53	20,59	100,00	01/07/2016	Aaa.br	MOODY	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIF CRED PRIV
BNDP16	BNDP	22,60	20,07	100,00	01/07/2016	Aaa.br	MOODY	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIF CRED PRIV
BRMI12	BRML	2.091,79	53,57	-	15/02/2017	AA(bra)	FR	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIF CRED PRIV
CSSA12	CVIA	183,82	90,14	100,00	20/06/2018	A2.br	MOODY	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIF CRED PRIV
ECOR11	ECOR	31,64	1,84	100,00	15/04/2018	A2.br	MOODY	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIF CRED PRIV
IGTA13	IGTA	6.752,42	1,55	-	01/02/2018	brAA	SP	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIF CRED PRIV
LRNF14	LRFN	139,32	0,95	100,00	15/07/2016	brAA+	SP	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIF CRED PRIV
SULM11	SULA	504,68	1,09	-	06/02/2017	AA-(bra)	FR	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIF CRED PRIV
SULM11	SULA	746,80	1,09	-	06/02/2017	AA-(bra)	FR	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIF CRED PRIV
SULM11	SULA	237,00	1,08	-	06/02/2017	AA-(bra)	FR	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIF CRED PRIV
SULM11	SULA	1.880,63	1,08	-	06/02/2017	AA-(bra)	FR	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIF CRED PRIV
VNRI12	VIAN	631,47	41,53	100,00	20/03/2017	A2.br	MOODY	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIF CRED PRIV
VNRI12	VIAN	170,40	43,36	100,00	20/03/2017	A2.br	MOODY	BRASIL PLURAL HIGH YIELD FIF CRED PRIV

Títulos Públicos

Produto	Inf.	Tx. Média	Tx. ANBIMA	Vencimento	Fundo de Origem
NTNB	33.727,50	6,43	6,47	15/05/2055	CAIXA FI MASTER BRASIL IMA B RF LP
NTNB	42.934,38	6,43	6,47	15/05/2055	CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP
NTNB	212.970,73	6,16	6,50	15/08/2050	CAIXA FI MASTER BRASIL IMA B RF LP
NTNB	849.067,50	6,16	6,50	15/08/2050	CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP
NTNB	72.026,93	6,16	6,50	15/08/2050	BRAM FI RF IMA B
NTNB	276.827,03	6,00	6,53	15/05/2045	CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP
NTNB	64.088,13	6,15	6,44	15/08/2040	CAIXA FI MASTER BRASIL IMA B RF LP
NTNB	132.062,19	6,15	6,44	15/08/2040	CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP
NTNB	571.954,91	6,30	6,45	15/05/2035	CAIXA FI MASTER BRASIL IMA B RF LP
NTNB	803.079,24	6,30	6,45	15/05/2035	CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP
NTNB	46.631,84	6,30	6,45	15/05/2035	BRAM FI RF IMA B
NTNB	76.160,65	6,34	6,40	15/08/2030	CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP
NTNB	65.038,28	6,34	6,40	15/08/2030	BRAM FI RF IMA B
NTNB	8.162,68	6,30	6,53	15/08/2024	CAIXA FI MASTER BRASIL IMA B RF LP
NTNB	156.383,27	6,30	6,53	15/08/2024	CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP



PRAIA GRANDE CONSOLIDADO

31/Mar/2016

Produto	Inf.	Tx. Média	Tx. ANBIMA	Vencimento	Fundo de Origem
NTNB	9.317,12	6,30	6,53	15/08/2024	BRAM FI RF IMA B
NTNB	87.064,74	6,24	6,60	15/05/2023	CAIXA FI MASTER BRASIL IMA B RF LP
NTNB	358.355,33	6,24	6,60	15/05/2023	CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP
NTNB	587.043,12	6,41	6,62	15/08/2022	CAIXA FI MASTER BRASIL IMA B RF LP
NTNB	629.474,92	6,41	6,62	15/08/2022	CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP
NTNB	336.660,08	6,41	6,62	15/08/2022	BB PREVIDENCIARIO RF TTT PUB X FI
NTNB	917.671,37	6,22	6,57	15/05/2021	CAIXA FI MASTER BRASIL IMA B RF LP
NTNB	167.642,57	6,22	6,57	15/05/2021	CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP
NTNB	594.438,26	6,10	6,43	15/08/2020	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP
NTNB	37.400,57	6,10	6,43	15/08/2020	BB RPPS RENDA FIXA IDKA 2 FI
NTNB	1.812.292,29	6,10	6,43	15/08/2020	CAIXA FI MASTER BRASIL IMA B RF LP
NTNB	1.199.767,26	6,10	6,43	15/08/2020	SANT FI IMA B 5 TITULOS PUBLICOS RF
NTNB	302.576,28	6,10	6,43	15/08/2020	WA IMAB5 ATIVO FI RENDA FIXA
NTNB	379.038,46	6,10	6,43	15/08/2020	BRAM FI RF IMA B
NTNB	677.402,54	6,09	6,49	15/05/2019	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP
NTNB	180.135,54	6,09	6,49	15/05/2019	BB RPPS RENDA FIXA IDKA 2 FI
NTNB	1.183.188,53	6,09	6,49	15/05/2019	CAIXA FI MASTER BRASIL IMA B RF LP
NTNB	1.572.576,56	6,09	6,49	15/05/2019	SANT FI IMA B 5 TITULOS PUBLICOS RF
NTNB	18.425,02	6,09	6,49	15/05/2019	BRAM FI RF IMA B
NTNB	597.812,56	6,05	6,61	15/08/2018	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP
NTNB	417.285,76	6,05	6,61	15/08/2018	BB RPPS RENDA FIXA IDKA 2 FI
NTNB	996.381,45	6,05	6,61	15/08/2018	SANT FI IMA B 5 TITULOS PUBLICOS RF
NTNB	421.526,67	5,71	6,26	15/05/2017	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP
NTNB	41.331,43	5,71	6,26	15/05/2017	BB RPPS RENDA FIXA IDKA 2 FI
NTNB	790.808,65	5,71	6,26	15/05/2017	SANT FI IMA B 5 TITULOS PUBLICOS RF
LIN	2.133,87	0,00	13,77	01/01/2017	WESTERN ASSET SOVEREIGN II SELIC RF FI
NTNB	918.826,04	6,94	8,09	15/08/2016	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP
NTNB	2.357.698,44	6,94	8,09	15/08/2016	SANT FI IMA B 5 TITULOS PUBLICOS RF
NTNB	62.758,30	6,94	8,09	15/08/2016	WA IMAB5 ATIVO FI RENDA FIXA
LIN	446.806,20	14,34	14,38	01/04/2016	BB TOP RF MODERADO FI RF LP

Alterações de Ratings



PRAIA GRANDE CONSOLIDADO

31/Mar/2016

Produto	Contraparte	Agência	Rating Anterior	Rating Atual	Emissor/Emissão	Fundo de Origem
LI CDI - PRBC	PARANA BCO SA	SP	brAA-	brA	Emissão	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
LI CDI - PRBC	PARANA BCO SA	SP	brAA-	brA	Emissão	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP
LI CDI - PRBC	PARANA BCO SA	SP	brAA-	brA	Emissão	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP
LI CDI - ZXSZ	BCO VOTORANTIM SA	SP	brAA-	brA+	Emissão	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
LI CDI - ZXSZ	BCO VOTORANTIM SA	SP	brAA-	brA+	Emissão	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
LI CDI - ZXSZ	BCO VOTORANTIM SA	SP	brAA-	brA+	Emissão	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
LI CDI - ZXSZ	BCO VOTORANTIM SA	SP	brAA-	brA+	Emissão	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP
LI CDI - ZXSZ	BCO VOTORANTIM SA	SP	brAA-	brA+	Emissão	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP



PRAIA GRANDE CONSOLIDADO

31/Mar/2016

Debêntures

Produto	Contraparte	Agência	Rating Anterior	Rating Atual	Emissor/Emissão	Fundo de Origem
AMPL16	AMPLA ENERGIA SERVICOS SA	SP	brAA	brAA-	Emissão	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
AMPL16	AMPLA ENERGIA SERVICOS SA	SP	brAA	brAA-	Emissão	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
AMPL16	AMPLA ENERGIA SERVICOS SA	SP	brAA	brAA-	Emissão	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP
AMPL26	AMPLA ENERGIA SERVICOS SA	SP	brAA	brAA-	Emissão	CAIXA FI MASTER BRASIL IMA B RF LP
AMPL27	AMPLA ENERGIA SERVICOS SA	SP	brAA	brAA-	Emissão	CAIXA FI MASTER BRASIL IMA B RF LP
BRT010	OI SA	FR	BBB (bra)	CCC(bra)	Emissão	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
BRT010	OI SA	FR	BBB-(bra)	CCC(bra)	Emissão	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP
BRT018	OI SA	MOODY	Aa3.br	Caa2.br	Emissão	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
BRT018	OI SA	MOODY	Aa3.br	Caa2.br	Emissão	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
BRT018	OI SA	MOODY	Aa3.br	Caa2.br	Emissão	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP
CPGE17	CPFL GERACAO ENERGIA SA	FR	AA+(bra)	AA(bra)	Emissão	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
CSNA15	CIA SIDERURGICA NACIONAL	SP	brBBB-	brBB-	Emissão	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
CSNA15	CIA SIDERURGICA NACIONAL	SP	brBBB-	brBB-	Emissão	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
CSNA15	CIA SIDERURGICA NACIONAL	SP	brBBB-	brBB-	Emissão	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
CSNA15	CIA SIDERURGICA NACIONAL	SP	brBBB-	brBB-	Emissão	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
CSNA15	CIA SIDERURGICA NACIONAL	SP	brBBB-	brBB-	Emissão	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP
CSNA17	CIA SIDERURGICA NACIONAL	SP	brBBB-	brBB-	Emissão	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
CSNA17	CIA SIDERURGICA NACIONAL	SP	brBBB-	brBB-	Emissão	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP
MIL511	MILLS ESTRUTURAS SERVICOS	MOODY	Baa3.br	Ba2.br	Emissão	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
MIL511	MILLS ESTRUTURAS SERVICOS	MOODY	Baa3.br	Ba2.br	Emissão	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
MIL511	MILLS ESTRUTURAS SERVICOS	MOODY	Baa3.br	Ba2.br	Emissão	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP
MIL512	MILLS ESTRUTURAS SERVICOS	MOODY	Baa3.br	Ba2.br	Emissão	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
MIL512	MILLS ESTRUTURAS SERVICOS	MOODY	Baa3.br	Ba2.br	Emissão	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
MIL512	MILLS ESTRUTURAS SERVICOS	MOODY	Baa3.br	Ba2.br	Emissão	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP
MIL513	MILLS ESTRUTURAS SERVICOS	MOODY	Baa3.br	Ba2.br	Emissão	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
MIL513	MILLS ESTRUTURAS SERVICOS	MOODY	Baa3.br	Ba2.br	Emissão	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP
MIL522	MILLS ESTRUTURAS SERVICOS	MOODY	Baa3.br	Ba2.br	Emissão	CAIXA FI MASTER BRASIL IMA B RF LP
MULP13	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
MULP13	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP
NATU25	NATURA COSMETICOS SA	SP	-	brAAA	Emissão	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
NATU25	NATURA COSMETICOS SA	SP	-	brAAA	Emissão	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
NATU25	NATURA COSMETICOS SA	SP	-	brAAA	Emissão	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP
NATU35	NATURA COSMETICOS SA	SP	-	brAAA	Emissão	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
NATU35	NATURA COSMETICOS SA	SP	-	brAAA	Emissão	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
NATU35	NATURA COSMETICOS SA	SP	-	brAAA	Emissão	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP
USIM16	USINAS SIDERURGICAS MINAS	SP	-	brC	Emissão	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
USIM16	USINAS SIDERURGICAS MINAS	SP	-	brC	Emissão	BB TOP RF MODERADO FI RF LP
USIM16	USINAS SIDERURGICAS MINAS	SP	-	brC	Emissão	BB TOP RF ARROJADO FI RF LP



Rendimento dos Veículos - INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE PRAIA GRANDE - MARANHÃO

Marca Atualizada	Valor Investido	Valor Investido (R\$)	Retorno Mensal	Retorno Anual	Retorno Mensal	Retorno Anual
			3 Meses	12 Meses	3 Meses	12 Meses
INPC+6.00%			4.4353%	6.9210%	9.3406%	16.5138%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA						
FIC IMA-B 5 TIT PUB RF	10.646.895/0001-30	65.162.702,70	9.2556%	5.2321%	14.7627%	4.4337%
BB PREVID RF PERFIL	13.455.117/0001-01	64.357.349,86	5.3001%	0.7445%	10.7409%	9.2556%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS	13.077.418/0001-49	58.441.920,29	3.1645%	1.1123%	6.6580%	5.3001%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B	11.060.913/0001-10	47.231.441,52	5.2356%	0.7347%	10.5989%	3.1645%
SANTANDER FIC FI REF DI	08.702.788/0001-23	41.085.865,49	9.2596%	5.0005%	14.7845%	5.2356%
GERACAO FUTURO DIVIDENDOS FIA	07.907.396/0001-02	27.025.523,09	2.7313%	1.1442%	2.7313%	9.2596%
FI CAIXA BRASIL IMA B5+ TP RF LP	11.898.349/0001-08	12.014.377,74	-9.7022%	-6.2937%	-10.4457%	2.7313%
BB PREVID RF IDKA 2	10.577.563/0001-66	10.673.234,55	12.4691%	6.3368%	17.9335%	-9.7022%
WESTERN ASSET LONG E SHORT FUNDO DE INVESTIMENTO	13.322.265/0001-35	8.578.742,23	0.6600%	0.5360%	0.6600%	12.4691%
BB PREVID RF TP X	07.672.392/0001-64	6.113.489,04	3.1669%	0.9569%	3.1669%	0.6600%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	20.734.931/0001-20	5.247.082,04	8.4789%	2.7747%	10.8881%	3.1669%
BB PREVID RF TP IX	17.517.577/0001-78	4.715.981,37	-0.4075%	-0.4075%	-0.4075%	8.4789%
ATICO GERACAO DE ENERGIA FIC PARTICIP	20.734.937/0001-08	3.967.304,50	3.7038%	0.8363%	8.7636%	-0.4075%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FIC FIP	11.490.580/0001-69	3.752.627,54	-0.3776%	-0.1336%	-1.0323%	3.7038%
GERACAO FUTURO SELECAO FIA	13.328.452/0001-49	3.130.008,17	-0.0834%	0.0130%	7.9292%	-0.3776%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII	11.898.290/0001-13	2.666.368,36	-9.9821%	-5.2739%	-7.5473%	-0.0834%
Santander FIC Selecao Max Acoes	13.842.663/0001-76	1.967.132,52	4.2216%	1.1960%	4.4374%	-9.9821%
AQUILA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII	04.435.076/0001-09	1.505.277,15	7.5914%	9.3370%	7.3409%	4.2216%
BRADESCO FIA SMALL CAP PLUS	13.555.918/0001-49	1.390.698,21	1.8667%	0.0320%	1.4659%	7.5914%
	06.988.623/0001-00	1.319.266,95	5.0462%	2.0313%	8.5457%	1.8667%



RENTABILIDADE DOS VEÍCULOS - INSTITUTO DE PREVIDENCIA MUNICIPAL DE PRAIA GRANDE - MAR/2008

FIDO 1 - TRANSITORIAL ITALIA	13.590.000/0001-28	17.03.2007	Outros	317.306,35	0,9253%	2,5176%	16,8053%	2,5168%
FIDC TPENBANK BANCO DE FOMENTO - MULTISECTORIAL	08.927.498/0001-09	27.07.2007	CDI	26.953,63	-1,7442%	-7,0356%	-17,4651%	-7,0859%
FOCC/UNOQUINISTFIP	10.525.626/0001-47	01.09.2006	Outros	4,55	-0,2141%	-0,4273%	-0,4273%	-0,4273%

1 - Este documento tem caráter meramente informativo, sendo exclusivamente do usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização das informações.

2 - Os dados de mercado, se utilizados neste relatório, foram obtidos nas fontes públicas nas quais o Aurora deposita confiança. Entretanto, o Aurora não se responsabiliza pela acurácia desses dados.

3 - As informações utilizadas neste relatório foram obtidas junto ao RPPS que administra o plano e aos seus prestadores de serviços, não sendo de responsabilidade do Aurora quaisquer erros decorrentes de ruídos ou falhas de informação.

RESUMO ENQUADRAMENTO - INSTITUTO DE PROVIDENCIA MUNICIPAL DE PRAIA GRANDE - MAR/2016

Limites de Alocação e Concentração (Limite Anual PL 25,00%)

Produto	Valor Investido (R\$)	Porcentagem Investido	Limite PL	Status	Setor Art. 14
FUNDOS DE INVESTIMENTO EM TÍTULOS PÚBLICOS					
BB PREVID RF FIXA 2	3.572.742,23	2,3142%	100,00%	Enquadrado	
BB PREVID RF TP IX	3.567.304,50	1,0702%	100,00%	Enquadrado	
BB PREVID RF TP X	5.247.082,04	1,4154%	100,00%	Enquadrado	
FI CAIXA BRASIL IMA B5+ TP RF LP	10.673.234,55	2,8792%	100,00%	Enquadrado	
FIC IMA-B 5 TIT PUB RF	64.367.349,86	17,3614%	100,00%	Enquadrado	
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	47.531.441,52	12,7411%	100,00%	Enquadrado	
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	4.715.981,37	1,2722%	100,00%	Enquadrado	
FUNDOS DE INVESTIMENTO EM TÍTULOS PRIVADOS					
BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B	41.085.365,49	11,0835%	80,00%	Enquadrado	
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	65.162.702,70	17,5767%	80,00%	Enquadrado	
FUNDOS DE INVESTIMENTO EM TÍTULOS DE RENDA FIXA - ALÍNEA A					
BB PREVID RF PERFIL	53.441.920,29	15,7656%	30,00%	Enquadrado	
SANTANDER FIC FI REF DI	27.025.523,09	7,2905%	30,00%	Enquadrado	
FUNDOS DE INVESTIMENTO EM TÍTULOS DE RENDA FIXA - ALÍNEA B					
FIDC MULTISETORIAL ITALIA	317.308,35	0,0855%	5,00%	Enquadrado	
FIDC TREDDANK BANCO DE FOMENTO - MULTISETORIAL	26.963,63	0,0072%	5,00%	Enquadrado	
FUNDOS DE INVESTIMENTO EM TÍTULOS DE RENDA FIXA - ALÍNEA C					
BRABESCO FIA SMALL CAP PLUS	1.319.265,95	0,3559%	15,00%	Enquadrado	



Resumo Enquadramento - INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE PRAIA GRANDE - MARIZIA

GERACAO FUTURO DIVIDENDOS FIA	12.014.377,74	3,2410%	Enquadrado
GERACAO FUTURO SELECAO FIA	2.660.388,30	0,7192%	Enquadrado
Santander FIC Selecao Max Access	1.505.277,15	0,40960%	Enquadrado
WESTERN ASSET LONG E SHORT FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	6.113.489,04	1,6492%	Enquadrado
Fundo de Participações (FIP) - (R\$ 100,00 V)	6.882.000,00	1,8859%	Enquadrado
ATICO GERACAO DE ENERGIA FI EM PARTICIP	3.752.627,54	1,0123%	Enquadrado
FOCO CONQUEST FIP	4,66	0,00009%	Enquadrado
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FIC FIP	3.130.008,17	0,8443%	Enquadrado
Fundo de Investimento Imobiliário - FII - (R\$ 100,00 V)	6.877.186,00	0,9069%	Enquadrado
AGUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII	1.350.658,21	0,3751%	Enquadrado
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII	1.967.132,52	0,5395%	Enquadrado
Total Geral	370.090.669,96		



Mesmo Enquadramento - INSTITUTO DE PREVIDENCIA MUNICIPAL DE PRAIA GRANDE - 2016/2016

Síntese Ativos (R\$)

Descrição	Valor Investido (R\$)	Porcentual Investido	Síntese
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B	41.085.865,49	11,0835%	Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	65.162.702,70	17,5787%	Enquadrado
TOTAL	106.248.568,19	28,6622%	
DB FRENDA RF PERJIL	22.441.920,20	15,7660%	Enquadrado
SANTANDER FIC FI REF DI	27.025.523,09	7,2905%	Enquadrado

Não existem veículos para este enquadramento.

- 1 - Este documento tem caráter meramente informativo, sendo exclusivamente do usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização das informações.
- 2 - Os dados de mercado, se utilizados neste relatório, foram obtidos junto a fontes públicas nas quais o Aurora dispõe confiança. Entretanto, o Aurora não se responsabiliza pela acurácia desses dados.
- 3 - As informações utilizadas neste relatório foram obtidas junto ao RPPS que administra o plano e aos seus prestadores de serviços, não sendo de responsabilidade do Aurora quaisquer erros decorrentes de ruídos ou falhas de informação.

