EXTRATO MENSAL

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE OSASCO

OUTUBRO/2014

PLENA
CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS

DESEMPENHO			PRINCIPAIS INDICADORES		
CLIENTE	MÊS	ANO	INDICADORES	MÊS	ANO
OSASCO	1,04%	7,22%	IBOVESPA	0,95%	6,06%
IPCA+6%	0,91%	10,28%	CDI	0,94%	8,85%

					RENTABILIDADES							LIMITE DO FUNDO		LIMITE DA CARTEIRA				
CLASSE	INSTITUIÇAO	CUSTODIANTE	ATIVO	VOL*	MÊS	% ÍNDICE	ANO	VALOR(R$)	% CARTEIRA	LIMITE DOS RECURSOS RPPS	PL DO FUNDO	% NO PL DO FUNDO	LIMITE NO PL DO FUNDO	PART. NA CARTEIRA		LIMITE DA RES. 3.922/10		NORMA
TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL**	TESOURO NACIONAL	ITAÚ	NTN-B 2015 6,306166%	3,40%	0,72%	76,00%	6,66%	2.585.418,86	1,57%	-	-	0,00%	25%	19,25%		100%		Artigo 7°, Inciso I, Alínia a e b.
	TESOURO NACIONAL	ITAÚ	NTN-B 2017 6,521271%	4,84%	1,06%	111,92%	8,38%	5.661.221,93	3,45%		-	0,00%						
	TESOURO NACIONAL	ITAÚ	NTN-B 2045 6,254902%	14,76%	3,55%	371,40%	15,49%	1.540.474,46	0,94%		-	0,00%						
	TESOURO NACIONAL	ITAÚ	NTN-B 2045 6,997524%	14,76%	3,55%	371,40%	15,49%	2.310.711,70	1,41%		-	0,00%						
	TESOURO NACIONAL	ITAÚ	NTN-B 2045 7,088989%	14,76%	3,55%	371,40%	15,49%	5.905.152,11	3,60%		-	0,00%						
	TESOURO NACIONAL	ITAÚ	NTN-F 2017 9,812659%	4,89%	1,04%	109,51%	10,07%	39.669,84	0,02%		-	0,00%						
FUNDOS 100% TP (IMA OU IDkA)	BB	BB	BB IRF M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,90%	0,82%	87,23%	8,43%	2.502.720,49	1,52%		7.591.878.804,91	0,03%						
	BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7,08%	1,90%	200,42%	13,75%	867.193,89	0,53%		768.477.674,23	0,11%						
	BB	BB	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,93%	0,89%	94,72%	10,13%	8.677.702,44	5,28%		3.135.572.873,34	0,28%						
	BB	BB	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,02%	1,09%	114,88%	10,01%	1.533.961,75	0,93%		2.504.580.955,73	0,06%						
REFERENCIADO (IMA OU IDkA)										20%			25%	20,84%		80%		Artigo 7°, Inciso III
RENDA FIXA (IMA OU IDkA)	ÁTICO	BRADESCO	ÁTICO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2,88%	1,04%	110,04%	10,37%	23.030.314,58	14,02%		393.724.328,09	5,85%						
	BTG	BTG	BTG PACTUAL FI RENDA FIXA IPCA	3,57%	0,97%	102,28%	10,09%	9.073.423,38	5,52%		476.266.478,43	1,91%						
	BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO IMA B 5+ FI RENDA FIXA	11,65%	2,65%	277,71%	16,47%	2.127.383,83	1,30%		58.330.858,81	3,65%						
RF E REF. NÃO CRÉDITO PRIVADO	BB	BB	BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,50%	0,90%	95,09%	8,16%	36.468,20	0,02%	20%	906.585.441,96	0,00%	25%	15,41%		30%		Artigo 7°, Inciso IV
	BB	BB	BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,52%	0,98%	104,18%	9,01%	10.043.224,07	6,11%		4.344.400.512,91	0,23%						
	CEF	CEF	CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	0,48%	0,95%	100,45%	8,90%	15.228.513,04	9,27%		3.357.518.611,21	0,45%						
FIDC ABERTO***	LEME	SANTANDER	LEME IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,80%	1,20%	127,21%	11,37%	14.301.576,61	8,71%	-	326.473.196,52	4,38%	25%	13,07%	17,88%	15%	15%	Artigo 7°, Inciso VI
	SRM	DEUTSCHE BANK	INDÚSTRIA EXODUS INSTITUCIONAL FIDC SÊNIOR	0,53%	1,13%	119,88%	10,71%	2.553.001,59	1,55%		134.020.963,47	1,90%						
	INCENTIVO	SANTANDER	INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	0,72%	1,28%	135,18%	10,39%	4.618.284,83	2,81%		121.651.034,30	3,80%						
FIDC FECHADO***	INCENTIVO	SANTANDER	INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL	1,72%	0,23%	23,94%	6,40%	3.018.537,73	1,84%	-	62.258.875,81	4,85%	25%	1,84%		5%		Artigo 7°, Inciso VII
RF E REF. CRÉDITO PRIVADO***	INCENTIVO	SANTANDER	PIATÃ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	6,61%	0,52%	54,83%	7,96%	4.880.205,65	2,97%		195.844.282,79	2,49%		2,97%				

TOTAL CARTEIRA RENDA FIXA	120.535.160,98	73,39%

EXTRATO MENSAL

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE OSASCO

OUTUBRO/2014

DESEMPENHO			PRINCIPAIS INDICADORES		
CLIENTE	MÊS	ANO	INDICADORES	MÊS	ANO
OSASCO	1,04%	7,22%	IBOVESPA	0,95%	6,06%
IPCA+6%	0,91%	10,28%	CDI	0,94%	8,85%

					RENTABILIDADES							LIMITE DO FUNDO		LIMITE DA CARTEIRA		
CLASSE	INSTITUIÇAO	CUSTODIANTE	ATIVO	VOL*	MÊS	% ÍNDICE	ANO	VALOR(R$)	% CARTEIRA	LIMITE DOS RECURSOS RPPS	PL DO FUNDO	% NO PL DO FUNDO	LIMITE NO PL DO FUNDO	PART. NA CARTEIRA	LIMITE DA RES. 3.922/10	NORMA
MULTIMERCADO	HUMAITÁ	BRADESCO	HUMAITÁ EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	1,75%	1,08%	113,85%	7,32%	3.360.497,54	2,05%	-	35.899.659,31	9,36%	25%	4,67%	5%	Artigo 8°, Inciso IV
	PERFIN	ITAÚ	PERFIN LONG SHORT 15 FIC MULTIMERCADO	2,00%	1,15%	121,99%	4,50%	2.045.308,99	1,25%		80.124.272,15	2,55%				
	PERFIN	ITAÚ	PERFIN LONG SHORT FIC MULTIMERCADO	5,94%	1,16%	122,59%	4,50%	2.272.337,62	1,38%		63.672.949,07	3,57%				
FIA INDEXADO IBOV. IBX OU IBX-50	FRANKLIN	BRADESCO	FRANKLIN TEMPLETON IBX FI AÇÕES	20,53%	0,69%	-0,26%	2,71%	4.744.535,69	2,89%	20%	115.007.878,02	4,13%	25%	2,89%	30%	Artigo 8°, Inciso I
FUNDO DE AÇÃO	HUMAITÁ	BRADESCO	HUMAITÁ VALUE FI AÇÕES	25,95%	-5,21%	-6,16%	-10,03%	2.115.972,16	1,29%	-	21.062.349,89	10,05%	25%	9,81%	15%	Artigo 8°, Inciso III
	CRPC	BRADESCO	TOTAL MIX FIC AÇÕES	12,23%	1,62%	0,67%	-0,60%	1.912.294,42	1,16%		15.181.263,11	12,60%				
	GUEPARDO	BRADESCO	GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	19,84%	5,22%	4,27%	-2,39%	4.724.172,76	2,88%		323.398.300,68	1,46%				
	PERFIN	ITAÚ	PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	13,99%	-0,84%	-1,78%	-6,51%	2.733.148,22	1,66%		156.369.841,87	1,75%				
	FRANKLIN	BRADESCO	FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	27,52%	1,28%	0,33%	-2,10%	3.692.764,86	2,25%		209.094.107,89	1,77%				
	HUMAITÁ	BRADESCO	HUMAITÁ ABSOLUTE FI AÇÕES	15,86%	-5,46%	-6,41%	-9,19%	929.136,24	0,57%		13.576.082,03	6,84%				
FUNDO DE INVEST EM PARTICIPAÇÃO	EVOCATI	BTG PACTUAL	W7BZ FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES	5,83%	-0,16%	-1,11%	-0,48%	6.131.417,64	3,73%	-	50.010.559,40	12,26%	25%	4,71%	5%	Artigo 8" inciso V
	ÁTICO	BRADESCO	ATICO FIC FIP FLORESTAL	6,36%	-0,14%	-1,08%	7,93%	1.604.797,79	0,98%		39.484.099,05	4,06%				
FUNDO DE INVEST IMOBILIÁRIO	ÁTICO	PAULISTA	ÀTICO RENDA FUNDO DE INVESTIMENTOS IMOBILIARIOS FII	2,63%	0,26%	-0,68%	0,14%	7.444.692,85	4,53%	-	90.994.901,10	8,18%	25%	4,53%	5%	Artigo 8" inciso VI
					TOTAL CARTEIRA R. VARIÁVEL			43.711.076,78	26,61%							
CONTA CORRENTE	-	-	CONTA CORRENTE	-	-	-	-		0,00%	-	-	0,00%	-	0,00%	-	-
					TOTAL DA CARTEIRA			164.246.237,76	100,00%							

*Cálculo de volatilidade anualizada para os últimos doze meses.
** Para análise financeira e apuração de rentabilidade são considerados os preços dos títulos com marcação a mercado.
***O desenquadramento apontado, perante o MPAS e o seu parecer email, já se encontram como Ativo Enquadramento.
A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura, os produtos estruturados possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito.

Este extrato foi elaborado pela Plena Consultoria de Investimentos Ltda. para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da Empresa. As informações aqui contidas foram fornecidas pelo Instituto/Fundo e ou terceiros e são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. A Plena Consultoria de Investimentos Ltda. não se responsabiliza pelas informações transmitidas incorretamente e plena utilização destas em suas tomadas de decisões e consequentes perdas e ganhos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade das mesmas sendo apenas também uma OPINIÃO que reflete o momento da carteira no período especifico e são consubstanciadas em informações coletadas que julgamos confiáveis. As informações deste extrato procuram estar em consonância com o regulamento dos produtos mencionados, como regulamentos e prospectos de distribuição. É recomendada a leitura cuidadosa tanto do prospecto quanto do regulamento, com especial atenção para as clausulas relativas ao objetivo e à política de investimento dos produtos de investimento.