

IPREVI - INSTITUTO DE PREVIDENCIA MUNICIPAL DOS SERVIDORES PUBLICOS DO MUNICIPIO DE VICOSA

Relatório Competência

02/2018



VISÃO GERAL

FUNDO	DISP. DE RESGATE	SALDO R\$	PARTICIPAÇÃO	QTDE. COTISTAS	% SOBRE PL DO FUNDO	PL DO FUNDO R\$	RESOLUÇÃO	GRAU DE RISCO	TAXA ADM.
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 4	0,00	0,00 %	102	0,00 %	234.694.649,72	Art 8º, III	Alto	1,00 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 0	1.004.131,56	2,47 %	698	0,02 %	5.033.785.063,57	Art 7º, I, "b"	Médio	0,20 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D + 0	116.507,49	0,29 %	1225	0,00 %	12.566.930.658,11	Art 7º, I, "b"	Baixo	0,30 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D + 0	80.894,09	0,20 %	1225	0,00 %	12.566.930.658,11	Art 7º, I, "b"	Baixo	0,30 %
BRADESCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B	D + 1	1.080.505,93	2,66 %	99	0,07 %	1.482.793.903,55	Art 7º, III "a"	Médio	0,20 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	0,00	0,00 %		0,00 %	0,00	Art 7º, I, "b"	Médio	0,20 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 V TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	0,00	0,00 %		0,00 %	0,00	Art 7º, I, "b"	Médio	0,20 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	0,00	0,00 %		0,00 %	0,00	Art 7º, I, "b"	Médio	0,20 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 425	1.305.342,00	3,21 %	163	0,10 %	1.308.845.425,26	Art 7º, IV "a"	Baixo	0,00 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	6.382.584,53	15,68 %	632	0,14 %	4.475.500.473,21	Art 7º, I, "b"	Baixo	0,20 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	0,00	0,00 %	632	0,00 %	4.475.500.473,21	Art 7º, I, "b"	Baixo	0,20 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	0,00	0,00 %	745	0,00 %	4.283.874.711,54	Art 7º, I, "b"	Médio	0,20 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	3.167.336,23	7,78 %	745	0,07 %	4.283.874.711,54	Art 7º, I, "b"	Médio	0,20 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	0,00	0,00 %	745	0,00 %	4.283.874.711,54	Art 7º, I, "b"	Médio	0,20 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	0,00	0,00 %	1417	0,00 %	17.525.487.466,80	Art 7º, I, "b"	Baixo	0,20 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	15.351.882,47	37,72 %	1417	0,09 %	17.525.487.466,80	Art 7º, I, "b"	Baixo	0,20 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	134.611,75	0,33 %	1417	0,00 %	17.525.487.466,80	Art 7º, I, "b"	Baixo	0,20 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	7.482,51	0,02 %	1417	0,00 %	17.525.487.466,80	Art 7º, I, "b"	Baixo	0,20 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	337.240,93	0,83 %	1417	0,00 %	17.525.487.466,80	Art 7º, I, "b"	Baixo	0,20 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	2.009.236,92	4,94 %	321	0,07 %	2.813.285.709,33	Art 7º, I, "b"	Médio	0,20 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	D + 0	2.283.167,39	5,61 %	733	0,03 %	6.530.312.240,81	Art 7º, IV "a"	Baixo	0,20 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	0,00	0,00 %	427	0,00 %	2.010.533.770,62	Art 7º, IV "a"	Baixo	0,20 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	6.158.443,88	15,13 %	427	0,31 %	2.010.533.770,62	Art 7º, IV "a"	Baixo	0,20 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	379.730,37	0,93 %	427	0,02 %	2.010.533.770,62	Art 7º, IV "a"	Baixo	0,20 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	70.052,04	0,17 %	427	0,00 %	2.010.533.770,62	Art 7º, IV "a"	Baixo	0,20 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	5.373,37	0,01 %	427	0,00 %	2.010.533.770,62	Art 7º, IV "a"	Baixo	0,20 %
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO FICFI	D + 0	147.195,76	0,36 %	1443	0,00 %	10.845.052.436,01	Art 7º, IV "a"	Baixo	0,20 %
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II RENDA FIXA FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	D + 5	672.935,53	1,65 %	100	0,06 %	1.054.997.247,71	Art 7º, IV "a"	Baixo	0,20 %

TOTAL SALDO: R\$ 40.694.654,75

Relatório competência: 02/2018

ENQUADRAMENTO

RENDA FIXA - ARTIGOS	LIMITE DA RESOLUÇÃO	LIMITE POLÍTICA	TOTAL	% CARTEIRA	SITUAÇÃO
Art 7º, I, "b"	100 %	100 %	28.591.908,48	70,26 %	ENQUADRADO
Art 7º, III "a"	80 %	80 %	1.080.505,93	2,66 %	ENQUADRADO
Art 7º, IV "a"	30 %	30 %	11.022.240,34	27,09 %	ENQUADRADO

RENDA VARIÁVEL - ARTIGOS	LIMITE DA RESOLUÇÃO	LIMITE POLÍTICA	TOTAL	% CARTEIRA	SITUAÇÃO
Art 8º, III	15 %	%	0,00	0,00 %	ENQUADRADO

DISTRIBUIÇÃO POR PARÂMETRO DE RENTABILIDADE	TOTAL	% CARTEIRA
AÇÕES	0,00	0,00
CDI	9.716.898,34	23,88
IDKA 2	6.382.584,53	15,68
IMA-B	4.247.842,16	10,44
IPCA	1.305.342,00	3,21
IRF-M	3.013.368,48	7,40
IRF-M1	16.028.619,24	39,39

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	TOTAL	% CARTEIRA
BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A CNPJ: 30822936000169	1.201.533,14	2,95
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CNPJ: 360305000104	37.592.484,39	92,38
ITAU UNIBANCO S/A CNPJ: 60701190000104	820.131,29	2,02
BANCO BRADESCO S.A. CNPJ: 60746948000112	1.080.505,93	2,66

Relatório competência: 02/2018

RETORNOS

FUNDO	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO R\$	RETORNO %	EFETIVO %
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	0,00000 %	0,00000 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 0,00	R\$ 1.000.000,00	R\$ 0,00	R\$ 1.004.131,56	R\$ 4.131,56	1,10299 %	1,10299 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 1.111.775,62	R\$ 0,00	R\$ 1.000.000,00	R\$ 116.507,49	R\$ 4.731,87	0,52471 %	0,52471 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 80.471,87	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 80.894,09	R\$ 422,22	0,52471 %	0,52471 %
BRASESCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B	R\$ 1.074.618,32	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 1.080.505,93	R\$ 5.887,61	0,54788 %	0,54788 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	-	-
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 V TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	-	-
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	-	-
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	R\$ 1.333.105,00	R\$ 0,00	R\$ 36.214,42	R\$ 1.305.342,00	R\$ 8.451,42	0,63397 %	0,63397 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 6.346.637,24	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 6.382.584,53	R\$ 35.947,29	0,56640 %	0,56640 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	0,56640 %	0,56640 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	0,54152 %	0,54152 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 3.150.276,81	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 3.167.336,23	R\$ 17.059,42	0,54152 %	0,54152 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	0,54152 %	0,54152 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	0,53378 %	0,53378 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	R\$ 17.261.987,59	R\$ 0,00	R\$ 2.000.000,00	R\$ 15.351.882,47	R\$ 89.894,88	0,53378 %	0,53378 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	R\$ 133.897,03	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 134.611,75	R\$ 714,72	0,53378 %	0,53378 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	R\$ 7.442,78	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 7.482,51	R\$ 39,73	0,53378 %	0,53378 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	R\$ 335.450,36	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 337.240,93	R\$ 1.790,57	0,53378 %	0,53378 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 0,00	R\$ 2.000.000,00	R\$ 0,00	R\$ 2.009.236,92	R\$ 9.236,92	1,16942 %	1,16942 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	R\$ 2.273.143,87	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 2.283.167,39	R\$ 10.023,52	0,44095 %	0,44095 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	0,44695 %	0,44695 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 6.094.925,88	R\$ 36.214,42	R\$ 0,00	R\$ 6.158.443,88	R\$ 27.303,58	0,44695 %	0,44695 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 318.175,85	R\$ 60.000,00	R\$ 0,00	R\$ 379.730,37	R\$ 1.554,52	0,44695 %	0,44695 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 69.740,34	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 70.052,04	R\$ 311,70	0,44695 %	0,44695 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 5.349,46	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 5.373,37	R\$ 23,91	0,44695 %	0,44695 %
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO FICFI	R\$ 146.533,04	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 147.195,76	R\$ 662,72	0,45227 %	0,45227 %
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II RENDA FIXA FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 108.305,62	R\$ 561.739,51	R\$ 0,00	R\$ 672.935,53	R\$ 2.890,40	0,75246 %	0,75246 %
TOTAIS	R\$ 39.851.836,68	R\$ 3.657.953,93	R\$ 3.036.214,42	R\$ 40.694.654,75	R\$ 221.078,56	0,5725 %	0,5725 %



RETORNOS ACUMULADO

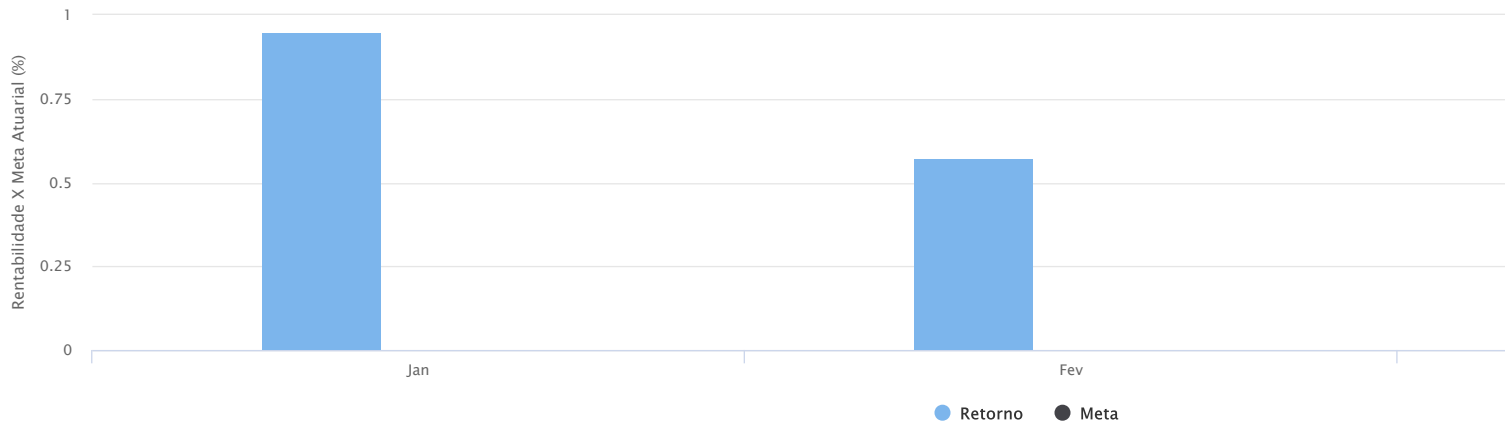
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO R\$	RETORNO %	META %	ATINGIMENTO %
JANEIRO	R\$ 39.424.448,84	R\$ 785.000,00	R\$ 730.000,00	R\$ 39.851.836,68	R\$ 372.387,84	0,9478 %	0,78 %	121,79 %
FEVEREIRO	R\$ 39.851.836,68	R\$ 3.657.953,93	R\$ 3.036.214,42	R\$ 40.694.654,75	R\$ 221.078,56	0,5725 %	0,81 %	70,82 %
TOTAIS		R\$ 4.442.953,93	R\$ 3.766.214,42		R\$ 593.466,40	1,53	1,59	95,79

Relatório competência: 02/2018



Gráfico

Retorno Acumulado no Ano





EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO X RENTABILIDADE MONETÁRIA

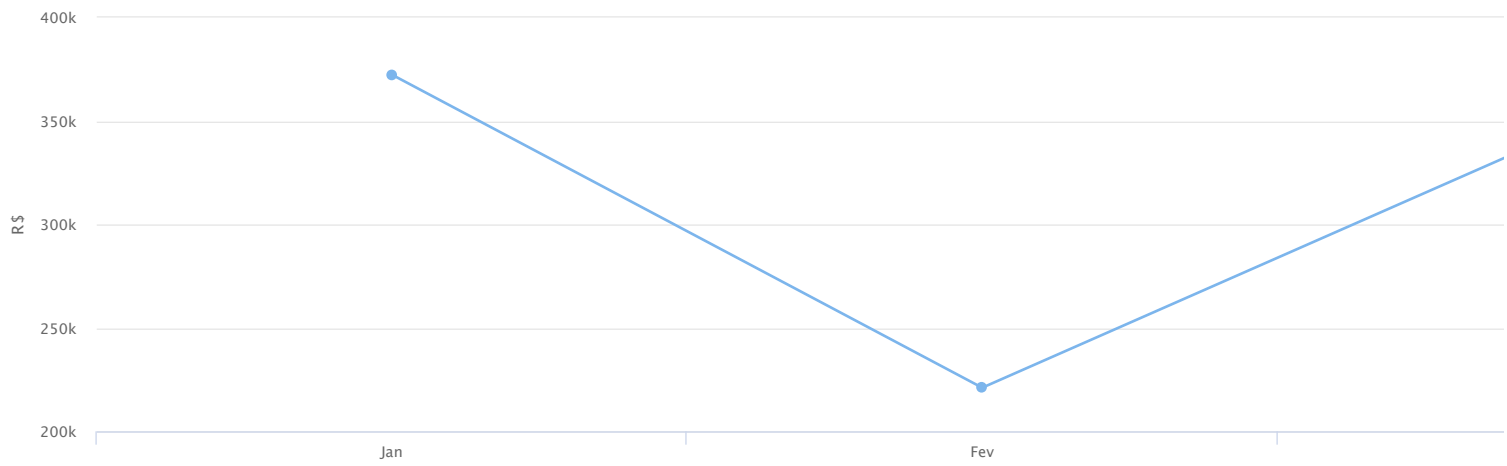
MESES	JANEIRO	FEVEREIRO	MARÇO	ABRIL	MAIO	JUNHO	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO
SALDO (R\$)	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
RETORNO (R\$)	372.387,84	221.078,56	346.655,62	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

REFERENTE AO SALDO (R\$)

R\$



REFERENTE AO RETORNO (R\$)



Relatório competência: 02/2018

MEDIDA DE RISCO

GESTÃO DE RISCO - MERCADO: O valor dos ativos que compõem a carteira do fundo pode aumentar ou diminuir de acordo com flutuações de preços e cotações de mercado, mudanças no cenário político e econômico, alterações nas taxas de juros e, ainda, com os resultados das empresas emissores de valores mobiliários (ações, debêntures, notas promissórias, entre outros).

Índice Sharpe: O índice de Sharpe é uma medida que permite a classificação do fundo em termos de desempenho global, sendo considerados melhores os fundos com maior índice. Vale lembrar ainda que o índice varia se o resultado for calculado com base em rentabilidades semanais, mensais ou anuais.

Var - Value at Risk: Value-at-risk ou Valor sob Risco pode ser definido como perda máxima, num determinado período, sob condições normais de mercado, com determinado grau de confiança.

FUNDO	BENCHMARK	VAR 12 MESES	SHARPE	VOLATILIDADE 3 MESES	VOLATILIDADE 6 MESES	VOLATILIDADE 12 MESES
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FUNDO DE INVESTIMENTO	AÇÕES	6,81 %	2,08 %	17,01 %	14,35 %	17,41 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	IRF-M	2,16 %	1,61 %	2,30 %	2,97 %	2,80 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	IRF-M1	0,32 %	1,13 %	0,09 %	0,68 %	0,75 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	IRF-M1	0,32 %	1,13 %	0,09 %	0,68 %	0,75 %
BRADESCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B	IMA-B	4,44 %	0,49 %	3,00 %	6,07 %	5,95 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IMA-B	0,00 %	0,00 %	0,00 %	0,00 %	0,00 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 V TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IMA-B	0,00 %	0,00 %	0,00 %	0,00 %	0,00 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IMA-B	0,00 %	0,00 %	0,00 %	0,00 %	0,00 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IPCA	1,87 %	-1,78 %	0,29 %	3,61 %	3,65 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IDKA 2	1,27 %	1,13 %	1,18 %	2,54 %	1,95 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IDKA 2	1,27 %	1,13 %	1,18 %	2,54 %	1,95 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	4,37 %	0,44 %	2,88 %	5,94 %	5,80 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	4,37 %	0,44 %	2,88 %	5,94 %	5,80 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	4,37 %	0,44 %	2,88 %	5,94 %	5,80 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IRF-M1	0,32 %	1,23 %	0,09 %	0,66 %	0,75 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IRF-M1	0,32 %	1,23 %	0,09 %	0,66 %	0,75 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IRF-M1	0,32 %	1,23 %	0,09 %	0,66 %	0,75 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IRF-M1	0,32 %	1,23 %	0,09 %	0,66 %	0,75 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IRF-M	2,17 %	1,56 %	2,30 %	3,02 %	2,83 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	CDI	0,06 %	0,02 %	0,24 %	0,39 %	0,62 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CDI	0,08 %	-0,02 %	0,15 %	0,40 %	0,61 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CDI	0,08 %	-0,02 %	0,15 %	0,40 %	0,61 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CDI	0,08 %	-0,02 %	0,15 %	0,40 %	0,61 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CDI	0,08 %	-0,02 %	0,15 %	0,40 %	0,61 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CDI	0,08 %	-0,02 %	0,15 %	0,40 %	0,61 %
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO FICFI	CDI	0,03 %	-0,97 %	0,03 %	0,06 %	0,12 %
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II RENDA FIXA FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FDS DE INVESTIMENTO	CDI	2,72 %	0,72 %	1,44 %	3,23 %	3,80 %

PROVISÃO DE RISCO - INDICATIVO

FUNDO	CNPJ	BENCHMARK	SALDO (R\$)	VAR 12 MESES	VOLATILIDADE 12 MESES	VAR% BASE 1 DIA CONFIANÇA 95% 252 DU* (R\$)
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FUNDO DE INVESTIMENTO	10.418.335/0001-88	AÇÕES	0,00	6,81 %	17,41 %	0,00
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	07.111.384/0001-69	IRF-M	1.004.131,56	2,16 %	2,80 %	21.689,24
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	11.328.882/0001-35	IRF-M1	116.507,49	0,32 %	0,75 %	372,82
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	11.328.882/0001-35	IRF-M1	80.894,09	0,32 %	0,75 %	258,86
BRASESCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B	08.702.798/0001-25	IMA-B	1.080.505,93	4,44 %	5,95 %	47.974,46
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	20.139.299/0001-77	IMA-B	0,00	0,00 %	0,00 %	0,00
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 V TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	21.922.168/0001-24	IMA-B	0,00	0,00 %	0,00 %	0,00
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	22.791.300/0001-79	IMA-B	0,00	0,00 %	0,00 %	0,00
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	18.598.256/0001-08	IPCA	1.305.342,00	1,87 %	3,65 %	24.409,90
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	14.386.926/0001-71	IDKA 2	6.382.584,53	1,27 %	1,95 %	81.058,82
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	14.386.926/0001-71	IDKA 2	0,00	1,27 %	1,95 %	0,00
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	10.740.658/0001-93	IMA-B	0,00	4,37 %	5,80 %	0,00
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	10.740.658/0001-93	IMA-B	3.167.336,23	4,37 %	5,80 %	138.412,59
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	10.740.658/0001-93	IMA-B	0,00	4,37 %	5,80 %	0,00
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	IRF-M1	0,00	0,32 %	0,75 %	0,00
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	IRF-M1	15.351.882,47	0,32 %	0,75 %	49.126,02
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	IRF-M1	134.611,75	0,32 %	0,75 %	430,76
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	IRF-M1	7.482,51	0,32 %	0,75 %	23,94
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	IRF-M1	337.240,93	0,32 %	0,75 %	1.079,17
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	14.508.605/0001-00	IRF-M	2.009.236,92	2,17 %	2,83 %	43.600,44
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	CDI	2.283.167,39	0,06 %	0,62 %	1.369,90
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	05.164.356/0001-84	CDI	0,00	0,08 %	0,61 %	0,00
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	05.164.356/0001-84	CDI	6.158.443,88	0,08 %	0,61 %	4.926,76
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	05.164.356/0001-84	CDI	379.730,37	0,08 %	0,61 %	303,78
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	05.164.356/0001-84	CDI	70.052,04	0,08 %	0,61 %	56,04
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	05.164.356/0001-84	CDI	5.373,37	0,08 %	0,61 %	4,30
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO FICFI	06.175.696/0001-73	CDI	147.195,76	0,03 %	0,12 %	44,16
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II RENDA FIXA FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FDOS DE INVESTIMENTO	25.306.703/0001-73	CDI	672.935,53	2,72 %	3,80 %	18.303,85

RISCO DE MERCADO	
Saldo Total:	R\$ 40.694.654,75
Provisão para perda e Investimentos:	R\$ 433.445,83
% Provisão de Perda:	1,065%

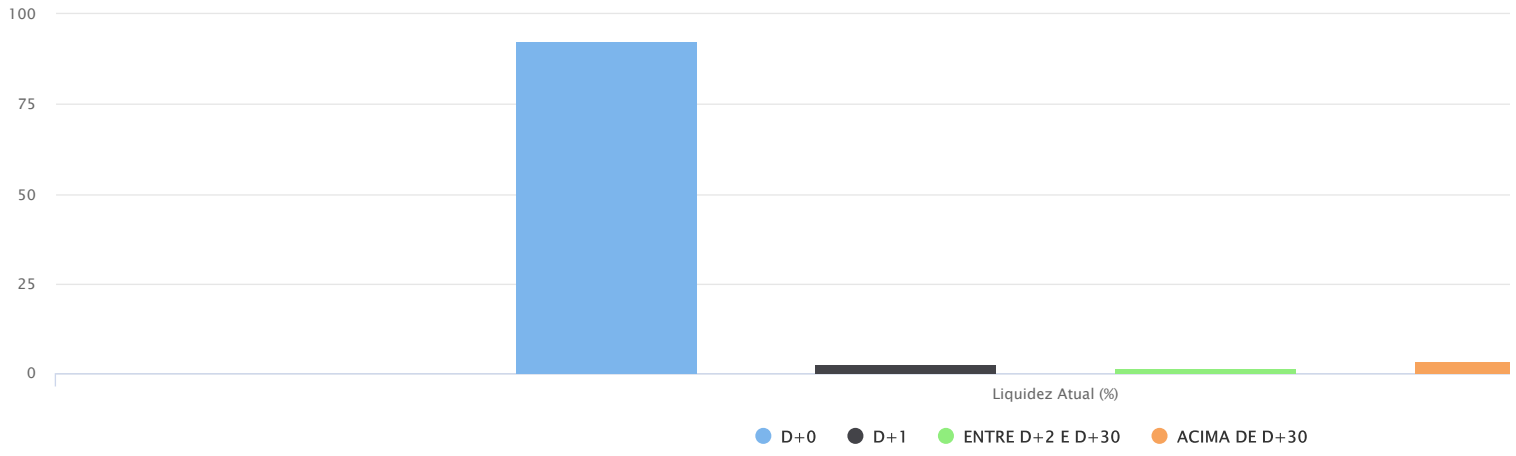
RISCO DE LIQUIDEZ

FUNDO	DISP. DE RESGATE	SALDO R\$	PARTICIPAÇÃO	QTDE. COTISTAS	% SOBRE PL DO FUNDO	PL DO FUNDO R\$	RESOLUÇÃO	GRAU DE RISCO
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 4	0,00	0,00 %	102	0,00 %	234.694.649,72	Art 8º, III	Alto
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 0	1.004.131,56	2,47 %	698	0,02 %	5.033.785.063,57	Art 7º, I, "b"	Médio
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D + 0	116.507,49	0,29 %	1225	0,00 %	12.566.930.658,11	Art 7º, I, "b"	Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D + 0	80.894,09	0,20 %	1225	0,00 %	12.566.930.658,11	Art 7º, I, "b"	Baixo
BRADESCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B	D + 1	1.080.505,93	2,66 %	99	0,07 %	1.482.793.903,55	Art 7º, III "a"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	0,00	0,00 %		0,00 %	0,00	Art 7º, I, "b"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 V TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	0,00	0,00 %		0,00 %	0,00	Art 7º, I, "b"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	0,00	0,00 %		0,00 %	0,00	Art 7º, I, "b"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 425	1.305.342,00	3,21 %	163	0,10 %	1.308.845.425,26	Art 7º, IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	6.382.584,53	15,68 %	632	0,14 %	4.475.500.473,21	Art 7º, I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	0,00	0,00 %	632	0,00 %	4.475.500.473,21	Art 7º, I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	0,00	0,00 %	745	0,00 %	4.283.874.711,54	Art 7º, I, "b"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	3.167.336,23	7,78 %	745	0,07 %	4.283.874.711,54	Art 7º, I, "b"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	0,00	0,00 %	745	0,00 %	4.283.874.711,54	Art 7º, I, "b"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	0,00	0,00 %	1417	0,00 %	17.525.487.466,80	Art 7º, I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	15.351.882,47	37,72 %	1417	0,09 %	17.525.487.466,80	Art 7º, I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	134.611,75	0,33 %	1417	0,00 %	17.525.487.466,80	Art 7º, I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	7.482,51	0,02 %	1417	0,00 %	17.525.487.466,80	Art 7º, I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	337.240,93	0,83 %	1417	0,00 %	17.525.487.466,80	Art 7º, I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	2.009.236,92	4,94 %	321	0,07 %	2.813.285.709,33	Art 7º, I, "b"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	D + 0	2.283.167,39	5,61 %	733	0,03 %	6.530.312.240,81	Art 7º, IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	0,00	0,00 %	427	0,00 %	2.010.533.770,62	Art 7º, IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	6.158.443,88	15,13 %	427	0,31 %	2.010.533.770,62	Art 7º, IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	379.730,37	0,93 %	427	0,02 %	2.010.533.770,62	Art 7º, IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	70.052,04	0,17 %	427	0,00 %	2.010.533.770,62	Art 7º, IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	5.373,37	0,01 %	427	0,00 %	2.010.533.770,62	Art 7º, IV "a"	Baixo
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO FICFI	D + 0	147.195,76	0,36 %	1443	0,00 %	10.845.052.436,01	Art 7º, IV "a"	Baixo
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II RENDA FIXA FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FDOS DE INVESTIMENTO	D + 5	672.935,53	1,65 %	100	0,06 %	1.054.997.247,71	Art 7º, IV "a"	Baixo

TOTAL SALDO: R\$ 40.694.654,75

PRAZO DE RESGATE	QUANTIDADE DE FUNDOS	LIQUIDEZ ATUAL
D+0	24	92%
D+1	1	3%
ENTRE D+2 E D+30	2	2%
ACIMA DE D+30	1	3%

Gráfico



Relatório competência: 02/2018



RISCO DE CRÉDITO

RENDA FIXA - ARTIGOS	LIMITE DA RESOLUÇÃO	LIMITE POLÍTICA	TOTAL	% CARTEIRA
Art 7º, I, "b"	100 %	100 %	28.591.908,48	70,26
Art 7º, III "a"	80 %	80 %	1.080.505,93	2,66
Art 7º, IV "a"	30 %	30 %	11.022.240,34	27,09
			40.694.654,75	

RISCO DE CRÉDITO	% CARTEIRA
100% Títulos Públicos e 0% Títulos Privados	70,26%
50% Títulos Públicos e 50% Títulos Privados	29,74%
0% Títulos Públicos e 100% Títulos Privados	0,00%

Relatório competência: 02/2018

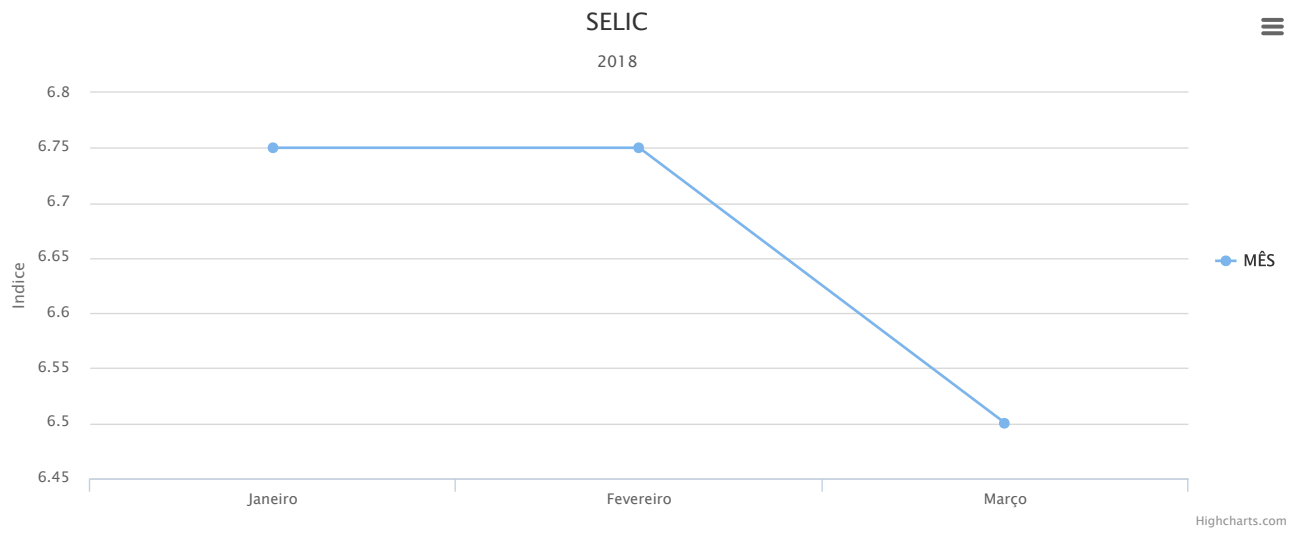


CAPITAL PROTEGIDO

TIPO DE PRODUTO E PERCENTUAL DO CAPITAL INVESTIDO PROTEGIDO	
INVESTIDO PROTEGIDO	INVESTIDO PROTEGIDO (Até)
Títulos Públicos Federais/ Carteira Própria	100%
Fundos de Investimento Referenciado e Renda Fixa 100% Títulos Públicos Federais (previsto no regulamento do fundo)	100%
Fundos de Investimento Referenciado e Renda Fixa (50% de títulos públicos federais)	50%
Fundos de Investimentos Crédito Privado	0%
FIDC	0%
Fundos de Ações	0%
Fundos de Índices - ETF	0%
Fundos Multimercados	0%
Fundos Imobiliários	0%
Fundos de Participação	0%

PERCENTUAL MÍNIMO DE ALOCAÇÃO DA CARTEIRA TOTAL DO RPPS EM PRODUTOS COM CAPITAL INVESTIDO PROTEGIDO: 80% do Patrimônio Líquido do RPPS, apurado concomitantemente na data de fechamento dos dados para envio do DAIR ao Ministério da Previdência Social - MPS.

Relatório competência: 02/2018



Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Mai	Junho	Julho	Agosto	Setembro	Outubro	Novembro	Dezembro
6.75	6.75	6.50									

CADPREV

Renda Variável		Tipo de Fundo: AÇÕES
Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FUNDO DE INVESTIMENTO	CNPJ: 10.418.335/0001-88	Saldo em 02/2018: R\$ 0,00
Administrador: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	CNPJ: 30.822.936/0001-69	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: Art 8º, III	Disponibilidade: D + 4	Adesão: 28/02/2018
Valor da Cota: R\$ 2,177910691	Quantidade de Cotas: 0,0000	PL do Fundo: R\$ 234.694.649,72
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,00%	Limite do Fundo: 15%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: IRF-M
Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	CNPJ: 71.113.840/0016-9	Saldo em 02/2018: R\$ 1.004.131,56
Administrador: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	CNPJ: 30.822.936/0001-69	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "b"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 31/01/2018
Valor da Cota: R\$ 4,788796343	Quantidade de Cotas: 209.683,4962	PL do Fundo: R\$ 5.033.785.063,57
% do PL do Fundo: 0,02%	Limite Cumulativo: 2,47%	Limite do Fundo: 100%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: IRF-M1
Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	CNPJ: 11.328.882/0001-35	Saldo em 02/2018: R\$ 116.507,49
Administrador: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	CNPJ: 30.822.936/0001-69	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "b"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/12/2015
Valor da Cota: R\$ 2,342476000	Quantidade de Cotas: 49.736,8981	PL do Fundo: R\$ 12.566.930.658,11
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,29%	Limite do Fundo: 100%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: IRF-M1
Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	CNPJ: 11.328.882/0001-35	Saldo em 02/2018: R\$ 80.894,09
Administrador: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	CNPJ: 30.822.936/0001-69	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "b"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/12/2015
Valor da Cota: R\$ 2,342476000	Quantidade de Cotas: 34.533,5833	PL do Fundo: R\$ 12.566.930.658,11
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,20%	Limite do Fundo: 100%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: IMA-B
Fundo: BRADESCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B	CNPJ: 87.027.980/0012-5	Saldo em 02/2018: R\$ 1.080.505,93
Administrador: BANCO BRADESCO S.A.	CNPJ: 60.746.948/0001-12	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: Art 7º, III "a"	Disponibilidade: D + 1	Adesão: 31/08/2017
Valor da Cota: R\$ 3,626632700	Quantidade de Cotas: 297.936,4108	PL do Fundo: R\$ 1.482.793.903,55
% do PL do Fundo: 0,07%	Limite Cumulativo: 2,66%	Limite do Fundo: 80%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: IMA-B
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	CNPJ: 20.139.299/0001-77	Saldo em 02/2018: R\$ 0,00
Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "b"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/12/2015
Valor da Cota: R\$ 0,000000000	Quantidade de Cotas: 0,0000	PL do Fundo: R\$ 0,00
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,00%	Limite do Fundo: 100%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: IMA-B
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 V TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	CNPJ: 21.922.168/0001-24	Saldo em 02/2018: R\$ 0,00
Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "b"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/12/2015
Valor da Cota: R\$ 0,000000000	Quantidade de Cotas: 0,0000	PL do Fundo: R\$ 0,00
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,00%	Limite do Fundo: 100%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: IMA-B
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	CNPJ: 22.791.300/0001-79	Saldo em 02/2018: R\$ 0,00
Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "b"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/12/2015
Valor da Cota: R\$ 0,000000000	Quantidade de Cotas: 0,0000	PL do Fundo: R\$ 0,00
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,00%	Limite do Fundo: 100%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: IPCA
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	CNPJ: 18.598.256/0001-08	Saldo em 02/2018: R\$ 1.305.342,00
Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: Art 7º, IV "a"	Disponibilidade: D + 425	Adesão: 01/12/2015
Valor da Cota: R\$ 1,305342000	Quantidade de Cotas: 1.000.000,0000	PL do Fundo: R\$ 1.308.845.425,26
% do PL do Fundo: 0,10%	Limite Cumulativo: 3,21%	Limite do Fundo: 30%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: IDKA 2
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CNPJ: 14.386.926/0001-71	Saldo em 02/2018: R\$ 6.382.584,53
Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%

Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "b"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/12/2015
Valor da Cota: R\$ 1,853664000	Quantidade de Cotas: 3.443.226,2427	PL do Fundo: R\$ 4.475.500.473,21
% do PL do Fundo: 0,14%	Limite Cumulativo: 15,68%	Limite do Fundo: 100%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: IDKA 2
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CNPJ: 14.386.926/0001-71	Saldo em 02/2018: R\$ 0,00
Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "b"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/12/2015
Valor da Cota: R\$ 1,853664000	Quantidade de Cotas: 0,0000	PL do Fundo: R\$ 4.475.500.473,21
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,00%	Limite do Fundo: 100%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: IMA-B
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CNPJ: 10.740.658/0001-93	Saldo em 02/2018: R\$ 0,00
Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "b"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/12/2015
Valor da Cota: R\$ 2,616948000	Quantidade de Cotas: 0,0000	PL do Fundo: R\$ 4.283.874.711,54
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,00%	Limite do Fundo: 100%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: IMA-B
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CNPJ: 10.740.658/0001-93	Saldo em 02/2018: R\$ 3.167.336,23
Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "b"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/12/2015
Valor da Cota: R\$ 2,616948000	Quantidade de Cotas: 1.210.316,8385	PL do Fundo: R\$ 4.283.874.711,54
% do PL do Fundo: 0,07%	Limite Cumulativo: 7,78%	Limite do Fundo: 100%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: IMA-B
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CNPJ: 10.740.658/0001-93	Saldo em 02/2018: R\$ 0,00
Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "b"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/12/2015
Valor da Cota: R\$ 2,616948000	Quantidade de Cotas: 0,0000	PL do Fundo: R\$ 4.283.874.711,54
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,00%	Limite do Fundo: 100%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: IRF-M1
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	CNPJ: 10.740.670/0001-06	Saldo em 02/2018: R\$ 0,00
Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "b"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/12/2015
Valor da Cota: R\$ 2,240155000	Quantidade de Cotas: 0,0000	PL do Fundo: R\$ 17.525.487.466,80
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,00%	Limite do Fundo: 100%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: IRF-M1
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	CNPJ: 10.740.670/0001-06	Saldo em 02/2018: R\$ 15.351.882,47
Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "b"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/12/2015
Valor da Cota: R\$ 2,240155000	Quantidade de Cotas: 6.853.044,7536	PL do Fundo: R\$ 17.525.487.466,80
% do PL do Fundo: 0,09%	Limite Cumulativo: 37,72%	Limite do Fundo: 100%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: IRF-M1
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	CNPJ: 10.740.670/0001-06	Saldo em 02/2018: R\$ 134.611,75
Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "b"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/12/2015
Valor da Cota: R\$ 2,240155000	Quantidade de Cotas: 60.090,3732	PL do Fundo: R\$ 17.525.487.466,80
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,33%	Limite do Fundo: 100%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: IRF-M1
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	CNPJ: 10.740.670/0001-06	Saldo em 02/2018: R\$ 7.482,51
Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "b"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/12/2015
Valor da Cota: R\$ 2,240155000	Quantidade de Cotas: 3.340,1751	PL do Fundo: R\$ 17.525.487.466,80
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,02%	Limite do Fundo: 100%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: IRF-M1
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	CNPJ: 10.740.670/0001-06	Saldo em 02/2018: R\$ 337.240,93
Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "b"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/12/2015
Valor da Cota: R\$ 2,240155000	Quantidade de Cotas: 150.543,5695	PL do Fundo: R\$ 17.525.487.466,80
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,83%	Limite do Fundo: 100%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: IRF-M
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CNPJ: 14.508.605/0001-00	Saldo em 02/2018: R\$ 2.009.236,92
Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "b"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 31/01/2018
Valor da Cota: R\$ 1,835453000	Quantidade de Cotas: 1.094.681,7598	PL do Fundo: R\$ 2.813.285.709,33
% do PL do Fundo: 0,07%	Limite Cumulativo: 4,94%	Limite do Fundo: 100%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: CDI
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	CNPJ: 37.372.060/0019-7	Saldo em 02/2018: R\$ 2.283.167,39
Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: Art 7º, IV "a"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/12/2015
Valor da Cota: R\$ 3,284145000	Quantidade de Cotas: 695.209,0696	PL do Fundo: R\$ 6.530.312.240,81
% do PL do Fundo: 0,03%	Limite Cumulativo: 5,61%	Limite do Fundo: 30%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: CDI
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CNPJ: 51.643.560/0018-4	Saldo em 02/2018: R\$ 0,00
Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: Art 7º, IV "a"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/12/2015
Valor da Cota: R\$ 3,550891000	Quantidade de Cotas: 0,0000	PL do Fundo: R\$ 2.010.533.770,62
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,00%	Limite do Fundo: 30%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: CDI
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CNPJ: 51.643.560/0018-4	Saldo em 02/2018: R\$ 6.158.443,88
Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: Art 7º, IV "a"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/12/2015
Valor da Cota: R\$ 3,550891000	Quantidade de Cotas: 1.734.337,6296	PL do Fundo: R\$ 2.010.533.770,62
% do PL do Fundo: 0,31%	Limite Cumulativo: 15,13%	Limite do Fundo: 30%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: CDI
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CNPJ: 51.643.560/0018-4	Saldo em 02/2018: R\$ 379.730,37
Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: Art 7º, IV "a"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/12/2015
Valor da Cota: R\$ 3,550891000	Quantidade de Cotas: 106.939,4611	PL do Fundo: R\$ 2.010.533.770,62
% do PL do Fundo: 0,02%	Limite Cumulativo: 0,93%	Limite do Fundo: 30%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: CDI
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CNPJ: 51.643.560/0018-4	Saldo em 02/2018: R\$ 70.052,04
Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: Art 7º, IV "a"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/12/2015
Valor da Cota: R\$ 3,550891000	Quantidade de Cotas: 19.728,0176	PL do Fundo: R\$ 2.010.533.770,62
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,17%	Limite do Fundo: 30%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: CDI
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CNPJ: 51.643.560/0018-4	Saldo em 02/2018: R\$ 5.373,37
Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: Art 7º, IV "a"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/12/2015
Valor da Cota: R\$ 3,550891000	Quantidade de Cotas: 1.513,2455	PL do Fundo: R\$ 2.010.533.770,62
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,01%	Limite do Fundo: 30%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: CDI
Fundo: ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO FICFI	CNPJ: 61.756.960/0017-3	Saldo em 02/2018: R\$ 147.195,76
Administrador: ITAÚ UNIBANCO S/A	CNPJ: 60.701.190/0001-04	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: Art 7º, IV "a"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/12/2015
Valor da Cota: R\$ 42,796870000	Quantidade de Cotas: 3.439,4048	PL do Fundo: R\$ 10.845.052.436,01
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,36%	Limite do Fundo: 30%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: CDI
Fundo: ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II RENDA FIXA FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FDOS DE INVESTIMENTO	CNPJ: 25.306.703/0001-73	Saldo em 02/2018: R\$ 672.935,53
Administrador: Itaú Unibanco S.A	CNPJ: 60.701.190/0001-04	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: Art 7º, IV "a"	Disponibilidade: D + 5	Adesão: 24/02/2017
Valor da Cota: R\$ 12,003045000	Quantidade de Cotas: 56.063,7347	PL do Fundo: R\$ 1.054.997.247,71
% do PL do Fundo: 0,06%	Limite Cumulativo: 1,65%	Limite do Fundo: 30%

TOTAL: R\$ 40.694.654,75

Relatório competência: 02/2018

CARTEIRA SUGERIDA ESTRATEGIA PRÓXIMO MÊS - PERFIL CONSERVADOR

INDICE	CARTEIRA ATUAL		MOVIMENTAÇÕES	CARTEIRA SUGERIDA	
	SALDO ATUAL	% CAPITAL	APLICAR / RESGATAR	SALDO FINAL	% CAPITAL
FIDC	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
CRED PRIVADO	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
MULTIMERCADO	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
GERAL	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IPCA	1.305.342,00	3,21	956,42	1.306.298,42	3,21
IMA-B	4.247.842,16	10,44	-178.376,69	4.069.465,48	10,00
IMA-B 5	0,00	0,00	4.069.465,48	4.069.465,48	10,00
IMA-B 5+	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IDKA 2	6.382.584,53	15,68	-2.313.119,06	4.069.465,48	10,00
IDKA 20	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IRF-M	3.013.368,48	7,40	5.125.562,47	8.138.930,95	20,00
IRF-M1	16.028.619,24	39,39	-3.820.222,82	12.208.396,43	30,00
IRF-M1+	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
AÇÕES	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
POUPANÇA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FIP	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
SELIC/CDI	9.716.898,34	23,88	-2.884.265,81	6.832.632,53	16,79
TOTAL:	40.694.654,75	100,00		40.694.654,75	100,00

MOVIMENTAÇÕES ACIMA SÃO SUGESTÕES PARA O SEGMENTO DE RENDA FIXA, EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS COMPOSTOS EXCLUSIVAMENTE POR TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS, PARA ALOCAÇÃO EM INSTITUIÇÕES RECONHECIDAMENTE DE PRIMEIRA LINHA, EM PRODUTOS QUE JÁ INTEGRAM A CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RPPS.

Relatório competência: 02/2018

ESTRATEGIA PRÓXIMO MÊS - PERFIL MODERADO

ÍNDICE	CARTEIRA ATUAL		MOVIMENTAÇÕES	CARTEIRA SUGERIDA	
	SALDO ATUAL	% CAPITAL	APLICAR / RESGATAR	SALDO FINAL	% CAPITAL
FIDC	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
CRED PRIVADO	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
MULTIMERCADO	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
GERAL	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IPCA	1.305.342,00	3,21	956,42	1.306.298,42	3,21
IMA-B	4.247.842,16	10,44	1.856.356,05	6.104.198,21	15,00
IMA-B 5	0,00	0,00	2.034.732,74	2.034.732,74	5,00
IMA-B 5+	0,00	0,00	2.763.167,06	2.763.167,06	6,79
IDKA 2	6.382.584,53	15,68	-2.313.119,06	4.069.465,48	10,00
IDKA 20	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IRF-M	3.013.368,48	7,40	5.125.562,47	8.138.930,95	20,00
IRF-M1	16.028.619,24	39,39	-3.820.222,82	12.208.396,43	30,00
IRF-M1+	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
AÇÕES	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
POUPANÇA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FIP	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
SELIC/CDI	9.716.898,34	23,88	-5.647.432,87	4.069.465,48	10,00
TOTAL:	40.694.654,75	100,00		40.694.654,75	100,00

MOVIMENTAÇÕES ACIMA SÃO SUGESTÕES PARA O SEGMENTO DE RENDA FIXA, EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS COMPOSTOS EXCLUSIVAMENTE POR TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS, PARA ALOCAÇÃO EM INSTITUIÇÕES RECONHECIDAMENTE DE PRIMEIRA LINHA, EM PRODUTOS QUE JÁ INTEGRAM A CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RPPS.



DI BLASI CONSULTORIA FINANCEIRA LTDA
 CNPJ 03.866.812/0001-02
 CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS HABILITADA PELA COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS - CVM

Relatório competência: 02/2018