

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

Relatório Competência

09/2017

VISÃO GERAL

FUNDO	DISP. DE RESGATE	SALDO R\$	PARTICIPAÇÃO	QTDE. COTISTAS	% SOBRE PL DO FUNDO	PL DO FUNDO R\$	RESOLUÇÃO	GRAU DE RISCO
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D + 0	78.614,12	0,20 %	1221	0,00 %	11.114.189.323,99	Art 7º ,I, "b"	Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D + 0	1.086.109,47	2,76 %	1221	0,01 %	11.114.189.323,99	Art 7º ,I, "b"	Baixo
BRADESCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B	D + 1	1.043.504,58	2,65 %	103	0,06 %	1.698.626.671,43	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	1.288.040,00	3,28 %	163	0,10 %	1.291.496.610,56	Art 7º , IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	6.172.310,15	15,70 %	601	0,17 %	3.696.441.584,44	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 %	601	0,00 %	3.696.441.584,44	Art 7º ,I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	0,00	0,00 %	771	0,00 %	5.624.777.345,67	Art 7º ,I, "b"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	0,00	0,00 %	771	0,00 %	5.624.777.345,67	Art 7º ,I, "b"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	3.059.477,62	7,78 %	771	0,05 %	5.624.777.345,67	Art 7º ,I, "b"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	0,00	0,00 %	1382	0,00 %	14.886.805.108,28	Art 7º ,I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	327.682,02	0,83 %	1382	0,00 %	14.886.805.108,28	Art 7º ,I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	16.764.360,20	42,64 %	1382	0,11 %	14.886.805.108,28	Art 7º ,I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	351.773,58	0,89 %	1382	0,00 %	14.886.805.108,28	Art 7º ,I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	45.830,62	0,12 %	1382	0,00 %	14.886.805.108,28	Art 7º ,I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	D + 0	2.221.600,36	5,65 %	776	0,04 %	5.872.213.177,84	Art 7º , IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	0,00	0,00 %	442	0,00 %	1.922.875.272,25	Art 7º , IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	6.226.947,78	15,84 %	442	0,32 %	1.922.875.272,25	Art 7º , IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	230.131,15	0,59 %	442	0,01 %	1.922.875.272,25	Art 7º , IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	32.050,52	0,08 %	442	0,00 %	1.922.875.272,25	Art 7º , IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	142.198,24	0,36 %	442	0,01 %	1.922.875.272,25	Art 7º , IV "a"	Baixo
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO FICFI	D + 0	143.217,42	0,36 %	1262	0,00 %	7.596.415.591,82	Art 7º , IV "a"	Baixo
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II RENDA FIXA FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FDS DE INVESTIMENTO	D + 5	105.699,84	0,27 %	66	0,02 %	494.909.720,17	Art 7º , IV "a"	Baixo

TOTAL SALDO: R\$ 39.319.547,67

Relatório competência: 09/2017



ENQUADRAMENTO

RENDA FIXA - ARTIGOS	LIMITE DA RESOLUÇÃO	LIMITE POLITICA	TOTAL	% CARTEIRA
Art 7º, I, "b"	100 %	100 %	27.886.157,78	70,92
Art 7º, III "a"	80 %	80 %	1.043.504,58	2,65
Art 7º, IV "a"	30 %	30 %	10.389.885,31	26,42

RENDA VARIÁVEL - ARTIGOS	LIMITE DA RESOLUÇÃO	LIMITE POLÍTICA	TOTAL	% CARTEIRA
--------------------------	---------------------	-----------------	-------	------------

DISTRIBUIÇÃO POR PARÂMETRO DE RENTABILIDADE	TOTAL	% CARTEIRA
CDI	9.101.845,31	23,15
IDKA 2	6.172.310,15	15,70
IMA-B	4.102.982,20	10,43
IPCA	1.288.040,00	3,28
IRF-M1	18.654.370,01	47,44

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	TOTAL	% CARTEIRA
BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A CNPJ: 30822936000169	1.164.723,59	2,96
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CNPJ: 360305000104	36.862.402,24	93,75
ITAU UNIBANCO S/A CNPJ: 60701190000104	248.917,26	0,63
BANCO BRADESCO S.A. CNPJ: 60746948000112	1.043.504,58	2,65

Relatório competência: 09/2017

RETORNOS

FUNDO	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO R\$	RETORNO %	EFETIVO %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 78.058,91	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 78.614,12	R\$ 555,21	0,71130 %	0,71130 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 1.078.438,93	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 1.086.109,47	R\$ 7.670,54	0,71130 %	0,71130 %
BRASESCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B	R\$ 0,00	R\$ 1.036.263,12	R\$ 0,00	R\$ 1.043.504,58	R\$ 7.241,46	1,82554 %	1,82554 %
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\$ 1.281.668,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 1.288.040,00	R\$ 6.372,00	0,49716 %	0,49716 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 6.117.759,11	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 6.172.310,15	R\$ 54.551,04	0,89168 %	0,89168 %
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	0,89168 %	0,89168 %
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	1,79986 %	1,79986 %
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	1,79986 %	1,79986 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 3.005.384,95	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 3.059.477,62	R\$ 54.092,67	1,79986 %	1,79986 %
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	0,71464 %	0,71464 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	R\$ 325.356,87	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 327.682,02	R\$ 2.325,15	0,71464 %	0,71464 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	R\$ 16.645.404,68	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 16.764.360,20	R\$ 118.955,52	0,71464 %	0,71464 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	R\$ 264.600,84	R\$ 85.000,00	R\$ 0,00	R\$ 351.773,58	R\$ 2.172,74	0,71464 %	0,71464 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	R\$ 45.505,42	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 45.830,62	R\$ 325,20	0,71464 %	0,71464 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	R\$ 2.207.604,41	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 2.221.600,36	R\$ 13.995,95	0,63399 %	0,63399 %
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	0,65445 %	0,65445 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 6.163.514,69	R\$ 68.000,00	R\$ 45.000,00	R\$ 6.226.947,78	R\$ 40.433,09	0,65445 %	0,65445 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 133.503,16	R\$ 560.000,00	R\$ 465.000,00	R\$ 230.131,15	R\$ 1.627,99	0,65445 %	0,65445 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 32.825,63	R\$ 25.000,00	R\$ 26.000,00	R\$ 32.050,52	R\$ 224,89	0,65445 %	0,65445 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 41.578,47	R\$ 150.000,00	R\$ 50.000,00	R\$ 142.198,24	R\$ 619,77	0,65445 %	0,65445 %
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO FICFI	R\$ 142.315,19	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 143.217,42	R\$ 902,23	0,63396 %	0,63396 %
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II RENDA FIXA FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FDS DE INVESTIMENTO	R\$ 104.130,58	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 105.699,84	R\$ 1.569,26	1,50701 %	1,50701 %
TOTAIS	R\$ 37.667.649,84	R\$ 1.924.263,12	R\$ 586.000,00	R\$ 39.319.547,67	R\$ 313.634,71	0,8363 %	0,8363 %



RETORNOS ACUMULADO

MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO R\$	RETORNO %	META %	ATINGIMENTO %
JANEIRO	R\$ 32.309.160,96	R\$ 2.140.000,00	R\$ 314.000,00	R\$ 34.516.230,59	R\$ 381.069,63	1,1583 %	0,87 %	133,35 %
FEVEREIRO	R\$ 34.516.230,59	R\$ 5.796.348,44	R\$ 5.531.348,44	R\$ 35.175.550,42	R\$ 394.319,83	1,1474 %	0,82 %	140,20 %
MARÇO	R\$ 35.175.550,42	R\$ 1.275.000,00	R\$ 686.000,00	R\$ 36.169.216,68	R\$ 404.666,26	1,1275 %	0,74 %	152,78 %
ABRIL	R\$ 36.169.216,68	R\$ 10.000,00	R\$ 87.000,00	R\$ 36.352.355,27	R\$ 260.138,59	0,7205 %	0,63 %	114,82 %
MAIO	R\$ 36.352.355,27	R\$ 722.000,00	R\$ 769.121,72	R\$ 36.531.808,08	R\$ 226.574,53	0,6432 %	0,80 %	80,57 %
JUNHO	R\$ 36.531.808,08	R\$ 564.000,00	R\$ 620.000,00	R\$ 36.749.184,84	R\$ 273.376,76	0,7459 %	0,26 %	291,70 %
JULHO	R\$ 36.749.184,84	R\$ 672.000,00	R\$ 994.000,00	R\$ 36.948.224,79	R\$ 521.039,95	1,4305 %	0,73 %	196,49 %
AGOSTO	R\$ 36.948.224,79	R\$ 991.530,85	R\$ 613.530,85	R\$ 37.667.649,84	R\$ 341.425,05	0,9173 %	0,68 %	135,36 %
SETEMBRO	R\$ 37.667.649,84	R\$ 1.924.263,12	R\$ 586.000,00	R\$ 39.319.547,67	R\$ 313.634,71	0,8363 %	0,65 %	129,13 %
TOTAIS		R\$ 14.095.142,41	R\$ 10.201.001,01		R\$ 3.116.245,31	9,07	6,33	143,29

Relatório competência: 09/2017

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 emittentes 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 RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	IRF-M1	0,32 %	1,60 %	0,37 %	0,37 %	0,47%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	IRF-M1	0,32 %	1,60 %	0,37 %	0,37 %	0,47%
BRASESCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B	IMA-B	1,03 %	0,24 %	17,41 %	13,21 %	10,18%
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 %	-2,33 %	4,59 %	3,58 %	3,63%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IDKA 2	1,34 %	0,57 %	3,29 %	2,52 %	1,94%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IDKA 2	1,34 %	0,57 %	3,29 %	2,52 %	1,94%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	4,66 %	0,52 %	6,78 %	6,21 %	6,01%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	4,66 %	0,52 %	6,78 %	6,21 %	6,01%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	4,66 %	0,52 %	6,78 %	6,21 %	6,01%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IRF-M1	0,32 %	1,75 %	0,33 %	0,37 %	0,47%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IRF-M1	0,32 %	1,75 %	0,33 %	0,37 %	0,47%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IRF-M1	0,32 %	1,75 %	0,33 %	0,37 %	0,47%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IRF-M1	0,32 %	1,75 %	0,33 %	0,37 %	0,47%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IRF-M1	0,32 %	1,75 %	0,33 %	0,37 %	0,47%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	CDI	0,05 %	0,06 %	0,07 %	0,39 %	0,46%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CDI	0,07 %	-0,14 %	0,03 %	0,35 %	0,47%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CDI	0,07 %	-0,14 %	0,03 %	0,35 %	0,47%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CDI	0,07 %	-0,14 %	0,03 %	0,35 %	0,47%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CDI	0,07 %	-0,14 %	0,03 %	0,35 %	0,47%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CDI	0,07 %	-0,14 %	0,03 %	0,35 %	0,47%
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO FICFI	CDI	0,00 %	0,00 %	0,00 %	0,00 %	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II RENDA FIXA FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	CDI	0,40 %	0,88 %	2,93 %	4,34 %	3,89%



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 RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	11.328.882/0001-35	IRF-M1	78.614,12	0,07 %	0,66 %	55,03
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	11.328.882/0001-35	IRF-M1	1.086.109,47	0,07 %	0,66 %	760,28
BRADESCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B	08.702.798/0001-25	IMA-B	1.043.504,58	1,03 %	10,18 %	10.748,10
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	1.288.040,00	0,42 %	4,24 %	5.409,77
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	14.386.926/0001-71	IDKA 2	6.172.310,15	0,29 %	2,86 %	17.899,70
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	14.386.926/0001-71	IDKA 2	0,00	0,29 %	2,86 %	0,00
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	10.740.658/0001-93	IMA-B	0,00	1,01 %	9,99 %	0,00
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	10.740.658/0001-93	IMA-B	0,00	1,01 %	9,99 %	0,00
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	10.740.658/0001-93	IMA-B	3.059.477,62	1,01 %	9,99 %	30.900,72
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	IRF-M1	0,00	0,07 %	0,65 %	0,00
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	IRF-M1	327.682,02	0,07 %	0,65 %	229,38
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	IRF-M1	16.764.360,20	0,07 %	0,65 %	11.735,05
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	IRF-M1	351.773,58	0,07 %	0,65 %	246,24
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	IRF-M1	45.830,62	0,07 %	0,65 %	32,08
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	CDI	2.221.600,36	0,01 %	0,07 %	222,16
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	05.164.356/0001-84	CDI	0,00	0,01 %	0,14 %	0,00
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	05.164.356/0001-84	CDI	6.226.947,78	0,01 %	0,14 %	622,69
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	05.164.356/0001-84	CDI	230.131,15	0,01 %	0,14 %	23,01
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	05.164.356/0001-84	CDI	32.050,52	0,01 %	0,14 %	3,21
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	05.164.356/0001-84	CDI	142.198,24	0,01 %	0,14 %	14,22
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO FICFI	06.175.696/0001-73	CDI	143.217,42	0,00 %	0,00 %	0,00
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II RENDA FIXA FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FDS DE INVESTIMENTO	25.306.703/0001-73	CDI	105.699,84	0,40 %	3,89 %	422,80

RISCO DE MERCADO	
Saldo Total:	R\$ 39.319.547,67
Provisão para perda e Investimentos:	R\$ 79.324,44
% Provisão de Perda:	0,202%



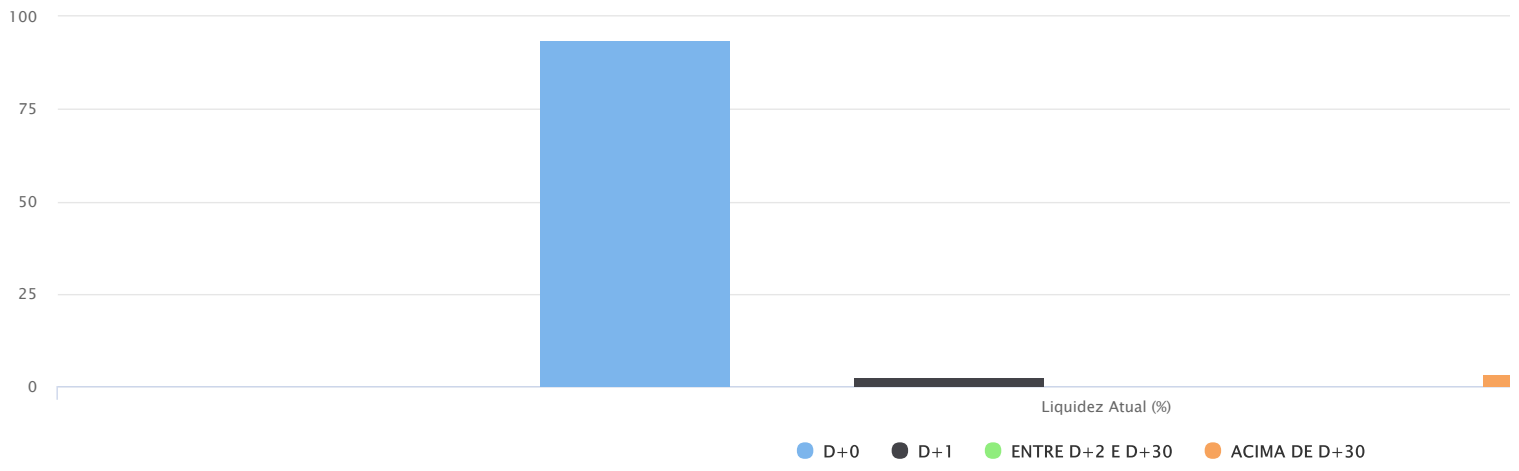
RISCO DE LIQUIDEZ

FUNDO	DISP. DE RESGATE	SALDO R\$	PARTICIPAÇÃO	QTDE. COTISTAS	% SOBRE PL DO FUNDO	PL DO FUNDO R\$	RESOLUÇÃO	GRAU DE RISCO
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D + 0	78.614,12	0,20 %	1221	0,00 %	11.114.189.323,99	Art 7º, I, "b"	Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D + 0	1.086.109,47	2,76 %	1221	0,01 %	11.114.189.323,99	Art 7º, I, "b"	Baixo
BRADESCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B	D + 1	1.043.504,58	2,65 %	103	0,06 %	1.698.626.671,43	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	1.288.040,00	3,28 %	163	0,10 %	1.291.496.610,56	Art 7º, IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	6.172.310,15	15,70 %	601	0,17 %	3.696.441.584,44	Art 7º, I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	0,00	0,00 %	601	0,00 %	3.696.441.584,44	Art 7º, I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	0,00	0,00 %	771	0,00 %	5.624.777.345,67	Art 7º, I, "b"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	0,00	0,00 %	771	0,00 %	5.624.777.345,67	Art 7º, I, "b"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	3.059.477,62	7,78 %	771	0,05 %	5.624.777.345,67	Art 7º, I, "b"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	0,00	0,00 %	1382	0,00 %	14.886.805.108,28	Art 7º, I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	327.682,02	0,83 %	1382	0,00 %	14.886.805.108,28	Art 7º, I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	16.764.360,20	42,64 %	1382	0,11 %	14.886.805.108,28	Art 7º, I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	351.773,58	0,89 %	1382	0,00 %	14.886.805.108,28	Art 7º, I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	45.830,62	0,12 %	1382	0,00 %	14.886.805.108,28	Art 7º, I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	D + 0	2.221.600,36	5,65 %	776	0,04 %	5.872.213.177,84	Art 7º, IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	0,00	0,00 %	442	0,00 %	1.922.875.272,25	Art 7º, IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	6.226.947,78	15,84 %	442	0,32 %	1.922.875.272,25	Art 7º, IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	230.131,15	0,59 %	442	0,01 %	1.922.875.272,25	Art 7º, IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	32.050,52	0,08 %	442	0,00 %	1.922.875.272,25	Art 7º, IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	142.198,24	0,36 %	442	0,01 %	1.922.875.272,25	Art 7º, IV "a"	Baixo
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO FICFI	D + 0	143.217,42	0,36 %	1262	0,00 %	7.596.415.591,82	Art 7º, IV "a"	Baixo
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II RENDA FIXA FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	D + 5	105.699,84	0,27 %	66	0,02 %	494.909.720,17	Art 7º, IV "a"	Baixo

TOTAL SALDO: R\$ 39.319.547,67

PRAZO DE RESGATE	QUANTIDADE DE FUNDOS	LIQUIDEZ ATUAL
D+0	22	94%
D+1	1	3%
ENTRE D+2 E D+30	1	0%
ACIMA DE D+30	1	3%

Gráfico



Relatório competência: 09/2017



RISCO DE CRÉDITO

RENDA FIXA - ARTIGOS	LIMITE DA RESOLUÇÃO	LIMITE POLÍTICA	TOTAL	% CARTEIRA
Art 7º, I, "b"	100 %	100 %	27.886.157,78	70,92
Art 7º, III "a"	80 %	80 %	1.043.504,58	2,65
Art 7º, IV "a"	30 %	30 %	10.389.885,31	26,42
			39.319.547,67	

RISCO DE CRÉDITO	% CARTEIRA
100% Títulos Públicos e 0% Títulos Privados	70,92%
50% Títulos Públicos e 50% Títulos Privados	29,08%
0% Títulos Públicos e 100% Títulos Privados	0,00%

Relatório competência: 09/2017



CAPITAL PROTEGIDO

TIPO DE PRODUTO E PERCENTUAL DO CAPITAL INVESTIDO PROTEGIDO	TIPO DE PRODUTO PERCENTUAL DO CAPITAL
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.

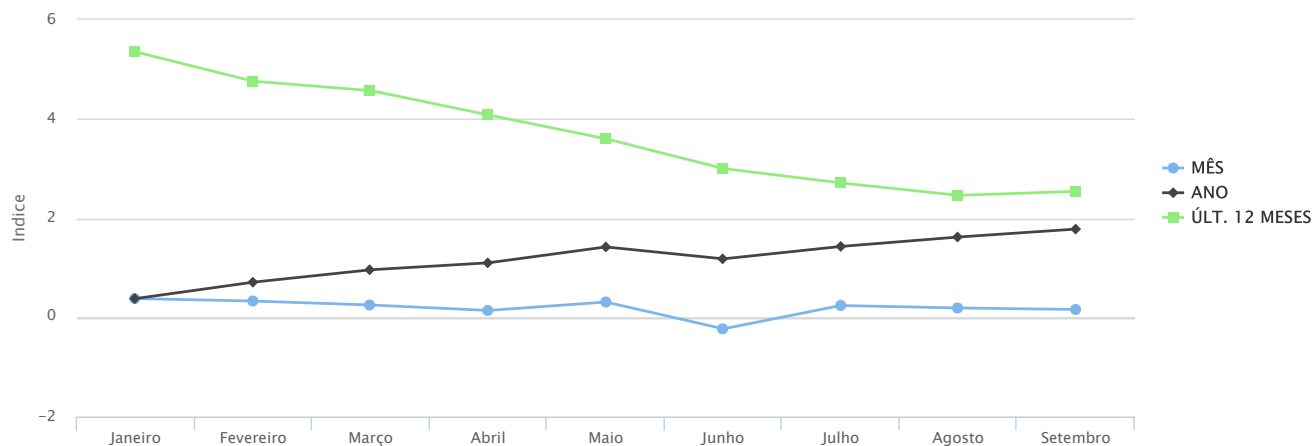
Relatório competência: 09/2017



ÍNDICES ECONÔMICOS

IPCA

2017

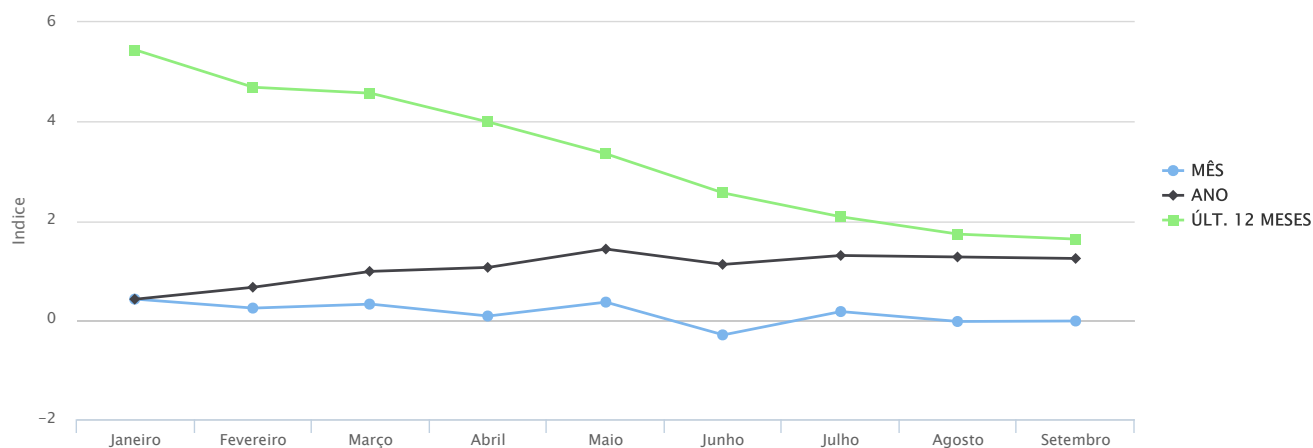


Highcharts.com

2017	Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Maior	Junho	Julho	Agosto	Setembro	Outubro	Novembro	Dezembro
MÊS	0.3800	0.3300	0.2500	0.1400	0.3100	-0.2300	0.2400	0.1900	0.1600			
ANO	0.3800	0.7100	0.9600	1.1000	1.4200	1.1800	1.4300	1.6200	1.7800			
ULT. 12 M	5.3500	4.7600	4.5700	4.0800	3.6000	3.0000	2.7100	2.4600	2.5400			

INPC

2017

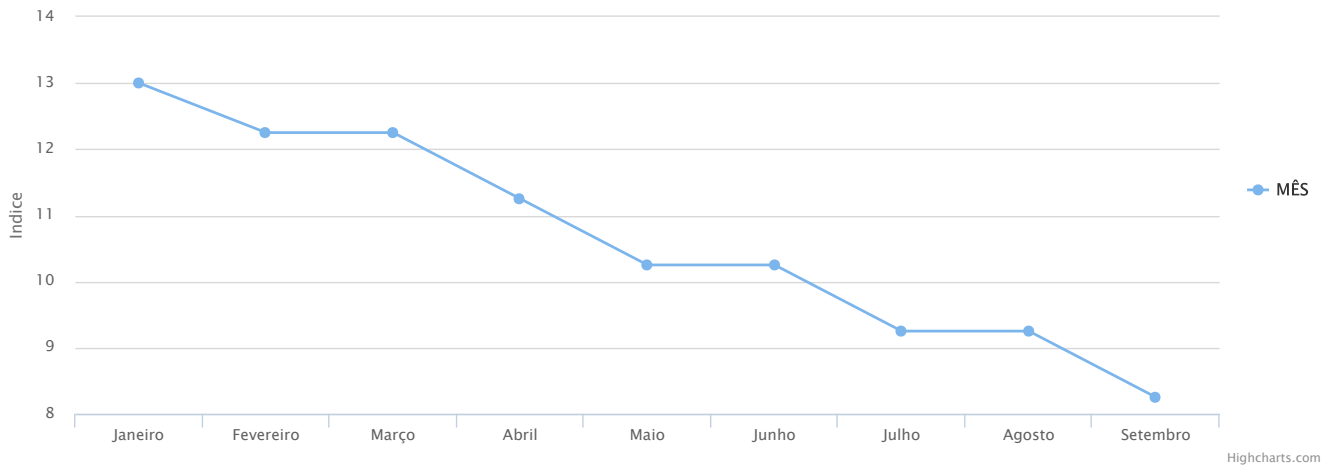


Highcharts.com

2017	Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Maior	Junho	Julho	Agosto	Setembro	Outubro	Novembro	Dezembro
MÊS	0.42	0.24	0.32	0.08	0.36	-0.30	0.17	-0.03	-0.02			
ANO	0.42	0.66	0.98	1.06	1.43	1.12	1.30	1.27	1.24			
ULT. 12 M	5.44	4.69	4.57	3.99	3.35	2.56	2.08	1.73	1.63			

SELIC

2017



Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Maiο	Junho	Julho	Agosto	Setembro	Outubro	Novembro	Dezembro
13.00	12.25	12.25	11.25	10.25	10.25	9.25	9.25	8.25			

Relatório competência: 09/2017



CADPREV

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 09/2017: R\$ 78.614,12
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\$ 2,276454000	Quantidade de Cotas: 34.533,5860	PL do Fundo: R\$ 11.114.189.323,99
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,20%	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 09/2017: R\$ 1.086.109,47
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\$ 2,276454000	Quantidade de Cotas: 477.105,8277	PL do Fundo: R\$ 11.114.189.323,99
% do PL do Fundo: 0,01%	Limite Cumulativo: 2,76%	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 09/2017: R\$ 1.043.504,58
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\$ 3,502440600	Quantidade de Cotas: 297.936,4104	PL do Fundo: R\$ 1.698.626.671,43
% do PL do Fundo: 0,06%	Limite Cumulativo: 2,65%	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 09/2017: 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 09/2017: 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 09/2017: 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 09/2017: R\$ 1.288.040,00
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\$ 1,288040000	Quantidade de Cotas: 1.000.000,0000	PL do Fundo: R\$ 1.291.496.610,56
% do PL do Fundo: 0,10%	Limite Cumulativo: 3,28%	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 09/2017: R\$ 6.172.310,15
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\$ 1,792595000	Quantidade de Cotas: 3.443.226,2446	PL do Fundo: R\$ 3.696.441.584,44
% do PL do Fundo: 0,17%	Limite Cumulativo: 15,70%	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 09/2017: 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\$ 1,792595000	Quantidade de Cotas: 0,0000	PL do Fundo: R\$ 3.696.441.584,44
% 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 09/2017: 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\$ 2,527832000	Quantidade de Cotas: 0,0000	PL do Fundo: R\$ 5.624.777.345,67
% 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 09/2017: 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\$ 2,527832000	Quantidade de Cotas: 0,0000	PL do Fundo: R\$ 5.624.777.345,67
% 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 09/2017: R\$ 3.059.477,62
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\$ 2,527832000	Quantidade de Cotas: 1.210.316,8328	PL do Fundo: R\$ 5.624.777.345,67
% do PL do Fundo: 0,05%	Limite Cumulativo: 7,78%	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 09/2017: 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\$ 2,176659000	Quantidade de Cotas: 0,0000	PL do Fundo: R\$ 14.886.805.108,28
% 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 09/2017: R\$ 327.682,02
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\$ 2,176659000	Quantidade de Cotas: 150.543,5716	PL do Fundo: R\$ 14.886.805.108,28
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,83%	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 09/2017: R\$ 16.764.360,20
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\$ 2,176659000	Quantidade de Cotas: 7.701.877,1429	PL do Fundo: R\$ 14.886.805.108,28
% do PL do Fundo: 0,11%	Limite Cumulativo: 42,64%	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 09/2017: R\$ 351.773,58
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\$ 2,176659000	Quantidade de Cotas: 161.611,7086	PL do Fundo: R\$ 14.886.805.108,28
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,89%	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 09/2017: R\$ 45.830,62
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\$ 2,176659000	Quantidade de Cotas: 21.055,4892	PL do Fundo: R\$ 14.886.805.108,28
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,12%	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 09/2017: R\$ 2.221.600,36
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\$ 3,195586000	Quantidade de Cotas: 695.209,0665	PL do Fundo: R\$ 5.872.213.177,84
% do PL do Fundo: 0,04%	Limite Cumulativo: 5,65%	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 09/2017: 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\$ 3,454633000	Quantidade de Cotas: 0,0000	PL do Fundo: R\$ 1.922.875.272,25
% 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 09/2017: R\$ 6.226.947,78
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\$ 3,454633000	Quantidade de Cotas: 1.802.491,8363	PL do Fundo: R\$ 1.922.875.272,25
% do PL do Fundo: 0,32%	Limite Cumulativo: 15,84%	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 09/2017: R\$ 230.131,15
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\$ 3,454633000	Quantidade de Cotas: 66.615,2237	PL do Fundo: R\$ 1.922.875.272,25
% do PL do Fundo: 0,01%	Limite Cumulativo: 0,59%	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 09/2017: R\$ 32.050,52
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\$ 3,454633000	Quantidade de Cotas: 9.277,5470	PL do Fundo: R\$ 1.922.875.272,25
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,08%	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 09/2017: R\$ 142.198,24
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\$ 3,454633000	Quantidade de Cotas: 41.161,6053	PL do Fundo: R\$ 1.922.875.272,25
% do PL do Fundo: 0,01%	Limite Cumulativo: 0,36%	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 09/2017: R\$ 143.217,42
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\$ 41,640176000	Quantidade de Cotas: 3.439,4048	PL do Fundo: R\$ 7.596.415.591,82
% 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 FDS DE INVESTIMENTO	CNPJ: 25.306.703/0001-73	Saldo em 09/2017: R\$ 105.699,84
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\$ 11,626770000	Quantidade de Cotas: 9.091,0752	PL do Fundo: R\$ 494.909.720,17
% do PL do Fundo: 0,02%	Limite Cumulativo: 0,27%	Limite do Fundo: 30%

TOTAL: R\$ 39.319.547,67

Relatório competência: 09/2017

CARTEIRA SUGERIDA ESTRATEGIA PRÓXIMO MÊS - PERFIL CONSERVADOR

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	1.288.040,00	3,28	1.641,16	1.289.681,16	3,28
IMA-B	4.102.982,20	10,43	1.794.949,95	5.897.932,15	15,00
IMA-B 5	0,00	0,00	3.931.954,77	3.931.954,77	10,00
IMA-B 5+	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IDKA 2	6.172.310,15	15,70	-4.206.332,77	1.965.977,38	5,00
IDKA 20	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IRF-M	0,00	0,00	7.863.909,53	7.863.909,53	20,00
IRF-M1	18.654.370,01	47,44	-10.790.460,48	7.863.909,53	20,00
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	9.101.845,31	23,15	1.404.337,83	10.506.183,14	26,72
TOTAL:	39.319.547,67	100,00		39.319.547,67	100,00

Relatório competência: 09/2017



ESTRATEGIA PRÓXIMO MÊS - PERFIL MODERADO

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	1.965.977,38	1.965.977,38	5,00
GERAL	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IPCA	1.288.040,00	3,28	1.641,16	1.289.681,16	3,28
IMA-B	4.102.982,20	10,43	-171.027,43	3.931.954,77	10,00
IMA-B 5	0,00	0,00	1.965.977,38	1.965.977,38	5,00
IMA-B 5+	0,00	0,00	2.642.273,60	2.642.273,60	6,72
IDKA 2	6.172.310,15	15,70	-4.206.332,77	1.965.977,38	5,00
IDKA 20	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IRF-M	0,00	0,00	7.863.909,53	7.863.909,53	20,00
IRF-M1	18.654.370,01	47,44	-10.790.460,48	7.863.909,53	20,00
IRF-M1+	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
AÇÕES	0,00	0,00	5.897.932,15	5.897.932,15	15,00
POUPANÇA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FIP	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
SELIC/CDI	9.101.845,31	23,15	-5.169.890,54	3.931.954,77	10,00
TOTAL:	39.319.547,67	100,00		39.319.547,67	100,00

Kenzo Eduardo de Blasi

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

Relatório competência: 09/2017