



INSTITUTO DE PREVIDENCIA DOS SERVIDORES PUBLICOS DE PARAGOMINAS

Relatório Competência

09/2018

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 %	114	0,00 %	267.797.231,50	Art 8º, I, "a"	Alto	1,00 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	D + 0	11.181,86	0,01 %	670	0,00 %	1.316.299.879,59	Art 7º, IV "a"	Baixo	1,00 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	D + 0	54.798,28	0,03 %	670	0,00 %	1.316.299.879,59	Art 7º, IV "a"	Baixo	1,00 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 1	9.701.869,85	5,34 %	733	0,15 %	6.551.962.373,55	Art 7º, I, "b"	Baixo	0,20 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 0	330.764,93	0,18 %	192	0,04 %	905.048.053,56	Art 7º, IV "a"	Médio	0,30 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D + 0	11.352.665,13	6,25 %	1267	0,09 %	12.769.780.117,05	Art 7º, I, "b"	Baixo	0,10 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	D + 0	28.447.941,37	15,67 %	814	0,50 %	5.706.167.765,89	Art 7º, IV "a"	Baixo	0,20 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 2705	839.581,70	0,46 %	140	0,11 %	795.157.942,58	Art 7º, I, "b"	Médio	0,20 %
BRASESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS	D + 0	3.287.542,87	1,81 %	298	0,21 %	1.529.875.360,39	Art 7º, I, "b"	Baixo	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 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 425	0,00	0,00 %		0,00 %	0,00	Art 7º, IV "a"	Baixo	0,00 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	4.416.463,93	2,43 %	599	0,14 %	3.081.131.095,61	Art 7º, I, "b"	Médio	0,20 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA VII MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D + 0	0,00	0,00 %		0,00 %	0,00	Art 8º, III	Alto	0,20 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	27.513.438,91	15,15 %	1471	0,14 %	19.832.435.937,17	Art 7º, I, "b"	Baixo	0,20 %

FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	19.465.340,99	10,72 %	313	0,95 %	2.057.423.262,98	Art 7º, I, "b"	Médio	0,20 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	D + 0	7.241.981,32	3,99 %	822	0,09 %	8.348.473.002,20	Art 7º, IV "a"	Baixo	0,20 %
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	D + 0	8.130.784,55	4,48 %	263	0,46 %	1.749.264.876,20	Art 7º, III "a"	Médio	0,20 %
META PLUS FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	D + 1	880.568,98	0,48 %	16	5,21 %	16.909.798,61	Art 8º, III	Alto	2,50 %
META VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	D + 4	7.363.824,50	4,06 %	192	5,14 %	143.336.656,42	Art 8º, II, "a"	Alto	3,00 %
OCEANA VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	D + 4	0,00	0,00 %	78	0,00 %	376.019.946,53	Art 8º, II, "a"	Alto	2,00 %
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	D + 13	6.644.706,87	3,66 %	203	9,84 %	67.504.620,19	Art 8º, II, "a"	Alto	2,00 %
SAFRA EXECUTIVE 2 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	D + 1	0,00	0,00 %	16	0,00 %	407.619.586,11	Art 7º, IV "a"	Médio	0,20 %
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B LP	D + 1	5.059.708,97	2,79 %	63	3,42 %	147.996.961,11	Art 7º, III "a"	Médio	0,20 %
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1	D + 1	21.298.885,94	11,73 %	61	12,35 %	172.429.076,89	Art 7º, III "a"	Médio	0,20 %
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	D + 1	1.086.710,14	0,60 %	55	0,85 %	127.616.756,05	Art 7º, III "a"	Médio	0,20 %
WESTERN ASSET IMAB5 ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	D + 0	630.992,99	0,35 %	21	0,22 %	283.759.032,69	Art 7º, I, "b"	Médio	0,40 %
WESTERN ASSET US INDEX 500 FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	D + 1	2.428.577,63	1,34 %	11415	0,20 %	1.216.325.834,54	Art 8º, III	Alto	1,00 %
OCEANA VALOR 30 FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	D + 30	15.379.220,72	8,47 %	28	15,12 %	101.700.723,29	Art 8º, II, "a"	Alto	2,00 %

TOTAL SALDO: R\$ 181.567.552,43

Relatório competência: 09/2018

ENQUADRAMENTO

RENTA FIXA - ARTIGOS	LIMITE DA RESOLUÇÃO	LIMITE POLÍTICA	TOTAL	% CARTEIRA	SITUAÇÃO
FI 100 TÍTULOS TN - Art 7º, I, "b"	100 %	100 %	77.207.896,37	42,52 %	ENQUADRADO
FI RENDA FIXA REFERENCIADA - Art 7º, III "a"	60 %	60 %	35.576.089,60	19,59 %	ENQUADRADO
FI RENDA FIXA GERAL - Art 7º, IV "a"	40 %	40 %	36.086.667,76	19,88 %	ENQUADRADO

RENTA VARIÁVEL - ARTIGOS	LIMITE DA RESOLUÇÃO	LIMITE POLÍTICA	TOTAL	% CARTEIRA	SITUAÇÃO
FI DE AÇÕES / INDICES COM MIN 50 AÇÕES - Art 8º, I, "a"	30 %	30 %	0,00	0,00 %	ENQUADRADO
FI DE AÇÕES GERAL - Art 8º, II, "a"	20 %	20 %	29.387.752,09	16,19 %	ENQUADRADO
FI MULTIMERCADO ABERTO - Art 8º, III	10 %	10 %	3.309.146,61	1,82 %	ENQUADRADO

DISTRIBUIÇÃO POR PARÂMETRO DE RENTABILIDADE	TOTAL	% CARTEIRA
AÇÕES	29.387.752,09	16,19
CDI	35.755.902,83	19,69
IDKA 2	9.701.869,85	5,34
IMA-B	17.937.722,38	9,88
IMA-B 5	630.992,99	0,35
IPCA	839.581,70	0,46
IRF-M	20.552.051,13	11,32
IRF-M1	63.452.532,85	34,95
MULTIMERCADO	3.309.146,61	1,82

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	TOTAL	% CARTEIRA
BEM - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA. CNPJ: 00066670000100	6.644.706,87	3,66
BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A. CNPJ: 01181521000155	27.445.305,05	15,12

BNY MELLON SERVICOS FINANCEIROS DTVM S.A. CNPJ: 02201501000161	23.623.614,20	13,01
WESTERN ASSET MANAGEMENT COMPANY DTVM LIMITADA CNPJ: 07437241000141	3.059.570,62	1,69
BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A CNPJ: 30822936000169	50.738.803,12	27,94
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CNPJ: 360305000104	66.768.009,70	36,77
JS ADMINISTRACAO DE RECURSOS S/A CNPJ: 43826833000119	0,00	0,00
BANCO BRADESCO S.A CNPJ: 60746948000112	3.287.542,87	1,81

Relatório competência: 09/2018

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	3,25106 %	3,25106 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 32.015,55	R\$ 80.250,32	R\$ 101.198,85	R\$ 11.181,86	R\$ 114,84	0,38760 %	0,38760 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 131.173,46	R\$ 1.870.591,11	R\$ 1.951.716,03	R\$ 54.798,28	R\$ 4.749,74	0,38760 %	0,38760 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 9.589.551,90	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 9.701.869,85	R\$ 112.317,95	1,17125 %	1,17125 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 331.319,37	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 330.764,93	R\$ -554,44	-0,16734 %	-0,16734 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 11.286.059,01	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 11.352.665,13	R\$ 66.606,12	0,59015 %	0,59015 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	R\$ 27.239.862,36	R\$ 1.073.456,41	R\$ 0,00	R\$ 28.447.941,37	R\$ 134.622,60	0,49155 %	0,49155 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 833.097,51	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 839.581,70	R\$ 6.484,19	0,77832 %	0,77832 %
BRASESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 3.267.439,97	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 3.287.542,87	R\$ 20.102,90	0,61525 %	0,61525 %
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 2018 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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 4.424.454,57	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 4.416.463,93	R\$ -7.990,64	-0,18060 %	-0,18060 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA VII MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	-	-
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	R\$ 27.352.409,33	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 27.513.438,91	R\$ 161.029,58	0,58872 %	0,58872 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 19.237.804,36	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 19.465.340,99	R\$ 227.536,63	1,18276 %	1,18276 %

FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	R\$ 7.209.932,23	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 7.241.981,32	R\$ 32.049,09	0,44451 %	0,44451 %
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	R\$ 8.141.026,05	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 8.130.784,55	R\$ -10.241,50	-0,12580 %	-0,12580 %
META PLUS FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	R\$ 883.347,69	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 880.568,98	R\$ -2.778,71	-0,31457 %	-0,31457 %
META VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	R\$ 7.211.568,17	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 7.363.824,50	R\$ 152.256,33	2,11128 %	2,11128 %
OCEANA VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	3,11938 %	3,11938 %
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$ 6.559.037,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 6.644.706,87	R\$ 85.669,87	1,30613 %	1,30613 %
SAFRA EXECUTIVE 2 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	0,66020 %	0,66020 %
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B LP	R\$ 11.069.418,61	R\$ 0,00	R\$ 6.000.000,00	R\$ 5.059.708,97	R\$ -9.709,64	-0,08252 %	-0,08252 %
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1	R\$ 14.214.282,46	R\$ 7.000.000,00	R\$ 0,00	R\$ 21.298.885,94	R\$ 84.603,48	0,59520 %	0,59520 %
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	R\$ 2.061.745,32	R\$ 0,00	R\$ 1.000.000,00	R\$ 1.086.710,14	R\$ 24.964,82	1,21424 %	1,21424 %
WESTERN ASSET IMAB5 ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 624.658,59	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 630.992,99	R\$ 6.334,40	1,01406 %	1,01406 %
WESTERN ASSET US INDEX 500 FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	R\$ 2.417.270,75	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 2.428.577,63	R\$ 11.306,88	0,46775 %	0,46775 %
OCEANA VALOR 30 FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	R\$ 14.916.326,29	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 15.379.220,72	R\$ 462.894,43	3,10327 %	3,10327 %
TOTAIS	R\$ 179.033.800,55	R\$ 10.024.297,84	R\$ 9.052.914,88	R\$ 181.567.552,43	R\$ 1.562.368,92	0,8941 %	0,8941 %

RETORNOS ACUMULADO

MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO R\$	RETORNO %	META %	ATINGIMENTO %
JANEIRO	R\$ 166.315.104,34	R\$ 131.752,61	R\$ 1.365.273,23	R\$ 169.526.619,49	R\$ 4.445.035,77	2,8087 %	0,78 %	360,92 %
FEVEREIRO	R\$ 169.526.619,49	R\$ 2.907.608,36	R\$ 1.458.342,60	R\$ 172.174.315,89	R\$ 1.198.430,64	0,7042 %	0,81 %	87,11 %
MARÇO	R\$ 172.174.315,89	R\$ 4.935.601,85	R\$ 3.267.477,46	R\$ 174.897.062,76	R\$ 1.054.622,48	0,6394 %	0,58 %	110,78 %
ABRIL	R\$ 174.897.062,76	R\$ 5.037.594,43	R\$ 3.049.228,09	R\$ 177.710.241,35	R\$ 824.812,25	0,4680 %	0,71 %	66,11 %
MAIO	R\$ 177.710.241,35	R\$ 1.992.243,42	R\$ 1.039.552,06	R\$ 174.822.685,78	R\$ -3.840.246,93	-2,0135 %	0,89 %	-226,57 %
JUNHO	R\$ 174.822.685,78	R\$ 2.880.447,65	R\$ 1.931.968,01	R\$ 174.743.586,97	R\$ -1.027.578,45	-0,5273 %	1,75 %	-30,08 %
JULHO	R\$ 174.743.586,97	R\$ 2.062.907,80	R\$ 1.036.817,10	R\$ 179.672.666,09	R\$ 3.902.988,42	2,2896 %	0,82 %	279,77 %
AGOSTO	R\$ 179.672.666,09	R\$ 7.830.379,71	R\$ 7.350.058,97	R\$ 179.033.800,55	R\$ -1.119.186,28	-0,6123 %	0,40 %	-154,46 %
SETEMBRO	R\$ 179.033.800,55	R\$ 10.024.297,84	R\$ 9.052.914,88	R\$ 181.567.552,43	R\$ 1.562.368,92	0,8941 %	0,97 %	92,26 %
TOTAIS		R\$ 37.802.833,67	R\$ 29.551.632,40		R\$ 7.001.246,82	4,66	7,96	58,52

Relatório competência: 09/2018



DI BLASI
Consultoria Financeira

Relatório competência: 09/2018

EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO X RENTABILIDADE MONETÁRIA

MESES	JANEIRO	FEVEREIRO	MARÇO	ABRIL	MAIO	JUNHO	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO
SALDO (R\$)	169.526.619,49	172.174.315,89	174.897.062,76	177.710.241,35	174.822.685,78	174.743.586,97	179.672.666,09	179.033.800,55	181.567.552,43	0,00	0,00	0,00
RETORNO (R\$)	4.445.035,77	1.198.430,64	1.054.622,48	824.812,25	-3.840.246,93	-1.027.578,45	3.902.988,42	-1.119.186,28	1.562.368,92	0,00	0,00	0,00



DI BLASI
Consultoria Financeira

Relatório competência: 09/2018

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 emitentes 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	38,20 %	0,49 %	19,49 %	21,64 %	17,55%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	CDI	0,92 %	-2,48 %	0,04 %	0,11 %	0,42%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	CDI	0,92 %	-2,48 %	0,04 %	0,11 %	0,42%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	IDKA 2	5,70 %	0,85 %	4,10 %	2,72 %	2,62%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	IMA-B	12,74 %	-0,36 %	5,60 %	6,31 %	5,86%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	IRF-M1	1,07 %	-0,37 %	0,49 %	0,62 %	0,49%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	CDI	0,46 %	0,10 %	0,09 %	0,07 %	0,21%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO	IPCA	1,44 %	2,01 %	0,12 %	0,56 %	0,66%
BRDESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS	IRF-M1	1,73 %	0,39 %	0,85 %	0,58 %	0,80%
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 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IPCA	7,94 %	-1,21 %	0,11 %	4,07 %	3,65%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	12,72 %	-0,38 %	5,43 %	6,28 %	5,85%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA VII MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	MULTIMERCADO	0,04 %	1,34 %	0,41 %	0,34 %	0,34%

FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IRF-M1	1,65 %	0,40 %	0,79 %	0,55 %	0,76%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IRF-M	8,07 %	0,61 %	5,72 %	4,42 %	3,71%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	CDI	0,98 %	-0,24 %	0,03 %	0,14 %	0,45%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	IMA-B	12,44 %	-0,36 %	5,40 %	6,15 %	5,72%
META PLUS FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	MULTIMERCADO	10,99 %	0,62 %	0,75 %	4,39 %	5,05%
META VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	AÇÕES	47,80 %	1,09 %	22,80 %	25,22 %	21,97%
OCEANA VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	AÇÕES	39,95 %	0,80 %	18,64 %	24,09 %	18,36%
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	AÇÕES	33,34 %	0,69 %	21,83 %	19,64 %	15,32%
SAFRA EXECUTIVE 2 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	IRF-M1	1,74 %	-0,25 %	1,16 %	1,02 %	0,80%
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B LP	IMA-B	14,06 %	0,15 %	7,24 %	7,29 %	6,46%
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1	IRF-M1	1,67 %	0,51 %	0,81 %	0,57 %	0,77%
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	IRF-M	8,03 %	0,66 %	5,77 %	4,39 %	3,69%
WESTERN ASSET IMAB5 ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	IMA-B 5	10,70 %	0,56 %	8,03 %	5,63 %	4,92%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	MULTIMERCADO	18,63 %	1,23 %	10,62 %	11,78 %	8,56%
OCEANA VALOR 30 FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	AÇÕES	6,30 %	2,26 %	15,04 %	13,26 %	15,96%

Relatório competência: 09/2018

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	38,20 %	17,55 %	0,00
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	13.077.415/0001-05	CDI	11.181,86	0,92 %	0,42 %	102,87
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	13.077.415/0001-05	CDI	54.798,28	0,92 %	0,42 %	504,14
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	13.322.205/0001-35	IDKA 2	9.701.869,85	5,70 %	2,62 %	553.006,58
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	07.861.554/0001-22	IMA-B	330.764,93	12,74 %	5,86 %	42.139,45
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	11.328.882/0001-35	IRF-M1	11.352.665,13	1,07 %	0,49 %	121.473,52
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	13.077.418/0001-49	CDI	28.447.941,37	0,46 %	0,21 %	130.860,53
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO	19.303.795/0001-35	IPCA	839.581,70	1,44 %	0,66 %	12.089,98
BRASESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS	11.484.558/0001-06	IRF-M1	3.287.542,87	1,73 %	0,80 %	56.874,49
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 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	18.598.256/0001-08	IPCA	0,00	7,94 %	3,65 %	0,00
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	10.740.658/0001-93	IMA-B	4.416.463,93	12,72 %	5,85 %	561.774,21
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA VII MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	14.120.236/0001-76	MULTIMERCADO	0,00	0,04 %	0,34 %	0,00
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	IRF-M1	27.513.438,91	1,65 %	0,76 %	453.971,74
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	14.508.605/0001-00	IRF-M	19.465.340,99	8,07 %	3,71 %	1.570.853,02

FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	CDI	7.241.981,32	0,98 %	0,45 %	70.971,42
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	10.646.895/0001-90	IMA-B	8.130.784,55	12,44 %	5,72 %	1.011.469,60
META PLUS FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	07.967.083/0001-31	MULTIMERCADO	880.568,98	10,99 %	5,05 %	96.774,53
META VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	07.899.238/0001-40	AÇÕES	7.363.824,50	47,80 %	21,97 %	3.519.908,11
OCEANA VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	10.309.539/0001-80	AÇÕES	0,00	39,95 %	18,36 %	0,00
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	09.289.072/0001-75	AÇÕES	6.644.706,87	33,34 %	15,32 %	2.215.345,27
SAFRA EXECUTIVE 2 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	10.787.647/0001-69	IRF-M1	0,00	1,74 %	0,80 %	0,00
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B LP	11.087.118/0001-15	IMA-B	5.059.708,97	14,06 %	6,46 %	711.395,08
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1	19.196.599/0001-09	IRF-M1	21.298.885,94	1,67 %	0,77 %	355.691,40
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	13.081.159/0001-20	IRF-M	1.086.710,14	8,03 %	3,69 %	87.262,82
WESTERN ASSET IMAB5 ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	17.517.577/0001-78	IMA-B 5	630.992,99	10,70 %	4,92 %	67.516,25
WESTERN ASSET US INDEX 500 FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	17.453.850/0001-48	MULTIMERCADO	2.428.577,63	18,63 %	8,56 %	452.444,01
OCEANA VALOR 30 FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	26.956.042/0001-94	AÇÕES	15.379.220,72	6,30 %	15,96 %	968.890,91

RISCO DE MERCADO	
Saldo Total:	R\$ 181.567.552,43
Provisão para perda e Investimentos:	R\$ 13.061.319,93
% Provisão de Perda:	7,194%

Relatório competência: 09/2018

RISCO DE LIQUIDEZ

ERRO: consultar indices dos fundos

FUNDO	DISP. DE RESGATE	SALDO R\$	PARTICIPAÇÃO	QTDE. COTISTAS	% SOBRE PL DO FUNDO	PL DO FUNDO R\$	RESOLUÇÃO	GRAU DE RISCO
-------	---------------------	--------------	--------------	-------------------	------------------------	--------------------	-----------	------------------