

INSTITUTO DE PREVIDENCIA DOS SERVIDORES PUBLICOS DE PARAGOMINAS

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 AÇÕES GOVERNANÇA FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 4	0,00	0,00 %	86	0,00 %	156.449.931,07	Art 8º , III	Alto
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	D + 0	10.914,05	0,01 %	642	0,00 %	1.190.553.387,79	Art 7º , IV "a"	Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	D + 0	2.238.000,66	1,39 %	642	0,19 %	1.190.553.387,79	Art 7º , IV "a"	Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 1	9.016.542,04	5,59 %	701	0,18 %	5.133.992.687,63	Art 7º ,I, "b"	Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 0	474.168,88	0,29 %	262	0,04 %	1.309.486.949,77	Art 7º , III "a"	Médio
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D + 0	6.372.957,14	3,95 %	1221	0,06 %	11.114.189.323,99	Art 7º ,I, "b"	Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	D + 0	25.657.788,63	15,91 %	763	0,60 %	4.279.499.588,21	Art 7º , IV "a"	Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 2705	907.583,33	0,56 %	143	0,09 %	1.030.722.833,35	Art 7º , IV "a"	Médio
BRDESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS	D + 0	3.086.650,87	1,91 %	195	0,40 %	764.156.706,57	Art 7º ,I, "b"	Baixo
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 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 425	2.962.492,00	1,84 %	163	0,23 %	1.291.496.610,56	Art 7º , IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	4.317.868,89	2,68 %	771	0,08 %	5.624.777.345,67	Art 7º ,I, "b"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA VII MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D + 0	0,00	0,00 %		0,00 %	0,00	Art 8º , IV	Alto
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	23.772.607,05	14,74 %	1382	0,16 %	14.886.805.108,28	Art 7º ,I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	14.659.407,45	9,09 %	303	0,47 %	3.093.607.731,13	Art 7º ,I, "b"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	D + 0	6.801.409,55	4,22 %	776	0,12 %	5.872.213.177,84	Art 7º , IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	D + 0	7.929.013,80	4,92 %	329	0,29 %	2.698.829.713,03	Art 7º , III "a"	Médio

META PLUS FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	D + 1	841.017,24	0,52 %	9	20,02 %	4.201.692,16	Art 8º , IV	Alto
META VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	D + 4	6.221.720,78	3,86 %	22	9,09 %	68.459.751,24	Art 8º , III	Alto
OCEANA VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	D + 4	0,00	0,00 %	92	0,00 %	399.276.087,18	Art 8º , III	Alto
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	D + 13	4.079.857,37	2,53 %	424	5,08 %	80.367.184,35	Art 8º , III	Alto
SAFRA EXECUTIVE 2 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	D + 1	0,00	0,00 %	14	0,00 %	330.739.861,70	Art 7º, III "a"	Médio
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B LP	D + 1	10.791.776,16	6,69 %	66	6,41 %	168.272.964,92	Art 7º, III "a"	Médio
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1	D + 1	13.932.984,97	8,64 %	43	12,16 %	114.563.314,23	Art 7º, III "a"	Médio
WESTERN ASSET IMAB5 ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	D + 0	596.406,11	0,37 %	11	0,53 %	112.847.838,33	Art 7º ,I, "b"	Médio
WESTERN ASSET US INDEX 500 FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	D + 1	2.014.644,04	1,25 %	4790	0,43 %	467.829.534,58	Art 8º , IV	Alto
OCEANA VALOR 30 FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	D + 30	14.550.931,23	9,02 %	20	25,77 %	56.457.434,12	Art 8º , III	Alto

TOTAL SALDO: R\$ 161.236.742,24

Relatório competência: 09/2017

ENQUADRAMENTO

RENDA FIXA - ARTIGOS	LIMITE DA RESOLUÇÃO	LIMITE POLÍTICA	TOTAL	% CARTEIRA
Art 7º, I, "b"	100 %	100 %	61.822.439,55	38,34
Art 7º, III "a"	80 %	80 %	33.127.943,81	20,55
Art 7º, IV "a"	30 %	30 %	38.578.188,22	23,93

RENDA VARIÁVEL - ARTIGOS	LIMITE DA RESOLUÇÃO	LIMITE POLÍTICA	TOTAL	% CARTEIRA
Art 8º, III	15 %	%	24.852.509,38	15,41
Art 8º, IV	5 %	%	2.855.661,28	1,77

DISTRIBUIÇÃO POR PARÂMETRO DE RENTABILIDADE	TOTAL	% CARTEIRA
AÇÕES	24.852.509,38	15,41
CDI	34.708.112,89	21,53
IDKA 2	9.016.542,04	5,59
IMA-B	23.512.827,73	14,58
IMA-B 5	596.406,11	0,37
IPCA	3.870.075,33	2,40
IRF-M	14.659.407,45	9,09
IRF-M1	47.165.200,03	29,25
MULTIMERCADO	2.855.661,28	1,77

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	TOTAL	% CARTEIRA
BEM - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA. CNPJ: 00066670000100	4.079.857,37	2,53
BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A. CNPJ: 01181521000155	24.724.761,13	15,33
BNY MELLON SERVICOS FINANCEIROS DTVM S.A. CNPJ: 02201501000161	21.613.669,25	13,40
WESTERN ASSET MANAGEMENT COMPANY DTVM LIMITADA CNPJ: 07437241000141	2.611.050,15	1,62
BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A CNPJ: 30822936000169	44.677.954,73	27,71
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CNPJ: 360305000104	60.442.798,74	37,49
JS ADMINISTRACAO DE RECURSOS S/A CNPJ: 43826833000119	0,00	0,00
BANCO BRADESCO S.A. CNPJ: 60746948000112	3.086.650,87	1,91

Relatório competência: 09/2017

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	4,58404 %	4,58404 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 6.393,96	R\$ 92.239,72	R\$ 87.828,39	R\$ 10.914,05	R\$ 108,76	0,55577 %	0,55577 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 1.736.294,36	R\$ 1.359.262,50	R\$ 872.290,19	R\$ 2.238.000,66	R\$ 14.733,99	0,55577 %	0,55577 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 8.939.916,51	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 9.016.542,04	R\$ 76.625,53	0,85712 %	0,85712 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 465.579,96	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 474.168,88	R\$ 8.588,92	1,84478 %	1,84478 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 6.327.948,77	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 6.372.957,14	R\$ 45.008,37	0,71130 %	0,71130 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 25.492.181,36	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 25.657.788,63	R\$ 165.607,27	0,64963 %	0,64963 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 902.920,47	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 907.583,33	R\$ 4.662,86	0,51642 %	0,51642 %
BRDESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 3.064.794,37	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 3.086.650,87	R\$ 21.856,50	0,71315 %	0,71315 %
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\$ 2.947.836,40	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 2.962.492,00	R\$ 14.655,60	0,49716 %	0,49716 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 4.241.527,37	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 4.317.868,89	R\$ 76.341,52	1,79986 %	1,79986 %
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\$ 23.603.922,88	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 23.772.607,05	R\$ 168.684,17	0,71464 %	0,71464 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 14.451.313,15	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 14.659.407,45	R\$ 208.094,30	1,43997 %	1,43997 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	R\$ 6.758.561,08	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 6.801.409,55	R\$ 42.848,47	0,63399 %	0,63399 %
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	R\$ 7.789.520,20	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 7.929.013,80	R\$ 139.493,60	1,79079 %	1,79079 %

META PLUS FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	R\$ 813.170,02	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 841.017,24	R\$ 27.847,22	3,42452 %	3,42452 %
META VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	R\$ 5.755.018,77	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 6.221.720,78	R\$ 466.702,01	8,10948 %	8,10948 %
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	3,87701 %	3,87701 %
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$ 3.915.684,65	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 4.079.857,37	R\$ 164.172,72	4,19270 %	4,19270 %
SAFRA EXECUTIVE 2 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	0,79519 %	0,79519 %
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B LP	R\$ 10.601.434,80	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 10.791.776,16	R\$ 190.341,36	1,79543 %	1,79543 %
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1	R\$ 13.833.821,95	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 13.932.984,97	R\$ 99.163,02	0,71682 %	0,71682 %
WESTERN ASSET IMAB5 ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 589.693,26	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 596.406,11	R\$ 6.712,85	1,13836 %	1,13836 %
WESTERN ASSET US INDEX 500 FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	R\$ 1.973.949,64	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 2.014.644,04	R\$ 40.694,40	2,06157 %	2,06157 %
OCEANA VALOR 30 FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	R\$ 14.011.702,67	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 14.550.931,23	R\$ 539.228,56	3,84842 %	3,84842 %
TOTAIS	R\$ 158.223.186,60	R\$ 1.451.502,22	R\$ 960.118,58	R\$ 161.236.742,24	R\$ 2.522.172,00	1,6138 %	1,6138 %

RETORNOS ACUMULADO

MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO R\$	RETORNO %	META %	ATINGIMENTO %
JANEIRO	R\$ 138.957.123,61	R\$ 0,00	R\$ 2.894.996,45	R\$ 138.987.249,08	R\$ 2.925.121,92	2,0718 %	0,87 %	238,52 %
FEVEREIRO	R\$ 138.987.249,08	R\$ 8.894.996,45	R\$ 6.109.435,24	R\$ 144.719.648,60	R\$ 2.946.838,31	2,0950 %	0,82 %	255,99 %
MARÇO	R\$ 144.719.648,60	R\$ 1.283.571,41	R\$ 0,00	R\$ 148.380.582,35	R\$ 1.217.625,77	0,8401 %	0,74 %	113,84 %
ABRIL	R\$ 148.380.582,35	R\$ 1.173.094,58	R\$ 1.510.935,95	R\$ 149.010.293,79	R\$ 967.552,81	0,6547 %	0,63 %	104,33 %
MAIO	R\$ 149.010.293,79	R\$ 8.413.012,86	R\$ 7.935.872,66	R\$ 149.336.270,79	R\$ -151.163,20	-0,0340 %	0,80 %	-4,26 %
JUNHO	R\$ 149.336.270,79	R\$ 13.866.629,94	R\$ 13.345.641,89	R\$ 151.080.812,39	R\$ 1.223.553,55	0,8161 %	0,26 %	319,18 %
JULHO	R\$ 151.080.812,39	R\$ 2.410.086,51	R\$ 2.078.626,06	R\$ 154.740.114,33	R\$ 3.327.841,49	2,2433 %	0,73 %	308,14 %
AGOSTO	R\$ 154.740.114,33	R\$ 3.774.159,20	R\$ 3.331.787,01	R\$ 158.223.186,60	R\$ 3.040.700,08	1,9138 %	0,68 %	282,40 %
SETEMBRO	R\$ 158.223.186,60	R\$ 1.451.502,22	R\$ 960.118,58	R\$ 161.236.742,24	R\$ 2.522.172,00	1,6138 %	0,65 %	249,20 %
TOTAIS		R\$ 41.267.053,17	R\$ 38.167.413,84		R\$ 19.179.979,30	12,87	6,33	203,33

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 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	9,04 %	0,66 %	11,87 %	12,98 %	15,35%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	CDI	0,05 %	-1,81 %	0,04 %	0,36 %	0,49%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	CDI	0,05 %	-1,81 %	0,04 %	0,36 %	0,49%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	IDKA 2	1,38 %	0,56 %	3,34 %	2,57 %	1,99%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	IMA-B	4,67 %	0,54 %	6,79 %	6,29 %	6,10%
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 PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	CDI	0,05 %	0,22 %	0,04 %	0,39 %	0,48%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPKA III FUNDO DE INVESTIMENTO	IPKA	0,14 %	-4,33 %	0,98 %	0,74 %	0,57%
BRASESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS	IRF-M1	0,07 %	0,18 %	1,21 %	0,91 %	0,66%
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	IPKA	1,87 %	-2,33 %	4,59 %	3,58 %	3,63%
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 IPKA 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	0,32 %	1,75 %	0,33 %	0,37 %	0,47%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IRF-M	2,32 %	1,98 %	2,35 %	2,53 %	2,57%

FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	CDI	0,05 %	0,06 %	0,07 %	0,39 %	0,46%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	IMA-B	4,46 %	0,51 %	6,44 %	5,90 %	5,81%
META PLUS FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	MULTIMERCADO	2,99 %	-1,54 %	3,85 %	4,06 %	4,11%
META VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	AÇÕES	12,14 %	0,83 %	16,23 %	17,67 %	22,60%
OCEANA VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	AÇÕES	8,30 %	1,07 %	9,16 %	11,56 %	14,79%
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	AÇÕES	7,10 %	0,18 %	7,41 %	11,21 %	13,71%
SAFRA EXECUTIVE 2 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	IRF-M1	0,12 %	0,48 %	2,02 %	1,54 %	1,15%
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B LP	IMA-B	4,61 %	0,53 %	6,67 %	6,16 %	6,05%
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1	IRF-M1	0,32 %	1,80 %	0,27 %	0,35 %	0,44%
WESTERN ASSET IMAB5 ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	IMA-B 5	0,54 %	0,07 %	8,79 %	6,69 %	5,25%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	MULTIMERCADO	3,78 %	2,27 %	3,01 %	2,38 %	5,52%
OCEANA VALOR 30 FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	AÇÕES	8,30 %	1,07 %	9,16 %	11,56 %	14,79%

Relatório competência: 09/2017



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	9,12 %	14,22 %	0,00
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	13.077.415/0001-05	CDI	10.914,05	0,01 %	0,10 %	1,09
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	13.077.415/0001-05	CDI	2.238.000,66	0,01 %	0,10 %	223,80
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	13.322.205/0001-35	IDKA 2	9.016.542,04	0,30 %	2,95 %	27.049,63
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	07.861.554/0001-22	IMA-B	474.168,88	1,01 %	10,01 %	4.789,11
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	11.328.882/0001-35	IRF-M1	6.372.957,14	0,07 %	0,66 %	4.461,07
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	13.077.418/0001-49	CDI	25.657.788,63	0,02 %	0,18 %	5.131,56
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO	19.303.795/0001-35	IPCA	907.583,33	0,14 %	0,66 %	1.270,62
BRDESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS	11.484.558/0001-06	IRF-M1	3.086.650,87	0,07 %	0,66 %	2.160,66
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	2.962.492,00	0,42 %	4,24 %	12.442,47
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	10.740.658/0001-93	IMA-B	4.317.868,89	1,01 %	9,99 %	43.610,48
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	23.772.607,05	0,07 %	0,65 %	16.640,82
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	14.508.605/0001-00	IRF-M	14.659.407,45	0,50 %	4,92 %	73.297,04
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	CDI	6.801.409,55	0,01 %	0,07 %	680,14

FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	10.646.895/0001-90	IMA-B	7.929.013,80	0,96 %	9,54 %	76.118,53
META PLUS FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	07.967.083/0001-31	MULTIMERCADO	841.017,24	2,99 %	4,11 %	25.146,42
META VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	07.899.238/0001-40	AÇÕES	6.221.720,78	12,22 %	21,38 %	760.294,28
OCEANA VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	10.309.539/0001-80	AÇÕES	0,00	8,36 %	13,90 %	0,00
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	09.289.072/0001-75	AÇÕES	4.079.857,37	7,16 %	13,12 %	292.117,79
SAFRA EXECUTIVE 2 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	10.787.647/0001-69	IRF-M1	0,00	0,12 %	1,15 %	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	10.791.776,16	1,00 %	9,89 %	107.917,76
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1	19.196.599/0001-09	IRF-M1	13.932.984,97	0,07 %	0,66 %	9.753,09
WESTERN ASSET IMAB5 ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	17.517.577/0001-78	IMA-B 5	596.406,11	0,54 %	5,25 %	3.220,59
WESTERN ASSET US INDEX 500 FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	17.453.850/0001-48	MULTIMERCADO	2.014.644,04	0,98 %	9,50 %	19.743,51
OCEANA VALOR 30 FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	26.956.042/0001-94	AÇÕES	14.550.931,23	8,36 %	13,90 %	1.216.457,85

RISCO DE MERCADO	
Saldo Total:	R\$ 161.236.742,24
Provisão para perda e Investimentos:	R\$ 2.702.528,29
% Provisão de Perda:	1,676%

Relatório competência: 09/2017



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
-------	------------------	-----------	--------------	----------------	---------------------	-----------------	-----------	---------------