



INSTITUTO DE PREVIDENCIA DOS SERVIDORES PUBLICOS DE PARAGOMINAS

Relatório Competência

12/2017

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 %	90	0,00 %	218.518.106,08	Art 8º , III	Alto	1,00 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	D + 0	16.799,71	0,01 %	632	0,00 %	1.263.019.749,86	Art 7º , IV "a"	Baixo	1,00 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	D + 0	1.428.554,52	0,86 %	632	0,11 %	1.263.019.749,86	Art 7º , IV "a"	Baixo	1,00 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 1	9.189.139,03	5,53 %	712	0,17 %	5.436.556.596,64	Art 7º , I, "b"	Baixo	0,20 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 0	321.903,27	0,19 %	235	0,03 %	1.070.534.298,25	Art 7º , III "a"	Médio	0,30 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D + 0	8.503.588,79	5,11 %	1226	0,07 %	12.272.521.315,53	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	26.127.847,30	15,71 %	757	0,62 %	4.205.421.961,32	Art 7º , IV "a"	Baixo	0,20 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 2705	929.753,94	0,56 %	143	0,09 %	1.055.901.523,32	Art 7º , IV "a"	Médio	0,20 %
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS	D + 0	3.141.430,48	1,89 %	201	0,41 %	766.561.999,83	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	3.033.842,60	1,82 %	163	0,23 %	1.322.601.966,10	Art 7º , IV "a"	Baixo	0,00 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	4.300.896,88	2,59 %	722	0,11 %	4.084.421.859,82	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 , IV	Alto	0,20 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	22.257.743,22	13,38 %	1412	0,13 %	17.173.437.880,47	Art 7º , I, "b"	Baixo	0,20 %

FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	17.863.682,58	10,74 %	297	0,68 %	2.638.455.038,83	Art 7º, I, "b"	Médio	0,20 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	D + 0	6.919.900,52	4,16 %	748	0,12 %	5.699.053.539,88	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	7.904.133,59	4,75 %	313	0,32 %	2.480.853.390,51	Art 7º, III "a"	Médio	0,20 %
META PLUS FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	D + 1	844.530,44	0,51 %	11	19,59 %	4.312.001,38	Art 8º, IV	Alto	2,50 %
META VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	D + 4	6.313.061,81	3,80 %	31	7,30 %	86.484.184,20	Art 8º, III	Alto	3,00 %
OCEANA VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	D + 4	0,00	0,00 %	90	0,00 %	407.736.076,44	Art 8º, III	Alto	2,00 %
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	D + 13	4.090.468,88	2,46 %	399	5,15 %	79.402.810,17	Art 8º, III	Alto	2,00 %
SAFRA EXECUTIVE 2 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	D + 1	0,00	0,00 %	15	0,00 %	352.786.319,87	Art 7º, III "a"	Médio	0,20 %
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B LP	D + 1	10.742.511,55	6,46 %	66	6,46 %	166.276.789,09	Art 7º, III "a"	Médio	0,20 %
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1	D + 1	13.166.974,99	7,92 %	48	9,66 %	136.285.348,44	Art 7º, III "a"	Médio	0,20 %
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	D + 1	1.522.969,07	0,92 %	50	1,65 %	92.116.231,16	Art 7º, III "a"	Médio	0,20 %
WESTERN ASSET IMAB5 ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	D + 0	603.162,10	0,36 %	13	0,46 %	130.046.911,78	Art 7º, I, "b"	Médio	0,40 %
WESTERN ASSET US INDEX 500 FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	D + 1	2.175.039,43	1,31 %	9642	0,23 %	946.407.676,08	Art 8º, IV	Alto	1,00 %
OCEANA VALOR 30 FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	D + 30	14.917.169,64	8,97 %	30	17,10 %	87.220.129,05	Art 8º, III	Alto	2,00 %

TOTAL SALDO: R\$ 166.315.104,34

Relatório competência: 12/2017

ENQUADRAMENTO

RENTA FIXA - ARTIGOS	LIMITE DA RESOLUÇÃO	LIMITE POLÍTICA	TOTAL	% CARTEIRA	SITUAÇÃO
Cotas de Fundos de Investimento - Art 7º, I, "b"	100 %	100 %	65.859.643,08	39,60 %	ENQUADRADO
Fundos de Investimento Renda Fixa / Referenciados / Cond. Aberto (IMA/IDKA) - Art 7º, III "a"	80 %	80 %	33.658.492,47	20,24 %	ENQUADRADO
Fundos de Investimento de Renda Fixa / Referenciados / Cond. Aberto (IMA/IDKA) - Art 7º, IV "a"	30 %	30 %	38.456.698,59	23,12 %	ENQUADRADO

RENTA VARIÁVEL - ARTIGOS	LIMITE DA RESOLUÇÃO	LIMITE POLÍTICA	TOTAL	% CARTEIRA	SITUAÇÃO
Fundos de investimentos em Ações - Art 8º, III	15 %	15 %	25.320.700,33	15,22 %	DESENQUADRADO
Fundos de investimentos Multimercado - Art 8º, IV	5 %	5 %	3.019.569,87	1,82 %	ENQUADRADO

DISTRIBUIÇÃO POR PARÂMETRO DE RENTABILIDADE	TOTAL	% CARTEIRA
AÇÕES	25.320.700,33	15,22
CDI	34.493.102,05	20,74
IDKA 2	9.189.139,03	5,53
IMA-B	23.269.445,29	13,99
IMA-B 5	603.162,10	0,36
IPCA	3.963.596,54	2,38
IRF-M	19.386.651,65	11,66
IRF-M1	47.069.737,48	28,30
MULTIMERCADO	3.019.569,87	1,82

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	TOTAL	% CARTEIRA
BEM - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA. CNPJ: 00066670000100	4.090.468,88	2,46

BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A. CNPJ: 01181521000155	25.432.455,61	15,29
BNY MELLON SERVICOS FINANCEIROS DTVM S.A. CNPJ: 02201501000161	22.074.761,89	13,27
WESTERN ASSET MANAGEMENT COMPANY DTVM LIMITADA CNPJ: 07437241000141	2.778.201,53	1,67
BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A CNPJ: 30822936000169	46.517.586,56	27,97
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CNPJ: 360305000104	62.280.199,39	37,45
JS ADMINISTRACAO DE RECURSOS S/A CNPJ: 43826833000119	0,00	0,00
BANCO BRADESCO S.A CNPJ: 60746948000112	3.141.430,48	1,89

Relatório competência: 12/2017

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	5,80281 %	5,80281 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 13.034,15	R\$ 65.055,93	R\$ 61.432,63	R\$ 16.799,71	R\$ 142,26	0,44745 %	0,44745 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 84.910,80	R\$ 2.134.165,59	R\$ 792.858,43	R\$ 1.428.554,52	R\$ 2.336,56	0,44745 %	0,44745 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 9.110.507,53	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 9.189.139,03	R\$ 78.631,50	0,86309 %	0,86309 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 468.504,49	R\$ 0,00	R\$ 150.000,00	R\$ 321.903,27	R\$ 3.398,78	0,84683 %	0,84683 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 8.456.338,72	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 8.503.588,79	R\$ 47.250,07	0,55877 %	0,55877 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	R\$ 25.976.430,78	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 26.127.847,30	R\$ 151.416,52	0,58288 %	0,58288 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 923.188,56	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 929.753,94	R\$ 6.565,38	0,71116 %	0,71116 %
BRASESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 3.124.105,18	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 3.141.430,48	R\$ 17.325,30	0,55457 %	0,55457 %
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\$ 3.012.678,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 3.033.842,60	R\$ 21.164,60	0,70252 %	0,70252 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 4.266.486,57	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 4.300.896,88	R\$ 34.410,31	0,80653 %	0,80653 %
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\$ 22.132.070,73	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 22.257.743,22	R\$ 125.672,49	0,56783 %	0,56783 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 17.653.865,32	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 17.863.682,58	R\$ 209.817,26	1,18851 %	1,18851 %

FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	R\$ 6.883.856,46	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 6.919.900,52	R\$ 36.044,06	0,52360 %	0,52360 %
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	R\$ 7.839.607,76	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 7.904.133,59	R\$ 64.525,83	0,82307 %	0,82307 %
META PLUS FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	R\$ 838.492,44	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 844.530,44	R\$ 6.038,00	0,72010 %	0,72010 %
META VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	R\$ 5.904.482,58	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 6.313.061,81	R\$ 408.579,23	6,91982 %	6,91982 %
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	6,20956 %	6,20956 %
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$ 3.919.481,26	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 4.090.468,88	R\$ 170.987,62	4,36251 %	4,36251 %
SAFRA EXECUTIVE 2 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	0,61437 %	0,61437 %
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B LP	R\$ 10.656.929,56	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 10.742.511,55	R\$ 85.581,99	0,80306 %	0,80306 %
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1	R\$ 13.091.904,62	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 13.166.974,99	R\$ 75.070,37	0,57341 %	0,57341 %
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	R\$ 1.504.403,05	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 1.522.969,07	R\$ 18.566,02	1,23411 %	1,23411 %
WESTERN ASSET IMAB5 ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 596.192,25	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 603.162,10	R\$ 6.969,85	1,16906 %	1,16906 %
WESTERN ASSET US INDEX 500 FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	R\$ 2.138.461,86	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 2.175.039,43	R\$ 36.577,57	1,71046 %	1,71046 %
OCEANA VALOR 30 FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	R\$ 14.047.614,04	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 14.917.169,64	R\$ 869.555,60	6,19006 %	6,19006 %
TOTAIS	R\$ 162.643.546,71	R\$ 2.199.221,52	R\$ 1.004.291,06	R\$ 166.315.104,34	R\$ 2.476.627,17	1,5500 %	1,5500 %

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 %
OUTUBRO	R\$ 161.236.742,24	R\$ 6.161.968,35	R\$ 5.328.288,09	R\$ 162.568.001,75	R\$ 497.579,25	0,3035 %	0,91 %	33,39 %
NOVEMBRO	R\$ 162.568.001,75	R\$ 5.034.606,45	R\$ 4.470.871,73	R\$ 162.643.546,71	R\$ -488.189,76	-0,2742 %	0,77 %	-35,69 %
DEZEMBRO	R\$ 162.643.546,71	R\$ 2.199.221,52	R\$ 1.004.291,06	R\$ 166.315.104,34	R\$ 2.476.627,17	1,5500 %	0,93 %	166,87 %
TOTAIS		R\$ 54.662.849,49	R\$ 48.970.864,72		R\$ 20.506.259,39	14,65	9,12	160,58

Relatório competência: 12/2017



DI BLASI
Consultoria Financeira

Relatório competência: 12/2017

EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO X RENTABILIDADE MONETÁRIA

MESES	JANEIRO	FEVEREIRO	MARÇO	ABRIL	MAIO	JUNHO	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO
SALDO (R\$)	138.987.249,08	144.719.648,60	148.380.582,35	149.010.293,79	149.336.270,79	151.080.812,39	154.740.114,33	158.223.186,60	161.236.742,24	162.568.001,75	162.643.546,71	166.315.104,34
RETORNO (R\$)	2.925.121,92	2.946.838,31	1.217.625,77	967.552,81	-151.163,20	1.223.553,55	3.327.841,49	3.040.700,08	2.522.172,00	497.579,25	-488.189,76	2.476.627,17

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: 12/2017

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	6,81 %	17,41 %	0,00
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	13.077.415/0001-05	CDI	16.799,71	0,06 %	0,62 %	10,08
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	13.077.415/0001-05	CDI	1.428.554,52	0,06 %	0,62 %	857,13
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	13.322.205/0001-35	IDKA 2	9.189.139,03	1,30 %	1,96 %	119.458,81
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	07.861.554/0001-22	IMA-B	321.903,27	4,38 %	5,88 %	14.099,36
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	11.328.882/0001-35	IRF-M1	8.503.588,79	0,32 %	0,75 %	27.211,48
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	13.077.418/0001-49	CDI	26.127.847,30	0,06 %	0,60 %	15.676,71
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO	19.303.795/0001-35	IPCA	929.753,94	0,15 %	0,62 %	1.394,63
BRASESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS	11.484.558/0001-06	IRF-M1	3.141.430,48	0,32 %	0,75 %	10.052,58
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	3.033.842,60	1,87 %	3,65 %	56.732,86
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	10.740.658/0001-93	IMA-B	4.300.896,88	4,37 %	5,80 %	187.949,19
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	22.257.743,22	0,32 %	0,75 %	71.224,78
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	14.508.605/0001-00	IRF-M	17.863.682,58	2,17 %	2,83 %	387.641,91

FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	CDI	6.919.900,52	0,06 %	0,62 %	4.151,94
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	10.646.895/0001-90	IMA-B	7.904.133,59	4,18 %	5,62 %	330.392,78
META PLUS FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	07.967.083/0001-31	MULTIMERCADO	844.530,44	2,99 %	4,11 %	25.251,46
META VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	07.899.238/0001-40	AÇÕES	6.313.061,81	8,80 %	23,08 %	555.549,44
OCEANA VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	10.309.539/0001-80	AÇÕES	0,00	6,30 %	15,96 %	0,00
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	09.289.072/0001-75	AÇÕES	4.090.468,88	5,53 %	13,91 %	226.202,93
SAFRA EXECUTIVE 2 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	10.787.647/0001-69	IRF-M1	0,00	0,52 %	0,91 %	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	10.742.511,55	4,32 %	5,82 %	464.076,50
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1	19.196.599/0001-09	IRF-M1	13.166.974,99	0,32 %	0,73 %	42.134,32
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	13.081.159/0001-20	IRF-M	1.522.969,07	2,26 %	2,85 %	34.419,10
WESTERN ASSET IMAB5 ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	17.517.577/0001-78	IMA-B 5	603.162,10	0,54 %	5,25 %	3.257,08
WESTERN ASSET US INDEX 500 FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	17.453.850/0001-48	MULTIMERCADO	2.175.039,43	3,02 %	3,77 %	65.686,19
OCEANA VALOR 30 FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	26.956.042/0001-94	AÇÕES	14.917.169,64	6,30 %	15,96 %	939.781,69

RISCO DE MERCADO	
Saldo Total:	R\$ 166.315.104,34
Provisão para perda e Investimentos:	R\$ 3.583.212,95
% Provisão de Perda:	2,154%

Relatório competência: 12/2017

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