



DI BLASI
Consultoria Financeira

INSTITUTO DE SEGURIDADE DO SERVIDOR MUNICIPAL CAMAÇARI

Relatório Competência

08/2016

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 IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 0	15.388.284,22	7,33 %	241	1,38 %	1.113.831.021,21	Art 7º, III "a"	Médio
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D + 0	49.642.655,13	23,65 %	1176	0,60 %	8.266.051.545,61	Art 7º ,I, "b"	Baixo
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO DI PREMIUM	D + 0	989.316,53	0,47 %	384	0,01 %	6.830.157.675,82	Art 7º , IV "a"	Baixo
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO DI PREMIUM	D + 0	10.472.760,69	4,99 %	384	0,15 %	6.830.157.675,82	Art 7º , IV "a"	Baixo
FIC FI LONGO PRAZO RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D + 902	11.726.433,36	5,59 %	3	60,71 %	19.316.047,48	Art 7º , VII, "b"	Alto
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	4.044.360,32	1,93 %	207	0,34 %	1.205.568.739,51	Art 7º ,I, "b"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	1.884.801,96	0,90 %	731	0,03 %	5.821.830.490,52	Art 7º ,I, "b"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	12.372.694,44	5,89 %	716	0,24 %	5.226.399.198,11	Art 7º ,I, "b"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	7.461.751,02	3,56 %	716	0,14 %	5.226.399.198,11	Art 7º ,I, "b"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	6.351.769,60	3,03 %	716	0,12 %	5.226.399.198,11	Art 7º ,I, "b"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	603.062,49	0,29 %	1336	0,01 %	10.136.234.610,70	Art 7º ,I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	32.446.391,28	15,46 %	1336	0,32 %	10.136.234.610,70	Art 7º ,I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	D + 0	5.292.934,25	2,52 %	763	0,11 %	5.039.441.339,49	Art 7º , IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	22.613.602,69	10,77 %	467	1,01 %	2.244.004.211,62	Art 7º , IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	8.167.903,57	3,89 %	467	0,36 %	2.244.004.211,62	Art 7º , IV "a"	Baixo

FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	0,00	0,00 %	467	0,00 %	2.244.004.211,62	Art 7º , IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	D + 0	2.803.009,15	1,34 %	340	0,12 %	2.344.278.875,66	Art 7º , III "a"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	D + 0	5.446.931,93	2,60 %	340	0,23 %	2.344.278.875,66	Art 7º , III "a"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO SECURITY REFERENCIADO DI LONGO PRAZO CRÉDITO PRIVADO	D + 91	926.935,80	0,44 %	14	8,84 %	10.485.954,37	Art 7º , VII, "b"	Alto
NTN-F20170101	D + 270	11.256.043,25	5,36 %	1	1.125.604.325,00 %	1,00	Art 7º , I, "a"	Alto

TOTAL SALDO: R\$ 209.891.641,68

ENQUADRAMENTO

RENDA FIXA - ARTIGOS	LIMITE DA RESOLUÇÃO	LIMITE POLÍTICA	TOTAL	% CARTEIRA
Art 7º, I, "a"	100 %	100 %	11.256.043,25	5,36
Art 7º, I, "b"	100 %	100 %	114.807.486,24	54,70
Art 7º, III "a"	80 %	80 %	23.638.225,30	11,26
Art 7º, IV "a"	30 %	30 %	47.536.517,73	22,65
Art 7º, VII, "b"	5 %	5 %	12.653.369,16	6,03

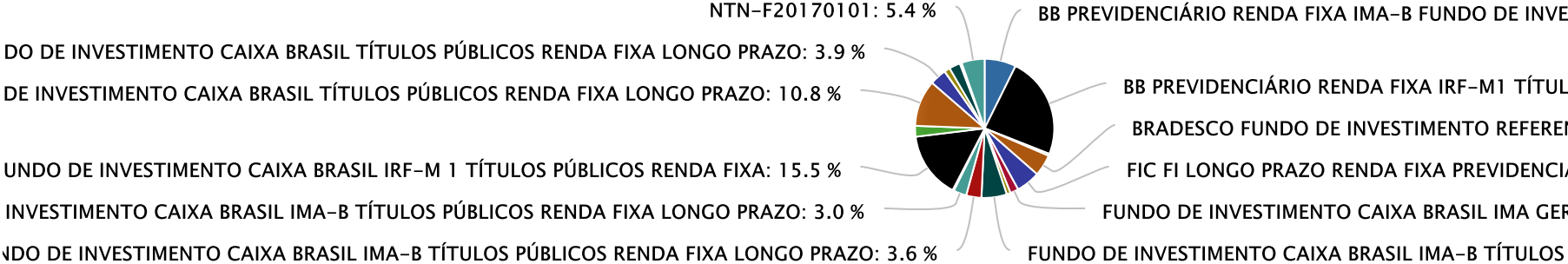
RENDA VARIÁVEL - ARTIGOS	LIMITE DA RESOLUÇÃO	LIMITE POLÍTICA	TOTAL	% CARTEIRA
--------------------------	---------------------	-----------------	-------	------------

DISTRIBUIÇÃO POR PARÂMETRO DE RENTABILIDADE	TOTAL	% CARTEIRA
CDI	47.536.517,73	22,65
CREDITO PRIVADO	12.653.369,16	6,03
IMA-B	49.824.440,36	23,74
IMA-B 5	1.884.801,96	0,90
IMA-GERAL	4.044.360,32	1,93
IRF-M1	82.692.108,90	39,40
NTN-F	11.256.043,25	5,36

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	TOTAL	% CARTEIRA
CNPJ:	11.256.043,25	5,36
BNY MELLON SERVICOS FINANCEIROS DTVM S.A. CNPJ: 2201501000161	926.935,80	0,44
BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A CNPJ: 30822936000169	65.030.939,35	30,98
GRADUAL CCTVM S/A CNPJ: 33918160000173	11.726.433,36	5,59
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CNPJ: 360305000104	109.489.212,70	52,16
BANCO BRADESCO S.A. CNPJ: 60746948000112	11.462.077,22	5,46

DISTRIBUIÇÃO

Visão Geral – Fundos de Investimento



RETORNOS

FUNDO	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO R\$	RETORNO %	EFETIVO %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 15.238.293,54	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 15.388.284,22	R\$ 149.990,68	0,98430 %	0,98430 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 51.266.055,53	R\$ 1.571.619,39	R\$ 3.800.000,00	R\$ 49.642.655,13	R\$ 604.980,21	1,16276 %	1,23370 %
BRDESCO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 385.745,62	R\$ 932.781,24	R\$ 339.497,24	R\$ 989.316,53	R\$ 10.286,91	1,21801 %	1,05073 %
BRDESCO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 11.147.657,52	R\$ 127.675,20	R\$ 932.781,24	R\$ 10.472.760,69	R\$ 130.209,21	1,21801 %	1,25897 %
FIC FI LONGO PRAZO RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	R\$ 11.766.465,01	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 11.726.433,36	R\$ -40.031,65	-0,34022 %	-0,34022 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 4.003.398,16	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 4.044.360,32	R\$ 40.962,16	1,02318 %	1,02318 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 1.864.887,90	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 1.884.801,96	R\$ 19.914,06	1,06784 %	1,06784 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 12.270.712,89	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 12.372.694,44	R\$ 101.981,55	0,83110 %	0,83110 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 7.400.247,77	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 7.461.751,02	R\$ 61.503,25	0,83110 %	0,83110 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 6.299.415,32	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 6.351.769,60	R\$ 52.354,28	0,83110 %	0,83110 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	R\$ 596.059,07	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 603.062,49	R\$ 7.003,42	1,17495 %	1,17495 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	R\$ 32.069.588,40	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 32.446.391,28	R\$ 376.802,88	1,17495 %	1,17495 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	R\$ 4.470.629,00	R\$ 4.605.294,37	R\$ 3.868.380,54	R\$ 5.292.934,25	R\$ 85.391,42	1,20707 %	1,20707 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 22.346.788,85	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 22.613.602,69	R\$ 266.813,84	1,19397 %	1,19397 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 8.071.531,95	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 8.167.903,57	R\$ 96.371,62	1,19397 %	1,19397 %
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	1,19397 %	1,19397 %

FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	R\$ 2.776.213,52	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 2.803.009,15	R\$ 26.795,63	0,96519 %	0,96519 %
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	R\$ 5.394.861,49	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 5.446.931,93	R\$ 52.070,44	0,96519 %	0,96519 %
FUNDO DE INVESTIMENTO SECURITY REFERENCIADO DI LONGO PRAZO CRÉDITO PRIVADO	R\$ 921.122,87	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 926.935,80	R\$ 5.812,93	0,63107 %	0,63107 %
NTN-F20170101	R\$ 11.123.701,34	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 11.256.043,25	R\$ 132.341,91	1,17545 %	1,17545 %
TOTAIS	R\$ 209.413.375,75	R\$ 7.237.370,20	R\$ 8.940.659,02	R\$ 209.891.641,68	R\$ 2.181.554,75	1,0220 %	1,0400 %

RETORNOS ACUMULADO

MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO R\$	RETORNO %	META %	ATINGIMENTO %
JANEIRO	R\$ 184.655.366,80	R\$ 8.168.580,73	R\$ 6.512.159,45	R\$ 188.528.084,26	R\$ 2.216.296,18	1,4696 %	1,76 %	83,36 %
FEVEREIRO	R\$ 188.528.084,26	R\$ 10.202.348,80	R\$ 7.070.271,33	R\$ 194.073.615,78	R\$ 2.413.454,05	1,2619 %	1,39 %	90,71 %
MARÇO	R\$ 194.073.615,78	R\$ 8.536.127,91	R\$ 7.005.505,76	R\$ 199.405.078,53	R\$ 3.800.840,60	2,0032 %	0,92 %	218,00 %
ABRIL	R\$ 199.405.078,53	R\$ 6.727.706,59	R\$ 7.027.136,65	R\$ 202.458.421,21	R\$ 3.352.772,74	1,6866 %	1,10 %	153,36 %
MAIO	R\$ 202.458.421,21	R\$ 6.598.321,60	R\$ 6.313.819,37	R\$ 204.248.292,64	R\$ 1.505.369,20	0,7233 %	1,27 %	56,93 %
JUNHO	R\$ 204.248.292,64	R\$ 13.312.396,52	R\$ 12.443.967,06	R\$ 207.660.799,25	R\$ 2.544.077,15	1,2277 %	0,84 %	146,41 %
JULHO	R\$ 207.660.799,25	R\$ 6.032.307,20	R\$ 6.557.289,30	R\$ 209.413.375,75	R\$ 2.277.558,60	1,3461 %	1,01 %	133,37 %
AGOSTO	R\$ 209.413.375,75	R\$ 7.237.370,20	R\$ 8.940.659,02	R\$ 209.891.641,68	R\$ 2.181.554,75	1,0400 %	0,93 %	111,96 %
TOTAIS		R\$ 66.815.159,55	R\$ 61.870.807,94		R\$ 20.291.923,27	-100,00	-100,00	100,00

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 emissoras 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 IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	IMA-B	0,75 %	1,31 %	7,68 %	6,15 %	7,24%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	IRF-M1	0,04 %	1,16 %	0,30 %	0,20 %	0,40%
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO DI PREMIUM	CDI	0,00 %	4,21 %	0,09 %	0,06 %	0,05%
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO DI PREMIUM	CDI	0,00 %	4,21 %	0,09 %	0,06 %	0,05%
FIC FI LONGO PRAZO RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	CREDITO PRIVADO	0,08 %	-14,79 %	0,18 %	0,93 %	0,79%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-GERAL	0,38 %	1,69 %	3,87 %	3,12 %	3,64%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B 5	0,27 %	0,42 %	2,68 %	2,18 %	2,59%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	0,75 %	1,31 %	7,67 %	6,15 %	7,30%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	0,75 %	1,31 %	7,67 %	6,15 %	7,30%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	0,75 %	1,31 %	7,67 %	6,15 %	7,30%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IRF-M1	0,04 %	1,42 %	0,28 %	0,23 %	0,35%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IRF-M1	0,04 %	1,42 %	0,28 %	0,23 %	0,35%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	CDI	0,00 %	-0,56 %	0,04 %	0,04 %	0,04%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CDI	0,01 %	0,17 %	0,02 %	0,03 %	0,09%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CDI	0,01 %	0,17 %	0,02 %	0,03 %	0,09%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CDI	0,01 %	0,17 %	0,02 %	0,03 %	0,09%

FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	IMA-B	0,70 %	1,34 %	7,44 %	5,94 %	6,82%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	IMA-B	0,70 %	1,34 %	7,44 %	5,94 %	6,82%
FUNDO DE INVESTIMENTO SECURITY REFERENCIADO DI LONGO PRAZO CRÉDITO PRIVADO	CREDITO PRIVADO	2,48 %	-1,34 %	0,12 %	0,11 %	26,60%
NTN-F20170101	NTN-F	0,00 %	0,00 %	0,00 %	0,00 %	0,00%

PROVISÃO DE RISCO - INDICATIVO

FUNDO	CNPJ	BENCHMARK	SALDO (R\$)	VAR 12 MESES	VOLATILIDADE 12 MESES	VAR COM 95% - 252 DU* (R\$)
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	07.861.554/0001-22	IMA-B	15.388.284,22	0,69 %	6,68 %	106.179,16
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	11.328.882/0001-35	IRF-M1	49.642.655,13	0,04 %	0,35 %	19.857,06
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO DI PREMIUM	03.399.411/0001-90	CDI	989.316,53	0,00 %	0,04 %	0,00
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO DI PREMIUM	03.399.411/0001-90	CDI	10.472.760,69	0,00 %	0,04 %	0,00
FIC FI LONGO PRAZO RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	09.586.955/0001-47	CREDITO PRIVADO	11.726.433,36	0,43 %	4,09 %	50.423,66
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	11.061.217/0001-28	IMA-GERAL	4.044.360,32	0,35 %	3,37 %	14.155,26
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	11.060.913/0001-10	IMA-B 5	1.884.801,96	0,26 %	2,52 %	4.900,49
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	10.740.658/0001-93	IMA-B	12.372.694,44	0,70 %	6,79 %	86.608,86
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	10.740.658/0001-93	IMA-B	7.461.751,02	0,70 %	6,79 %	52.232,26
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	10.740.658/0001-93	IMA-B	6.351.769,60	0,70 %	6,79 %	44.462,39
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	IRF-M1	603.062,49	0,04 %	0,35 %	241,22
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	IRF-M1	32.446.391,28	0,04 %	0,35 %	12.978,56
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	CDI	5.292.934,25	0,00 %	0,04 %	0,00
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	05.164.356/0001-84	CDI	22.613.602,69	0,01 %	0,12 %	2.261,36
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	05.164.356/0001-84	CDI	8.167.903,57	0,01 %	0,12 %	816,79
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	05.164.356/0001-84	CDI	0,00	0,01 %	0,12 %	0,00
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	10.646.895/0001-90	IMA-B	2.803.009,15	0,64 %	6,20 %	17.939,26
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	10.646.895/0001-90	IMA-B	5.446.931,93	0,64 %	6,20 %	34.860,36

FUNDO DE INVESTIMENTO SECURITY REFERENCIADO DI LONGO PRAZO CRÉDITO PRIVADO	09.315.625/0001-17	CREDITO PRIVADO	926.935,80	2,48 %	26,65 %	22.988,01
NTN-F20170101	34.327.635/0001-10	NTN-F	11.256.043,25	0,00 %	0,00 %	0,00

Saldo Total: R\$ 209.891.641,68

Provisão para perda e Investimentos R\$ 470.904,70

CAPITAL PROTEGIDO

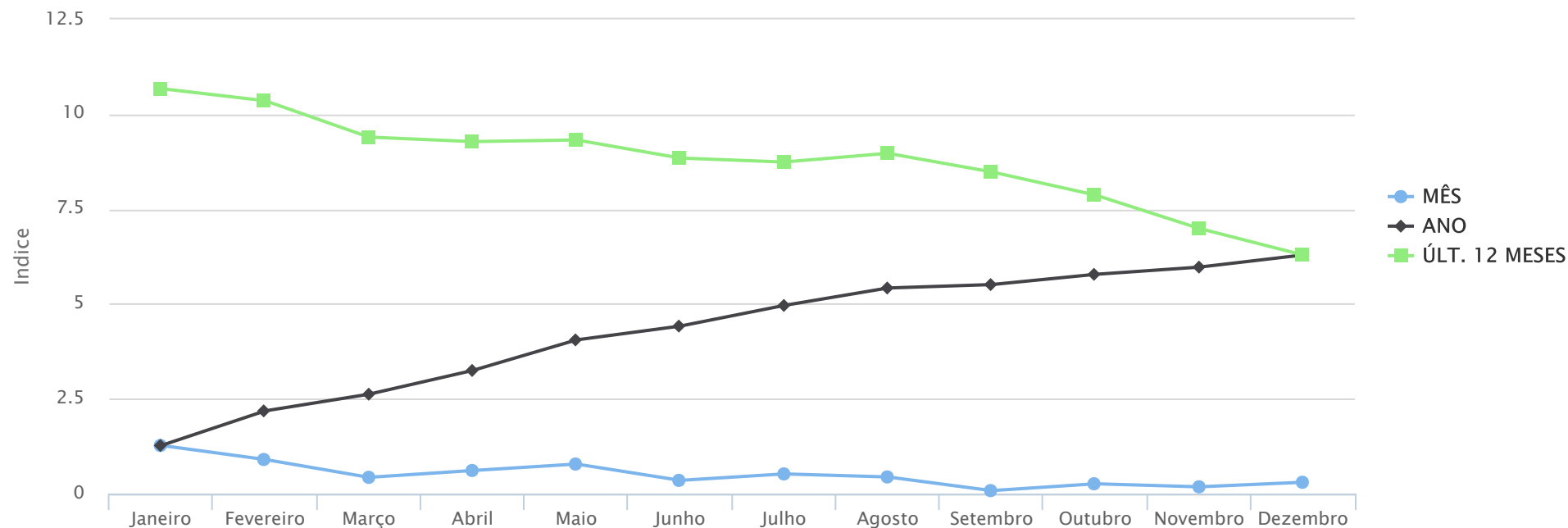
TIPO DE PRODUTO E PERCENTUAL DO CAPITAL INVESTIDO PROTEGIDO	
TIPO DE PRODUTO	PERCENTUAL DO CAPITAL
INVESTIDO PROTEGIDO	INVESTIDO PROTEGIDO (Até)
Títulos Públicos Federais/ Carteira Própria	100%
Fundos de Investimento Referenciado e Renda Fixa 100% Títulos Públicos Federais (previsto no regulamento do 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.

ÍNDICES ECONÔMICOS

IPCA

2016

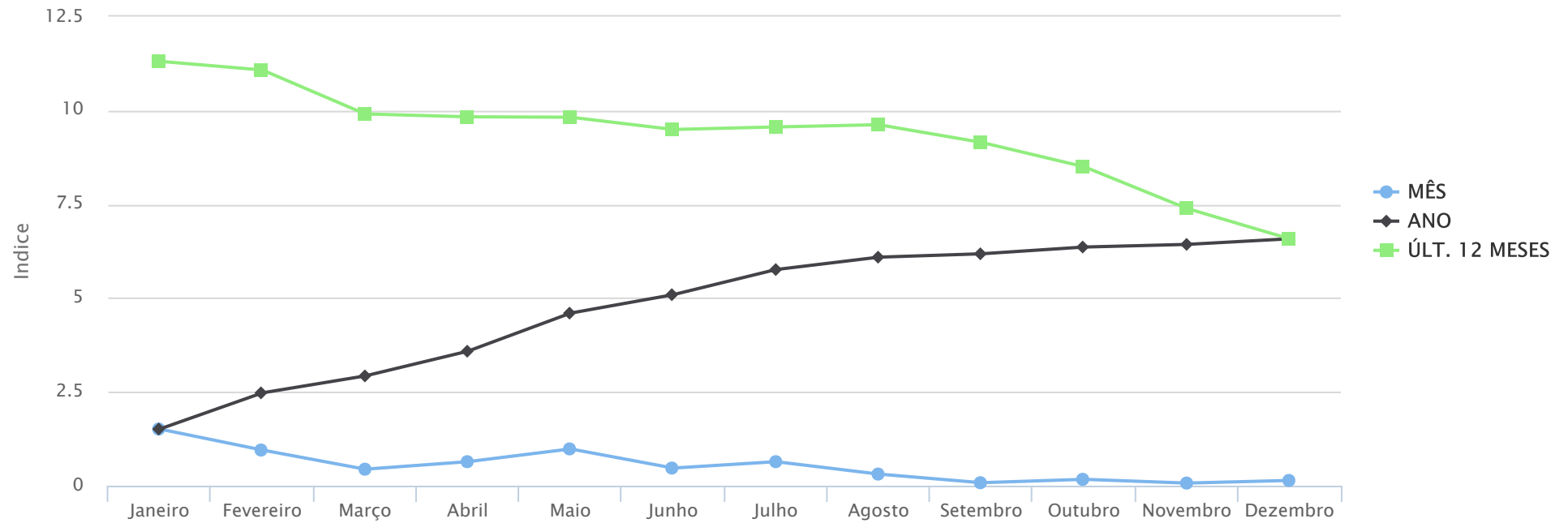


Highcharts.com

2016	Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Mai	Junho	Julho	Agosto	Setembro	Outubro	Novembro	Dezembro
MÊS	1.2700	0.9000	0.4300	0.6100	0.7800	0.3500	0.5200	0.4400	0.0800	0.2600	0.1800	0.3000
ANO	1.2700	2.1814	2.6208	3.2468	4.0521	4.4163	4.9600	5.4200	5.5100	5.7800	5.9700	6.2900
ULT. 12 M	10.6735	10.3563	9.3969	9.2783	9.3217	8.8445	8.7400	8.9700	8.4800	7.8700	6.9900	6.2900

INPC

2016

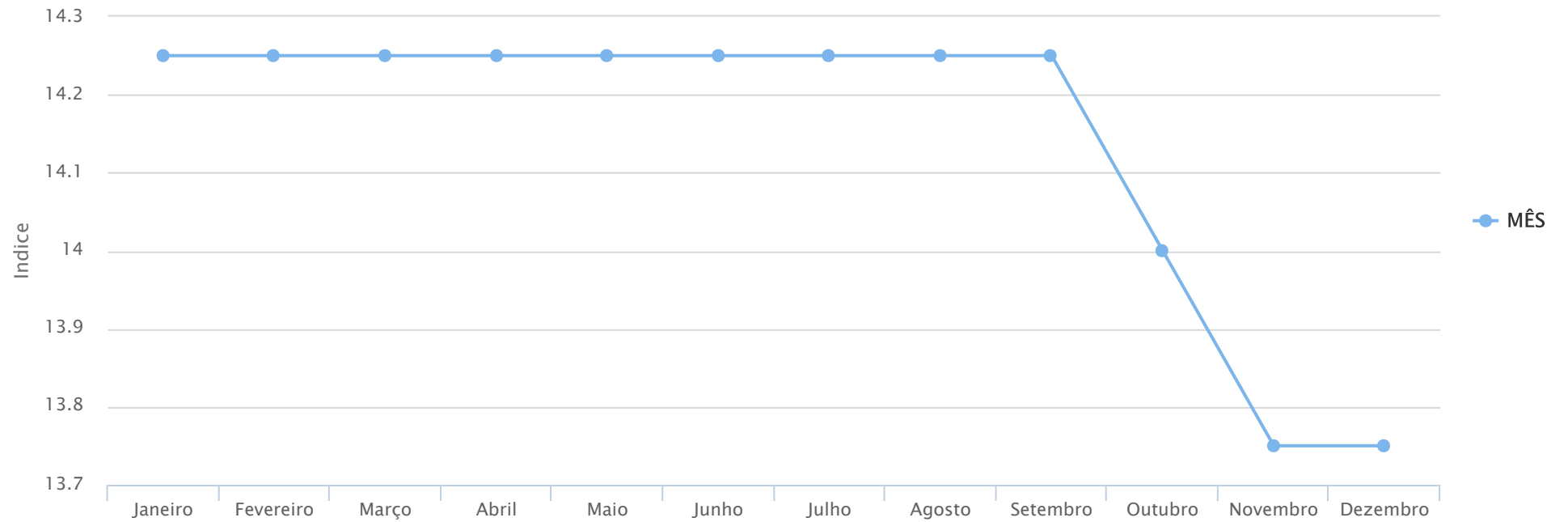


Highcharts.com

2016	Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Mai	Junho	Julho	Agosto	Setembro	Outubro	Novembro	Dezembro
MÊS	1.51	0.95	0.44	0.64	0.98	0.47	0.64	0.31	0.08	0.17	0.07	0.14
ANO	1.51	2.4743	2.9252	3.5840	4.5991	5.0907	5.76	6.09	6.18	6.36	6.43	6.58
ULT. 12 M	11.3091	11.0780	9.9071	9.8307	9.8199	9.4929	9.56	9.62	9.15	8.50	7.39	6.58

SELIC

2016



Highcharts.com

Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Mai	Junho	Julho	Agosto	Setembro	Outubro	Novembro	Dezembro
14.25	14.25	14.25	14.25	14.25	14.25	14.25	14.25	14.25	14.00	13.75	13.75

CADPREV

Renda Fixa		Tipo de Fundo: IMA-B
Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	CNPJ: 78.615.540/0012-2	Saldo em 08/2016: R\$ 15.388.284,22
Administrador: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	CNPJ: 30.822.936/0001-69	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: Art 7º, III "a"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 12/04/2016
Valor da Cota: R\$ 3,377348629	Quantidade de Cotas: 4.556.320,9222	PL do Fundo: R\$ 1.113.831.021,21
% do PL do Fundo: 1,38%	Limite Cumulativo: 7,33%	Limite do Fundo: 80%

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 08/2016: R\$ 49.642.655,13
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: 12/04/2016
Valor da Cota: R\$ 2,002451000	Quantidade de Cotas: 24.790.946,2604	PL do Fundo: R\$ 8.266.051.545,61
% do PL do Fundo: 0,60%	Limite Cumulativo: 23,65%	Limite do Fundo: 100%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: CDI
Fundo: BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO DI PREMIUM	CNPJ: 33.994.110/0019-0	Saldo em 08/2016: R\$ 989.316,53
Administrador: BANCO BRADESCO S.A.	CNPJ: 60.746.948/0001-12	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: Art 7º, IV "a"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/12/2015
Valor da Cota: R\$ 9,261675700	Quantidade de Cotas: 106.818,3083	PL do Fundo: R\$ 6.830.157.675,82
% do PL do Fundo: 0,01%	Limite Cumulativo: 0,47%	Limite do Fundo: 30%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: CDI
Fundo: BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO DI PREMIUM	CNPJ: 33.994.110/0019-0	Saldo em 08/2016: R\$ 10.472.760,69
Administrador: BANCO BRADESCO S.A.	CNPJ: 60.746.948/0001-12	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: Art 7º, IV "a"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 12/04/2016
Valor da Cota: R\$ 9,261675700	Quantidade de Cotas: 1.130.763,0530	PL do Fundo: R\$ 6.830.157.675,82
% do PL do Fundo: 0,15%	Limite Cumulativo: 4,99%	Limite do Fundo: 30%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: CREDITO PRIVADO
-------------------	--	--------------------------------

Fundo: FIC FI LONGO PRAZO RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	CNPJ: 95.869.550/0014-7	Saldo em 08/2016: R\$ 11.726.433,36
Administrador: GRADUAL CCTVM S/A	CNPJ: 33.918.160/0001-73	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: Art 7º , VII, "b"	Disponibilidade: D + 902	Adesão: 12/04/2016
Valor da Cota: R\$ 1,172978740	Quantidade de Cotas: 9.997.140,5790	PL do Fundo: R\$ 19.316.047,48
% do PL do Fundo: 60,71%	Limite Cumulativo: 5,59%	Limite do Fundo: 5%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: IMA-GERAL
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CNPJ: 11.061.217/0001-28	Saldo em 08/2016: R\$ 4.044.360,32
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: 12/04/2016
Valor da Cota: R\$ 1,960266000	Quantidade de Cotas: 2.063.169,1413	PL do Fundo: R\$ 1.205.568.739,51
% do PL do Fundo: 0,34%	Limite Cumulativo: 1,93%	Limite do Fundo: 100%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: IMA-B 5
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CNPJ: 11.060.913/0001-10	Saldo em 08/2016: R\$ 1.884.801,96
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: 12/04/2016
Valor da Cota: R\$ 2,078538000	Quantidade de Cotas: 906.792,1587	PL do Fundo: R\$ 5.821.830.490,52
% do PL do Fundo: 0,03%	Limite Cumulativo: 0,90%	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 08/2016: R\$ 12.372.694,44
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\$ 2,152025000	Quantidade de Cotas: 5.749.326,5366	PL do Fundo: R\$ 5.226.399.198,11
% do PL do Fundo: 0,24%	Limite Cumulativo: 5,89%	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 08/2016: R\$ 7.461.751,02
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\$ 2,152025000	Quantidade de Cotas: 3.467.316,1418	PL do Fundo: R\$ 5.226.399.198,11

% do PL do Fundo: 0,14%	Limite Cumulativo: 3,56%	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 08/2016: R\$ 6.351.769,60
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: 12/04/2016
Valor da Cota: R\$ 2,152025000	Quantidade de Cotas: 2.951.531,5110	PL do Fundo: R\$ 5.226.399.198,11
% do PL do Fundo: 0,12%	Limite Cumulativo: 3,03%	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 08/2016: R\$ 603.062,49
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: 12/04/2016
Valor da Cota: R\$ 1,913272000	Quantidade de Cotas: 315.199,5587	PL do Fundo: R\$ 10.136.234.610,70
% do PL do Fundo: 0,01%	Limite Cumulativo: 0,29%	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 08/2016: R\$ 32.446.391,28
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\$ 1,913272000	Quantidade de Cotas: 16.958.587,8432	PL do Fundo: R\$ 10.136.234.610,70
% do PL do Fundo: 0,32%	Limite Cumulativo: 15,46%	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 08/2016: R\$ 5.292.934,25
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: 12/04/2016
Valor da Cota: R\$ 2,833211000	Quantidade de Cotas: 1.868.175,1024	PL do Fundo: R\$ 5.039.441.339,49
% do PL do Fundo: 0,11%	Limite Cumulativo: 2,52%	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 08/2016: R\$ 22.613.602,69
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\$ 3,065137000	Quantidade de Cotas: 7.377.680,8965	PL do Fundo: R\$ 2.244.004.211,62
% do PL do Fundo: 1,01%	Limite Cumulativo: 10,77%	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 08/2016: R\$ 8.167.903,57
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\$ 3,065137000	Quantidade de Cotas: 2.664.776,0182	PL do Fundo: R\$ 2.244.004.211,62
% do PL do Fundo: 0,36%	Limite Cumulativo: 3,89%	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 08/2016: 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: 12/04/2016
Valor da Cota: R\$ 3,065137000	Quantidade de Cotas: 0,0000	PL do Fundo: R\$ 2.244.004.211,62
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,00%	Limite do Fundo: 30%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: IMA-B
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	CNPJ: 10.646.895/0001-90	Saldo em 08/2016: R\$ 2.803.009,15
Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: Art 7º , III "a"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 12/04/2016
Valor da Cota: R\$ 2,294659000	Quantidade de Cotas: 1.221.536,2500	PL do Fundo: R\$ 2.344.278.875,66
% do PL do Fundo: 0,12%	Limite Cumulativo: 1,34%	Limite do Fundo: 80%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: IMA-B
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	CNPJ: 10.646.895/0001-90	Saldo em 08/2016: R\$ 5.446.931,93
Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: Art 7º , III "a"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 01/12/2015
Valor da Cota: R\$ 2,294659000	Quantidade de Cotas: 2.373.743,5192	PL do Fundo: R\$ 2.344.278.875,66

% do PL do Fundo: 0,23%	Limite Cumulativo: 2,60%	Limite do Fundo: 80%
-------------------------	--------------------------	----------------------

Renda Fixa		Tipo de Fundo: CREDITO PRIVADO
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO SECURITY REFERENCIADO DI LONGO PRAZO CRÉDITO PRIVADO	CNPJ: 93.156.250/0011-7	Saldo em 08/2016: R\$ 926.935,80
Administrador: BNY MELLON SERVICOS FINANCEIROS DTVM S.A.	CNPJ: 22.015.010/0016-1	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: Art 7º , VII, "b"	Disponibilidade: D + 91	Adesão: 12/04/2016
Valor da Cota: R\$ 0,185597980	Quantidade de Cotas: 4.994.320,5201	PL do Fundo: R\$ 10.485.954,37
% do PL do Fundo: 8,84%	Limite Cumulativo: 0,44%	Limite do Fundo: 5%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: NTN-F
Fundo: NTN-F20170101	CNPJ: 34.327.635/0001-10	Saldo em 08/2016: R\$ 11.256.043,25
Administrador:	CNPJ: 00../-	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "a"	Disponibilidade: D + 270	Adesão: 12/04/2016
Valor da Cota: R\$ 1,112073000	Quantidade de Cotas: 10.121.676,5896	PL do Fundo: R\$ 1,00
% do PL do Fundo: 1.125.604.325,00%	Limite Cumulativo: 5,36%	Limite do Fundo: 100%

TOTAL: R\$ 209.891.641,68

CARTEIRA SUGERIDA

ESTRATEGIA PRÓXIMO MÊS - PERFIL CONSERVADOR

CARTEIRA ATUAL			MOVIMENTAÇÕES	CARTEIRA SUGERIDA	
INDICE	SALDO ATUAL	% CAPITAL	APLICAR / RESGATAR	SALDO FINAL	% CAPITAL
FIDC	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
CRED PRIVADO	12.653.369,16	6,37	-12.653.369,16	0,00	0,00
MULTIMERCADO	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
GERAL	4.044.360,32	2,04	-4.044.360,32	0,00	0,00
IPCA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IMA-B	49.824.440,36	25,08	-49.824.440,36	0,00	0,00
IMA-B 5	1.884.801,96	0,95	-1.884.801,96	0,00	0,00
IMA-B 5+	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IDKA 2	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IDKA 20	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IRF-M	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IRF-M1	82.692.108,90	41,63	-82.692.108,90	0,00	0,00
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	47.536.517,73	23,93	-47.536.517,73	0,00	0,00
TOTAL:	198.635.598,43	100,00		0,00	0,00

ESTRATEGIA PRÓXIMO MÊS - PERFIL MODERADO

CARTEIRA ATUAL			MOVIMENTAÇÕES	CARTEIRA SUGERIDA	
INDICE	SALDO ATUAL	% CAPITAL	APLICAR / RESGATAR	SALDO FINAL	% CAPITAL
FIDC	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
CRED PRIVADO	12.653.369,16	6,37	-12.653.369,16	0,00	0,00
MULTIMERCADO	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
GERAL	4.044.360,32	2,04	-4.044.360,32	0,00	0,00
IPCA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IMA-B	49.824.440,36	25,08	-49.824.440,36	0,00	0,00
IMA-B 5	1.884.801,96	0,95	-1.884.801,96	0,00	0,00
IMA-B 5+	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IDKA 2	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IDKA 20	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IRF-M	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IRF-M1	82.692.108,90	41,63	-82.692.108,90	0,00	0,00
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	47.536.517,73	23,93	-47.536.517,73	0,00	0,00
TOTAL:	198.635.598,43	100,00		0,00	0,00

Kenzo Leonardo de Blasi