



DI BLASI
Consultoria Financeira

INSTITUTO DE SEGURIDADE DO SERVIDOR MUNICIPAL CAMAÇARI

Relatório Competência

02/2017

VISÃO GERAL

FUNDO	DISP. DE RESGATE	SALDO R\$	PARTICIPAÇÃO	QTDE. COTISTAS	% SOBRE PL DO FUNDO	PL DO FUNDO R\$	RESOLUÇÃO	GRAU DE RISCO
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	D + 0	16.937.096,72	7,15 %	253	1,32 %	1.284.102.751,60	Art 7º, III "a"	Médio
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D + 0	47.753.320,08	20,16 %	1177	0,52 %	9.245.082.413,39	Art 7º ,I, "b"	Baixo
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO DI PREMIUM	D + 0	0,00	0,00 %	411	0,00 %	7.584.324.320,29	Art 7º , IV "a"	Baixo
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO DI PREMIUM	D + 0	10.794.856,42	4,56 %	411	0,14 %	7.584.324.320,29	Art 7º , IV "a"	Baixo
FIC FI LONGO PRAZO RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D + 902	11.810.067,74	4,99 %	3	60,71 %	19.453.812,04	Art 7º , VII, "b"	Alto
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	4.400.514,90	1,86 %	203	0,35 %	1.251.723.270,23	Art 7º ,I, "b"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	2.005.107,88	0,85 %	712	0,04 %	5.626.003.834,34	Art 7º ,I, "b"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	13.600.302,13	5,74 %	746	0,24 %	5.631.232.992,31	Art 7º ,I, "b"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	8.202.099,31	3,46 %	746	0,15 %	5.631.232.992,31	Art 7º ,I, "b"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	6.981.986,51	2,95 %	746	0,12 %	5.631.232.992,31	Art 7º ,I, "b"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	3.797.556,59	1,60 %	1341	0,03 %	11.686.776.140,44	Art 7º ,I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	53.899.435,57	22,76 %	1341	0,46 %	11.686.776.140,44	Art 7º ,I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	D + 0	26.305.974,58	11,11 %	764	0,42 %	6.313.650.918,31	Art 7º , IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	11.613.424,09	4,90 %	433	0,61 %	1.908.851.339,36	Art 7º , IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	8.693.623,91	3,67 %	433	0,46 %	1.908.851.339,36	Art 7º , IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	0,00	0,00 %	433	0,00 %	1.908.851.339,36	Art 7º , IV "a"	Baixo

FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	D + 0	3.082.947,39	1,30 %	334	0,12 %	2.528.652.551,60	Art 7º, III "a"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	D + 0	5.990.920,37	2,53 %	334	0,24 %	2.528.652.551,60	Art 7º, III "a"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO SECURITY REFERENCIADO DI LONGO PRAZO CRÉDITO PRIVADO	D + 91	955.663,60	0,40 %	14	8,84 %	10.810.937,33	Art 7º, VII, "b"	Alto
NTN-F20170101	D + 270	0,00	0,00 %		0,00 %	0,00	Art 7º, I, "a"	Alto

TOTAL SALDO: R\$ 236.824.897,79

ENQUADRAMENTO

RENDA FIXA - ARTIGOS	LIMITE DA RESOLUÇÃO	LIMITE POLÍTICA	TOTAL	% CARTEIRA
Art 7º, I, "a"	100 %	100 %	0,00	0,00
Art 7º, I, "b"	100 %	100 %	140.640.322,97	59,39
Art 7º, III "a"	80 %	80 %	26.010.964,48	10,98
Art 7º, IV "a"	30 %	30 %	57.407.879,00	24,24
Art 7º, VII, "b"	5 %	5 %	12.765.731,34	5,39

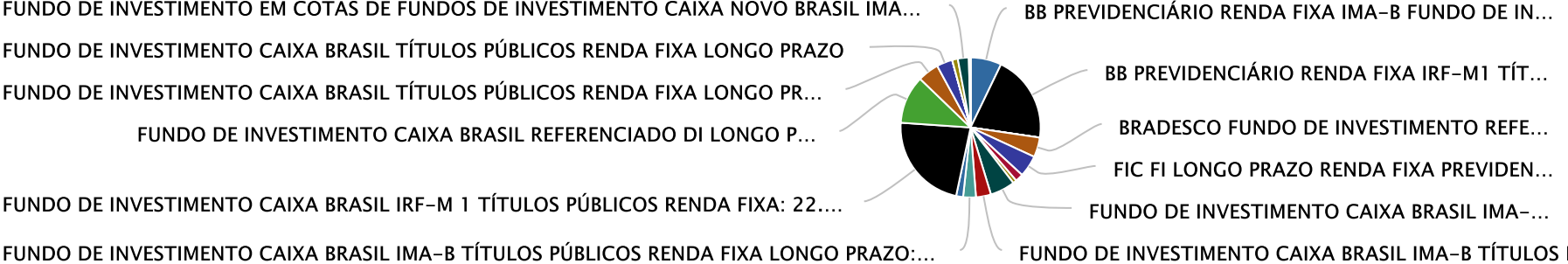
RENDA VARIÁVEL - ARTIGOS	LIMITE DA RESOLUÇÃO	LIMITE POLÍTICA	TOTAL	% CARTEIRA
--------------------------	---------------------	-----------------	-------	------------

DISTRIBUIÇÃO POR PARÂMETRO DE RENTABILIDADE	TOTAL	% CARTEIRA
CDI	57.407.879,00	24,24
CREDITO PRIVADO	12.765.731,34	5,39
IMA-B	54.795.352,43	23,14
IMA-B 5	2.005.107,88	0,85
IMA-GERAL	4.400.514,90	1,86
IRF-M1	105.450.312,24	44,53
NTN-F	0,00	0,00

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	TOTAL	% CARTEIRA
CNPJ:	0,00	0,00
BNY MELLON SERVICOS FINANCEIROS DTVM S.A. CNPJ: 2201501000161	955.663,60	0,40
BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A CNPJ: 30822936000169	64.690.416,80	27,32
GRADUAL CCTVM S/A CNPJ: 33918160000173	11.810.067,74	4,99
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CNPJ: 360305000104	148.573.893,23	62,74
BANCO BRADESCO S.A. CNPJ: 60746948000112	10.794.856,42	4,56

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\$ 16.303.225,36	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 16.937.096,72	R\$ 633.871,36	3,88801 %	3,88801 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 45.628.980,93	R\$ 1.666.765,44	R\$ 0,00	R\$ 47.753.320,08	R\$ 457.573,71	0,98694 %	0,96747 %
BRDESCO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 260.493,69	R\$ 0,00	R\$ 258.633,68	R\$ 0,00	R\$ -1.860,01	0,87280 %	0,87280 %
BRDESCO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 10.529.960,82	R\$ 176.766,80	R\$ 5.000,00	R\$ 10.794.856,42	R\$ 93.128,80	0,87280 %	0,87022 %
FIC FI LONGO PRAZO RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	R\$ 11.811.213,81	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 11.810.067,74	R\$ -1.146,07	-0,00970 %	-0,00970 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 4.304.195,84	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 4.400.514,90	R\$ 96.319,06	2,23779 %	2,23779 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 1.975.910,99	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 2.005.107,88	R\$ 29.196,89	1,47764 %	1,47764 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 13.099.041,34	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 13.600.302,13	R\$ 501.260,79	3,82670 %	3,82670 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 7.899.797,88	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 8.202.099,31	R\$ 302.301,43	3,82670 %	3,82670 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 6.724.654,27	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 6.981.986,51	R\$ 257.332,24	3,82670 %	3,82670 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	R\$ 1.085.289,19	R\$ 2.686.039,11	R\$ 0,00	R\$ 3.797.556,59	R\$ 26.228,29	0,99436 %	0,99436 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	R\$ 53.368.758,39	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 53.899.435,57	R\$ 530.677,18	0,99436 %	0,99436 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	R\$ 33.225.716,63	R\$ 0,00	R\$ 7.202.899,28	R\$ 26.305.974,58	R\$ 283.157,23	0,88041 %	0,88041 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 10.701.311,18	R\$ 811.413,52	R\$ 0,00	R\$ 11.613.424,09	R\$ 100.699,39	0,90010 %	0,87468 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 8.616.070,91	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 8.693.623,91	R\$ 77.553,00	0,90010 %	0,90010 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	0,90010 %	0,90010 %

FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	R\$ 2.970.762,72	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 3.082.947,39	R\$ 112.184,67	3,77629 %	3,77629 %
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	R\$ 5.772.918,12	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 5.990.920,37	R\$ 218.002,25	3,77629 %	3,77629 %
FUNDO DE INVESTIMENTO SECURITY REFERENCIADO DI LONGO PRAZO CRÉDITO PRIVADO	R\$ 951.767,42	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 955.663,60	R\$ 3.896,18	0,40936 %	0,40936 %
NTN-F20170101	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	-	-
TOTAIS	R\$ 235.230.069,49	R\$ 5.340.984,87	R\$ 7.466.532,96	R\$ 236.824.897,79	R\$ 3.720.376,39	1,5991 %	1,5938 %

RETORNOS ACUMULADO

MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO R\$	RETORNO %	META %	ATINGIMENTO %
JANEIRO	R\$ 231.042.589,63	R\$ 39.003.254,46	R\$ 37.897.386,79	R\$ 235.230.069,49	R\$ 3.081.612,19	1,3227 %	0,87 %	152,28 %
FEVEREIRO	R\$ 235.230.069,49	R\$ 5.340.984,87	R\$ 7.466.532,96	R\$ 236.824.897,79	R\$ 3.720.376,39	1,5938 %	0,82 %	194,75 %
TOTAIS		R\$ 44.344.239,33	R\$ 45.363.919,75		R\$ 6.801.988,58	2,94	1,69	173,40

MEDIDA DE RISCO

GESTÃO DE RISCO - MERCADO: O valor dos ativos que compõem a carteira do fundo pode aumentar ou diminuir de acordo com flutuações de preços e cotações de mercado, mudanças no cenário político e econômico, alterações nas taxas de juros e, ainda, com os resultados das empresas emittentes de valores mobiliários (ações, debêntures, notas promissórias, entre outros).

Índice Sharpe: O índice de Sharpe é uma medida que permite a classificação do fundo em termos de desempenho global, sendo considerados melhores os fundos com maior índice. Vale lembrar ainda que o índice varia se o resultado for calculado com base em rentabilidades semanais, mensais ou anuais.

VaR - Value at Risk: *Value-at-risk* ou Valor sob Risco pode ser definido como perda máxima, num determinado período, sob condições normais de mercado, com determinado grau de confiança.

FUNDO	BENCHMARK	VAR 12 MESES	SHARPE	VOLATILIDADE 3 MESES	VOLATILIDADE 6 MESES	VOLATILIDADE 12 MESES
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	IMA-B	0,76 %	1,58 %	6,42 %	6,72 %	7,31%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	IRF-M1	0,03 %	0,16 %	0,40 %	0,34 %	0,31%
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO DI PREMIUM	CDI	0,01 %	4,83 %	0,03 %	0,07 %	0,05%
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO DI PREMIUM	CDI	0,01 %	4,83 %	0,03 %	0,07 %	0,05%
FIC FI LONGO PRAZO RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	CREDITO PRIVADO	0,08 %	-13,15 %	0,82 %	0,60 %	0,82%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-GERAL	0,37 %	1,87 %	3,10 %	3,36 %	3,63%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B 5	0,25 %	-0,28 %	2,39 %	2,38 %	2,39%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	0,76 %	1,57 %	6,43 %	6,71 %	7,37%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	0,76 %	1,57 %	6,43 %	6,71 %	7,37%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	0,76 %	1,57 %	6,43 %	6,71 %	7,37%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IRF-M1	0,03 %	0,46 %	0,39 %	0,33 %	0,30%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IRF-M1	0,03 %	0,46 %	0,39 %	0,33 %	0,30%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	CDI	0,01 %	0,01 %	0,07 %	0,06 %	0,05%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CDI	0,01 %	-0,29 %	0,08 %	0,06 %	0,08%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CDI	0,01 %	-0,29 %	0,08 %	0,06 %	0,08%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CDI	0,01 %	-0,29 %	0,08 %	0,06 %	0,08%

FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	IMA-B	0,72 %	1,65 %	6,16 %	6,48 %	6,93%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	IMA-B	0,72 %	1,65 %	6,16 %	6,48 %	6,93%
FUNDO DE INVESTIMENTO SECURITY REFERENCIADO DI LONGO PRAZO CRÉDITO PRIVADO	CREDITO PRIVADO	2,48 %	-1,34 %	0,11 %	0,11 %	26,64%
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% BASE 1 DIA CONFIANÇA 95% 252 DU* (R\$)
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	07.861.554/0001-22	IMA-B	16.937.096,72	0,76 %	7,40 %	128.721,94
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	11.328.882/0001-35	IRF-M1	47.753.320,08	0,03 %	0,32 %	14.326,00
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO DI PREMIUM	03.399.411/0001-90	CDI	0,00	0,01 %	0,05 %	0,00
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO DI PREMIUM	03.399.411/0001-90	CDI	10.794.856,42	0,01 %	0,05 %	1.079,49
FIC FI LONGO PRAZO RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	09.586.955/0001-47	CREDITO PRIVADO	11.810.067,74	0,08 %	0,82 %	9.448,05
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	11.061.217/0001-28	IMA-GERAL	4.400.514,90	0,38 %	3,68 %	16.721,96
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	11.060.913/0001-10	IMA-B 5	2.005.107,88	0,26 %	2,48 %	5.213,28
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	10.740.658/0001-93	IMA-B	13.600.302,13	0,77 %	7,46 %	104.722,33
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	10.740.658/0001-93	IMA-B	8.202.099,31	0,77 %	7,46 %	63.156,16
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	10.740.658/0001-93	IMA-B	6.981.986,51	0,77 %	7,46 %	53.761,30
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	IRF-M1	3.797.556,59	0,03 %	0,31 %	1.139,27
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	IRF-M1	53.899.435,57	0,03 %	0,31 %	16.169,83
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	CDI	26.305.974,58	0,00 %	0,05 %	0,00
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	05.164.356/0001-84	CDI	11.613.424,09	0,01 %	0,09 %	1.161,34
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	05.164.356/0001-84	CDI	8.693.623,91	0,01 %	0,09 %	869,36
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	05.164.356/0001-84	CDI	0,00	0,01 %	0,09 %	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	3.082.947,39	0,72 %	6,98 %	22.197,22

FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	10.646.895/0001-90	IMA-B	5.990.920,37	0,72 %	6,98 %	43.134,63
FUNDO DE INVESTIMENTO SECURITY REFERENCIADO DI LONGO PRAZO CRÉDITO PRIVADO	09.315.625/0001-17	CREDITO PRIVADO	955.663,60	2,47 %	26,53 %	23.604,89
NTN-F20170101	34.327.635/0001-10	NTN-F	0,00	0,00 %	0,00 %	0,00

RISCO DE MERCADO	
Saldo Total:	R\$ 236.824.897,79
Provisão para perda e Investimentos:	R\$ 505.427,04
% Provisão de Perda:	0,213%
Percentual aceitável:	2,00%
Espaço para utilização:	89,33%

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.

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 02/2017: R\$ 16.937.096,72
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\$ 3,717274750	Quantidade de Cotas: 4.556.320,9230	PL do Fundo: R\$ 1.284.102.751,60
% do PL do Fundo: 1,32%	Limite Cumulativo: 7,15%	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 02/2017: R\$ 47.753.320,08
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\$ 2,136919000	Quantidade de Cotas: 22.346.808,6905	PL do Fundo: R\$ 9.245.082.413,39
% do PL do Fundo: 0,52%	Limite Cumulativo: 20,16%	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 02/2017: R\$ 0,00
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\$ 9,877988300	Quantidade de Cotas: 0,0000	PL do Fundo: R\$ 7.584.324.320,29
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,00%	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 02/2017: R\$ 10.794.856,42
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\$ 9,877988300	Quantidade de Cotas: 1.092.819,3163	PL do Fundo: R\$ 7.584.324.320,29
% do PL do Fundo: 0,14%	Limite Cumulativo: 4,56%	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 02/2017: R\$ 11.810.067,74
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\$ 1,181344570	Quantidade de Cotas: 9.997.140,5802	PL do Fundo: R\$ 19.453.812,04
% do PL do Fundo: 60,71%	Limite Cumulativo: 4,99%	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 02/2017: R\$ 4.400.514,90
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\$ 2,132891000	Quantidade de Cotas: 2.063.169,1446	PL do Fundo: R\$ 1.251.723.270,23
% do PL do Fundo: 0,35%	Limite Cumulativo: 1,86%	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 02/2017: R\$ 2.005.107,88
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\$ 2,211210000	Quantidade de Cotas: 906.792,1545	PL do Fundo: R\$ 5.626.003.834,34
% do PL do Fundo: 0,04%	Limite Cumulativo: 0,85%	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 02/2017: R\$ 13.600.302,13
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\$ 2,365547000	Quantidade de Cotas: 5.749.326,5321	PL do Fundo: R\$ 5.631.232.992,31
% do PL do Fundo: 0,24%	Limite Cumulativo: 5,74%	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 02/2017: R\$ 8.202.099,31
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\$ 2,365547000	Quantidade de Cotas: 3.467.316,1472	PL do Fundo: R\$ 5.631.232.992,31

% do PL do Fundo: 0,15%	Limite Cumulativo: 3,46%	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 02/2017: R\$ 6.981.986,51
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\$ 2,365547000	Quantidade de Cotas: 2.951.531,5105	PL do Fundo: R\$ 5.631.232.992,31
% do PL do Fundo: 0,12%	Limite Cumulativo: 2,95%	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 02/2017: R\$ 3.797.556,59
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\$ 2,042518000	Quantidade de Cotas: 1.859.252,4472	PL do Fundo: R\$ 11.686.776.140,44
% do PL do Fundo: 0,03%	Limite Cumulativo: 1,60%	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 02/2017: R\$ 53.899.435,57
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\$ 2,042518000	Quantidade de Cotas: 26.388.719,9868	PL do Fundo: R\$ 11.686.776.140,44
% do PL do Fundo: 0,46%	Limite Cumulativo: 22,76%	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 02/2017: R\$ 26.305.974,58
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\$ 3,015392000	Quantidade de Cotas: 8.723.898,7767	PL do Fundo: R\$ 6.313.650.918,31
% do PL do Fundo: 0,42%	Limite Cumulativo: 11,11%	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 02/2017: R\$ 11.613.424,09
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\$ 3,262422000	Quantidade de Cotas: 3.559.755,3260	PL do Fundo: R\$ 1.908.851.339,36
% do PL do Fundo: 0,61%	Limite Cumulativo: 4,90%	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 02/2017: R\$ 8.693.623,91
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\$ 3,262422000	Quantidade de Cotas: 2.664.776,0192	PL do Fundo: R\$ 1.908.851.339,36
% do PL do Fundo: 0,46%	Limite Cumulativo: 3,67%	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 02/2017: R\$ 0,00
Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: Art 7º , IV "a"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 12/04/2016
Valor da Cota: R\$ 3,262422000	Quantidade de Cotas: 0,0000	PL do Fundo: R\$ 1.908.851.339,36
% 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 02/2017: R\$ 3.082.947,39
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\$ 2,523828000	Quantidade de Cotas: 1.221.536,2497	PL do Fundo: R\$ 2.528.652.551,60
% do PL do Fundo: 0,12%	Limite Cumulativo: 1,30%	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 02/2017: R\$ 5.990.920,37
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\$ 2,523828000	Quantidade de Cotas: 2.373.743,5237	PL do Fundo: R\$ 2.528.652.551,60

% do PL do Fundo: 0,24%	Limite Cumulativo: 2,53%	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 02/2017: R\$ 955.663,60
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\$ 0,191350070	Quantidade de Cotas: 4.994.320,6187	PL do Fundo: R\$ 10.810.937,33
% do PL do Fundo: 8,84%	Limite Cumulativo: 0,40%	Limite do Fundo: 5%

Renda Fixa		Tipo de Fundo: NTN-F
Fundo: NTN-F20170101	CNPJ: 34.327.635/0001-10	Saldo em 02/2017: R\$ 0,00
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\$ 0,000000000	Quantidade de Cotas: 0,0000	PL do Fundo: R\$ 0,00
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,00%	Limite do Fundo: 100%

TOTAL: R\$ 236.824.897,79

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	12.765.731,34	5,39	-869,35	12.764.861,99	5,39
MULTIMERCADO	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
GERAL	4.400.514,90	1,86	75.475,67	4.475.990,57	1,89
IPCA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IMA-B	54.795.352,43	23,14	-31.112.862,65	23.682.489,78	10,00
IMA-B 5	2.005.107,88	0,85	21.677.381,90	23.682.489,78	10,00
IMA-B 5+	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IDKA 2	0,00	0,00	47.364.979,56	47.364.979,56	20,00
IDKA 20	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IRF-M	0,00	0,00	23.682.489,78	23.682.489,78	10,00
IRF-M1	105.450.312,24	44,53	-34.402.842,90	71.047.469,34	30,00
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	57.407.879,00	24,24	-27.283.752,00	30.124.127,00	12,72
TOTAL:	236.824.897,79	100,00		236.824.897,79	100,00

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	12.765.731,34	5,39	-869,35	12.764.861,99	5,39
MULTIMERCADO	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
GERAL	4.400.514,90	1,86	75.475,67	4.475.990,57	1,89
IPCA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IMA-B	54.795.352,43	23,14	-19.271.617,76	35.523.734,67	15,00
IMA-B 5	2.005.107,88	0,85	33.518.626,79	35.523.734,67	15,00
IMA-B 5+	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IDKA 2	0,00	0,00	47.364.979,56	47.364.979,56	20,00
IDKA 20	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IRF-M	0,00	0,00	47.364.979,56	47.364.979,56	20,00
IRF-M1	105.450.312,24	44,53	-81.767.822,46	23.682.489,78	10,00
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	57.407.879,00	24,24	-27.283.752,00	30.124.127,00	12,72
TOTAL:	236.824.897,79	100,00		236.824.897,79	100,00

Renato Leonardo de Blasi

DI BLASI CONSULTORIA FINANCEIRA LTDA

CNPJ 03.866.812/0001-02

CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS HABILITADA PELA COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS - CVM