



**DI BLASI**  
Consultoria Financeira

# INSTITUTO DE SEGURIDADE DO SERVIDOR MUNICIPAL CAMAÇARI

## Relatório Competência

### 03/2017

## 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	17.114.182,72	6,97 %	257	1,31 %	1.303.474.709,01	Art 7º, III "a"	Médio
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D + 0	49.957.085,68	20,35 %	1170	0,55 %	9.030.435.490,32	Art 7º ,I, "b"	Baixo
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO DI PREMIUM	D + 0	693.711,14	0,28 %	419	0,01 %	7.549.648.257,31	Art 7º , IV "a"	Baixo
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO DI PREMIUM	D + 0	10.947.462,91	4,46 %	419	0,15 %	7.549.648.257,31	Art 7º , IV "a"	Baixo
FIC FI LONGO PRAZO RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D + 902	11.853.569,60	4,83 %	0	60,71 %	19.525.482,48	Art 7º , VII, "b"	Alto
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	4.452.807,97	1,81 %	207	0,35 %	1.275.678.677,48	Art 7º ,I, "b"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	2.032.724,25	0,83 %	718	0,04 %	5.761.023.230,35	Art 7º ,I, "b"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	13.741.005,42	5,60 %	766	0,23 %	5.954.581.114,26	Art 7º ,I, "b"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	8.286.954,93	3,38 %	766	0,14 %	5.954.581.114,26	Art 7º ,I, "b"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	7.054.219,34	2,87 %	766	0,12 %	5.954.581.114,26	Art 7º ,I, "b"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	13.552.718,80	5,52 %	1342	0,12 %	11.724.254.123,84	Art 7º ,I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D + 0	54.500.016,46	22,20 %	1342	0,46 %	11.724.254.123,84	Art 7º ,I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	D + 0	19.860.107,34	8,09 %	754	0,32 %	6.226.798.118,69	Art 7º , IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	12.553.465,49	5,11 %	433	0,66 %	1.910.326.544,74	Art 7º , IV "a"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D + 0	8.785.132,31	3,58 %	433	0,46 %	1.910.326.544,74	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 %	1.910.326.544,74	Art 7º , IV "a"	Baixo

FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	D + 0	3.112.212,95	1,27 %	340	0,12 %	2.562.643.492,65	Art 7º, III "a"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	D + 0	6.047.790,50	2,46 %	340	0,24 %	2.562.643.492,65	Art 7º, III "a"	Médio
FUNDO DE INVESTIMENTO SECURITY REFERENCIADO DI LONGO PRAZO CRÉDITO PRIVADO	D + 91	960.790,06	0,39 %	14	8,84 %	10.868.930,59	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\$ 245.505.957,87

# 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 %	153.577.532,85	62,56
Art 7º, III "a"	80 %	80 %	26.274.186,17	10,70
Art 7º, IV "a"	30 %	30 %	52.839.879,19	21,52
Art 7º, VII, "b"	5 %	5 %	12.814.359,66	5,22

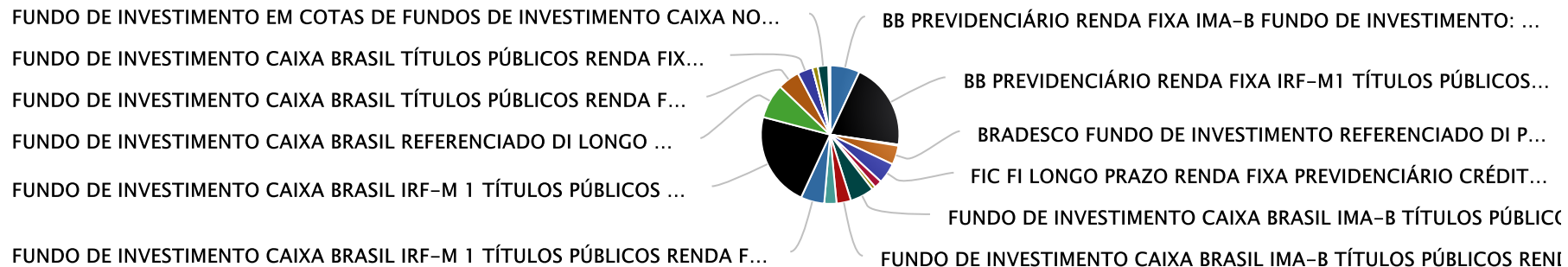
RENDA VARIÁVEL - ARTIGOS	LIMITE DA RESOLUÇÃO	LIMITE POLÍTICA	TOTAL	% CARTEIRA
--------------------------	---------------------	-----------------	-------	------------

DISTRIBUIÇÃO POR PARÂMETRO DE RENTABILIDADE	TOTAL	% CARTEIRA
CDI	52.839.879,19	21,52
CREDITO PRIVADO	12.814.359,66	5,22
IMA-B	55.356.365,86	22,55
IMA-B 5	2.032.724,25	0,83
IMA-GERAL	4.452.807,97	1,81
IRF-M1	118.009.820,94	48,07
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	960.790,06	0,39
BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A   CNPJ: 30822936000169	67.071.268,40	27,32
GRADUAL CCTVM S/A   CNPJ: 33918160000173	11.853.569,60	4,83
CAIXA ECONOMICA FEDERAL   CNPJ: 360305000104	153.979.155,76	62,72
BANCO BRADESCO S.A.   CNPJ: 60746948000112	11.641.174,05	4,74

# DISTRIBUIÇÃO

## Visão Geral – Fundos de Investimento



Highcharts.com

# RETORNOS

FUNDO	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO R\$	RETORNO %	EFETIVO %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 16.937.096,72	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 17.114.182,72	R\$ 177.086,00	1,04555 %	1,04555 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 47.753.320,08	R\$ 1.667.651,68	R\$ 0,00	R\$ 49.957.085,68	R\$ 536.113,92	1,10098 %	1,10098 %
BRDESCO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 0,00	R\$ 1.002.739,72	R\$ 315.925,53	R\$ 693.711,14	R\$ 6.896,95	1,05139 %	1,05139 %
BRDESCO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 10.794.856,42	R\$ 94.927,07	R\$ 56.000,00	R\$ 10.947.462,91	R\$ 113.679,42	1,05139 %	1,05139 %
FIC FI LONGO PRAZO RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	R\$ 11.810.067,74	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 11.853.569,60	R\$ 43.501,86	0,36835 %	0,36835 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 4.400.514,90	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 4.452.807,97	R\$ 52.293,07	1,18834 %	1,18834 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 2.005.107,88	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 2.032.724,25	R\$ 27.616,37	1,37730 %	1,37730 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 13.600.302,13	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 13.741.005,42	R\$ 140.703,29	1,03456 %	1,03456 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 8.202.099,31	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 8.286.954,93	R\$ 84.855,62	1,03456 %	1,03456 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 6.981.986,51	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 7.054.219,34	R\$ 72.232,83	1,03456 %	1,03456 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	R\$ 3.797.556,59	R\$ 9.715.109,30	R\$ 38.276,64	R\$ 13.552.718,80	R\$ 78.329,55	1,11426 %	1,11426 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	R\$ 53.899.435,57	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 54.500.016,46	R\$ 600.580,89	1,11426 %	1,11426 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	R\$ 26.305.974,58	R\$ 0,00	R\$ 6.713.363,89	R\$ 19.860.107,34	R\$ 267.496,65	1,06832 %	1,06832 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 11.613.424,09	R\$ 812.700,00	R\$ 0,00	R\$ 12.553.465,49	R\$ 127.341,40	1,05259 %	1,05259 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 8.693.623,91	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 8.785.132,31	R\$ 91.508,40	1,05259 %	1,05259 %
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	1,05259 %	1,05259 %

FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	R\$ 3.082.947,39	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 3.112.212,95	R\$ 29.265,56	0,94927 %	0,94927 %
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	R\$ 5.990.920,37	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 6.047.790,50	R\$ 56.870,13	0,94927 %	0,94927 %
FUNDO DE INVESTIMENTO SECURITY REFERENCIADO DI LONGO PRAZO CRÉDITO PRIVADO	R\$ 955.663,60	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 960.790,06	R\$ 5.126,46	0,53643 %	0,53643 %
NTN-F20170101	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	-	-
TOTAIS	R\$ 236.824.897,79	R\$ 13.293.127,77	R\$ 7.123.566,06	R\$ 245.505.957,87	R\$ 2.511.498,37	1,0444 %	1,0444 %

# 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 %
MARÇO	R\$ 236.824.897,79	R\$ 13.293.127,77	R\$ 7.123.566,06	R\$ 245.505.957,87	R\$ 2.511.498,37	1,0444 %	0,74 %	141,51 %
TOTAIS		R\$ 57.637.367,10	R\$ 52.487.485,81		R\$ 9.313.486,95	4,01	2,44	164,14



# 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	0,63 %	1,13 %	5,35 %	6,64 %	6,14%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	IRF-M1	0,03 %	0,14 %	0,41 %	0,35 %	0,30%
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO DI PREMIUM	CDI	0,01 %	5,15 %	0,03 %	0,09 %	0,06%
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO DI PREMIUM	CDI	0,01 %	5,15 %	0,03 %	0,09 %	0,06%
FIC FI LONGO PRAZO RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	CREDITO PRIVADO	0,09 %	-12,37 %	0,89 %	0,65 %	0,84%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-GERAL	0,32 %	1,43 %	2,63 %	3,32 %	3,14%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B 5	0,22 %	0,04 %	1,98 %	2,36 %	2,16%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	0,64 %	1,10 %	5,34 %	6,63 %	6,15%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	0,64 %	1,10 %	5,34 %	6,63 %	6,15%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B	0,64 %	1,10 %	5,34 %	6,63 %	6,15%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IRF-M1	0,03 %	0,46 %	0,40 %	0,35 %	0,29%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IRF-M1	0,03 %	0,46 %	0,40 %	0,35 %	0,29%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	CDI	0,01 %	-0,01 %	0,08 %	0,07 %	0,06%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CDI	0,01 %	-0,53 %	0,12 %	0,09 %	0,08%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CDI	0,01 %	-0,53 %	0,12 %	0,09 %	0,08%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CDI	0,01 %	-0,53 %	0,12 %	0,09 %	0,08%

FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	IMA-B	0,60 %	1,14 %	5,13 %	6,41 %	5,84%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	IMA-B	0,60 %	1,14 %	5,13 %	6,41 %	5,84%
FUNDO DE INVESTIMENTO SECURITY REFERENCIADO DI LONGO PRAZO CRÉDITO PRIVADO	CREDITO PRIVADO	1,17 %	-1,44 %	0,10 %	0,11 %	12,03%
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	17.114.182,72	0,76 %	7,31 %	130.067,79
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	11.328.882/0001-35	IRF-M1	49.957.085,68	0,03 %	0,31 %	14.987,13
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO DI PREMIUM	03.399.411/0001-90	CDI	693.711,14	0,01 %	0,05 %	69,37
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO DI PREMIUM	03.399.411/0001-90	CDI	10.947.462,91	0,01 %	0,05 %	1.094,75
FIC FI LONGO PRAZO RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	09.586.955/0001-47	CREDITO PRIVADO	11.853.569,60	0,08 %	0,82 %	9.482,86
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	11.061.217/0001-28	IMA-GERAL	4.452.807,97	0,37 %	3,63 %	16.475,39
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	11.060.913/0001-10	IMA-B 5	2.032.724,25	0,25 %	2,39 %	5.081,81
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	10.740.658/0001-93	IMA-B	13.741.005,42	0,76 %	7,37 %	104.431,64
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	10.740.658/0001-93	IMA-B	8.286.954,93	0,76 %	7,37 %	62.980,86
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	10.740.658/0001-93	IMA-B	7.054.219,34	0,76 %	7,37 %	53.612,07
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	IRF-M1	13.552.718,80	0,03 %	0,30 %	4.065,82
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	IRF-M1	54.500.016,46	0,03 %	0,30 %	16.350,00
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	CDI	19.860.107,34	0,01 %	0,05 %	1.986,01
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	05.164.356/0001-84	CDI	12.553.465,49	0,01 %	0,08 %	1.255,35
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	05.164.356/0001-84	CDI	8.785.132,31	0,01 %	0,08 %	878,51
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	05.164.356/0001-84	CDI	0,00	0,01 %	0,08 %	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	3.112.212,95	0,72 %	6,93 %	22.407,93

FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	10.646.895/0001-90	IMA-B	6.047.790,50	0,72 %	6,93 %	43.544,09
FUNDO DE INVESTIMENTO SECURITY REFERENCIADO DI LONGO PRAZO CRÉDITO PRIVADO	09.315.625/0001-17	CREDITO PRIVADO	960.790,06	2,48 %	26,64 %	23.827,59
NTN-F20170101	34.327.635/0001-10	NTN-F	0,00	0,00 %	0,00 %	0,00

RISCO DE MERCADO	
<b>Saldo Total:</b>	R\$ 245.505.957,87
<b>Provisão para perda e Investimentos:</b>	R\$ 512.598,96
<b>% Provisão de Perda:</b>	0,209%
<b>Percentual aceitável:</b>	2,00%
<b>Espaço para utilização:</b>	<b>89,56%</b>

# CAPITAL PROTEGIDO

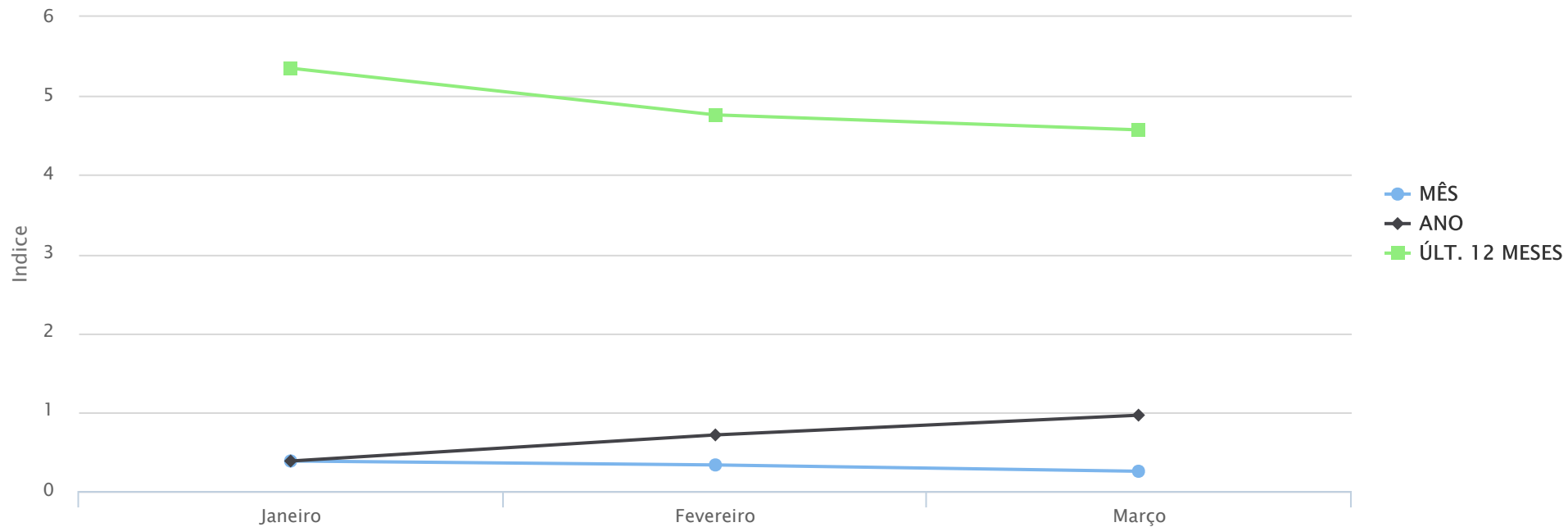
TIPO DE PRODUTO E PERCENTUAL DO CAPITAL INVESTIDO PROTEGIDO	
TIPO DE PRODUTO	PERCENTUAL DO CAPITAL
INVESTIDO PROTEGIDO	INVESTIDO PROTEGIDO (Até)
Títulos Públicos Federais/ Carteira Própria	100%
Fundos de Investimento Referenciado e Renda Fixa 100% Títulos Públicos Federais (previsto no regulamento do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

2017

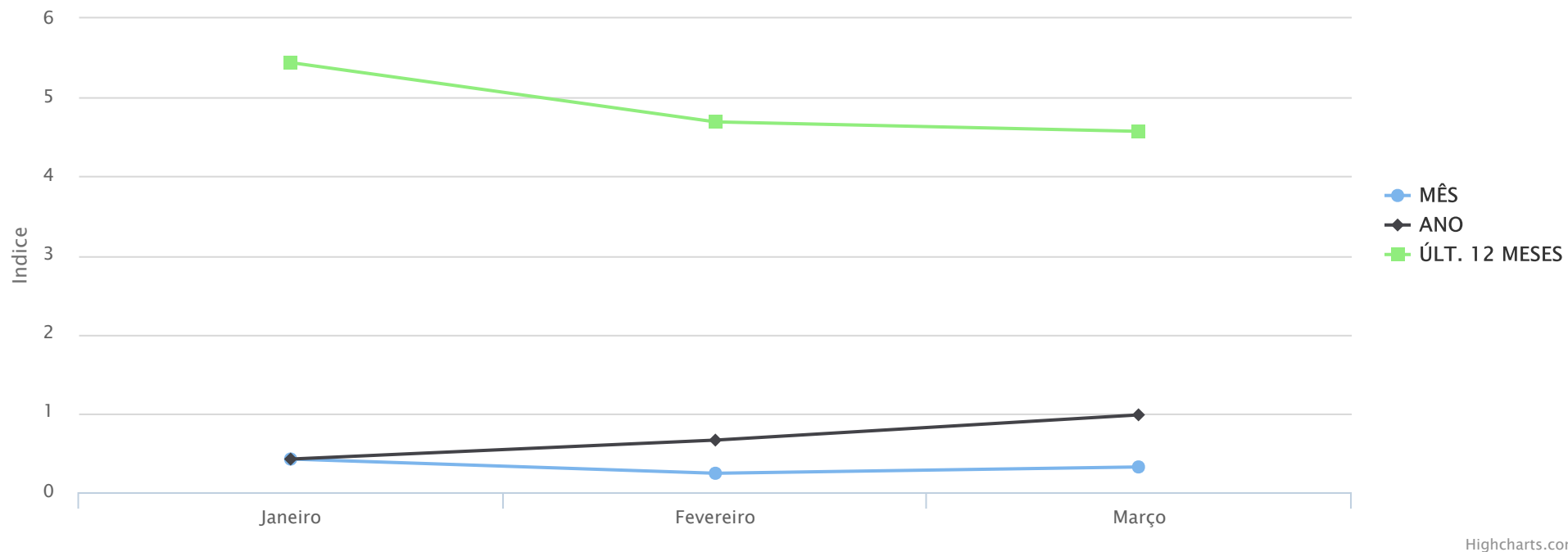


Highcharts.com

2017	Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Mai	Junho	Julho	Agosto	Setembro	Outubro	Novembro	Dezembro
MÊS	0.3800	0.3300	0.2500									
ANO	0.3800	0.7100	0.9600									
ULT. 12 M	5.3500	4.7600	4.5700									

# INPC

2017

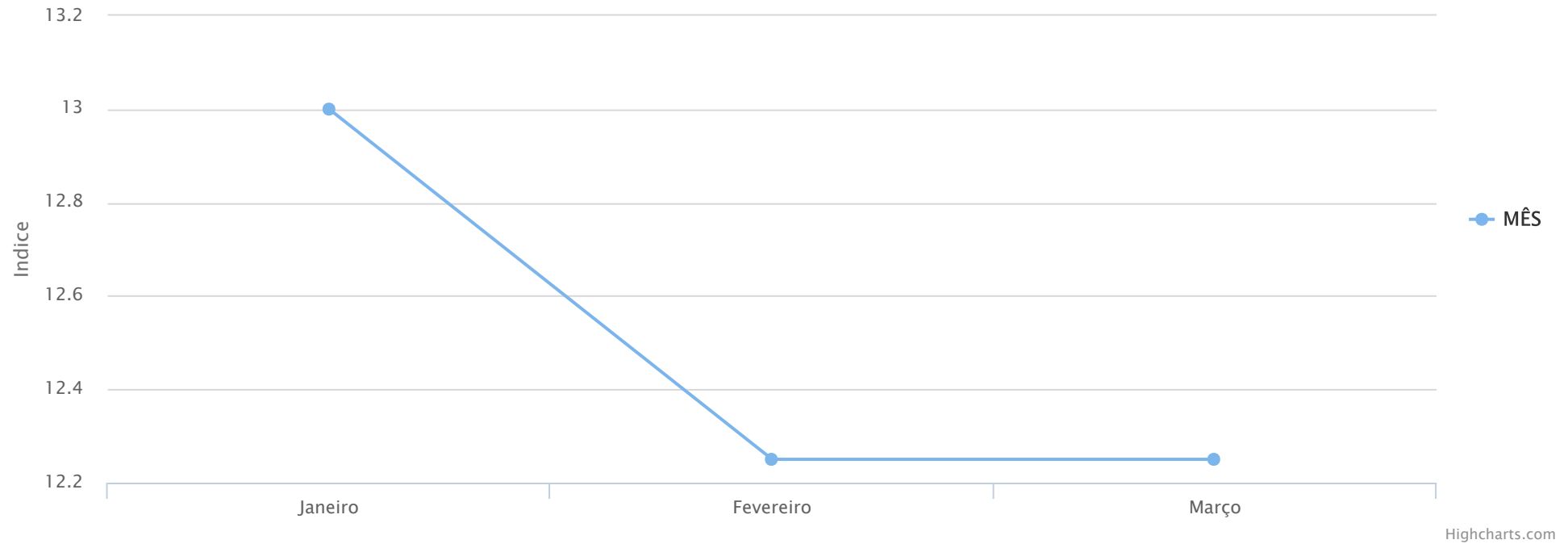


Highcharts.com

2017	Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Maió	Junho	Julho	Agosto	Setembro	Outubro	Novembro	Dezembro
MÊS	0.42	0.24	0.32									
ANO	0.42	0.66	0.98									
ULT. 12 M	5.44	4.69	4.57									

# SELIC

2017



Highcharts.com

Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Maior	Junho	Julho	Agosto	Setembro	Outubro	Novembro	Dezembro
13.00	12.25	12.25									



## CADPREV

<b>Renda Fixa</b>		Tipo de Fundo: IMA-B
Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	CNPJ: 78.615.540/0012-2	Saldo em 03/2017: R\$ 17.114.182,72
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\$ 3,756140757	Quantidade de Cotas: 4.556.320,9228	PL do Fundo: R\$ 1.303.474.709,01
% do PL do Fundo: 1,31%	Limite Cumulativo: 6,97%	Limite do Fundo: 80%

<b>Renda Fixa</b>		Tipo de Fundo: IRF-M1
Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	CNPJ: 11.328.882/0001-35	Saldo em 03/2017: R\$ 49.957.085,68
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\$ 2,160446000	Quantidade de Cotas: 23.123.505,8317	PL do Fundo: R\$ 9.030.435.490,32
% do PL do Fundo: 0,55%	Limite Cumulativo: 20,35%	Limite do Fundo: 100%

<b>Renda Fixa</b>		Tipo de Fundo: CDI
Fundo: BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO DI PREMIUM	CNPJ: 33.994.110/0019-0	Saldo em 03/2017: R\$ 693.711,14
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\$ 9,981844700	Quantidade de Cotas: 69.497,2884	PL do Fundo: R\$ 7.549.648.257,31
% do PL do Fundo: 0,01%	Limite Cumulativo: 0,28%	Limite do Fundo: 30%

<b>Renda Fixa</b>		Tipo de Fundo: CDI
Fundo: BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO DI PREMIUM	CNPJ: 33.994.110/0019-0	Saldo em 03/2017: R\$ 10.947.462,91
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\$ 9,981844700	Quantidade de Cotas: 1.096.737,4507	PL do Fundo: R\$ 7.549.648.257,31
% do PL do Fundo: 0,15%	Limite Cumulativo: 4,46%	Limite do Fundo: 30%

<b>Renda Fixa</b>		Tipo de Fundo: CREDITO PRIVADO
-------------------	--	--------------------------------

Fundo: FIC FI LONGO PRAZO RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	CNPJ: 95.869.550/0014-7	Saldo em 03/2017: R\$ 11.853.569,60
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\$ 1,185696000	Quantidade de Cotas: 9.997.140,5824	PL do Fundo: R\$ 19.525.482,48
% do PL do Fundo: 60,71%	Limite Cumulativo: 4,83%	Limite do Fundo: 5%

<b>Renda Fixa</b>		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 03/2017: R\$ 4.452.807,97
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\$ 2,158237000	Quantidade de Cotas: 2.063.169,1376	PL do Fundo: R\$ 1.275.678.677,48
% do PL do Fundo: 0,35%	Limite Cumulativo: 1,81%	Limite do Fundo: 100%

<b>Renda Fixa</b>		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 03/2017: R\$ 2.032.724,25
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\$ 2,241665000	Quantidade de Cotas: 906.792,1612	PL do Fundo: R\$ 5.761.023.230,35
% do PL do Fundo: 0,04%	Limite Cumulativo: 0,83%	Limite do Fundo: 100%

<b>Renda Fixa</b>		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 03/2017: R\$ 13.741.005,42
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\$ 2,390020000	Quantidade de Cotas: 5.749.326,5412	PL do Fundo: R\$ 5.954.581.114,26
% do PL do Fundo: 0,23%	Limite Cumulativo: 5,60%	Limite do Fundo: 100%

<b>Renda Fixa</b>		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 03/2017: R\$ 8.286.954,93
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\$ 2,390020000	Quantidade de Cotas: 3.467.316,1438	PL do Fundo: R\$ 5.954.581.114,26

% do PL do Fundo: 0,14%	Limite Cumulativo: 3,38%	Limite do Fundo: 100%
-------------------------	--------------------------	-----------------------

<b>Renda Fixa</b>		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 03/2017: R\$ 7.054.219,34
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\$ 2,390020000	Quantidade de Cotas: 2.951.531,5102	PL do Fundo: R\$ 5.954.581.114,26
% do PL do Fundo: 0,12%	Limite Cumulativo: 2,87%	Limite do Fundo: 100%

<b>Renda Fixa</b>		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 03/2017: R\$ 13.552.718,80
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\$ 2,065277000	Quantidade de Cotas: 6.562.179,6979	PL do Fundo: R\$ 11.724.254.123,84
% do PL do Fundo: 0,12%	Limite Cumulativo: 5,52%	Limite do Fundo: 100%

<b>Renda Fixa</b>		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 03/2017: R\$ 54.500.016,46
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\$ 2,065277000	Quantidade de Cotas: 26.388.719,9925	PL do Fundo: R\$ 11.724.254.123,84
% do PL do Fundo: 0,46%	Limite Cumulativo: 22,20%	Limite do Fundo: 100%

<b>Renda Fixa</b>		Tipo de Fundo: CDI
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	CNPJ: 37.372.060/0019-7	Saldo em 03/2017: R\$ 19.860.107,34
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\$ 3,047606000	Quantidade de Cotas: 6.516.625,6202	PL do Fundo: R\$ 6.226.798.118,69
% do PL do Fundo: 0,32%	Limite Cumulativo: 8,09%	Limite do Fundo: 30%

<b>Renda Fixa</b>		Tipo de Fundo: CDI
-------------------	--	--------------------

Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CNPJ: 51.643.560/0018-4	Saldo em 03/2017: R\$ 12.553.465,49
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\$ 3,296762000	Quantidade de Cotas: 3.807.816,7274	PL do Fundo: R\$ 1.910.326.544,74
% do PL do Fundo: 0,66%	Limite Cumulativo: 5,11%	Limite do Fundo: 30%

<b>Renda Fixa</b>		Tipo de Fundo: CDI
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CNPJ: 51.643.560/0018-4	Saldo em 03/2017: R\$ 8.785.132,31
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\$ 3,296762000	Quantidade de Cotas: 2.664.776,0166	PL do Fundo: R\$ 1.910.326.544,74
% do PL do Fundo: 0,46%	Limite Cumulativo: 3,58%	Limite do Fundo: 30%

<b>Renda Fixa</b>		Tipo de Fundo: CDI
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	CNPJ: 51.643.560/0018-4	Saldo em 03/2017: 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\$ 3,296762000	Quantidade de Cotas: 0,0000	PL do Fundo: R\$ 1.910.326.544,74
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,00%	Limite do Fundo: 30%

<b>Renda Fixa</b>		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 03/2017: R\$ 3.112.212,95
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\$ 2,547786000	Quantidade de Cotas: 1.221.536,2475	PL do Fundo: R\$ 2.562.643.492,65
% do PL do Fundo: 0,12%	Limite Cumulativo: 1,27%	Limite do Fundo: 80%

<b>Renda Fixa</b>		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 03/2017: R\$ 6.047.790,50
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\$ 2,547786000	Quantidade de Cotas: 2.373.743,5169	PL do Fundo: R\$ 2.562.643.492,65

% do PL do Fundo: 0,24%	Limite Cumulativo: 2,46%	Limite do Fundo: 80%
-------------------------	--------------------------	----------------------

<b>Renda Fixa</b>		Tipo de Fundo: CREDITO PRIVADO
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO SECURITY REFERENCIADO DI LONGO PRAZO CRÉDITO PRIVADO	CNPJ: 93.156.250/0011-7	Saldo em 03/2017: R\$ 960.790,06
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\$ 0,192376530	Quantidade de Cotas: 4.994.320,5650	PL do Fundo: R\$ 10.868.930,59
% do PL do Fundo: 8,84%	Limite Cumulativo: 0,39%	Limite do Fundo: 5%

<b>Renda Fixa</b>		Tipo de Fundo: NTN-F
Fundo: NTN-F20170101	CNPJ: 34.327.635/0001-10	Saldo em 03/2017: 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\$ 245.505.957,87**

## 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	12.814.359,66	5,22	1.051,34	12.815.411,00	5,22
MULTIMERCADO	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
GERAL	4.452.807,97	1,81	-9.150,13	4.443.657,84	1,81
IPCA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IMA-B	55.356.365,86	22,55	-30.805.770,07	24.550.595,79	10,00
IMA-B 5	2.032.724,25	0,83	22.517.871,54	24.550.595,79	10,00
IMA-B 5+	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IDKA 2	0,00	0,00	49.101.191,57	49.101.191,57	20,00
IDKA 20	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IRF-M	0,00	0,00	24.550.595,79	24.550.595,79	10,00
IRF-M1	118.009.820,94	48,07	-44.358.033,58	73.651.787,36	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	52.839.879,19	21,52	-20.997.756,45	31.842.122,74	12,97
TOTAL:	245.505.957,87	100,00		245.505.957,87	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	12.814.359,66	5,22	1.051,34	12.815.411,00	5,22
MULTIMERCADO	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
GERAL	4.452.807,97	1,81	-9.150,13	4.443.657,84	1,81
IPCA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IMA-B	55.356.365,86	22,55	-18.530.472,18	36.825.893,68	15,00
IMA-B 5	2.032.724,25	0,83	34.793.169,43	36.825.893,68	15,00
IMA-B 5+	0,00	0,00	24.550.595,79	24.550.595,79	10,00
IDKA 2	0,00	0,00	24.550.595,79	24.550.595,79	10,00
IDKA 20	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IRF-M	0,00	0,00	49.101.191,57	49.101.191,57	20,00
IRF-M1	118.009.820,94	48,07	-93.459.225,15	24.550.595,79	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	52.839.879,19	21,52	-20.997.756,45	31.842.122,74	12,97
TOTAL:	245.505.957,87	100,00		245.505.957,87	100,00

*Kenzo Leonardo Di Blasi*

DI BLASI CONSULTORIA FINANCEIRA LTDA

CNPJ 03.866.812/0001-02

CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS HABILITADA PELA COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS - CVM