INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE ESPIGÃO DO OESTE

CNPJ 63.761.126/0001-07

**RELATÓRIO TRIMESTRAL DE INVESTIMENTOS**

**SEGUNDO TRIMESTRE**

**2018**

1. RENTABILIDADE VERSUS META ATUARIAL

A rentabilidade média da carteira é obtida através da média ponderada da rentabilidade dos fundos pelo seu respectivo peso na carteira.

A seguir iremos apresentar os investimentos mensalmente comparando sua rentabilidade com a meta atuarial.

* 1. ABRIL

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **ABRIL 2018** | | | | | | |
| **Fundo** | **Aplicação** | **Rentab.** | **CDI** | **%CDI** | **Meta**  **Atuarial** | **%Meta**  **Atuarial** |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA  PREVIDENCIÁRIO | R$ 2.273.979,58 | 0,69% | 0,52% | 133,48% | 0,71% | 97,59% |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA  PREVIDENCIÁRIO | R$ 0,00 | -0,15% | 0,52% | -29,06% | 0,71% | -21,25% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA  FIXA PREVIDENCIÁRIO | R$ 3.035.903,69 | 0,48% | 0,52% | 92,75% | 0,71% | 67,82% |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA  PREVIDENCIÁRIO | R$ 2.240.385,37 | 0,43% | 0,52% | 82,63% | 0,71% | 60,42% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | R$ 551.589,58 | 0,52% | 0,52% | 100,02% | 0,71% | 73,13% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TP FIC  RENDA FIXA | R$ 5.722.748,59 | -0,16% | 0,52% | -31,69% | 0,71% | -23,17% |
| BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI  RENDA FIXA | R$ 11.460.055,47 | 0,50% | 0,52% | 95,68% | 0,71% | 69,96% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI  RENDA FIXA LP | R$ 4.705.189,54 | -0,16% | 0,52% | -30,99% | 0,71% | -22,66% |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA  CRÉDITO PRIVADO | R$ 1.707.444,00 | 0,44% | 0,52% | 84,59% | 0,71% | 61,85% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI  RENDA FIXA | R$ 10.378.797,42 | 0,49% | 0,52% | 94,28% | 0,71% | 68,94% |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI  RENDA FIXA LP | R$ 9.121.086,85 | 0,36% | 0,52% | 68,72% | 0,71% | 50,24% |
| **TOTAL** | **R$ 51.197.180,09** | **0,34%** | **0,52%** | **64,78%** | **0,71%** | **47,37%** |

* 1. **MAIO**

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **MAIO 2018** | | | | | | |
| **Fundo** | **Aplicação** | **Rentab.** | **CDI** | **%CDI** | **Meta**  **Atuarial** | **%Meta**  **Atuarial** |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA  PREVIDENCIÁRIO | R$ 2.254.779,26 | -0,84% | 0,52% | -163,15% | 0,89% | -95,00% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA  FIXA PREVIDENCIÁRIO | R$ 3.041.413,69 | 0,18% | 0,52% | 35,07% | 0,89% | 20,42% |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA  PREVIDENCIÁRIO | R$ 2.198.784,94 | -1,86% | 0,52% | -358,80% | 0,89% | -208,93% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | R$ 554.389,63 | 0,51% | 0,52% | 98,08% | 0,89% | 57,11% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TP FIC  RENDA FIXA | R$ 5.538.813,65 | -3,21% | 0,52% | -621,07% | 0,89% | -361,64% |
| BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI  RENDA FIXA | R$ 11.479.173,72 | 0,17% | 0,52% | 32,24% | 0,89% | 18,77% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI  RENDA FIXA LP | R$ 4.555.740,95 | -3,18% | 0,52% | -613,75% | 0,89% | -357,38% |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA  CRÉDITO PRIVADO | R$ 1.693.551,60 | -0,81% | 0,52% | -157,22% | 0,89% | -91,55% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI  RENDA FIXA | R$ 10.398.707,71 | 0,19% | 0,52% | 37,07% | 0,89% | 21,58% |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI  RENDA FIXA LP | R$ 9.124.241,29 | -1,91% | 0,52% | -369,76% | 0,89% | -215,31% |
| **TOTAL** | **R$ 50.839.596,44** | **-0,70%** | **0,52%** | **-134,96%** | **0,89%** | **-78,59%** |

* 1. **JUNHO**

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **JUNHO 2018** | | | | | | |
| **Fundo** | **Aplicação** | **Rentab.** | **CDI** | **%CDI** | **Meta**  **Atuarial** | **%Meta**  **Atuarial** |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA  PREVIDENCIÁRIO | R$ 2.331.997,35 | 0,29% | 0,52% | 55,59% | 1,75% | 16,41% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA  FIXA PREVIDENCIÁRIO | R$ 3.056.614,42 | 0,50% | 0,52% | 96,57% | 1,75% | 28,51% |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA  PREVIDENCIÁRIO | R$ 2.199.106,11 | 0,01% | 0,52% | 2,82% | 1,75% | 0,83% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | R$ 557.167,41 | 0,50% | 0,52% | 96,83% | 1,75% | 28,59% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TP FIC  RENDA FIXA | R$ 5.518.796,63 | -0,36% | 0,52% | -69,83% | 1,75% | -20,62% |
| BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI  RENDA FIXA | R$ 11.537.015,02 | 0,50% | 0,52% | 97,37% | 1,75% | 28,75% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI  RENDA FIXA LP | R$ 4.539.344,94 | -0,36% | 0,52% | -69,54% | 1,75% | -20,53% |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA  CRÉDITO PRIVADO | R$ 1.696.441,20 | 0,17% | 0,52% | 32,97% | 1,75% | 9,73% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI  RENDA FIXA | R$ 10.450.325,17 | 0,50% | 0,52% | 95,92% | 1,75% | 28,32% |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI  RENDA FIXA LP | R$ 9.127.362,16 | 0,03% | 0,52% | 6,61% | 1,75% | 1,95% |
| **TOTAL** | **R$ 51.014.170,41** | **0,21%** | **0,52%** | **39,69%** | **1,75%** | **11,72%** |

1. **RENTABILIDADE VERSUS META ATUARIAL NO TRIMESTRE**

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **RENTABILIDADE TRIMESTRAL DE ABRIL A JUNHO DE 2018** | | | | | | | | |
| **Fundo** | **ABR** | **MAI** | **JUN** | **Acum.** | **CDI**  **Acum.** | **%CDI** | **Meta**  **Acum.** | **%Meta**  **Atuarial** |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA  FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,69% | -0,84% | 0,29% | 0,13% | 1,56% | 8,19% | 3,38% | 3,78% |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA  FIXA PREVIDENCIÁRIO | -0,15% | n.d. | n.d. | -0,15% | 0,52% | -29,06% | 0,71% | -21,25% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA  FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,48% | 0,18% | 0,50% | 1,17% | 1,56% | 74,68% | 3,38% | 34,44% |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA  FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,43% | -1,86% | 0,01% | -1,42% | 1,56% | -91,17% | 3,38% | -42,05% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA  PREVIDENCIÁRIO | 0,52% | 0,51% | 0,50% | 1,53% | 1,56% | 98,30% | 3,38% | 45,34% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TP FIC  RENDA FIXA | -0,16% | -3,21% | -0,36% | -3,72% | 1,56% | -238,50% | 3,38% | -110,00% |
| BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI  RENDA FIXA | 0,50% | 0,17% | 0,50% | 1,17% | 1,56% | 74,97% | 3,38% | 34,58% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI  RENDA FIXA LP | -0,16% | -3,18% | -0,36% | -3,68% | 1,56% | -235,77% | 3,38% | -108,74% |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA  CRÉDITO PRIVADO | 0,44% | -0,81% | 0,17% | -0,21% | 1,56% | -13,42% | 3,38% | -6,19% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS  FI RENDA FIXA | 0,49% | 0,19% | 0,50% | 1,18% | 1,56% | 75,64% | 3,38% | 34,89% |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI  RENDA FIXA LP | 0,36% | -1,91% | 0,03% | -1,53% | 1,56% | -98,11% | 3,38% | -45,25% |
| **TOTAL** | **0,34%** | **-0,70%** | **0,21%** | **-0,16%** | **1,56%** | **-10,31%** | **3,38%** | **-4,75%** |

Como pode ser observado pela tabela acima a rentabilidade no acumulado do trimestre ficou em -0,16% enquanto que a meta acumulada ficou em 3,38%, ou seja, o Instituto atingiu -4,75% da meta atuarial.

1. ENQUADRAMENTO

Os investimentos se subordinam ao permitido na legislação em vigor. Assim a cada mês fez-se a análise de enquadramento como abaixo demonstrado:

* 1. ABRIL

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **OBJETIVO DE ALOCAÇÃO DOS RECURSOS POR SEGMENTO DE APLICAÇÃO E CARTEIRA** | | | |
| **Alocação dos Recursos / Diversificação** | **Alocação dos Recursos** | | |
| **Limite da**  **Resolução** | **Enquadramento Atual** | **%** |
| **Renda Fixa - Art. 7º** | | | |
| Títulos Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I, "a" | 100% | R$ 0,00 | 0,00% |
| FI Referenciado 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b" | R$ 48.938.146,51 | 98,89% |
| Cotas FI , TN Negociada na Bolsa Art. 7º, I, "c" | R$ 0,00 | 0,00% |
| Operações Compromissadas - Art. 7º, II | 5% | R$ 0,00 | 0,00% |
| FI Cotas de Renda Fixa (Referenciado)- Art. 7º, III , "a" | 60% | R$ 0,00 | 0,00% |
| FI Cotas de Fundos de Índices RF Subíndices Anbima (Referenc.) - Art. 7º,III, "b" | R$ 0,00 | 0,00% |
| Cotas de Fundos FI de Renda fixa - Art. 7º, IV,"a" | 40% | R$ 551.589,58 | 1,11% |
| Cotas FI de Índices Renda Fixa - Art. 7º, IV, "b" | R$ 0,00 | 0,00% |
| Letras Imobiliárias Garantidas - Art. 7º, V, "b" | 20% | R$ 0,00 | 0,00% |
| Certificado de Bancário (CDB) , Art. 7º, VI, "a" | 15% | R$ 0,00 | 0,00% |
| Poupança - Art. 7º, VI, b | R$ 0,00 | 0,00% |
| FI em Direitos Creditórios - Classe Sênior - aberto, Art. 7º, VI, "a" | 5% | R$ 0,00 | 0,00% |
| Cotas FI Renda Fixa "Crédito Privado"- Art. 7º, VI, "b" | R$ 0,00 | 0,00% |
| Cotas FI Art. - Art. 7º, VII, "c" Lei 12.431- Debêntures | R$ 0,00 | 0,00% |
| **Renda Variável - Art. 8º** | | | |
| FI Ações Referenciados - Art. 8º, I, "a" | 30% | R$ 0,00 | 0,00% |
| FI Ações - Art. 8º, I, "b" ETF (Quaisquer Indices Abrangentes) | R$ 0,00 | 0,00% |
| FI Classificados Açoes - Art. 8º, II, "a" | 20% | R$ 0,00 | 0,00% |
| FI de Índices Classificados Ações - Art. 8º, II, "b" | R$ 0,00 | 0,00% |
| FI Multimercado - aberto - Art. 8º, III | 10% | R$ 0,00 | 0,00% |
| FI em Participações - fechado - Art. 8º,I V, "a" | 5% | R$ 0,00 | 0,00% |
| FI Imobiliário - cotas negociadas em bolsa - Art. 8º,IV, "b" | 5% | R$ 0,00 | 0,00% |
| Disponibilidades Financeiras |  | R$ 0,00 | 0,00% |
| **TOTAL GERAL** |  | **R$ 49.489.736,09** | **100,00%** |

* 1. **MAIO**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **OBJETIVO DE ALOCAÇÃO DOS RECURSOS POR SEGMENTO DE APLICAÇÃO E CARTEIRA** | | | |
| **Alocação dos Recursos / Diversificação** | **Alocação dos Recursos** | | |
| **Limite da**  **Resolução** | **Enquadramento Atual** | **%** |
| **Renda Fixa - Art. 7º** | | | |
| Títulos Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I, "a" | 100% | R$ 0,00 | 0,00% |
| FI Referenciado 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b" | R$ 48.591.655,21 | 98,87% |
| Cotas FI , TN Negociada na Bolsa Art. 7º, I, "c" | R$ 0,00 | 0,00% |
| Operações Compromissadas - Art. 7º, II | 5% | R$ 0,00 | 0,00% |
| FI Cotas de Renda Fixa (Referenciado)- Art. 7º, III , "a" | 60% | R$ 0,00 | 0,00% |
| FI Cotas de Fundos de Índices RF Subíndices Anbima (Referenc.) - Art. 7º,III, "b" | R$ 0,00 | 0,00% |
| Cotas de Fundos FI de Renda fixa - Art. 7º, IV,"a" | 40% | R$ 554.389,63 | 1,13% |
| Cotas FI de Índices Renda Fixa - Art. 7º, IV, "b" | R$ 0,00 | 0,00% |
| Letras Imobiliárias Garantidas - Art. 7º, V, "b" | 20% | R$ 0,00 | 0,00% |
| Certificado de Bancário (CDB) , Art. 7º, VI, "a" | 15% | R$ 0,00 | 0,00% |
| Poupança - Art. 7º, VI, b | R$ 0,00 | 0,00% |
| FI em Direitos Creditórios - Classe Sênior - aberto, Art. 7º, VI, "a" | 5% | R$ 0,00 | 0,00% |
| Cotas FI Renda Fixa "Crédito Privado"- Art. 7º, VI, "b" | R$ 0,00 | 0,00% |
| Cotas FI Art. - Art. 7º, VII, "c" Lei 12.431- Debêntures | R$ 0,00 | 0,00% |
| **Renda Variável - Art. 8º** | | | |
| FI Ações Referenciados - Art. 8º, I, "a" | 30% | R$ 0,00 | 0,00% |
| FI Ações - Art. 8º, I, "b" ETF (Quaisquer Indices Abrangentes) | R$ 0,00 | 0,00% |
| FI Classificados Açoes - Art. 8º, II, "a" | 20% | R$ 0,00 | 0,00% |
| FI de Índices Classificados Ações - Art. 8º, II, "b" | R$ 0,00 | 0,00% |
| FI Multimercado - aberto - Art. 8º, III | 10% | R$ 0,00 | 0,00% |
| FI em Participações - fechado - Art. 8º,I V, "a" | 5% | R$ 0,00 | 0,00% |
| FI Imobiliário - cotas negociadas em bolsa - Art. 8º,IV, "b" | 5% | R$ 0,00 | 0,00% |
| Disponibilidades Financeiras |  | R$ 0,00 | 0,00% |
| **TOTAL GERAL** |  | **R$ 49.146.044,84** | **100,00%** |

* 1. **JUNHO**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **OBJETIVO DE ALOCAÇÃO DOS RECURSOS POR SEGMENTO DE APLICAÇÃO E CARTEIRA** | | | |
| **Alocação dos Recursos / Diversificação** | **Alocação dos Recursos** | | |
| **Limite da**  **Resolução** | **Enquadramento Atual** | **%** |
| **Renda Fixa - Art. 7º** | | | |
| Títulos Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I, "a" | 100% | R$ 0,00 | 0,00% |
| FI Referenciado 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b" | R$ 48.760.561,80 | 98,87% |
| Cotas FI , TN Negociada na Bolsa Art. 7º, I, "c" | R$ 0,00 | 0,00% |
| Operações Compromissadas - Art. 7º, II | 5% | R$ 0,00 | 0,00% |
| FI Cotas de Renda Fixa (Referenciado)- Art. 7º, III , "a" | 60% | R$ 0,00 | 0,00% |
| FI Cotas de Fundos de Índices RF Subíndices Anbima (Referenc.) - Art. 7º,III, "b" | R$ 0,00 | 0,00% |
| Cotas de Fundos FI de Renda fixa - Art. 7º, IV,"a" | 40% | R$ 557.167,41 | 1,13% |
| Cotas FI de Índices Renda Fixa - Art. 7º, IV, "b" | R$ 0,00 | 0,00% |
| Letras Imobiliárias Garantidas - Art. 7º, V, "b" | 20% | R$ 0,00 | 0,00% |
| Certificado de Bancário (CDB) , Art. 7º, VI, "a" | 15% | R$ 0,00 | 0,00% |
| Poupança - Art. 7º, VI, b | R$ 0,00 | 0,00% |
| FI em Direitos Creditórios - Classe Sênior - aberto, Art. 7º, VI, "a" | 5% | R$ 0,00 | 0,00% |
| Cotas FI Renda Fixa "Crédito Privado"- Art. 7º, VI, "b" | R$ 0,00 | 0,00% |
| Cotas FI Art. - Art. 7º, VII, "c" Lei 12.431- Debêntures | R$ 0,00 | 0,00% |
| **Renda Variável - Art. 8º** | | | |
| FI Ações Referenciados - Art. 8º, I, "a" | 30% | R$ 0,00 | 0,00% |
| FI Ações - Art. 8º, I, "b" ETF (Quaisquer Indices Abrangentes) | R$ 0,00 | 0,00% |
| FI Classificados Açoes - Art. 8º, II, "a" | 20% | R$ 0,00 | 0,00% |
| FI de Índices Classificados Ações - Art. 8º, II, "b" | R$ 0,00 | 0,00% |
| FI Multimercado - aberto - Art. 8º, III | 10% | R$ 0,00 | 0,00% |
| FI em Participações - fechado - Art. 8º,I V, "a" | 5% | R$ 0,00 | 0,00% |
| FI Imobiliário - cotas negociadas em bolsa - Art. 8º,IV, "b" | 5% | R$ 0,00 | 0,00% |
| Disponibilidades Financeiras |  | R$ 0,00 | 0,00% |
| **TOTAL GERAL** |  | **R$ 49.317.729,21** | **100,00%** |

1. **GERENCIAMENTO DE RISCO**
   1. **ABRIL**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Fundo** | **Sharpe** | **VAR** |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,00% | 0,00% |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,00% | 0,00% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,00% | 0,00% |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,00% | 0,00% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,00% | 0,00% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TP FIC RENDA FIXA | 0,00% | 0,00% |
| BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,00% | 0,00% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,00% | 0,00% |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | 0,00% | 0,00% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,00% | 0,00% |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,00% | 0,00% |

* 1. **MAIO**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Fundo** | **Sharpe** | **VAR** |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,00% | 0,00% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,00% | 0,00% |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,00% | 0,00% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,00% | 0,00% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TP FIC RENDA FIXA | 0,00% | 0,00% |
| BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,00% | 0,00% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,00% | 0,00% |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | 0,00% | 0,00% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,00% | 0,00% |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,00% | 0,00% |

* 1. **JUNHO**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Fundo** | **Sharpe** | **VAR** |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,00% | 0,00% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,00% | 0,00% |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,00% | 0,00% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,00% | 0,00% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TP FIC RENDA FIXA | 0,00% | 0,00% |
| BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,00% | 0,00% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,00% | 0,00% |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | 0,00% | 0,00% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,00% | 0,00% |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,00% | 0,00% |

1. **GERENCIAMENTO DE RISCO NO TRIMESTRE**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Fundo** | **ABR** | **MAI** | **JUN** |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,00% | n.d. | n.d. |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TP FIC RENDA FIXA | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,00% | 0,00% | 0,00% |