INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE ESPIGÃO DO OESTE

CNPJ 63.761.126/0001-07

**RELATÓRIO TRIMESTRAL DE INVESTIMENTOS**

**QUARTO 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. OUTUBRO

|  |
| --- |
| **OUTUBRO 2018** |
| **Fundo** | **Aplicação** | **Rentab.** | **CDI** | **%CDI** | **Meta****Atuarial** | **%Meta****Atuarial** |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXAPREVIDENCIÁRIO | R$ 2.724.089,33 | 2,09% | 0,54% | 384,82% | 0,94% | 222,58% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDAFIXA PREVIDENCIÁRIO | R$ 3.136.714,92 | 0,93% | 0,54% | 172,15% | 0,94% | 99,57% |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXAPREVIDENCIÁRIO | R$ 2.318.891,89 | 3,58% | 0,54% | 659,61% | 0,94% | 381,52% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | R$ 536.237,15 | 0,53% | 0,54% | 97,74% | 0,94% | 56,53% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TP FICRENDA FIXA | R$ 1.318.625,93 | 7,10% | 0,54% | 1.306,96% | 0,94% | 755,94% |
| BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIRENDA FIXA | R$ 16.849.055,06 | 0,90% | 0,54% | 165,89% | 0,94% | 95,95% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIRENDA FIXA LP | R$ 901.853,17 | 7,16% | 0,54% | 1.318,58% | 0,94% | 762,66% |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXACRÉDITO PRIVADO | R$ 1.772.336,40 | 2,06% | 0,54% | 378,44% | 0,94% | 218,89% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIRENDA FIXA | R$ 14.922.513,84 | 0,94% | 0,54% | 172,19% | 0,94% | 99,60% |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FIRENDA FIXA LP | R$ 9.638.417,30 | 3,86% | 0,54% | 710,21% | 0,94% | 410,78% |
| **TOTAL** | **R$ 54.118.734,99** | **2,75%** | **0,54%** | **505,59%** | **0,94%** | **292,43%** |

* 1. **NOVEMBRO**

|  |
| --- |
| **NOVEMBRO 2018** |
| **Fundo** | **Aplicação** | **Rentab.** | **CDI** | **%CDI** | **Meta****Atuarial** | **%Meta****Atuarial** |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXAPREVIDENCIÁRIO | R$ 2.727.046,76 | 0,11% | 0,49% | 22,00% | 0,28% | 39,38% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDAFIXA PREVIDENCIÁRIO | R$ 3.153.041,50 | 0,52% | 0,49% | 105,47% | 0,28% | 188,81% |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXAPREVIDENCIÁRIO | R$ 2.341.617,94 | 0,98% | 0,49% | 198,57% | 0,28% | 355,49% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | R$ 538.856,71 | 0,49% | 0,49% | 98,98% | 0,28% | 177,20% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TP FICRENDA FIXA | R$ 1.330.190,70 | 0,88% | 0,49% | 177,70% | 0,28% | 318,12% |
| BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIRENDA FIXA | R$ 16.937.414,93 | 0,52% | 0,49% | 106,25% | 0,28% | 190,22% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIRENDA FIXA LP | R$ 1.143.081,06 | 0,90% | 0,49% | 181,88% | 0,28% | 325,61% |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXACRÉDITO PRIVADO | R$ 1.774.461,60 | 0,12% | 0,49% | 24,30% | 0,28% | 43,49% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIRENDA FIXA | R$ 15.001.356,01 | 0,53% | 0,49% | 107,05% | 0,28% | 191,65% |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FIRENDA FIXA LP | R$ 9.734.157,26 | 0,99% | 0,49% | 201,26% | 0,28% | 360,30% |
| **TOTAL** | **R$ 54.681.224,47** | **0,61%** | **0,49%** | **123,95%** | **0,28%** | **221,91%** |

* 1. **DEZEMBRO**

|  |
| --- |
| **DEZEMBRO 2018** |
| **Fundo** | **Aplicação** | **Rentab.** | **CDI** | **%CDI** | **Meta****Atuarial** | **%Meta****Atuarial** |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXAPREVIDENCIÁRIO | R$ 2.760.388,94 | 1,22% | 0,49% | 247,72% | 0,64% | 191,79% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDAFIXA PREVIDENCIÁRIO | R$ 3.169.942,30 | 0,54% | 0,49% | 108,60% | 0,64% | 84,08% |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXAPREVIDENCIÁRIO | R$ 3.188.422,21 | 1,51% | 0,49% | 306,41% | 0,64% | 237,22% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | R$ 707.538,87 | 0,47% | 0,49% | 94,84% | 0,64% | 73,42% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TP FICRENDA FIXA | R$ 11.532.040,60 | 1,62% | 0,49% | 328,97% | 0,64% | 254,69% |
| BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIRENDA FIXA | R$ 6.979.871,28 | 0,54% | 0,49% | 109,13% | 0,64% | 84,49% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIRENDA FIXA LP | R$ 11.633.812,39 | 1,63% | 0,49% | 330,17% | 0,64% | 255,62% |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXACRÉDITO PRIVADO | R$ 0,00 | 1,17% | 0,49% | 237,67% | 0,64% | 184,01% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIRENDA FIXA | R$ 6.539.193,29 | 0,54% | 0,49% | 109,89% | 0,64% | 85,07% |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FIRENDA FIXA LP | R$ 9.877.966,61 | 1,48% | 0,49% | 299,33% | 0,64% | 231,75% |
| **TOTAL** | **R$ 56.389.176,49** | **1,32%** | **0,49%** | **267,19%** | **0,64%** | **206,86%** |

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

|  |
| --- |
| **RENTABILIDADE TRIMESTRAL DE OUTUBRO A DEZEMBRO DE 2018** |
| **Fundo** | **OUT** | **NOV** | **DEZ** | **Acum.** | **CDI****Acum.** | **%CDI** | **Meta****Acum.** | **%Meta****Atuarial** |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDAFIXA PREVIDENCIÁRIO | 2,09% | 0,11% | 1,22% | 3,45% | 1,54% | 224,33% | 1,86% | 185,25% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDAFIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,93% | 0,52% | 0,54% | 2,00% | 1,54% | 130,31% | 1,86% | 107,61% |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDAFIXA PREVIDENCIÁRIO | 3,58% | 0,98% | 1,51% | 6,18% | 1,54% | 401,76% | 1,86% | 331,77% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXAPREVIDENCIÁRIO | 0,53% | 0,49% | 0,47% | 1,49% | 1,54% | 97,19% | 1,86% | 80,26% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TP FICRENDA FIXA | 7,10% | 0,88% | 1,62% | 9,79% | 1,54% | 636,61% | 1,86% | 525,71% |
| BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIRENDA FIXA | 0,90% | 0,52% | 0,54% | 1,98% | 1,54% | 128,50% | 1,86% | 106,12% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIRENDA FIXA LP | 7,16% | 0,90% | 1,63% | 9,88% | 1,54% | 642,69% | 1,86% | 530,73% |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXACRÉDITO PRIVADO | 2,06% | 0,12% | 1,17% | 3,38% | 1,54% | 219,51% | 1,86% | 181,27% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOSFI RENDA FIXA | 0,94% | 0,53% | 0,54% | 2,02% | 1,54% | 131,26% | 1,86% | 108,39% |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FIRENDA FIXA LP | 3,86% | 0,99% | 1,48% | 6,44% | 1,54% | 418,60% | 1,86% | 345,68% |
| **TOTAL** | **2,75%** | **0,61%** | **1,32%** | **4,74%** | **1,54%** | **308,03%** | **1,86%** | **254,37%** |

Como pode ser observado pela tabela acima a rentabilidade no acumulado do trimestre ficou em 4,74% enquanto que a meta acumulada ficou em 1,86%, ou seja, o Instituto atingiu 254,37% 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. OUTUBRO

|  |
| --- |
| **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$ 51.810.161,44 | 98,98% |
| 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$ 536.237,15 | 1,02% |
| 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$ 52.346.398,59** | **100,00%** |

* 1. **NOVEMBRO**

|  |
| --- |
| **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$ 52.367.906,16 | 98,98% |
| 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$ 538.856,71 | 1,02% |
| 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$ 52.906.762,87** | **100,00%** |

* 1. **DEZEMBRO**

|  |
| --- |
| **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$ 55.681.637,62 | 98,75% |
| 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$ 707.538,87 | 1,25% |
| 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$ 56.389.176,49** | **100,00%** |

1. **GERENCIAMENTO DE RISCO**
	1. **OUTUBRO**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Fundo** | **Sharpe** | **VAR** |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,53% | 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 | 0,93% | 0,01% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,00% | 0,00% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TP FIC RENDA FIXA | 1,32% | 0,01% |
| BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,00% | 0,00% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,37% | 0,01% |
| 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 | 1,01% | 0,01% |

* 1. **NOVEMBRO**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Fundo** | **Sharpe** | **VAR** |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,79% | 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 | 1,77% | 0,01% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,00% | 0,00% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TP FIC RENDA FIXA | 1,74% | 0,01% |
| BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,00% | 0,00% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,80% | 0,01% |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | 0,02% | 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 | 1,81% | 0,01% |

* 1. **DEZEMBRO**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Fundo** | **Sharpe** | **VAR** |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 3,54% | 0,01% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,90% | 0,00% |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 3,02% | 0,01% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,00% | 0,00% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TP FIC RENDA FIXA | 2,48% | 0,01% |
| BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1,72% | 0,00% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 2,54% | 0,01% |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | 1,76% | 0,00% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 2,21% | 0,00% |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 2,97% | 0,01% |

1. **GERENCIAMENTO DE RISCO NO TRIMESTRE**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Fundo** | **OUT** | **NOV** | **DEZ** |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,53% | 1,79% | 3,54% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,00% | 0,00% | 1,90% |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,93% | 1,77% | 3,02% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TP FIC RENDA FIXA | 1,32% | 1,74% | 2,48% |
| BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,00% | 0,00% | 1,72% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,37% | 1,80% | 2,54% |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | 0,00% | 0,02% | 1,76% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,00% | 0,00% | 2,21% |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,01% | 1,81% | 2,97% |