

## Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2018



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.



FUNDO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE FELIZ - FPSM  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 28/02/2018

Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			228.879,90	0,74%			Artigo 20
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	D+1	Não há	4.095.967,57	13,29%	283	1,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	3.001.162,86	9,74%	180	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	365.675,82	1,19%	107	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	D+0	15/08/2024	643.515,00	2,09%	96	0,57%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	896.342,25	2,91%	223	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2018	1.305.342,00	4,24%	163	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	852.857,34	2,77%	94	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	521.931,20	1,69%	18	0,95%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	788.595,14	2,56%	143	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	253.727,83	0,82%	192	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.052.108,25	13,15%	95	2,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+0	Não há	2.074.389,06	6,73%	310	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	4.852.655,97	15,75%	733	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	436.013,50	1,41%	25	0,35%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+0	Não há	110.323,11	0,36%	126	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.038.154,67	9,86%	236	0,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BANRISUL ÍNDICE FI AÇÕES	D+4	Não há	75.875,91	0,25%	422	0,66%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB PETROBRAS FI AÇÕES	D+4	Não há	46.287,98	0,15%	54.437	0,01%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BANRISUL INFRA-ESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	33.088,76	0,11%	571	0,31%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	894.909,47	2,90%	43	0,76%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
GERAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	150.504,32	0,49%	93	0,12%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "



FUNDO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE FELIZ - FPSM  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 28/02/2018

Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2018)

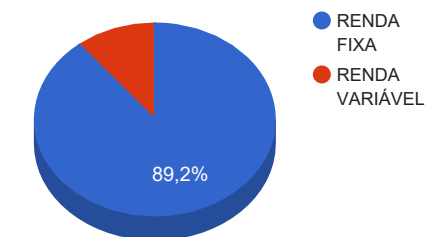
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	551.855,57	1,79%	113	0,15%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	156.134,45	0,51%	33	0,27%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB CONSUMO FIC AÇÕES	D+4	Não há	66.407,03	0,22%	3.040	0,05%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRS PARTICIPAÇÕES FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	4 anos	141.869,75	0,46%	33	0,13%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	506.902,50	1,64%	729	0,20%	Artigo 8º, Inciso III
AGÊNCIAS CAIXA FII - AGCX11	Não se aplica	Não se aplica	128.000,00	0,42%		0,02%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
BANRISUL NOVAS FRONTEIRAS FII - BNFS11	Não se aplica	Não se aplica	436.135,00	1,42%		0,52%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	113.800,00	0,37%		0,06%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
		<b>TOTAL -</b>	<b>30.819.412,21</b>				



Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (fevereiro / 2018)

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	12.725.117,01	41,29%	25,00%	35,00%	60,00%	5.766.530,32
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.540.970,61
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	15,00%	35,00%	50,00%	15.409.706,11
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	14.563.644,56	47,25%	5,00%	20,00%	30,00%	-5.317.820,90
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>27.288.761,57</b>	<b>88,54%</b>	<b>45,00</b>	<b>95,00</b>	<b>245,00</b>	<b>-</b>

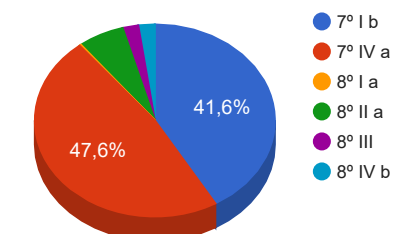
Distribuição por Segmento



**⚠** O Somatório dos incisos "a" e "b" do Artigo 7º IV não podem ultrapassar 40% (quarenta por cento).

Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	75.875,91	0,25%	0,00%	0,00%	5,00%	1.465.094,70
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	1.899.187,58	6,16%	0,00%	0,00%	5,00%	-358.216,97
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	648.772,25	2,11%	5,00%	8,00%	10,00%	2.433.168,97
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	1.540.970,61
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	677.935,00	2,20%	0,00%	2,00%	5,00%	863.035,61
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>3.301.770,74</b>	<b>10,71%</b>	<b>5,00</b>	<b>12,00</b>	<b>40,00</b>	<b>-</b>

Distribuição por Artigo / Resolução





Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: fevereiro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	12.725.117,01	41,29%	25,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	15,00%	50,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	50,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	14.563.644,56	47,25%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>27.288.761,57</b>	<b>88,54%</b>	<b>45,00</b>	<b>245,00</b>

Artigos - Renda Variável	Base: fevereiro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	75.875,91	0,25%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	1.899.187,58	6,16%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso III	648.772,25	2,11%	5,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	677.935,00	2,20%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>3.301.770,74</b>	<b>10,71%</b>	<b>5,00</b>	<b>40,00</b>



Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (fevereiro / 2018)

Artigo 14º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	10.637.038,80	34,51%	0,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	9.098.236,77	29,52%	0,00%
BANRISUL CORRETORA	9.010.878,60	29,24%	0,08%
AUSTRO CAPITAL	577.883,25	1,88%	0,11%
VINCI PARTNERS	551.855,57	1,79%	0,00%
OLIVEIRA TRUST	436.135,00	1,42%	0,00%
GERAÇÃO FUTURO	150.504,32	0,49%	0,00%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	128.000,00	0,42%	0,01%



FUNDO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE FELIZ - FPSM  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 28/02/2018

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (fevereiro / 2018)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 6,00% ao ano	0,74%	1,55%	2,47%	4,82%	8,94%	20,97%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,65%	1,74%	2,46%	4,76%	9,34%	22,24%	0,20%	0,160%	0,35%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,08%	-1,04%	-0,34%	1,85%	3,17%	8,63%	0,20%	4,802%	3,90%
IMA Geral ex-C	0,72%	2,41%	3,33%	4,83%	11,12%	35,03%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,76%	2,49%	3,42%	4,65%	10,51%	-	0,30%	0,871%	4,83%
IMA Geral	0,72%	2,48%	3,39%	4,91%	11,06%	34,86%	-	-	-
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	0,76%	2,40%	3,33%	4,84%	10,93%	34,13%	0,20%	0,763%	4,25%
IDKA IPCA 2 Anos	0,63%	1,40%	2,58%	4,61%	12,44%	26,40%	-	-	-
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	0,57%	1,53%	2,46%	4,34%	11,41%	25,95%	0,20%	0,648%	2,68%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,24%	1,28%	1,64%	3,39%	9,43%	22,90%	0,20%	0,356%	1,65%
IMA-B	0,55%	3,97%	4,83%	5,51%	10,85%	40,45%	-	-	-
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	0,59%	3,92%	4,77%	5,45%	10,43%	39,60%	0,20%	1,827%	8,67%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	0,59%	3,93%	4,76%	5,38%	10,13%	38,49%	0,35%	1,847%	8,77%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,55%	2,56%	3,48%	4,58%	12,03%	33,47%	0,20%	1,126%	5,47%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,55%	3,91%	4,79%	5,45%	10,73%	40,10%	0,30%	1,835%	9,08%
AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	0,34%	4,33%	4,10%	6,15%	9,17%	26,98%	0,30%	0,997%	3,80%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,93%	-0,93%	0,11%	1,79%	6,16%	14,92%	0,20%	4,349%	5,15%



FUNDO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE FELIZ - FPSM  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 28/02/2018

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (fevereiro / 2018)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,12%	2,24%	3,03%	3,33%	4,60%	31,39%	0,20%	4,242%	11,02%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,43%	-1,41%	-1,06%	0,64%	3,66%	9,89%	0,20%	4,703%	4,18%
CDI	0,46%	1,05%	1,59%	3,48%	8,95%	24,07%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,44%	1,01%	1,54%	3,42%	8,91%	24,05%	0,20%	0,021%	0,12%
IPCA	0,32%	0,61%	1,05%	1,92%	2,84%	7,74%	-	-	-
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	-2,16%	-1,10%	-0,39%	1,84%	3,24%	9,01%	0,15%	4,966%	4,01%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-





FUNDO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE FELIZ - FPSM  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 28/02/2018

Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (fevereiro / 2018)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
PETROBRAS PN - PETR4	8,93%	33,29%	39,53%	57,22%	41,37%	317,51%	-	-	-
BB PETROBRAS FI AÇÕES	8,58%	35,22%	42,57%	61,29%	41,19%	229,21%	2,00%	19,757%	33,82%
IFIX	1,15%	3,82%	4,44%	10,91%	13,93%	69,83%	-	-	-
AGÊNCIAS CAIXA FII - AGCX11	0,55%	2,23%	2,41%	3,06%	-0,31%	-	0,35%	8,908%	21,08%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-2,32%	6,36%	6,36%	11,68%	5,37%	53,78%	1,20%	11,351%	23,15%
Ibovespa	0,52%	11,72%	18,59%	20,50%	28,04%	99,46%	-	-	-
GERAÇÃO FI AÇÕES	1,39%	11,20%	15,48%	11,80%	5,77%	27,29%	3,00%	11,519%	19,86%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1,26%	11,36%	17,32%	21,40%	23,74%	72,51%	1,00%	11,412%	19,41%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	1,18%	-	-	-	-	-	1,60%	0,532%	-
BANRISUL ÍNDICE FI AÇÕES	0,81%	12,78%	18,69%	20,61%	25,43%	94,50%	0,85%	11,597%	18,74%
BB PIPE FIC AÇÕES	-3,55%	-0,13%	3,76%	6,73%	23,35%	55,14%	1,20%	8,545%	16,24%
IBX	0,42%	11,21%	18,26%	19,47%	28,07%	96,43%	-	-	-
BANRISUL INFRA-ESTRUTURA FI AÇÕES	3,65%	11,06%	15,84%	19,53%	28,74%	74,37%	2,50%	8,905%	17,88%
IPCA	0,32%	0,61%	1,05%	1,92%	2,84%	7,74%	-	-	-
BRS PARTICIPAÇÕES FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,15%	-0,05%	0,17%	14,58%	13,24%	32,62%	1,50%	0,337%	15,38%
ICON	-3,58%	-2,27%	4,39%	5,21%	24,82%	47,64%	-	-	-
BB CONSUMO FIC AÇÕES	-3,58%	-2,28%	4,26%	4,48%	23,02%	43,49%	1,00%	8,705%	17,32%



FUNDO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE FELIZ - FPSM  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 28/02/2018

Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (fevereiro / 2018)

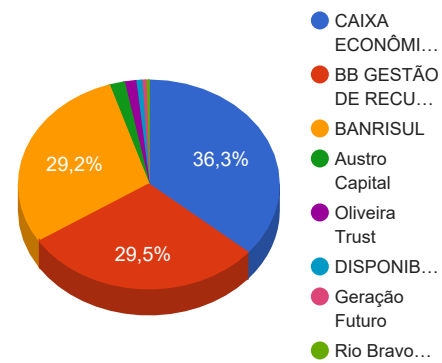
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDIV	-0,61%	9,21%	14,61%	13,85%	17,78%	124,49%	-	-	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	0,34%	6,07%	11,62%	12,17%	18,24%	42,73%	1,72%	8,323%	17,55%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BANRISUL NOVAS FRONTEIRAS FII - BNFS11	-0,83%	-0,83%	-6,31%	5,31%	-2,32%	32,27%	0,40%	7,413%	35,12%



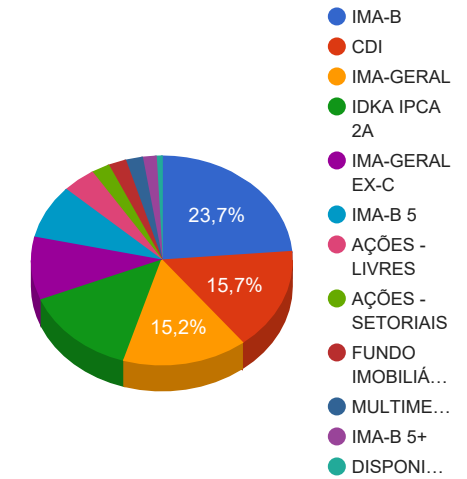
FUNDO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE FELIZ - FPSM  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 28/02/2018

Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (fevereiro / 2018)

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	11.188.894,37	36,30%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	9.098.236,77	29,52%
BANRISUL	9.010.878,60	29,24%
Austro Capital	577.883,25	1,88%
Oliveira Trust	436.135,00	1,42%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	228.879,90	0,74%
Geração Futuro	150.504,32	0,49%
Rio Bravo Investimentos	128.000,00	0,42%



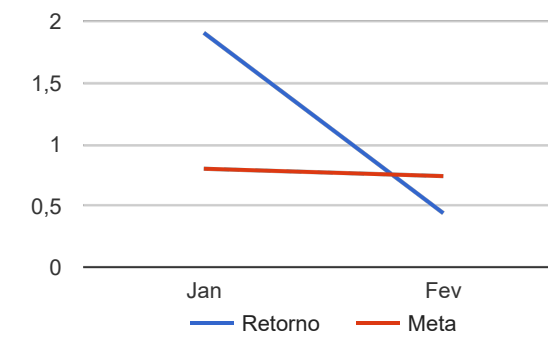
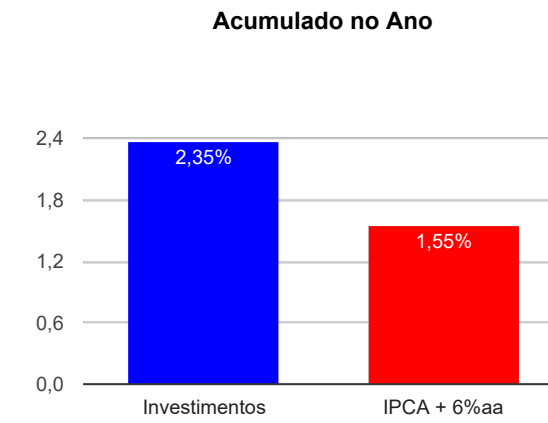
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	7.300.332,82	23,69%
CDI	4.852.655,97	15,75%
IMA-GERAL	4.695.623,25	15,24%
IDKA IPCA 2A	4.349.695,40	14,11%
IMA-GERAL EX-C	3.001.162,86	9,74%
IMA-B 5	2.567.360,07	8,33%
AÇÕES - LIVRES	1.277.424,15	4,14%
AÇÕES - SETORIAIS	697.639,34	2,26%
FUNDO IMOBILIÁRIO	677.935,00	2,20%
MULTIMERCADO	648.772,25	2,11%
IMA-B 5+	521.931,20	1,69%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	228.879,90	0,74%





Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	29.745.826,63	560.087,84	515.000,00	30.358.501,08	567.586,61	1,91%	0,80%	237,72%	1,45%
Fevereiro	30.358.501,08	252.814,24	154.400,64	30.590.532,31	133.617,63	0,44%	0,74%	59,41%	2,01%
Acumulado no ano					701.204,24	2,35%	1,55%	152,17%	





FUNDO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE FELIZ - FPSM  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 28/02/2018

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de fevereiro / 2018

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)	
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	4.021.617,57	0,00	0,00	4.052.108,25	30.490,68	0,76%	0,76%	0,76%	
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.978.594,19	0,00	0,00	3.001.162,86	22.568,67	0,76%	0,87%	0,76%	
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	372.863,86	0,00	9.597,95	365.675,82	2.409,91	0,65%	4,35%	-1,93%	
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	657.700,00	0,00	18.431,16	643.515,00	4.246,16	0,65%	4,97%	-2,16%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	806.232,79	0,00	22.793,26	788.595,14	5.155,61	0,64%	0,16%	0,65%	
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.333.105,00	0,00	36.214,42	1.305.342,00	8.451,42	0,63%	4,80%	-2,08%	
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III FI RENDA FIXA REFERENCIAD...	109.673,76	0,00	0,00	110.323,11	649,35	0,59%	1,85%	0,59%	
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	4.072.762,84	0,00	0,00	4.095.967,57	23.204,73	0,57%	0,65%	0,57%	
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.977.881,73	84.814,24	0,00	2.074.389,06	11.693,09	0,57%	1,83%	0,59%	
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.021.609,67	0,00	0,00	3.038.154,67	16.545,00	0,55%	1,83%	0,55%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	870.823,33	0,00	22.642,52	852.857,34	4.676,53	0,54%	1,13%	0,55%	
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.663.376,12	168.000,00	0,00	4.852.655,97	21.279,85	0,44%	0,02%	0,44%	
AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	434.556,46	0,00	0,00	436.013,50	1.457,04	0,34%	1,00%	0,34%	
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	533.233,40	0,00	12.933,79	521.931,20	1.631,59	0,31%	4,24%	-2,12%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	260.383,05	0,00	7.275,94	253.727,83	620,72	0,24%	0,36%	0,24%	
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	918.672,75	0,00	24.511,60	896.342,25	2.181,10	0,24%	4,70%	-2,43%	
Total Renda Fixa						157.261,45	0,58%	1,36%	



FUNDO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE FELIZ - FPSM  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 28/02/2018

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de fevereiro / 2018

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB PETROBRAS FI AÇÕES	42.628,94	0,00	0,00	46.287,98	3.659,04	8,58%	19,76%	8,58%
BANRISUL INFRA-ESTRUTURA FI AÇÕES	31.923,80	0,00	0,00	33.088,76	1.164,96	3,65%	8,91%	3,65%
GERAÇÃO FI AÇÕES	148.434,62	0,00	0,00	150.504,32	2.069,70	1,39%	11,52%	1,39%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	154.189,88	0,00	0,00	156.134,45	1.944,57	1,26%	11,41%	1,26%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	500.989,50	0,00	0,00	506.902,50	5.913,00	1,18%	0,53%	1,18%
BANRISUL ÍNDICE FI AÇÕES	75.269,53	0,00	0,00	75.875,91	606,38	0,81%	11,60%	0,81%
AGÊNCIAS CAIXA FII - AGCX11	127.300,00	0,00	0,00	128.000,00	700,00	0,55%	8,91%	0,55%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	550.001,98	0,00	0,00	551.855,57	1.853,59	0,34%	8,32%	0,34%
BRS PARTICIPAÇÕES FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	141.652,79	0,00	0,00	141.869,75	216,96	0,15%	0,34%	0,15%
BANRISUL NOVAS FRONTEIRAS FII - BNFS11	439.800,00	0,00	0,00	436.135,00	-3.665,00	-0,83%	7,41%	-0,83%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	116.500,00	0,00	0,00	113.800,00	-2.700,00	-2,32%	11,35%	-2,32%
BB PIPE FIC AÇÕES	927.851,13	0,00	0,00	894.909,47	-32.941,66	-3,55%	8,55%	-3,55%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	68.872,39	0,00	0,00	66.407,03	-2.465,36	-3,58%	8,70%	-3,58%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>-23.643,82</b>	<b>-0,71%</b>	<b>7,39%</b>	