

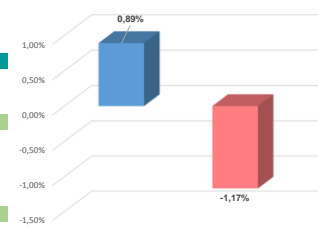


Instituto de Previdência Social dos Servidores do Município do Cabo de Santo Agostinho

Carteira de Investimentos - Maio 2018

ATIVOS	CNPJ	Qtde de Cotas	Valor da Cota	Saldo Total (R\$)	%	Limite da Resolução CMN (%)	Limite Inferior (%)	Estratégia Alvo (%)	Limite Superior (%)	
APLICAÇÕES										
RENTA FIXA										
Títulos tesouro nacional - SELIC - Art. 7º, i, "a"					86,60%	100%	0%	0%	70%	100%
N/D										
FI Referenciados em 100% títulos TN - Art. 7º, i, "b"					30,07%	100%	25%	40%	100%	
CAIXA FI BR IMA B TIT PUBLICOS	10.740.658/0001-93	612374,339775	2.552946	R\$ 1.563.358,62	0,76%					
CAIXA FI IMA GERAL TIT PUB R	11.061.217/0001-28	15120589,561467	2.356627	R\$ 35.633.589,62	17,28%					
CAIXA FI BR 2018 I TP RF	18.598.256/0001-08	1000000	1.332853	R\$ 1.332.853,00	0,65%					
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	10.577.519/0001-90	892142,6109540	1,91094	R\$ 1.704.831,00	0,83%					
CAIXA IMA B 5 TP RF LP	11.060.913/0001-10	1327950,6275320	2,475637	R\$ 3.287.523,71	1,59%					
CAIXA BRASIL 2020 V TP RF	22.791.028/0001-27	300000,0000000	1,266069	R\$ 379.820,70	0,18%					
CAIXA BRASIL 2024 I TP RF	18.598.288/0001-03	1800000,0000000	1,423961	R\$ 2.563.129,80	1,24%					
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	22.791.074/0001-26	300000,0000000	1,279432	R\$ 383.829,60	0,19%					
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	10.740.670/0001-06	6657948,4460780	2,269819	R\$ 15.112.337,88	7,33%					
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TP FI	07.111.384/0001-69	9464,3652880	4,781390759	R\$ 45.252,83	0,02%					
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M1 TP FIC FI	11.328.882/0001-35	5381,8820240	2,372936	R\$ 12.770,86	0,01%					
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M1 TP FIC FI *	11.328.882/0001-35	140.6094840	2,372936	R\$ 333,66	0,00%					
FI Referenciados em índice de renda fixa, 100% títulos TN - Art. 7º, i, "c"										
N/D										
Operações compromissadas em títulos TN - Art. 7º, ii										
N/D										
FI Referenciados RF - Art. 7º, iii, "a"					9,32%	60%	1%	5%	60%	
CAIXA FI FIC NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	10.646.895/0001-90	7060578,3867930	2,72233	R\$ 19.221.224,36	9,32%					
FI de índices Referenciado RF - Art. 7º, iii, alínea, "b"										
N/D										
FI de Renda Fixa - Art. 7º, Inciso IV, Alínea "a"					4,57%	40%	5%	10%	40%	
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP 6-9 *	05.164.356/0001-84	548,3073050	3,603763	R\$ 1.975,97	0,00%					
CAIXA FI BR DISPONIBILIDADE RF 11-5	14.508.643/0001-55	2238261,5683680	1,703202	R\$ 3.812.211,58	1,85%					
CAIXA FI BR DISPONIBILIDADE RF 7-7	14.508.643/0001-55	218561,1157510	1,703202	R\$ 372.253,73	0,18%					
CAIXA FI BR DISPONIBILIDADE RF 5-0 *	14.508.643/0001-55	634329,8543710	1,703202	R\$ 1.080.391,88	0,52%					
CAIXA FI BR DISPONIBILIDADE RF 122-7 *	14.508.643/0001-55	120729,8436480	1,703202	R\$ 205.627,31	0,10%					
CAIXA FI FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	23.215.097/0001-55	3420583,1168440	1,153453	R\$ 3.945.481,86	1,91%					
BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FI FIC 6-8	13.077.415/0001-05	4677,2262700	1,926006	R\$ 9.008,37	0,00%					
BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FI FIC *	13.077.415/0001-05	14.5068370	1,926006	R\$ 27,94	0,00%					
FI Índices Renda Fixa - Art. 7º, iv, alínea "b"										
N/D										
Letras imobiliárias garantidas - Art. 7º - alínea "b"					20%	0%	0%	5%		
N/D										
Certificados de depósitos bancários - Art. 7º, vi, alínea "a"					15%	0%	10%	15%		
N/D										
Dispositivo em poupança - Art 7º, vi, alínea, "b"					15%	0%	0%	0%		
N/D										
FI em direitos creditórios - senior - Art. 7º, vii, "a"					5%	1%	3,5%	5%		
N/D										
FI renda fixa 'credito privado' Art. 7º, vii, "b"					5%	1%	1,5%	5%		
N/D										
RENTA VARIÁVEL										
FI referenciados em renda variável - Artigo 8º, Inciso I, Alínea "a"					12,23%	30%	0%	2%	30%	15%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	17.502.937/0001-68	1493429,18114121	2,597063	R\$ 3.878.529,67	1,88%					
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	10.418.335/0001-88	1394209,931	1,958535957	R\$ 2.730.610,28	1,32%					
FI de índice referenciados em renda variável art. 8º, i, "b"										
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	15.154.236/0001-50	1014726,674982	1,618842	R\$ 1.642.682,16	0,80%	30%	0%	1%	15%	
FI em ações art. 8º, ii, "a"										
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	15.154.220/0001-47	2020481,494455	1,161619	R\$ 2.347.029,69	1,14%	20%	8%	14%	20%	
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	15.154.441/0001-15	3525235,39759367	1,283493	R\$ 4.524.614,96	2,19%	20%	0%	0%	15%	
FI em índices de ações - art. 8º, ii, "b"										
N/D										
FI multimercado - art. 8º, iii					2,37%	10%	6%	9%	10%	
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	03.737.188/0001-43	762785,408555	6,4187232	R\$ 4.896.108,40	2,37%					
FI em participações art. 8º, iv, "a"										
N/D										
FI imobiliário - art. 8º, iv, "b"					5%	0%	2%	3%	5%	
N/D										
DESENQUADRADOS										
TERRA NOVA IMA-B FI FIC RF					23,948.236/0001-50	27595651,1908873	1,11871074	R\$ 30.871.551,36	14,57%	
TERRA NOVA IMA-B RF II					26.326.321/0001-74	24242604,54863210	1,06618277	R\$ 25.847.047,27	12,53%	
TERRA NOVA PREMIUM IMA-B FIC RENDA FIXA					26.326.285/0001-49	20746016,5715031	1,09642394	R\$ 22.746.429,23	11,03%	
TERRA NOVA PREMIUM FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO					26.327.862/0001-17	7835907,78492149	1,08406068	R\$ 8.494.599,52	4,12%	
TERRA NOVA FIC MULT CRÉDITO PRIVADO					26.326.293/0001-95	4851135,48539341	1,07196581	R\$ 5.200.251,38	2,52%	
TOTAL DAS APLICAÇÕES							R\$ 203.847.288,19	98,83%		
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA										
FUNDO FINANCEIRO										
CAIXA 5-0		1	0	R\$ 0,00						
CAIXA 6-9		1	1884,35	R\$ 1.884,35						
CAIXA 122-7		1	166891,9	R\$ 166.891,90						
BB FIN		1	70	R\$ 70,00						
SUB-TOTAL							R\$ 168.846,25			
FUNDO PREVIDENCIÁRIO										
CAIXA 11-5		1	1291942,16	R\$ 1.291.942,16						
CAIXA 7-7		1	9728,17	R\$ 9.728,17						
BB PREV		1	949958	R\$ 949.958,00						
SUB-TOTAL							R\$ 2.251.628,33			
TOTAL DISPONIBILIDADE FINANCEIRA							R\$ 2.420.474,58	1,17%		
TOTAL GERAL							R\$ 206.267.762,77	100%		

META ATUARIAL VS. CARTEIRA (MÊS)



Obs: Os ATIVOS em Negrito* fazem parte dos Investimentos do Fundo Financeiro do CABOPREV
 (%) Percentagem do Ativo ou Segmento em relação ao PL do CABOPREV
 DESENQUADRADOS: Relação de Aplicações em Desacordo com a Resolução CMN nº 3.992/2010, CMN nº 4.604/2017