

Relatório Analítico dos Investimentos em junho, 2º Trimestre e 1º semestre de 2018

Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	427.634,27	0,45%	59	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.216.175,00	2,31%	726	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	1.273.560,00	1,33%	26	0,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.677.447,63	6,97%	336	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.735.304,78	3,90%	1.252	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	17/08/2020	2.105.134,50	2,20%	20	3,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.765.517,61	8,11%	638	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.149.485,09	2,24%	711	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.891.096,29	4,06%	62	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	14.048.043,69	14,66%	1.438	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	69.875,78	0,07%	91	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	7.319.674,03	7,64%	761	0,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.731.565,21	2,85%	470	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	1.878.253,79	1,96%	79	1,38%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	923.544,24	0,96%	124	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	2.454.361,10	2,56%	765	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	10.133.351,26	10,58%	239	0,56%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	5.247.510,23	5,48%	84	0,98%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	706.850,50	0,74%	81	0,46%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	1.596.764,03	1,67%	115	0,66%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.771.361,94	1,85%	5.012	1,32%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	3.075.191,84	3,21%	109	0,43%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

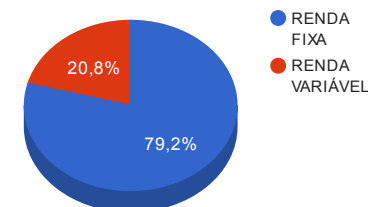
Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.977.441,68	2,06%	1.396	0,14%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.079.762,98	3,21%	34	4,42%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	3.433.716,78	3,58%	2.766	0,58%	Artigo 8º, Inciso III
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.195.203,54	3,34%	69	2,40%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXR11	Não se aplica	Não se aplica	1.832.000,00	1,91%		1,27%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	Término do fundo	Não há	82.022,79	0,09%	750	0,63%	Desenquadrado - RF
		TOTAL -	95.797.850,58				

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

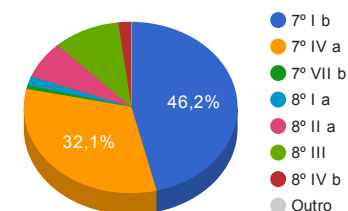
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	44.289.398,86	46,23%	15,00%	25,00%	70,00%	22.769.096,55
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	57.478.710,35
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	30.758.135,64	32,11%	5,00%	10,00%	30,00%	-2.018.780,47
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	7,00%	15,00%	15,00%	14.369.677,59
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.789.892,53
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	706.850,50	0,74%	2,00%	5,00%	5,00%	4.083.042,03
Desenquadrado - RF	0,00%	82.022,79	0,09%	0,00%	0,00%	0,00%	-82.022,79
Total Renda Fixa	100,00%	75.836.407,79	79,16%	36,00	70,00	190,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	1.596.764,03	1,67%	2,00%	5,00%	10,00%	7.983.021,03
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	6.823.995,46	7,12%	2,00%	5,00%	10,00%	2.755.789,60
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	9.708.683,30	10,13%	7,00%	10,00%	10,00%	-128.898,24
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.789.892,53
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	1.832.000,00	1,91%	2,00%	5,00%	5,00%	2.957.892,53
Total Renda Variável	30,00%	19.961.442,79	20,84%	15,00	30,00	40,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: junho / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	44.289.398,86	46,23%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30.758.135,64	32,11%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	706.850,50	0,74%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	82.022,79	0,09%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	75.836.407,79	79,16%	36,00	190,00

Artigos - Renda Variável	Base: junho / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	1.596.764,03	1,67%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	6.823.995,46	7,12%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	9.708.683,30	10,13%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	1.832.000,00	1,91%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	19.961.442,79	20,84%	15,00	40,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (junho / 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	52.579.468,16	54,89%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	16.639.279,78	17,37%	0,00%
ITAÚ UNIBANCO	11.397.229,62	11,90%	0,00%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	10.026.392,90	10,47%	0,00%
INFINITY ASSET MANAGEMENT	5.073.457,33	5,30%	0,93%
MACROINVEST GESTÃO DE RECURSOS	82.022,79	0,09%	0,17%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA	1,26%	2,60%	1,89%	2,60%	4,39%	7,52%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,45%	2,45%	-0,40%	2,45%	8,12%	-	0,002	1,526%	1,68%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,17%	1,80%	-0,21%	1,80%	5,88%	17,30%	0,20%	2,646%	1,79%
IRF-M 1	0,55%	3,08%	1,25%	3,08%	7,81%	22,32%	-	-	-
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,50%	2,94%	1,17%	2,94%	7,57%	21,83%	0,20%	0,701%	0,52%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,50%	2,94%	1,17%	2,94%	7,55%	21,72%	0,10%	0,691%	0,51%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,50%	2,95%	1,18%	2,95%	7,60%	21,87%	0,20%	0,685%	0,50%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,49%	2,94%	1,18%	2,94%	7,57%	21,72%	0,20%	0,676%	0,50%
Selic	0,52%	3,18%	1,56%	3,18%	7,36%	21,18%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,51%	3,14%	1,52%	3,14%	7,55%	21,86%	0,20%	0,006%	0,11%
CDI	0,52%	3,17%	1,56%	3,17%	7,35%	21,15%	-	-	-
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	0,61%	3,60%	1,68%	3,60%	7,86%	24,39%	0,75%	1,065%	1,47%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	0,51%	3,10%	1,53%	3,10%	7,22%	21,07%	0,18%	0,003%	0,07%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,50%	3,15%	1,53%	3,15%	7,41%	21,42%	0,20%	0,023%	0,09%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,50%	3,07%	1,52%	3,07%	7,21%	21,04%	0,20%	0,014%	0,08%
IMA-B 5	0,45%	2,81%	-0,70%	2,81%	9,73%	22,81%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,42%	2,68%	-0,77%	2,68%	9,48%	22,32%	0,20%	3,126%	2,66%

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

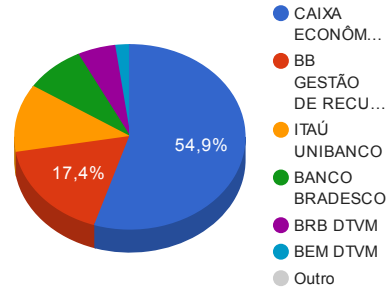
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	0,41%	2,60%	-0,80%	2,60%	9,28%	21,84%	0,40%	3,122%	2,66%
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,38%	2,59%	-0,96%	2,59%	9,52%	22,51%	0,20%	3,286%	2,81%
IDKA IPCA 2 Anos	0,17%	2,98%	-0,03%	2,98%	9,98%	24,14%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,29%	3,16%	0,13%	3,16%	9,69%	22,95%	0,20%	2,618%	2,11%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,21%	3,27%	0,20%	3,27%	9,73%	23,00%	0,20%	2,643%	2,13%
IRF-M	0,04%	2,37%	-1,35%	2,37%	8,94%	27,21%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,03%	2,30%	-1,53%	2,30%	8,61%	26,69%	0,20%	2,977%	2,87%
IMA-B	-0,32%	1,16%	-3,61%	1,16%	8,20%	22,61%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,10%	0,92%	0,20%	0,92%	5,02%	12,45%	0,20%	2,708%	4,23%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,01%	-0,56%	-3,61%	-0,56%	3,39%	10,92%	0,20%	5,120%	5,87%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,59%	7,12%	2,13%	7,12%	15,31%	50,97%	2,00%	0,493%	7,11%

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

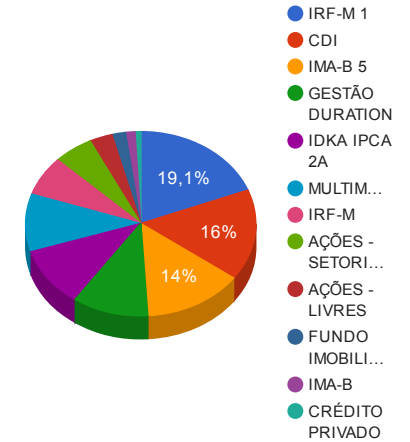
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,52%	3,17%	1,56%	3,17%	7,35%	21,15%	-	-	-
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,62%	3,51%	1,72%	3,51%	8,18%	23,78%	1,00%	0,735%	0,83%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	0,58%	3,28%	1,48%	3,28%	7,44%	20,34%	0,35%	0,114%	0,39%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,46%	2,42%	1,15%	2,42%	6,86%	20,23%	0,70%	0,285%	0,37%
IFNC	-6,71%	-7,75%	-23,55%	-7,75%	7,77%	33,66%	-	-	-
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	-6,72%	-8,19%	-23,58%	-8,19%	6,45%	30,05%	1,00%	17,086%	22,16%
Ibovespa	-5,20%	-4,76%	-14,76%	-4,76%	15,68%	41,22%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-3,07%	2,42%	-8,38%	2,42%	24,31%	-	2,50%	9,132%	15,49%
IGC	-4,42%	-8,37%	-14,18%	-8,37%	9,36%	33,01%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-4,40%	-7,37%	-13,15%	-7,37%	10,05%	33,04%	1,00%	11,601%	16,93%
IDIV	-4,33%	-6,87%	-15,61%	-6,87%	8,85%	48,78%	-	-	-
BRADESCO DIVIDENDOS FIC AÇÕES	-5,36%	-2,56%	-15,33%	-2,56%	14,67%	44,97%	1,50%	10,446%	17,35%
IFIX	-4,01%	-4,55%	-9,85%	-4,55%	2,46%	29,73%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-11,75%	-14,39%	-21,03%	-14,39%	-14,39%	-1,51%	1,20%	11,050%	23,25%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	52.579.468,16	54,89%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	16.639.279,78	17,37%
ITAÚ UNIBANCO	11.397.229,62	11,90%
BANCO BRADESCO	8.048.951,22	8,40%
BRB DTVM	5.073.457,33	5,30%
BEM DTVM	1.977.441,68	2,06%
ICLA Trust	82.022,79	0,09%



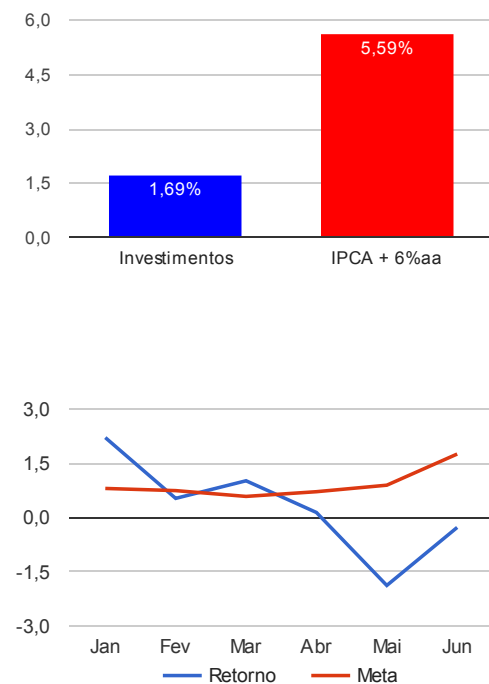
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	18.280.858,52	19,08%
CDI	15.307.398,37	15,98%
IMA-B 5	13.393.226,11	13,98%
GESTÃO DURATION	10.133.351,26	10,58%
IDKA IPCA 2A	9.981.692,61	10,42%
MULTIMERCADO	9.708.683,30	10,13%
IRF-M	6.677.447,63	6,97%
AÇÕES - SETORIAIS	5.345.567,65	5,58%
AÇÕES - LIVRES	3.075.191,84	3,21%
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.832.000,00	1,91%
IMA-B	1.273.560,00	1,33%
CRÉDITO PRIVADO	788.873,29	0,82%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	90.709.916,42	14.666.421,45	14.203.028,25	93.182.708,73	2.009.399,11	2,20%	0,80%	274,99%	1,59%
Fevereiro	93.182.708,73	2.588.930,81	2.361.161,19	93.901.609,06	491.130,71	0,53%	0,74%	71,20%	1,99%
Março	93.901.609,06	1.542.391,06	568.253,17	95.835.681,57	959.934,62	1,01%	0,58%	175,29%	1,35%
Abril	95.835.681,57	5.943.458,78	5.154.028,27	96.756.743,56	131.631,48	0,14%	0,71%	19,25%	1,39%
Mai	96.756.743,56	1.036.950,95	842.226,83	95.130.919,08	-1.820.548,60	-1,88%	0,89%	-211,30%	2,21%
Junho	95.130.919,08	15.524.036,18	14.591.738,33	95.797.850,58	-265.366,35	-0,28%	1,75%	-15,76%	2,59%
Acumulado no ano					1.506.180,97	1,69%	5,59%	30,23%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	1.866.899,64	0,00	0,00	1.878.253,79	11.354,15	0,61%	1,06%	0,61%
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	81.543,52	0,00	0,00	82.022,79	479,27	0,59%	0,49%	0,59%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.717.808,36	0,00	0,00	2.731.565,21	13.756,85	0,51%	0,01%	0,51%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	69.524,74	0,00	0,00	69.875,78	351,04	0,50%	0,70%	0,50%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.336.845,96	0,00	53.837,50	7.319.674,03	36.665,57	0,50%	0,02%	0,50%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.462.352,35	254.440,18	0,00	3.735.304,78	18.512,25	0,50%	0,69%	0,50%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	425.530,44	0,00	0,00	427.634,27	2.103,83	0,49%	0,68%	0,49%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.660.174,10	9.321.197,04	0,00	14.048.043,69	66.672,55	0,48%	0,68%	0,50%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	419.376,43	500.000,00	0,00	923.544,24	4.167,81	0,45%	0,00%	0,51%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	10.087.968,86	0,00	0,00	10.133.351,26	45.382,40	0,45%	1,53%	0,45%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.451.674,32	0,00	1.012.000,00	2.454.361,10	14.686,78	0,43%	0,01%	0,50%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.140.479,23	0,00	0,00	2.149.485,09	9.005,86	0,42%	3,13%	0,42%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	3.875.270,75	0,00	0,00	3.891.096,29	15.825,54	0,41%	3,12%	0,41%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	5.227.600,54	0,00	0,00	5.247.510,23	19.909,69	0,38%	3,29%	0,38%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.467.571,86	4.185.340,58	0,00	6.677.447,63	24.535,19	0,37%	2,98%	0,03%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.209.805,17	0,00	0,00	2.216.175,00	6.369,83	0,29%	2,62%	0,29%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.986.574,84	763.058,38	0,00	7.765.517,61	15.884,39	0,20%	2,64%	0,21%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	331.221,91	0,00	331.802,05	0,00	580,14	0,18%	3,89%	-0,15%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	705.646,50	0,00	0,00	706.850,50	1.204,00	0,17%	2,65%	0,17%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.848.898,78	0,00	7.857.919,21	0,00	9.020,43	0,11%	3,95%	-0,36%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.103.117,00	0,00	0,00	2.105.134,50	2.017,50	0,10%	2,71%	0,10%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	4.734.599,08	0,00	4.739.037,46	0,00	4.438,38	0,09%	3,80%	-0,36%

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.273.671,00	0,00	0,00	1.273.560,00	-111,00	-0,01%	5,12%	-0,01%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	83.786,56	0,00	83.142,11	0,00	-644,45	-0,77%	3,92%	-0,35%
INFINITY IMA-B 5+ TIGER FI RENDA FIXA	0,01	0,00	0,00	0,00	-0,01	-100,00%	3,23%	-0,01%
Total Renda Fixa					322.167,99	0,43%	1,67%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.175.603,58	0,00	0,00	3.195.203,54	19.599,96	0,62%	0,74%	0,62%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	3.561.610,03	0,00	500.000,00	3.079.762,98	18.152,95	0,51%	0,11%	0,58%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	2.918.231,37	500.000,00	0,00	3.433.716,78	15.485,41	0,45%	0,29%	0,46%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	3.172.748,88	0,00	0,00	3.075.191,84	-97.557,04	-3,07%	9,13%	-3,07%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1.670.212,22	0,00	0,00	1.596.764,03	-73.448,19	-4,40%	11,60%	-4,40%
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.089.508,13	0,00	0,00	1.977.441,68	-112.066,45	-5,36%	10,45%	-5,36%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	1.899.062,92	0,00	0,00	1.771.361,94	-127.700,98	-6,72%	17,09%	-6,72%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.076.000,00	0,00	14.000,00	1.832.000,00	-230.000,00	-11,08%	11,05%	-11,75%
Total Renda Variável					-587.534,34	-2,86%	6,08%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2018

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.613.005,30	9.321.197,04	4.000.000,00	14.048.043,69	113.841,35	1,12%	1,18%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.419.204,48	3.738,07	215.448,64	7.319.674,03	112.180,12	1,53%	1,53%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.645.064,97	0,00	2.248.643,96	2.454.361,10	57.940,09	1,41%	1,52%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.439.571,11	254.440,18	0,00	3.735.304,78	41.293,49	1,16%	1,17%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.690.730,40	0,00	0,00	2.731.565,21	40.834,81	1,52%	1,52%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	1.847.266,62	0,00	0,00	1.878.253,79	30.987,17	1,68%	1,68%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	982.844,27	500.000,00	570.000,00	923.544,24	10.699,97	1,42%	1,53%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	422.641,78	0,00	0,00	427.634,27	4.992,49	1,18%	1,18%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.101.012,50	0,00	0,00	2.105.134,50	4.122,00	0,20%	0,20%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.707.257,32	3.055.364,30	0,00	7.765.517,61	2.895,99	0,12%	0,20%
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	80.312,10	0,00	0,00	82.022,79	1.710,69	2,13%	2,13%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	66.594,09	2.473,66	0,00	69.875,78	808,03	1,17%	1,17%
INFINITY IMA-B 5+ TIGER FI RENDA FIXA	0,01	0,00	0,00	0,00	-0,01	-100,00%	-2,14%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	708.334,00	0,00	0,00	706.850,50	-1.483,50	-0,21%	-0,21%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	86.656,29	0,00	83.142,11	0,00	-3.514,18	-4,06%	-3,65%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	339.407,05	0,00	331.802,05	0,00	-7.605,00	-2,24%	-2,56%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	195.671,36	2.028.328,50	0,00	2.216.175,00	-7.824,86	-0,35%	0,13%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.506.796,87	4.185.340,58	0,00	6.677.447,63	-14.689,82	-1,20%	-1,53%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.082.626,56	83.563,58	0,00	2.149.485,09	-16.705,05	-0,77%	-0,77%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	3.922.552,87	0,00	0,00	3.891.096,29	-31.456,58	-0,80%	-0,80%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	10.173.766,01	0,00	0,00	10.133.351,26	-40.414,75	-0,40%	-0,40%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.321.240,00	0,00	0,00	1.273.560,00	-47.680,00	-3,61%	-3,61%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2018

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	3.302.265,11	2.000.000,00	0,00	5.247.510,23	-54.754,88	-1,03%	-0,96%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	4.891.072,36	0,00	4.739.037,46	0,00	-152.034,90	-3,11%	-3,55%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.119.400,99	0,00	7.857.919,21	0,00	-261.481,78	-3,22%	-3,68%
Total Renda Fixa					-217.339,11	-0,29%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2018

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.141.119,67	0,00	0,00	3.195.203,54	54.083,87	1,72%	1,72%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	2.962.572,93	570.000,00	500.000,00	3.079.762,98	47.190,05	1,34%	1,48%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	2.898.313,00	500.000,00	0,00	3.433.716,78	35.403,78	1,14%	1,15%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1.838.536,42	0,00	0,00	1.596.764,03	-241.772,39	-13,15%	-13,15%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	3.356.504,17	0,00	0,00	3.075.191,84	-281.312,33	-8,38%	-8,38%
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.335.383,84	0,00	0,00	1.977.441,68	-357.942,16	-15,33%	-15,33%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.320.000,00	0,00	42.000,00	1.832.000,00	-446.000,00	-19,36%	-21,03%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	2.317.957,12	0,00	0,00	1.771.361,94	-546.595,18	-23,58%	-23,58%
Total Renda Variável					-1.736.944,36	-8,00%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 2018

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.774.345,66	10.015.563,26	4.000.000,00	14.048.043,69	258.134,77	2,85%	2,95%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	9.060.847,13	842.836,99	0,00	10.133.351,26	229.667,14	2,43%	2,45%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.588.650,23	1.321.691,79	812.134,80	7.319.674,03	221.466,81	3,07%	3,15%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	10.541.862,65	0,00	10.739.037,46	0,00	197.174,81	0,93%	1,14%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.083.144,24	4.201.872,63	7.700.000,00	7.765.517,61	180.500,74	2,96%	3,27%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.578.498,70	379.327,81	3.644.389,43	2.454.361,10	140.924,02	2,94%	3,07%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.306.965,08	626.734,07	1.308.334,58	3.735.304,78	109.940,21	2,87%	2,94%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	3.792.655,23	0,00	0,00	3.891.096,29	98.441,06	2,60%	2,60%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.648.448,60	0,00	0,00	2.731.565,21	83.116,61	3,14%	3,14%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.413.002,28	4.185.340,58	0,00	6.677.447,63	79.104,77	2,64%	2,30%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.086.027,50	0,00	53.314,25	2.105.134,50	72.421,25	3,52%	0,92%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	1.812.947,05	0,00	0,00	1.878.253,79	65.306,74	3,60%	3,60%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	3.188.093,48	2.000.000,00	0,00	5.247.510,23	59.416,75	2,51%	2,59%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.012.684,09	83.563,58	0,00	2.149.485,09	53.237,42	2,68%	2,68%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.280.760,00	0,00	32.962,15	1.273.560,00	25.762,15	1,97%	-0,56%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	967.824,58	500.000,00	570.000,00	923.544,24	25.719,66	2,99%	3,10%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	694.349,00	0,00	0,00	706.850,50	12.501,50	1,80%	1,80%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	415.425,81	0,00	0,00	427.634,27	12.208,46	2,94%	2,94%
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	76.571,35	0,00	0,00	82.022,79	5.451,44	7,12%	7,12%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	59.941,94	7.993,00	0,00	69.875,78	1.940,84	2,92%	2,94%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	329.981,43	331.802,05	0,00	1.820,62	1,19%	2,00%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	82.636,52	0,00	83.142,11	0,00	505,59	0,61%	1,04%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 2018

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
INFINITY IMA-B 5+ TIGER FI RENDA FIXA	0,01	0,00	0,00	0,00	-0,01	-100,00%	2,23%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	181.126,35	2.037.284,09	0,00	2.216.175,00	-2.235,44	2,65%	3,16%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.872.526,71	6.000.000,00	7.857.919,21	0,00	-14.607,50	-0,19%	1,03%
				Total Renda Fixa	1.917.920,41	2,54%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 2018

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	1.593.171,96	1.500.000,00	0,00	3.195.203,54	102.031,58	3,30%	3,51%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	1.416.497,95	2.070.000,00	500.000,00	3.079.762,98	93.265,03	2,94%	3,28%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	1.367.433,04	2.000.000,00	0,00	3.433.716,78	66.283,74	2,23%	2,42%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.224.160,67	800.000,00	0,00	3.075.191,84	51.031,17	1,69%	2,42%
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.277.330,24	800.000,00	0,00	1.977.441,68	-99.888,56	-4,81%	-2,56%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	961.692,18	800.000,00	0,00	1.596.764,03	-164.928,15	-9,36%	-7,37%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.140.000,00	0,00	87.400,00	1.832.000,00	-220.600,00	-10,85%	-14,39%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	1.210.296,19	800.000,00	0,00	1.771.361,94	-238.934,25	-11,89%	-8,19%
Total Renda Variável					-411.739,44	-1,86%	