

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
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.209.039,35	3,72%	711	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.027.783,48	2,88%	638	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.296.198,22	2,35%	726	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	2.740.202,00	1,96%	31	1,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO NTN-B	D+0 ou D+1	Não há	2.575.641,20	1,84%	12	1,69%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	9.967.658,90	7,12%	46	5,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	15.123.774,64	10,80%	1.438	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	6.706.266,66	4,79%	273	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	65.629,68	0,05%	269	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	5.486.111,40	3,92%	506	2,62%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.352.669,17	2,39%	761	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	6.705.444,45	4,79%	239	0,37%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	10.580.162,02	7,55%	79	7,75%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	10.765.588,53	7,69%	765	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	208.761,40	0,15%	669	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	5.020.688,19	3,58%	84	0,94%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	11.904.031,67	8,50%	117	1,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	6.139.794,79	4,38%	36	2,70%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
BBIF MASTER FIDC LP	Não se aplica	27 meses	278.459,87	0,20%	13	0,93%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	2.057.456,70	1,47%	207	0,56%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+63	Não há	1.961.186,91	1,40%	1.185	2,82%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	5.106.131,53	3,65%	4.949	0,89%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

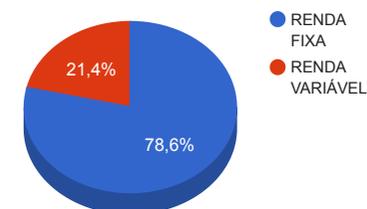
Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	D+4	Não há	2.222.674,25	1,59%	3.454	0,69%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	2.245.618,53	1,60%	2.004	2,25%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.900.256,59	1,36%	2.162	1,31%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
SULAMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+361	2 anos	2.887.300,35	2,06%	9	8,28%	Artigo 8º, Inciso III
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	7.059.414,12	5,04%	69	5,31%	Artigo 8º, Inciso III
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	3.266.382,13	2,33%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	1.201.493,11	0,86%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
		TOTAL -	140.061.819,84				

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

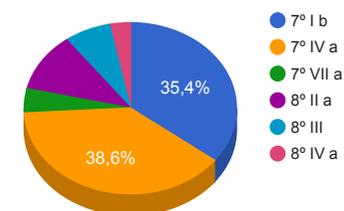
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	49.646.564,45	35,45%	15,00%	25,00%	70,00%	48.396.709,44
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	84.037.091,90
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	54.089.086,51	38,62%	5,00%	15,00%	30,00%	-12.070.540,56
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	15,00%	21.009.272,98
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	6.418.254,66	4,58%	2,00%	5,00%	5,00%	584.836,33
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	7.003.090,99
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	7.003.090,99
Em Enquadramento - RF	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	7.003.090,99
Total Renda Fixa	100,00%	110.153.905,62	78,65%	33,00	80,00	200,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	15.493.324,51	11,06%	2,00%	12,00%	15,00%	5.515.948,47
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	9.946.714,47	7,10%	7,00%	10,00%	10,00%	4.059.467,51
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	4.467.875,24	3,19%	2,00%	4,00%	5,00%	2.535.215,75
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	4,00%	5,00%	7.003.090,99
Desenquadrado - RV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	7.003.090,99
Em Enquadramento - RV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	7.003.090,99
Total Renda Variável	30,00%	29.907.914,22	21,35%	17,00	40,00	55,00	-

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 "	49.646.564,45	35,45%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	54.089.086,51	38,62%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	6.418.254,66	4,58%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Em Enquadramento - RF	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Total Renda Fixa	110.153.905,62	78,65%	33,00	200,00

Artigos - Renda Variável	Base: junho / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	15.493.324,51	11,06%	2,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso III	9.946.714,47	7,10%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	4.467.875,24	3,19%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Desenquadrado - RV	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Em Enquadramento - RV	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	29.907.914,22	21,35%	17,00	55,00

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	41.897.260,13	29,91%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	28.208.129,12	20,14%	0,00%
INFINITY ASSET MANAGEMENT	17.639.576,14	12,59%	3,24%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	14.988.347,09	10,70%	0,00%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	8.883.265,84	6,34%	0,01%
Horus GGR	6.139.794,79	4,38%	-
AZ QUEST INVESTIMENTOS	5.486.111,40	3,92%	0,03%
A5 CAPITAL PARTNERS	3.266.382,13	2,33%	-
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS	2.887.300,35	2,06%	0,01%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	2.245.618,53	1,60%	1,36%
FRANKLIN TEMPLETON INVESTIMENTOS	2.222.674,25	1,59%	0,07%
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	2.057.456,70	1,47%	0,00%
HIX CAPITAL	1.961.186,91	1,40%	0,20%
PERFIN INVESTIMENTOS	1.900.256,59	1,36%	0,05%
Bridge Trust	278.459,87	0,20%	-

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 + 7,00% ao ano	1,83%	6,08%	3,63%	6,08%	11,61%	22,97%	-	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-1,25%	-21,74%	-17,50%	-21,74%	-21,85%	-14,09%	1,65%	4,434%	13,82%
IPCA + 6,00% ao ano	1,75%	5,59%	3,38%	5,59%	10,58%	20,70%	-	-	-
BTG PACTUAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO NTN-B	1,37%	2,37%	-0,08%	2,37%	3,77%	7,66%	0,15%	0,283%	3,95%
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,15%	2,11%	-2,50%	2,11%	9,64%	24,06%	0,20%	4,521%	4,06%
IRF-M 1	0,55%	3,08%	1,25%	3,08%	7,81%	22,32%	-	-	-
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%
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%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,50%	3,15%	1,53%	3,15%	7,42%	21,66%	0,20%	0,016%	0,09%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI 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%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,45%	2,75%	1,35%	2,75%	6,49%	19,20%	0,80%	0,000%	0,07%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,43%	2,62%	1,28%	2,62%	6,22%	18,92%	1,00%	0,003%	0,07%
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	0,04%	2,14%	0,15%	2,14%	8,18%	20,75%	1,00%	0,596%	1,16%

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
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%
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%
IMA Geral ex-C	0,10%	2,30%	-1,06%	2,30%	8,26%	24,11%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,19%	2,55%	-0,93%	2,55%	8,41%	-	0,30%	2,067%	2,47%
IDKA PRÉ 2 ANOS	-0,12%	3,37%	-0,42%	3,37%	10,88%	30,41%	-	-	-
BRDESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	-0,26%	3,30%	-0,48%	3,30%	10,53%	29,41%	0,20%	3,309%	2,69%
Não Possui	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BBIF MASTER FIDC LP	-0,35%	2,90%	-1,26%	2,90%	65.371,85%	-84,41%	0,72%	0,027%	19.960.094.729.600,00%

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

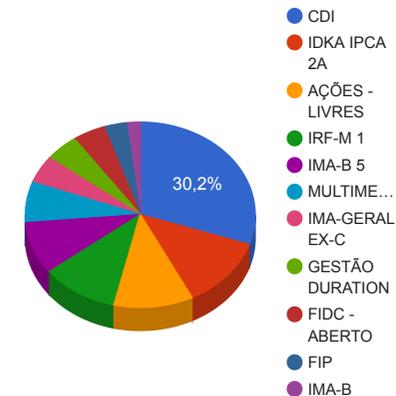
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 8,00% ao ano	1,91%	6,56%	3,87%	6,56%	12,64%	25,26%	-	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-	-	-	-	-	-	2,00%	-	-
IPCA	1,26%	2,60%	1,89%	2,60%	4,39%	7,52%	-	-	-
SULAMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,69%	3,65%	1,20%	3,65%	9,41%	23,43%	1,50%	0,720%	0,89%
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%
Ibovespa	-5,20%	-4,76%	-14,76%	-4,76%	15,68%	41,22%	-	-	-
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-1,91%	-2,72%	-11,64%	-2,72%	13,89%	24,60%	3,00%	12,463%	15,88%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-3,43%	-10,23%	-10,64%	-10,23%	-2,45%	21,30%	2,00%	10,965%	12,03%
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	-4,13%	-3,92%	-14,90%	-3,92%	16,50%	49,84%	2,00%	11,347%	16,83%
PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-4,44%	-9,28%	-13,56%	-9,28%	4,91%	34,76%	1,85%	11,532%	13,78%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-4,64%	-3,04%	-11,31%	-3,04%	17,84%	47,82%	2,00%	9,017%	14,40%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-6,59%	-12,76%	-14,99%	-12,76%	5,18%	31,28%	2,00%	9,903%	13,04%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	43.098.753,24	30,77%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	28.208.129,12	20,14%
BRB DTVM	17.639.576,14	12,59%
BANCO BRADESCO	14.988.347,09	10,70%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	11.915.591,09	8,51%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	7.681.772,73	5,48%
CM Capital Markets DTVM	6.139.794,79	4,38%
Planner Corretora	3.266.382,13	2,33%
SulAmérica Investimentos	2.887.300,35	2,06%
BNP Paribas	2.057.456,70	1,47%
BEM DTVM	1.900.256,59	1,36%
Santander Securities Services	278.459,87	0,20%



Sub-segmento	Valor	%
CDI	42.362.953,87	30,25%
IDKA IPCA 2A	17.291.640,60	12,35%
AÇÕES - LIVRES	15.493.324,51	11,06%
IRF-M 1	15.123.774,64	10,80%
IMA-B 5	12.805.368,74	9,14%
MULTIMERCADO	9.946.714,47	7,10%
IMA-GERAL EX-C	6.706.266,66	4,79%
GESTÃO DURATION	6.705.444,45	4,79%
FIDC - ABERTO	6.418.254,66	4,58%
FIP	4.467.875,24	3,19%
IMA-B	2.740.202,00	1,96%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	135.375.483,75	6.850.318,55	4.326.148,48	140.379.143,23	2.479.489,41	1,80%	0,80%	224,34%	1,46%
Fevereiro	140.379.143,23	2.305.721,89	2.117.805,09	141.176.912,13	609.852,10	0,43%	0,74%	58,75%	1,49%
Março	141.176.912,13	3.575.644,90	4.044.467,62	141.874.773,03	1.166.683,62	0,83%	0,58%	143,18%	1,36%
Abril	141.874.773,03	2.427.518,16	2.139.081,83	141.624.678,86	-538.530,50	-0,38%	0,71%	-53,52%	1,97%
Mai	141.624.678,86	42.769.884,17	41.894.262,42	139.628.883,83	-2.871.416,78	-2,02%	0,89%	-226,74%	2,43%
Junho	139.628.883,83	28.218.941,99	27.338.779,16	140.061.819,84	-447.226,82	-0,32%	1,75%	-18,16%	2,62%
Acumulado no ano					398.851,03	0,30%	5,59%	5,45%	

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(%)
BTG PACTUAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO NTN-B	2.540.765,40	0,00	0,00	2.575.641,20	34.875,80	1,37%	0,28%	1,37%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	5.512.896,39	5.000.000,00	0,00	10.580.162,02	67.265,63	0,64%	1,06%	0,61%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	3.335.954,27	0,00	0,00	3.352.669,17	16.714,90	0,50%	0,02%	0,50%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.898.949,63	0,00	850.000,00	15.123.774,64	74.825,01	0,47%	0,68%	0,50%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	6.675.413,99	0,00	0,00	6.705.444,45	30.030,46	0,45%	1,53%	0,45%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.187.214,65	0,00	0,00	5.209.039,35	21.824,70	0,42%	3,13%	0,42%
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	5.001.639,08	0,00	0,00	5.020.688,19	19.049,11	0,38%	3,29%	0,38%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	5.203.902,19	6.657.000,00	0,00	11.904.031,67	43.129,48	0,36%	0,02%	0,50%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.286.743,23	0,00	0,00	3.296.198,22	9.454,99	0,29%	2,62%	0,29%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.454.918,27	15.335.048,34	10.080.000,00	10.765.588,53	55.621,92	0,27%	0,01%	0,50%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.019.424,41	0,00	0,00	4.027.783,48	8.359,07	0,21%	2,64%	0,21%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.693.515,72	0,00	0,00	6.706.266,66	12.750,94	0,19%	2,07%	0,19%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.736.022,36	0,00	0,00	2.740.202,00	4.179,64	0,15%	4,52%	0,15%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	52.950,50	309.174,98	296.827,28	65.629,68	331,48	0,09%	0,00%	0,45%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	313.869,46	917.718,67	1.023.658,21	208.761,40	831,48	0,07%	0,00%	0,43%
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	5.484.135,04	0,00	0,00	5.486.111,40	1.976,36	0,04%	0,60%	0,04%
BRADERCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	9.994.078,49	0,00	0,00	9.967.658,90	-26.419,59	-0,26%	3,31%	-0,26%
BBIF MASTER FIDC LP	279.424,49	0,00	0,00	278.459,87	-964,62	-0,35%	0,03%	-0,35%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.061.783,70	0,00	2.040.503,30	0,00	-21.280,40	-1,03%	2,98%	0,03%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	6.217.634,13	0,00	0,00	6.139.794,79	-77.839,34	-1,25%	4,43%	-1,25%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.896.252,21	0,00	4.833.924,84	0,00	-62.327,37	-1,27%	3,95%	-0,36%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	8.319.989,07	0,00	8.213.865,53	0,00	-106.123,54	-1,28%	3,80%	-0,36%
Total Renda Fixa					106.266,11	0,10%	1,59%	

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(%)
SULAMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	2.867.431,87	0,00	0,00	2.887.300,35	19.868,48	0,69%	0,72%	0,69%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	7.016.110,40	0,00	0,00	7.059.414,12	43.303,72	0,62%	0,74%	0,62%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	3.271.945,57	0,00	0,00	3.266.382,13	-5.563,44	-0,17%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	1.208.379,40	0,00	0,00	1.201.493,11	-6.886,29	-0,57%	-	-
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.205.304,65	0,00	0,00	5.106.131,53	-99.173,12	-1,91%	12,46%	-1,91%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	2.130.543,16	0,00	0,00	2.057.456,70	-73.086,46	-3,43%	10,96%	-3,43%
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	2.318.510,77	0,00	0,00	2.222.674,25	-95.836,52	-4,13%	11,35%	-4,13%
PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.988.630,45	0,00	0,00	1.900.256,59	-88.373,86	-4,44%	11,53%	-4,44%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.354.957,66	0,00	0,00	2.245.618,53	-109.339,13	-4,64%	9,02%	-4,64%
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FI AÇÕES	2.099.593,22	0,00	0,00	1.961.186,91	-138.406,31	-6,59%	9,90%	-6,59%
Total Renda Variável					-553.492,93	-1,82%	7,09%	

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	17.371.623,75	0,00	2.435.000,00	15.123.774,64	187.150,89	1,13%	1,18%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	10.225.993,03	7.047.000,00	5.500.000,00	11.904.031,67	131.038,64	1,21%	1,53%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.274.887,48	15.773.096,98	10.392.000,00	10.765.588,53	109.604,07	1,25%	1,52%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	0,00	10.500.000,00	0,00	10.580.162,02	80.162,02	0,88%	1,68%
BTG PACTUAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO NTN-B	2.577.700,60	0,00	71.785,10	2.575.641,20	69.725,70	2,74%	-0,08%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	3.302.014,39	0,00	0,00	3.352.669,17	50.654,78	1,53%	1,53%
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,00	5.000.000,00	0,00	5.020.688,19	20.688,19	0,41%	-0,96%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.019.877,31	0,00	0,00	4.027.783,48	7.906,17	0,20%	0,20%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	37.580,55	8.989.174,31	8.822.852,03	208.761,40	4.858,57	0,16%	1,28%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	24.770,44	1.602.073,03	1.562.192,61	65.629,68	978,82	0,21%	1,35%
BBIF MASTER FIDC LP	282.010,33	0,00	0,00	278.459,87	-3.550,46	-1,26%	-1,26%
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	0,00	5.500.000,00	0,00	5.486.111,40	-13.888,60	-0,25%	0,15%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	6.732.187,71	0,00	0,00	6.705.444,45	-26.743,26	-0,40%	-0,40%
BRADERCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	0,00	10.000.000,00	0,00	9.967.658,90	-32.341,10	-0,32%	-0,48%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.094.558,23	0,00	2.040.503,30	0,00	-54.054,93	-2,58%	-1,53%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	23.846.722,46	2.005.000,00	22.500.000,00	3.296.198,22	-55.524,24	0,06%	0,13%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.769.280,69	0,00	0,00	6.706.266,66	-63.014,03	-0,93%	-0,93%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.810.351,23	0,00	0,00	2.740.202,00	-70.149,23	-2,50%	-2,50%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.313.154,00	0,00	5.000.000,00	5.209.039,35	-104.114,65	-0,81%	-0,77%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.064.995,25	0,00	4.833.924,84	0,00	-231.070,41	-4,56%	-3,68%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	8.594.955,53	0,00	8.213.865,53	0,00	-381.090,00	-4,43%	-3,55%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	7.442.408,50	0,00	0,00	6.139.794,79	-1.302.613,71	-17,50%	-17,50%
Total Renda Fixa					-1.675.386,77	-1,43%	

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	0,00	7.000.000,00	0,00	7.059.414,12	59.414,12	0,85%	1,72%
SULAMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	2.853.035,62	0,00	0,00	2.887.300,35	34.264,73	1,20%	1,20%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	3.284.016,85	0,00	0,00	3.266.382,13	-17.634,72	-0,54%	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	1.222.008,41	0,00	0,00	1.201.493,11	-20.515,30	-1,68%	-
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	2.302.477,74	0,00	0,00	2.057.456,70	-245.021,04	-10,64%	-10,64%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.531.951,56	0,00	0,00	2.245.618,53	-286.333,03	-11,31%	-11,31%
PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.198.226,39	0,00	0,00	1.900.256,59	-297.969,80	-13,56%	-13,56%
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FI AÇÕES	2.306.996,59	0,00	0,00	1.961.186,91	-345.809,68	-14,99%	-14,99%
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	2.611.981,61	0,00	0,00	2.222.674,25	-389.307,36	-14,90%	-14,90%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.779.006,78	0,00	0,00	5.106.131,53	-672.875,25	-11,64%	-11,64%
				Total Renda Variável	-2.181.787,33	-6,85%	

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 (%)
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.198.088,61	4.987.000,00	22.500.000,00	3.296.198,22	611.109,61	3,01%	3,16%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	17.837.797,29	0,00	3.210.000,00	15.123.774,64	495.977,35	2,88%	2,95%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	10.527.940,35	8.756.000,00	7.700.000,00	11.904.031,67	320.091,32	2,78%	3,15%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.966.799,32	0,00	5.000.000,00	5.209.039,35	242.240,03	2,64%	2,68%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	6.753.239,12	16.245.367,99	12.427.000,00	10.765.588,53	193.981,42	2,65%	3,07%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.539.228,46	0,00	0,00	6.706.266,66	167.038,20	2,55%	2,55%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	6.545.378,46	0,00	0,00	6.705.444,45	160.065,99	2,45%	2,45%
BTG PACTUAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO NTN-B	2.516.088,60	0,00	71.785,10	2.575.641,20	131.337,70	5,26%	2,37%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.900.351,12	0,00	0,00	4.027.783,48	127.432,36	3,27%	3,27%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	3.255.370,20	0,00	5.000,00	3.352.669,17	102.298,97	3,14%	3,15%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	0,00	10.500.000,00	0,00	10.580.162,02	80.162,02	0,88%	3,60%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.755.362,27	0,00	72.979,96	2.740.202,00	57.819,69	2,09%	2,11%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.016.187,99	0,00	2.040.503,30	0,00	24.315,31	1,21%	2,30%
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,00	5.000.000,00	0,00	5.020.688,19	20.688,19	0,41%	2,59%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	8.196.484,92	0,00	8.213.865,53	0,00	17.380,61	0,21%	1,14%
BBIF MASTER FIDC LP	270.621,61	0,00	0,00	278.459,87	7.838,26	2,90%	2,90%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	73.720,33	13.601.529,96	13.473.073,41	208.761,40	6.584,52	0,27%	2,62%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.829.030,41	0,00	4.833.924,84	0,00	4.894,43	0,10%	1,03%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	17.433,50	2.358.131,71	2.312.412,46	65.629,68	2.476,93	0,70%	2,75%
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	0,00	5.500.000,00	0,00	5.486.111,40	-13.888,60	-0,25%	2,14%
BRADERCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	0,00	10.000.000,00	0,00	9.967.658,90	-32.341,10	-0,32%	3,30%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	7.845.384,55	0,00	0,00	6.139.794,79	-1.705.589,76	-21,74%	-21,74%
Total Renda Fixa					1.021.913,45	0,85%	

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 (%)
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	2.918.608,91	0,00	0,00	3.266.382,13	347.773,22	11,92%	-
SULAMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	2.785.594,63	0,00	0,00	2.887.300,35	101.705,72	3,65%	3,65%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,00	7.000.000,00	0,00	7.059.414,12	59.414,12	0,85%	3,51%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	1.208.683,99	0,00	0,00	1.201.493,11	-7.190,88	-0,59%	-
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.316.092,18	0,00	0,00	2.245.618,53	-70.473,65	-3,04%	-3,04%
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	2.313.309,30	0,00	0,00	2.222.674,25	-90.635,05	-3,92%	-3,92%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.248.743,15	0,00	0,00	5.106.131,53	-142.611,62	-2,72%	-2,72%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	2.291.943,10	0,00	0,00	2.057.456,70	-234.486,40	-10,23%	-10,23%
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FI AÇÕES	2.248.001,38	0,00	0,00	1.961.186,91	-286.814,47	-12,76%	-12,76%
PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	2.200.000,00	0,00	1.900.256,59	-299.743,41	-13,62%	-9,28%
Total Renda Variável					-623.062,42	-0,11%	