

Relatório Analítico dos Investimentos em maio de 2018



Carteira consolidada de investimentos - base (maio / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	2.736.022,36	1,96%	33	0,85%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.187.214,65	3,72%	737	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	15.898.949,63	11,39%	1.416	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	9.994.078,49	7,16%	48	3,77%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO NTN-B	D+0 ou D+1	Não há	2.540.765,40	1,82%	12	1,69%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	6.693.515,72	4,79%	262	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.286.743,23	2,35%	742	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.061.783,70	1,48%	364	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.019.424,41	2,88%	661	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.896.252,21	3,51%	729	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+0	Não há	8.319.989,07	5,96%	300	0,40%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	5.484.135,04	3,93%	514	2,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	5.512.896,39	3,95%	75	4,34%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	313.869,46	0,22%	662	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	6.675.413,99	4,78%	227	0,36%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	5.454.918,27	3,91%	712	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.203.902,19	3,73%	115	0,42%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	5.001.639,08	3,58%	87	0,89%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.335.954,27	2,39%	724	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	52.950,50	0,04%	263	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	6.217.634,13	4,45%	36	2,68%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
BBIF MASTER FIDC LP	Não se aplica	27 meses	279.424,49	0,20%	13	0,93%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "

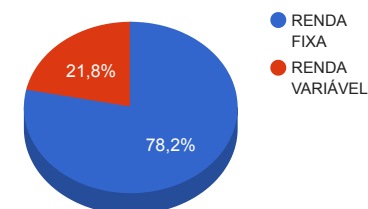
Carteira consolidada de investimentos - base (maio / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	5.205.304,65	3,73%	5.247	0,89%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	D+4	Não há	2.318.510,77	1,66%	3.668	0,66%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.988.630,45	1,42%	2.261	1,32%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	2.354.957,66	1,69%	2.134	2,25%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+63	Não há	2.099.593,22	1,50%	1.203	2,81%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	2.130.543,16	1,53%	226	0,50%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
SULAMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+361	2 anos	2.867.431,87	2,05%	9	8,28%	Artigo 8º, Inciso III
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	7.016.110,40	5,02%	66	5,78%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	1.208.379,40	0,87%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	3.271.945,57	2,34%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
		TOTAL -	139.628.883,83				

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

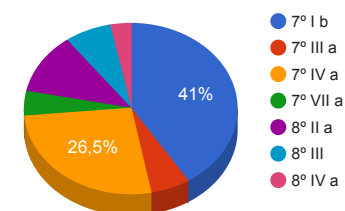
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	57.314.749,80	41,05%	15,00%	25,00%	70,00%	40.425.468,88
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	8.319.989,07	5,96%	5,00%	10,00%	60,00%	75.457.341,23
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	37.035.679,19	26,52%	5,00%	15,00%	30,00%	4.852.985,96
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	15,00%	20.944.332,57
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	6.497.058,62	4,65%	2,00%	5,00%	5,00%	484.385,57
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	6.981.444,19
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	6.981.444,19
Em Enquadramento - RF	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	6.981.444,19
Total Renda Fixa	100,00%	109.167.476,68	78,18%	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%	16.097.539,91	11,53%	2,00%	12,00%	15,00%	4.846.792,66
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	9.883.542,27	7,08%	7,00%	10,00%	10,00%	4.079.346,11
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	4.480.324,97	3,21%	2,00%	4,00%	5,00%	2.501.119,22
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	4,00%	5,00%	6.981.444,19
Desenquadrado - RV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	6.981.444,19
Em Enquadramento - RV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	6.981.444,19
Total Renda Variável	30,00%	30.461.407,15	21,82%	17,00	40,00	55,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: maio / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	57.314.749,80	41,05%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	8.319.989,07	5,96%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	37.035.679,19	26,52%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	6.497.058,62	4,65%	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	109.167.476,68	78,18%	33,00	200,00

Artigos - Renda Variável	Base: maio / 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 "	16.097.539,91	11,53%	2,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso III	9.883.542,27	7,08%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	4.480.324,97	3,21%	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	30.461.407,15	21,82%	17,00	55,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (maio / 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	52.566.896,43	37,65%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	21.570.007,23	15,45%	0,00%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	14.995.717,57	10,74%	0,00%
INFINITY ASSET MANAGEMENT	12.529.006,79	8,97%	2,52%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	8.954.449,45	6,41%	0,01%
Horus GGR	6.217.634,13	4,45%	1,12%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	5.484.135,04	3,93%	0,03%
A5 CAPITAL PARTNERS	3.271.945,57	2,34%	-
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS	2.867.431,87	2,05%	0,01%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	2.354.957,66	1,69%	1,39%
FRANKLIN TEMPLETON INVESTIMENTOS	2.318.510,77	1,66%	0,07%
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	2.130.543,16	1,53%	0,00%
HIX CAPITAL	2.099.593,22	1,50%	0,20%
PERFIN INVESTIMENTOS	1.988.630,45	1,42%	0,06%
Bridge Trust	279.424,49	0,20%	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 7,00% ao ano	0,97%	4,17%	2,43%	5,19%	9,97%	21,90%	-	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-4,30%	-20,75%	-18,33%	-20,19%	-20,13%	-11,92%	1,65%	6,958%	-
IPCA + 6,00% ao ano	0,89%	3,77%	2,19%	4,71%	8,95%	19,64%	-	-	-
BTG PACTUAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO NTN-B	-2,08%	0,98%	-0,72%	1,69%	2,85%	7,40%	0,15%	4,522%	3,94%
CDI	0,52%	2,64%	1,57%	3,19%	7,66%	21,92%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	0,51%	2,63%	1,57%	3,23%	7,75%	22,10%	0,20%	0,018%	0,10%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,51%	2,64%	1,57%	3,24%	7,79%	21,69%	0,20%	0,013%	0,10%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	0,51%	2,98%	1,65%	3,51%	8,14%	24,77%	0,75%	0,397%	1,99%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,50%	2,56%	1,53%	3,10%	7,55%	21,83%	0,20%	0,005%	0,09%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,45%	2,29%	1,37%	2,78%	6,80%	19,95%	0,80%	0,000%	0,08%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,42%	2,19%	1,30%	2,64%	6,54%	19,79%	1,00%	0,003%	0,08%
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	-0,25%	2,10%	0,86%	2,76%	9,17%	22,17%	1,00%	0,326%	1,13%
IPCA	0,40%	1,33%	0,71%	1,77%	2,85%	6,55%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-1,17%	1,99%	0,32%	2,80%	8,10%	-	0,002	1,276%	1,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-2,78%	1,95%	-0,63%	2,90%	9,82%	24,62%	0,20%	2,060%	3,15%
IRF-M 1	0,20%	2,52%	1,37%	3,10%	8,17%	22,97%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,19%	2,45%	1,32%	3,03%	7,99%	22,55%	0,20%	0,285%	0,31%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	-3,16%	1,48%	-2,39%	2,32%	8,72%	25,38%	-	-	-
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-3,07%	1,51%	-2,32%	2,34%	8,46%	24,98%	0,20%	2,566%	4,04%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-3,18%	1,39%	-2,45%	2,21%	8,48%	24,94%	0,20%	2,616%	4,17%
IRF-M	-1,85%	2,32%	-0,09%	3,60%	10,37%	29,87%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,91%	2,26%	-0,29%	3,48%	10,02%	29,19%	0,20%	1,750%	2,39%
IMA-B 5	-1,56%	2,35%	0,46%	3,25%	9,82%	23,40%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,59%	2,25%	0,39%	3,13%	9,58%	22,93%	0,20%	1,313%	1,97%
BRANCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	-1,72%	2,20%	0,29%	3,08%	9,63%	23,12%	0,20%	1,375%	2,10%
IMA Geral ex-C	-1,45%	2,19%	-0,22%	3,10%	9,08%	26,20%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,34%	2,36%	-0,13%	3,28%	9,07%	-	0,30%	1,225%	2,26%
IDKA IPCA 2 Anos	-1,02%	2,81%	1,39%	4,00%	10,66%	25,09%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,79%	3,05%	1,50%	3,95%	10,18%	23,82%	0,20%	1,005%	1,48%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,84%	2,87%	1,32%	3,76%	10,05%	23,60%	0,20%	1,010%	1,48%
IDKA PRÉ 2 ANOS	-0,95%	3,49%	1,32%	4,89%	12,56%	32,36%	-	-	-
BRANCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	-0,91%	3,57%	1,38%	4,98%	12,41%	-	0,20%	1,489%	1,97%
Não Possui	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

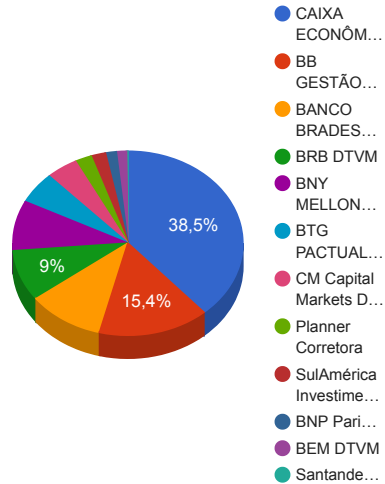
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BBIF MASTER FIDC LP	-0,46%	3,25%	-1,24%	2,89%	20.991,38%	-84,52%	0,72%	0,153%	19.960.094.729.600,00%

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

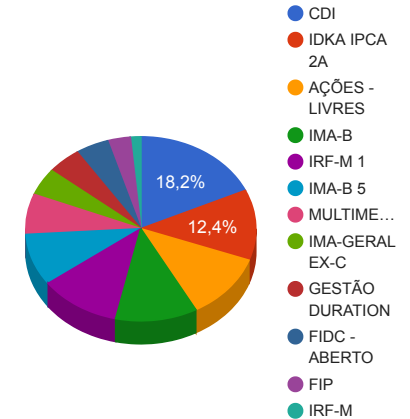
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 8,00% ao ano	1,05%	4,56%	2,67%	5,67%	10,98%	24,17%	-	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-	-	-	-	-	-	2,00%	-	-
CDI	0,52%	2,64%	1,57%	3,19%	7,66%	21,92%	-	-	-
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,55%	2,88%	1,72%	3,42%	8,46%	26,16%	1,00%	0,205%	1,05%
IPCA	0,40%	1,33%	0,71%	1,77%	2,85%	6,55%	-	-	-
SULAMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,01%	2,94%	1,34%	3,63%	9,38%	23,83%	1,50%	0,347%	0,86%
Ibovespa	-10,87%	0,46%	-10,08%	6,65%	22,39%	58,35%	-	-	-
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-6,63%	1,68%	-6,68%	8,42%	24,21%	56,02%	2,00%	10,521%	13,64%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-8,58%	-7,04%	-7,19%	-1,66%	1,76%	26,39%	2,00%	9,401%	10,40%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-9,05%	-0,83%	-8,21%	4,08%	18,51%	34,86%	3,00%	10,587%	14,36%
PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-9,54%	-5,06%	-9,39%	0,78%	10,09%	48,35%	1,85%	10,502%	12,17%
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	-10,91%	0,22%	-9,11%	6,33%	22,99%	64,19%	2,00%	11,846%	15,59%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-8,38%	-6,60%	-9,58%	-4,17%	10,58%	44,01%	2,00%	8,936%	11,81%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	53.775.275,83	38,51%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	21.570.007,23	15,45%
BANCO BRADESCO	14.995.717,57	10,74%
BRB DTVM	12.529.006,79	8,97%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	12.257.196,69	8,78%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	7.746.070,05	5,55%
CM Capital Markets DTVM	6.217.634,13	4,45%
Planner Corretora	3.271.945,57	2,34%
SulAmérica Investimentos	2.867.431,87	2,05%
BNP Paribas	2.130.543,16	1,53%
BEM DTVM	1.988.630,45	1,42%
Santander Securities Services	279.424,49	0,20%



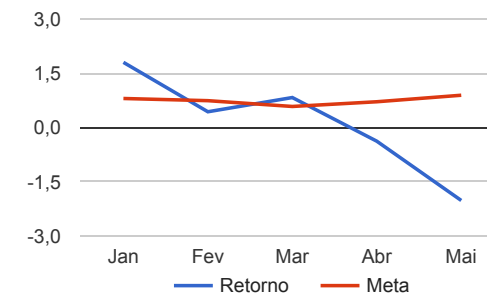
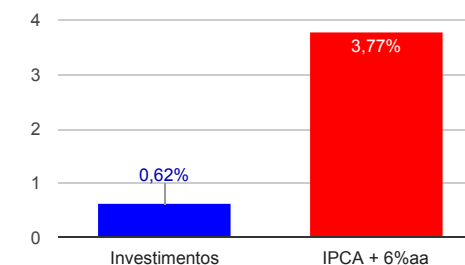
Sub-segmento	Valor	%
CDI	25.358.626,12	18,16%
IDKA IPCA 2A	17.300.246,13	12,39%
AÇÕES - LIVRES	16.097.539,91	11,53%
IMA-B	15.952.263,64	11,42%
IRF-M 1	15.898.949,63	11,39%
IMA-B 5	12.729.619,13	9,12%
MULTIMERCADO	9.883.542,27	7,08%
IMA-GERAL EX-C	6.693.515,72	4,79%
GESTÃO DURATION	6.675.413,99	4,78%
FIDC - ABERTO	6.497.058,62	4,65%
FIP	4.480.324,97	3,21%
IRF-M	2.061.783,70	1,48%



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%
Acumulado no ano					846.077,85	0,62%	3,77%	16,58%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de maio / 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	2.594.800,00	0,00	71.785,10	2.540.765,40	17.750,50	0,68%	4,52%	-2,08%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	3.319.105,44	0,00	0,00	3.335.954,27	16.848,83	0,51%	0,02%	0,51%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.361.579,48	228.262,23	162.000,00	5.454.918,27	27.076,56	0,48%	0,00%	0,50%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	10.278.390,83	390.000,00	5.500.000,00	5.203.902,19	35.511,36	0,33%	0,01%	0,51%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	0,00	5.500.000,00	0,00	5.512.896,39	12.896,39	0,23%	0,40%	0,51%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	16.653.122,94	0,00	785.000,00	15.898.949,63	30.826,69	0,19%	0,29%	0,19%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	22.919,41	7.168.064,01	6.880.779,38	313.869,46	3.665,42	0,05%	0,00%	0,42%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	53.716,85	993.557,93	994.697,94	52.950,50	373,66	0,04%	0,00%	0,45%
BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,00	5.000.000,00	0,00	5.001.639,08	1.639,08	0,03%	1,38%	-1,72%
BRABESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	0,00	10.000.000,00	0,00	9.994.078,49	-5.921,51	-0,06%	1,49%	-0,91%
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	0,00	5.500.000,00	0,00	5.484.135,04	-15.864,96	-0,29%	0,33%	-0,25%
BBIF MASTER FIDC LP	280.709,30	0,00	0,00	279.424,49	-1.284,81	-0,46%	0,15%	-0,46%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.051.369,56	0,00	0,00	4.019.424,41	-31.945,15	-0,79%	1,01%	-0,79%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	25.032.730,79	990.000,00	22.500.000,00	3.286.743,23	-235.987,56	-0,91%	1,01%	-0,84%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	6.754.399,48	0,00	0,00	6.675.413,99	-78.985,49	-1,17%	1,28%	-1,17%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.784.141,10	0,00	0,00	6.693.515,72	-90.625,38	-1,34%	1,22%	-1,34%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.354.951,51	0,00	5.000.000,00	5.187.214,65	-167.736,86	-1,62%	1,31%	-1,59%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.102.006,93	0,00	0,00	2.061.783,70	-40.223,23	-1,91%	1,75%	-1,91%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.814.198,65	0,00	0,00	2.736.022,36	-78.176,29	-2,78%	2,06%	-2,78%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	8.583.488,66	0,00	0,00	8.319.989,07	-263.499,59	-3,07%	2,57%	-3,07%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.056.871,09	0,00	0,00	4.896.252,21	-160.618,88	-3,18%	2,62%	-3,18%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	6.496.847,69	0,00	0,00	6.217.634,13	-279.213,56	-4,30%	6,96%	-4,30%
Total Renda Fixa					-1.303.494,78	-1,12%	1,46%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,00	7.000.000,00	0,00	7.016.110,40	16.110,40	0,23%	0,20%	0,55%
SULAMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	2.867.857,72	0,00	0,00	2.867.431,87	-425,85	-0,01%	0,35%	-0,01%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	3.277.697,55	0,00	0,00	3.271.945,57	-5.751,98	-0,18%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	1.215.276,19	0,00	0,00	1.208.379,40	-6.896,79	-0,57%	-	-
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.522.193,58	0,00	0,00	2.354.957,66	-167.235,92	-6,63%	10,52%	-6,63%
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FI AÇÕES	2.291.756,38	0,00	0,00	2.099.593,22	-192.163,16	-8,38%	8,94%	-8,38%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	2.330.559,48	0,00	0,00	2.130.543,16	-200.016,32	-8,58%	9,40%	-8,58%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.723.047,39	0,00	0,00	5.205.304,65	-517.742,74	-9,05%	10,59%	-9,05%
PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.198.474,80	0,00	0,00	1.988.630,45	-209.844,35	-9,54%	10,50%	-9,54%
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	2.602.466,06	0,00	0,00	2.318.510,77	-283.955,29	-10,91%	11,85%	-10,91%
Total Renda Variável					-1.567.922,00	-4,90%	6,52%	