

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 ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	4.968.165,39	4,05%	262	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.239.035,58	5,08%	729	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	8.663.242,93	7,06%	1.416	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	607.781,48	0,50%	167	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	6.339.976,86	5,16%	742	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	12.116.584,87	9,87%	661	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	1.226.304,42	1,00%	107	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	3.194.386,25	2,60%	211	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.043.449,14	4,11%	1.230	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	8.403.792,19	6,85%	27	2,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	842.666,68	0,69%	192	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	6.889.406,74	5,61%	584	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	7.960.487,64	6,48%	324	0,62%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	5.919.207,80	4,82%	223	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	1.004.864,14	0,82%	20	0,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.553.256,54	2,89%	364	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.349.178,00	1,91%	429	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou D+1461	Não há	2.870.377,99	2,34%	17	1,43%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	4.567.015,58	3,72%	724	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	13.349.021,32	10,87%	704	0,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	5.864.214,64	4,78%	469	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	Não se aplica	Não se aplica	8.774,63	0,01%		1,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (maio / 2018)

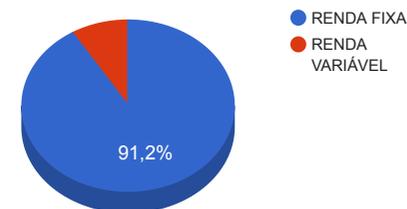
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4	Não há	898.609,10	0,73%	42	0,40%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	D+4	Não há	889.701,14	0,72%	84	0,62%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	909.700,46	0,74%	115	0,37%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.807.715,72	1,47%	24.209	0,41%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	D+4	360 dias	164.242,85	0,13%	6	10,40%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	2.574.200,02	2,10%	729	1,00%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	1.875.792,69	1,53%	33	0,71%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
HAZ FII - ATCR11	Não se aplica	Não se aplica	650.428,67	0,53%		4,38%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	D+31 ou D+1800	1800 dias	1.020.431,21	0,83%	10	5,93%	Desenquadrado - RV
		TOTAL -	122.772.012,67				

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

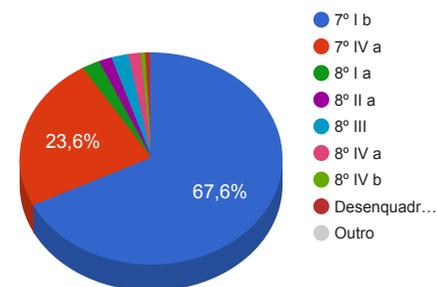
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	82.972.608,65	67,58%	0,00%	64,42%	100,00%	39.799.404,02
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,43%	15,00%	18.415.801,90
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	28.999.807,53	23,62%	0,00%	28,50%	30,00%	7.831.796,27
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	8.774,63	0,01%	0,00%	0,01%	5,00%	6.129.826,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	2.698.010,70	2,20%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.698.010,70
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	1.971.958,57	1,61%	0,00%	1,78%	15,00%	16.443.843,33
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.574.200,02	2,10%	0,00%	0,00%	5,00%	3.564.400,61
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	1.875.792,69	1,53%	0,00%	2,05%	5,00%	4.262.807,94
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	650.428,67	0,53%	0,00%	0,81%	5,00%	5.488.171,96
Desenquadrado - RV	0,00%	1.020.431,21	0,83%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.020.431,21
Total Carteira		122.772.012,67					

RENDA FIXA	111.981.190,81	91,21%
RENDA VARIÁVEL	10.790.821,86	8,79%

Distribuição por Segmento



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 "	82.972.608,65	67,58%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	28.999.807,53	23,62%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	8.774,63	0,01%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	2.698.010,70	2,20%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	1.971.958,57	1,61%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso III	2.574.200,02	2,10%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	1.875.792,69	1,53%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	650.428,67	0,53%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RV	1.020.431,21	0,83%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	122.772.012,67	100,00%	0,00	235,00

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	43.530.711,30	35,46%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	35.170.264,30	28,65%	0,00%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	30.611.910,25	24,93%	0,01%
BRANCO ASSET MANAGEMENT	5.864.214,64	4,78%	0,00%
Elleven Gestora de Recursos	3.520.806,66	2,87%	1,34%
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUTURADOS LTDA	1.884.567,32	1,54%	0,01%
ROMA ASSET	1.020.431,21	0,83%	0,33%
SAFRA ASSET MANAGEMENT	1.004.864,14	0,82%	0,00%

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
120% do CDI	0,62%	3,18%	1,89%	3,85%	9,26%	26,85%	-	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR 2	-7,82%	-45,18%	-40,59%	-47,28%	-57,01%	-64,56%	0,00%	-	-
Selic	0,52%	2,65%	1,58%	3,20%	7,67%	21,96%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,50%	2,62%	1,53%	3,16%	7,90%	22,67%	0,20%	0,003%	0,11%
CDI	0,52%	2,64%	1,57%	3,19%	7,66%	21,92%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,51%	2,63%	1,57%	3,23%	7,75%	22,10%	0,20%	0,018%	0,10%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,50%	2,60%	1,54%	3,14%	7,73%	22,31%	0,20%	0,007%	0,10%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,47%	2,52%	1,49%	3,08%	7,57%	21,66%	0,20%	0,035%	0,10%
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%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,19%	2,42%	1,31%	3,00%	8,01%	22,81%	0,00%	0,283%	0,32%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,18%	2,43%	1,30%	3,00%	7,95%	22,36%	0,10%	0,282%	0,32%
IMA-B 5+	-4,65%	0,37%	-4,89%	1,16%	7,21%	25,90%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-4,62%	0,29%	-4,92%	1,05%	6,96%	24,99%	0,20%	3,937%	5,96%
IMA-B	-3,16%	1,48%	-2,39%	2,32%	8,72%	25,38%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,80%	0,36%	1,80%	0,72%	2,60%	8,54%	0,20%	0,271%	3,90%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,51%	2,99%	1,33%	3,76%	9,73%	23,50%	0,20%	0,761%	1,42%

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

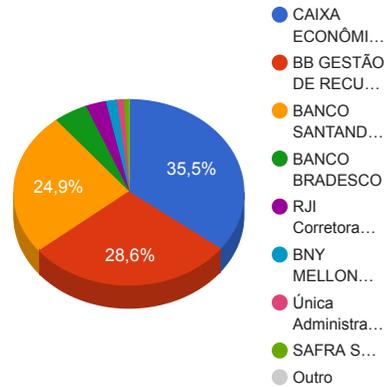
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,81%	0,80%	1,75%	1,86%	5,50%	12,66%	0,20%	1,061%	3,99%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	-2,71%	0,29%	-2,79%	1,55%	7,29%	24,47%	1,30%	1,948%	3,34%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-3,17%	1,39%	-2,44%	2,21%	8,45%	24,83%	0,20%	2,606%	4,16%
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%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	-3,39%	1,22%	-2,52%	2,08%	8,60%	23,96%	0,30%	3,000%	4,47%
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%	-	-	-
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-1,58%	2,25%	0,40%	3,14%	9,61%	22,94%	0,10%	1,312%	1,98%
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%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,79%	3,10%	1,79%	3,46%	8,31%	21,36%	0,20%	0,268%	0,76%
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%

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

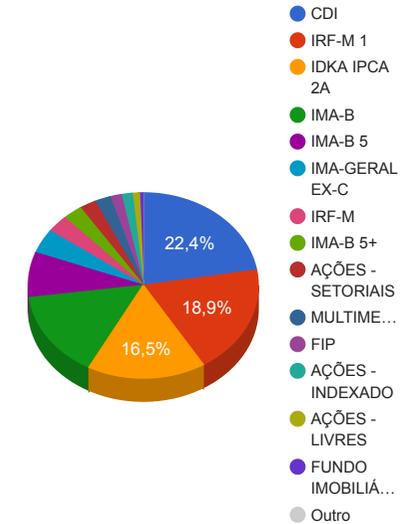
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA	0,40%	1,33%	0,71%	1,77%	2,85%	6,55%	-	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,30%	0,009%	20,84%
IGC	-10,88%	-4,13%	-11,12%	1,50%	15,03%	47,15%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-9,79%	-3,11%	-10,07%	2,51%	15,62%	47,07%	1,00%	11,053%	15,82%
IBX-50	-10,88%	0,68%	-10,26%	6,92%	22,66%	57,65%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	-10,99%	0,45%	-10,87%	6,75%	23,69%	51,37%	0,70%	12,935%	17,94%
Ibovespa	-10,87%	0,46%	-10,08%	6,65%	22,39%	58,35%	-	-	-
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	-0,45%	-2,24%	-1,38%	-2,66%	-5,23%	-12,83%	4,00%	0,074%	0,17%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	-0,84%	-	1,61%	-	-	-	1,60%	1,165%	-
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	-9,33%	1,30%	-8,69%	5,84%	18,50%	31,96%	3,00%	9,222%	13,67%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-10,39%	-0,46%	-10,39%	5,13%	20,46%	54,61%	0,75%	12,018%	17,15%
IDIV	-10,53%	-2,66%	-10,87%	2,16%	12,39%	67,47%	-	-	-
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	-11,15%	-0,68%	-10,03%	4,39%	12,62%	31,90%	2,00%	11,979%	15,50%
IFIX	-5,27%	-0,55%	-4,21%	0,05%	7,65%	37,32%	-	-	-
HAZ FII - ATR11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	1,20%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	43.530.711,30	35,46%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	35.170.264,30	28,65%
BANCO SANTANDER	30.611.910,25	24,93%
BANCO BRADESCO	5.864.214,64	4,78%
RJI Corretora de Valores	3.520.806,66	2,87%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	1.875.792,69	1,53%
Única Administradora	1.184.674,06	0,96%
SAFRA SERVIÇOS DE ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA LTDA.	1.004.864,14	0,82%
Brasil Plural	8.774,63	0,01%



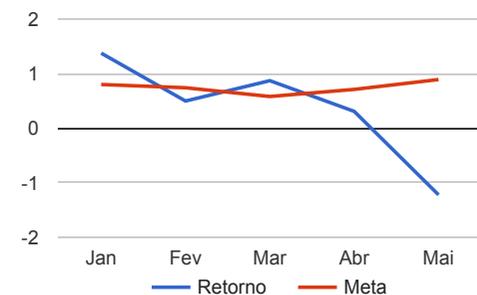
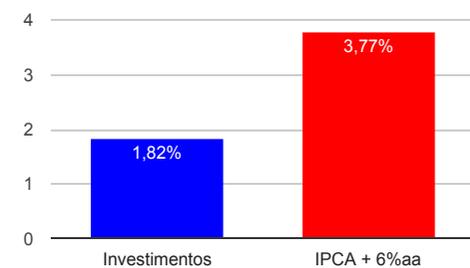
Sub-segmento	Valor	%
CDI	26.129.429,54	21,28%
IRF-M 1	22.110.484,26	18,01%
IDKA IPCA 2A	19.299.228,41	15,72%
IMA-B	17.611.465,93	14,34%
IMA-B 5	9.186.792,06	7,48%
IMA-GERAL EX-C	4.968.165,39	4,05%
IRF-M	3.553.256,54	2,89%
IMA-B 5+	3.194.386,25	2,60%
AÇÕES - SETORIAIS	2.717.416,18	2,21%
MULTIMERCADO	2.574.200,02	2,10%
FIP	1.875.792,69	1,53%
AÇÕES - INDEXADO	1.788.310,24	1,46%
AÇÕES - LIVRES	1.184.674,06	0,96%
FUNDO IMOBILIÁRIO	650.428,67	0,53%
FIDC - FECHADO	8.774,63	0,01%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	114.216.440,46	10.266.099,47	8.846.346,38	117.224.289,56	1.588.096,01	1,37%	0,80%	171,35%	0,67%
Fevereiro	117.224.289,56	6.216.112,57	5.063.696,56	118.965.268,41	588.562,84	0,50%	0,74%	67,33%	1,12%
Março	118.965.268,41	28.408.298,69	26.934.670,37	121.486.183,10	1.047.286,37	0,87%	0,58%	150,65%	0,80%
Abril	121.486.183,10	7.412.643,47	8.996.306,33	120.276.744,69	374.224,45	0,31%	0,71%	43,52%	0,61%
Mai	120.276.744,69	7.697.824,50	3.687.760,55	122.772.012,67	-1.514.795,97	-1,22%	0,89%	-137,14%	1,42%
Acumulado no ano					2.083.373,70	1,82%	3,77%	48,38%	

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(%)	
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.872.239,36	0,00	0,00	5.919.207,80	46.968,44	0,80%	0,27%	0,80%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	836.028,76	0,00	0,00	842.666,68	6.637,92	0,79%	0,27%	0,79%	
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	4.854.514,66	117.584,37	430.000,00	4.567.015,58	24.916,55	0,50%	0,02%	0,51%	
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	5.835.123,09	0,00	0,00	5.864.214,64	29.091,55	0,50%	0,00%	0,50%	
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.189.195,06	550.240,13	400.365,98	2.349.178,00	10.108,79	0,37%	0,03%	0,47%	
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	12.522.294,47	3.530.000,00	2.755.000,00	13.349.021,32	51.726,85	0,32%	0,01%	0,50%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.749.008,36	0,00	102.394,57	8.663.242,93	16.629,14	0,19%	0,29%	0,19%	
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.388.170,85	0,00	0,00	8.403.792,19	15.621,34	0,19%	0,28%	0,19%	
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.034.312,14	0,00	0,00	5.043.449,14	9.137,00	0,18%	0,28%	0,18%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	610.867,07	0,00	0,00	607.781,48	-3.085,59	-0,51%	0,76%	-0,51%	
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.212.883,70	0,00	0,00	12.116.584,87	-96.298,83	-0,79%	1,01%	-0,79%	
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.236.332,00	0,00	0,00	1.226.304,42	-10.027,58	-0,81%	1,06%	-0,81%	
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.393.964,22	0,00	0,00	6.339.976,86	-53.987,36	-0,84%	1,01%	-0,84%	
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.035.430,77	0,00	0,00	4.968.165,39	-67.265,38	-1,34%	1,22%	-1,34%	
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	8.088.123,91	0,00	0,00	7.960.487,64	-127.636,27	-1,58%	1,31%	-1,58%	
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.622.576,83	0,00	0,00	3.553.256,54	-69.320,29	-1,91%	1,75%	-1,91%	
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	2.950.276,48	0,00	0,00	2.870.377,99	-79.898,49	-2,71%	1,95%	-2,72%	
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.114.657,19	0,00	0,00	6.889.406,74	-225.250,45	-3,17%	2,61%	-3,17%	
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.443.703,74	0,00	0,00	6.239.035,58	-204.668,16	-3,18%	2,62%	-3,18%	
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	1.040.157,68	0,00	0,00	1.004.864,14	-35.293,54	-3,39%	3,00%	-3,39%	
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.348.966,05	0,00	0,00	3.194.386,25	-154.579,80	-4,62%	3,94%	-4,62%	
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	9.519,07	0,00	0,00	8.774,63	-744,44	-7,82%	-	-7,82%	
Total Renda Fixa						-917.218,60	-0,81%	0,95%	

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(%)
HAZ FII - ATCR11	650.211,69	0,00	0,00	650.428,67	216,98	0,03%	-	0,00%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	1.876.398,85	0,00	0,00	1.875.792,69	-606,16	-0,03%	0,01%	-0,03%
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	164.984,61	0,00	0,00	164.242,85	-741,76	-0,45%	0,07%	-0,45%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	2.596.071,19	0,00	0,00	2.574.200,02	-21.871,17	-0,84%	1,16%	-0,84%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	491.891,48	500.000,00	0,00	909.700,46	-82.191,02	-8,29%	11,05%	-9,79%
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	1.125.383,46	0,00	0,00	1.020.431,21	-104.952,25	-9,33%	9,22%	-9,33%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	493.326,46	500.000,00	0,00	898.609,10	-94.717,36	-9,54%	12,02%	-10,39%
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	1.807.715,72	-192.284,28	-9,61%	11,98%	-11,15%
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	490.131,49	500.000,00	0,00	889.701,14	-100.430,35	-10,14%	12,93%	-10,99%
Total Renda Variável					-597.577,37	-5,25%	6,55%	