

# 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
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	4.977.629,59	4,16%	273	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.216.581,41	5,20%	661	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	8.103.578,01	6,78%	1.438	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	611.301,32	0,51%	166	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	6.358.215,09	5,32%	726	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	11.541.128,63	9,66%	638	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	1.227.536,98	1,03%	107	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	3.160.129,57	2,64%	199	0,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.454.791,05	3,73%	1.252	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	8.444.514,56	7,06%	30	2,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	852.095,97	0,71%	192	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	6.865.210,78	5,74%	539	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	7.995.166,95	6,69%	310	0,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	5.986.011,62	5,01%	223	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	998.456,96	0,84%	21	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.554.471,90	2,97%	336	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.909.664,42	2,43%	435	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou D+1461	Não há	2.849.020,27	2,38%	17	1,43%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	4.642.946,40	3,88%	761	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	14.360.508,14	12,01%	697	0,29%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.883.053,27	2,41%	470	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	Não se aplica	Não se aplica	8.428,50	0,01%		1,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2018)

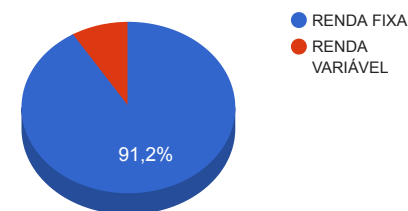
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4	Não há	852.457,57	0,71%	73	0,30%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	D+4	Não há	839.706,67	0,70%	82	0,56%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	869.696,05	0,73%	115	0,36%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.714.081,44	1,43%	23.854	0,42%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	D+4	360 dias	163.503,52	0,14%	6	10,40%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	2.567.445,25	2,15%	729	1,00%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	1.875.279,72	1,57%	33	0,71%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
HAZ FII - ATCR11	Não se aplica	Não se aplica	649.795,55	0,54%		4,37%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	D+31 ou D+1800	1800 dias	995.682,09	0,83%	10	5,96%	Desenquadrado - RV
		<b>TOTAL -</b>	<b>119.528.089,25</b>				

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

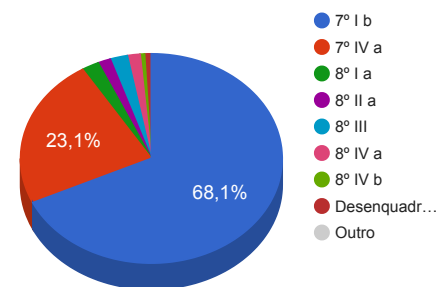
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	81.346.820,39	68,06%	0,00%	64,42%	100,00%	38.181.268,86
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,43%	15,00%	17.929.213,39
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	27.645.192,50	23,13%	0,00%	28,50%	30,00%	8.213.234,28
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	8.428,50	0,01%	0,00%	0,01%	5,00%	5.967.975,96
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	2.561.860,29	2,14%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.561.860,29
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	1.877.584,96	1,57%	0,00%	1,78%	15,00%	16.051.628,43
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.567.445,25	2,15%	0,00%	0,00%	5,00%	3.408.959,21
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	1.875.279,72	1,57%	0,00%	2,05%	5,00%	4.101.124,74
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	649.795,55	0,54%	0,00%	0,81%	5,00%	5.326.608,91
Desenquadrado - RV	0,00%	995.682,09	0,83%	0,00%	0,00%	0,00%	-995.682,09
<b>Total Carteira</b>		<b>119.528.089,25</b>					

RENDA FIXA	109.000.441,39	91,19%
RENDA VARIÁVEL	10.527.647,86	8,81%

Distribuição por Segmento



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 "	81.346.820,39	68,06%	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 "	27.645.192,50	23,13%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	8.428,50	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 "	2.561.860,29	2,14%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	1.877.584,96	1,57%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso III	2.567.445,25	2,15%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	1.875.279,72	1,57%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	649.795,55	0,54%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RV	995.682,09	0,83%	0,00%	0,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>119.528.089,25</b>	<b>100,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>235,00</b>

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	42.946.124,89	35,93%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	34.506.097,26	28,87%	0,00%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	31.652.647,22	26,48%	0,01%
Elleven Gestora de Recursos	3.498.815,82	2,93%	1,08%
BRABESCO ASSET MANAGEMENT	2.883.053,27	2,41%	0,00%
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUTURADOS LTDA	1.883.708,22	1,58%	0,01%
SAFRA ASSET MANAGEMENT	998.456,96	0,84%	0,00%
ROMA ASSET	995.682,09	0,83%	0,21%

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
120% do CDI	0,62%	3,82%	1,88%	3,82%	8,89%	25,89%	-	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR 2	-3,95%	-47,34%	-28,40%	-47,34%	-56,95%	-65,30%	0,00%	-	-
IRF-M 1	0,55%	3,08%	1,25%	3,08%	7,81%	22,32%	-	-	-
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%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,48%	2,92%	1,16%	2,92%	7,56%	22,04%	0,00%	0,695%	0,51%
Selic	0,52%	3,18%	1,56%	3,18%	7,36%	21,18%	-	-	-
BRADERCO 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%	-	-	-
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,51%	3,12%	1,52%	3,12%	7,36%	21,49%	0,20%	0,004%	0,09%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,50%	3,15%	1,53%	3,15%	7,41%	21,42%	0,20%	0,023%	0,09%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,49%	3,02%	1,46%	3,02%	7,22%	20,87%	0,20%	0,068%	0,10%
IMA-B 5	0,45%	2,81%	-0,70%	2,81%	9,73%	22,81%	-	-	-
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,44%	2,70%	-0,75%	2,70%	9,53%	22,35%	0,10%	3,128%	2,66%
IDKA IPCA 2 Anos	0,17%	2,98%	-0,03%	2,98%	9,98%	24,14%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,12%	4,25%	2,34%	4,25%	8,90%	21,18%	0,20%	0,518%	0,77%
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%

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
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%
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 5+	-1,08%	-0,71%	-6,27%	-0,71%	6,11%	21,42%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,07%	-0,78%	-6,24%	-0,78%	5,90%	20,57%	0,20%	5,004%	6,38%
IMA-B	-0,32%	1,16%	-3,61%	1,16%	8,20%	22,61%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,13%	1,50%	2,36%	1,50%	3,17%	8,87%	0,20%	0,525%	3,90%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,58%	3,59%	0,64%	3,59%	9,79%	22,95%	0,20%	1,937%	1,78%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,10%	0,90%	0,21%	0,90%	5,01%	12,01%	0,20%	2,709%	4,27%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,35%	1,04%	-3,65%	1,04%	7,91%	22,07%	0,20%	3,917%	4,54%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,36%	1,03%	-3,68%	1,03%	7,92%	22,14%	0,20%	3,952%	4,56%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	-0,64%	0,58%	-4,14%	0,58%	7,80%	21,01%	0,30%	4,314%	4,95%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	-0,74%	-0,45%	-4,92%	-0,45%	6,29%	21,33%	1,30%	3,417%	3,81%

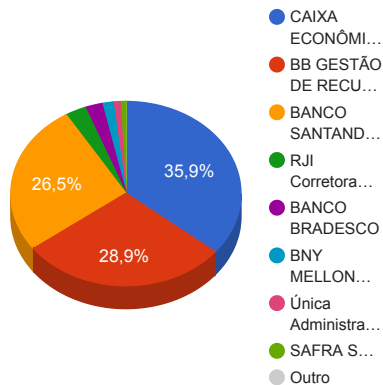


Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (junho / 2018)

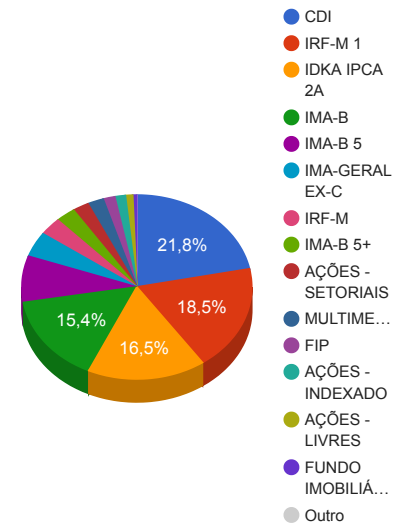
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA	1,26%	2,60%	1,89%	2,60%	4,39%	7,52%	-	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,30%	-	-
IBX-50	-5,30%	-4,66%	-15,07%	-4,66%	15,58%	40,49%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	-5,62%	-5,19%	-15,61%	-5,19%	16,62%	36,79%	0,70%	11,404%	18,93%
Ibovespa	-5,20%	-4,76%	-14,76%	-4,76%	15,68%	41,22%	-	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	-0,26%	-	-0,58%	-	-	-	1,60%	2,646%	-
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	-0,45%	-2,68%	-1,39%	-2,68%	-5,24%	-17,74%	4,00%	0,074%	0,17%
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	-2,43%	-1,16%	-12,28%	-1,16%	12,75%	25,20%	3,00%	7,205%	13,90%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-5,14%	-5,57%	-14,44%	-5,57%	13,92%	38,93%	0,75%	11,348%	18,17%
IGC	-4,42%	-8,37%	-14,18%	-8,37%	9,36%	33,01%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI 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%	-	-	-
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	-5,18%	-5,82%	-15,58%	-5,82%	6,73%	19,61%	2,00%	10,456%	16,37%
IFIX	-4,01%	-4,55%	-9,85%	-4,55%	2,46%	29,73%	-	-	-
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 (junho / 2018)

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	42.946.124,89	35,93%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	34.506.097,26	28,87%
BANCO SANTANDER	31.652.647,22	26,48%
RJI Corretora de Valores	3.498.815,82	2,93%
BANCO BRADESCO	2.883.053,27	2,41%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	1.875.279,72	1,57%
Única Administradora	1.159.185,61	0,97%
SAFRA SERVIÇOS DE ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA LTDA.	998.456,96	0,84%
Brasil Plural	8.428,50	0,01%



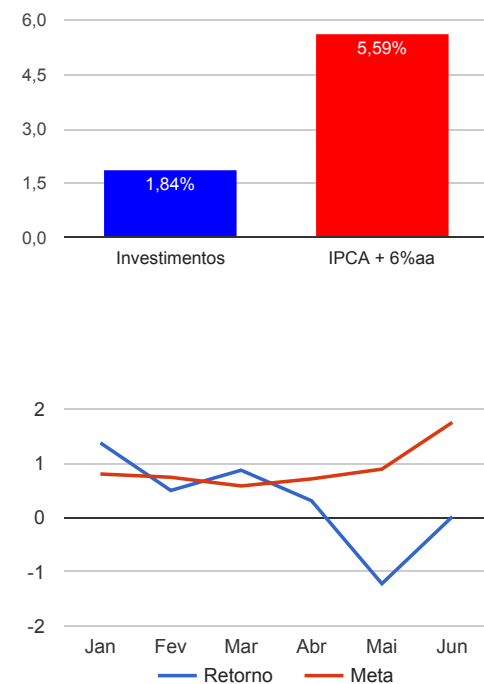
Sub-segmento	Valor	%
CDI	24.796.172,23	20,75%
IRF-M 1	21.002.883,62	17,57%
IDKA IPCA 2A	18.751.439,69	15,69%
IMA-B	17.540.570,74	14,67%
IMA-B 5	9.222.703,93	7,72%
IMA-GERAL EX-C	4.977.629,59	4,16%
IRF-M	3.554.471,90	2,97%
IMA-B 5+	3.160.129,57	2,64%
AÇÕES - SETORIAIS	2.583.777,49	2,16%
MULTIMERCADO	2.567.445,25	2,15%
FIP	1.875.279,72	1,57%
AÇÕES - INDEXADO	1.692.164,24	1,42%
AÇÕES - LIVRES	1.159.185,61	0,97%
FUNDO IMOBILIÁRIO	649.795,55	0,54%
FIDC - FECHADO	8.428,50	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%
Junho	122.772.012,67	7.403.947,98	10.665.441,90	119.528.089,25	17.570,50	0,01%	1,75%	0,82%	2,21%
Acumulado no ano					2.100.944,20	1,84%	5,59%	32,89%	

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(%)
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.919.207,80	0,00	0,00	5.986.011,62	66.803,82	1,13%	0,52%	1,13%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	842.666,68	0,00	0,00	852.095,97	9.429,29	1,12%	0,52%	1,12%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	607.781,48	0,00	0,00	611.301,32	3.519,84	0,58%	1,94%	0,58%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.663.242,93	0,00	602.058,07	8.103.578,01	42.393,15	0,49%	0,68%	0,50%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.403.792,19	0,00	0,00	8.444.514,56	40.722,37	0,48%	0,69%	0,48%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	4.567.015,58	352.561,05	300.000,00	4.642.946,40	23.369,77	0,48%	0,02%	0,50%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	7.960.487,64	0,00	0,00	7.995.166,95	34.679,31	0,44%	3,13%	0,44%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.043.449,14	0,00	610.000,00	4.454.791,05	21.341,91	0,42%	0,69%	0,50%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.349.178,00	549.386,93	365,98	2.909.664,42	11.465,47	0,40%	0,07%	0,49%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	5.864.214,64	0,00	3.000.017,85	2.883.053,27	18.856,48	0,32%	0,01%	0,51%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	13.349.021,32	6.502.000,00	5.553.000,00	14.360.508,14	62.486,82	0,31%	0,00%	0,51%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.339.976,86	0,00	0,00	6.358.215,09	18.238,23	0,29%	2,62%	0,29%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.116.584,87	0,00	600.000,00	11.541.128,63	24.543,76	0,20%	2,64%	0,21%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.968.165,39	0,00	0,00	4.977.629,59	9.464,20	0,19%	2,07%	0,19%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.226.304,42	0,00	0,00	1.227.536,98	1.232,56	0,10%	2,71%	0,10%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.553.256,54	0,00	0,00	3.554.471,90	1.215,36	0,03%	2,98%	0,03%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.889.406,74	0,00	0,00	6.865.210,78	-24.195,96	-0,35%	3,92%	-0,35%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.239.035,58	0,00	0,00	6.216.581,41	-22.454,17	-0,36%	3,95%	-0,36%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	1.004.864,14	0,00	0,00	998.456,96	-6.407,18	-0,64%	4,31%	-0,64%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	2.870.377,99	0,00	0,00	2.849.020,27	-21.357,72	-0,74%	3,42%	-0,74%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.194.386,25	0,00	0,00	3.160.129,57	-34.256,68	-1,07%	5,00%	-1,07%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	8.774,63	0,00	0,00	8.428,50	-346,13	-3,94%	-	-3,95%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>280.744,50</b>	<b>0,25%</b>	<b>1,81%</b>	

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(%)
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	1.875.792,69	0,00	0,00	1.875.279,72	-512,97	-0,03%	-	-
HAZ FII - ATCR11	650.428,67	0,00	0,00	649.795,55	-633,12	-0,10%	-	0,00%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	2.574.200,02	0,00	0,00	2.567.445,25	-6.754,77	-0,26%	2,65%	-0,26%
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	164.242,85	0,00	0,00	163.503,52	-739,33	-0,45%	0,07%	-0,45%
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	1.020.431,21	0,00	0,00	995.682,09	-24.749,12	-2,43%	7,20%	-2,80%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	909.700,46	0,00	0,00	869.696,05	-40.004,41	-4,40%	11,60%	-4,40%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	898.609,10	0,00	0,00	852.457,57	-46.151,53	-5,14%	11,35%	-5,14%
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.807.715,72	0,00	0,00	1.714.081,44	-93.634,28	-5,18%	10,46%	-5,18%
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	889.701,14	0,00	0,00	839.706,67	-49.994,47	-5,62%	11,40%	-5,62%
Total Renda Variável					-263.174,00	-2,44%	7,65%	

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 (%)
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	10.865.435,03	16.880.000,00	13.549.000,00	14.360.508,14	164.073,11	0,92%	1,52%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.847.966,97	0,00	0,00	5.986.011,62	138.044,65	2,36%	2,36%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.307.193,71	0,00	1.307.629,09	8.103.578,01	104.013,39	1,17%	1,18%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.347.913,32	0,00	0,00	8.444.514,56	96.601,24	1,16%	1,16%
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	5.805.788,52	0,00	3.000.017,85	2.883.053,27	77.282,60	1,33%	1,52%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	4.939.007,15	470.145,42	840.000,00	4.642.946,40	73.793,83	1,50%	1,53%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.000.711,34	0,00	2.610.000,00	4.454.791,05	64.079,71	1,09%	1,17%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.617.264,69	1.664.270,53	401.463,92	2.909.664,42	29.593,12	1,14%	1,46%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.117.950,09	0,00	600.000,00	11.541.128,63	23.178,54	0,19%	0,20%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	832.578,43	0,00	0,00	852.095,97	19.517,54	2,34%	2,34%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.350.100,63	0,00	0,00	6.358.215,09	8.114,46	0,13%	0,13%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	607.384,50	0,00	0,00	611.301,32	3.916,82	0,64%	0,64%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.224.958,81	0,00	0,00	1.227.536,98	2.578,17	0,21%	0,21%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR 2	11.772,30	0,00	0,00	8.428,50	-3.343,80	-28,40%	-28,40%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	1.041.587,83	0,00	0,00	998.456,96	-43.130,87	-4,14%	-4,14%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.024.400,85	0,00	0,00	4.977.629,59	-46.771,26	-0,93%	-0,93%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.609.739,81	0,00	0,00	3.554.471,90	-55.267,91	-1,53%	-1,53%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	8.055.847,12	0,00	0,00	7.995.166,95	-60.680,17	-0,75%	-0,75%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	2.996.509,48	0,00	0,00	2.849.020,27	-147.489,21	-4,92%	-4,92%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.370.467,48	0,00	0,00	3.160.129,57	-210.337,91	-6,24%	-6,24%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.454.055,92	0,00	0,00	6.216.581,41	-237.474,51	-3,68%	-3,68%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.125.371,62	0,00	0,00	6.865.210,78	-260.160,84	-3,65%	-3,65%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>-259.869,30</b>	<b>-0,23%</b>	

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 (%)
HAZ FII - ATCR11	650.889,44	0,00	0,00	649.795,55	-1.093,89	-0,17%	0,00%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	1.876.963,49	0,00	0,00	1.875.279,72	-1.683,77	-0,09%	-
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	165.802,54	0,00	0,00	163.503,52	-2.299,02	-1,39%	-1,39%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.054.567,72	0,00	1.041.397,92	0,00	-13.169,80	-1,25%	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	2.582.454,19	0,00	0,00	2.567.445,25	-15.008,94	-0,58%	-0,58%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	488.476,74	500.000,00	0,00	869.696,05	-118.780,69	-11,71%	-13,15%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	490.142,27	500.000,00	0,00	852.457,57	-137.684,70	-13,62%	-14,44%
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	1.135.014,47	0,00	0,00	995.682,09	-139.332,38	-12,28%	-12,28%
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	487.866,64	500.000,00	0,00	839.706,67	-148.159,97	-14,80%	-15,61%
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	1.714.081,44	-285.918,56	-14,30%	-15,58%
				<b>Total Renda Variável</b>	<b>-863.131,72</b>	<b>-7,58%</b>	

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 IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.083.847,67	692.824,68	600.000,00	11.541.128,63	364.456,28	3,19%	3,27%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.150.367,11	1.617.097,62	1.912.547,78	8.103.578,01	248.661,06	2,80%	2,95%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.897.693,98	0,00	159.004,51	5.986.011,62	247.322,15	4,27%	1,50%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.204.932,15	0,00	0,00	8.444.514,56	239.582,41	2,92%	2,92%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	7.785.333,36	0,00	0,00	7.995.166,95	209.833,59	2,70%	2,70%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.163.152,37	0,00	0,00	6.358.215,09	195.062,72	3,16%	3,16%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	31.401.233,28	17.233.000,00	14.360.508,14	192.274,86	1,12%	3,12%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.265.151,98	2.660.592,28	4.661.643,76	4.454.791,05	190.690,55	2,80%	2,94%
BRASECO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	6.712.210,06	0,00	4.000.017,85	2.883.053,27	170.861,06	2,90%	3,14%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	4.949.714,81	9.202.103,02	9.669.779,21	4.642.946,40	160.907,78	2,71%	3,15%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	11.063.467,87	1.802.000,00	13.005.733,28	0,00	140.265,41	1,14%	3,13%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.474.677,36	0,00	0,00	3.554.471,90	79.794,54	2,30%	2,30%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.794.843,22	0,00	0,00	6.865.210,78	70.367,56	1,04%	1,04%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.391.368,70	1.854.908,62	3.402.561,86	2.909.664,42	65.948,96	2,52%	3,02%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.153.378,39	0,00	0,00	6.216.581,41	63.203,02	1,03%	1,03%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.216.584,98	0,00	31.633,58	1.227.536,98	42.585,58	3,55%	0,90%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	840.829,72	0,00	23.739,23	852.095,97	35.005,48	4,25%	4,25%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	606.419,57	0,00	16.484,65	611.301,32	21.366,40	3,58%	3,59%
SANTANDER TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.746.244,26	5.674.167,18	8.436.678,46	0,00	16.267,02	0,38%	3,00%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	992.731,76	0,00	0,00	998.456,96	5.725,20	0,58%	0,58%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	15.998,21	0,00	0,00	8.428,50	-7.569,71	-47,32%	-47,34%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	2.862.032,45	0,00	0,00	2.849.020,27	-13.012,18	-0,45%	-0,45%



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 ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	5.000.000,00	0,00	4.977.629,59	-22.370,41	-0,45%	2,55%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.185.016,29	0,00	0,00	3.160.129,57	-24.886,72	-0,78%	-0,78%
				Total Renda Fixa	2.692.342,61	2,46%	

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 (%)
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	954.311,05	0,00	1.041.397,92	0,00	87.086,87	9,13%	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	0,00	2.500.000,00	0,00	2.567.445,25	67.445,25	2,70%	-
HAZ FII - ATCR11	648.913,19	0,00	0,00	649.795,55	882,36	0,14%	0,00%
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	167.998,29	0,00	0,00	163.503,52	-4.494,77	-2,68%	-2,68%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	1.881.874,89	0,00	0,00	1.875.279,72	-6.595,17	-0,35%	-
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	1.007.346,77	0,00	0,00	995.682,09	-11.664,68	-1,16%	-1,16%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	0,00	1.000.000,00	0,00	869.696,05	-130.303,95	-13,74%	-7,37%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	852.457,57	-147.542,43	-15,33%	-5,57%
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	839.706,67	-160.293,33	-16,87%	-5,19%
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	1.714.081,44	-285.918,56	-14,30%	-5,82%
				<b>Total Renda Variável</b>	<b>-591.398,41</b>	<b>-4,25%</b>	