

# 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 IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	39.516.844,92	12,87%	726	0,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	5.628.057,91	1,83%	273	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	36.279.103,79	11,82%	1.438	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	5.851.615,99	1,91%	143	0,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2030	18.713.072,00	6,10%	34	9,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	6.417.352,04	2,09%	539	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	33.435.934,40	10,89%	179	3,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+3	Não há	6.966.547,12	2,27%	257	14,91%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	10.855.684,80	3,54%	38	6,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	1.562.145,41	0,51%	120	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	7.100.718,94	2,31%	199	1,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA REFERENCIADO LP	D+1	Não há	7.903.910,59	2,57%	63	5,21%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	D+1	Não há	13.291.980,50	4,33%	53	10,80%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	2.456.034,51	0,80%	79	1,80%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRASESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	15.476.174,39	5,04%	84	2,89%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	36.749.573,47	11,97%	761	0,79%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	976.260,26	0,32%	98	1,02%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.169.998,80	1,03%	5.121	2,25%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	3.725.483,86	1,21%	21	9,81%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	10.631.762,51	3,46%	5.627	1,77%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	1.355.887,99	0,44%	200	1,08%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	6.126.714,25	2,00%	538	11,05%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

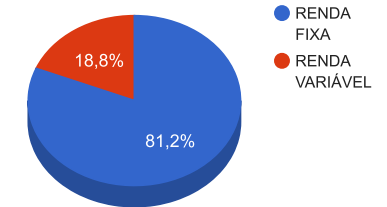
Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	7.529.078,38	2,45%	196	1,96%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	15.165.129,70	4,94%	26	4,10%	Artigo 8º, Inciso III
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	4.844.544,94	1,58%	69	3,64%	Artigo 8º, Inciso III
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	5.226.277,87	1,70%	590	12,16%	Desenquadrado - RV
		<b>TOTAL -</b>	<b>306.955.889,34</b>				

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

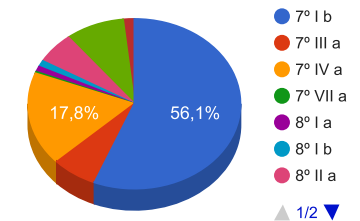
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	172.327.077,32	56,14%	15,00%	25,00%	70,00%	42.542.045,22
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	21.195.891,09	6,91%	8,00%	15,00%	60,00%	162.977.642,51
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	54.681.782,37	17,81%	5,00%	15,00%	30,00%	37.404.984,43
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	8,00%	15,00%	46.043.383,40
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	976.260,26	0,32%	0,00%	2,00%	5,00%	14.371.534,21
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	15.347.794,47
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>249.181.011,04</b>	<b>81,18%</b>	<b>28,00</b>	<b>70,00</b>	<b>190,00</b>	<b>-</b>

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	3.169.998,80	1,03%	1,00%	5,00%	10,00%	27.525.590,13
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	30,00%	3.725.483,86	1,21%	0,00%	0,00%	3,00%	5.483.192,82
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	18.114.364,75	5,90%	1,00%	5,00%	10,00%	12.581.224,18
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	27.538.753,02	8,97%	2,00%	10,00%	10,00%	3.156.835,91
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	15.347.794,47
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	15.347.794,47
Desenquadrado - RV	0,00%	5.226.277,87	1,70%	0,00%	0,00%	0,00%	-5.226.277,87
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>57.774.878,30</b>	<b>18,82%</b>	<b>4,00</b>	<b>30,00</b>	<b>44,00</b>	<b>-</b>

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 "	172.327.077,32	56,14%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	21.195.891,09	6,91%	8,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	54.681.782,37	17,81%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	976.260,26	0,32%	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%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>249.181.011,04</b>	<b>81,18%</b>	<b>28,00</b>	<b>190,00</b>

Artigos - Renda Variável	Base: junho / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	3.169.998,80	1,03%	1,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	3.725.483,86	1,21%	0,00%	3,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	18.114.364,75	5,90%	1,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	1,00%
Artigo 8º, Inciso III	27.538.753,02	8,97%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RV	5.226.277,87	1,70%	0,00%	0,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>57.774.878,30</b>	<b>18,82%</b>	<b>4,00</b>	<b>44,00</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
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	113.525.385,86	36,98%	0,01%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	109.135.993,10	35,55%	0,03%
SICREDI	21.195.891,09	6,91%	0,06%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	15.476.174,39	5,04%	0,00%
SAFRA ASSET MANAGEMENT	15.165.129,70	4,94%	0,01%
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	12.192.824,99	3,97%	0,49%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	10.631.762,51	3,46%	0,05%
INFINITY ASSET MANAGEMENT	7.300.579,45	2,38%	1,34%
META ASSET MANAGEMENT	1.355.887,99	0,44%	0,90%
FINAXIS CORRETORA	976.260,26	0,32%	1,02%

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 + 6,00% ao ano	1,75%	5,59%	3,38%	5,59%	10,58%	20,70%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,39%	5,38%	2,81%	5,38%	10,06%	21,04%	0,20%	0,272%	0,37%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,38%	2,37%	2,77%	2,37%	3,75%	7,17%	0,20%	0,273%	4,03%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,38%	2,39%	2,76%	2,39%	3,80%	7,34%	0,20%	0,273%	3,95%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,63%	3,95%	1,31%	3,95%	9,85%	23,30%	0,15%	1,416%	1,37%
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	1,62%	4,67%	2,94%	4,67%	8,64%	16,47%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-1,10%	-5,25%	-2,50%	-5,25%	-6,98%	-18,85%	0,25%	0,927%	3,52%
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 PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,50%	3,15%	1,53%	3,15%	7,41%	21,42%	0,20%	0,023%	0,09%
IMA-B 5	0,45%	2,81%	-0,70%	2,81%	9,73%	22,81%	-	-	-
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,39%	2,38%	-0,90%	2,38%	8,89%	21,34%	0,50%	3,173%	2,69%
BRABESCO 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%

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 Geral	0,12%	2,44%	-0,99%	2,44%	8,47%	23,90%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,07%	2,17%	-1,16%	2,17%	7,96%	23,54%	0,20%	2,212%	2,35%
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%	-	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	0,02%	2,33%	-1,48%	2,33%	8,76%	26,56%	0,20%	2,911%	2,83%
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%	-	-	-
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%
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA REFERENCIADO LP	-0,38%	1,22%	-3,56%	1,22%	7,95%	22,31%	0,20%	3,887%	4,56%

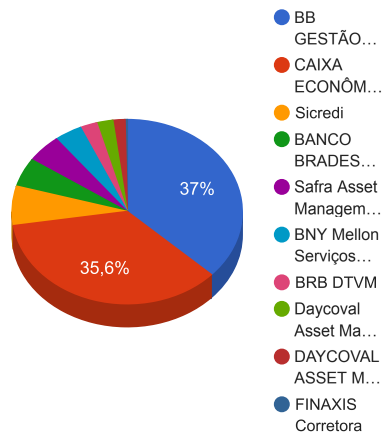


Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (junho / 2018)

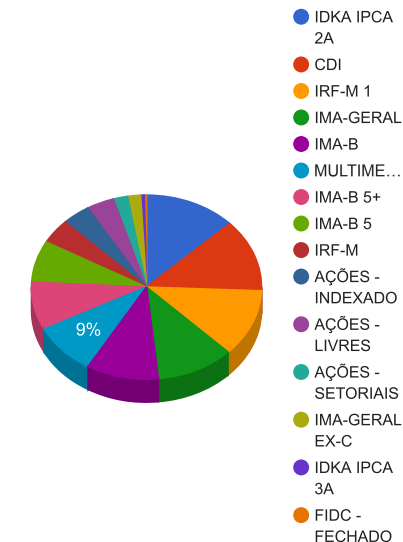
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,52%	3,17%	1,56%	3,17%	7,35%	21,15%	-	-	-
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,62%	3,51%	1,72%	3,51%	8,18%	23,78%	1,00%	0,735%	0,83%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,43%	3,17%	1,37%	3,17%	8,84%	23,36%	0,60%	2,653%	2,58%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	0,13%	3,29%	4,08%	3,29%	18,34%	53,42%	1,00%	3,824%	11,97%
Ibovespa	-5,20%	-4,76%	-14,76%	-4,76%	15,68%	41,22%	-	-	-
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	-4,34%	-1,24%	-13,11%	-1,24%	15,95%	42,30%	2,50%	10,972%	18,36%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	-4,43%	-9,63%	-14,83%	-9,63%	5,53%	20,79%	2,00%	11,705%	17,97%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	-5,20%	-4,95%	-14,76%	-4,95%	14,78%	39,67%	0,50%	12,217%	18,48%
IBX	-5,19%	-5,23%	-14,85%	-5,23%	14,67%	40,34%	-	-	-
META VALOR FI AÇÕES	-4,95%	-1,68%	-13,77%	-1,68%	26,28%	72,38%	2,50%	14,529%	21,99%
BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES	-5,28%	-6,21%	-15,22%	-6,21%	12,10%	34,51%	1,50%	11,120%	17,95%
SMLL	-3,66%	-9,00%	-12,53%	-9,00%	13,97%	52,19%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-2,60%	3,61%	-9,25%	3,61%	32,89%	59,18%	2,00%	10,201%	16,87%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	113.525.385,86	36,98%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	109.135.993,10	35,55%
Sicredi	21.195.891,09	6,91%
BANCO BRADESCO	15.476.174,39	5,04%
Safra Asset Management	15.165.129,70	4,94%
BNY Mellon Serviços Financeiros	11.987.650,50	3,91%
BRB DTVM	7.300.579,45	2,38%
Daycoval Asset Management	6.966.547,12	2,27%
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS	5.226.277,87	1,70%
FINAXIS Corretora	976.260,26	0,32%



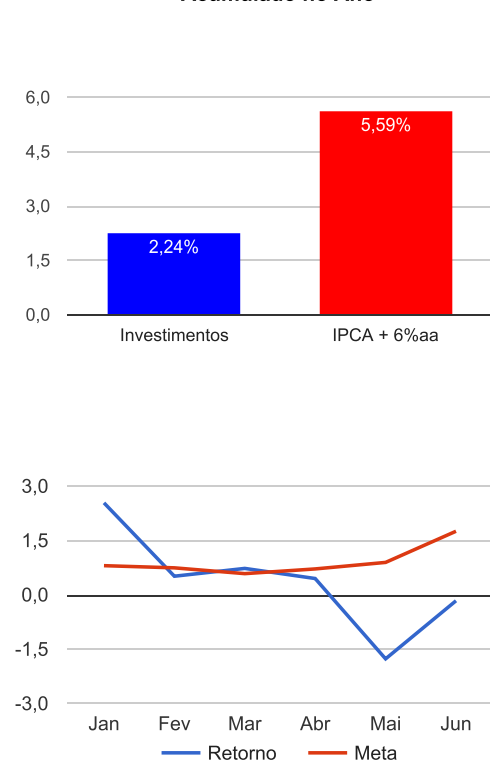
Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	39.516.844,92	12,87%
CDI	39.205.607,98	12,77%
IRF-M 1	36.279.103,79	11,82%
IMA-GERAL	33.435.934,40	10,89%
IMA-B	31.028.563,42	10,11%
MULTIMERCADO	27.538.753,02	8,97%
IMA-B 5+	25.813.790,94	8,41%
IMA-B 5	22.442.721,51	7,31%
IRF-M	13.291.980,50	4,33%
AÇÕES - INDEXADO	12.121.760,53	3,95%
AÇÕES - LIVRES	11.987.650,50	3,91%
AÇÕES - SETORIAIS	6.126.714,25	2,00%
IMA-GERAL EX-C	5.628.057,91	1,83%
IDKA IPCA 3A	1.562.145,41	0,51%
FIDC - FECHADO	976.260,26	0,32%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	285.820.098,11	2.836.852,82	5.338.400,85	290.560.428,82	7.241.878,74	2,53%	0,80%	316,13%	1,75%
Fevereiro	290.560.428,82	8.000.303,34	3.678.258,57	296.383.002,93	1.500.529,34	0,51%	0,74%	68,91%	2,98%
Março	296.383.002,93	9.387.439,54	6.479.867,60	301.458.126,67	2.167.551,80	0,72%	0,58%	125,47%	1,82%
Abril	301.458.126,67	17.100.593,69	16.266.085,77	303.638.430,66	1.345.796,07	0,45%	0,71%	62,90%	1,71%
Mai	303.638.430,66	13.588.285,10	8.005.528,34	303.741.834,78	-5.479.352,64	-1,77%	0,89%	-199,39%	2,34%
Junho	303.741.834,78	20.683.148,28	16.949.889,07	306.955.889,34	-519.204,65	-0,17%	1,75%	-9,63%	2,78%
Acumulado no ano					6.257.198,66	2,24%	5,59%	40,15%	

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(%)
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.771.421,48	0,00	0,00	5.851.615,99	80.194,51	1,39%	0,27%	1,39%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	18.458.160,00	0,00	0,00	18.713.072,00	254.912,00	1,38%	0,27%	1,38%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.708.426,80	0,00	0,00	10.855.684,80	147.258,00	1,38%	0,27%	1,38%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.552.378,61	0,00	0,00	1.562.145,41	9.766,80	0,63%	1,42%	0,63%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	2.441.187,63	0,00	0,00	2.456.034,51	14.846,88	0,61%	1,06%	0,61%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	26.981.519,05	9.119.206,03	0,00	36.279.103,79	178.378,71	0,49%	0,68%	0,50%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	30.668.491,29	8.749.974,66	2.829.985,76	36.749.573,47	161.093,28	0,41%	0,02%	0,50%
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	6.939.723,35	0,00	0,00	6.966.547,12	26.823,77	0,39%	3,17%	0,39%
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	15.417.455,88	0,00	0,00	15.476.174,39	58.718,51	0,38%	3,29%	0,38%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	39.403.492,77	0,00	0,00	39.516.844,92	113.352,15	0,29%	2,62%	0,29%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.799.162,77	2.813.967,59	0,00	5.628.057,91	14.927,55	0,27%	2,07%	0,19%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	33.410.925,42	0,00	0,00	33.435.934,40	25.008,98	0,07%	2,21%	0,07%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	13.289.985,93	0,00	0,00	13.291.980,50	1.994,57	0,02%	2,91%	0,02%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.439.969,56	0,00	0,00	6.417.352,04	-22.617,52	-0,35%	3,92%	-0,35%
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA REFERENCIADO LP	7.934.218,45	0,00	0,00	7.903.910,59	-30.307,86	-0,38%	3,89%	-0,38%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	987.071,28	0,00	697,28	976.260,26	-10.113,74	-1,02%	0,93%	-1,10%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.239.217,05	0,00	9.119.206,03	0,00	-120.011,02	-1,30%	3,95%	-0,36%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.349.414,78	0,00	5.000.000,00	7.100.718,94	-248.695,84	-2,01%	5,00%	-1,07%
Total Renda Fixa					655.529,73	0,26%	1,74%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	4.814.827,62	0,00	0,00	4.844.544,94	29.717,32	0,62%	0,74%	0,62%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	7.496.794,82	0,00	0,00	7.529.078,38	32.283,56	0,43%	2,65%	0,43%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	15.145.028,38	0,00	0,00	15.165.129,70	20.101,32	0,13%	3,82%	0,13%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	10.915.446,67	0,00	0,00	10.631.762,51	-283.684,16	-2,60%	10,20%	-2,60%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	5.463.617,44	0,00	0,00	5.226.277,87	-237.339,57	-4,34%	10,97%	-4,34%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	6.410.741,63	0,00	0,00	6.126.714,25	-284.027,38	-4,43%	11,71%	-4,43%
META VALOR FI AÇÕES	1.426.457,16	0,00	0,00	1.355.887,99	-70.569,17	-4,95%	14,53%	-4,95%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	3.929.861,46	0,00	0,00	3.725.483,86	-204.377,60	-5,20%	12,22%	-5,20%
BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES	3.346.837,50	0,00	0,00	3.169.998,80	-176.838,70	-5,28%	11,12%	-5,28%
Total Renda Variável					-1.174.734,38	-1,99%	7,26%	

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 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	18.207.980,00	0,00	0,00	18.713.072,00	505.092,00	2,77%	2,77%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	29.156.461,14	15.126.557,53	7.998.834,62	36.749.573,47	465.389,42	1,34%	1,53%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	26.352.431,26	11.970.971,30	2.400.000,00	36.279.103,79	355.701,23	1,12%	1,18%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.564.514,10	0,00	0,00	10.855.684,80	291.170,70	2,76%	2,76%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.691.644,00	0,00	0,00	5.851.615,99	159.971,99	2,81%	2,81%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	420.488,59	2.000.000,00	0,00	2.456.034,51	35.545,92	1,47%	1,68%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	34.489.413,64	5.000.000,00	0,00	39.516.844,92	27.431,28	0,16%	0,13%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.541.918,25	0,00	0,00	1.562.145,41	20.227,16	1,31%	1,31%
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	688.279,07	0,00	694.518,87	0,00	6.239,80	1,05%	-100,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	5.627.935,21	0,00	5.628.057,91	122,70	-0,26%	-0,93%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.001.292,32	0,00	8.943,65	976.260,26	-16.088,41	-1,62%	-2,50%
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	7.029.562,32	0,00	0,00	6.966.547,12	-63.015,20	-0,90%	-0,90%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	15.626.292,18	0,00	0,00	15.476.174,39	-150.117,79	-0,96%	-0,96%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	9.497.031,15	4.000.000,00	0,00	13.291.980,50	-205.050,65	-1,52%	-1,48%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.660.541,04	0,00	0,00	6.417.352,04	-243.189,00	-3,65%	-3,65%
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA REFERENCIADO LP	12.203.976,00	0,00	4.000.000,01	7.903.910,59	-300.065,40	-3,60%	-3,56%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	33.828.833,66	0,00	0,00	33.435.934,40	-392.899,26	-1,16%	-1,16%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.557.634,79	0,00	9.119.206,03	0,00	-438.428,76	-4,59%	-3,68%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	25.170.148,81	0,00	17.000.000,00	7.100.718,94	-1.069.429,87	-5,87%	-6,24%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>-1.011.392,14</b>	<b>-0,42%</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 (%)
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	12.939.613,62	1.695.000,00	0,00	15.165.129,70	530.516,08	3,69%	4,08%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	4.266.327,71	500.000,00	0,00	4.844.544,94	78.217,23	1,70%	1,72%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	3.458.976,12	4.000.000,00	0,00	7.529.078,38	70.102,26	1,10%	1,37%
META VALOR FI AÇÕES	638.989,32	900.000,00	0,00	1.355.887,99	-183.101,33	-11,14%	-13,77%
BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES	3.739.157,61	0,00	0,00	3.169.998,80	-569.158,81	-15,22%	-15,22%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	4.370.451,86	0,00	0,00	3.725.483,86	-644.968,00	-14,76%	-14,76%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	5.447.350,69	551.563,03	0,00	5.226.277,87	-772.635,85	-12,79%	-13,11%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	7.193.690,36	0,00	0,00	6.126.714,25	-1.066.976,11	-14,83%	-14,83%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	11.715.127,06	0,00	0,00	10.631.762,51	-1.083.364,55	-9,25%	-9,25%
Total Renda Variável					-3.641.369,08	-5,85%	

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	33.474.038,29	5.000.000,00	0,00	39.516.844,92	1.042.806,63	3,19%	3,16%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	18.279.268,00	0,00	517.677,25	18.713.072,00	951.481,25	5,31%	2,37%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	34.459.440,75	18.138.194,62	16.792.954,22	36.749.573,47	944.892,32	2,81%	3,15%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	21.996.837,33	15.932.208,30	2.400.000,00	36.279.103,79	750.058,16	2,83%	2,95%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	32.725.148,73	0,00	0,00	33.435.934,40	710.785,67	2,17%	2,17%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.601.847,00	0,00	294.454,94	10.855.684,80	548.292,74	5,27%	2,39%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	25.679.788,37	0,00	19.000.000,00	7.100.718,94	420.930,57	-0,41%	-0,78%
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	15.086.032,91	0,00	0,00	15.476.174,39	390.141,48	2,59%	2,59%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.713.752,90	0,00	163.288,11	5.851.615,99	301.151,20	5,37%	5,38%
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA REFERENCIADO LP	11.627.508,48	0,00	4.000.000,01	7.903.910,59	276.402,12	1,18%	1,22%
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	8.288.826,26	0,00	1.500.000,00	6.966.547,12	177.720,86	2,34%	2,38%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	9.143.177,06	4.000.000,00	0,00	13.291.980,50	148.803,44	2,29%	2,33%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.351.574,98	0,00	0,00	6.417.352,04	65.777,06	1,04%	1,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.544.515,96	0,00	42.211,20	1.562.145,41	59.840,65	3,94%	3,95%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	412.676,52	2.000.000,00	0,00	2.456.034,51	43.357,99	3,39%	3,60%
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	1.008.025,97	0,00	1.036.969,30	0,00	28.943,33	3,40%	-100,00%
AZ QUEST LUCE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	813.457,07	0,00	825.205,36	0,00	11.748,29	1,44%	3,32%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.112.369,66	0,00	9.119.206,03	0,00	6.836,37	0,08%	1,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	5.627.935,21	0,00	5.628.057,91	122,70	-0,26%	2,55%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.030.332,02	0,00	32.497,46	976.260,26	-21.574,30	-2,15%	-5,25%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>6.858.518,53</b>	<b>2,79%</b>	



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 (%)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	9.525.525,68	825.205,36	0,00	10.631.762,51	281.031,47	3,52%	3,61%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	5.605.581,52	9.295.303,34	0,00	15.165.129,70	264.244,84	4,70%	3,29%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	4.192.466,05	500.000,00	0,00	4.844.544,94	152.078,89	3,49%	3,51%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	7.432.646,59	0,00	7.529.078,38	96.431,79	2,15%	3,17%
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	981.717,03	0,00	993.566,32	0,00	11.849,29	1,21%	-12,19%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	4.792.870,50	551.563,03	0,00	5.226.277,87	-118.155,66	-0,88%	-1,24%
META VALOR FI AÇÕES	202.083,67	1.300.000,00	0,00	1.355.887,99	-146.195,68	0,73%	-1,68%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	3.919.442,29	0,00	0,00	3.725.483,86	-193.958,43	-4,95%	-4,95%
BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES	2.472.234,47	993.566,32	0,00	3.169.998,80	-295.801,99	-5,92%	-6,21%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	6.779.558,64	0,00	0,00	6.126.714,25	-652.844,39	-9,63%	-9,63%
Total Renda Variável					-601.319,87	1,32%	