

# Relatório Analítico dos Investimentos em abril de 2018

SIRU 

## Carteira consolidada de investimentos - base (abril / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	32.230.284,54	6,00%	223	1,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	60.799.957,34	11,31%	589	1,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	51.784.074,05	9,63%	203	6,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	40.158.274,73	7,47%	742	0,51%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	52.831.194,56	9,83%	239	2,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	25.026.702,66	4,66%	17	10,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	630.431,83	0,12%	192	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	64.353.050,55	11,97%	729	1,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	9.357.079,87	1,74%	23	2,51%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	6.225.239,60	1,16%	94	1,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	103.320.276,16	19,22%	94	7,45%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	131.222,03	0,02%	719	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	8.083.423,60	1,50%	37	3,40%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	5.116.719,62	0,95%	119	0,37%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	Não se aplica	Não se aplica	9.530,74	0,00%	1	0,83%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	54.024,95	0,01%	47	0,37%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	7.686.160,12	1,43%	67	1,65%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BRADERCO H VALUATION IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	5.090.014,75	0,95%	873	6,90%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	10.142.551,86	1,89%	359	3,33%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	D+4	Não há	5.083.048,81	0,95%	83	3,54%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	5.912.011,86	1,10%	3.154	1,96%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	4.095.055,81	0,76%	2.061	1,03%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

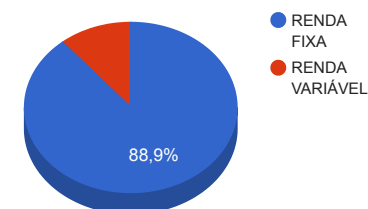
Carteira consolidada de investimentos - base (abril / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	15.029.471,35	2,80%	1.304	0,92%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	4.362.657,25	0,81%	11.970	0,40%	Artigo 8º, Inciso III
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	Não se aplica	Não se aplica	3.465.521,75	0,64%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	2.886.767,46	0,54%	33	1,09%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se aplica	Não se aplica	1.340.086,21	0,25%		2,58%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	2.253.377,91	0,42%		3,41%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	10.029.544,19	1,87%	4.924	5,03%	Desenquadrado - RF
		<b>TOTAL -</b>	<b>537.487.756,16</b>				

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

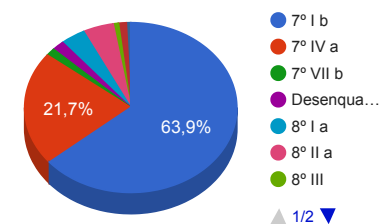
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	343.396.289,73	63,89%	0,00%	69,49%	100,00%	194.091.466,43
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	23,00%	60,00%	322.492.653,70
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	116.651.641,41	21,70%	0,00%	1,00%	40,00%	98.343.461,05
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	63.555,69	0,01%	0,00%	0,01%	5,00%	26.810.832,12
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	7.686.160,12	1,43%	0,00%	1,00%	5,00%	19.188.227,69
Desenquadrado - RF	0,00%	10.029.544,19	1,87%	2,00%	5,00%	5,00%	16.844.843,62
Em Enquadramento - RF	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	26.874.387,81
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>477.827.191,14</b>	<b>88,90%</b>	<b>4,00</b>	<b>104,50</b>	<b>530,00</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%	20.315.615,42	3,78%	0,00%	0,00%	30,00%	140.930.711,43
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	25.036.539,02	4,66%	0,00%	3,00%	20,00%	82.461.012,21
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	4.362.657,25	0,81%	0,00%	1,00%	10,00%	49.386.118,37
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	6.352.289,21	1,18%	0,00%	1,00%	5,00%	20.522.098,60
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	3.593.464,12	0,67%	0,00%	0,05%	5,00%	23.280.923,69
Desenquadrado - RV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	26.874.387,81
Em Enquadramento - RV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	26.874.387,81
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>59.660.565,02</b>	<b>11,10%</b>	<b>4,00</b>	<b>15,05</b>	<b>130,00</b>	<b>-</b>

Distribuição por Artigo / Resolução



## Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: abril / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	50,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	343.396.289,73	63,89%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	116.651.641,41	21,70%	0,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	63.555,69	0,01%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	7.686.160,12	1,43%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	10.029.544,19	1,87%	2,00%	5,00%
Em Enquadramento - RF	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>477.827.191,14</b>	<b>88,90%</b>	<b>4,00</b>	<b>530,00</b>

Artigos - Renda Variável	Base: abril / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	20.315.615,42	3,78%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	25.036.539,02	4,66%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	4.362.657,25	0,81%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	6.352.289,21	1,18%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	3.593.464,12	0,67%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RV	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Em Enquadramento - RV	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>59.660.565,02</b>	<b>11,10%</b>	<b>4,00</b>	<b>130,00</b>

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (abril / 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	187.998.888,55	34,98%	0,05%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	139.826.061,47	26,01%	0,01%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	131.523.185,86	24,47%	0,01%
WESTERN ASSET	39.531.911,77	7,35%	0,08%
ICATU VANGUARDA	10.029.544,19	1,87%	0,04%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	9.357.079,87	1,74%	0,00%
ITAÚ UNIBANCO	5.116.719,62	0,95%	0,00%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	4.095.055,81	0,76%	0,02%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	3.465.521,75	0,64%	0,17%
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUTURADOS LTDA	2.896.298,20	0,54%	0,02%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	2.253.377,91	0,42%	1,51%
AQ3 ASSET MANAGEMENT	1.340.086,21	0,25%	1,01%
VILA RICA CAPITAL	54.024,95	0,01%	0,10%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI + 3,50% ao ano	0,81%	3,26%	2,36%	4,98%	11,85%	31,32%	-	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-1,81%	-40,01%	-55,56%	-20,45%	-32,91%	-82,92%	0,39%	1,938%	117,80%
IDKA IPCA 2 Anos	1,36%	6,14%	3,07%	3,04%	8,51%	23,34%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,17%	5,58%	2,34%	2,47%	7,60%	21,30%	0,20%	0,881%	2,27%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,15%	5,71%	2,36%	2,56%	7,66%	21,41%	0,20%	0,875%	2,27%
110% do CDI	0,57%	2,33%	1,68%	3,58%	8,95%	25,17%	-	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-19,15%	-35,69%	-33,19%	-44,94%	-54,52%	-63,83%	0,00%	31,510%	-
CDI	0,52%	2,11%	1,52%	3,25%	8,10%	22,64%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,52%	2,11%	1,53%	3,28%	8,19%	22,87%	0,20%	0,018%	0,11%
IRF-M 1	0,51%	2,32%	1,71%	3,53%	8,94%	24,04%	-	-	-
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,48%	2,23%	1,66%	3,42%	8,80%	23,83%	0,00%	0,067%	0,64%
IRF-M	0,47%	4,25%	2,92%	5,64%	12,79%	32,67%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,43%	4,18%	2,86%	5,52%	12,49%	32,10%	0,20%	0,827%	4,41%
IRF-M 1+	0,45%	4,97%	3,37%	6,41%	14,19%	36,11%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,31%	5,00%	3,29%	6,36%	13,85%	35,53%	0,20%	1,179%	5,77%
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	0,13%	5,76%	3,48%	7,12%	14,62%	37,94%	0,30%	1,619%	7,94%
IMA-B 5	0,42%	3,97%	2,60%	4,99%	11,65%	26,36%	-	-	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	0,45%	5,16%	3,51%	6,13%	13,24%	29,21%	0,40%	0,794%	4,89%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,41%	3,89%	2,55%	4,89%	11,44%	25,88%	0,20%	0,481%	3,46%
IPCA	0,22%	0,92%	0,63%	1,65%	2,76%	6,96%	-	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,48%	4,29%	2,89%	5,51%	12,98%	30,58%	0,20%	0,470%	4,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,33%	3,64%	2,12%	4,60%	10,01%	-	0,40%	0,511%	5,50%
IMA-B 5+	-0,63%	5,27%	0,31%	4,61%	10,45%	31,07%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,64%	5,17%	0,25%	4,46%	10,24%	30,38%	0,20%	2,119%	11,67%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	-0,65%	5,12%	0,23%	4,42%	10,00%	30,36%	0,20%	2,137%	11,94%
IMA-B	-0,14%	4,79%	1,34%	4,85%	10,93%	29,34%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,42%	-0,43%	-1,46%	0,13%	2,51%	8,43%	0,20%	0,097%	4,15%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,23%	4,85%	2,80%	5,43%	12,46%	28,51%	0,20%	0,767%	5,44%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,15%	4,71%	1,28%	4,74%	10,66%	28,76%	0,20%	1,342%	8,97%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,18%	4,77%	1,34%	4,80%	10,95%	29,73%	0,20%	1,382%	9,10%

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

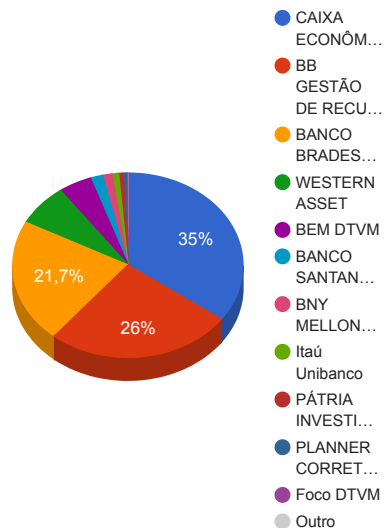
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Global BDRX	6,98%	4,52%	2,83%	11,32%	24,80%	33,97%	-	-	-
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7,64%	3,71%	2,32%	9,81%	21,09%	28,03%	1,50%	7,806%	14,40%
SMLL	2,37%	6,50%	2,07%	11,22%	32,49%	86,18%	-	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	1,86%	5,63%	1,02%	10,32%	32,09%	78,34%	1,50%	7,041%	17,89%
Ibovespa	0,88%	12,71%	1,42%	15,89%	31,67%	59,74%	-	-	-
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	1,92%	19,80%	5,28%	20,67%	40,05%	67,94%	2,00%	7,060%	19,57%
BRADERCO H VALUATION IBOVESPA FI AÇÕES	0,57%	16,83%	3,72%	19,36%	39,42%	74,59%	2,00%	7,863%	20,91%
IBX-50	0,63%	12,97%	1,12%	16,12%	32,13%	58,89%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	0,46%	12,86%	0,82%	15,65%	33,10%	53,48%	0,70%	8,015%	19,31%
S&P 500	0,27%	-0,96%	-6,22%	2,83%	11,07%	28,22%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	0,59%	-0,32%	-5,41%	4,75%	17,74%	52,90%	1,00%	8,420%	11,82%
IPCA	0,22%	0,92%	0,63%	1,65%	2,76%	6,96%	-	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,30%	0,006%	20,80%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	-	-	-	-	-	-	1,00%	-	-
IDIV	-1,42%	8,80%	-0,99%	6,56%	18,46%	65,00%	-	-	-
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,41%	15,55%	3,80%	18,54%	29,66%	69,78%	1,50%	7,661%	18,42%
IFIX	-0,86%	4,98%	2,28%	4,99%	14,80%	50,39%	-	-	-

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

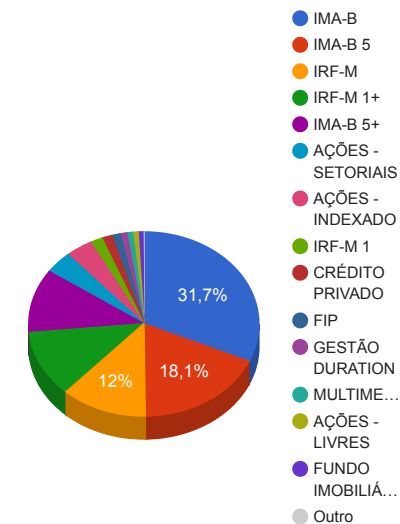
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,00%	24,70%	24,71%	24,70%	4,93%	-29,33%	1,50%	0,000%	30,62%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,00%	-	0,00%	-	0,00%	0,00%	0,14%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	187.998.888,55	34,98%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	139.826.061,47	26,01%
BANCO BRADESCO	116.493.714,51	21,67%
WESTERN ASSET	39.531.911,77	7,35%
BEM DTVM	25.059.015,54	4,66%
BANCO SANTANDER	9.357.079,87	1,74%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	6.981.823,27	1,30%
Itaú Unibanco	5.116.719,62	0,95%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	3.465.521,75	0,64%
PLANNER CORRETORA	2.253.377,91	0,42%
Foco DTVM	1.340.086,21	0,25%
BRL Trust Investimentos	54.024,95	0,01%
Brasil Plural	9.530,74	0,00%



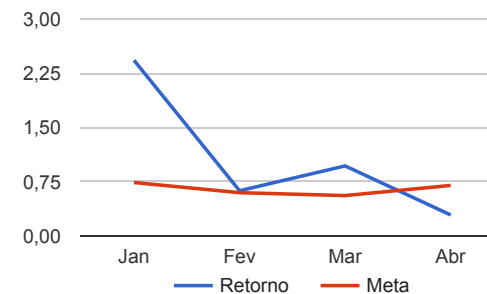
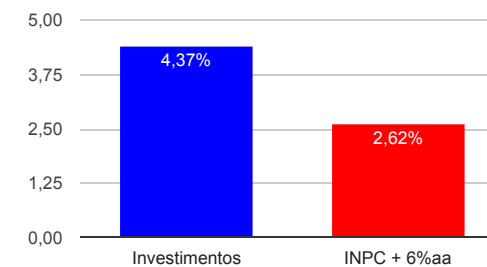
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	170.345.473,10	31,69%
IMA-B 5	97.415.261,93	18,12%
IRF-M	64.353.050,55	11,97%
IRF-M 1+	62.860.738,75	11,70%
IMA-B 5+	59.867.497,65	11,14%
AÇÕES - SETORIAIS	20.941.483,21	3,90%
AÇÕES - INDEXADO	20.315.615,42	3,78%
IRF-M 1	9.357.079,87	1,74%
CRÉDITO PRIVADO	7.686.160,12	1,43%
FIP	6.352.289,21	1,18%
GESTÃO DURATION	5.116.719,62	0,95%
MULTIMERCADO	4.362.657,25	0,81%
AÇÕES - LIVRES	4.095.055,81	0,76%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.593.464,12	0,67%
IDKA IPCA 2A	630.431,83	0,12%
CDI	131.222,03	0,02%
FIDC - FECHADO	63.555,69	0,01%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	515.807.497,39	10.444.075,18	16.011.182,45	522.763.526,19	12.523.136,07	2,43%	0,74%	327,57%	1,65%
Fevereiro	522.763.526,19	13.340.335,05	11.777.052,88	527.612.975,14	3.286.166,78	0,63%	0,60%	104,84%	2,16%
Março	527.612.975,14	32.723.163,98	31.230.037,28	534.235.279,92	5.129.178,08	0,97%	0,56%	174,01%	1,73%
Abril	534.235.279,92	20.411.988,27	18.726.904,70	537.487.756,16	1.567.392,67	0,29%	0,70%	41,91%	1,73%
Acumulado no ano					22.505.873,60	4,37%	2,62%	166,98%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	133.209,91	0,00	2.668,47	131.222,03	680,59	0,51%	0,02%	0,52%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	7.649.694,22	0,00	0,00	7.686.160,12	36.465,90	0,48%	0,47%	0,48%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	24.913.606,74	0,00	0,00	25.026.702,66	113.095,92	0,45%	0,79%	0,45%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.125.346,94	0,00	5.836.115,45	9.357.079,87	67.848,38	0,45%	0,07%	0,48%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	64.079.018,70	0,00	0,00	64.353.050,55	274.031,85	0,43%	0,83%	0,43%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	32.097.063,48	0,00	0,00	32.230.284,54	133.221,06	0,42%	0,10%	0,42%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	627.830,01	0,00	0,00	630.431,83	2.601,82	0,41%	0,10%	0,41%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	48.992.271,83	0,00	9.000.000,00	40.158.274,73	166.002,90	0,34%	0,48%	0,41%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	5.100.109,38	0,00	0,00	5.116.719,62	16.610,24	0,33%	0,51%	0,33%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	52.670.023,71	0,00	0,00	52.831.194,56	161.170,85	0,31%	1,18%	0,31%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.210.872,05	0,00	0,00	6.225.239,60	14.367,55	0,23%	0,77%	0,23%
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	10.016.468,57	0,00	0,00	10.029.544,19	13.075,62	0,13%	1,62%	0,13%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	60.891.520,05	0,00	0,00	60.799.957,34	-91.562,71	-0,15%	1,34%	-0,15%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	103.509.526,30	0,00	0,00	103.320.276,16	-189.250,14	-0,18%	1,38%	-0,18%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	44.528.432,10	7.523.954,19	0,00	51.784.074,05	-268.312,24	-0,52%	2,12%	-0,64%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	8.136.326,08	0,00	0,00	8.083.423,60	-52.902,48	-0,65%	2,14%	-0,65%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	55.019,32	0,00	86,70	54.024,95	-907,67	-1,65%	1,94%	-1,81%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	11.786,73	0,00	0,00	9.530,74	-2.255,99	-19,14%	31,51%	-19,17%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>393.981,45</b>	<b>0,08%</b>	<b>1,12%</b>	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9.422.880,83	0,00	0,00	10.142.551,86	719.671,03	7,64%	7,81%	7,64%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	1.000.000,00	3.000.000,00	0,00	4.095.055,81	95.055,81	2,38%	7,06%	1,92%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	5.804.207,58	0,00	0,00	5.912.011,86	107.804,28	1,86%	7,04%	1,86%
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	10.923.196,07	3.888.034,08	0,00	15.029.471,35	218.241,20	1,47%	7,66%	0,41%
BRADESCO H VALUATION IBOVESPA FI AÇÕES	2.019.928,40	3.000.000,00	0,00	5.090.014,75	70.086,35	1,40%	7,86%	0,57%
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	2.020.705,07	3.000.000,00	0,00	5.083.048,81	62.343,74	1,24%	8,01%	0,46%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	4.337.103,77	0,00	0,00	4.362.657,25	25.553,48	0,59%	8,42%	0,59%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	2.246.175,80	0,00	0,00	2.253.377,91	7.202,11	0,32%	-	0,32%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	2.887.636,14	0,00	0,00	2.886.767,46	-868,68	-0,03%	0,01%	-0,03%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	3.468.590,68	0,00	0,00	3.465.521,75	-3.068,93	-0,09%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.342.923,60	0,00	0,00	1.340.086,21	-2.837,39	-0,21%	0,00%	0,00%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	4.013.805,86	0,00	3.888.034,08	0,00	-125.771,78	-3,13%	-	-
<b>Total Renda Variável</b>					<b>1.173.411,22</b>	<b>2,01%</b>	<b>7,09%</b>	