

## Relatório Analítico dos Investimentos em junho, 2º Trimestre e 1º semestre de 2018

SIRU 

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
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	32.854.733,23	6,28%	223	1,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	58.668.255,04	11,21%	539	1,57%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	48.870.599,85	9,34%	182	5,84%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	38.698.696,51	7,40%	711	0,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	51.323.311,12	9,81%	221	2,77%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	24.326.413,13	4,65%	20	9,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	642.547,78	0,12%	192	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	63.167.341,06	12,07%	700	1,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	164.213,25	0,03%	30	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	6.081.574,41	1,16%	93	1,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	99.464.932,57	19,01%	83	7,88%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	4.929.179,95	0,94%	761	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	7.630.361,49	1,46%	34	4,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	12.541.928,70	2,40%	133	0,75%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	Não se aplica	Não se aplica	8.438,83	0,00%			Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	32.519,21	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	7.595.834,51	1,45%	70	1,62%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BRADERCO H VALUATION IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	4.381.896,20	0,84%	854	6,29%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	11.365.952,12	2,17%	846	3,31%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	D+4	Não há	4.269.979,16	0,82%	82	2,86%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	5.026.027,38	0,96%	2.573	2,13%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	4.487.546,23	0,86%	2.250	0,95%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

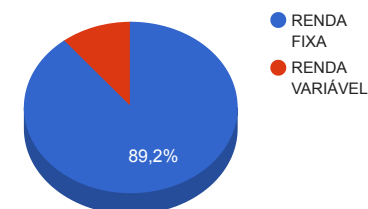
## Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	12.673.718,96	2,42%	1.396	0,90%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	4.516.317,45	0,86%	10.989	0,44%	Artigo 8º, Inciso III
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	Não se aplica	Não se aplica	3.460.055,52	0,66%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	2.885.045,72	0,55%	33	1,09%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se aplica	Não se aplica	1.338.372,43	0,26%		3,37%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	2.237.056,71	0,43%		3,41%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	9.585.802,94	1,83%	3.723	6,71%	Desenquadrado - RF
		<b>TOTAL -</b>	<b>523.228.651,46</b>				

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

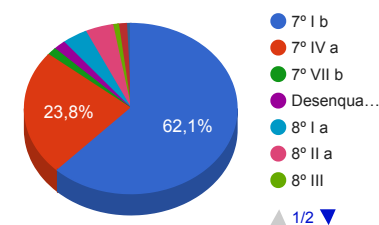
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	324.797.685,38	62,08%	0,00%	69,49%	100,00%	198.430.966,08
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	23,00%	60,00%	313.937.190,88
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	124.566.402,71	23,81%	0,00%	1,00%	40,00%	84.725.057,87
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	40.958,04	0,01%	0,00%	0,01%	5,00%	26.120.474,53
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	7.595.834,51	1,45%	0,00%	1,00%	5,00%	18.565.598,06
Desenquadrado - RF	0,00%	9.585.802,94	1,83%	2,00%	5,00%	5,00%	16.575.629,63
Em Enquadramento - RF	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	26.161.432,57
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>466.586.683,58</b>	<b>89,17%</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%	20.017.827,48	3,83%	0,00%	0,00%	30,00%	136.950.767,96
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	22.187.292,57	4,24%	0,00%	3,00%	20,00%	82.458.437,72
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	4.516.317,45	0,86%	0,00%	1,00%	10,00%	47.806.547,70
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	6.345.101,24	1,21%	0,00%	1,00%	5,00%	19.816.331,33
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	3.575.429,14	0,68%	0,00%	0,05%	5,00%	22.586.003,43
Desenquadrado - RV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	26.161.432,57
Em Enquadramento - RV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	26.161.432,57
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>56.641.967,88</b>	<b>10,83%</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: junho / 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 "	324.797.685,38	62,08%	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 "	124.566.402,71	23,81%	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 "	40.958,04	0,01%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	7.595.834,51	1,45%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	9.585.802,94	1,83%	2,00%	5,00%
Em Enquadramento - RF	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>466.586.683,58</b>	<b>89,17%</b>	<b>4,00</b>	<b>530,00</b>

Artigos - Renda Variável	Base: junho / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	20.017.827,48	3,83%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	22.187.292,57	4,24%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	4.516.317,45	0,86%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	6.345.101,24	1,21%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	3.575.429,14	0,68%	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>56.641.967,88</b>	<b>10,83%</b>	<b>4,00</b>	<b>130,00</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	181.043.347,25	34,60%	0,04%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	141.084.732,75	26,96%	0,01%
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	124.150.909,22	23,73%	0,01%
WESTERN ASSET	40.208.682,70	7,68%	0,08%
ITAÚ UNIBANCO	12.541.928,70	2,40%	0,00%
ICATU VANGUARDA	9.585.802,94	1,83%	0,04%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	4.487.546,23	0,86%	0,02%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	3.460.055,52	0,66%	-
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUTURADOS LTDA	2.893.484,55	0,55%	0,02%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	2.237.056,71	0,43%	0,57%
AQ3 ASSET MANAGEMENT	1.338.372,43	0,26%	2,80%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	164.213,25	0,03%	0,00%
VILA RICA CAPITAL	32.519,21	0,01%	0,05%

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	1,26%	2,60%	1,89%	2,60%	4,39%	7,52%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,59%	3,89%	0,57%	3,89%	10,45%	-	0,40%	0,116%	1,82%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,12%	3,06%	-0,70%	3,06%	10,63%	27,31%	0,20%	3,032%	2,65%
CDI + 3,50% ao ano	0,81%	4,93%	2,44%	4,93%	11,06%	29,71%	-	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-8,52%	-63,89%	-40,89%	-63,89%	-65,97%	-89,66%	0,39%	11,189%	110,13%
110% do CDI	0,57%	3,50%	1,72%	3,50%	8,12%	23,50%	-	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-3,95%	-53,12%	-41,07%	-53,12%	-64,57%	-71,44%	0,00%	-	-
IRF-M 1	0,55%	3,08%	1,25%	3,08%	7,81%	22,32%	-	-	-
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%
CDI	0,52%	3,17%	1,56%	3,17%	7,35%	21,15%	-	-	-
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%
IMA-B 5	0,45%	2,81%	-0,70%	2,81%	9,73%	22,81%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,42%	2,68%	-0,77%	2,68%	9,48%	22,32%	0,20%	3,126%	2,66%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	-0,32%	2,22%	-2,36%	2,22%	9,49%	23,89%	0,40%	5,160%	4,12%
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%
IRF-M	0,04%	2,37%	-1,35%	2,37%	8,94%	27,21%	-	-	-

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
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,01%	2,26%	-1,42%	2,26%	8,71%	26,69%	0,20%	2,830%	2,76%
IMA-B 5+	-1,08%	-0,71%	-6,27%	-0,71%	6,11%	21,42%	-	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	-0,97%	-0,77%	-6,22%	-0,77%	5,84%	20,86%	0,20%	4,931%	6,39%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,10%	-0,75%	-6,23%	-0,75%	5,88%	20,92%	0,20%	4,983%	6,37%
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 X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,14%	2,43%	-2,08%	2,43%	9,77%	24,23%	0,20%	4,188%	3,75%
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%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,43%	0,86%	-3,91%	0,86%	7,93%	22,69%	0,20%	4,120%	4,71%
IRF-M 1+	-0,15%	2,07%	-2,32%	2,07%	9,28%	29,10%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,15%	2,00%	-2,56%	2,00%	8,88%	28,46%	0,20%	3,891%	3,78%
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	-0,22%	1,08%	-4,30%	1,08%	8,38%	28,34%	0,30%	5,236%	5,30%

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

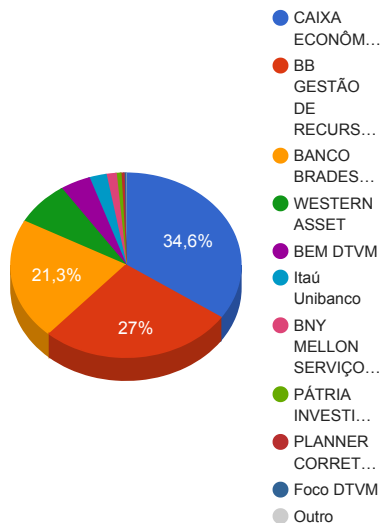
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Global BDRX	4,31%	19,45%	22,27%	19,45%	33,25%	62,39%	-	-	-
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,09%	16,22%	20,62%	16,22%	27,94%	55,29%	1,50%	10,735%	14,02%
S&P 500	2,87%	18,40%	19,30%	18,40%	30,61%	55,43%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	0,16%	3,19%	4,13%	3,19%	17,93%	52,34%	1,00%	3,876%	12,06%
IPCA	1,26%	2,60%	1,89%	2,60%	4,39%	7,52%	-	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,30%	-	-
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	-	-	-	-	-	-	1,00%	-	-
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%	-	-	-
BRADERCO H VALUATION IBOVESPA FI AÇÕES	-4,02%	0,58%	-13,42%	0,58%	27,38%	53,44%	2,00%	10,147%	18,92%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-4,35%	4,71%	-10,92%	4,71%	29,59%	53,50%	2,00%	11,511%	18,67%
IDIV	-4,33%	-6,87%	-15,61%	-6,87%	8,85%	48,78%	-	-	-
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	-5,36%	-2,56%	-15,33%	-2,56%	14,67%	44,97%	1,50%	10,446%	17,35%
IFIX	-4,01%	-4,55%	-9,85%	-4,55%	2,46%	29,73%	-	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	-23,58%	-4,71%	-23,58%	-4,71%	-19,82%	-46,00%	1,50%	38,794%	38,81%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	-100,00%	-	-100,00%	-	-	-100,00%	0,14%	-	-

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

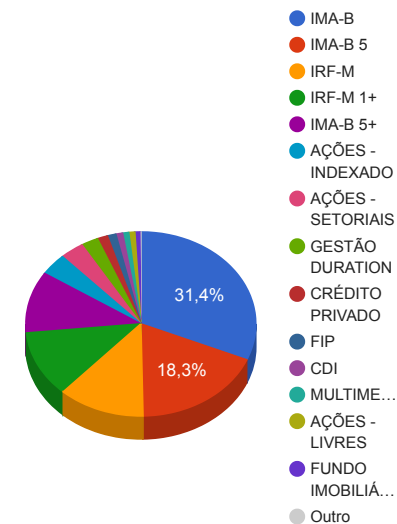
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	-3,66%	-9,00%	-12,53%	-9,00%	13,97%	52,19%	-	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-4,39%	-10,20%	-13,41%	-10,20%	13,41%	48,18%	1,50%	11,843%	17,29%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	181.043.347,25	34,60%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	141.084.732,75	26,96%
BANCO BRADESCO	111.477.190,26	21,31%
WESTERN ASSET	40.208.682,70	7,68%
BEM DTVM	22.259.521,90	4,25%
Itaú Unibanco	12.541.928,70	2,40%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	7.372.591,95	1,41%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	3.460.055,52	0,66%
PLANNER CORRETORA	2.237.056,71	0,43%
Foco DTVM	1.338.372,43	0,26%
BANCO SANTANDER	164.213,25	0,03%
BRL Trust Investimentos	32.519,21	0,01%
Brasil Plural	8.438,83	0,00%



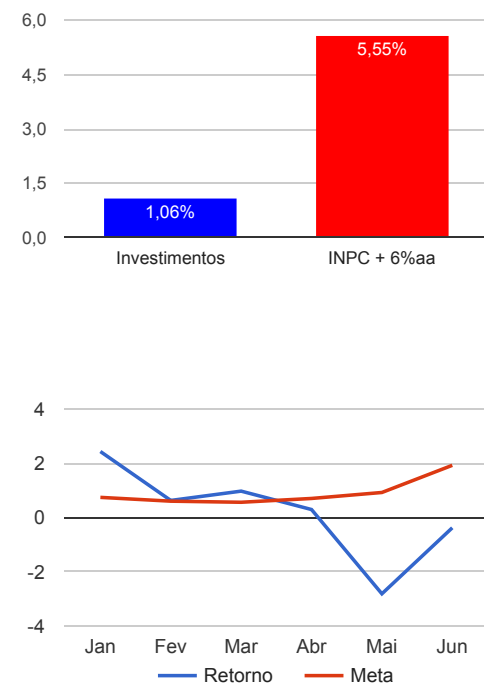
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	164.214.762,02	31,38%
IMA-B 5	95.879.842,87	18,32%
IRF-M	63.167.341,06	12,07%
IRF-M 1+	60.909.114,06	11,64%
IMA-B 5+	56.500.961,34	10,80%
AÇÕES - INDEXADO	20.017.827,48	3,83%
AÇÕES - SETORIAIS	17.699.746,34	3,38%
GESTÃO DURATION	12.541.928,70	2,40%
CRÉDITO PRIVADO	7.595.834,51	1,45%
FIP	6.345.101,24	1,21%
CDI	4.929.179,95	0,94%
MULTIMERCADO	4.516.317,45	0,86%
AÇÕES - LIVRES	4.487.546,23	0,86%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.575.429,14	0,68%
IDKA IPCA 2A	642.547,78	0,12%
IRF-M 1	164.213,25	0,03%
FIDC - FECHADO	40.958,04	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%
Mai	537.487.756,16	8.506.523,15	7.130.153,50	523.724.602,63	-15.139.523,18	-2,81%	0,92%	-305,77%	2,96%
Junho	523.724.602,63	7.572.161,76	6.073.377,41	523.228.651,46	-1.994.735,52	-0,38%	1,92%	-19,74%	4,26%
Acumulado no ano					5.371.614,90	1,06%	5,55%	19,01%	

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	32.488.074,90	0,00	0,00	32.854.733,23	366.658,33	1,13%	0,52%	1,13%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	635.437,35	0,00	0,00	642.547,78	7.110,43	1,12%	0,52%	1,12%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	5.099.161,40	7.379.813,88	0,00	12.541.928,70	62.953,42	0,50%	0,12%	0,59%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	7.666.933,90	192.347,88	2.965.550,26	4.929.179,95	35.448,43	0,45%	0,02%	0,50%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	38.536.557,71	0,00	0,00	38.698.696,51	162.138,80	0,42%	3,13%	0,42%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.259.172,76	0,00	3.106.969,87	164.213,25	12.010,36	0,37%	0,69%	0,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.072.784,48	0,00	0,00	6.081.574,41	8.789,93	0,14%	4,19%	0,14%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	7.586.713,66	0,00	0,00	7.595.834,51	9.120,85	0,12%	3,03%	0,12%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	63.158.115,77	0,00	0,00	63.167.341,06	9.225,29	0,01%	2,83%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	51.399.835,00	0,00	0,00	51.323.311,12	-76.523,88	-0,15%	3,89%	-0,15%
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	9.607.309,24	0,00	0,00	9.585.802,94	-21.506,30	-0,22%	5,24%	-0,22%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	24.403.558,49	0,00	0,00	24.326.413,13	-77.145,36	-0,32%	5,16%	-0,32%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	58.875.027,28	0,00	0,00	58.668.255,04	-206.772,24	-0,35%	3,92%	-0,35%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	99.890.266,30	0,00	0,00	99.464.932,57	-425.333,73	-0,43%	4,12%	-0,43%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	7.704.716,19	0,00	0,00	7.630.361,49	-74.354,70	-0,97%	4,93%	-0,97%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	49.411.882,15	0,00	0,00	48.870.599,85	-541.282,30	-1,10%	4,98%	-1,10%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	8.785,39	0,00	0,00	8.438,83	-346,56	-3,94%	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	35.549,11	0,00	857,28	32.519,21	-2.172,62	-6,11%	11,19%	-8,52%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>-751.981,85</b>	<b>-0,16%</b>	<b>3,57%</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(%)
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	11.025.421,98	0,00	0,00	11.365.952,12	340.530,14	3,09%	10,74%	3,09%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	4.509.001,90	0,00	0,00	4.516.317,45	7.315,55	0,16%	3,88%	0,16%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	2.233.988,22	0,00	0,00	2.237.056,71	3.068,49	0,14%	-	0,14%
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.337.202,88	0,00	0,00	1.338.372,43	1.169,55	0,09%	38,79%	-23,58%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	2.885.834,90	0,00	0,00	2.885.045,72	-789,18	-0,03%	-	-
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	3.463.127,95	0,00	0,00	3.460.055,52	-3.072,43	-0,09%	-	-
BRANCO H VALUATION IBOVESPA FI AÇÕES	4.565.325,70	0,00	0,00	4.381.896,20	-183.429,50	-4,02%	10,15%	-4,02%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	4.691.842,57	0,00	0,00	4.487.546,23	-204.296,34	-4,35%	11,51%	-4,35%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	5.256.800,58	0,00	0,00	5.026.027,38	-230.773,20	-4,39%	11,84%	-4,39%
BRANCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	13.391.969,61	0,00	0,00	12.673.718,96	-718.250,65	-5,36%	10,45%	-5,36%
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	4.524.205,26	0,00	0,00	4.269.979,16	-254.226,10	-5,62%	11,40%	-5,62%
Total Renda Variável					-1.242.753,67	-2,15%	10,99%	

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 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	32.097.063,48	0,00	0,00	32.854.733,23	757.669,75	2,36%	2,36%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.125.346,94	0,00	15.056.691,87	164.213,25	95.558,18	0,99%	1,16%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	133.209,91	7.698.871,03	2.968.218,73	4.929.179,95	65.317,74	1,35%	1,53%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	5.100.109,38	7.379.813,88	0,00	12.541.928,70	62.005,44	0,49%	0,57%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	627.830,01	0,00	0,00	642.547,78	14.717,77	2,34%	2,34%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	11.786,73	0,00	0,00	8.438,83	-3.347,90	-28,40%	-41,07%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	55.019,32	0,00	17.490,93	32.519,21	-5.009,18	-10,96%	-40,89%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	7.649.694,22	0,00	0,00	7.595.834,51	-53.859,71	-0,70%	-0,70%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.210.872,05	0,00	0,00	6.081.574,41	-129.297,64	-2,08%	-2,08%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	48.992.271,83	0,00	10.000.000,00	38.698.696,51	-293.575,32	-0,80%	-0,77%
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	10.016.468,57	0,00	0,00	9.585.802,94	-430.665,63	-4,30%	-4,30%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	8.136.326,08	0,00	0,00	7.630.361,49	-505.964,59	-6,22%	-6,22%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	24.913.606,74	0,00	0,00	24.326.413,13	-587.193,61	-2,36%	-2,36%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	64.079.018,70	0,00	0,00	63.167.341,06	-911.677,64	-1,42%	-1,42%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	52.670.023,71	0,00	0,00	51.323.311,12	-1.346.712,59	-2,56%	-2,56%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	60.891.520,05	0,00	0,00	58.668.255,04	-2.223.265,01	-3,65%	-3,65%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	44.528.432,10	7.523.954,19	0,00	48.870.599,85	-3.181.786,44	-6,11%	-6,23%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	103.509.526,30	0,00	0,00	99.464.932,57	-4.044.593,73	-3,91%	-3,91%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>-12.721.680,11</b>	<b>-2,66%</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 (%)
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9.422.880,83	0,00	0,00	11.365.952,12	1.943.071,29	20,62%	20,62%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	4.337.103,77	0,00	0,00	4.516.317,45	179.213,68	4,13%	4,13%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP	2.887.636,14	0,00	0,00	2.885.045,72	-2.590,42	-0,09%	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.342.923,60	0,00	0,00	1.338.372,43	-4.551,17	-0,34%	-23,58%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	3.468.590,68	0,00	0,00	3.460.055,52	-8.535,16	-0,25%	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	2.246.175,80	0,00	0,00	2.237.056,71	-9.119,09	-0,41%	-
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	4.013.805,86	0,00	3.888.034,08	0,00	-125.771,78	-3,13%	-
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	1.000.000,00	4.000.000,00	0,00	4.487.546,23	-512.453,77	-9,83%	-10,92%
BRADESCO H VALUATION IBOVESPA FI AÇÕES	2.019.928,40	3.000.000,00	0,00	4.381.896,20	-638.032,20	-12,71%	-13,42%
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	2.020.705,07	3.000.000,00	0,00	4.269.979,16	-750.725,91	-14,95%	-15,61%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	5.804.207,58	0,00	0,00	5.026.027,38	-778.180,20	-13,41%	-13,41%
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	10.923.196,07	3.888.034,08	0,00	12.673.718,96	-2.137.511,19	-14,43%	-15,33%
				<b>Total Renda Variável</b>	<b>-2.845.185,92</b>	<b>-4,75%</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 IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	56.865.010,73	179.587,15	20.000.000,00	38.698.696,51	1.654.098,63	2,59%	2,68%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	59.884.388,06	0,00	10.000.000,00	51.323.311,12	1.438.923,06	1,98%	2,00%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	61.770.828,25	0,00	0,00	63.167.341,06	1.396.512,81	2,26%	2,26%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	32.369.994,42	0,00	872.709,73	32.854.733,23	1.357.448,54	4,27%	1,50%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	98.618.406,32	0,00	0,00	99.464.932,57	846.526,25	0,86%	0,86%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	58.066.912,77	0,00	0,00	58.668.255,04	601.342,27	1,04%	1,04%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	28.390.141,86	1.588.014,24	30.216.611,96	164.213,25	402.669,11	2,52%	2,92%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	19.000.289,51	5.000.000,00	0,00	24.326.413,13	326.123,62	1,89%	2,22%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	7.370.150,38	0,00	0,00	7.595.834,51	225.684,13	3,06%	3,06%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	11.949.369,80	7.698.871,03	14.922.790,31	4.929.179,95	203.729,43	2,79%	3,15%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,00	12.379.813,88	0,00	12.541.928,70	162.114,82	2,50%	3,89%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.095.734,64	0,00	161.661,58	6.081.574,41	147.501,35	2,42%	2,43%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	90.050,78	0,00	113.740,72	32.519,21	56.209,15	49,32%	-63,89%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.710.843,96	0,00	6.755.258,58	0,00	44.414,62	1,20%	2,95%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	634.052,14	0,00	17.901,26	642.547,78	26.396,90	4,25%	4,25%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	16.017,82	0,00	0,00	8.438,83	-7.578,99	-47,32%	-53,12%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	7.689.608,77	0,00	0,00	7.630.361,49	-59.247,28	-0,77%	-0,77%
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	0,00	10.000.000,00	0,00	9.585.802,94	-414.197,06	-4,14%	1,08%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	27.076.287,67	23.263.927,01	0,00	48.870.599,85	-1.469.614,83	-0,61%	-0,75%
Total Renda Fixa					6.939.056,53	1,35%	

## 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 (%)
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	10.000.000,00	0,00	11.365.952,12	1.365.952,12	13,66%	16,22%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	7.313.462,40	0,00	7.888.034,08	0,00	574.571,68	6,14%	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	4.376.522,72	0,00	0,00	4.516.317,45	139.794,73	3,19%	3,19%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	2.197.890,59	0,00	0,00	2.237.056,71	39.166,12	1,78%	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.336.041,82	0,00	0,00	1.338.372,43	2.330,61	0,17%	-4,71%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	2.895.192,14	0,00	0,00	2.885.045,72	-10.146,42	-0,35%	-
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	3.477.429,39	0,00	0,00	3.460.055,52	-17.373,87	-0,50%	-
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	0,00	5.000.000,00	0,00	4.487.546,23	-512.453,77	-9,83%	4,71%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	5.596.771,90	0,00	0,00	5.026.027,38	-570.744,52	-10,20%	-10,20%
BRADESCO H VALUATION IBOVESPA FI AÇÕES	0,00	5.000.000,00	0,00	4.381.896,20	-618.103,80	-11,84%	0,58%
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	0,00	5.000.000,00	0,00	4.269.979,16	-730.020,84	-14,07%	-5,19%
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	6.016.098,55	7.888.034,08	0,00	12.673.718,96	-1.230.413,67	-2,14%	-2,56%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>-1.567.441,63</b>	<b>-1,87%</b>	