

# Relatório Analítico dos Investimentos em maio de 2018

SIRU 

Carteira consolidada de investimentos - base (maio / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	3.259.172,76	0,62%	27	0,85%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	6.072.784,48	1,16%	94	1,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	32.488.074,90	6,20%	223	1,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	58.875.027,28	11,24%	584	1,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	49.411.882,15	9,43%	194	5,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	38.536.557,71	7,36%	737	0,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	51.399.835,00	9,81%	236	2,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	24.403.558,49	4,66%	18	9,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	635.437,35	0,12%	192	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	63.158.115,77	12,06%	727	1,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	99.890.266,30	19,07%	92	7,64%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	5.099.161,40	0,97%	131	0,31%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	7.666.933,90	1,46%	724	0,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	7.704.716,19	1,47%	34	4,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	35.549,11	0,01%	47	0,37%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	Não se aplica	Não se aplica	8.785,39	0,00%			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	7.586.713,66	1,45%	70	1,62%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BRADERCO H VALUATION IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	4.565.325,70	0,87%	865	5,99%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	D+4	Não há	4.524.205,26	0,86%	84	3,15%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	11.025.421,98	2,11%	526	3,41%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	5.256.800,58	1,00%	2.803	2,02%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	4.691.842,57	0,90%	2.353	1,18%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

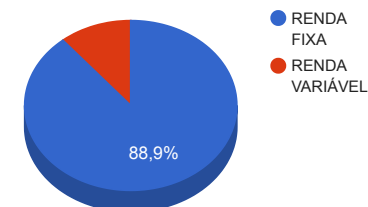
Carteira consolidada de investimentos - base (maio / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	13.391.969,61	2,56%	1.408	0,87%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	4.509.001,90	0,86%	11.235	0,42%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	2.885.834,90	0,55%	33	1,09%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	Não se aplica	Não se aplica	3.463.127,95	0,66%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se aplica	Não se aplica	1.337.202,88	0,26%		2,58%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	2.233.988,22	0,43%		3,41%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	9.607.309,24	1,83%	4.511	5,50%	Desenquadrado - RF
		<b>TOTAL -</b>	<b>523.724.602,63</b>				

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

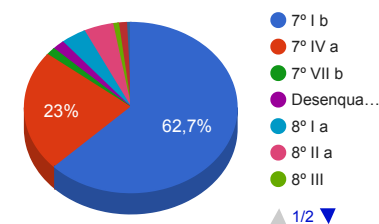
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	328.240.445,89	62,67%	0,00%	69,49%	100,00%	195.484.156,74
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	23,00%	60,00%	314.234.761,58
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	120.361.077,79	22,98%	0,00%	1,00%	40,00%	89.128.763,26
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	44.334,50	0,01%	0,00%	0,01%	5,00%	26.141.895,63
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	7.586.713,66	1,45%	0,00%	1,00%	5,00%	18.599.516,47
Desenquadrado - RF	0,00%	9.607.309,24	1,83%	2,00%	5,00%	5,00%	16.578.920,89
Em Enquadramento - RF	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	26.186.230,13
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>465.839.881,08</b>	<b>88,95%</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%	20.114.952,94	3,84%	0,00%	0,00%	30,00%	137.002.427,85
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	23.340.612,76	4,46%	0,00%	3,00%	20,00%	81.404.307,77
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	4.509.001,90	0,86%	0,00%	1,00%	10,00%	47.863.458,36
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	6.348.962,85	1,21%	0,00%	1,00%	5,00%	19.837.267,28
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	3.571.191,10	0,68%	0,00%	0,05%	5,00%	22.615.039,03
Desenquadrado - RV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	26.186.230,13
Em Enquadramento - RV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	26.186.230,13
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>57.884.721,55</b>	<b>11,05%</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: maio / 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 "	328.240.445,89	62,67%	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 "	120.361.077,79	22,98%	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 "	44.334,50	0,01%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	7.586.713,66	1,45%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	9.607.309,24	1,83%	2,00%	5,00%
Em Enquadramento - RF	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>465.839.881,08</b>	<b>88,95%</b>	<b>4,00</b>	<b>530,00</b>

Artigos - Renda Variável	Base: maio / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	20.114.952,94	3,84%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	23.340.612,76	4,46%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	4.509.001,90	0,86%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	6.348.962,85	1,21%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	3.571.191,10	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>57.884.721,55</b>	<b>11,05%</b>	<b>4,00</b>	<b>130,00</b>

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (maio / 2018)

Artigo 14º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	181.617.355,60	34,68%	0,04%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	143.995.012,44	27,49%	0,01%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	125.552.277,80	23,97%	0,01%
WESTERN ASSET	39.937.982,37	7,63%	0,08%
ICATU VANGUARDA	9.607.309,24	1,83%	0,04%
ITAÚ UNIBANCO	5.099.161,40	0,97%	0,00%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	4.691.842,57	0,90%	0,03%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	3.463.127,95	0,66%	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	3.259.172,76	0,62%	0,00%
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUTURADOS LTDA	2.894.620,29	0,55%	0,02%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	2.233.988,22	0,43%	0,60%
AQ3 ASSET MANAGEMENT	1.337.202,88	0,26%	2,77%
VILA RICA CAPITAL	35.549,11	0,01%	0,17%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI + 3,50% ao ano	0,81%	4,10%	2,45%	4,94%	11,39%	30,56%	-	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-34,20%	-60,52%	-38,66%	-45,28%	-54,54%	-88,74%	0,39%	5,972%	112,79%
110% do CDI	0,57%	2,91%	1,73%	3,52%	8,46%	24,37%	-	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-24,12%	-51,20%	-51,10%	-56,61%	-64,62%	-70,83%	0,00%	-	-
CDI	0,52%	2,64%	1,57%	3,19%	7,66%	21,92%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,51%	2,63%	1,57%	3,23%	7,75%	22,10%	0,20%	0,018%	0,10%
IPCA	0,40%	1,33%	0,71%	1,77%	2,85%	6,55%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	-0,34%	3,28%	1,01%	4,10%	10,87%	-	0,40%	0,713%	1,89%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	-1,29%	2,94%	0,97%	3,99%	11,54%	28,29%	0,20%	1,254%	2,04%
IRF-M 1	0,20%	2,52%	1,37%	3,10%	8,17%	22,97%	-	-	-
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,19%	2,42%	1,31%	3,00%	8,01%	22,81%	0,00%	0,283%	0,32%
IMA-B 5+	-4,65%	0,37%	-4,89%	1,16%	7,21%	25,90%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-4,58%	0,35%	-4,86%	1,11%	6,98%	25,41%	0,20%	3,933%	5,95%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	-4,68%	0,20%	-4,97%	0,97%	6,78%	25,25%	0,20%	3,997%	5,99%
IMA-B	-3,16%	1,48%	-2,39%	2,32%	8,72%	25,38%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,80%	0,36%	1,80%	0,72%	2,60%	8,54%	0,20%	0,271%	3,90%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-2,45%	2,28%	-0,27%	3,20%	9,99%	24,85%	0,20%	1,872%	2,92%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-3,17%	1,39%	-2,44%	2,21%	8,45%	24,83%	0,20%	2,606%	4,16%
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-3,32%	1,29%	-2,56%	2,15%	8,55%	25,61%	0,20%	2,749%	4,28%
IRF-M 1+	-2,62%	2,22%	-0,65%	3,71%	11,09%	32,73%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-2,71%	2,15%	-0,91%	3,57%	10,66%	31,88%	0,20%	2,352%	3,17%
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	-4,21%	1,30%	-2,42%	3,07%	10,38%	32,97%	0,30%	3,457%	4,55%
IRF-M	-1,85%	2,32%	-0,09%	3,60%	10,37%	29,87%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,86%	2,25%	-0,15%	3,50%	10,13%	29,28%	0,20%	1,602%	2,33%
IMA-B 5	-1,56%	2,35%	0,46%	3,25%	9,82%	23,40%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,59%	2,25%	0,39%	3,13%	9,58%	22,93%	0,20%	1,313%	1,97%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	-2,49%	2,54%	-0,01%	3,74%	10,54%	25,51%	0,40%	2,100%	2,84%
IDKA IPCA 2 Anos	-1,02%	2,81%	1,39%	4,00%	10,66%	25,09%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,79%	3,10%	1,79%	3,46%	8,31%	21,36%	0,20%	0,268%	0,76%

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

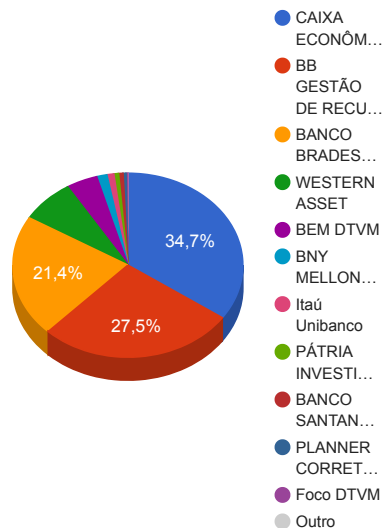
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Global BDRX	9,57%	14,52%	14,11%	19,51%	32,68%	38,11%	-	-	-
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	8,70%	12,74%	14,46%	16,98%	27,16%	32,17%	1,50%	6,043%	12,76%
S&P 500	2,87%	1,89%	0,38%	2,89%	12,95%	29,90%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	3,35%	3,03%	1,09%	4,79%	19,06%	53,75%	1,00%	4,578%	11,97%
IPCA	0,40%	1,33%	0,71%	1,77%	2,85%	6,55%	-	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,30%	0,009%	20,84%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	-	-	-	-	-	-	1,00%	-	-
SMLL	-11,31%	-5,55%	-9,13%	1,10%	18,75%	72,39%	-	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-11,08%	-6,07%	-9,90%	0,68%	18,75%	65,95%	1,50%	13,444%	16,09%
IBX-50	-10,88%	0,68%	-10,26%	6,92%	22,66%	57,65%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	-10,99%	0,45%	-10,87%	6,75%	23,69%	51,37%	0,70%	12,935%	17,94%
Ibovespa	-10,87%	0,46%	-10,08%	6,65%	22,39%	58,35%	-	-	-
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-8,62%	9,47%	-5,66%	16,32%	35,77%	66,72%	2,00%	12,035%	17,63%
BRADESCO H VALUATION IBOVESPA FI AÇÕES	-10,31%	4,79%	-8,82%	10,42%	34,03%	70,71%	2,00%	12,611%	18,18%
IDIV	-10,53%	-2,66%	-10,87%	2,16%	12,39%	67,47%	-	-	-
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	-10,90%	2,96%	-9,01%	8,91%	22,06%	62,82%	1,50%	11,921%	16,48%
IFIX	-5,27%	-0,55%	-4,21%	0,05%	7,65%	37,32%	-	-	-

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

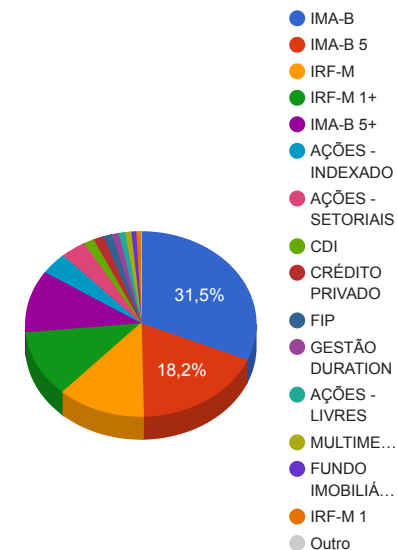
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,00%	24,70%	24,71%	24,70%	4,93%	-29,33%	1,50%	0,000%	30,69%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,00%	-	0,00%	-	0,00%	0,00%	0,14%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	181.617.355,60	34,68%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	143.995.012,44	27,49%
BANCO BRADESCO	112.160.308,19	21,42%
WESTERN ASSET	39.937.982,37	7,63%
BEM DTVM	22.999.278,85	4,39%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	7.577.677,47	1,45%
Itaú Unibanco	5.099.161,40	0,97%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	3.463.127,95	0,66%
BANCO SANTANDER	3.259.172,76	0,62%
PLANNER CORRETORA	2.233.988,22	0,43%
Foco DTVM	1.337.202,88	0,26%
BRL Trust Investimentos	35.549,11	0,01%
Brasil Plural	8.785,39	0,00%



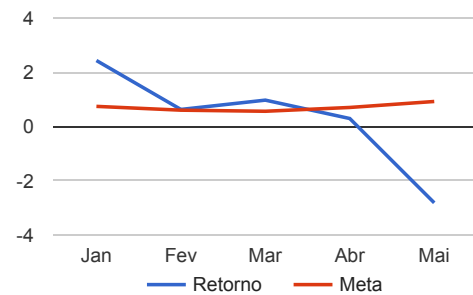
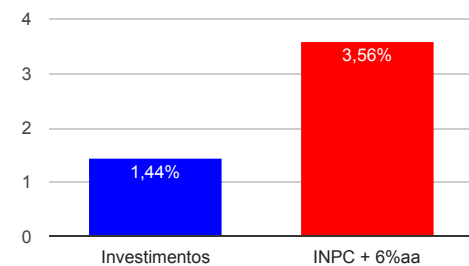
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	164.838.078,06	31,47%
IMA-B 5	95.428.191,10	18,22%
IRF-M	63.158.115,77	12,06%
IRF-M 1+	61.007.144,24	11,65%
IMA-B 5+	57.116.598,34	10,91%
AÇÕES - INDEXADO	20.114.952,94	3,84%
AÇÕES - SETORIAIS	18.648.770,19	3,56%
CDI	7.666.933,90	1,46%
CRÉDITO PRIVADO	7.586.713,66	1,45%
FIP	6.348.962,85	1,21%
GESTÃO DURATION	5.099.161,40	0,97%
AÇÕES - LIVRES	4.691.842,57	0,90%
MULTIMERCADO	4.509.001,90	0,86%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.571.191,10	0,68%
IRF-M 1	3.259.172,76	0,62%
IDKA IPCA 2A	635.437,35	0,12%
FIDC - FECHADO	44.334,50	0,01%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	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%
Acumulado no ano					7.366.350,42	1,44%	3,56%	40,45%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	32.230.284,54	0,00	0,00	32.488.074,90	257.790,36	0,80%	0,27%	0,80%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	630.431,83	0,00	0,00	635.437,35	5.005,52	0,79%	0,27%	0,79%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	131.222,03	7.506.523,15	0,00	7.666.933,90	29.188,72	0,38%	0,02%	0,51%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.357.079,87	0,00	6.113.606,55	3.259.172,76	15.699,44	0,17%	0,28%	0,19%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	5.116.719,62	0,00	0,00	5.099.161,40	-17.558,22	-0,34%	0,71%	-0,34%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	7.686.160,12	0,00	0,00	7.586.713,66	-99.446,46	-1,29%	1,25%	-1,29%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	40.158.274,73	0,00	1.000.000,00	38.536.557,71	-621.717,02	-1,55%	1,31%	-1,59%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	64.353.050,55	0,00	0,00	63.158.115,77	-1.194.934,78	-1,86%	1,60%	-1,86%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.225.239,60	0,00	0,00	6.072.784,48	-152.455,12	-2,45%	1,87%	-2,45%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	25.026.702,66	0,00	0,00	24.403.558,49	-623.144,17	-2,49%	2,10%	-2,49%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	52.831.194,56	0,00	0,00	51.399.835,00	-1.431.359,56	-2,71%	2,35%	-2,71%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	60.799.957,34	0,00	0,00	58.875.027,28	-1.924.930,06	-3,17%	2,61%	-3,17%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	103.320.276,16	0,00	0,00	99.890.266,30	-3.430.009,86	-3,32%	2,75%	-3,32%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	54.024,95	0,00	16.546,95	35.549,11	-1.928,89	-3,57%	5,97%	-5,18%
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	10.029.544,19	0,00	0,00	9.607.309,24	-422.234,95	-4,21%	3,46%	-4,21%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	51.784.074,05	0,00	0,00	49.411.882,15	-2.372.191,90	-4,58%	3,93%	-4,58%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	8.083.423,60	0,00	0,00	7.704.716,19	-378.707,41	-4,68%	4,00%	-4,68%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	9.530,74	0,00	0,00	8.785,39	-745,35	-7,82%	-	-
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>-12.363.679,71</b>	<b>-2,59%</b>	<b>2,24%</b>	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	10.142.551,86	0,00	0,00	11.025.421,98	882.870,12	8,70%	6,04%	8,70%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	4.362.657,25	0,00	0,00	4.509.001,90	146.344,65	3,35%	4,58%	3,35%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP	2.886.767,46	0,00	0,00	2.885.834,90	-932,56	-0,03%	0,01%	-0,03%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	3.465.521,75	0,00	0,00	3.463.127,95	-2.393,80	-0,07%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.340.086,21	0,00	0,00	1.337.202,88	-2.883,33	-0,22%	0,00%	0,00%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	2.253.377,91	0,00	0,00	2.233.988,22	-19.389,69	-0,86%	-	-0,86%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	4.095.055,81	1.000.000,00	0,00	4.691.842,57	-403.213,24	-7,91%	12,04%	-8,62%
BRDESCO H VALUATION IBOVESPA FI AÇÕES	5.090.014,75	0,00	0,00	4.565.325,70	-524.689,05	-10,31%	12,61%	-10,31%
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	15.029.471,35	0,00	0,00	13.391.969,61	-1.637.501,74	-10,90%	11,92%	-10,90%
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	5.083.048,81	0,00	0,00	4.524.205,26	-558.843,55	-10,99%	12,93%	-10,99%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	5.912.011,86	0,00	0,00	5.256.800,58	-655.211,28	-11,08%	13,44%	-11,08%
Total Renda Variável					-2.775.843,47	-4,58%	9,39%	