

Relatório Analítico dos Investimentos em maio de 2018

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
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	73.119.969,25	6,22%	223	2,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	16.106.292,48	1,37%	143	1,51%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	234.133.949,35	19,92%	262	7,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	25.046.478,97	2,13%	94	4,98%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2018	15.994.236,00	1,36%	163	1,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	15/05/2019	10.099.137,87	0,86%	11	11,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	121.255.279,86	10,31%	324	9,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	61.513.415,17	5,23%	661	1,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	17/08/2020	14.020.780,00	1,19%	20	21,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	9.321.716,38	0,79%	192	2,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	91.169.686,40	7,76%	1.230	0,80%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	18/08/2020	23.533.398,00	2,00%	19	18,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	88.985.551,29	7,57%	210	9,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	18/08/2018	90.744.906,12	7,72%	99	8,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	43.112.789,32	3,67%	20	1,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	24.323.020,00	2,07%	21	16,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	147.705,70	0,01%	712	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	107.720.951,77	9,16%	61	7,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	23.203.299,48	1,97%	131	1,41%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.507.970,60	0,30%	226	0,35%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	33.076.523,32	2,81%	724	0,82%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	17.570.930,84	1,49%	704	0,36%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "

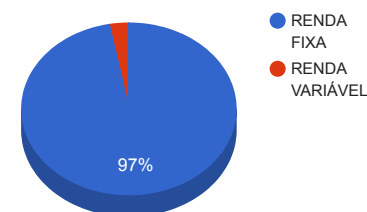
Carteira consolidada de investimentos - base (maio / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CASAN SANEAMENTO FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	6.092.076,25	0,52%	27	2,92%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	7.034.194,58	0,60%	82	4,40%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	D+4	Não há	17.036.268,41	1,45%	6.815	2,44%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	14.600.717,02	1,24%	100	2,13%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	3.114.000,00	0,26%		1,90%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
TOTAL -			1.175.585.244,43				

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

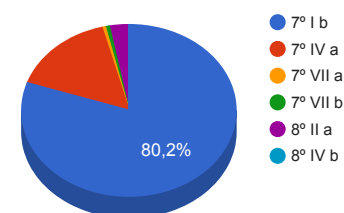
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	942.480.606,46	80,17%	50,00%	60,00%	80,00%	-2.012.410,92
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	2,00%	7,00%	10,00%	117.558.524,44
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	185.227.381,71	15,76%	15,00%	20,00%	40,00%	285.006.716,06
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	6.092.076,25	0,52%	0,50%	1,00%	3,00%	29.175.481,08
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	7.034.194,58	0,60%	0,50%	2,00%	4,00%	39.989.215,20
Total Renda Fixa	100,00%	1.140.834.259,00	97,04%	68,00	90,00	137,00	-

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%	0,00	0,00%	0,00%	4,00%	5,00%	58.779.262,22
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	31.636.985,43	2,69%	0,00%	4,00%	5,00%	27.142.276,79
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	3,00%	35.267.557,33
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	1,00%	11.755.852,44
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	3.114.000,00	0,26%	0,00%	0,50%	1,00%	8.641.852,44
Total Renda Variável	30,00%	34.750.985,43	2,96%	0,00	10,00	15,00	-

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 " b "	942.480.606,46	80,17%	50,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	185.227.381,71	15,76%	15,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	6.092.076,25	0,52%	0,50%	3,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	7.034.194,58	0,60%	0,50%	4,00%
Total Renda Fixa	1.140.834.259,00	97,04%	68,00	137,00

Artigos - Renda Variável	Base: maio / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	31.636.985,43	2,69%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	0,00%	3,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	1,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	3.114.000,00	0,26%	0,00%	1,00%
Total Renda Variável	34.750.985,43	2,96%	0,00	15,00

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
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	503.107.523,62	42,80%	0,04%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	228.892.794,95	19,47%	0,06%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	198.975.268,43	16,93%	0,05%
ITAÚ UNIBANCO	155.624.106,14	13,24%	0,01%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	88.985.551,29	7,57%	0,01%

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
IPCA + 9,00% ao ano	1,12%	4,96%	2,90%	6,14%	12,00%	26,47%	-	-	-
CASAN SANEAMENTO FIDC SÊNIOR	-1,53%	-6,91%	-4,37%	-8,17%	-13,51%	-13,68%	0,45%	4,315%	-

IPCA + 6,00% ao ano	0,89%	3,77%	2,19%	4,71%	8,95%	19,64%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,72%	3,94%	2,16%	4,68%	9,09%	20,75%	0,20%	0,105%	0,34%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,69%	1,05%	2,11%	1,76%	2,96%	7,32%	0,20%	0,106%	3,90%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,69%	1,04%	2,11%	1,75%	2,95%	7,23%	0,20%	0,106%	3,90%

CDI	0,52%	2,64%	1,57%	3,19%	7,66%	21,92%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,51%	2,63%	1,57%	3,23%	7,75%	22,10%	0,20%	0,018%	0,10%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,50%	2,56%	1,53%	3,10%	7,55%	21,83%	0,20%	0,005%	0,09%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,50%	2,60%	1,54%	3,14%	7,73%	22,31%	0,20%	0,007%	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%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,35%	3,26%	1,01%	4,09%	10,86%	27,81%	0,40%	0,716%	1,89%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	-0,81%	1,63%	0,21%	2,04%	6,35%	18,39%	0,20%	1,011%	0,87%

IRF-M 1	0,20%	2,52%	1,37%	3,10%	8,17%	22,97%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,18%	2,43%	1,30%	3,00%	7,95%	22,36%	0,10%	0,282%	0,32%
BRABESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,17%	2,43%	1,32%	2,99%	7,99%	22,47%	0,20%	0,289%	0,32%

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
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%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,82%	0,82%	1,73%	1,88%	5,52%	13,11%	0,20%	1,061%	3,95%
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%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-3,14%	1,40%	-2,42%	2,26%	8,66%	25,32%	0,30%	2,594%	4,16%
IRF-M	-1,85%	2,32%	-0,09%	3,60%	10,37%	29,87%	-	-	-
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,91%	2,20%	-0,23%	3,43%	9,99%	31,96%	0,10%	1,683%	2,37%
IMA-B 5	-1,56%	2,35%	0,46%	3,25%	9,82%	23,40%	-	-	-
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-1,58%	2,25%	0,40%	3,14%	9,61%	22,94%	0,10%	1,312%	1,98%
IMA Geral ex-C	-1,45%	2,19%	-0,22%	3,10%	9,08%	26,20%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,34%	2,36%	-0,13%	3,28%	9,07%	-	0,30%	1,225%	2,26%
IDKA IPCA 2 Anos	-1,02%	2,81%	1,39%	4,00%	10,66%	25,09%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,80%	3,11%	1,80%	3,47%	8,33%	-	0,20%	0,270%	0,77%
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%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,79%	3,05%	1,50%	3,95%	10,18%	23,82%	0,20%	1,005%	1,48%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,78%	-0,32%	-1,42%	0,38%	3,65%	10,36%	0,20%	4,566%	4,08%

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
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2018 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,80%	0,36%	1,80%	0,71%	2,59%	8,71%	0,20%	0,271%	3,89%

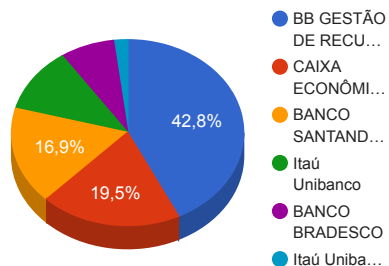
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (maio / 2018)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	-10,87%	0,46%	-10,08%	6,65%	22,39%	58,35%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-7,92%	5,67%	-3,74%	11,70%	28,65%	-	2,50%	9,420%	14,76%
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	-8,68%	-1,14%	-7,31%	4,31%	23,45%	58,22%	2,00%	11,913%	16,69%

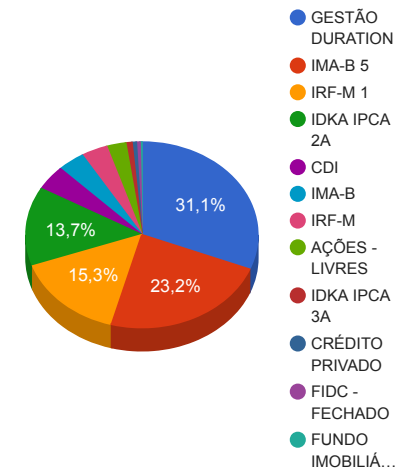
IFIX	-5,27%	-0,55%	-4,21%	0,05%	7,65%	37,32%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-1,14%	-2,99%	-8,79%	-2,99%	2,77%	13,15%	1,20%	11,320%	22,94%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	503.107.523,62	42,80%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	228.892.794,95	19,47%
BANCO SANTANDER	198.975.268,43	16,93%
Itaú Unibanco	132.420.806,66	11,26%
BANCO BRADESCO	88.985.551,29	7,57%
Itaú Unibanco S.A.	23.203.299,48	1,97%



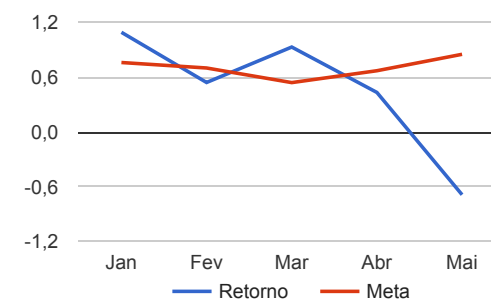
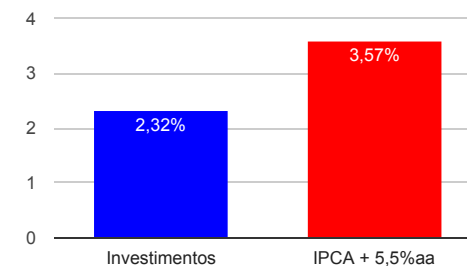
Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	365.058.200,60	31,05%
IMA-B 5	272.246.683,11	23,16%
IRF-M 1	180.155.237,69	15,32%
IDKA IPCA 2A	161.580.037,67	13,74%
CDI	50.795.159,86	4,32%
IMA-B	44.660.742,05	3,80%
IRF-M	43.112.789,32	3,67%
AÇÕES - LIVRES	31.636.985,43	2,69%
IDKA IPCA 3A	10.099.137,87	0,86%
CRÉDITO PRIVADO	7.034.194,58	0,60%
FIDC - FECHADO	6.092.076,25	0,52%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.114.000,00	0,26%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	1.099.169.661,50	27.236.531,08	16.362.674,29	1.122.154.566,01	12.111.047,72	1,09%	0,76%	143,58%	0,49%
Fevereiro	1.122.154.566,01	35.229.103,23	23.784.385,74	1.139.736.552,47	6.137.268,97	0,54%	0,70%	76,86%	1,06%
Março	1.139.736.552,47	230.657.871,91	220.226.269,47	1.160.857.771,62	10.689.616,71	0,93%	0,54%	172,89%	0,71%
Abril	1.160.857.771,62	125.834.550,55	117.297.638,60	1.174.449.594,87	5.054.911,30	0,43%	0,67%	64,70%	0,62%
Maio	1.174.449.594,87	27.656.428,35	18.379.029,94	1.175.585.244,43	-8.141.748,85	-0,69%	0,85%	-81,02%	1,12%
Acumulado no ano					25.851.095,85	2,32%	3,57%	64,95%	

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(%)
CASAN SANEAMENTO FIDC SÊNIOR	6.186.972,28	0,00	162.697,73	6.092.076,25	67.801,70	1,10%	4,32%	-1,53%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	72.539.767,93	0,00	0,00	73.119.969,25	580.201,32	0,80%	0,27%	0,80%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	90.026.198,57	0,00	0,00	90.744.906,12	718.707,55	0,80%	0,27%	0,80%
CAIXA BRASIL 2018 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	24.130.460,00	0,00	0,00	24.323.020,00	192.560,00	0,80%	0,27%	0,80%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.248.286,63	0,00	0,00	9.321.716,38	73.429,75	0,79%	0,27%	0,79%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.991.633,32	0,00	0,00	16.106.292,48	114.659,16	0,72%	0,11%	0,72%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.884.028,00	0,00	0,00	15.994.236,00	110.208,00	0,69%	0,11%	0,69%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	23.371.362,00	0,00	0,00	23.533.398,00	162.036,00	0,69%	0,11%	0,69%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	20.097.467,22	1.321.815,26	3.948.226,00	17.570.930,84	99.874,36	0,47%	0,01%	0,50%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	146.007,88	8.239,78	7.242,26	147.705,70	700,30	0,45%	0,00%	0,50%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	21.049.612,46	25.854.000,00	13.952.000,00	33.076.523,32	124.910,86	0,27%	0,02%	0,51%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	91.004.518,29	0,00	0,00	91.169.686,40	165.168,11	0,18%	0,28%	0,18%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	88.837.348,30	0,00	0,00	88.985.551,29	148.202,99	0,17%	0,29%	0,17%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.387.522,97	0,00	287.863,95	10.099.137,87	-521,15	-0,01%	4,57%	-2,78%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	22.994.151,41	287.863,95	0,00	23.203.299,48	-78.715,88	-0,34%	0,71%	-0,34%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	108.095.633,19	0,00	0,00	107.720.951,77	-374.681,42	-0,35%	0,72%	-0,35%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	61.817.075,58	184.509,36	0,00	61.513.415,17	-488.169,77	-0,79%	1,01%	-0,79%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	7.091.896,90	0,00	0,00	7.034.194,58	-57.702,32	-0,81%	1,01%	-0,81%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.136.110,00	0,00	0,00	14.020.780,00	-115.330,00	-0,82%	1,06%	-0,82%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	237.303.954,26	0,00	0,00	234.133.949,35	-3.170.004,91	-1,34%	1,22%	-1,34%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	123.199.453,87	0,00	0,00	121.255.279,86	-1.944.174,01	-1,58%	1,31%	-1,58%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	43.950.325,31	0,00	0,00	43.112.789,32	-837.535,99	-1,91%	1,68%	-1,91%

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(%)
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	25.675.262,04	0,00	0,00	25.046.478,97	-628.783,07	-2,45%	1,87%	-2,45%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.621.718,24	0,00	0,00	3.507.970,60	-113.747,64	-3,14%	2,59%	-3,14%
Total Renda Fixa					-5.250.906,06	-0,46%	0,82%	

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(%)
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	3.150.000,00	0,00	21.000,00	3.114.000,00	-15.000,00	-0,48%	11,32%	-1,14%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	15.856.528,44	0,00	0,00	14.600.717,02	-1.255.811,42	-7,92%	9,42%	-7,92%
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	18.656.299,78	0,00	0,00	17.036.268,41	-1.620.031,37	-8,68%	11,91%	-8,68%
Total Renda Variável					-2.890.842,79	-7,68%	10,81%	