

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

Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.



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 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2018	16.214.412,00	1,36%	163	1,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	18/08/2018	91.767.073,70	7,70%	99	8,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	18/08/2020	23.857.290,00	2,00%	19	18,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	61.831.421,29	5,19%	638	1,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	24.597.180,00	2,06%	21	16,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	269.643.121,46	22,63%	1.252	2,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	73.945.196,53	6,21%	223	2,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	16.330.091,11	1,37%	143	1,51%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	25.082.732,01	2,11%	93	5,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	89.433.932,14	7,51%	218	8,77%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	17/08/2020	14.034.230,00	1,18%	20	21,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	15/05/2019	10.180.102,95	0,85%	11	11,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	9.426.024,75	0,79%	192	2,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	183.803.534,75	15,43%	697	3,67%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	108.351.728,95	9,09%	60	7,25%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	280.988,41	0,02%	765	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	23.339.311,11	1,96%	133	1,39%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	103.218.684,82	8,66%	761	2,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CASAN SANEAMENTO FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	5.982.315,21	0,50%			Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	7.046.196,59	0,59%	81	4,57%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	D+4	Não há	16.183.399,86	1,36%	6.236	2,61%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	14.151.767,91	1,19%	109	1,97%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

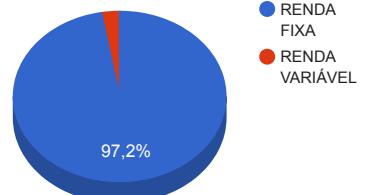
Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	2.748.000,00	0,23%		1,90%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
		TOTAL -	1.191.448.735,55				

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

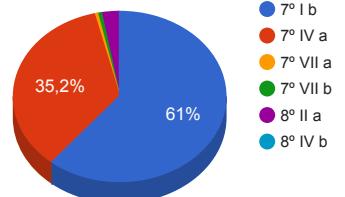
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	726.342.807,94	60,96%	50,00%	60,00%	80,00%	226.816.180,50
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	2,00%	7,00%	10,00%	119.144.873,56
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	418.994.248,04	35,17%	15,00%	20,00%	40,00%	57.585.246,18
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5.982.315,21	0,50%	0,50%	1,00%	3,00%	29.761.146,86
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	7.046.196,59	0,59%	0,50%	2,00%	4,00%	40.611.752,83
Total Renda Fixa	100,00%	1.158.365.567,78	97,22%	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%	59.572.436,78
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	30.335.167,77	2,55%	0,00%	4,00%	5,00%	29.237.269,01
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	3,00%	35.743.462,07
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	1,00%	11.914.487,36
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	2.748.000,00	0,23%	0,00%	0,50%	1,00%	9.166.487,36
Total Renda Variável	30,00%	33.083.167,77	2,78%	0,00	10,00	15,00	-

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 "	726.342.807,94	60,96%	50,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	418.994.248,04	35,17%	15,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5.982.315,21	0,50%	0,50%	3,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	7.046.196,59	0,59%	0,50%	4,00%
Total Renda Fixa	1.158.365.567,78	97,22%	68,00	137,00

Artigos - Renda Variável	Base: junho / 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 "	30.335.167,77	2,55%	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 "	2.748.000,00	0,23%	0,00%	1,00%
Total Renda Variável	33.083.167,77	2,78%	0,00	15,00

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	515.467.727,85	43,26%	0,04%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	230.537.230,03	19,35%	0,06%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	199.986.934,61	16,79%	0,05%
ITAÚ UNIBANCO	156.022.910,92	13,10%	0,01%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	89.433.932,14	7,51%	0,01%

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 + 9,00% ao ano	1,99%	7,05%	4,11%	7,05%	13,67%	27,57%	-	-	-
CASAN SANEAMENTO FIDC SÊNIOR	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	0,45%	-	-

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 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,38%	2,44%	2,76%	2,44%	3,88%	7,60%	0,20%	0,273%	3,91%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,38%	2,43%	2,76%	2,43%	3,87%	7,51%	0,20%	0,273%	3,91%

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%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,59%	3,87%	0,56%	3,87%	10,43%	26,03%	0,40%	0,117%	1,82%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,17%	1,80%	-0,21%	1,80%	5,88%	17,30%	0,20%	2,646%	1,79%

IRF-M 1	0,55%	3,08%	1,25%	3,08%	7,81%	22,32%	-	-	-
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,50%	2,94%	1,17%	2,94%	7,57%	21,80%	0,20%	0,692%	0,51%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,50%	2,94%	1,17%	2,94%	7,55%	21,72%	0,10%	0,691%	0,51%

CDI	0,52%	3,17%	1,56%	3,17%	7,35%	21,15%	-	-	-
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,51%	3,12%	1,52%	3,12%	7,36%	21,49%	0,20%	0,004%	0,09%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,50%	3,15%	1,53%	3,15%	7,41%	21,42%	0,20%	0,023%	0,09%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,50%	3,07%	1,52%	3,07%	7,21%	21,04%	0,20%	0,014%	0,08%

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
--	-----	-----	---------	---------	----------	----------	----------	-----------	-------------------------

IDKA IPCA 2 Anos	0,17%	2,98%	-0,03%	2,98%	9,98%	24,14%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,13%	4,27%	2,36%	4,27%	8,94%	-	0,20%	0,524%	0,77%
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%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,80%	0,48%	-1,61%	0,48%	3,77%	10,35%	0,20%	1,047%	4,10%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,21%	3,27%	0,20%	3,27%	9,73%	23,00%	0,20%	2,643%	2,13%

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%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,10%	0,92%	0,20%	0,92%	5,02%	12,45%	0,20%	2,708%	4,23%

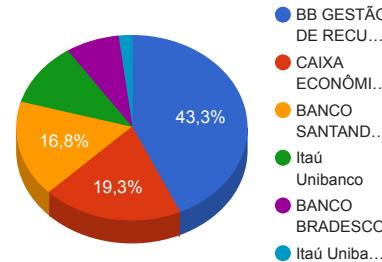
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2018 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,13%	1,49%	2,36%	1,49%	3,17%	9,04%	0,20%	0,525%	3,89%

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

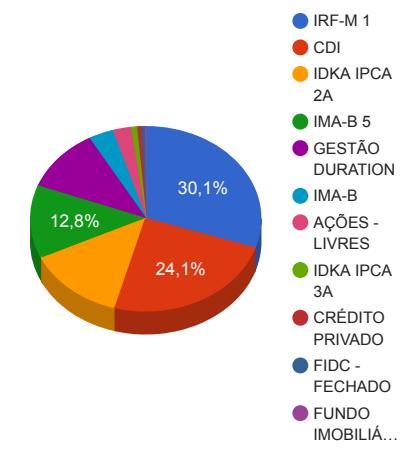
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	-5,20%	-4,76%	-14,76%	-4,76%	15,68%	41,22%	-	-	-
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-3,07%	2,42%	-8,38%	2,42%	24,31%	-	2,50%	9,132%	15,49%
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	-5,01%	-6,09%	-12,32%	-6,09%	17,01%	43,92%	2,00%	10,923%	17,66%
IFIX	-4,01%	-4,55%	-9,85%	-4,55%	2,46%	29,73%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-11,75%	-14,39%	-21,03%	-14,39%	-14,39%	-1,51%	1,20%	11,050%	23,25%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	515.467.727,85	43,26%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	230.537.230,03	19,35%
BANCO SANTANDER	199.986.934,61	16,79%
Itaú Unibanco	132.683.599,81	11,14%
BANCO BRADESCO	89.433.932,14	7,51%
Itaú Unibanco S.A.	23.339.311,11	1,96%



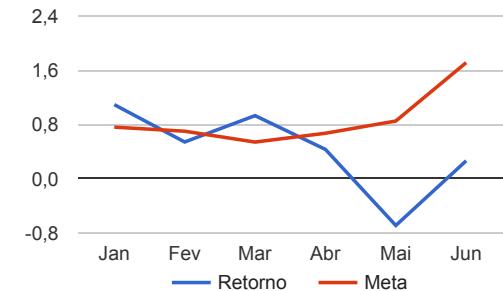
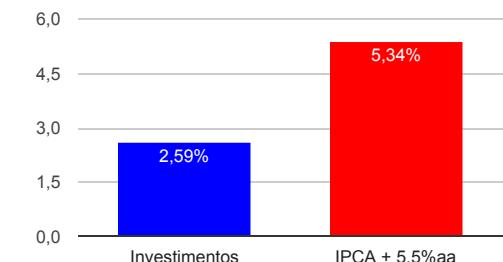
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	359.077.053,60	30,14%
CDI	287.303.207,98	24,11%
IDKA IPCA 2A	163.024.519,74	13,68%
IMA-B 5	152.648.308,53	12,81%
GESTÃO DURATION	131.691.040,06	11,05%
IMA-B	41.412.823,12	3,48%
AÇÕES - LIVRES	30.335.167,77	2,55%
IDKA IPCA 3A	10.180.102,95	0,85%
CRÉDITO PRIVADO	7.046.196,59	0,59%
FIDC - FECHADO	5.982.315,21	0,50%
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.748.000,00	0,23%



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%
Junho	1.175.585.244,43	433.684.627,13	420.963.748,81	1.191.448.735,55	3.142.612,80	0,26%	1,71%	15,44%	0,89%
Acumulado no ano					28.993.708,65	2,59%	5,34%	48,45%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.106.292,48	0,00	0,00	16.330.091,11	223.798,63	1,39%	0,27%	1,39%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.994.236,00	0,00	0,00	16.214.412,00	220.176,00	1,38%	0,27%	1,38%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	23.533.398,00	0,00	0,00	23.857.290,00	323.892,00	1,38%	0,27%	1,38%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	73.119.969,25	0,00	0,00	73.945.196,53	825.227,28	1,13%	0,52%	1,13%
CAIXA BRASIL 2018 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	24.323.020,00	0,00	0,00	24.597.180,00	274.160,00	1,13%	0,52%	1,13%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	90.744.906,12	0,00	0,00	91.767.073,70	1.022.167,58	1,13%	0,52%	1,13%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.321.716,38	0,00	0,00	9.426.024,75	104.308,37	1,12%	0,52%	1,12%
CASAN SANEAMENTO FIDC SÊNIOR	6.092.076,25	0,00	166.883,65	5.982.315,21	57.122,61	0,94%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.099.137,87	0,00	0,00	10.180.102,95	80.965,08	0,80%	1,05%	0,80%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	23.203.299,48	0,00	0,00	23.339.311,11	136.011,63	0,59%	0,12%	0,59%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	107.720.951,77	0,00	0,00	108.351.728,95	630.777,18	0,59%	0,12%	0,59%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	88.985.551,29	0,00	0,00	89.433.932,14	448.380,85	0,50%	0,69%	0,50%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	91.169.686,40	177.688.900,00	0,00	269.643.121,46	784.535,06	0,29%	0,69%	0,50%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	33.076.523,32	89.579.272,22	19.698.000,00	103.218.684,82	260.889,28	0,21%	0,02%	0,50%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	61.513.415,17	187.883,65	0,00	61.831.421,29	130.122,47	0,21%	2,64%	0,21%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	17.570.930,84	165.902.135,18	0,00	183.803.534,75	330.468,73	0,18%	0,00%	0,51%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	147.705,70	326.436,08	193.976,65	280.988,41	823,28	0,17%	0,01%	0,50%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	7.034.194,58	0,00	0,00	7.046.196,59	12.002,01	0,17%	2,65%	0,17%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	25.046.478,97	0,00	0,00	25.082.732,01	36.253,04	0,14%	4,19%	0,14%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.020.780,00	0,00	0,00	14.034.230,00	13.450,00	0,10%	2,71%	0,10%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	121.255.279,86	0,00	121.091.506,12	0,00	-163.773,74	-0,14%	3,13%	0,44%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	234.133.949,35	0,00	233.563.887,21	0,00	-570.062,14	-0,24%	2,07%	0,19%

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

Ativos de Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	43.112.789,32	0,00	42.759.882,71	0,00	-352.906,61	-0,82%	2,95%	-0,02%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.507.970,60	0,00	3.468.612,47	0,00	-39.358,13	-1,12%	3,87%	-0,40%
Total Renda Fixa				4.789.430,46		0,42%	0,63%	

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

Ativos de Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	14.600.717,02	0,00	0,00	14.151.767,91	-448.949,11	-3,07%	9,13%	-3,07%
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	17.036.268,41	0,00	0,00	16.183.399,86	-852.868,55	-5,01%	10,92%	-5,01%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	3.114.000,00	0,00	21.000,00	2.748.000,00	-345.000,00	-11,08%	11,05%	-11,75%
			Total Renda Variável		-1.646.817,66	-4,74%	10,17%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2018

Ativos de Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	89.654.585,23	0,00	0,00	91.767.073,70	2.112.488,47	2,36%	2,36%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	72.239.931,15	0,00	0,00	73.945.196,53	1.705.265,38	2,36%	2,36%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	90.569.817,00	177.688.900,00	0,00	269.643.121,46	1.384.404,46	0,96%	1,17%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	79.997.946,96	8.406.212,34	0,00	89.433.932,14	1.029.772,84	1,16%	1,17%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	23.216.598,00	0,00	0,00	23.857.290,00	640.692,00	2,76%	2,76%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	107.744.684,77	0,00	0,00	108.351.728,95	607.044,18	0,56%	0,56%
CAIXA BRASIL 2018 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	24.031.120,00	0,00	0,00	24.597.180,00	566.060,00	2,36%	2,36%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	54.717.427,11	169.932.950,44	41.378.343,11	183.803.534,75	531.500,31	0,82%	1,52%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	66.184.548,83	141.411.419,04	104.899.645,62	103.218.684,82	522.362,57	0,63%	1,53%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.883.657,64	0,00	0,00	16.330.091,11	446.433,47	2,81%	2,81%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.778.824,00	0,00	0,00	16.214.412,00	435.588,00	2,76%	2,76%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.210.118,55	0,00	0,00	9.426.024,75	215.906,20	2,34%	2,34%
CASAN SANEAMENTO FIDC SÊNIOR	6.296.767,30	0,00	508.167,39	5.982.315,21	193.715,30	3,16%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	22.919.506,23	287.863,95	0,00	23.339.311,11	131.940,93	0,57%	0,57%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	61.136.048,90	573.821,67	0,00	61.831.421,29	121.550,72	0,20%	0,20%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.347.043,83	0,00	287.863,95	10.180.102,95	120.923,07	1,19%	-1,61%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.006.750,00	0,00	0,00	14.034.230,00	27.480,00	0,20%	0,20%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	8.402.156,94	0,00	8.406.212,34	0,00	4.055,40	0,05%	1,52%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	157.333,84	334.675,86	213.296,43	280.988,41	2.275,14	1,11%	1,52%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	7.060.984,77	0,00	0,00	7.046.196,59	-14.788,18	-0,21%	-0,21%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.628.022,46	0,00	3.468.612,47	0,00	-159.409,99	-4,39%	-3,70%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	25.616.004,77	0,00	0,00	25.082.732,01	-533.272,76	-2,08%	-2,08%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2018

Ativos de Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	24.058.990,26	19.700.830,21	42.759.882,71	0,00	-999.937,76	-2,29%	-1,53%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	104.766.457,05	17.923.786,90	121.091.506,12	0,00	-1.598.737,83	-1,30%	-0,75%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	185.848.648,80	50.915.145,62	233.563.887,21	0,00	-3.199.907,21	-1,35%	-0,93%
Total Renda Fixa					4.293.404,71	0,37%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2018

Ativos de Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	3.480.000,00	0,00	63.000,00	2.748.000,00	-669.000,00	-19,36%	-21,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	15.446.343,03	0,00	0,00	14.151.767,91	-1.294.575,12	-8,38%	-8,38%
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	18.457.454,20	0,00	0,00	16.183.399,86	-2.274.054,34	-12,32%	-12,32%
Total Renda Variável				-4.237.629,46	-11,34%		

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 2018

Ativos de Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	104.317.956,01	0,00	0,00	108.351.728,95	4.033.772,94	3,87%	3,87%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	90.562.835,37	0,00	2.581.952,39	91.767.073,70	3.786.190,72	4,26%	4,27%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	72.854.208,92	0,00	1.964.182,51	73.945.196,53	3.055.170,12	4,27%	1,50%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	87.909.468,56	178.789.914,39	0,00	269.643.121,46	2.943.738,51	2,72%	2,94%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	164.099.176,46	66.728.820,12	233.563.887,21	0,00	2.735.890,63	2,09%	2,55%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	78.620.825,02	8.406.212,34	0,00	89.433.932,14	2.406.894,78	2,94%	2,94%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	64.348.592,38	207.275.826,56	89.325.372,59	183.803.534,75	1.504.488,40	2,13%	3,12%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	52.385.009,77	209.957.419,04	160.615.145,62	103.218.684,82	1.491.401,63	1,81%	3,15%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	23.291.172,00	0,00	640.361,10	23.857.290,00	1.206.479,10	5,28%	2,43%
CAIXA BRASIL 2018 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	24.236.480,00	0,00	653.280,86	24.597.180,00	1.013.980,86	4,26%	1,49%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	60.841.745,68	0,00	61.831.421,29	989.675,61	1,64%	3,27%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.945.356,90	0,00	455.687,74	16.330.091,11	840.421,95	5,37%	5,38%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.828.744,00	0,00	434.572,99	16.214.412,00	820.240,99	5,28%	2,44%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	43.218.883,40	77.120.844,66	121.091.506,12	0,00	751.778,06	2,03%	2,70%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	58.537.399,45	0,00	59.197.057,76	0,00	659.658,31	1,13%	2,92%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	55.149.347,22	4.240.139,74	60.024.101,11	0,00	634.614,15	1,11%	2,95%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	25.141.134,19	0,00	666.753,99	25.082.732,01	608.351,81	2,42%	2,43%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	5.824.678,04	17.025.293,09	0,00	23.339.311,11	489.339,98	3,86%	3,89%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.906.850,00	0,00	355.428,32	14.034.230,00	482.808,32	3,52%	0,92%
CASAN SANEAMENTO FIDC SÉNIOR	6.543.940,52	0,00	989.297,86	5.982.315,21	427.672,55	6,94%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.301.395,68	0,00	262.607,24	9.426.024,75	387.236,31	4,25%	4,25%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.131.273,15	0,00	287.863,95	10.180.102,95	336.693,75	3,35%	0,48%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 2018

Ativos de Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	26.485.128,23	0,00	26.782.054,40	0,00	296.926,17	1,12%	2,94%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	8.270.126,47	0,00	8.406.212,34	0,00	136.085,87	1,65%	3,14%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	6.921.576,14	0,00	0,00	7.046.196,59	124.620,45	1,80%	1,80%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.459.494,08	0,00	3.468.612,47	0,00	9.118,39	0,26%	1,00%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	802.667,75	1.226.463,52	1.756.396,49	280.988,41	8.253,63	1,95%	3,07%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	594.166,89	0,00	600.429,08	0,00	6.262,19	1,05%	3,10%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	23.187.718,46	19.700.830,21	42.759.882,71	0,00	-128.665,96	1,39%	2,17%
Total Renda Fixa					32.059.100,22	2,89%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 2018

Ativos de Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	3.210.000,00	0,00	131.100,00	2.748.000,00	-330.900,00	-10,85%	-14,39%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	4.084.056,44	10.645.054,34	0,00	14.151.767,91	-577.342,87	2,69%	2,42%
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	0,00	18.340.548,56	0,00	16.183.399,86	-2.157.148,70	-11,76%	-6,09%
Total Renda Variável				-3.065.391,57	-2,07%		