

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



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 IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.433.543,48	1,91%	179	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	1.230.378,00	0,96%	223	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	628.435,12	0,49%	166	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.138.133,46	7,16%	638	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	6.778.407,45	5,31%	104	1,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.256.711,66	4,90%	661	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	9.825.370,62	7,69%	726	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	10.759.310,72	8,43%	273	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	8.379.208,48	6,56%	700	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	3.811.455,40	2,99%	95	0,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	13.467.570,10	10,55%	336	0,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	173.312,79	0,14%	192	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	6.155.882,92	4,82%	1.252	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	5.980.230,92	4,68%	470	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.242.377,12	0,97%	60	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	609.426,30	0,48%	133	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	2.527.208,05	1,98%	239	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.530.676,51	1,98%	697	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	14.649.891,25	11,47%	47	9,96%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.179.875,49	2,49%	669	0,25%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRANCO SMALL CAP PLUS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.053.838,59	0,83%	145	0,40%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	2.884.043,35	2,26%	2.004	2,89%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2018)

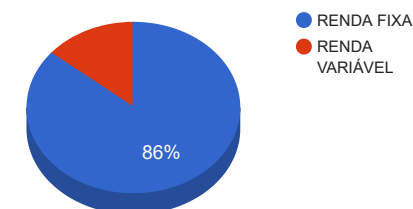
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	4.566.736,08	3,58%	2.573	1,93%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	2.899.907,48	2,27%	75	2,46%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.052.750,06	2,39%	69	2,30%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.471.109,94	2,72%	10.989	0,33%	Artigo 8º, Inciso III
<b>TOTAL -</b>			<b>127.685.791,34</b>				

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

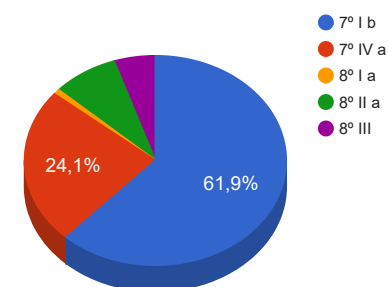
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	79.037.720,20	61,90%	15,00%	25,00%	90,00%	35.879.492,01
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	5,00%	60,00%	76.611.474,80
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	30.719.685,64	24,06%	5,00%	25,00%	40,00%	20.354.630,90
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	15,00%	15,00%	19.152.868,70
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	1.053.838,59	0,83%	0,00%	5,00%	15,00%	18.099.030,11
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	10.350.686,91	8,11%	0,00%	10,00%	15,00%	8.802.181,79
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	6.523.860,00	5,11%	0,00%	5,00%	10,00%	6.244.719,13
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	6.384.289,57
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	6.384.289,57
<b>Total Carteira</b>		<b>127.685.791,34</b>					

RENDA FIXA	109.757.405,84	85,96%
RENDA VARIÁVEL	17.928.385,50	14,04%

Distribuição por Segmento



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 "	79.037.720,20	61,90%	15,00%	90,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30.719.685,64	24,06%	5,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	1.053.838,59	0,83%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	10.350.686,91	8,11%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso III	6.523.860,00	5,11%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>127.685.791,34</b>	<b>100,00%</b>	<b>25,00</b>	<b>270,00</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	61.048.579,53	47,81%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	42.912.851,54	33,61%	0,00%
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	7.034.069,51	5,51%	0,00%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTO LTDA	5.783.950,83	4,53%	3,51%
WESTERN ASSET	3.471.109,94	2,72%	0,01%
INFINITY ASSET MANAGEMENT	3.052.750,06	2,39%	0,56%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	2.530.676,51	1,98%	0,00%
ITAÚ UNIBANCO	1.851.803,42	1,45%	0,00%

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 + 6,00% ao ano	1,75%	5,59%	3,38%	5,59%	10,58%	20,70%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,31%	2,03%	-2,39%	2,03%	9,92%	24,38%	0,15%	4,648%	4,13%
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 GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,45%	2,45%	-0,40%	2,45%	8,12%	-	0,002	1,526%	1,68%
IRF-M 1	0,55%	3,08%	1,25%	3,08%	7,81%	22,32%	-	-	-
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%
Selic	0,52%	3,18%	1,56%	3,18%	7,36%	21,18%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,51%	3,14%	1,52%	3,14%	7,55%	21,86%	0,20%	0,006%	0,11%
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%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,50%	3,08%	1,51%	3,08%	7,26%	21,07%	0,20%	0,007%	0,08%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,43%	2,62%	1,28%	2,62%	6,22%	18,92%	1,00%	0,003%	0,07%
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%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,29%	3,16%	0,13%	3,16%	9,69%	22,95%	0,20%	2,618%	2,11%

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
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 Geral	0,12%	2,44%	-0,99%	2,44%	8,47%	23,90%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,07%	2,17%	-1,16%	2,17%	7,96%	23,54%	0,20%	2,212%	2,35%
IMA Geral ex-C	0,10%	2,30%	-1,06%	2,30%	8,26%	24,11%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,19%	2,55%	-0,93%	2,55%	8,41%	-	0,30%	2,067%	2,47%
IRF-M	0,04%	2,37%	-1,35%	2,37%	8,94%	27,21%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,03%	2,30%	-1,53%	2,30%	8,61%	26,69%	0,20%	2,977%	2,87%
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	-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 VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,58%	3,59%	0,64%	3,59%	9,79%	22,95%	0,20%	1,937%	1,78%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,01%	-0,56%	-3,60%	-0,56%	3,40%	10,93%	0,20%	5,120%	5,88%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,36%	1,03%	-3,68%	1,03%	7,92%	22,14%	0,20%	3,952%	4,56%

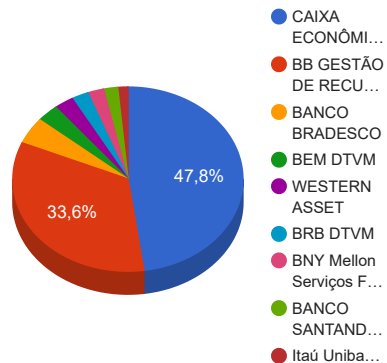


Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (junho / 2018)

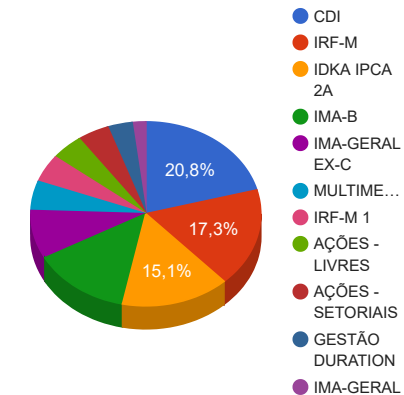
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
S&P 500	2,87%	18,40%	19,30%	18,40%	30,61%	55,43%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	0,16%	3,19%	4,13%	3,19%	17,93%	52,34%	1,00%	3,876%	12,06%
CDI	0,52%	3,17%	1,56%	3,17%	7,35%	21,15%	-	-	-
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,62%	3,51%	1,72%	3,51%	8,18%	23,78%	1,00%	0,735%	0,83%
Ibovespa	-5,20%	-4,76%	-14,76%	-4,76%	15,68%	41,22%	-	-	-
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	-4,37%	-0,53%	-12,40%	-0,53%	15,61%	38,53%	2,00%	12,196%	18,16%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-4,64%	-3,04%	-11,31%	-3,04%	17,84%	47,82%	2,00%	9,017%	14,40%
SMLL	-3,66%	-9,00%	-12,53%	-9,00%	13,97%	52,19%	-	-	-
BRDESCO SMALL CAP PLUS FI AÇÕES	-2,97%	-1,35%	-8,67%	-1,35%	20,70%	54,68%	1,50%	11,770%	17,10%
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	61.048.579,53	47,81%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	42.912.851,54	33,61%
BANCO BRADESCO	5.980.230,92	4,68%
BEM DTVM	3.953.746,07	3,10%
WESTERN ASSET	3.471.109,94	2,72%
BRB DTVM	3.052.750,06	2,39%
BNY Mellon Serviços Financeiros	2.884.043,35	2,26%
BANCO SANTANDER	2.530.676,51	1,98%
Itaú Unibanco	1.851.803,42	1,45%

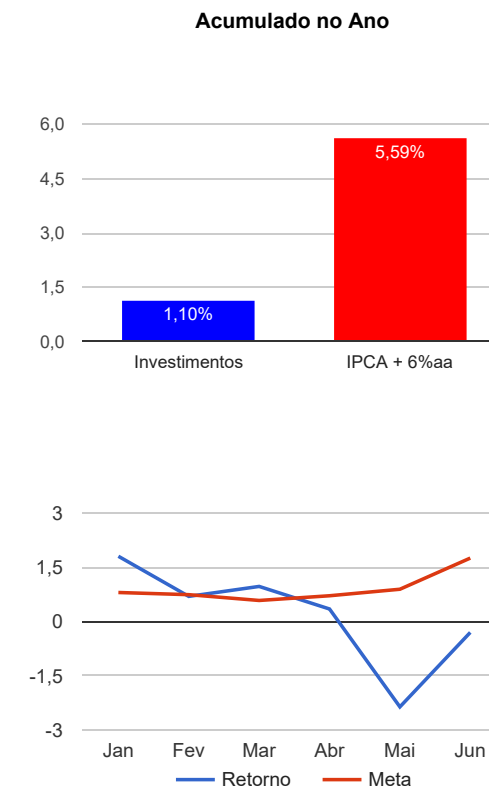


Sub-segmento	Valor	%
CDI	26.340.674,17	20,63%
IRF-M	21.846.778,58	17,11%
IDKA IPCA 2A	19.136.816,87	14,99%
IMA-B	17.475.009,63	13,69%
IMA-GERAL EX-C	10.759.310,72	8,43%
MULTIMERCADO	6.523.860,00	5,11%
IRF-M 1	6.155.882,92	4,82%
AÇÕES - LIVRES	5.783.950,83	4,53%
AÇÕES - SETORIAIS	5.620.574,67	4,40%
GESTÃO DURATION	4.379.011,47	3,43%
IMA-GERAL	2.433.543,48	1,91%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	105.724.325,65	42.751.442,59	36.725.304,21	113.762.419,68	2.011.955,65	1,80%	0,80%	224,64%	1,43%
Fevereiro	113.762.419,68	17.110.714,95	14.479.418,37	117.200.198,64	806.482,38	0,69%	0,74%	93,84%	2,18%
Março	117.200.198,64	6.221.758,25	3.503.728,27	121.078.344,57	1.160.115,95	0,97%	0,58%	167,61%	1,45%
Abril	121.078.344,57	5.098.702,39	1.201.041,89	125.406.874,85	430.869,78	0,34%	0,71%	48,71%	1,47%
Mai	125.406.874,85	909.126,24	1.067.848,93	122.291.546,94	-2.956.605,22	-2,36%	0,89%	-265,29%	2,57%
Junho	122.291.546,94	37.726.815,86	31.945.538,72	127.685.791,34	-387.032,74	-0,30%	1,75%	-17,24%	2,92%
Acumulado no ano					1.065.785,80	1,10%	5,59%	19,67%	



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 IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	9.000.000,00	0,00	9.138.133,46	138.133,46	1,53%	2,64%	0,21%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.216.647,00	0,00	0,00	1.230.378,00	13.731,00	1,13%	0,52%	1,13%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	171.394,91	0,00	0,00	173.312,79	1.917,88	1,12%	0,52%	1,12%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00	2.500.000,00	0,00	2.527.208,05	27.208,05	1,09%	1,53%	0,45%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.745.067,21	4.000.000,00	0,00	9.825.370,62	80.303,41	0,82%	2,62%	0,29%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	299.519,36	5.812.084,12	0,00	6.155.882,92	44.279,44	0,72%	0,69%	0,50%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	605.874,82	0,00	0,00	609.426,30	3.551,48	0,59%	0,12%	0,59%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.295.829,91	0,00	61.000,00	1.242.377,12	7.547,21	0,58%	0,12%	0,59%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	624.816,62	0,00	0,00	628.435,12	3.618,50	0,58%	1,94%	0,58%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	5.950.112,99	0,00	0,00	5.980.230,92	30.117,93	0,51%	0,01%	0,51%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.213.920,50	2.500.000,00	0,00	10.759.310,72	45.390,22	0,42%	2,07%	0,19%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	753.439,39	2.500.000,00	736.000,00	2.530.676,51	13.237,12	0,41%	0,00%	0,51%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	8.366.428,41	6.325.936,04	100.000,00	14.649.891,25	57.526,80	0,39%	0,01%	0,50%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.814.719,83	1.088.795,70	736.454,60	3.179.875,49	12.814,56	0,33%	0,00%	0,43%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.799.798,48	0,00	0,00	3.811.455,40	11.656,92	0,31%	4,65%	0,31%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	13.462.965,20	0,00	0,00	13.467.570,10	4.604,90	0,03%	2,98%	0,03%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.778.907,31	0,00	0,00	6.778.407,45	-499,86	-0,01%	5,12%	-0,01%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.484.372,93	0,00	9.000.000,00	2.433.543,48	-50.829,45	-0,44%	2,21%	0,07%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.966.583,58	0,00	6.500.000,00	8.379.208,48	-87.375,10	-0,58%	2,83%	0,01%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15.380.225,04	0,00	9.000.000,00	6.256.711,66	-123.513,38	-0,80%	3,95%	-0,36%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	2.984.566,81	0,00	2.952.628,20	0,00	-31.938,61	-1,07%	2,18%	0,08%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.917.056,90	0,00	2.859.455,92	0,00	-57.600,98	-1,97%	3,92%	-0,35%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>143.881,50</b>	<b>0,13%</b>	<b>2,09%</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(%)
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	1.030.214,21	2.000.000,00	0,00	3.052.750,06	22.535,85	0,74%	0,74%	0,62%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	1.509.719,95	2.000.000,00	0,00	3.471.109,94	-38.610,01	-1,10%	3,88%	0,16%
BRDESCO SMALL CAP PLUS FI AÇÕES	1.086.079,35	0,00	0,00	1.053.838,59	-32.240,76	-2,97%	11,77%	-2,97%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	3.032.398,22	0,00	0,00	2.899.907,48	-132.490,74	-4,37%	12,20%	-4,37%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	4.776.420,64	0,00	0,00	4.566.736,08	-209.684,56	-4,39%	11,84%	-4,39%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3.024.467,37	0,00	0,00	2.884.043,35	-140.424,02	-4,64%	9,02%	-4,64%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>-530.914,24</b>	<b>-2,88%</b>	<b>8,01%</b>	

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 IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	9.000.000,00	0,00	9.138.133,46	138.133,46	1,53%	0,20%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	4.221.406,86	10.626.273,49	321.000,00	14.649.891,25	123.210,90	1,17%	1,51%
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	5.890.831,05	0,00	0,00	5.980.230,92	89.399,87	1,52%	1,52%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.754.241,01	4.000.000,00	0,00	9.825.370,62	71.129,61	0,66%	0,13%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	297.548,61	5.812.084,12	0,00	6.155.882,92	46.250,19	1,39%	1,17%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.403.979,73	2.796.286,88	2.057.345,42	3.179.875,49	36.954,30	1,03%	1,28%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.202.004,00	0,00	0,00	1.230.378,00	28.374,00	2,36%	2,36%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00	2.500.000,00	0,00	2.527.208,05	27.208,05	1,09%	-0,40%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.412.693,11	2.500.000,00	1.406.000,00	2.530.676,51	23.983,40	1,40%	1,52%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.353.141,03	0,00	118.000,00	1.242.377,12	7.236,09	0,56%	0,56%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	624.408,50	0,00	0,00	628.435,12	4.026,62	0,64%	0,64%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	169.343,00	0,00	0,00	173.312,79	3.969,79	2,34%	2,34%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	605.987,46	0,00	0,00	609.426,30	3.438,84	0,57%	0,57%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.306.894,99	2.500.000,00	0,00	10.759.310,72	-47.584,27	-0,70%	-0,93%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.021.094,99	0,00	2.952.628,20	0,00	-68.466,79	-2,27%	-1,13%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.904.597,02	0,00	0,00	3.811.455,40	-93.141,62	-2,39%	-2,39%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.016.967,27	0,00	2.859.455,92	0,00	-157.511,35	-5,22%	-3,65%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.628.020,97	0,00	9.000.000,00	2.433.543,48	-194.477,49	-1,67%	-1,16%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	13.676.975,17	0,00	0,00	13.467.570,10	-209.405,07	-1,53%	-1,53%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.031.895,06	0,00	0,00	6.778.407,45	-253.487,61	-3,60%	-3,60%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.184.810,03	0,00	6.500.000,00	8.379.208,48	-305.601,55	-2,01%	-1,42%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15.910.284,72	0,00	9.000.000,00	6.256.711,66	-653.573,06	-4,11%	-3,68%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>-1.379.933,69</b>	<b>-1,26%</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 (%)
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	1.019.027,11	2.000.000,00	0,00	3.052.750,06	33.722,95	1,85%	1,72%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	1.452.164,41	2.000.000,00	0,00	3.471.109,94	18.945,53	2,82%	4,13%
BRDESCO SMALL CAP PLUS FI AÇÕES	1.153.939,25	0,00	0,00	1.053.838,59	-100.100,66	-8,67%	-8,67%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3.251.780,35	0,00	0,00	2.884.043,35	-367.737,00	-11,31%	-11,31%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	3.310.504,69	0,00	0,00	2.899.907,48	-410.597,21	-12,40%	-12,40%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	5.273.804,18	0,00	0,00	4.566.736,08	-707.068,10	-13,41%	-13,41%
Total Renda Variável					-1.532.834,49	-9,17%	

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 IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	13.165.235,87	0,00	0,00	13.467.570,10	302.334,23	2,30%	2,30%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.584.834,99	4.000.000,00	0,00	9.825.370,62	240.535,63	3,72%	3,16%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.024.587,51	2.500.000,00	0,00	10.759.310,72	234.723,21	2,79%	2,55%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.670.505,73	6.000.000,00	6.500.000,00	8.379.208,48	208.702,75	1,42%	2,26%
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	5.798.263,25	0,00	0,00	5.980.230,92	181.967,67	3,14%	3,14%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	23.809.844,13	23.356.952,74	32.693.255,37	14.649.891,25	176.349,75	1,55%	3,08%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	9.000.000,00	0,00	9.138.133,46	138.133,46	1,53%	3,27%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.816.854,05	0,00	176.107,51	6.778.407,45	137.660,91	1,98%	-0,56%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	11.400.000,00	9.072.000,00	2.433.543,48	105.543,48	1,05%	2,17%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.371.896,78	11.722.982,55	17.997.040,28	3.179.875,49	82.036,44	1,77%	2,62%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.145.148,76	5.829.769,40	4.900.000,00	6.155.882,92	80.964,76	2,69%	2,94%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.836.581,28	0,00	102.573,24	3.811.455,40	77.447,36	2,01%	2,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.443.005,83	0,00	254.000,00	1.242.377,12	53.371,29	3,85%	3,87%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.212.225,00	0,00	32.682,14	1.230.378,00	50.835,14	4,27%	1,50%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	4.668.862,59	2.166.000,00	2.530.676,51	27.813,92	1,58%	3,12%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00	2.500.000,00	0,00	2.527.208,05	27.208,05	1,09%	2,45%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	586.623,81	0,00	0,00	609.426,30	22.802,49	3,89%	3,89%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	623.416,55	0,00	16.946,68	628.435,12	21.965,25	3,58%	3,59%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	171.021,29	0,00	4.828,46	173.312,79	7.119,96	4,25%	4,25%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	192.964,07	0,00	195.362,59	0,00	2.398,52	1,34%	3,13%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	0,00	2.970.000,00	2.952.628,20	0,00	-17.371,80	-0,58%	2,19%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	2.970.000,00	2.859.455,92	0,00	-110.544,08	-3,72%	1,04%



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 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	15.399.993,00	9.000.000,00	6.256.711,66	-143.281,34	-0,61%	1,03%
				Total Renda Fixa	1.908.717,05	1,95%	

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 (%)
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	1.001.385,00	2.000.000,00	0,00	3.052.750,06	51.365,06	3,64%	3,51%
BRDESCO SMALL CAP PLUS FI AÇÕES	1.068.229,04	0,00	0,00	1.053.838,59	-14.390,45	-1,35%	-1,35%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	500.235,73	3.000.000,00	0,00	3.471.109,94	-29.125,79	3,03%	3,19%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	1.559.353,68	1.500.000,00	0,00	2.899.907,48	-159.446,20	-0,18%	-0,53%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.056.788,79	1.000.000,00	0,00	2.884.043,35	-172.745,44	-3,70%	-3,04%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	5.085.324,51	0,00	0,00	4.566.736,08	-518.588,43	-10,20%	-10,20%
Total Renda Variável					-842.931,25	-3,70%	