

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 IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.613.801,27	10,49%	336	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	599.871,00	0,83%	539	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	1.114.670,70	1,54%	107	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.338.505,74	1,84%	116	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	10.105.455,01	13,92%	1.438	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	725.348,48	1,00%	95	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.205.103,34	3,04%	638	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	1.103.581,38	1,52%	72	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2030	1.336.648,00	1,84%	34	0,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.647.681,79	9,16%	711	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	93.894,61	0,13%	1.252	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	2.158.991,59	2,97%	223	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	69.896,86	0,10%	726	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.725.368,88	5,13%	661	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+0	Não há	896.038,62	1,23%	276	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	4.871.853,78	6,71%	239	0,27%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.074.215,03	2,86%	47	1,41%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.117.735,19	1,54%	470	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	2.012.355,45	2,77%	133	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.403.078,38	4,69%	761	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	4.349.726,79	5,99%	10.471	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	1.001.647,39	1,38%	70	0,21%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "

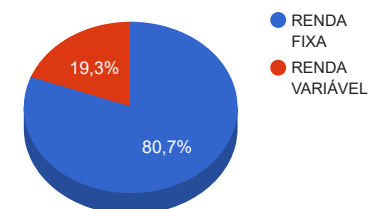
Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.517.428,18	2,09%	6	2,74%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.208.667,01	1,66%	34	1,78%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	2.321.514,95	3,20%	2.787	6,53%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.212.231,80	3,05%	1.396	0,16%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	2.683.352,43	3,70%	538	4,84%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	D+45	5 anos	729.043,45	1,00%	55	0,77%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.032.640,00	1,42%	109	0,14%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	2.053.956,20	2,83%	729	0,80%	Artigo 8º, Inciso III
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	286.558,05	0,39%		0,01%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
		TOTAL -	72.610.861,35				

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

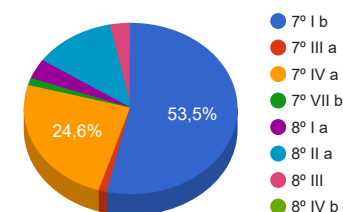
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	38.838.818,65	53,49%	15,00%	25,00%	90,00%	26.510.956,57
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	896.038,62	1,23%	5,00%	10,00%	60,00%	42.670.478,19
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	17.828.964,62	24,55%	5,00%	10,00%	40,00%	11.215.379,92
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	15,00%	15,00%	10.891.629,20
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	3.630.543,07
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	1.001.647,39	1,38%	0,00%	5,00%	5,00%	2.628.895,68
Total Renda Fixa	100,00%	58.565.469,28	80,66%	25,00	70,00	220,00	-

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%	2.726.095,19	3,75%	0,00%	5,00%	10,00%	4.534.990,95
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	8.978.782,63	12,37%	0,00%	5,00%	20,00%	5.543.389,64
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.053.956,20	2,83%	0,00%	10,00%	10,00%	5.207.129,94
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	3.630.543,07
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	286.558,05	0,39%	0,00%	5,00%	5,00%	3.343.985,02
Total Renda Variável	30,00%	14.045.392,07	19,34%	0,00	30,00	50,00	-

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 "	38.838.818,65	53,49%	15,00%	90,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	896.038,62	1,23%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	17.828.964,62	24,55%	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 "	1.001.647,39	1,38%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	58.565.469,28	80,66%	25,00	220,00

Artigos - Renda Variável	Base: junho / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	2.726.095,19	3,75%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	8.978.782,63	12,37%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	2.053.956,20	2,83%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	286.558,05	0,39%	0,00%	5,00%
Total Renda Variável	14.045.392,07	19,34%	0,00	50,00

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
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	56.470.626,77	77,77%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	7.232.242,46	9,96%	0,00%
ITAÚ UNIBANCO	4.562.423,63	6,28%	0,00%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	3.329.966,99	4,59%	0,00%
VINCI PARTNERS	729.043,45	1,00%	0,00%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	286.558,05	0,39%	0,02%

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%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,38%	2,37%	2,77%	2,37%	3,75%	7,17%	0,20%	0,273%	4,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,37%	5,26%	2,75%	5,26%	9,76%	20,29%	0,20%	0,273%	0,37%
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%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,45%	2,45%	-0,40%	2,45%	8,12%	-	0,002	1,526%	1,68%
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%

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%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,50%	2,95%	1,18%	2,95%	7,60%	21,87%	0,20%	0,685%	0,50%

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%	-	-	-
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 PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,50%	3,15%	1,53%	3,15%	7,41%	21,42%	0,20%	0,023%	0,09%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,50%	3,06%	1,51%	3,06%	7,15%	20,99%	0,25%	0,021%	0,07%

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

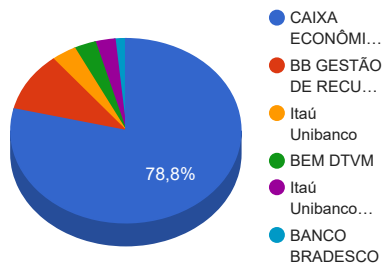
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5	0,45%	2,81%	-0,70%	2,81%	9,73%	22,81%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,42%	2,68%	-0,77%	2,68%	9,48%	22,32%	0,20%	3,126%	2,66%
IDKA IPCA 2 Anos	0,17%	2,98%	-0,03%	2,98%	9,98%	24,14%	-	-	-
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%
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%
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%
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%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,10%	0,90%	0,21%	0,90%	5,01%	12,01%	0,20%	2,709%	4,27%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,01%	-0,57%	-3,60%	-0,57%	3,38%	10,70%	0,20%	5,121%	5,89%
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%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,36%	1,14%	-3,55%	1,14%	7,95%	22,20%	0,20%	3,802%	4,44%
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)

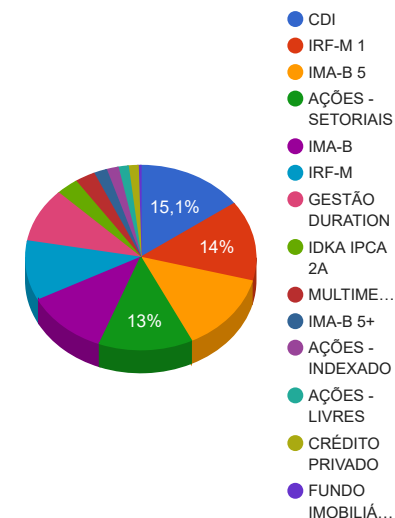
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	-5,20%	-4,76%	-14,76%	-4,76%	15,68%	41,22%	-	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	-0,26%	-	-0,58%	-	-	-	1,60%	2,646%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-3,07%	2,42%	-8,38%	2,42%	24,31%	-	2,50%	9,132%	15,49%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	-4,43%	-9,63%	-14,83%	-9,63%	5,53%	20,79%	2,00%	11,705%	17,97%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	-5,23%	-4,95%	-14,81%	-4,95%	14,95%	39,57%	0,50%	11,388%	18,37%
ICON	-4,55%	-18,21%	-15,77%	-18,21%	1,50%	11,51%	-	-	-
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	-5,25%	-19,48%	-16,89%	-19,48%	-0,10%	8,67%	1,60%	11,923%	17,65%
IGCT	-4,35%	-5,87%	-13,68%	-5,87%	13,59%	43,00%	-	-	-
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	-4,39%	-6,05%	-13,81%	-6,05%	13,16%	41,98%	0,90%	11,684%	17,70%
IDIV	-4,33%	-6,87%	-15,61%	-6,87%	8,85%	48,78%	-	-	-
BRADESCO 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%	-	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	0,30%	-	-
SMLL	-3,66%	-9,00%	-12,53%	-9,00%	13,97%	52,19%	-	-	-
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	-4,71%	-6,74%	-14,98%	-6,74%	14,42%	17,48%	1,72%	11,696%	17,23%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	57.199.670,22	78,78%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	7.518.800,51	10,35%
Itaú Unibanco	2.550.068,18	3,51%
BEM DTVM	2.212.231,80	3,05%
Itaú Unibanco S.A.	2.012.355,45	2,77%
BANCO BRADESCO	1.117.735,19	1,54%



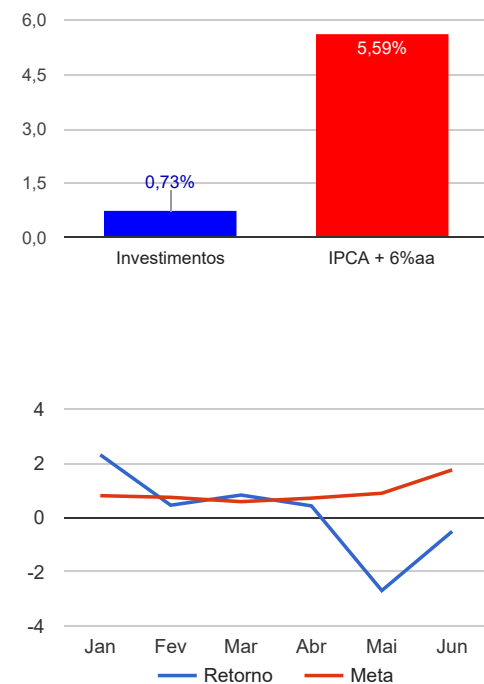
Sub-segmento	Valor	%
CDI	10.944.755,39	15,07%
IRF-M 1	10.199.349,62	14,05%
IMA-B 5	9.921.344,08	13,66%
AÇÕES - SETORIAIS	9.463.570,81	13,03%
IMA-B	8.388.714,10	11,55%
IRF-M	7.613.801,27	10,49%
GESTÃO DURATION	6.884.209,23	9,48%
IDKA IPCA 2A	2.275.000,20	3,13%
MULTIMERCADO	2.053.956,20	2,83%
IMA-B 5+	1.336.648,00	1,84%
AÇÕES - INDEXADO	1.208.667,01	1,66%
AÇÕES - LIVRES	1.032.640,00	1,42%
CRÉDITO PRIVADO	1.001.647,39	1,38%
FUNDO IMOBILIÁRIO	286.558,05	0,39%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	74.839.932,74	5.062.074,36	6.070.623,12	75.556.887,15	1.725.503,17	2,31%	0,80%	287,67%	2,05%
Fevereiro	75.556.887,15	2.895.072,78	3.934.061,59	74.857.607,11	339.708,77	0,45%	0,74%	60,89%	2,62%
Março	74.857.607,11	8.446.072,79	9.581.353,87	74.339.187,50	616.861,47	0,82%	0,58%	142,77%	1,69%
Abril	74.339.187,50	1.203.821,13	2.363.417,02	73.495.581,69	315.990,08	0,43%	0,71%	60,05%	1,68%
Mai	73.495.581,69	5.206.006,73	4.318.893,09	72.380.507,67	-2.002.187,66	-2,69%	0,89%	-302,88%	2,86%
Junho	72.380.507,67	3.803.919,33	3.198.156,10	72.610.861,35	-375.409,55	-0,51%	1,75%	-29,34%	3,30%
Acumulado no ano					620.466,28	0,73%	5,59%	13,09%	

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 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.318.440,00	0,00	0,00	1.336.648,00	18.208,00	1,38%	0,27%	1,38%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.320.393,98	0,00	0,00	1.338.505,74	18.111,76	1,37%	0,27%	1,37%	
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.134.897,27	0,00	0,00	2.158.991,59	24.094,32	1,13%	0,52%	1,13%	
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	2.000.628,30	0,00	0,00	2.012.355,45	11.727,15	0,59%	0,12%	0,59%	
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.112.106,01	0,00	0,00	1.117.735,19	5.629,18	0,51%	0,01%	0,51%	
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	2.063.872,72	0,00	0,00	2.074.215,03	10.342,31	0,50%	0,01%	0,50%	
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	93.427,67	0,00	0,00	93.894,61	466,94	0,50%	0,69%	0,50%	
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.342.715,77	43.575,56	0,00	3.403.078,38	16.787,05	0,50%	0,02%	0,50%	
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.328.283,02	0,00	0,00	4.349.726,79	21.443,77	0,50%	0,02%	0,50%	
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	4.850.035,09	0,00	0,00	4.871.853,78	21.818,69	0,45%	1,53%	0,45%	
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.619.829,51	0,00	0,00	6.647.681,79	27.852,28	0,42%	3,13%	0,42%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.496.768,70	3.760.343,77	3.198.156,10	10.105.455,01	46.498,64	0,35%	0,68%	0,50%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	723.130,08	0,00	0,00	725.348,48	2.218,40	0,31%	4,65%	0,31%	
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	69.696,36	0,00	0,00	69.896,86	200,50	0,29%	2,62%	0,29%	
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.200.526,98	0,00	0,00	2.205.103,34	4.576,36	0,21%	2,64%	0,21%	
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.000.444,64	0,00	0,00	1.001.647,39	1.202,75	0,12%	3,03%	0,12%	
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.113.551,46	0,00	0,00	1.114.670,70	1.119,24	0,10%	2,71%	0,10%	
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.611.197,93	0,00	0,00	7.613.801,27	2.603,34	0,03%	2,98%	0,03%	
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.103.665,60	0,00	0,00	1.103.581,38	-84,22	-0,01%	5,12%	-0,01%	
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	601.985,20	0,00	0,00	599.871,00	-2.114,20	-0,35%	3,92%	-0,35%	
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	899.261,63	0,00	0,00	896.038,62	-3.223,01	-0,36%	3,80%	-0,36%	
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.738.824,84	0,00	0,00	3.725.368,88	-13.455,96	-0,36%	3,95%	-0,36%	
Total Renda Fixa						216.023,29	0,37%	1,74%	

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(%)
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	2.059.360,02	0,00	0,00	2.053.956,20	-5.403,82	-0,26%	2,65%	-0,26%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	289.151,67	0,00	0,00	286.558,05	-2.593,62	-0,90%	-	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.065.399,36	0,00	0,00	1.032.640,00	-32.759,36	-3,07%	9,13%	-3,07%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	1.587.072,18	0,00	0,00	1.517.428,18	-69.644,00	-4,39%	11,68%	-4,39%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	2.807.749,60	0,00	0,00	2.683.352,43	-124.397,17	-4,43%	11,71%	-4,43%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	765.055,08	0,00	0,00	729.043,45	-36.011,63	-4,71%	11,70%	-4,71%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	1.275.335,81	0,00	0,00	1.208.667,01	-66.668,80	-5,23%	11,39%	-5,23%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	2.450.096,80	0,00	0,00	2.321.514,95	-128.581,85	-5,25%	11,92%	-5,25%
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.337.604,39	0,00	0,00	2.212.231,80	-125.372,59	-5,36%	10,45%	-5,36%
Total Renda Variável					-591.432,84	-4,04%	9,96%	

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.921.076,67	8.139.854,42	5.049.548,53	10.105.455,01	94.072,45	0,90%	1,18%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	7.835.248,20	28.397,21	3.595.700,78	4.349.726,79	81.782,16	1,35%	1,51%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.386.144,35	1.045.495,56	1.080.202,94	3.403.078,38	51.641,41	1,41%	1,53%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.109.202,64	0,00	0,00	2.158.991,59	49.788,95	2,36%	2,36%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.300.570,00	0,00	0,00	1.336.648,00	36.078,00	2,77%	2,77%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.302.729,94	0,00	0,00	1.338.505,74	35.775,80	2,75%	2,75%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	2.043.274,50	0,00	0,00	2.074.215,03	30.940,53	1,51%	1,51%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.101.025,91	0,00	0,00	1.117.735,19	16.709,28	1,52%	1,52%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	2.001.000,22	0,00	0,00	2.012.355,45	11.355,23	0,57%	0,57%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.351.443,63	0,00	151.293,96	2.205.103,34	4.953,67	0,22%	0,20%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.112.329,57	0,00	0,00	1.114.670,70	2.341,13	0,21%	0,21%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,00	1.000.000,00	0,00	1.001.647,39	1.647,39	0,16%	-0,70%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	92.812,94	0,00	0,00	93.894,61	1.081,67	1,17%	1,17%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	69.807,65	0,00	0,00	69.896,86	89,21	0,13%	0,13%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	743.074,02	0,00	0,00	725.348,48	-17.725,54	-2,39%	-2,39%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	4.891.284,16	0,00	0,00	4.871.853,78	-19.430,38	-0,40%	-0,40%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	622.603,43	0,00	0,00	599.871,00	-22.732,43	-3,65%	-3,65%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	928.981,23	0,00	0,00	896.038,62	-32.942,61	-3,55%	-3,55%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.144.839,15	0,00	0,00	1.103.581,38	-41.257,77	-3,60%	-3,60%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.699.431,53	0,00	0,00	6.647.681,79	-51.749,74	-0,77%	-0,77%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.732.187,03	0,00	0,00	7.613.801,27	-118.385,76	-1,53%	-1,53%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.867.678,62	0,00	0,00	3.725.368,88	-142.309,74	-3,68%	-3,68%
Total Renda Fixa					-28.277,09	-0,05%	

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 (%)
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	295.817,71	0,00	3.720,00	286.558,05	-5.539,66	-1,89%	0,00%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	2.065.963,35	0,00	0,00	2.053.956,20	-12.007,15	-0,58%	-0,58%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.127.103,82	0,00	0,00	1.032.640,00	-94.463,82	-8,38%	-8,38%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	857.500,51	0,00	0,00	729.043,45	-128.457,06	-14,98%	-14,98%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	1.418.831,31	0,00	0,00	1.208.667,01	-210.164,30	-14,81%	-14,81%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	1.760.522,22	0,00	0,00	1.517.428,18	-243.094,04	-13,81%	-13,81%
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.612.673,98	0,00	0,00	2.212.231,80	-400.442,18	-15,33%	-15,33%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	3.150.662,16	0,00	0,00	2.683.352,43	-467.309,73	-14,83%	-14,83%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	2.793.367,05	0,00	0,00	2.321.514,95	-471.852,10	-16,89%	-16,89%
Total Renda Variável					-2.033.330,04	-12,65%	

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 MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.610.629,08	3.461.808,60	9.950.762,02	4.349.726,79	228.051,13	2,72%	3,06%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.017.646,70	13.617.157,60	10.741.956,56	10.105.455,01	212.607,27	2,27%	2,95%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.474.439,30	0,00	0,00	6.647.681,79	173.242,49	2,68%	2,68%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.442.878,62	0,00	0,00	7.613.801,27	170.922,65	2,30%	2,30%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.926.814,72	1.146.052,55	3.781.202,91	3.403.078,38	111.414,02	2,79%	3,15%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.127.137,82	0,00	57.348,60	2.158.991,59	89.202,37	4,27%	1,50%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.281.526,31	0,00	151.293,96	2.205.103,34	74.870,99	3,30%	3,27%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	2.097.359,83	2.000.000,00	2.153.877,65	2.012.355,45	68.873,27	3,09%	3,89%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.305.662,00	0,00	36.976,95	1.336.648,00	67.962,95	5,31%	2,37%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.308.164,77	0,00	37.035,13	1.338.505,74	67.376,10	5,25%	5,26%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	2.012.282,79	0,00	0,00	2.074.215,03	61.932,24	3,08%	3,08%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	2.013.578,94	2.810.511,32	0,00	4.871.853,78	47.763,52	1,86%	2,45%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.800.508,22	0,00	117.000,00	3.725.368,88	41.860,66	1,02%	1,03%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.104.725,68	0,00	28.725,02	1.114.670,70	38.670,04	3,55%	0,90%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	804.691,29	281.000,00	0,00	1.117.735,19	32.043,90	3,10%	3,14%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.109.864,02	0,00	28.746,47	1.103.581,38	22.463,83	1,99%	-0,57%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	730.130,13	0,00	19.520,46	725.348,48	14.738,81	2,01%	2,03%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	693.107,80	0,00	636.925,25	69.896,86	13.714,31	2,10%	3,16%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	912.977,78	0,00	28.000,00	896.038,62	11.060,84	1,13%	1,14%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	682.901,48	0,00	598.955,04	93.894,61	9.948,17	2,48%	2,94%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	612.127,56	0,00	19.000,00	599.871,00	6.743,44	1,02%	1,04%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,00	1.000.000,00	0,00	1.001.647,39	1.647,39	0,16%	3,06%
Total Renda Fixa					1.567.110,39	2,65%	

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 (%)
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	0,00	2.000.000,00	0,00	2.053.956,20	53.956,20	2,70%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.008.261,44	0,00	0,00	1.032.640,00	24.378,56	2,42%	2,42%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	290.512,39	0,00	10.980,00	286.558,05	7.025,66	2,40%	0,00%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	1.180.984,16	0,00	435.198,77	729.043,45	-16.741,94	-6,94%	-6,74%
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.524.943,50	0,00	281.000,00	2.212.231,80	-31.711,70	-2,80%	-2,56%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	1.316.667,12	100.109,31	155.000,00	1.208.667,01	-53.109,42	-5,37%	-4,95%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	1.796.875,80	0,00	197.000,00	1.517.428,18	-82.447,62	-6,15%	-6,05%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	2.869.606,54	100.129,74	0,00	2.683.352,43	-286.383,85	-9,64%	-9,63%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	2.782.926,95	100.198,00	0,00	2.321.514,95	-561.610,00	-19,48%	-19,48%
Total Renda Variável					-946.644,11	-6,72%	