

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 IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.611.197,93	10,52%	364	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	601.985,20	0,83%	584	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	1.113.551,46	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	1.320.393,98	1,82%	116	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	9.496.768,70	13,12%	1.416	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	723.130,08	1,00%	95	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.200.526,98	3,04%	661	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	1.103.665,60	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	1.318.440,00	1,82%	34	0,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.619.829,51	9,15%	737	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	93.427,67	0,13%	1.230	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	2.134.897,27	2,95%	223	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	69.696,36	0,10%	742	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.738.824,84	5,17%	729	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+0	Não há	899.261,63	1,24%	300	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	4.850.035,09	6,70%	227	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.063.872,72	2,85%	38	2,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.112.106,01	1,54%	469	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	2.000.628,30	2,76%	131	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.342.715,77	4,62%	724	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	4.328.283,02	5,98%	9.866	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	1.000.444,64	1,38%	70	0,21%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "

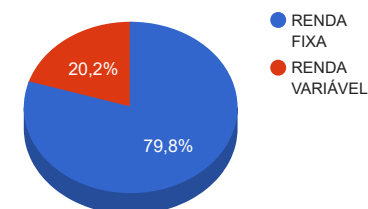
Carteira consolidada de investimentos - base (maio / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.587.072,18	2,19%	7	2,67%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.275.335,81	1,76%	36	2,08%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	2.450.096,80	3,39%	2.824	5,24%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.337.604,39	3,23%	1.408	0,15%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	2.807.749,60	3,88%	586	4,12%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	D+45	5 anos	765.055,08	1,06%	55	0,77%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.065.399,36	1,47%	100	0,16%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	2.059.360,02	2,85%	729	0,80%	Artigo 8º, Inciso III
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	289.151,67	0,40%		0,01%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
		TOTAL -	72.380.507,67				

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

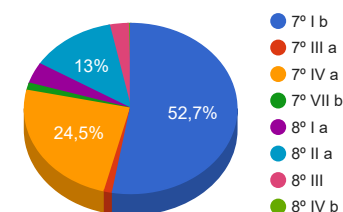
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	38.146.335,58	52,70%	15,00%	25,00%	90,00%	26.996.121,32
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	899.261,63	1,24%	5,00%	10,00%	60,00%	42.529.042,97
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	17.697.640,91	24,45%	5,00%	10,00%	40,00%	11.254.562,16
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	15,00%	15,00%	10.857.076,15
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	3.619.025,38
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	1.000.444,64	1,38%	0,00%	5,00%	5,00%	2.618.580,74
Total Renda Fixa	100,00%	57.743.682,76	79,78%	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%	2.862.407,99	3,95%	0,00%	5,00%	10,00%	4.375.642,78
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	9.425.905,23	13,02%	0,00%	5,00%	20,00%	5.050.196,30
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.059.360,02	2,85%	0,00%	10,00%	10,00%	5.178.690,75
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	3.619.025,38
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	289.151,67	0,40%	0,00%	5,00%	5,00%	3.329.873,71
Total Renda Variável	30,00%	14.636.824,91	20,22%	0,00	30,00	50,00	-

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 "	38.146.335,58	52,70%	15,00%	90,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	899.261,63	1,24%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	17.697.640,91	24,45%	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 "	1.000.444,64	1,38%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	57.743.682,76	79,78%	25,00	220,00

Artigos - Renda Variável	Base: maio / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	2.862.407,99	3,95%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	9.425.905,23	13,02%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	2.059.360,02	2,85%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	289.151,67	0,40%	0,00%	5,00%
Total Renda Variável	14.636.824,91	20,22%	0,00	50,00

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
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	56.071.696,98	77,47%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	7.151.793,70	9,88%	0,00%
ITAÚ UNIBANCO	4.653.099,84	6,43%	0,00%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	3.449.710,40	4,77%	0,00%
VINCI PARTNERS	765.055,08	1,06%	0,00%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	289.151,67	0,40%	0,02%

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 + 6,00% ao ano	0,89%	3,77%	2,19%	4,71%	8,95%	19,64%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,70%	0,98%	2,12%	1,69%	2,83%	6,90%	0,20%	0,106%	4,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,69%	3,83%	2,09%	4,56%	8,79%	20,00%	0,20%	0,106%	0,34%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-2,87%	1,71%	-0,64%	2,78%	9,96%	24,69%	0,15%	2,096%	3,18%
Selic	0,52%	2,65%	1,58%	3,20%	7,67%	21,96%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,50%	2,62%	1,53%	3,16%	7,90%	22,67%	0,20%	0,003%	0,11%
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 MATRIZ FI RENDA FIXA	0,50%	2,56%	1,53%	3,11%	7,61%	21,86%	0,20%	0,003%	0,09%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,50%	2,55%	1,52%	3,09%	7,50%	21,80%	0,25%	0,007%	0,09%
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%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-1,17%	1,99%	0,32%	2,80%	8,10%	-	0,002	1,276%	1,48%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	-1,29%	2,94%	0,97%	3,99%	11,54%	28,29%	0,20%	1,254%	2,04%
IRF-M 1	0,20%	2,52%	1,37%	3,10%	8,17%	22,97%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,19%	2,45%	1,32%	3,03%	7,99%	22,55%	0,20%	0,285%	0,31%
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%

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

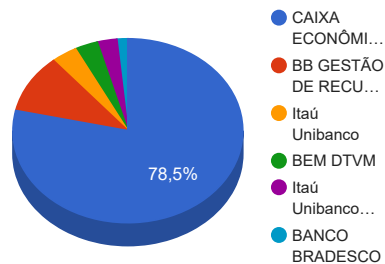
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	-3,16%	1,48%	-2,39%	2,32%	8,72%	25,38%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,80%	0,36%	1,80%	0,72%	2,60%	8,54%	0,20%	0,271%	3,90%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,81%	0,80%	1,75%	1,86%	5,50%	12,66%	0,20%	1,061%	3,99%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-3,07%	1,51%	-2,32%	2,34%	8,46%	24,98%	0,20%	2,566%	4,04%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-3,17%	1,39%	-2,44%	2,21%	8,45%	24,83%	0,20%	2,606%	4,16%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-3,18%	1,39%	-2,45%	2,21%	8,48%	24,94%	0,20%	2,616%	4,17%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-3,32%	-0,56%	-1,48%	0,04%	3,55%	11,52%	0,20%	2,531%	5,14%
IRF-M	-1,85%	2,32%	-0,09%	3,60%	10,37%	29,87%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,91%	2,26%	-0,29%	3,48%	10,02%	29,19%	0,20%	1,750%	2,39%
IMA-B 5	-1,56%	2,35%	0,46%	3,25%	9,82%	23,40%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,59%	2,25%	0,39%	3,13%	9,58%	22,93%	0,20%	1,313%	1,97%
IDKA IPCA 2 Anos	-1,02%	2,81%	1,39%	4,00%	10,66%	25,09%	-	-	-
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%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,84%	2,87%	1,32%	3,76%	10,05%	23,60%	0,20%	1,010%	1,48%

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

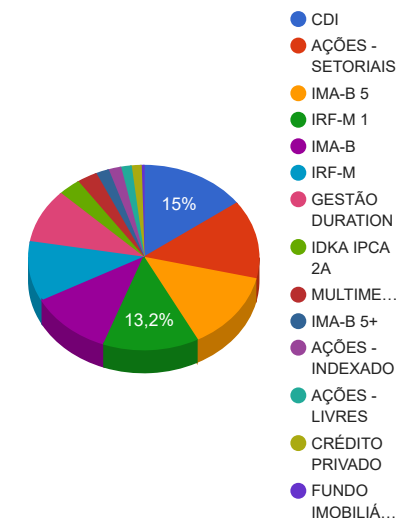
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	-11,31%	-5,55%	-9,13%	1,10%	18,75%	72,39%	-	-	-
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	-11,22%	-2,13%	-8,72%	5,58%	20,44%	27,37%	1,72%	11,777%	15,81%
Ibovespa	-10,87%	0,46%	-10,08%	6,65%	22,39%	58,35%	-	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	-0,84%	-	1,61%	-	-	-	1,60%	1,165%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-7,92%	5,67%	-3,74%	11,70%	28,65%	-	2,50%	9,420%	14,76%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	-10,86%	0,30%	-10,13%	6,55%	21,51%	56,15%	0,50%	12,417%	17,36%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	-12,51%	-5,44%	-11,66%	-1,40%	10,05%	36,95%	2,00%	12,991%	16,99%
ICON	-10,79%	-14,30%	-12,32%	-8,47%	3,17%	22,98%	-	-	-
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	-11,00%	-15,02%	-13,23%	-9,29%	2,23%	20,25%	1,60%	12,582%	16,47%
IDIV	-10,53%	-2,66%	-10,87%	2,16%	12,39%	67,47%	-	-	-
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	-10,90%	2,96%	-9,01%	8,91%	22,06%	62,82%	1,50%	11,921%	16,48%
IGCT	-10,14%	-1,59%	-10,18%	4,71%	19,90%	59,18%	-	-	-
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	-10,20%	-1,74%	-10,31%	4,59%	19,44%	58,10%	0,90%	11,225%	16,67%
IFIX	-5,27%	-0,55%	-4,21%	0,05%	7,65%	37,32%	-	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	0,30%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	56.836.752,06	78,52%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	7.440.945,37	10,28%
Itaú Unibanco	2.652.471,54	3,66%
BEM DTVM	2.337.604,39	3,23%
Itaú Unibanco S.A.	2.000.628,30	2,76%
BANCO BRADESCO	1.112.106,01	1,54%



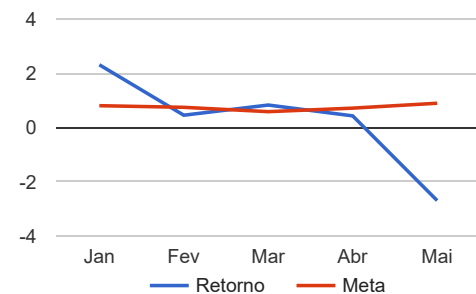
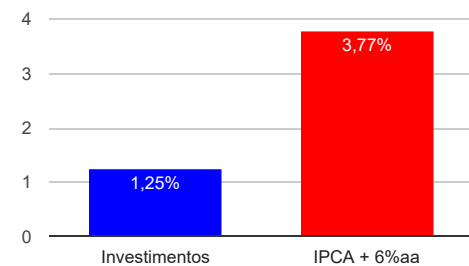
Sub-segmento	Valor	%
CDI	10.846.977,52	14,99%
AÇÕES - SETORIAIS	9.947.578,05	13,74%
IMA-B 5	9.868.278,24	13,63%
IRF-M 1	9.590.196,37	13,25%
IMA-B	8.387.261,33	11,59%
IRF-M	7.611.197,93	10,52%
GESTÃO DURATION	6.850.663,39	9,46%
IDKA IPCA 2A	2.270.223,34	3,14%
MULTIMERCADO	2.059.360,02	2,85%
IMA-B 5+	1.318.440,00	1,82%
AÇÕES - INDEXADO	1.275.335,81	1,76%
AÇÕES - LIVRES	1.065.399,36	1,47%
CRÉDITO PRIVADO	1.000.444,64	1,38%
FUNDO IMOBILIÁRIO	289.151,67	0,40%



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%
Acumulado no ano					995.875,83	1,25%	3,77%	33,22%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.117.957,03	0,00	0,00	2.134.897,27	16.940,24	0,80%	0,27%	0,80%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.309.300,00	0,00	0,00	1.318.440,00	9.140,00	0,70%	0,11%	0,70%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.311.359,99	0,00	0,00	1.320.393,98	9.033,99	0,69%	0,11%	0,69%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	2.053.564,02	0,00	0,00	2.063.872,72	10.308,70	0,50%	0,00%	0,50%
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.106.589,00	0,00	0,00	1.112.106,01	5.517,01	0,50%	0,00%	0,50%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	6.331.023,16	0,00	2.029.006,40	4.328.283,02	26.266,26	0,41%	0,01%	0,50%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.403.572,46	1.000.000,00	1.078.188,27	3.342.715,77	17.331,58	0,39%	0,02%	0,51%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	93.258,41	0,00	0,00	93.427,67	169,26	0,18%	0,28%	0,18%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.334.598,08	3.206.006,73	1.058.604,46	9.496.768,70	14.768,35	0,14%	0,29%	0,19%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,00	1.000.000,00	0,00	1.000.444,64	444,64	0,04%	1,25%	-1,29%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	2.007.517,17	0,00	0,00	2.000.628,30	-6.888,87	-0,34%	0,71%	-0,34%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.369.865,16	0,00	151.293,96	2.200.526,98	-18.044,22	-0,76%	1,01%	-0,79%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.122.657,06	0,00	0,00	1.113.551,46	-9.105,60	-0,81%	1,06%	-0,81%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	70.289,85	0,00	0,00	69.696,36	-593,49	-0,84%	1,01%	-0,84%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	4.907.422,16	0,00	0,00	4.850.035,09	-57.387,07	-1,17%	1,28%	-1,17%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.726.583,22	0,00	0,00	6.619.829,51	-106.753,71	-1,59%	1,31%	-1,59%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.759.684,38	0,00	0,00	7.611.197,93	-148.486,45	-1,91%	1,75%	-1,91%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	744.473,65	0,00	0,00	723.130,08	-21.343,57	-2,87%	2,10%	-2,87%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	927.741,84	0,00	0,00	899.261,63	-28.480,21	-3,07%	2,57%	-3,07%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	621.667,22	0,00	0,00	601.985,20	-19.682,02	-3,17%	2,61%	-3,17%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.861.474,92	0,00	0,00	3.738.824,84	-122.650,08	-3,18%	2,62%	-3,18%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.141.531,55	0,00	0,00	1.103.665,60	-37.865,95	-3,32%	2,53%	-3,32%
Total Renda Fixa					-467.361,21	-0,80%	0,97%	

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 CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	2.076.856,95	0,00	0,00	2.059.360,02	-17.496,93	-0,84%	1,16%	-0,84%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	294.443,27	0,00	1.800,00	289.151,67	-3.491,60	-1,19%	-	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.157.034,63	0,00	0,00	1.065.399,36	-91.635,27	-7,92%	9,42%	-7,92%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	1.767.271,37	0,00	0,00	1.587.072,18	-180.199,19	-10,20%	11,22%	-10,20%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	1.430.696,71	0,00	0,00	1.275.335,81	-155.360,90	-10,86%	12,42%	-10,86%
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.623.434,72	0,00	0,00	2.337.604,39	-285.830,33	-10,90%	11,92%	-10,90%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	2.752.865,22	0,00	0,00	2.450.096,80	-302.768,42	-11,00%	12,58%	-11,00%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	861.754,97	0,00	0,00	765.055,08	-96.699,89	-11,22%	11,78%	-11,22%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	3.209.093,52	0,00	0,00	2.807.749,60	-401.343,92	-12,51%	12,99%	-12,51%
Total Renda Variável					-1.534.826,45	-9,49%	10,47%	