

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
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	14.506.969,50	3,89%	95	3,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BGT PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	D+0 ou D+1	Não há	12.878.206,00	3,45%	12	8,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	31.409.795,16	8,41%	273	1,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.663.472,52	0,45%	310	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	32.341.753,51	8,66%	1.438	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	14.952.812,87	4,00%	173	2,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	D+1	16/05/2019	11.945.116,29	3,20%	11	15,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	38.024.444,21	10,18%	711	0,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	19.833.097,38	5,31%	20	7,41%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	58.306.982,13	15,62%	83	4,62%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.516.760,34	0,67%	60	0,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	40.790.385,11	10,92%	761	0,88%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	20.182.936,14	5,41%	470	0,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	9.811.758,24	2,63%	26	5,10%	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	7.755.615,89	2,08%	70	1,65%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	15.644.643,10	4,19%	109	2,18%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	2.108.523,98	0,56%	122	0,54%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	5.111.008,86	1,37%	5.627	0,85%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	12.716.233,46	3,41%	10.989	1,23%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	9.720.575,37	2,60%	41	3,14%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	949.591,83	0,25%	19	1,02%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	Não se aplica	Não se aplica	4.125.051,18	1,10%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "

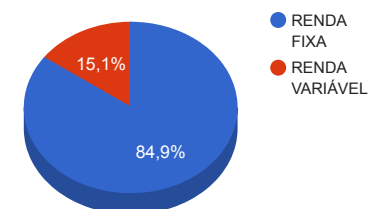
Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11	Não se aplica	Não se aplica	1.320.192,21	0,35%		0,74%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	4.775.967,55	1,28%		0,20%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
		TOTAL -	373.391.892,83				

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

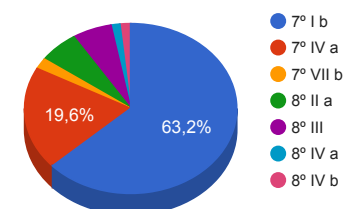
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	235.862.649,57	63,17%	15,00%	35,00%	70,00%	25.511.675,41
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	15,00%	60,00%	224.035.135,70
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	73.301.839,83	19,63%	5,00%	20,00%	40,00%	76.054.917,30
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	18.669.594,64
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	7.755.615,89	2,08%	0,00%	2,50%	5,00%	10.913.978,75
Total Renda Fixa	100,00%	316.920.105,29	84,88%	25,00	75,00	185,00	-

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%	2,00%	5,00%	10,00%	37.339.189,28
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	22.864.175,94	6,12%	2,00%	5,00%	10,00%	14.475.013,34
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	22.436.808,83	6,01%	2,00%	9,00%	10,00%	14.902.380,45
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	5.074.643,01	1,36%	1,00%	3,00%	5,00%	13.594.951,63
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	6.096.159,76	1,63%	1,00%	3,00%	5,00%	12.573.434,88
Total Renda Variável	30,00%	56.471.787,54	15,12%	8,00	25,00	40,00	-

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 "	235.862.649,57	63,17%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	73.301.839,83	19,63%	5,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	7.755.615,89	2,08%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	316.920.105,29	84,88%	25,00	185,00

Artigos - Renda Variável	Base: junho / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	22.864.175,94	6,12%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	22.436.808,83	6,01%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5.074.643,01	1,36%	1,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	6.096.159,76	1,63%	1,00%	5,00%
Total Renda Variável	56.471.787,54	15,12%	8,00	40,00

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	94.462.765,66	25,30%	0,01%
BRADERCO ASSET MANAGEMENT	90.435.034,56	24,22%	0,01%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	71.315.789,55	19,10%	0,02%
WESTERN ASSET	42.269.906,21	11,32%	0,09%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	26.428.043,63	7,08%	0,01%
ITAÚ UNIBANCO	18.161.403,44	4,86%	0,00%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	12.878.206,00	3,45%	0,02%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	5.111.008,86	1,37%	0,03%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	4.775.967,55	1,28%	0,31%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	4.125.051,18	1,10%	-
VINCI PARTNERS	2.108.523,98	0,56%	0,01%
BRASIL PLURAL	1.320.192,21	0,35%	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 + 6,00% ao ano	1,75%	5,59%	3,38%	5,59%	10,58%	20,70%	-	-	-
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	1,37%	2,37%	-0,08%	2,37%	3,77%	7,66%	0,15%	0,283%	3,95%
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 FIC RENDA FIXA	0,59%	3,87%	0,56%	3,87%	10,43%	26,03%	0,40%	0,117%	1,82%
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%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	-0,21%	0,94%	-2,01%	0,94%	4,10%	-	0,40%	1,124%	1,88%
IRF-M 1	0,55%	3,08%	1,25%	3,08%	7,81%	22,32%	-	-	-
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%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,50%	3,15%	1,53%	3,15%	7,41%	21,42%	0,20%	0,023%	0,09%
IMA-B 5	0,45%	2,81%	-0,70%	2,81%	9,73%	22,81%	-	-	-
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,44%	2,70%	-0,75%	2,70%	9,53%	22,35%	0,10%	3,128%	2,66%
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%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	-0,32%	2,22%	-2,36%	2,22%	9,49%	23,89%	0,40%	5,160%	4,12%

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

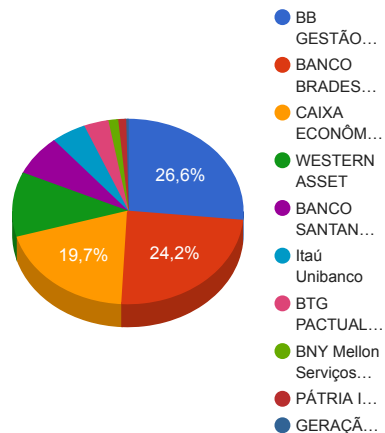
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA Geral ex-C	0,10%	2,30%	-1,06%	2,30%	8,26%	24,11%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,19%	2,55%	-0,93%	2,55%	8,41%	-	0,30%	2,067%	2,47%
IMA-B	-0,32%	1,16%	-3,61%	1,16%	8,20%	22,61%	-	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	0,80%	0,64%	-1,45%	0,64%	4,10%	7,60%	0,20%	1,045%	3,88%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	-0,36%	1,01%	-3,69%	1,01%	7,92%	22,11%	0,20%	3,920%	4,56%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,43%	0,86%	-3,91%	0,86%	7,93%	22,69%	0,20%	4,120%	4,71%

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

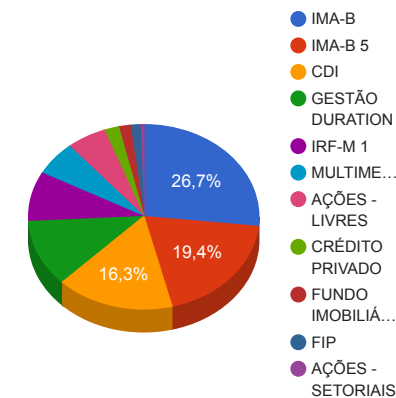
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
S&P 500	2,87%	18,40%	19,30%	18,40%	30,61%	55,43%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	0,16%	3,19%	4,13%	3,19%	17,93%	52,34%	1,00%	3,876%	12,06%
IPCA	1,26%	2,60%	1,89%	2,60%	4,39%	7,52%	-	-	-
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	-	-	-	-	-	-	1,00%	-	-
CDI	0,52%	3,17%	1,56%	3,17%	7,35%	21,15%	-	-	-
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	0,69%	5,41%	2,19%	5,41%	9,79%	25,45%	2,00%	0,728%	1,47%
Ibovespa	-5,20%	-4,76%	-14,76%	-4,76%	15,68%	41,22%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-3,07%	2,42%	-8,38%	2,42%	24,31%	-	2,50%	9,132%	15,49%
IDIV	-4,33%	-6,87%	-15,61%	-6,87%	8,85%	48,78%	-	-	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-5,34%	-10,19%	-15,87%	-10,19%	2,90%	13,47%	1,72%	11,096%	16,19%
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%	-	-
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	-13,13%	-8,32%	-16,93%	-8,32%	-3,82%	13,02%	0,40%	13,285%	19,40%
SMLL	-3,66%	-9,00%	-12,53%	-9,00%	13,97%	52,19%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-2,60%	3,61%	-9,25%	3,61%	32,89%	59,18%	2,00%	10,201%	16,87%
Não Possui	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	-	-

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	99.238.733,21	26,58%
BANCO BRADESCO	90.435.034,56	24,22%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	73.424.313,53	19,66%
WESTERN ASSET	42.269.906,21	11,32%
BANCO SANTANDER	26.428.043,63	7,08%
Itaú Unibanco	18.161.403,44	4,86%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	12.878.206,00	3,45%
BNY Mellon Serviços Financeiros	5.111.008,86	1,37%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	4.125.051,18	1,10%
GERAÇÃO FUTURO	1.320.192,21	0,35%



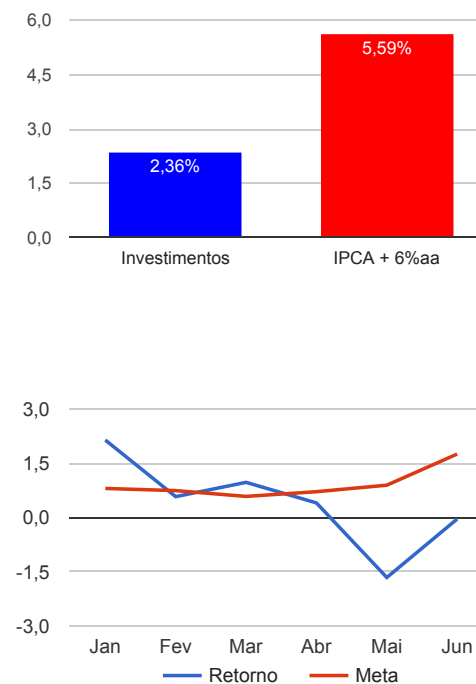
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	99.711.880,79	26,70%
IMA-B 5	72.399.220,11	19,39%
CDI	60.973.321,25	16,33%
GESTÃO DURATION	43.738.313,74	11,71%
IRF-M 1	32.341.753,51	8,66%
MULTIMERCADO	22.436.808,83	6,01%
AÇÕES - LIVRES	20.755.651,96	5,56%
CRÉDITO PRIVADO	7.755.615,89	2,08%
FUNDO IMOBILIÁRIO	6.096.159,76	1,63%
FIP	5.074.643,01	1,36%
AÇÕES - SETORIAIS	2.108.523,98	0,56%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	352.247.338,48	13.890.830,75	7.263.121,96	366.543.099,38	7.668.052,11	2,14%	0,80%	266,60%	1,31%
Fevereiro	366.543.099,38	29.643.789,41	26.899.037,56	371.404.803,94	2.116.952,71	0,57%	0,74%	77,63%	1,67%
Março	371.404.803,94	12.417.000,00	13.972.040,50	373.445.166,24	3.595.402,80	0,97%	0,58%	167,72%	1,50%
Abril	373.445.166,24	9.351.800,00	11.048.137,57	373.245.319,50	1.496.490,83	0,40%	0,71%	56,61%	1,27%
Mai	373.245.319,50	49.660.879,19	51.438.094,60	365.278.227,77	-6.189.876,32	-1,66%	0,89%	-186,61%	2,23%
Junho	365.278.227,77	9.323.200,00	14.142.540,02	360.299.566,55	-159.321,20	-0,04%	1,75%	-2,49%	2,82%
Acumulado no ano					8.527.700,93	2,36%	5,59%	42,25%	

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(%)
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	12.703.827,00	0,00	0,00	12.878.206,00	174.379,00	1,37%	0,28%	1,37%
BRABESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	11.850.638,77	0,00	0,00	11.945.116,29	94.477,52	0,80%	1,04%	0,80%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.502.108,84	0,00	0,00	2.516.760,34	14.651,50	0,59%	0,12%	0,59%
BRABESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	20.081.289,86	0,00	0,00	20.182.936,14	101.646,28	0,51%	0,01%	0,51%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	32.182.007,44	0,00	0,00	32.341.753,51	159.746,07	0,50%	0,68%	0,50%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.656.257,16	0,00	0,00	1.663.472,52	7.215,36	0,44%	3,13%	0,44%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	37.865.130,38	0,00	0,00	38.024.444,21	159.313,83	0,42%	3,13%	0,42%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	45.696.552,07	9.323.200,00	14.444.500,00	40.790.385,11	215.133,04	0,39%	0,02%	0,50%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.462.601,51	0,00	0,00	14.506.969,50	44.367,99	0,31%	4,65%	0,31%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	31.350.074,27	0,00	0,00	31.409.795,16	59.720,89	0,19%	2,07%	0,19%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	7.746.303,17	0,00	0,00	7.755.615,89	9.312,72	0,12%	3,03%	0,12%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	9.832.129,52	0,00	0,00	9.811.758,24	-20.371,28	-0,21%	1,12%	-0,21%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	19.895.993,23	0,00	0,00	19.833.097,38	-62.895,85	-0,32%	5,16%	-0,32%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	15.006.683,85	0,00	0,00	14.952.812,87	-53.870,98	-0,36%	3,92%	-0,36%
BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	58.556.315,48	0,00	0,00	58.306.982,13	-249.333,35	-0,43%	4,12%	-0,43%
Total Renda Fixa					653.492,74	0,20%	2,31%	

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(%)
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	9.653.925,27	0,00	0,00	9.720.575,37	66.650,10	0,69%	0,73%	0,69%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	12.695.635,64	0,00	0,00	12.716.233,46	20.597,82	0,16%	3,88%	0,16%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	4.128.714,11	0,00	0,00	4.125.051,18	-3.662,93	-0,09%	-	-
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	950.903,07	0,00	0,00	949.591,83	-1.311,24	-0,14%	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	4.819.194,51	0,00	25.000,00	4.775.967,55	-18.226,96	-0,38%	-	0,00%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	5.247.384,39	0,00	0,00	5.111.008,86	-136.375,53	-2,60%	10,20%	-2,60%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	16.140.952,02	0,00	0,00	15.644.643,10	-496.308,92	-3,07%	9,13%	-3,07%
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	1.390.264,55	0,00	10.040,02	1.320.192,21	-60.032,32	-4,32%	13,28%	-13,13%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	2.227.380,13	0,00	0,00	2.108.523,98	-118.856,15	-5,34%	11,10%	-5,34%
Total Renda Variável					-747.526,13	-1,31%	6,27%	

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 (%)
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	48.788.654,91	26.375.500,00	35.069.347,57	40.790.385,11	695.577,77	1,25%	1,53%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	31.964.428,36	0,00	0,00	32.341.753,51	377.325,15	1,18%	1,18%
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	12.888.503,00	0,00	358.925,48	12.878.206,00	348.628,48	2,74%	-0,08%
BRAPRESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	19.567.463,57	316.237,70	0,00	20.182.936,14	299.234,87	1,51%	1,52%
BRAPRESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	12.120.867,81	0,00	316.237,70	11.945.116,29	140.486,18	1,18%	-1,45%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	18.754.212,94	0,00	18.859.574,01	0,00	105.361,07	0,56%	1,17%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.502.660,11	0,00	0,00	2.516.760,34	14.100,23	0,56%	0,56%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.676.097,62	0,00	0,00	1.663.472,52	-12.625,10	-0,75%	-0,75%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	7.810.608,55	0,00	0,00	7.755.615,89	-54.992,66	-0,70%	-0,70%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.888.215,39	0,00	12.784.567,48	0,00	-103.647,91	-0,80%	-3,65%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,00	10.000.000,00	0,00	9.811.758,24	-188.241,76	-1,88%	-2,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	31.644.141,49	0,00	31.409.795,16	-234.346,33	-0,74%	-0,93%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	38.320.450,39	0,00	0,00	38.024.444,21	-296.006,18	-0,77%	-0,77%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.861.480,23	0,00	0,00	14.506.969,50	-354.510,73	-2,39%	-2,39%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	20.311.830,82	0,00	0,00	19.833.097,38	-478.733,44	-2,36%	-2,36%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	25.669.285,37	0,00	10.000.000,00	14.952.812,87	-716.472,50	-2,93%	-3,69%
BRAPRESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	60.677.948,96	0,00	0,00	58.306.982,13	-2.370.966,83	-3,91%	-3,91%
				Total Renda Fixa	-2.829.829,69	-0,87%	

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 (%)
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	12.211.635,84	0,00	0,00	12.716.233,46	504.597,62	4,13%	4,13%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	9.512.273,94	0,00	0,00	9.720.575,37	208.301,43	2,19%	2,19%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTIESTRATÉGIA FIP	953.520,27	0,00	0,00	949.591,83	-3.928,44	-0,41%	-
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	4.135.226,72	0,00	0,00	4.125.051,18	-10.175,54	-0,25%	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	4.930.295,14	0,00	87.000,00	4.775.967,55	-67.327,59	-1,38%	0,00%
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	1.487.427,18	0,00	30.119,95	1.320.192,21	-137.115,02	-9,31%	-16,93%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	2.506.186,82	0,00	0,00	2.108.523,98	-397.662,84	-15,87%	-15,87%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	5.631.814,87	0,00	0,00	5.111.008,86	-520.806,01	-9,25%	-9,25%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	17.075.783,45	0,00	0,00	15.644.643,10	-1.431.140,35	-8,38%	-8,38%
Total Renda Variável					-1.855.256,74	-3,18%	

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 (%)
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	45.598.690,61	68.403.745,80	74.686.891,18	40.790.385,11	1.474.839,88	2,48%	3,15%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	37.033.504,87	0,00	0,00	38.024.444,21	990.939,34	2,68%	2,68%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	31.367.022,51	46.830,75	0,00	32.341.753,51	927.900,25	2,95%	2,95%
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	12.580.443,00	0,00	358.925,48	12.878.206,00	656.688,48	5,26%	2,37%
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	19.259.982,85	316.237,70	0,00	20.182.936,14	606.715,59	3,13%	3,14%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	57.810.743,02	0,00	0,00	58.306.982,13	496.239,11	0,86%	0,86%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.290.362,90	0,00	12.784.567,48	0,00	494.204,58	4,02%	1,04%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	24.474.576,42	0,00	10.000.000,00	14.952.812,87	478.236,45	1,81%	1,01%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	19.402.999,16	0,00	0,00	19.833.097,38	430.098,22	2,22%	2,22%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	18.430.961,65	0,00	18.859.574,01	0,00	428.612,36	2,33%	2,94%
BRADERCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	11.869.634,32	0,00	316.237,70	11.945.116,29	391.719,67	3,32%	0,64%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.602.602,34	0,00	390.409,10	14.506.969,50	294.776,26	2,01%	2,03%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	7.525.184,40	0,00	0,00	7.755.615,89	230.431,49	3,06%	3,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.423.065,11	0,00	0,00	2.516.760,34	93.695,23	3,87%	3,87%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.619.814,60	0,00	0,00	1.663.472,52	43.657,92	2,70%	2,70%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,00	10.000.000,00	0,00	9.811.758,24	-188.241,76	-1,88%	0,94%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	31.644.141,49	0,00	31.409.795,16	-234.346,33	-0,74%	2,55%
				Total Renda Fixa	7.616.166,74	2,33%	

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 (%)
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	8.189.785,18	0,00	8.876.543,61	0,00	686.758,43	8,39%	-
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	9.221.370,89	0,00	0,00	9.720.575,37	499.204,48	5,41%	5,41%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	9.390.335,61	2.876.543,61	0,00	12.716.233,46	449.354,24	4,92%	3,19%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	4.841.873,22	0,00	208.000,00	4.775.967,55	142.094,33	2,93%	0,00%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	2.065.571,27	3.000.000,00	0,00	5.111.008,86	45.437,59	6,20%	3,61%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	957.293,67	0,00	0,00	949.591,83	-7.701,84	-0,80%	-
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	4.145.764,16	0,00	0,00	4.125.051,18	-20.712,98	-0,50%	-
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11	1.446.768,65	0,00	60.992,90	1.320.192,21	-65.583,54	-4,80%	-8,32%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	2.347.857,15	0,00	46.830,75	2.108.523,98	-192.502,42	-8,50%	-10,19%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	7.847.557,15	8.000.000,00	0,00	15.644.643,10	-202.914,05	3,26%	2,42%
Total Renda Variável					1.333.434,24	2,89%	