

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 IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.205.031,58	2,71%	726	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.271.499,25	1,56%	182	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	279.390,42	0,34%	46	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	8.353.586,09	10,28%	1.438	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	957.208,86	1,18%	221	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	8.472.220,84	10,42%	539	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	545.941,98	0,67%	199	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	6.643.623,29	8,17%	101	1,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.527.941,49	5,57%	638	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.489.067,66	5,52%	1.252	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.769.882,57	9,56%	661	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	957.707,46	1,18%	31	0,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	9.126.446,90	11,23%	91	1,37%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	7.648.081,67	9,41%	84	1,43%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.785,55	0,01%	83	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	371.923,96	0,46%	470	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.006.765,87	1,24%	34	0,54%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	263.012,56	0,32%	26	0,33%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.515.218,66	4,32%	761	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	2.159.286,55	2,66%	10.471	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	9.660,67	0,01%		1,10%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	2.054.242,74	2,53%	98	2,14%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "

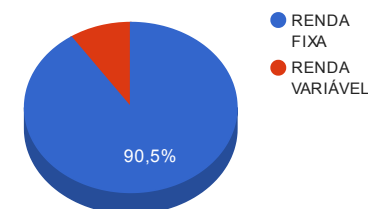
Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	D+90 ou D+150 a D+450	18 meses	948.282,21	1,17%	14	8,35%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	1.302.193,58	1,60%	122	0,34%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	D+4382	Não há	0,01	0,00%	5	-0,00%	Artigo 8º, Inciso III
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	Não se aplica	Não se aplica	3.055.976,30	3,76%	38	1,91%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se aplica	Não se aplica	3.346.702,59	4,12%		8,44%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
TOTAL -			81.285.681,31				

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

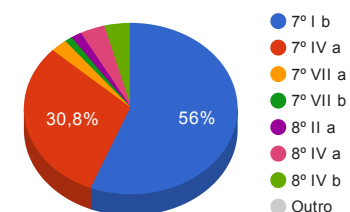
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	45.515.394,03	55,99%	15,00%	25,00%	70,00%	11.384.582,89
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	48.771.408,79
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	25.053.229,18	30,82%	5,00%	10,00%	30,00%	-667.524,79
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	7,00%	15,00%	15,00%	12.192.852,20
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	2.063.903,41	2,54%	2,00%	5,00%	5,00%	2.000.380,66
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	948.282,21	1,17%	2,00%	5,00%	5,00%	3.116.001,86
Total Renda Fixa	100,00%	73.580.808,83	90,52%	36,00	70,00	190,00	-

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%	8.128.568,13
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	1.302.193,58	1,60%	2,00%	5,00%	10,00%	6.826.374,55
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,01	0,00%	7,00%	10,00%	10,00%	8.128.568,12
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	3.055.976,30	3,76%	2,00%	5,00%	5,00%	1.008.307,77
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	3.346.702,59	4,12%	2,00%	5,00%	5,00%	717.581,48
Total Renda Variável	30,00%	7.704.872,48	9,48%	15,00	30,00	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 "	45.515.394,03	55,99%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	25.053.229,18	30,82%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	2.063.903,41	2,54%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	948.282,21	1,17%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	73.580.808,83	90,52%	36,00	190,00

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 "	1.302.193,58	1,60%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,01	0,00%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	3.055.976,30	3,76%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	3.346.702,59	4,12%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	7.704.872,48	9,48%	15,00	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
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	25.081.017,66	30,86%	0,00%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	25.039.404,81	30,80%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	19.227.480,72	23,65%	0,00%
AQ3 ASSET MANAGEMENT	3.346.702,59	4,12%	7,01%
ROMA ASSET	3.055.976,30	3,76%	0,65%
FINAXIS CORRETORA	2.054.242,74	2,53%	2,14%
VINCI PARTNERS	1.302.193,58	1,60%	0,01%
BRIDGE TRUST	1.220.720,02	1,50%	0,13%
SECURITY ADMINISTRADORA DE RECURSOS	948.282,21	1,17%	8,35%
BRASIL PLURAL	9.660,68	0,01%	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
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	1,62%	4,67%	2,94%	4,67%	8,64%	16,47%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-1,10%	-5,25%	-2,50%	-5,25%	-6,98%	-18,85%	0,15%	0,927%	3,52%
CDI + 3,50% ao ano	0,81%	4,93%	2,44%	4,93%	11,06%	29,71%	-	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-2,32%	-59,10%	-4,34%	-59,10%	51,00%	-5,86%	0,20%	14,091%	297,85%
IRF-M 1	0,55%	3,08%	1,25%	3,08%	7,81%	22,32%	-	-	-
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,50%	2,94%	1,17%	2,94%	7,57%	21,83%	0,20%	0,701%	0,52%
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%	-	-	-
BRADESCO 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 REFERENCIADO DI 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%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,25%	1,45%	0,71%	1,45%	3,44%	9,59%	1,00%	0,028%	0,09%
IMA-B 5	0,45%	2,81%	-0,70%	2,81%	9,73%	22,81%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,38%	2,59%	-0,96%	2,59%	9,52%	22,51%	0,20%	3,286%	2,81%
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-4,20%	-9,64%	-12,80%	-9,64%	-7,24%	1,27%	0,70%	6,464%	8,72%

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
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-7,71%	-12,44%	-14,71%	-12,44%	-8,39%	-5,23%	0,70%	10,559%	8,54%
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%
IMA-B 5+	-1,08%	-0,71%	-6,27%	-0,71%	6,11%	21,42%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	-0,97%	-0,77%	-6,22%	-0,77%	5,84%	20,86%	0,20%	4,931%	6,39%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,07%	-0,78%	-6,24%	-0,78%	5,90%	20,57%	0,20%	5,004%	6,38%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,10%	-0,75%	-6,23%	-0,75%	5,88%	20,92%	0,20%	4,983%	6,37%
IMA-B	-0,32%	1,16%	-3,61%	1,16%	8,20%	22,61%	-	-	-
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 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%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-0,36%	0,98%	-3,72%	0,98%	7,83%	21,74%	0,20%	3,951%	4,58%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,43%	0,86%	-3,91%	0,86%	7,93%	22,69%	0,20%	4,120%	4,71%
IRF-M 1+	-0,15%	2,07%	-2,32%	2,07%	9,28%	29,10%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,15%	2,00%	-2,56%	2,00%	8,88%	28,46%	0,20%	3,891%	3,78%
IDKA PRÉ 2 ANOS	-0,12%	3,37%	-0,42%	3,37%	10,88%	30,41%	-	-	-

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

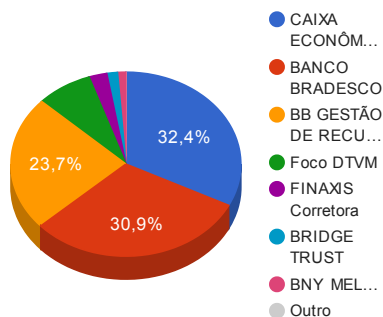
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	-0,26%	3,30%	-0,48%	3,30%	10,53%	29,41%	0,20%	3,309%	2,69%

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
IPCA + 8,00% ao ano	1,91%	6,56%	3,87%	6,56%	12,64%	25,26%	-	-	-
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	5,98%	53,78%	20,74%	53,78%	-100,79%	-100,49%	0,12%	0,328%	115,54%
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%	-	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	-23,58%	-4,71%	-23,58%	-4,71%	-19,82%	-46,00%	1,50%	38,794%	38,81%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	-	-	-	-	-	-	0,30%	0,026%	-

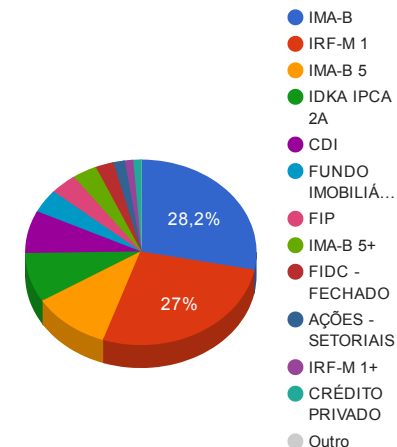
Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (junho / 2018)

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	26.341.598,39	32,41%
BANCO BRADESCO	25.081.017,66	30,86%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	19.227.480,72	23,65%
Foco DTVM	6.402.678,89	7,88%
FINAXIS Corretora	2.054.242,74	2,53%
BRIDGE TRUST	1.220.720,03	1,50%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	948.282,21	1,17%
Geração Futuro	9.660,67	0,01%



- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
- BANCO BRADESCO
- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- Foco DTVM
- FINAXIS Corretora
- BRIDGE TRUST
- BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS
- Outro

Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	22.890.512,25	28,16%
IRF-M 1	21.969.100,65	27,03%
IMA-B 5	8.868.801,69	10,91%
IDKA IPCA 2A	7.012.363,49	8,63%
CDI	6.046.429,17	7,44%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.346.702,59	4,12%
FIP	3.055.976,30	3,76%
IMA-B 5+	2.824.207,10	3,47%
FIDC - FECHADO	2.063.903,41	2,54%
AÇÕES - SETORIAIS	1.302.193,58	1,60%
IRF-M 1+	957.208,86	1,18%
CRÉDITO PRIVADO	948.282,21	1,17%
MULTIMERCADO	0,01	0,00%

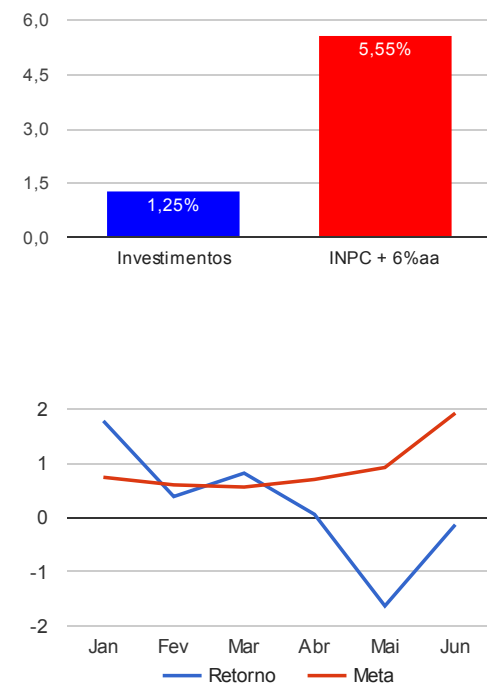


- IMA-B
- IRF-M 1
- IMA-B 5
- IDKA IPCA 2A
- CDI
- FUNDO IMOBILIÁRIO
- FIP
- IMA-B 5+
- FIDC - FECHADO
- AÇÕES - SETORIAIS
- IRF-M 1+
- CRÉDITO PRIVADO
- Outro

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	79.252.010,83	2.135.008,78	1.491.073,39	81.315.309,08	1.419.362,86	1,78%	0,74%	239,69%	1,06%
Fevereiro	81.315.309,08	577.688,15	782.665,89	81.423.749,70	313.418,36	0,39%	0,60%	64,47%	1,22%
Março	81.423.749,70	1.614.103,74	1.472.876,12	82.230.439,61	665.462,29	0,82%	0,56%	146,45%	2,59%
Abril	82.230.439,61	897.312,32	1.469.709,20	81.705.047,90	47.005,17	0,06%	0,70%	8,19%	0,93%
Mai	81.705.047,90	1.088.968,72	4.063.275,52	77.400.356,20	-1.330.384,90	-1,63%	0,92%	-177,21%	1,57%
Junho	77.400.356,20	247.792,32	2.061.462,70	75.483.726,33	-102.959,49	-0,13%	1,92%	-6,91%	3,97%
Acumulado no ano					1.011.904,29	1,25%	5,55%	22,47%	

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(%)
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	370.050,86	0,00	0,00	371.923,96	1.873,10	0,51%	0,01%	0,51%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	3.497.693,36	0,00	0,00	3.515.218,66	17.525,30	0,50%	0,02%	0,50%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.466.743,26	0,00	0,00	4.489.067,66	22.324,40	0,50%	0,69%	0,50%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.148.641,45	0,00	0,00	2.159.286,55	10.645,10	0,50%	0,02%	0,50%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.188.679,80	123.896,17	0,00	8.353.586,09	41.010,12	0,49%	0,68%	0,50%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	7.974.430,67	1.411.616,71	303.960,37	9.126.446,90	44.359,89	0,47%	0,70%	0,50%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	7.619.063,90	0,00	0,00	7.648.081,67	29.017,77	0,38%	3,29%	0,38%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.198.706,55	0,00	0,00	2.205.031,58	6.325,03	0,29%	2,62%	0,29%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	945.941,08	0,00	0,00	948.282,21	2.341,13	0,25%	0,03%	0,25%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.518.544,43	0,00	0,00	4.527.941,49	9.397,06	0,21%	2,64%	0,21%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	958.636,08	0,00	0,00	957.208,86	-1.427,22	-0,15%	3,89%	-0,15%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	280.130,95	0,00	0,00	279.390,42	-740,53	-0,26%	3,31%	-0,26%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.502.080,61	0,00	0,00	8.472.220,84	-29.859,77	-0,35%	3,92%	-0,35%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.806,01	0,00	0,00	4.785,55	-20,46	-0,43%	4,12%	-0,43%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	7.419.211,61	0,00	743.321,07	6.643.623,29	-32.267,25	-0,43%	3,95%	-0,36%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.839.789,74	0,00	1.030.731,35	7.769.882,57	-39.175,82	-0,44%	3,95%	-0,36%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	1.076.592,23	0,00	58.848,27	1.006.765,87	-10.978,09	-1,02%	4,93%	-0,97%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	551.860,14	0,00	0,00	545.941,98	-5.918,16	-1,07%	5,00%	-1,07%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.076.991,25	0,00	0,00	2.054.242,74	-22.748,51	-1,10%	0,93%	-1,10%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.362.375,97	0,00	75.398,36	1.271.499,25	-15.478,36	-1,14%	4,98%	-1,10%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	9.887,27	0,00	0,00	9.660,67	-226,60	-2,29%	14,09%	-2,32%
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	999.670,61	0,00	0,00	957.707,46	-41.963,15	-4,20%	6,46%	-4,20%

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(%)
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	284.994,68	0,00	0,00	263.012,56	-21.982,12	-7,71%	10,56%	-7,71%
Total Renda Fixa					-37.967,14	-0,05%	2,42%	

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(%)
ÁQUILLA FII - AQLL11	3.343.778,05	0,00	0,00	3.346.702,59	2.924,54	0,09%	38,79%	-23,58%
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	0,33%	5,98%
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	3.056.463,09	0,00	0,00	3.055.976,30	-486,79	-0,02%	0,03%	-0,02%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.375.597,40	0,00	0,00	1.302.193,58	-73.403,82	-5,34%	11,10%	-5,34%
Total Renda Variável					-70.966,07	-0,91%	18,74%	

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	9.604.272,47	123.896,17	1.478.771,80	8.353.586,09	104.189,25	1,17%	1,18%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	7.731.311,47	1.603.416,09	303.960,37	9.126.446,90	95.679,71	1,14%	1,17%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	3.462.107,95	0,00	0,00	3.515.218,66	53.110,71	1,53%	1,53%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.437.353,42	0,00	0,00	4.489.067,66	51.714,24	1,17%	1,17%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	661.968,68	1.479.519,93	0,00	2.159.286,55	17.797,94	1,18%	1,51%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.519.053,55	0,00	0,00	4.527.941,49	8.887,94	0,20%	0,20%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	941.625,20	0,00	0,00	948.282,21	6.657,01	0,71%	0,71%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	366.363,98	0,00	0,00	371.923,96	5.559,98	1,52%	1,52%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.202.217,48	0,00	0,00	2.205.031,58	2.814,10	0,13%	0,13%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.980,15	0,00	0,00	4.785,55	-194,60	-3,91%	-3,91%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	10.098,83	0,00	0,00	9.660,67	-438,16	-4,34%	-4,34%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	280.745,27	0,00	0,00	279.390,42	-1.354,85	-0,48%	-0,48%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	982.325,81	0,00	0,00	957.208,86	-25.116,95	-2,56%	-2,56%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	582.279,82	0,00	0,00	545.941,98	-36.337,84	-6,24%	-6,24%
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	308.362,71	0,00	0,00	263.012,56	-45.350,15	-14,71%	-14,71%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.106.915,11	0,00	0,00	2.054.242,74	-52.672,37	-2,50%	-2,50%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	1.201.938,73	0,00	122.275,16	1.006.765,87	-72.897,70	-6,25%	-6,22%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	7.722.267,50	0,00	0,00	7.648.081,67	-74.185,83	-0,96%	-0,96%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.501.719,80	0,00	138.825,25	1.271.499,25	-91.395,30	-6,24%	-6,23%
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.098.233,99	0,00	0,00	957.707,46	-140.526,53	-12,80%	-12,80%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.793.280,20	0,00	0,00	8.472.220,84	-321.059,36	-3,65%	-3,65%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	9.705.845,23	801.341,15	3.509.813,43	6.643.623,29	-353.749,66	-3,71%	-3,72%

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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.668.343,46	801.341,14	2.318.451,91	7.769.882,57	-381.350,12	-3,70%	-3,68%
				Total Renda Fixa	-1.250.218,54	-1,62%	

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 (%)
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	20,74%
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	3.058.987,91	0,00	0,00	3.055.976,30	-3.011,61	-0,10%	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	3.358.083,13	0,00	0,00	3.346.702,59	-11.380,54	-0,34%	-23,58%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.547.784,34	0,00	0,00	1.302.193,58	-245.590,76	-15,87%	-15,87%
				Total Renda Variável	-259.982,91	-3,26%	

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 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	11.227.410,69	549.751,19	3.713.633,07	8.353.586,09	290.057,28	2,91%	2,95%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	6.981.974,02	2.945.303,56	1.027.829,44	9.126.446,90	226.998,76	2,85%	2,94%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	7.455.279,89	0,00	0,00	7.648.081,67	192.801,78	2,59%	2,59%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.384.684,97	0,00	0,00	4.527.941,49	143.256,52	3,27%	3,27%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.360.870,33	0,00	0,00	4.489.067,66	128.197,33	2,94%	2,94%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	3.408.035,33	0,00	0,00	3.515.218,66	107.183,33	3,15%	3,15%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	9.191.436,63	1.593.794,08	4.238.139,74	6.643.623,29	96.532,32	0,94%	0,98%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.372.976,45	12.974,37	0,00	8.472.220,84	86.270,02	1,03%	1,04%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.137.383,75	0,00	0,00	2.205.031,58	67.647,83	3,16%	3,16%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.461.030,98	1.593.794,08	2.318.451,91	7.769.882,57	33.509,42	0,94%	1,03%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	651.999,54	1.479.519,93	0,00	2.159.286,55	27.767,08	2,73%	3,06%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	934.685,49	0,00	0,00	948.282,21	13.596,72	1,45%	1,45%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	944.954,44	0,00	957.208,86	12.254,42	1,30%	2,00%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	360.606,98	0,00	0,00	371.923,96	11.316,98	3,14%	3,14%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	270.469,40	0,00	0,00	279.390,42	8.921,02	3,30%	3,30%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.744,82	0,00	0,00	4.785,55	40,73	0,86%	0,86%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	1.251.973,18	0,00	244.711,87	1.006.765,87	-495,44	-0,79%	-0,77%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	23.618,76	0,00	12.669,17	9.660,67	-1.288,92	-12,03%	-59,10%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.534.663,86	16.223,50	277.485,66	1.271.499,25	-1.902,45	-0,74%	-0,75%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	550.241,39	0,00	0,00	545.941,98	-4.299,41	-0,78%	-0,78%
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	300.380,51	0,00	0,00	263.012,56	-37.367,95	-12,44%	-12,44%
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.059.924,65	0,00	0,00	957.707,46	-102.217,19	-9,64%	-9,64%

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 (%)
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.168.020,33	0,00	1.744,09	2.054.242,74	-112.033,50	-5,17%	-5,25%
				Total Renda Fixa	1.186.746,68	1,55%	

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 (%)
ÁQUILLA FII - AQLL11	3.340.874,72	0,00	0,00	3.346.702,59	5.827,87	0,17%	-4,71%
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	53,78%
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	3.062.815,22	0,00	0,00	3.055.976,30	-6.838,92	-0,22%	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.450.002,25	0,00	28.921,99	1.302.193,58	-118.886,68	-8,50%	-10,19%
Total Renda Variável					-119.897,73	-1,54%	