

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



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

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 IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	521.898,12	0,36%	192	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.303.959,67	1,59%	700	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2018	1.351.201,00	0,93%	163	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	2.019.650,89	1,39%	45	1,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.651.487,27	1,14%	364	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.865.477,18	3,36%	182	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	554.435,97	0,38%	1.252	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.956.466,40	6,18%	661	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	1.561.281,26	1,08%	273	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	8.388.471,80	5,79%	223	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.607.891,94	3,18%	179	0,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	14.737.047,32	10,17%	726	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	5.516.396,64	3,81%	107	0,57%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.081.358,98	4,89%	539	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	1.852.174,46	1,28%	199	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	18/08/2018	3.230.572,16	2,23%	99	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	6.301.559,42	4,35%	72	0,62%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	204.109,32	0,14%	109	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	33.523.226,61	23,14%	638	0,68%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	12.844.894,36	8,87%	1.438	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.991.980,66	2,07%	711	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	547.238,28	0,38%	15.520	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2018)

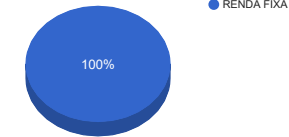
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	885.534,28	0,61%	761	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	18.363.658,78	12,68%	269	3,31%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		TOTAL -	144.861.972,77				

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

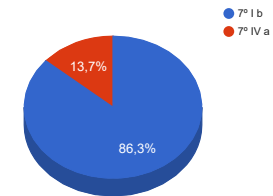
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	125.065.541,43	86,33%	15,00%	25,00%	100,00%	19.796.431,34
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	86.917.183,66
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	19.796.431,34	13,67%	5,00%	10,00%	40,00%	38.148.357,77
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	15,00%	15,00%	21.729.295,92
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	7.243.098,64
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	7.243.098,64
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	28.972.394,55
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	28.972.394,55
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	10,00%	14.486.197,28
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	7.243.098,64
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	7.243.098,64
Total Carteira		144.861.972,77					

RENDA FIXA	144.861.972,77	100,00%
------------	----------------	---------

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: junho / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	125.065.541,43	86,33%	15,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	19.796.431,34	13,67%	5,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	144.861.972,77	100,00%	20,00	290,00

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	108.258.463,07	74,73%	0,03%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	36.603.509,70	25,27%	0,00%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 6,00% ao ano	1,75%	5,59%	3,38%	5,59%	10,58%	20,70%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,38%	2,44%	2,76%	2,44%	3,88%	7,60%	0,20%	0,273%	3,91%
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%
CDI	0,52%	3,17%	1,56%	3,17%	7,35%	21,15%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,50%	3,15%	1,53%	3,15%	7,41%	21,42%	0,20%	0,023%	0,09%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,45%	2,75%	1,35%	2,75%	6,49%	19,20%	0,80%	0,000%	0,07%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,10%	0,66%	0,30%	0,66%	2,18%	9,73%	5,00%	0,000%	0,07%
IMA-B 5	0,45%	2,81%	-0,70%	2,81%	9,73%	22,81%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,43%	2,70%	-0,74%	2,70%	9,53%	22,39%	0,20%	3,112%	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%
IDKA IPCA 2 Anos	0,17%	2,98%	-0,03%	2,98%	9,98%	24,14%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,13%	4,27%	2,36%	4,27%	8,94%	-	0,20%	0,524%	0,77%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,12%	4,25%	2,34%	4,25%	8,90%	21,18%	0,20%	0,518%	0,77%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,29%	3,16%	0,13%	3,16%	9,69%	22,95%	0,20%	2,618%	2,11%
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%

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

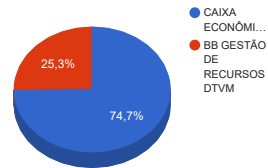
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA Geral	0,12%	2,44%	-0,99%	2,44%	8,47%	23,90%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,07%	2,17%	-1,16%	2,17%	7,96%	23,54%	0,20%	2,212%	2,35%
IMA Geral ex-C	0,10%	2,30%	-1,06%	2,30%	8,26%	24,11%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,19%	2,55%	-0,93%	2,55%	8,41%	-	0,30%	2,067%	2,47%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08%	2,19%	-1,13%	2,19%	8,01%	23,55%	0,20%	2,182%	2,33%
IDKA IPCA 5 Anos	0,07%	1,75%	-3,42%	1,75%	9,57%	24,17%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,31%	2,03%	-2,29%	2,03%	9,78%	24,08%	0,20%	4,564%	4,03%
IRF-M	0,04%	2,37%	-1,35%	2,37%	8,94%	27,21%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,01%	2,26%	-1,42%	2,26%	8,71%	26,69%	0,20%	2,830%	2,76%
IMA-B 5+	-1,08%	-0,71%	-6,27%	-0,71%	6,11%	21,42%	-	-	-
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%	-	-	-
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%

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

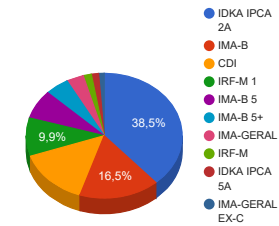
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,35%	1,04%	-3,65%	1,04%	7,91%	22,07%	0,20%	3,917%	4,54%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,36%	1,03%	-3,68%	1,03%	7,92%	22,14%	0,20%	3,952%	4,56%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	108.258.463,07	74,73%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	36.603.509,70	25,27%

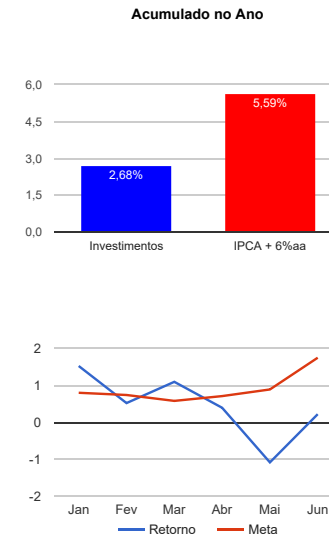


Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	52.012.744,21	35,91%
IMA-B	22.339.384,80	15,42%
CDI	19.796.431,34	13,67%
IRF-M 1	13.399.330,33	9,25%
IMA-B 5	10.159.864,57	7,01%
IMA-B 5+	6.717.651,64	4,64%
IMA-GERAL	4.812.001,26	3,32%
IRF-M	2.303.959,67	1,59%
IDKA IPCA 5A	2.019.650,89	1,39%
IMA-GERAL EX-C	1.561.281,26	1,08%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	134.674.306,49	1.650.000,00	1.591.908,75	136.788.194,08	2.055.796,34	1,53%	0,80%	190,38%	0,74%
Fevereiro	136.788.194,08	3.825.353,65	1.884.524,83	139.451.659,61	722.636,71	0,52%	0,74%	70,54%	1,37%
Março	139.451.659,61	2.198.840,34	1.472.849,40	141.714.894,67	1.537.244,12	1,10%	0,58%	190,00%	0,82%
Abril	141.714.894,67	2.321.615,85	766.052,42	143.834.972,44	564.514,34	0,39%	0,71%	55,67%	0,52%
Maio	143.834.972,44	0,00	0,00	142.272.640,00	-1.562.332,44	-1,09%	0,89%	-122,22%	1,18%
Junho	142.272.640,00	4.022.815,85	1.751.187,22	144.861.972,77	317.704,14	0,22%	1,75%	12,54%	2,29%
Acumulado no ano					3.635.563,21	2,68%	5,59%	47,97%	



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 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.332.853,00	0,00	0,00	1.351.201,00	18.348,00	1,38%	0,27%	1,38%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.294.856,58	0,00	0,00	8.388.471,80	93.615,22	1,13%	0,52%	1,13%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.194.587,72	0,00	0,00	3.230.572,16	35.984,44	1,13%	0,52%	1,13%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	516.122,80	0,00	0,00	521.898,12	5.775,32	1,12%	0,52%	1,12%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.925.884,58	0,00	1.050.000,00	885.534,28	9.649,70	0,50%	0,02%	0,50%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.098.943,55	0,00	550.000,00	554.435,97	5.492,42	0,50%	0,69%	0,50%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.781.449,40	0,00	0,00	12.844.894,36	63.444,96	0,50%	0,68%	0,50%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.644.442,10	0,00	0,00	1.651.487,27	7.045,17	0,43%	3,11%	0,43%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.979.444,94	0,00	0,00	2.991.980,66	12.535,72	0,42%	3,13%	0,42%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	15.099.172,88	3.237.018,10	40.191,18	18.363.658,78	67.658,98	0,37%	0,00%	0,45%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.013.343,13	0,00	0,00	2.019.650,89	6.307,76	0,31%	4,56%	0,31%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.694.774,81	0,00	0,00	14.737.047,32	42.272,51	0,29%	2,62%	0,29%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	32.836.114,17	618.824,32	0,00	33.523.226,61	68.288,12	0,20%	2,64%	0,21%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.558.312,72	0,00	0,00	1.561.281,26	2.968,54	0,19%	2,07%	0,19%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.510.857,65	0,00	0,00	5.516.396,64	5.538,99	0,10%	2,71%	0,10%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	490.678,24	166.973,43	110.996,04	547.238,28	582,65	0,09%	0,00%	0,10%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	203.940,24	0,00	0,00	204.109,32	169,08	0,08%	2,18%	0,08%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.604.445,39	0,00	0,00	4.607.891,94	3.446,55	0,07%	2,21%	0,07%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.303.623,18	0,00	0,00	2.303.959,67	336,49	0,01%	2,83%	0,01%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.302.040,30	0,00	0,00	6.301.559,42	-480,88	-0,01%	5,12%	-0,01%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.106.316,74	0,00	0,00	7.081.358,98	-24.957,76	-0,35%	3,92%	-0,35%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.988.816,96	0,00	0,00	8.956.466,40	-32.350,56	-0,36%	3,95%	-0,36%

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(%)
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.872.252,55	0,00	0,00	1.852.174,46	-20.078,09	-1,07%	5,00%	-1,07%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.919.366,37	0,00	0,00	4.865.477,18	-53.889,19	-1,10%	4,98%	-1,10%
Total Renda Fixa					317.704,14	0,22%	2,29%	

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 DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	15.228.171,99	3.237.018,10	304.501,33	18.363.658,78	202.970,02	1,27%	1,35%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.195.023,52	0,00	0,00	8.388.471,80	193.448,28	2,36%	2,36%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.695.035,40	0,00	0,00	12.844.894,36	149.858,96	1,18%	1,18%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.156.204,02	0,00	0,00	3.230.572,16	74.368,14	2,36%	2,36%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	31.517.125,15	2.450.301,18	501.742,27	33.523.226,61	57.542,55	0,16%	0,20%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.314.902,00	0,00	0,00	1.351.201,00	36.299,00	2,76%	2,76%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.906.290,70	0,00	1.050.000,00	885.534,28	29.243,58	1,53%	1,53%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.718.239,64	0,00	0,00	14.737.047,32	18.807,68	0,13%	0,13%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.091.712,82	0,00	550.000,00	554.435,97	12.723,15	1,17%	1,17%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	509.943,87	0,00	0,00	521.898,12	11.954,25	2,34%	2,34%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.504.810,63	0,00	0,00	5.516.396,64	11.586,01	0,21%	0,21%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00	657.112,42	110.996,04	547.238,28	1.121,90	0,20%	0,30%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	206.436,27	0,00	0,00	204.109,32	-2.326,95	-1,13%	-1,13%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.663.878,44	0,00	0,00	1.651.487,27	-12.391,17	-0,74%	-0,74%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.575.951,51	0,00	0,00	1.561.281,26	-14.670,25	-0,93%	-0,93%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.015.272,12	0,00	0,00	2.991.980,66	-23.291,46	-0,77%	-0,77%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.337.212,11	0,00	0,00	2.303.959,67	-33.252,44	-1,42%	-1,42%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.067.037,99	0,00	0,00	2.019.650,89	-47.387,10	-2,29%	-2,29%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.662.038,41	0,00	0,00	4.607.891,94	-54.146,47	-1,16%	-1,16%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.975.455,01	0,00	0,00	1.852.174,46	-123.280,55	-6,24%	-6,24%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.537.145,35	0,00	0,00	6.301.559,42	-235.585,93	-3,60%	-3,60%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.349.710,88	0,00	0,00	7.081.358,98	-268.351,90	-3,65%	-3,65%

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 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.188.691,86	0,00	0,00	4.865.477,18	-323.214,68	-6,23%	-6,23%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.298.604,98	0,00	0,00	8.956.466,40	-342.138,58	-3,68%	-3,68%
Total Renda Fixa					-680.113,96	-0,48%	

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 IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	30.580.001,62	2.450.301,18	501.742,27	33.523.226,61	994.666,08	3,23%	3,27%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.288.307,57	1.000.000,00	0,00	14.737.047,32	448.739,75	3,14%	3,16%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	13.321.649,23	9.185.858,44	4.528.430,66	18.363.658,78	384.581,77	2,47%	2,75%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.476.336,95	0,00	0,00	12.844.894,36	368.557,41	2,95%	2,95%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.264.708,26	0,00	222.820,28	8.388.471,80	346.583,82	4,27%	1,50%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.467.179,71	0,00	142.157,34	5.516.396,64	191.374,27	3,55%	0,90%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.188.178,10	0,00	90.895,17	3.230.572,16	133.289,23	4,26%	4,27%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.337.433,88	0,00	164.145,17	6.301.559,42	128.270,71	1,99%	-0,57%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.509.936,75	0,00	0,00	4.607.891,94	97.955,19	2,17%	2,17%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.865.407,38	0,00	0,00	8.956.466,40	91.059,02	1,03%	1,03%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.008.775,94	0,00	0,00	7.081.358,98	72.583,04	1,04%	1,04%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.356.335,14	565.337,21	0,00	2.991.980,66	70.308,31	2,66%	2,68%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.319.062,00	0,00	36.214,42	1.351.201,00	68.353,42	5,28%	2,44%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.717.875,01	160.016,44	1.050.000,00	885.534,28	57.642,83	3,12%	3,15%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.253.023,39	0,00	0,00	2.303.959,67	50.936,28	2,26%	2,26%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.608.063,28	0,00	0,00	1.651.487,27	43.423,99	2,70%	2,70%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.033.216,52	0,00	54.581,29	2.019.650,89	41.015,66	2,01%	2,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.522.393,21	0,00	0,00	1.561.281,26	38.888,05	2,55%	2,55%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.072.895,85	0,00	550.000,00	554.435,97	31.540,12	2,94%	2,94%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	514.997,88	0,00	14.539,98	521.898,12	21.440,42	4,25%	4,25%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	199.730,07	0,00	0,00	204.109,32	4.379,25	2,19%	2,19%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00	657.112,42	110.996,04	547.238,28	1.121,90	0,20%	0,66%

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 IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.866.760,75	0,00	0,00	1.852.174,46	-14.586,29	-0,78%	-0,78%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.902.038,20	0,00	0,00	4.865.477,18	-36.561,02	-0,75%	-0,75%
Total Renda Fixa					3.635.563,21	2,68%	