

# 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
TÍTULOS PÚBLICOS			115.166.328,88	11,07%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	15/05/2019	6.419.274,51	0,62%	11	7,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	850.470,00	0,08%	192	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	59.945.475,61	5,76%	2.506	15,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	12.726.650,16	1,22%	27	4,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	3.605.908,06	0,35%	107	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	60.110.111,31	5,78%	310	5,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	35.436.849,13	3,41%	221	1,92%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	25.934.329,46	2,49%	20	9,68%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	11.777.760,28	1,13%	364	0,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	7.346.438,05	0,71%	21	2,75%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	59.741.787,46	5,74%	700	1,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	16.923.768,98	1,63%	166	1,49%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	4.299.709,51	0,41%	223	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	108.467.703,94	10,43%	661	3,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	38.755.055,06	3,73%	62	2,95%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	6.386.725,50	0,61%	6	13,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	12.488.950,05	1,20%	72	1,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	37.407.528,88	3,60%	638	0,76%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	53.904.352,40	5,18%	133	3,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRASESCO H NILO FI RENDA FIXA	D+4	Não há	62.991.395,95	6,05%	14	10,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	126.120.732,19	12,12%	83	9,99%	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 FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.454,11	0,00%	669	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	15.595.119,98	1,50%	435	0,61%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
GÁVEA SUL FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1 LP	Não se aplica	Não se aplica	762.137,77	0,07%	18	5,20%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	Não se aplica	Não se aplica	84.122,73	0,01%			Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	15.416.583,98	1,48%	55	2,29%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.879.328,38	0,28%	5.407	1,03%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	9.410.195,17	0,90%	2.573	3,98%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
KONDOR EQUITIES INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+33	Não há	27.351.597,93	2,63%	1.244	7,69%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
XP DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES	D+33	Não há	4.937.729,76	0,47%	1.376	7,76%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	11.923.943,49	1,15%	5.627	1,99%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	11.799.006,62	1,13%	75	10,02%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
XP LONG SHORT 60 FIC MULTIMERCADO	D+2 a D+61	Não há	3.032.960,30	0,29%	3.793	0,91%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	24.388.735,34	2,34%	10.989	2,35%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	7.504.391,76	0,72%	41	2,42%	Artigo 8º, Inciso III
SULAMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+361	2 anos	4.397.692,45	0,42%	9	12,61%	Artigo 8º, Inciso III
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+180	Não há	1.216.591,17	0,12%	11	1,30%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	10.463.257,28	1,01%	1.956	0,48%	Artigo 8º, Inciso III
LSH FIP	Não se aplica	Não se aplica	1.236.815,15	0,12%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	5.443.970,22	0,52%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	484.432,14	0,05%		0,18%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	901.119,82	0,09%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	7.729.759,81	0,74%		11,80%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "

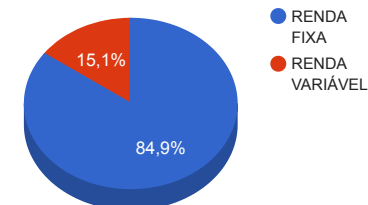
Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
MÉRITO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - MFII11	Não se aplica	Não se aplica	5.576.816,00	0,54%		7,37%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	Não se aplica	Não se aplica	999.980,00	0,10%		1,14%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
		<b>TOTAL -</b>	<b>1.040.347.046,73</b>				

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

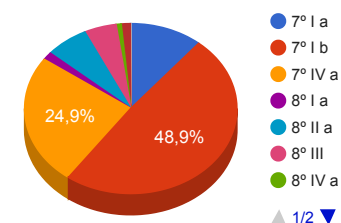
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	115.166.328,88	11,07%	0,00%	0,00%	0,00%	-115.166.328,88
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	508.624.495,95	48,89%	15,00%	25,00%	70,00%	219.618.436,76
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	624.208.228,04
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	258.615.054,63	24,86%	5,00%	10,00%	30,00%	53.489.059,39
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	7,00%	15,00%	15,00%	156.052.057,01
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	846.260,50	0,08%	2,00%	5,00%	5,00%	51.171.091,84
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	52.017.352,34
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>883.252.139,96</b>	<b>84,90%</b>	<b>36,00</b>	<b>70,00</b>	<b>190,00</b>	<b>-</b>

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%	15.416.583,98	1,48%	2,00%	5,00%	10,00%	88.618.120,69
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	68.301.801,35	6,57%	2,00%	5,00%	10,00%	35.732.903,32
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	51.003.628,30	4,90%	7,00%	10,00%	10,00%	53.031.076,37
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	8.066.337,33	0,78%	2,00%	5,00%	5,00%	43.951.015,01
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	14.306.555,81	1,38%	2,00%	5,00%	5,00%	37.710.796,53
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>157.094.906,77</b>	<b>15,10%</b>	<b>15,00</b>	<b>30,00</b>	<b>40,00</b>	<b>-</b>

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 " a "	115.166.328,88	11,07%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	508.624.495,95	48,89%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	258.615.054,63	24,86%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	846.260,50	0,08%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>883.252.139,96</b>	<b>84,90%</b>	<b>36,00</b>	<b>190,00</b>

Artigos - Renda Variável	Base: junho / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	15.416.583,98	1,48%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	68.301.801,35	6,57%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	51.003.628,30	4,90%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	8.066.337,33	0,78%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	14.306.555,81	1,38%	2,00%	5,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>157.094.906,77</b>	<b>15,10%</b>	<b>15,00</b>	<b>40,00</b>

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	239.438.614,88	23,02%	0,06%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	189.112.128,14	18,18%	0,02%
ITAÚ UNIBANCO	99.078.681,97	9,52%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	89.297.240,83	8,58%	0,01%
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS	64.343.168,06	6,18%	0,23%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	60.110.111,31	5,78%	0,01%
WESTERN ASSET	57.827.456,56	5,56%	0,12%
KONDOR INVEST	27.351.597,93	2,63%	1,89%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	23.722.950,11	2,28%	0,12%
SAFRA ASSET MANAGEMENT	17.809.695,33	1,71%	0,01%
ITAÚ DTVM	15.416.583,98	1,48%	0,00%
XP GESTÃO DE RECURSOS	10.850.018,44	1,04%	0,00%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	7.729.759,81	0,74%	1,97%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	7.287.845,32	0,70%	0,01%
MÉRITO INVESTIMENTOS	5.576.816,00	0,54%	-

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
A5 CAPITAL PARTNERS	5.443.970,22	0,52%	-%
ROMA ASSET	1.236.815,15	0,12%	0,26%%
CAPITÂNIA	1.216.591,17	0,12%	0,02%%
REAG GESTORA DE RECURSOS	999.980,00	0,10%	0,16%%
BELVEDERE INVESTIMENTOS	762.137,77	0,07%	0,06%%
BRASIL PLURAL	484.432,14	0,05%	0,00%%
Gradual Investimentos	84.122,73	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	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%
135% do CDI	0,70%	4,31%	2,11%	4,31%	10,05%	29,56%	-	-	-
GÁVEA SUL FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1 LP	-13,69%	-47,84%	-31,93%	-47,84%	-63,31%	-67,60%	0,25%	23,506%	-
130% do CDI	0,67%	4,14%	2,03%	4,14%	9,66%	28,33%	-	-	-
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	2,50%	-	-
CDI	0,52%	3,17%	1,56%	3,17%	7,35%	21,15%	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,49%	3,02%	1,46%	3,02%	7,22%	20,87%	0,20%	0,068%	0,10%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,43%	2,62%	1,28%	2,62%	6,22%	18,92%	1,00%	0,003%	0,07%
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%
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%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	0,41%	2,60%	-0,80%	2,60%	9,28%	21,84%	0,40%	3,122%	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%
IDKA IPCA 2 Anos	0,17%	2,98%	-0,03%	2,98%	9,98%	24,14%	-	-	-
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%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,80%	0,48%	-1,61%	0,48%	3,77%	10,35%	0,20%	1,047%	4,10%



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
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%	-	-	-
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	-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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,58%	3,59%	0,64%	3,59%	9,79%	22,95%	0,20%	1,937%	1,78%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	0,29%	2,25%	-2,89%	2,25%	9,24%	26,00%	0,40%	3,898%	4,70%
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%
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 FIC RENDA FIXA	-0,43%	0,86%	-3,91%	0,86%	7,93%	22,69%	0,20%	4,120%	4,71%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	-0,64%	0,58%	-4,14%	0,58%	7,80%	21,01%	0,45%	4,314%	4,95%
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	-0,88%	1,09%	-4,54%	1,09%	9,11%	26,32%	0,30%	4,539%	5,33%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,97%	-2,35%	-5,17%	-2,35%	1,41%	8,20%	0,20%	5,001%	6,29%
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%

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
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,21%	-0,34%	-1,85%	-0,34%	4,27%	11,44%	0,15%	4,101%	5,16%

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

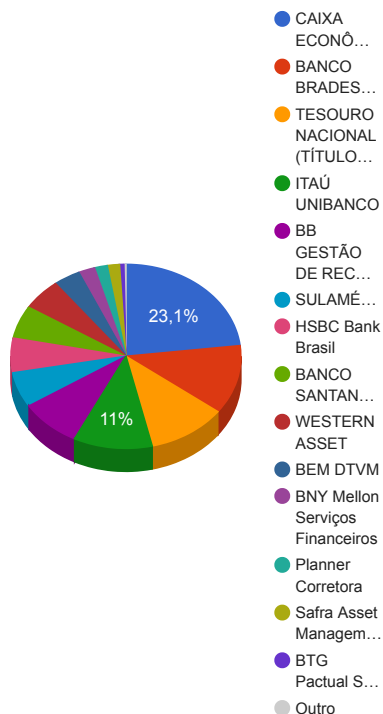
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
S&P 500	2,87%	18,40%	19,30%	18,40%	30,61%	55,43%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	0,16%	3,19%	4,13%	3,19%	17,93%	52,34%	1,00%	3,876%	12,06%
IPCA + 8,00% ao ano	1,91%	6,56%	3,87%	6,56%	12,64%	25,26%	-	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-	-	-	-	-	-	2,00%	-	-
IPCA	1,26%	2,60%	1,89%	2,60%	4,39%	7,52%	-	-	-
SULAMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,69%	3,65%	1,20%	3,65%	9,41%	23,43%	1,50%	0,720%	0,89%
CDI	0,52%	3,17%	1,56%	3,17%	7,35%	21,15%	-	-	-
XP LONG SHORT 60 FIC MULTIMERCADO	1,18%	10,53%	3,21%	10,53%	10,52%	-	2,00%	2,736%	4,17%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	0,69%	5,41%	2,19%	5,41%	9,79%	25,45%	2,00%	0,728%	1,47%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	0,30%	1,79%	-0,20%	1,79%	7,12%	20,66%	0,50%	1,279%	1,37%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,18%	-3,01%	-3,45%	-3,01%	-2,94%	8,96%	0,55%	0,089%	9,71%
Ibovespa	-5,20%	-4,76%	-14,76%	-4,76%	15,68%	41,22%	-	-	-
KONDOR EQUITIES INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-3,87%	9,55%	-7,88%	9,55%	33,65%	72,47%	1,50%	10,422%	16,18%
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	-4,37%	-0,53%	-12,40%	-0,53%	15,61%	38,53%	2,00%	12,196%	18,16%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-4,59%	-3,69%	-13,06%	-3,69%	14,43%	35,28%	1,50%	11,510%	16,70%
IDIV	-4,33%	-6,87%	-15,61%	-6,87%	8,85%	48,78%	-	-	-
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	-3,16%	-6,39%	-11,83%	-6,39%	3,61%	23,68%	3,00%	11,099%	15,47%

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

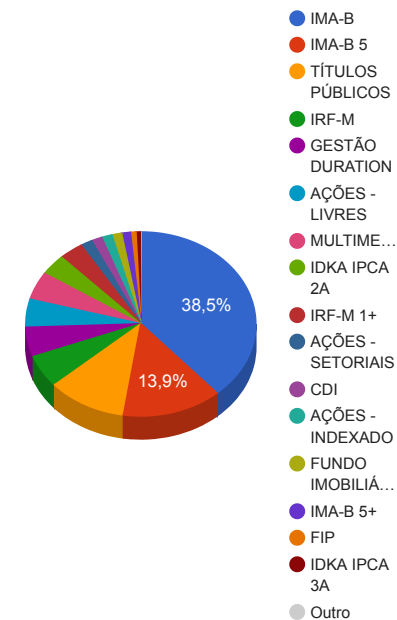
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	-4,01%	-4,55%	-9,85%	-4,55%	2,46%	29,73%	-	-	-
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	3,09%	-19,23%	-15,26%	-19,23%	25,00%	-0,00%	0,95%	33,062%	90,08%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	-100,00%	-	-100,00%	-	-	-100,00%	0,14%	-	-
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%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-4,39%	-10,20%	-13,41%	-10,20%	13,41%	48,18%	1,50%	11,843%	17,29%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
XP DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES	-3,09%	-6,36%	-11,65%	-6,36%	1,07%	-	3,00%	10,866%	15,14%
MÉRITO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - MFII11	-3,41%	-17,02%	-12,78%	-17,02%	-2,81%	11,48%	0,15%	6,264%	20,77%
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,65%	0,308%	334,25%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	-	-
LSH FIP	-	-	-	-	-	-	0,08%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	240.824.166,84	23,15%
BANCO BRADESCO	126.120.732,19	12,12%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	115.166.328,88	11,07%
ITAÚ UNIBANCO	114.495.265,95	11,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	89.297.240,83	8,58%
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS	64.343.168,06	6,18%
HSBC Bank Brasil	62.991.395,95	6,05%
BANCO SANTANDER	60.110.111,31	5,78%
WESTERN ASSET	57.827.456,56	5,56%
BEM DTVM	39.150.604,55	3,76%
BNY Mellon Serviços Financeiros	23.990.553,10	2,31%
Planner Corretora	18.750.546,03	1,80%
Safra Asset Management	17.809.695,33	1,71%
BTG Pactual Serviços Financeiros	6.386.725,50	0,61%
Orla DTVM	1.236.815,15	0,12%
CM Capital Markets DTVM	999.980,00	0,10%
Socopa	762.137,77	0,07%
Gradual Investimentos	84.122,73	0,01%



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	400.671.190,27	38,51%
IMA-B 5	144.482.873,68	13,89%
TÍTULOS PÚBLICOS	115.166.328,88	11,07%
IRF-M	59.741.787,46	5,74%
GESTÃO DURATION	53.904.352,40	5,18%
AÇÕES - LIVRES	51.074.548,04	4,91%
MULTIMERCADO	51.003.628,30	4,90%
IDKA IPCA 2A	38.257.998,88	3,68%
IRF-M 1+	35.436.849,13	3,41%
AÇÕES - SETORIAIS	17.227.253,31	1,66%
CDI	15.598.574,09	1,50%
AÇÕES - INDEXADO	15.416.583,98	1,48%
FUNDO IMOBILIÁRIO	14.306.555,81	1,38%
IMA-B 5+	12.726.650,16	1,22%
FIP	8.066.337,33	0,78%
IDKA IPCA 3A	6.419.274,51	0,62%
FIDC - FECHADO	846.260,50	0,08%



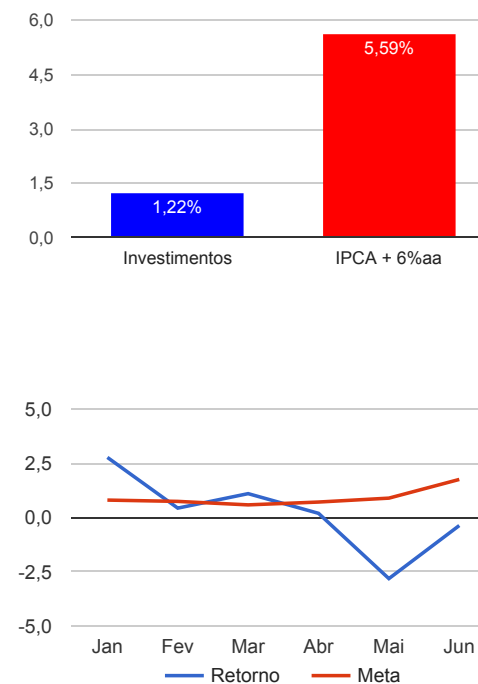
Carteira de Títulos Públicos - base (junho / 2018)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	GAP (Atual - Pago)
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2019	25/08/2015	7659	2.636,195170	3.212,761091	20.190.618,81	24.606.537,20	4.415.918,39
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	17/08/2016	4750	2.964,257204	3.233,846428	14.080.221,72	15.360.770,53	1.280.548,81
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	03/09/2015	6730	2.515,509771	3.191,691271	16.929.380,76	21.480.082,25	4.550.701,50
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	14/03/2014	6185	2.315,991673	3.248,687476	14.324.408,50	20.093.132,04	5.768.723,54
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	27/04/2016	2200	2.838,144079	3.232,707435	6.243.916,97	7.111.956,36	868.039,38
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	21/12/2015	8310	2.412,107871	3.190,595728	20.044.616,41	26.513.850,50	6.469.234,09

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	999.461.943,98	70.417.723,46	49.580.859,52	1.048.497.917,93	28.199.110,01	2,76%	0,80%	344,84%	2,13%
Fevereiro	1.048.497.917,93	37.653.204,40	36.236.509,81	1.054.434.538,77	4.519.926,25	0,43%	0,74%	58,30%	2,70%
Março	1.054.434.538,77	43.881.957,34	43.077.919,20	1.066.809.227,40	11.570.650,49	1,10%	0,58%	189,97%	1,97%
Abril	1.066.809.227,40	90.983.961,04	91.023.989,85	1.068.805.814,99	2.036.616,40	0,19%	0,71%	26,97%	1,88%
Mai	1.068.805.814,99	53.349.514,83	66.395.440,65	1.025.700.913,36	-30.058.975,81	-2,81%	0,89%	-316,46%	3,07%
Junho	1.025.700.913,36	41.411.155,20	27.343.262,06	1.035.915.947,35	-3.852.859,15	-0,37%	1,75%	-21,14%	4,10%
Acumulado no ano					12.414.468,19	1,22%	5,59%	21,84%	

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 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.251.724,82	0,00	0,00	4.299.709,51	47.984,69	1,13%	0,52%	1,13%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	841.058,70	0,00	0,00	850.470,00	9.411,30	1,12%	0,52%	1,12%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.368.220,31	0,00	0,00	6.419.274,51	51.054,20	0,80%	1,05%	0,80%
GÁVEA SUL FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1 LP	882.986,49	0,00	126.350,38	762.137,77	5.501,66	0,62%	23,51%	-13,69%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	53.590.220,60	0,00	0,00	53.904.352,40	314.131,80	0,59%	0,12%	0,59%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.826.322,84	0,00	0,00	16.923.768,98	97.446,14	0,58%	1,94%	0,58%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	59.849.381,70	0,00	0,00	60.110.111,31	260.729,61	0,44%	3,13%	0,44%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	11.727.516,91	0,00	0,00	11.777.760,28	50.243,37	0,43%	3,11%	0,43%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	38.597.433,74	0,00	0,00	38.755.055,06	157.621,32	0,41%	3,12%	0,41%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	59.773.722,94	0,00	0,00	59.945.475,61	171.752,67	0,29%	3,90%	0,29%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.499.128,24	23.925.604,76	18.905.359,75	15.595.119,98	75.746,73	0,22%	0,07%	0,49%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.373.373,10	0,00	0,00	6.386.725,50	13.352,40	0,21%	4,10%	0,21%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	37.329.895,20	0,00	0,00	37.407.528,88	77.633,68	0,21%	2,64%	0,21%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	171.447,01	143.000,00	311.551,93	3.454,11	559,03	0,18%	0,00%	0,43%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.602.287,38	0,00	0,00	3.605.908,06	3.620,68	0,10%	2,71%	0,10%
TÍTULOS PÚBLICOS	115.122.053,17	0,00	0,00	115.166.328,88	44.275,71	0,04%	-	-
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.489.903,09	0,00	0,00	12.488.950,05	-953,04	-0,01%	5,12%	-0,01%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	64.780.360,02	0,00	5.000.000,00	59.741.787,46	-38.572,56	-0,06%	2,83%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	35.489.686,04	0,00	0,00	35.436.849,13	-52.836,91	-0,15%	3,89%	-0,15%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	26.016.573,91	0,00	0,00	25.934.329,46	-82.244,45	-0,32%	5,16%	-0,32%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	108.859.486,98	0,00	0,00	108.467.703,94	-391.783,04	-0,36%	3,95%	-0,36%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	10.389.786,73	0,00	3.000.000,00	7.346.438,05	-43.348,68	-0,42%	4,31%	-0,64%



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 INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	126.660.051,88	0,00	0,00	126.120.732,19	-539.319,69	-0,43%	4,12%	-0,43%
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	49.240.872,11	14.342.550,44	0,00	62.991.395,95	-592.026,60	-0,93%	4,54%	-0,88%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.851.772,76	0,00	0,00	12.726.650,16	-125.122,60	-0,97%	5,00%	-0,97%
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	85.138,99	0,00	0,00	84.122,73	-1.016,26	-1,19%	-	-
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>-486.158,84</b>	<b>-0,06%</b>	<b>3,41%</b>	

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(%)
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	970.000,00	0,00	0,00	999.980,00	29.980,00	3,09%	33,06%	3,09%
XP LONG SHORT 60 FIC MULTIMERCADO	0,00	3.000.000,00	0,00	3.032.960,30	32.960,30	1,10%	2,74%	1,18%
SULAMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	4.367.430,46	0,00	0,00	4.397.692,45	30.261,99	0,69%	0,72%	0,69%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	7.452.937,14	0,00	0,00	7.504.391,76	51.454,62	0,69%	0,73%	0,69%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	10.432.032,50	0,00	0,00	10.463.257,28	31.224,78	0,30%	1,28%	0,30%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.214.431,53	0,00	0,00	1.216.591,17	2.159,64	0,18%	0,09%	0,18%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	24.349.230,34	0,00	0,00	24.388.735,34	39.505,00	0,16%	3,88%	0,16%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	7.719.157,17	0,00	0,00	7.729.759,81	10.602,64	0,14%	-	0,14%
LSH FIP	1.237.198,98	0,00	0,00	1.236.815,15	-383,83	-0,03%	-	-
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL MULTIESTRATÉGIA FIP	484.844,66	0,00	0,00	484.432,14	-412,52	-0,09%	0,31%	-0,19%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	5.453.242,61	0,00	0,00	5.443.970,22	-9.272,39	-0,17%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	906.284,55	0,00	0,00	901.119,82	-5.164,73	-0,57%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	12.242.106,53	0,00	0,00	11.923.943,49	-318.163,04	-2,60%	10,20%	-2,60%
XP DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES	5.095.101,93	0,00	0,00	4.937.729,76	-157.372,17	-3,09%	10,87%	-3,09%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.973.336,10	0,00	0,00	2.879.328,38	-94.007,72	-3,16%	11,10%	-3,16%
MÉRITO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - MFII11	5.773.927,60	0,00	0,00	5.576.816,00	-197.111,60	-3,41%	6,26%	-3,41%
KONDOR EQUITIES INSTITUCIONAL FI AÇÕES	28.451.871,43	0,00	0,00	27.351.597,93	-1.100.273,50	-3,87%	10,42%	-3,87%
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	12.338.078,70	0,00	0,00	11.799.006,62	-539.072,08	-4,37%	12,20%	-4,37%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	9.842.270,19	0,00	0,00	9.410.195,17	-432.075,02	-4,39%	11,84%	-4,39%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	16.157.477,52	0,00	0,00	15.416.583,98	-740.893,54	-4,59%	11,51%	-4,59%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>-3.366.053,17</b>	<b>-2,10%</b>	<b>7,89%</b>	

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 (%)
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	40.641.770,39	12.968.205,08	0,00	53.904.352,40	294.376,93	0,55%	0,57%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	29.730.451,07	71.042.229,36	85.425.276,76	15.595.119,98	247.716,31	0,63%	1,46%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.815.332,48	0,00	0,00	16.923.768,98	108.436,50	0,64%	0,64%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.200.553,02	0,00	0,00	4.299.709,51	99.156,49	2,36%	2,36%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.524.542,53	0,00	181.518,56	6.419.274,51	76.250,54	1,19%	-1,61%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	37.334.101,27	0,00	0,00	37.407.528,88	73.427,61	0,20%	0,20%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	830.989,71	0,00	0,00	850.470,00	19.480,29	2,34%	2,34%
GÁVEA SUL FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1 LP	1.119.556,74	0,00	376.383,52	762.137,77	18.964,55	1,90%	-31,93%
SULAMÉRICA CRÉDITO ATIVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	4.234.157,49	0,00	4.249.461,19	0,00	15.303,70	0,36%	1,48%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	5.941.260,68	0,00	5.956.071,70	0,00	14.811,02	0,25%	1,68%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	12.832.449,81	0,00	12.846.029,05	0,00	13.579,24	0,11%	0,56%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.612.208,37	335.500,00	2.953.283,58	3.454,11	9.029,32	0,70%	1,28%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.598.334,62	0,00	0,00	3.605.908,06	7.573,44	0,21%	0,21%
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	628.464,89	0,00	634.162,43	0,00	5.697,54	1,05%	-100,00%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	11.618,72	0,00	11.696,96	0,00	78,24	0,67%	1,52%
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	86.400,67	0,00	0,00	84.122,73	-2.277,94	-2,64%	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.309.444,01	0,00	7.292.539,12	0,00	-16.904,89	-0,23%	-6,24%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	11.866.129,26	0,00	0,00	11.777.760,28	-88.368,98	-0,74%	-0,74%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.507.280,75	0,00	0,00	6.386.725,50	-120.555,25	-1,85%	-1,85%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	39.008.293,91	59.342,53	0,00	38.755.055,06	-312.581,38	-0,80%	-0,80%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	10.769.491,13	0,00	3.000.000,00	7.346.438,05	-423.053,08	-3,93%	-4,14%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.955.853,68	0,00	0,00	12.488.950,05	-466.903,63	-3,60%	-3,60%

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 (%)
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	65.605.274,10	0,00	5.000.000,00	60.110.111,31	-495.162,79	-0,72%	-0,75%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	20.615.219,38	5.956.071,70	0,00	25.934.329,46	-636.961,62	-2,40%	-2,36%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.419.948,24	0,00	0,00	12.726.650,16	-693.298,08	-5,17%	-5,17%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	78.745.642,53	0,00	18.000.000,00	59.741.787,46	-1.003.855,07	-1,47%	-1,42%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	36.498.731,65	0,00	35.436.849,13	-1.061.882,52	-2,91%	-2,56%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	57.478.068,75	4.249.461,19	0,00	59.945.475,61	-1.782.054,33	-2,89%	-2,89%
BRADERCO H NILO FI RENDA FIXA	25.853.081,00	39.342.550,44	0,00	62.991.395,95	-2.204.235,49	-4,06%	-4,54%
TÍTULOS PÚBLICOS	120.767.861,62	0,00	2.493.719,25	115.166.328,88	-3.107.813,49	-2,57%	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	112.611.189,18	0,00	0,00	108.467.703,94	-4.143.485,24	-3,68%	-3,68%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	156.500.377,92	0,00	25.000.000,00	126.120.732,19	-5.379.645,73	-3,51%	-3,91%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>-20.935.157,79</b>	<b>-2,34%</b>	

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	23.420.956,82	0,00	0,00	24.388.735,34	967.778,52	4,13%	4,13%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	7.343.580,76	0,00	0,00	7.504.391,76	160.811,00	2,19%	2,19%
SULAMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	4.345.503,30	0,00	0,00	4.397.692,45	52.189,15	1,20%	1,20%
XP LONG SHORT 60 FIC MULTIMERCADO	0,00	3.000.000,00	0,00	3.032.960,30	32.960,30	1,10%	3,21%
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL MULTIESTRATÉGIA FIP	472.154,17	0,00	0,00	484.432,14	12.277,97	2,60%	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	916.506,31	0,00	0,00	901.119,82	-15.386,49	-1,68%	-
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	10.484.414,82	0,00	0,00	10.463.257,28	-21.157,54	-0,20%	-0,20%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	5.473.361,42	0,00	0,00	5.443.970,22	-29.391,20	-0,54%	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	7.761.269,25	0,00	0,00	7.729.759,81	-31.509,44	-0,41%	-
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.260.086,22	0,00	0,00	1.216.591,17	-43.495,05	-3,45%	-3,45%
XP DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES	0,00	5.000.000,00	0,00	4.937.729,76	-62.270,24	-1,25%	-11,65%
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	1.180.000,00	0,00	0,00	999.980,00	-180.020,00	-15,26%	-15,26%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	3.265.786,31	0,00	0,00	2.879.328,38	-386.457,93	-11,83%	-11,83%
LSH FIP	1.796.747,74	0,00	0,00	1.236.815,15	-559.932,59	-31,16%	-
MÉRITO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - MFII11	6.394.108,00	0,00	0,00	5.576.816,00	-817.292,00	-12,78%	-12,78%
BRADESCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES	15.392.325,00	0,00	14.342.550,44	0,00	-1.049.774,56	-6,82%	-12,92%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	13.138.979,81	0,00	0,00	11.923.943,49	-1.215.036,32	-9,25%	-9,25%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	10.867.176,40	0,00	0,00	9.410.195,17	-1.456.981,23	-13,41%	-13,41%
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	13.469.625,19	0,00	0,00	11.799.006,62	-1.670.618,57	-12,40%	-12,40%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	17.731.443,51	0,00	0,00	15.416.583,98	-2.314.859,53	-13,06%	-13,06%
KONDOR EQUITIES INSTITUCIONAL FI AÇÕES	22.427.469,68	7.292.539,12	0,00	27.351.597,93	-2.368.410,87	-7,97%	-7,88%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>-10.996.576,62</b>	<b>-6,37%</b>	

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 (%)
TÍTULOS PÚBLICOS	116.135.193,83	0,00	3.250.712,00	115.166.328,88	2.281.847,05	1,96%	-
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	73.081.953,70	0,00	15.000.000,00	60.110.111,31	2.028.157,61	2,71%	2,70%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	149.105.289,27	0,00	25.000.000,00	126.120.732,19	2.015.442,92	1,28%	0,86%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	69.291.925,53	6.654.989,20	18.000.000,00	59.741.787,46	1.794.872,73	2,17%	2,26%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	39.343.107,89	12.968.205,08	0,00	53.904.352,40	1.593.039,43	3,87%	3,89%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	36.224.017,05	0,00	0,00	37.407.528,88	1.183.511,83	3,27%	3,27%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	54.588.809,13	4.249.461,19	0,00	59.945.475,61	1.107.205,29	2,25%	2,25%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	37.716.511,41	59.342,53	0,00	38.755.055,06	979.201,12	2,60%	2,60%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	99.496.958,79	8.111.967,30	0,00	108.467.703,94	858.777,85	1,05%	1,03%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.451.428,38	166.051.358,46	161.612.005,87	15.595.119,98	704.339,01	1,48%	3,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.788.618,44	0,00	456.374,53	16.923.768,98	591.525,07	3,58%	3,59%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	12.424.324,57	0,00	12.846.029,05	0,00	421.704,48	3,39%	3,87%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.907.260,91	0,00	7.292.539,12	0,00	385.278,21	5,58%	-0,78%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	11.468.077,42	0,00	0,00	11.777.760,28	309.682,86	2,70%	2,70%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.560.049,01	0,00	325.316,44	12.488.950,05	254.217,48	1,99%	-0,57%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	7.863.690,60	0,00	8.111.967,30	0,00	248.276,70	3,16%	1,14%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.388.483,88	0,00	181.518,56	6.419.274,51	212.309,19	3,35%	0,48%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.236.271,58	0,00	114.211,80	4.299.709,51	177.649,73	4,27%	1,50%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.408.423,70	0,00	175.308,78	6.386.725,50	153.610,58	2,39%	-0,34%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	5.830.880,59	0,00	5.956.071,70	0,00	125.191,11	2,15%	3,60%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.573.736,38	0,00	92.924,12	3.605.908,06	125.095,80	3,55%	0,90%
SULAMÉRICA CRÉDITO ATIVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	4.166.716,54	0,00	4.249.461,19	0,00	82.744,65	1,99%	3,12%

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 (%)
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	10.264.344,06	0,00	3.000.000,00	7.346.438,05	82.093,99	0,80%	0,58%
GÁVEA SUL FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1 LP	1.461.289,03	0,00	745.004,31	762.137,77	45.853,05	3,94%	-47,84%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.043.232,90	1.335.491,85	3.414.283,58	3.454,11	39.012,94	1,92%	2,62%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	839.225,25	0,00	23.693,93	850.470,00	34.938,68	4,25%	4,25%
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	920.424,53	0,00	946.852,56	0,00	26.428,03	3,40%	-100,00%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.033.186,60	0,00	332.651,10	12.726.650,16	26.114,66	0,09%	-2,35%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	1.200.000,00	1.211.696,96	0,00	11.696,96	1,65%	3,12%
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	91.793,32	0,00	0,00	84.122,73	-7.670,59	-8,36%	-
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	10.119.793,05	26.549.873,35	10.593.801,65	25.934.329,46	-141.535,29	0,86%	2,22%
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	24.412.569,92	39.342.550,44	0,00	62.991.395,95	-763.724,41	1,60%	1,09%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	36.498.731,65	0,00	35.436.849,13	-1.061.882,52	-2,91%	2,00%
Total Renda Fixa					15.925.006,20	1,78%	

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 (%)
KONDOR EQUITIES INSTITUCIONAL FI AÇÕES	16.185.980,33	10.072.854,55	0,00	27.351.597,93	1.092.763,05	8,83%	9,55%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	23.633.824,57	0,00	0,00	24.388.735,34	754.910,77	3,19%	3,19%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	4.864.348,19	0,00	0,00	5.443.970,22	579.622,03	11,92%	-
BRADESCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES	13.907.228,54	0,00	14.342.550,44	0,00	435.321,90	3,13%	-3,62%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	7.119.000,39	0,00	0,00	7.504.391,76	385.391,37	5,41%	5,41%
APEX AÇÕES 30 FIC AÇÕES	8.266.908,49	0,00	8.460.950,15	0,00	194.041,66	2,35%	3,84%
SULAMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	4.242.782,87	0,00	0,00	4.397.692,45	154.909,58	3,65%	3,65%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	7.594.428,10	0,00	0,00	7.729.759,81	135.331,71	1,78%	-
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	5.326.211,05	5.029.258,16	0,00	10.463.257,28	107.788,07	1,65%	1,79%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	4.990.438,95	0,00	5.029.258,16	0,00	38.819,21	0,78%	3,51%
XP LONG SHORT 60 FIC MULTIMERCADO	0,00	3.000.000,00	0,00	3.032.960,30	32.960,30	1,10%	10,53%
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL MULTIESTRATÉGIA FIP	472.927,50	0,00	0,00	484.432,14	11.504,64	2,43%	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	906.512,98	0,00	0,00	901.119,82	-5.393,16	-0,59%	-
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.254.319,84	0,00	0,00	1.216.591,17	-37.728,67	-3,01%	-3,01%
XP DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES	0,00	5.000.000,00	0,00	4.937.729,76	-62.270,24	-1,25%	-6,36%
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	11.862.048,39	5.892.797,79	5.892.797,79	11.799.006,62	-63.041,77	-3,92%	-0,53%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	3.075.978,16	0,00	0,00	2.879.328,38	-196.649,78	-6,39%	-6,39%
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	1.238.000,00	0,00	0,00	999.980,00	-238.020,00	-19,23%	-19,23%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	6.207.009,73	6.000.000,00	0,00	11.923.943,49	-283.066,24	2,61%	3,61%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	10.486.629,90	5.680.634,72	0,00	15.416.583,98	-750.680,64	-4,64%	-3,69%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	10.478.796,06	0,00	0,00	9.410.195,17	-1.068.600,89	-10,20%	-10,20%
MÉRITO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - MFII11	6.720.544,04	0,00	0,00	5.576.816,00	-1.143.728,04	-17,02%	-17,02%



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 (%)
LSH FIP	4.633.799,38	0,00	0,00	1.236.815,15	-3.396.984,23	-73,31%	-
Total Renda Variável					-3.322.799,37	-1,80%	