

Relatório Analítico dos Investimentos em abril de 2018



Carteira consolidada de investimentos - base (abril / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	5.937.389,98	1,78%	337	0,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.567.531,28	1,07%	204	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	42.400.433,49	12,71%	223	1,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.615.720,06	2,28%	729	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	17.001.353,92	5,10%	760	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	837.850,84	0,25%	239	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.433.468,78	1,93%	1.411	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	4.251.546,11	1,27%	192	1,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.833.978,15	1,75%	654	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	4.434.197,90	1,33%	52	1,49%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	5.106.433,58	1,53%	244	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	25.248.679,90	7,57%	740	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	932.534,43	0,28%	742	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.431.571,85	0,43%	1.222	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	17.247.181,86	5,17%	111	2,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.122.575,08	0,94%	203	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	2.664.149,32	0,80%	143	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	792.740,99	0,24%	17	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.109.718,10	0,33%	257	0,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	87.609,22	0,03%	654	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRASESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	5.133.311,60	1,54%	84	0,91%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+0	Não há	22.624.357,53	6,78%	303	1,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (abril / 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 PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	6.978.751,24	2,09%	719	0,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	2.943.650,75	0,88%	17	0,66%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.037.252,86	0,61%	23	1,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	3.338.178,79	1,00%	9	1,80%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.230.717,86	2,17%	231	0,68%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	16.379.661,26	4,91%	479	0,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	30.654.376,21	9,19%	203	1,85%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.187.278,32	0,36%	99	0,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.695.923,37	1,11%	37	1,56%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	1.833.197,21	0,55%	67	0,39%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.820.072,94	0,55%	5.840	0,52%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB CONSUMO FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.791.313,88	1,14%	2.919	3,05%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	1.274.573,79	0,38%	43	1,13%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.757.934,70	0,53%	5.520	1,23%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	10.633.222,08	3,19%	1.304	0,65%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	23.091.460,75	6,92%	3.154	7,64%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	D+4	Não há	3.146.429,28	0,94%	6.618	2,74%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	3.568.308,09	1,07%	624	4,45%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
XP INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	3.029.552,78	0,91%	4.729	0,70%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB CIELO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.439.581,57	0,43%	4.501	1,90%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	D+4	Não há	4.641.958,35	1,39%	7.077	0,61%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	3.364.091,27	1,01%	35	4,91%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

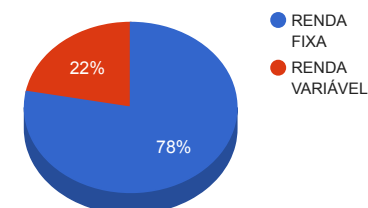
Carteira consolidada de investimentos - base (abril / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	11.867.685,47	3,56%	11.970	1,09%	Artigo 8º, Inciso III
		TOTAL -	333.519.506,79				

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

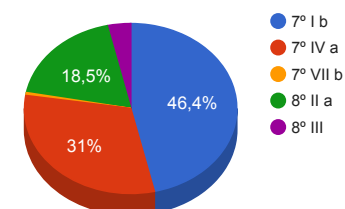
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	154.859.337,52	46,43%	15,00%	25,00%	70,00%	78.604.317,23
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	200.111.704,07
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	103.400.787,11	31,00%	5,00%	10,00%	30,00%	-3.344.935,07
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	7,00%	15,00%	15,00%	50.027.926,02
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	16.675.975,34
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	1.833.197,21	0,55%	2,00%	5,00%	5,00%	14.842.778,13
Total Renda Fixa	100,00%	260.093.321,84	77,98%	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%	33.351.950,68
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	61.558.499,48	18,46%	2,00%	5,00%	10,00%	-28.206.548,80
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	11.867.685,47	3,56%	7,00%	10,00%	10,00%	21.484.265,21
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	16.675.975,34
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	16.675.975,34
Total Renda Variável	30,00%	73.426.184,95	22,02%	15,00	30,00	40,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: abril / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	154.859.337,52	46,43%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	103.400.787,11	31,00%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	1.833.197,21	0,55%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	260.093.321,84	77,98%	36,00	190,00

Artigos - Renda Variável	Base: abril / 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 "	61.558.499,48	18,46%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	11.867.685,47	3,56%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	73.426.184,95	22,02%	15,00	40,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (abril / 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	161.970.687,64	48,56%	0,04%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	81.656.498,74	24,48%	0,01%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	54.276.578,49	16,27%	0,01%
WESTERN ASSET	15.205.864,26	4,56%	0,03%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	12.616.601,19	3,78%	0,00%
XP GESTÃO DE RECURSOS	4.849.625,72	1,45%	0,00%
SAFRA ASSET MANAGEMENT	2.943.650,75	0,88%	0,00%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	0,82%	3,86%	3,07%	5,34%	12,30%	27,17%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,78%	3,87%	2,89%	5,02%	11,52%	25,80%	0,20%	0,320%	2,65%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,69%	3,75%	2,76%	4,94%	11,42%	25,59%	0,20%	0,324%	2,70%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,41%	2,29%	1,24%	2,86%	8,22%	22,02%	0,20%	0,096%	1,61%
IPCA + 6,00% ao ano	0,71%	2,85%	2,04%	4,56%	8,88%	20,09%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,68%	3,20%	2,09%	4,78%	9,25%	21,36%	0,20%	0,067%	0,34%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,03%	4,79%	2,56%	5,30%	12,27%	28,70%	0,15%	0,997%	6,23%
Selic	0,52%	2,12%	1,52%	3,25%	8,11%	22,67%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,51%	2,11%	1,53%	3,22%	8,36%	23,43%	0,20%	0,001%	0,12%
CDI	0,52%	2,11%	1,52%	3,25%	8,10%	22,64%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,52%	2,11%	1,53%	3,28%	8,19%	22,87%	0,20%	0,018%	0,11%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,45%	1,84%	1,32%	2,83%	7,23%	20,66%	0,80%	0,000%	0,09%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,43%	1,76%	1,26%	2,70%	6,96%	20,57%	1,00%	0,004%	0,09%
IRF-M 1	0,51%	2,32%	1,71%	3,53%	8,94%	24,04%	-	-	-
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	0,53%	2,50%	1,92%	3,75%	9,20%	24,69%	0,50%	0,132%	1,04%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,49%	2,25%	1,67%	3,45%	8,76%	23,59%	0,20%	0,069%	0,65%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,49%	2,25%	1,67%	3,44%	8,76%	23,60%	0,20%	0,067%	0,63%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,48%	2,24%	1,65%	3,42%	8,71%	23,41%	0,10%	0,068%	0,64%
IRF-M	0,47%	4,25%	2,92%	5,64%	12,79%	32,67%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,43%	4,18%	2,86%	5,52%	12,49%	32,10%	0,20%	0,827%	4,41%
IRF-M 1+	0,45%	4,97%	3,37%	6,41%	14,19%	36,11%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,31%	5,00%	3,29%	6,36%	13,85%	35,53%	0,20%	1,179%	5,77%
IMA-B 5	0,42%	3,97%	2,60%	4,99%	11,65%	26,36%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,41%	3,89%	2,55%	4,89%	11,44%	25,88%	0,20%	0,481%	3,46%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,40%	3,89%	2,54%	4,91%	11,43%	25,89%	0,10%	0,481%	3,46%
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,39%	3,98%	2,63%	4,97%	11,59%	26,20%	0,20%	0,517%	3,69%
IMA Geral	0,32%	3,80%	2,01%	4,72%	10,82%	28,36%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,26%	3,64%	1,93%	4,52%	10,50%	28,01%	0,20%	0,699%	4,31%
IMA Geral ex-C	0,30%	3,70%	1,99%	4,62%	10,78%	28,55%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,22%	3,75%	1,99%	4,55%	10,15%	-	0,30%	0,711%	4,77%
IPCA	0,22%	0,92%	0,63%	1,65%	2,76%	6,96%	-	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,48%	4,29%	2,89%	5,51%	12,98%	30,58%	0,20%	0,470%	4,00%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,33%	3,19%	2,17%	4,30%	9,68%	-	0,002	0,603%	4,10%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,29%	3,31%	1,74%	4,15%	-	-	0,40%	0,878%	-
IMA-B 5+	-0,63%	5,27%	0,31%	4,61%	10,45%	31,07%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,64%	5,17%	0,25%	4,46%	10,24%	30,38%	0,20%	2,119%	11,67%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	-0,65%	5,12%	0,23%	4,42%	10,00%	30,36%	0,20%	2,137%	11,94%
IMA-B	-0,14%	4,79%	1,34%	4,85%	10,93%	29,34%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,42%	-0,43%	-1,46%	0,13%	2,51%	8,43%	0,20%	0,097%	4,15%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	-0,12%	5,69%	2,04%	5,71%	11,98%	30,95%	0,50%	1,666%	10,03%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,13%	4,72%	1,37%	4,81%	10,82%	28,97%	0,20%	1,343%	8,58%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,16%	4,72%	1,30%	4,74%	10,70%	28,86%	0,20%	1,346%	8,97%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-0,16%	4,71%	1,30%	4,73%	10,44%	28,35%	0,20%	1,355%	8,99%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,17%	4,69%	1,30%	4,77%	10,79%	29,20%	0,30%	1,338%	8,98%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,29%	2,86%	-0,19%	2,58%	6,69%	16,22%	0,20%	1,206%	7,54%

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

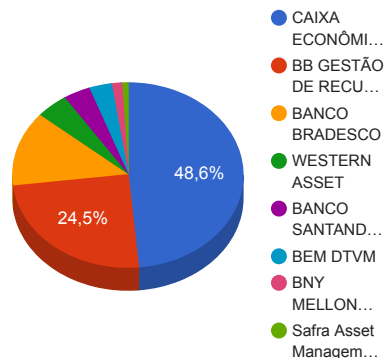
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	2,37%	6,50%	2,07%	11,22%	32,49%	86,18%	-	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	1,86%	5,63%	1,02%	10,32%	32,09%	78,34%	1,50%	7,041%	17,89%
Ibovespa	0,88%	12,71%	1,42%	15,89%	31,67%	59,74%	-	-	-
XP INVESTOR FI AÇÕES	2,72%	18,40%	8,60%	20,19%	42,51%	81,87%	2,00%	6,740%	17,46%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	1,85%	8,08%	0,74%	7,10%	19,78%	49,82%	2,00%	7,567%	19,31%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1,85%	12,76%	2,54%	13,82%	28,36%	50,87%	1,00%	7,917%	19,06%
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	1,08%	8,26%	0,71%	12,38%	28,95%	67,57%	2,00%	7,704%	18,00%
BB PIPE FIC AÇÕES	-2,31%	-4,33%	-7,61%	-1,80%	14,24%	33,38%	1,20%	6,234%	16,24%
S&P 500	0,27%	-0,96%	-6,22%	2,83%	11,07%	28,22%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	0,59%	-0,32%	-5,41%	4,75%	17,74%	52,90%	1,00%	8,420%	11,82%
CIELO ON NM - CIEL3	-7,20%	-16,96%	-27,34%	-12,29%	-16,84%	-26,88%	-	-	-
BB CIELO FI AÇÕES	-6,95%	-16,66%	-26,93%	-12,23%	-17,21%	-28,26%	1,50%	12,399%	27,15%
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	-6,12%	-0,43%	-8,82%	2,30%	-2,15%	3,19%	-	-	-
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	-6,24%	-1,04%	-9,20%	1,41%	-3,93%	-0,24%	1,5%	9,123%	23,81%
IFNC	-4,12%	15,70%	-3,00%	16,01%	27,37%	60,69%	-	-	-
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	-4,13%	15,17%	-3,09%	15,27%	25,43%	56,58%	1,00%	9,211%	22,55%
IDIV	-1,42%	8,80%	-0,99%	6,56%	18,46%	65,00%	-	-	-

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

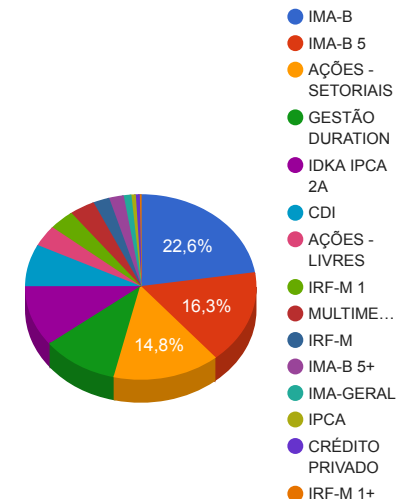
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	2,40%	8,72%	3,07%	12,97%	25,58%	51,97%	3,00%	4,886%	15,46%
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,41%	15,55%	3,80%	18,54%	29,66%	69,78%	1,50%	7,661%	18,42%
ICON	-1,08%	-3,94%	-5,23%	-1,01%	14,84%	34,46%	-	-	-
BB CONSUMO FIC AÇÕES	-1,14%	-4,04%	-5,32%	-1,49%	13,32%	30,74%	1,00%	5,125%	17,11%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	161.970.687,64	48,56%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	81.656.498,74	24,48%
BANCO BRADESCO	43.643.356,41	13,09%
WESTERN ASSET	15.205.864,26	4,56%
BANCO SANTANDER	12.616.601,19	3,78%
BEM DTVM	10.633.222,08	3,19%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	4.849.625,72	1,45%
Safra Asset Management	2.943.650,75	0,88%



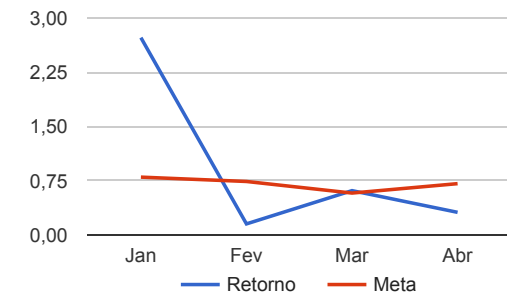
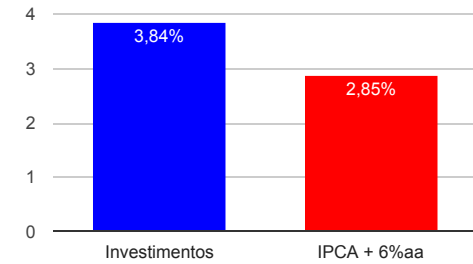
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	75.332.878,17	22,59%
IMA-B 5	54.403.669,50	16,31%
AÇÕES - SETORIAIS	49.248.323,29	14,77%
GESTÃO DURATION	35.760.809,79	10,72%
IDKA IPCA 2A	35.334.204,16	10,59%
CDI	24.555.739,82	7,36%
AÇÕES - LIVRES	12.310.176,19	3,69%
IRF-M 1	11.995.969,70	3,60%
MULTIMERCADO	11.867.685,47	3,56%
IRF-M	7.615.720,06	2,28%
IMA-B 5+	6.818.498,45	2,04%
IMA-GERAL	3.567.531,28	1,07%
IPCA	2.037.252,86	0,61%
CRÉDITO PRIVADO	1.833.197,21	0,55%
IRF-M 1+	837.850,84	0,25%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	325.218.072,19	12.171.088,33	12.155.217,07	334.098.767,58	8.864.824,13	2,73%	0,80%	340,08%	2,25%
Fevereiro	334.098.767,58	73.235.343,81	74.097.437,92	333.752.915,61	516.242,14	0,15%	0,74%	20,93%	3,49%
Março	333.752.915,61	6.881.302,17	8.287.041,41	334.394.216,53	2.047.040,16	0,61%	0,58%	106,26%	2,13%
Abril	334.394.216,53	11.785.465,78	13.710.250,14	333.519.506,79	1.050.074,62	0,31%	0,71%	44,36%	2,16%
Acumulado no ano					12.478.181,05	3,84%	2,85%	134,53%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.788.629,26	0,00	0,00	5.833.978,15	45.348,89	0,78%	0,32%	0,78%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	25.075.469,99	0,00	0,00	25.248.679,90	173.209,91	0,69%	0,32%	0,69%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.646.160,95	0,00	0,00	2.664.149,32	17.988,37	0,68%	0,07%	0,68%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	2.928.272,60	0,00	0,00	2.943.650,75	15.378,15	0,53%	0,13%	0,53%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.942.815,61	0,00	0,00	6.978.751,24	35.935,63	0,52%	0,02%	0,52%
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	16.297.316,74	0,00	0,00	16.379.661,26	82.344,52	0,51%	0,00%	0,51%
BRADERCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1.181.430,66	0,00	0,00	1.187.278,32	5.847,66	0,49%	0,07%	0,49%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.700.941,36	0,00	300.000,00	6.433.468,78	32.527,42	0,49%	0,07%	0,49%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.424.733,66	0,00	0,00	1.431.571,85	6.838,19	0,48%	0,07%	0,48%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.824.499,87	0,00	0,00	1.833.197,21	8.697,34	0,48%	0,47%	0,48%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.583.290,37	0,00	0,00	7.615.720,06	32.429,69	0,43%	0,83%	0,43%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	42.225.175,01	0,00	0,00	42.400.433,49	175.258,48	0,42%	0,10%	0,42%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.233.999,80	0,00	0,00	4.251.546,11	17.546,31	0,41%	0,10%	0,41%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	928.770,28	0,00	0,00	932.534,43	3.764,15	0,41%	0,48%	0,41%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	5.913.695,98	0,00	0,00	5.937.389,98	23.694,00	0,40%	0,48%	0,40%
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	5.113.517,71	0,00	0,00	5.133.311,60	19.793,89	0,39%	0,52%	0,39%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.416.668,00	0,00	1.421.919,00	0,00	5.251,00	0,37%	0,16%	0,44%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	30.553.569,60	0,00	0,00	30.654.376,21	100.806,61	0,33%	0,60%	0,33%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	835.294,83	0,00	0,00	837.850,84	2.556,01	0,31%	1,18%	0,31%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	2.031.403,08	0,00	0,00	2.037.252,86	5.849,78	0,29%	0,88%	0,29%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.558.251,30	0,00	0,00	3.567.531,28	9.279,98	0,26%	0,70%	0,26%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.095.248,13	0,00	0,00	5.106.433,58	11.185,45	0,22%	0,71%	0,22%

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	87.504,61	0,00	87.609,22	104,61	0,12%	0,00%	0,43%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1.402.204,16	8.608.482,24	8.905.158,01	1.109.718,10	4.189,71	0,04%	0,00%	0,45%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.435.558,80	0,00	0,00	4.434.197,90	-1.360,90	-0,03%	1,00%	-0,03%
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.085.706,96	0,00	3.083.173,13	0,00	-2.533,83	-0,08%	2,96%	-0,95%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	3.342.123,33	0,00	0,00	3.338.178,79	-3.944,54	-0,12%	1,67%	-0,12%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	22.654.581,91	0,00	0,00	22.624.357,53	-30.224,38	-0,13%	1,34%	-0,13%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	16.934.376,65	93.810,41	0,00	17.001.353,92	-26.833,14	-0,16%	1,35%	-0,16%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	17.275.517,71	0,00	0,00	17.247.181,86	-28.335,85	-0,16%	1,35%	-0,16%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.247.111,15	2.995.668,52	0,00	7.230.717,86	-12.061,81	-0,17%	1,34%	-0,17%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	795.046,71	0,00	0,00	792.740,99	-2.305,72	-0,29%	1,21%	-0,29%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.142.655,56	0,00	0,00	3.122.575,08	-20.080,48	-0,64%	2,12%	-0,64%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	3.720.111,58	0,00	0,00	3.695.923,37	-24.188,21	-0,65%	2,14%	-0,65%
Total Renda Fixa					683.956,89	0,26%	0,65%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
XP INVESTOR FI AÇÕES	2.949.454,30	0,00	0,00	3.029.552,78	80.098,48	2,72%	6,74%	2,72%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.777.459,08	0,00	0,00	1.820.072,94	42.613,86	2,40%	4,89%	2,40%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	22.670.392,86	0,00	0,00	23.091.460,75	421.067,89	1,86%	7,04%	1,86%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	3.503.336,13	0,00	0,00	3.568.308,09	64.971,96	1,85%	7,57%	1,85%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	3.302.899,40	0,00	0,00	3.364.091,27	61.191,87	1,85%	7,92%	1,85%
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	4.592.482,69	0,00	0,00	4.641.958,35	49.475,66	1,08%	7,70%	1,08%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	11.798.172,64	0,00	0,00	11.867.685,47	69.512,83	0,59%	8,42%	0,59%
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	10.589.606,90	0,00	0,00	10.633.222,08	43.615,18	0,41%	7,66%	0,41%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	3.834.900,72	0,00	0,00	3.791.313,88	-43.586,84	-1,14%	5,12%	-1,14%
BB PIPE FIC AÇÕES	1.304.737,17	0,00	0,00	1.274.573,79	-30.163,38	-2,31%	6,23%	-2,31%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	1.833.749,37	0,00	0,00	1.757.934,70	-75.814,67	-4,13%	9,21%	-4,13%
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	3.355.690,96	0,00	0,00	3.146.429,28	-209.261,68	-6,24%	9,12%	-6,24%
BB CIELO FI AÇÕES	1.547.185,00	0,00	0,00	1.439.581,57	-107.603,43	-6,95%	12,40%	-6,95%
Total Renda Variável					366.117,73	0,50%	7,53%	