

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
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.052.524,78	0,10%			Artigo 20
TÍTULOS PÚBLICOS			167.833.426,28	16,14%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	7.152.881,68	0,69%	961	16,92%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	48.110.616,97	4,63%	729	0,80%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	12.712.609,58	1,22%	20	4,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	35.209.367,36	3,39%	17	1,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	7.045.018,36	0,68%	65	0,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	69.065.310,32	6,64%	337	5,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	96.518.225,78	9,28%	742	1,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	41.706.139,44	4,01%	372	1,80%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	125.121.973,60	12,03%	371	3,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	48.330.287,58	4,65%	94	3,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	16.271.043,05	1,56%	524	7,67%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	209.887,58	0,02%	1.387	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+0	Não há	21.700.242,88	2,09%	303	0,99%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	36.744.057,49	3,53%	84	6,53%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	52.980.035,34	5,09%	231	4,98%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES LP	D+0	Não há	7.484.410,62	0,72%	1.462	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER MASTER FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	342.739,18	0,03%	70.167	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	35.476.590,29	3,41%	61	2,37%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	13.937.989,49	1,34%	479	0,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CARTÃO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	D+45 a D+75	Não há	7.053.355,85	0,68%	202	1,77%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "

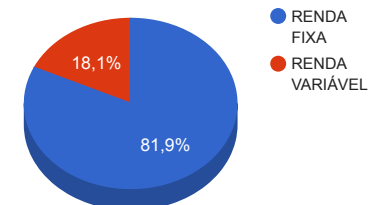
Carteira consolidada de investimentos - base (abril / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	Não se aplica	Não se aplica	47.292,92	0,00%	11	4,98%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	38.405,43	0,00%		4,29%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	39.637.094,23	3,81%	52	5,38%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	20.140.179,73	1,94%	359	6,62%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	7.030.135,53	0,68%	2.061	1,76%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ARX INCOME FI AÇÕES	D+4	Não há	24.415.180,72	2,35%	1.611	11,08%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	29.414.741,37	2,83%	5.485	4,68%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	4.666.879,03	0,45%	5.840	1,34%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	7.241.545,79	0,70%	122	1,59%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	10.057.851,10	0,97%	291	4,16%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	6.719.235,08	0,65%	11.970	0,61%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ INSTITUCIONAL CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA FI MULTIMERCADO	D+1	19/06/2018	8.522.165,60	0,82%	10	24,62%	Artigo 8º, Inciso III
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP	Não se aplica	Não se aplica	470.888,71	0,05%	20	0,22%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	852.014,13	0,08%	39	0,40%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	14.033.097,63	1,35%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	Não se aplica	Não se aplica	5.281.100,00	0,51%		5,71%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	S/Info	Não se aplica	9.344.839,14	0,90%		5,85%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
		TOTAL -	1.039.971.379,64				

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

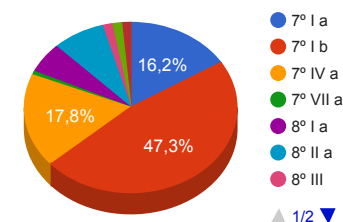
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	167.833.426,28	16,14%	17,00%	40,00%	40,00%	248.155.125,58
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	490.972.430,67	47,21%	35,00%	50,00%	50,00%	29.013.259,15
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	21,00%	35,00%	35,00%	363.989.982,87
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	185.146.995,92	17,80%	4,00%	10,00%	20,00%	22.847.280,01
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	7.139.054,20	0,69%	0,70%	1,00%	2,00%	13.660.373,39
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00	0,00%	1,00%	2,00%	3,00%	31.199.141,39
Em Enquadramento - RF	0,00%	0,00	0,00%	1,00%	2,00%	3,00%	31.199.141,39
Total Renda Fixa	100,00%	851.091.907,07	81,84%	79,70	140,00	154,00	-

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%	59.777.273,96	5,75%	5,00%	6,00%	7,00%	13.020.722,61
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	82.826.333,54	7,96%	6,00%	6,00%	7,00%	-10.028.336,97
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	20,00%	0,00	0,00%	0,70%	1,00%	2,00%	20.799.427,59
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	15.241.400,68	1,47%	1,00%	3,00%	5,00%	36.757.168,30
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	15.356.000,47	1,48%	1,00%	2,00%	4,00%	26.242.854,72
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	14.625.939,14	1,41%	1,00%	2,00%	3,00%	16.573.202,25
Desenquadrado - RV	0,00%	0,00	0,00%	1,00%	2,00%	3,00%	31.199.141,39
Em Enquadramento - RV	0,00%	0,00	0,00%	1,00%	2,00%	3,00%	31.199.141,39
Total Renda Variável	30,00%	187.826.947,79	18,06%	16,70	24,00	34,00	-

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 " a "	167.833.426,28	16,14%	17,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	490.972.430,67	47,21%	35,00%	50,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	21,00%	35,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	185.146.995,92	17,80%	4,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	7.139.054,20	0,69%	0,70%	2,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	1,00%
Desenquadrado - RF	0,00	0,00%	1,00%	3,00%
Em Enquadramento - RF	0,00	0,00%	1,00%	3,00%
Total Renda Fixa	851.091.907,07	81,84%	79,70	154,00

Artigos - Renda Variável	Base: abril / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	59.777.273,96	5,75%	5,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	82.826.333,54	7,96%	6,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,70%	5,00%
Artigo 8º, Inciso III	15.241.400,68	1,47%	1,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	15.356.000,47	1,48%	1,00%	4,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	14.625.939,14	1,41%	1,00%	3,00%
Desenquadrado - RV	0,00	0,00%	1,00%	3,00%
Em Enquadramento - RV	0,00	0,00%	1,00%	3,00%
Total Renda Variável	187.826.947,79	18,06%	16,70	68,00

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	243.340.442,26	23,40%	0,06%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	142.796.791,75	13,73%	0,01%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	104.827.304,44	10,08%	0,02%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	99.012.334,56	9,52%	0,01%
ITAÚ UNIBANCO	68.586.035,97	6,59%	0,01%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	52.715.919,95	5,07%	0,30%
ITAÚ DTVM	39.637.094,23	3,81%	0,00%
WESTERN ASSET	26.859.414,81	2,58%	0,05%
ARX INVESTIMENTOS	24.415.180,72	2,35%	0,31%
KINEA INVESTIMENTOS	14.033.097,63	1,35%	0,00%
SAFRA ASSET MANAGEMENT	12.712.609,58	1,22%	0,01%
RB CAPITAL ASSET MANAGEMENT	9.344.839,14	0,90%	1,34%
VINCI PARTNERS	7.241.545,79	0,70%	0,04%
GERAÇÃO FUTURO	7.152.881,68	0,69%	0,05%
OLIVEIRA TRUST	7.053.355,85	0,68%	0,10%

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
REAG GESTORA DE RECURSOS	5.281.100,00	0,51%	0,72%%
XP GESTÃO DE RECURSOS	4.666.879,03	0,45%	0,00%%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	852.014,13	0,08%	0,00%%
BRZ INVESTIMENTOS	470.888,71	0,05%	0,02%%
BRASIL PLURAL	85.698,35	0,01%	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
CDI + 3,50% ao ano	0,81%	3,26%	2,36%	4,98%	11,85%	31,32%	-	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-2,21%	-58,19%	-10,30%	11,19%	29,80%	-84,33%	0,20%	13,995%	297,30%
120% do CDI	0,62%	2,54%	1,83%	3,91%	9,80%	27,75%	-	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	-19,14%	-40,53%	-38,22%	-44,94%	-54,86%	-63,82%	0,00%	31,504%	-
115% do CDI	0,60%	2,43%	1,75%	3,74%	9,37%	26,45%	-	-	-
CARTÃO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	0,61%	2,48%	1,77%	3,76%	9,41%	26,51%	0,20%	0,087%	0,25%
Selic	0,52%	2,12%	1,52%	3,25%	8,11%	22,67%	-	-	-
BRDESCO 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%	-	-	-
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,51%	2,10%	1,50%	3,22%	8,20%	22,90%	0,20%	0,002%	0,11%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES LP	0,51%	2,06%	1,48%	3,17%	8,05%	22,39%	0,15%	0,002%	0,10%
SANTANDER MASTER FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,44%	1,83%	1,31%	2,82%	7,35%	20,97%	1,00%	0,002%	0,11%
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	0,36%	2,36%	1,59%	3,70%	8,25%	23,38%	1,00%	0,154%	4,80%
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%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,41%	4,18%	2,85%	5,52%	12,49%	34,34%	0,10%	0,841%	4,43%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,36%	4,26%	2,85%	5,59%	12,51%	32,17%	0,20%	0,862%	4,43%

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
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%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,40%	3,89%	2,54%	4,88%	11,47%	25,92%	0,20%	0,481%	3,47%
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%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	0,39%	3,83%	2,50%	4,79%	11,20%	25,37%	0,40%	0,480%	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%
IPCA	0,22%	0,92%	0,63%	1,65%	2,76%	6,96%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,33%	3,62%	2,10%	4,58%	10,00%	28,41%	0,40%	0,511%	5,51%
IMA-B	-0,14%	4,79%	1,34%	4,85%	10,93%	29,34%	-	-	-
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%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	-0,14%	4,78%	1,41%	4,85%	10,52%	28,14%	0,45%	1,530%	9,29%
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%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,18%	4,77%	1,34%	4,80%	10,95%	29,73%	0,20%	1,382%	9,10%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,24%	4,67%	1,23%	4,67%	9,64%	27,83%	0,15%	1,387%	9,46%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

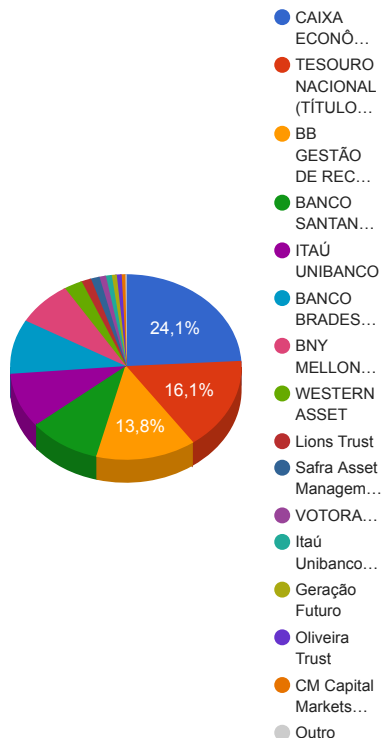
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Global BDRX	6,98%	4,52%	2,83%	11,32%	24,80%	33,97%	-	-	-
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7,64%	3,71%	2,32%	9,81%	21,09%	28,03%	1,50%	7,806%	14,40%
SMLL	2,37%	6,50%	2,07%	11,22%	32,49%	86,18%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1,07%	15,39%	5,65%	16,31%	40,15%	83,40%	2,00%	6,425%	20,07%
IPCA + 9,50% ao ano	0,98%	3,95%	2,83%	6,22%	12,44%	28,11%	-	-	-
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP	-	-	-	-	-	-	1,30%	0,650%	6,32%
Ibovespa	0,88%	12,71%	1,42%	15,89%	31,67%	59,74%	-	-	-
ARX INCOME FI AÇÕES	3,82%	20,54%	7,60%	21,62%	36,79%	68,22%	3,00%	8,262%	20,48%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	1,92%	19,80%	5,28%	20,67%	40,05%	67,94%	2,00%	7,060%	19,57%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	0,45%	11,27%	1,42%	13,55%	27,91%	56,68%	1,50%	6,629%	17,28%
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%
IPCA	0,22%	0,92%	0,63%	1,65%	2,76%	6,96%	-	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	-	-	-	-	-	-	0,00%	-	-
IDIV	-1,42%	8,80%	-0,99%	6,56%	18,46%	65,00%	-	-	-
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	2,40%	8,72%	3,07%	12,97%	25,58%	51,97%	3,00%	4,886%	15,46%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-0,61%	6,10%	0,36%	8,18%	17,39%	32,85%	1,72%	5,812%	17,20%

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

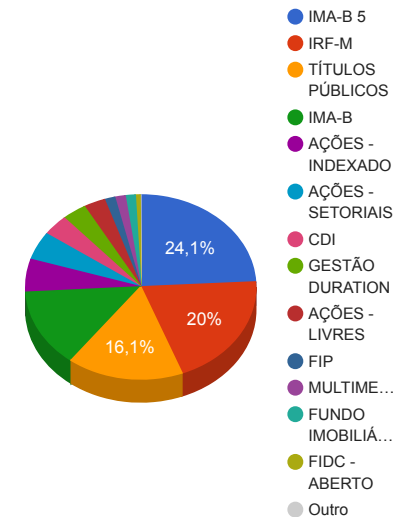
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	-1,59%	12,33%	-0,19%	11,22%	19,13%	65,62%	1,50%	6,626%	22,59%
IFIX	-0,86%	4,98%	2,28%	4,99%	14,80%	50,39%	-	-	-
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	-4,22%	7,21%	4,55%	1,82%	14,32%	45,00%	0,00%	6,540%	16,91%
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	-10,49%	-14,68%	-5,69%	-24,56%	16,97%	-7,35%	0,95%	15,899%	89,84%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA FI MULTIMERCADO	-0,59%	-0,29%	-0,10%	0,64%	-	-	0,18%	2,546%	-
Não informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	-	-	-	-	-	-	2,00%	0,039%	95,46%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	250.581.988,05	24,10%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	167.833.426,28	16,14%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	143.267.680,46	13,78%
BANCO SANTANDER	104.827.304,44	10,08%
ITAÚ UNIBANCO	99.700.964,60	9,59%
BANCO BRADESCO	99.012.334,56	9,52%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	81.797.979,70	7,87%
WESTERN ASSET	26.859.414,81	2,58%
Lions Trust	14.033.097,63	1,35%
Safra Asset Management	12.712.609,58	1,22%
VOTORANTIM ASSET MANAGEMENT	9.344.839,14	0,90%
Itaú Unibanco S.A.	8.522.165,60	0,82%
Geração Futuro	7.191.287,11	0,69%
Oliveira Trust	7.053.355,85	0,68%
CM Capital Markets DTVM	5.281.100,00	0,51%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.052.524,78	0,10%
Santander Securities Services	852.014,13	0,08%
GRADUAL INVESTIMENTOS	47.292,92	0,00%



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	251.078.751,39	24,14%
IRF-M	208.441.957,93	20,04%
TÍTULOS PÚBLICOS	167.833.426,28	16,14%
IMA-B	142.876.057,06	13,74%
AÇÕES - INDEXADO	59.777.273,96	5,75%
AÇÕES - SETORIAIS	51.381.017,29	4,94%
CDI	38.246.069,92	3,68%
GESTÃO DURATION	35.476.590,29	3,41%
AÇÕES - LIVRES	31.445.316,25	3,02%
FIP	15.356.000,47	1,48%
MULTIMERCADO	15.241.400,68	1,47%
FUNDO IMOBILIÁRIO	14.625.939,14	1,41%
FIDC - ABERTO	7.053.355,85	0,68%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.052.524,78	0,10%
FIDC - FECHADO	85.698,35	0,01%



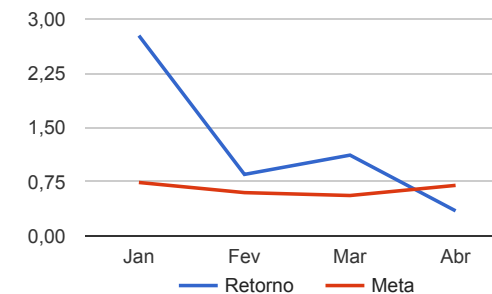
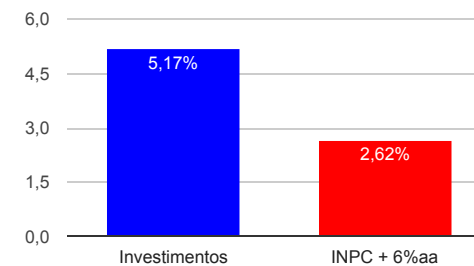
Carteira de Títulos Públicos - base (abril / 2018)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	GAP (Atual - Pago)
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/03/2015	8500	3.097,511439	3.450,468563	26.328.847,23	29.328.982,79	3.000.135,55
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/03/2015	6000	3.097,511438	3.450,468563	18.585.068,63	20.702.811,38	2.117.742,75
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/03/2015	3200	2.350,172187	3.450,468563	7.520.551,00	11.041.499,40	3.520.948,40
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	06/12/2016	3450	2.896,880939	3.450,468563	9.994.239,24	11.904.116,54	1.909.877,30
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	06/12/2016	3400	2.955,347610	3.380,040936	10.048.181,87	11.492.139,18	1.443.957,31
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	11/03/2015	7600	3.031,376224	3.374,415569	23.038.459,30	25.645.558,32	2.607.099,02
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	23/03/2015	2000	2.593,340767	3.374,415569	5.186.681,53	6.748.831,14	1.562.149,60
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	06/12/2016	3450	2.926,773673	3.376,239514	10.097.369,17	11.648.026,32	1.550.657,15
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2019	11/03/2015	8000	3.023,981475	3.276,788434	24.191.851,80	26.214.307,47	2.022.455,67
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2019	11/03/2015	4000	2.584,200138	3.276,788434	10.336.800,55	13.107.153,74	2.770.353,18

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	967.325.794,34	7.921.414,33	19.997.653,99	982.019.860,97	26.770.306,29	2,77%	0,74%	373,39%	2,44%
Fevereiro	982.019.860,97	73.502.867,19	40.700.678,25	1.023.462.107,99	8.640.058,08	0,85%	0,60%	142,41%	2,94%
Março	1.023.462.107,99	22.227.032,03	27.148.859,58	1.029.977.263,83	11.436.983,39	1,12%	0,56%	200,59%	2,18%
Abril	1.029.977.263,83	50.469.185,72	45.133.362,05	1.038.918.854,86	3.605.767,36	0,35%	0,70%	49,91%	2,02%
Acumulado no ano					50.453.115,12	5,17%	2,62%	197,23%	

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(%)
CARTÃO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	7.010.526,05	0,00	0,00	7.053.355,85	42.829,80	0,61%	0,09%	0,58%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	35.000.000,00	0,00	35.209.367,36	209.367,36	0,60%	0,84%	0,41%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES LP	7.446.771,11	0,00	0,00	7.484.410,62	37.639,51	0,51%	0,00%	0,51%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	13.867.919,84	0,00	0,00	13.937.989,49	70.069,65	0,51%	0,00%	0,51%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	47.905.749,62	0,00	0,00	48.110.616,97	204.867,35	0,43%	0,83%	0,43%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	96.103.854,05	24.769,87	0,00	96.518.225,78	389.601,86	0,41%	0,48%	0,41%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	41.109.831,36	428.077,04	0,00	41.706.139,44	168.231,04	0,41%	0,48%	0,40%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	63.361.093,78	5.449.338,81	22.000,00	69.065.310,32	276.877,73	0,40%	0,48%	0,40%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	7.017.777,92	0,00	0,00	7.045.018,36	27.240,44	0,39%	0,48%	0,39%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	36.602.373,51	0,00	0,00	36.744.057,49	141.683,98	0,39%	0,52%	0,39%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	248.214,75	210.000,00	250.048,23	209.887,58	1.721,06	0,38%	0,00%	0,51%
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	16.212.225,02	0,00	0,00	16.271.043,05	58.818,03	0,36%	0,15%	0,36%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	35.361.410,31	0,00	0,00	35.476.590,29	115.179,98	0,33%	0,51%	0,33%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	159.757.717,91	0,00	35.000.000,00	125.121.973,60	364.255,69	0,23%	0,86%	0,36%
SANTANDER MASTER FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	798.627,39	9.349.000,00	9.815.172,47	342.739,18	10.284,26	0,10%	0,00%	0,44%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	21.729.232,70	0,00	0,00	21.700.242,88	-28.989,82	-0,13%	1,34%	-0,13%
TÍTULOS PÚBLICOS	168.060.590,10	0,00	0,00	167.833.426,28	-227.163,82	-0,14%	-	-
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	12.730.088,61	0,00	0,00	12.712.609,58	-17.479,03	-0,14%	1,53%	-0,14%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	53.072.256,22	0,00	0,00	52.980.035,34	-92.220,88	-0,17%	1,34%	-0,17%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	48.418.813,42	0,00	0,00	48.330.287,58	-88.525,84	-0,18%	1,38%	-0,18%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	7.170.092,92	0,00	0,00	7.152.881,68	-17.211,24	-0,24%	1,39%	-0,24%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	39.274,64	0,00	0,00	38.405,43	-869,21	-2,21%	13,99%	-2,21%

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(%)
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	58.503,14	0,00	0,00	47.292,92	-11.210,22	-19,16%	31,50%	-19,16%
Total Renda Fixa					1.634.997,68	0,19%	0,76%	

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(%)
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	18.711.120,81	0,00	0,00	20.140.179,73	1.429.058,92	7,64%	7,81%	7,64%
ARX INCOME FI AÇÕES	23.515.726,32	0,00	0,00	24.415.180,72	899.454,40	3,82%	8,26%	3,82%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	4.557.612,24	0,00	0,00	4.666.879,03	109.266,79	2,40%	4,89%	2,40%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	6.897.543,79	0,00	0,00	7.030.135,53	132.591,74	1,92%	7,06%	1,92%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	29.104.426,28	0,00	0,00	29.414.741,37	310.315,09	1,07%	6,43%	1,07%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	6.679.878,37	0,00	0,00	6.719.235,08	39.356,71	0,59%	8,42%	0,59%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	39.458.518,48	0,00	0,00	39.637.094,23	178.575,75	0,45%	6,63%	0,45%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	14.022.737,12	0,00	0,00	14.033.097,63	10.360,51	0,07%	-	-
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP	463.515,73	8.000,00	0,00	470.888,71	-627,02	-0,13%	0,65%	0,27%
ITAÚ INSTITUCIONAL CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA FI MULTIMERCAD...	8.573.016,00	0,00	0,00	8.522.165,60	-50.850,40	-0,59%	2,55%	-0,59%
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	857.185,17	0,00	0,00	852.014,13	-5.171,04	-0,60%	0,04%	-0,60%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	7.285.780,59	0,00	0,00	7.241.545,79	-44.234,80	-0,61%	5,81%	-0,61%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	10.220.207,02	0,00	0,00	10.057.851,10	-162.355,92	-1,59%	6,63%	-1,59%
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	9.647.051,54	0,00	46.141,35	9.344.839,14	-256.071,05	-2,65%	6,54%	-4,22%
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	5.900.000,00	0,00	0,00	5.281.100,00	-618.900,00	-10,49%	15,90%	-10,49%
Total Renda Variável					1.970.769,68	1,06%	6,99%	