

Relatório Analítico dos Investimentos em julho de 2018



Carteira consolidada de investimentos - base (julho / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	30.753.834,84	13,12%	210	1,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	54.309.009,89	23,17%	709	0,74%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.361.408,36	3,57%	642	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	990.028,70	0,42%	61	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	261.351,24	0,11%	57	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	21.958.925,23	9,37%	729	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.794.784,72	2,47%	1.448	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	18.890.059,40	8,06%	694	0,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	39.292.674,25	16,77%	640	0,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.582.551,62	1,53%	294	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	869.099,24	0,37%	192	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.875.448,53	2,08%	1.257	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+0	Não há	9.439.766,26	4,03%	272	0,52%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	2.004.979,94	0,86%	145	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	10.543.360,24	4,50%	260	0,54%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	864.915,53	0,37%	783	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou D+1461	Não há	643.529,16	0,27%	17	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	6.817.234,61	2,91%	792	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	3.244,00	0,00%		0,31%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	29.621,40	0,01%	47	0,42%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.145.882,32	0,49%	21	2,99%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.022.500,45	0,44%	1.313	1,67%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

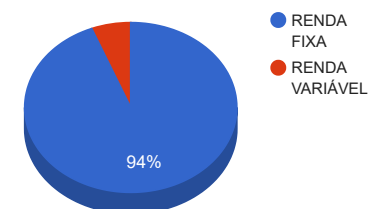
Carteira consolidada de investimentos - base (julho / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	995.559,79	0,42%	510	1,83%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	2.056.314,80	0,88%	132	1,20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	2.242.654,11	0,96%	2.531	0,99%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	1.284.394,28	0,55%	42	0,39%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	3.109.373,25	1,33%	729	1,20%	Artigo 8º, Inciso III
ÁTICO FLORESTAL MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	1.233.706,66	0,53%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	979.870,00	0,42%		0,63%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
		TOTAL -	234.356.082,82				

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

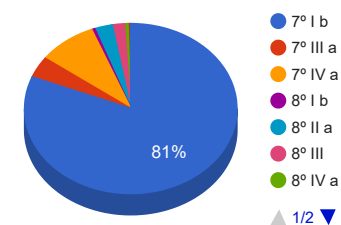
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	189.939.176,02	81,05%	40,00%	65,00%	100,00%	44.416.906,80
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	9.439.766,26	4,03%	5,00%	10,00%	20,00%	37.431.450,30
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	20.874.019,48	8,91%	10,00%	12,00%	40,00%	72.868.413,65
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	32.865,40	0,01%	0,00%	0,00%	3,00%	6.997.817,08
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	11.717.804,14
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	2,00%	4.687.121,66
Em Enquadramento - RF	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	2,00%	4.687.121,66
Total Renda Fixa	100,00%	220.285.827,16	94,00%	55,00	90,00	249,00	-

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%	0,00%	2,00%	15,00%	35.153.412,42
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	30,00%	1.145.882,32	0,49%	0,00%	0,00%	10,00%	22.289.725,96
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	6.317.029,15	2,70%	1,00%	2,00%	15,00%	28.836.383,27
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	11.717.804,14
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	4.393.767,53	1,87%	0,00%	5,00%	10,00%	19.041.840,75
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	1.233.706,66	0,53%	0,00%	1,00%	3,00%	5.796.975,82
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	979.870,00	0,42%	0,00%	1,00%	2,00%	3.707.251,66
Desenquadrado - RV	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	2,00%	4.687.121,66
Em Enquadramento - RV	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	2,00%	4.687.121,66
Total Renda Variável	30,00%	14.070.255,66	6,00%	1,00	14,00	64,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: julho / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	189.939.176,02	81,05%	40,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	9.439.766,26	4,03%	5,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	20.874.019,48	8,91%	10,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	2,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	32.865,40	0,01%	0,00%	3,00%
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%
Desenquadrado - RF	0,00	0,00%	0,00%	2,00%
Em Enquadramento - RF	0,00	0,00%	0,00%	2,00%
Total Renda Fixa	220.285.827,16	94,00%	55,00	249,00

Artigos - Renda Variável	Base: julho / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	1.145.882,32	0,49%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	6.317.029,15	2,70%	1,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso III	4.393.767,53	1,87%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	1.233.706,66	0,53%	0,00%	3,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	979.870,00	0,42%	0,00%	2,00%
Desenquadrado - RV	0,00	0,00%	0,00%	2,00%
Em Enquadramento - RV	0,00	0,00%	0,00%	2,00%
Total Renda Variável	14.070.255,66	6,00%	1,00	64,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (julho / 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	174.807.913,09	74,59%	0,04%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	47.458.447,93	20,25%	0,00%
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	5.638.866,42	2,41%	0,00%
ITAÚ UNIBANCO	3.256.359,88	1,39%	0,00%
WESTERN ASSET	1.284.394,28	0,55%	0,00%
ÁTICO ASSET MANAGEMENT	1.233.706,66	0,53%	3,26%
TMJ CAPITAL	643.529,16	0,27%	-
VILA RICA CAPITAL	29.621,40	0,01%	0,09%
BRASIL PLURAL	3.244,00	0,00%	0,00%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	2,32%	3,50%	-1,23%	0,09%	6,45%	22,38%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,30%	3,35%	-1,30%	-0,02%	6,19%	21,93%	0,20%	1,866%	4,45%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2,29%	3,46%	-1,20%	0,16%	6,41%	22,09%	0,20%	1,819%	4,34%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	1,82%	1,35%	-1,68%	-1,25%	4,92%	20,32%	1,30%	1,273%	3,76%
IRF-M 1+	1,79%	3,90%	-1,02%	2,31%	8,26%	29,52%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,94%	3,98%	-0,97%	2,29%	8,00%	29,04%	0,20%	1,816%	3,83%
IDKA IPCA 2 Anos	1,59%	4,62%	0,73%	3,82%	8,98%	24,99%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,23%	4,44%	0,67%	3,44%	8,41%	23,17%	0,20%	0,728%	2,05%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,19%	4,50%	0,60%	3,51%	8,42%	23,10%	0,20%	0,711%	2,06%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,50%	4,78%	2,44%	3,70%	7,68%	20,43%	0,20%	0,211%	0,64%
IMA-B 5	1,48%	4,33%	0,35%	2,95%	8,27%	23,13%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,46%	4,18%	0,27%	2,83%	8,03%	22,65%	0,20%	0,926%	2,58%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	1,44%	4,07%	0,24%	2,74%	7,83%	22,16%	0,40%	0,923%	2,58%
IRF-M	1,47%	3,88%	-0,36%	2,55%	8,06%	27,41%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,48%	3,78%	-0,39%	2,46%	7,83%	26,90%	0,20%	1,337%	2,79%
CDI + 3,50% ao ano	0,84%	5,82%	2,48%	4,89%	10,80%	29,00%	-	-	-
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-5,01%	-95,88%	-53,94%	-42,95%	-46,24%	-71,30%	0,20%	1,138%	988,81%

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

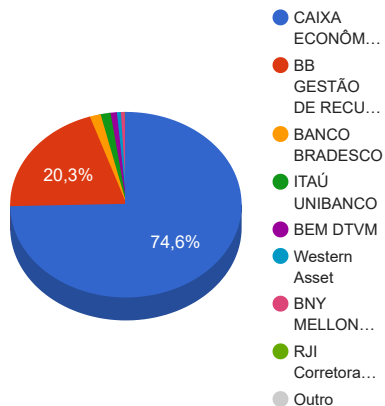
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-19,31%	-70,86%	-51,43%	-78,41%	-64,99%	-91,65%	0,39%	32,115%	111,81%
IRF-M 1	0,66%	3,76%	1,41%	3,15%	7,39%	21,86%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,68%	3,66%	1,38%	3,07%	7,21%	21,45%	0,20%	0,201%	0,49%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,68%	3,64%	1,36%	3,03%	7,15%	21,29%	0,10%	0,201%	0,50%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,66%	3,62%	1,33%	3,03%	7,14%	21,37%	0,20%	0,213%	0,50%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,64%	3,60%	1,33%	3,02%	7,13%	21,29%	0,20%	0,204%	0,49%
CDI	0,54%	3,73%	1,59%	3,13%	7,08%	20,47%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,52%	3,61%	1,53%	3,03%	6,93%	20,34%	0,20%	0,002%	0,06%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	0,52%	3,68%	1,54%	3,09%	7,11%	20,69%	0,20%	0,015%	0,08%
IPCA	0,33%	2,94%	2,00%	2,64%	4,48%	7,32%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,95%	3,42%	0,22%	2,39%	6,95%	-	0,002	0,441%	1,61%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,57%	4,48%	0,81%	2,95%	8,34%	-	0,40%	0,063%	1,66%

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

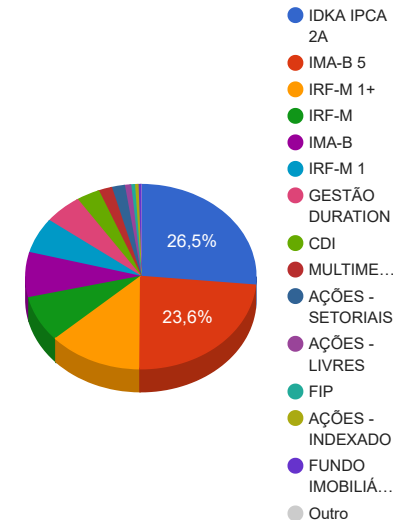
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	8,88%	3,69%	-8,01%	-6,70%	20,18%	38,24%	-	-	-
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	8,72%	3,34%	-8,04%	-6,82%	19,13%	36,64%	0,50%	7,438%	18,77%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	7,64%	9,48%	-6,88%	-2,93%	29,18%	46,03%	1,50%	8,217%	19,03%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	3,67%	-6,32%	-13,32%	-12,67%	3,47%	9,74%	2,00%	7,783%	18,37%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	1,13%	-	0,01%	3,69%	-	-	1,60%	0,856%	-
IDIV	7,27%	-0,10%	-8,17%	-9,08%	11,40%	41,60%	-	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	6,52%	-6,71%	-7,36%	-11,00%	3,71%	5,89%	1,50%	5,689%	16,35%
SMLL	5,09%	-4,38%	-10,21%	-8,35%	10,75%	39,56%	-	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	5,55%	-5,21%	-10,27%	-9,36%	10,98%	38,00%	1,50%	6,045%	17,47%
IFIX	1,37%	-3,23%	-7,82%	-5,72%	4,27%	24,10%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	6,97%	-8,42%	-6,68%	-15,89%	-10,84%	1,13%	1,20%	10,678%	22,65%
CDI	0,54%	3,73%	1,59%	3,13%	7,08%	20,47%	-	-	-
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	0,33%	5,76%	1,33%	4,60%	9,10%	23,47%	2,00%	0,559%	1,50%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ÁTICO FLORESTAL MULTIELSTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	174.807.913,09	74,59%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	47.458.447,93	20,25%
BANCO BRADESCO	3.582.551,62	1,53%
ITAÚ UNIBANCO	3.256.359,88	1,39%
BEM DTVM	2.056.314,80	0,88%
Western Asset	1.284.394,28	0,55%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	1.233.706,66	0,53%
RJI Corretora de Valores	643.529,16	0,27%
BRL Trust Investimentos	29.621,40	0,01%
Geração Futuro	3.244,00	0,00%

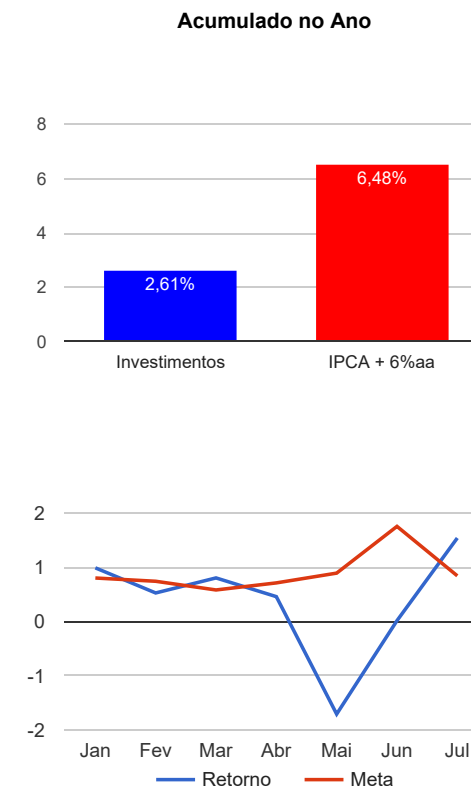


Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	62.120.698,72	26,51%
IMA-B 5	55.299.038,59	23,60%
IRF-M 1+	30.753.834,84	13,12%
IRF-M	18.890.059,40	8,06%
IMA-B	18.444.703,78	7,87%
IRF-M 1	14.514.136,11	6,19%
GESTÃO DURATION	12.548.340,18	5,35%
CDI	7.682.150,14	3,28%
MULTIMERCADO	4.393.767,53	1,87%
AÇÕES - SETORIAIS	4.260.714,35	1,82%
AÇÕES - LIVRES	2.056.314,80	0,88%
FIP	1.233.706,66	0,53%
AÇÕES - INDEXADO	1.145.882,32	0,49%
FUNDO IMOBILIÁRIO	979.870,00	0,42%
FIDC - FECHADO	32.865,40	0,01%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	218.358.197,99	3.256.598,24	584.529,28	223.211.271,45	2.181.004,50	0,99%	0,80%	123,12%	0,58%
Fevereiro	223.211.271,45	32.046.177,92	29.063.833,93	227.380.909,32	1.187.293,88	0,52%	0,74%	71,09%	0,64%
Março	227.380.909,32	5.700.509,83	3.998.503,56	230.919.074,26	1.836.158,67	0,80%	0,58%	138,87%	0,60%
Abril	230.919.074,26	131.368.431,63	130.651.708,81	232.694.872,29	1.059.075,21	0,46%	0,71%	64,59%	0,84%
Mai	232.694.872,29	1.685.173,82	1.066.270,58	229.336.706,31	-3.977.069,22	-1,70%	0,89%	-191,81%	1,71%
Junho	229.336.706,31	1.804.315,46	1.051.639,34	230.123.823,29	34.440,86	0,01%	1,75%	0,85%	3,02%
Julho	230.123.823,29	9.361.449,78	8.674.997,13	234.356.082,82	3.545.806,88	1,54%	0,84%	182,52%	1,22%
Acumulado no ano					5.866.710,78	2,61%	6,48%	40,36%	



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)	
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.173.242,03	0,00	0,00	8.361.408,36	188.166,33	2,30%	1,87%	2,30%	
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	9.228.072,32	0,00	0,00	9.439.766,26	211.693,94	2,29%	1,82%	2,29%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	34.132.560,93	0,00	4.000.000,00	30.753.834,84	621.273,91	1,82%	1,82%	1,94%	
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	632.053,88	0,00	0,00	643.529,16	11.475,28	1,82%	1,27%	1,82%	
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	18.613.991,64	0,00	0,00	18.890.059,40	276.067,76	1,48%	1,34%	1,48%	
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	53.526.518,84	0,00	0,00	54.309.009,89	782.491,05	1,46%	0,93%	1,46%	
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	975.978,38	0,00	0,00	990.028,70	14.050,32	1,44%	0,92%	1,44%	
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	21.691.329,56	0,00	0,00	21.958.925,23	267.595,67	1,23%	0,73%	1,23%	
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	38.830.855,74	0,00	0,00	39.292.674,25	461.818,51	1,19%	0,71%	1,19%	
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	10.444.320,37	0,00	0,00	10.543.360,24	99.039,87	0,95%	0,44%	0,95%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.755.444,29	0,00	0,00	5.794.784,72	39.340,43	0,68%	0,20%	0,68%	
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.842.730,79	0,00	0,00	4.875.448,53	32.717,74	0,68%	0,20%	0,68%	
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	259.682,79	0,00	0,00	261.351,24	1.668,45	0,64%	0,20%	0,64%	
BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	3.560.106,59	0,00	3.582.551,62	22.445,03	0,63%	0,21%	0,66%	
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	860.435,38	0,00	0,00	864.915,53	4.480,15	0,52%	0,02%	0,52%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	864.741,57	0,00	0,00	869.099,24	4.357,67	0,50%	0,21%	0,50%	
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	6.088.947,19	1.801.343,19	1.107.890,54	6.817.234,61	34.834,77	0,44%	0,00%	0,52%	
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,00	2.000.000,00	0,00	2.004.979,94	4.979,94	0,25%	0,06%	0,57%	
BRADERCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	3.559.363,03	0,00	3.560.106,59	0,00	743,56	0,02%	-	-	
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	3.415,12	0,00	0,00	3.244,00	-171,12	-5,01%	1,14%	-5,01%	
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	36.707,95	0,00	0,00	29.621,40	-7.086,55	-19,31%	32,11%	-19,31%	
Total Renda Fixa						3.071.982,71	1,41%	0,99%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	1.053.938,16	0,00	0,00	1.145.882,32	91.944,16	8,72%	7,44%	8,72%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	916.000,00	0,00	7.000,00	979.870,00	70.870,00	7,74%	10,68%	6,97%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	959.880,48	0,00	0,00	1.022.500,45	62.619,97	6,52%	5,69%	6,52%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	2.124.754,40	0,00	0,00	2.242.654,11	117.899,71	5,55%	6,05%	5,55%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	960.354,51	0,00	0,00	995.559,79	35.205,28	3,67%	7,78%	3,67%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.056.314,80	56.314,80	2,82%	8,22%	7,64%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	3.074.652,25	0,00	0,00	3.109.373,25	34.721,00	1,13%	0,86%	1,13%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1.280.145,03	0,00	0,00	1.284.394,28	4.249,25	0,33%	0,56%	0,33%
ÁTICO FLORESTAL MULTIELABORATÓRIA FIP	1.233.706,66	0,00	0,00	1.233.706,66	0,00	0,00%	-	-
Total Renda Variável					473.824,17	3,48%	5,17%	