

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



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

Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			389.483,29	1,26%			Artigo 20
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	3.002.911,71	9,69%	273	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	D+0	15/08/2024	666.510,00	2,15%	96	0,57%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	922.783,50	2,98%	223	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	372.447,08	1,20%	107	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	498.528,45	1,61%	18	0,95%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	261.162,55	0,84%	192	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2018	1.351.201,00	4,36%	163	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	816.822,69	2,64%	143	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	851.792,91	2,75%	93	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.665.829,32	8,60%	221	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	D+1	Não há	4.099.894,84	13,23%	316	1,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.951.667,95	12,76%	95	2,17%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+0	Não há	108.882,45	0,35%	130	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	427.987,47	1,38%	25	0,35%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	4.646.888,84	15,00%	765	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.031.407,40	9,78%	211	0,34%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BANRISUL ÍNDICE FI AÇÕES	D+4	Não há	66.179,49	0,21%	431	0,64%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	725.487,64	2,34%	25	1,23%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB PETROBRAS FI AÇÕES	D+4	Não há	38.096,20	0,12%	56.680	0,01%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	135.851,22	0,44%	42	0,18%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	467.243,61	1,51%	122	0,12%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

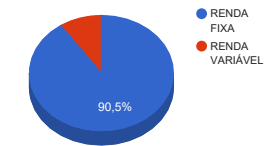
Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BANRISUL INFRA-ESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	32.542,95	0,11%	614	0,25%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB CONSUMO FIC AÇÕES	D+4	Não há	55.468,95	0,18%	2.662	0,05%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
GERAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	131.621,81	0,42%	2.019	0,09%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVSPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	513.696,50	1,66%	729	0,20%	Artigo 8º, Inciso III
BRS PARTICIPAÇÕES FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	4 anos	140.179,82	0,45%	33	0,13%	Artigo 8º, Inciso III
AGÊNCIAS CAIXA FII - AGCX11	Não se aplica	Não se aplica	106.000,00	0,34%		0,02%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	91.600,00	0,30%		0,06%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
BANRISUL NOVAS FRONTEIRAS FII - BNFS11	Não se aplica	Não se aplica	410.480,00	1,32%		0,52%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
		TOTAL -	30.980.649,64				

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

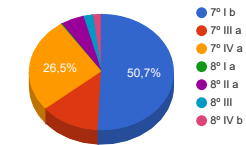
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	15.509.884,05	50,06%	25,00%	35,00%	60,00%	3.078.505,73
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.549.032,48
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	4.060.550,40	13,11%	15,00%	35,00%	50,00%	11.429.774,42
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	8.106.283,71	26,17%	5,00%	20,00%	30,00%	1.187.911,18
Total Renda Fixa	100,00%	27.676.718,16	89,34%	45,00	95,00	245,00	-

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%	66.179,49	0,21%	0,00%	0,00%	5,00%	1.482.852,99
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	1.586.312,38	5,12%	0,00%	0,00%	5,00%	-37.279,90
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	653.876,32	2,11%	5,00%	8,00%	10,00%	2.444.188,64
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	1.549.032,48
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	608.080,00	1,96%	0,00%	2,00%	5,00%	940.952,48
Total Renda Variável	30,00%	2.914.448,19	9,41%	5,00	12,00	40,00	-

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 "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	15.509.884,05	50,06%	25,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	4.060.550,40	13,11%	15,00%	50,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	50,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	8.106.283,71	26,17%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	27.676.718,16	89,34%	45,00	245,00

Artigos - Renda Variável	Base: junho / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	66.179,49	0,21%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	1.586.312,38	5,12%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso III	653.876,32	2,11%	5,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	608.080,00	1,96%	0,00%	5,00%
Total Renda Variável	2.914.448,19	9,41%	5,00	40,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (junho / 2018)

Artigo 14º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	11.062.974,69	35,71%	0,00%
BANRISUL CORRETORA	8.925.677,68	28,81%	0,09%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	8.919.001,27	28,79%	0,00%
AUSTRO CAPITAL	568.167,29	1,83%	0,10%
VINCI PARTNERS	467.243,61	1,51%	0,00%
OLIVEIRA TRUST	410.480,00	1,32%	0,01%
GERAÇÃO FUTURO	131.621,81	0,42%	0,00%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	106.000,00	0,34%	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 + 6,00% ao ano	1,75%	5,59%	3,38%	5,59%	10,58%	20,70%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,39%	5,38%	2,81%	5,38%	10,06%	21,04%	0,20%	0,272%	0,37%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,38%	2,44%	2,76%	2,44%	3,88%	7,60%	0,20%	0,273%	3,91%
IPCA	1,26%	2,60%	1,89%	2,60%	4,39%	7,52%	-	-	-
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	1,39%	2,43%	2,81%	2,43%	3,95%	7,94%	0,15%	0,260%	3,99%
CDI	0,52%	3,17%	1,56%	3,17%	7,35%	21,15%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,50%	3,07%	1,52%	3,07%	7,21%	21,04%	0,20%	0,014%	0,08%
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%
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	0,26%	3,07%	0,05%	3,07%	9,50%	22,91%	0,20%	2,593%	2,10%
IMA Geral	0,12%	2,44%	-0,99%	2,44%	8,47%	23,90%	-	-	-
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	0,13%	2,35%	-0,98%	2,35%	8,23%	23,93%	0,20%	2,037%	2,22%
IMA Geral ex-C	0,10%	2,30%	-1,06%	2,30%	8,26%	24,11%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,19%	2,55%	-0,93%	2,55%	8,41%	-	0,30%	2,067%	2,47%
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 X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,14%	2,43%	-2,08%	2,43%	9,77%	24,23%	0,20%	4,188%	3,75%

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 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%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,32%	1,17%	-3,51%	1,17%	7,79%	21,87%	0,35%	3,653%	4,38%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,40%	1,00%	-3,70%	1,00%	8,02%	22,57%	0,30%	3,869%	4,53%
AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	-0,53%	2,40%	-2,90%	2,40%	6,32%	15,03%	0,30%	3,173%	4,02%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,97%	-2,34%	-5,17%	-2,34%	1,45%	8,63%	0,20%	4,999%	6,27%
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%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

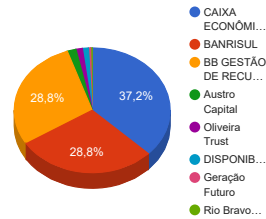
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA	1,26%	2,60%	1,89%	2,60%	4,39%	7,52%	-	-	-
BRS PARTICIPAÇÕES FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,34%	-1,24%	-0,93%	-1,24%	12,74%	4,64%	1,50%	0,210%	15,95%
PETROBRAS PN - PETR4	-9,43%	6,98%	-19,55%	6,98%	39,24%	82,85%	-	-	-
BB PETROBRAS FI AÇÕES	-11,82%	11,29%	-18,03%	11,29%	41,86%	66,01%	2,00%	34,174%	44,89%
Ibovespa	-5,20%	-4,76%	-14,76%	-4,76%	15,68%	41,22%	-	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	-0,28%	-	-0,58%	-	-	-	1,60%	2,646%	-
GERAÇÃO FI AÇÕES	-3,07%	-2,75%	-12,35%	-2,75%	1,84%	19,18%	3,00%	9,984%	17,68%
BB PIPE FIC AÇÕES	-4,14%	-19,03%	-17,32%	-19,03%	-3,80%	7,10%	1,20%	11,544%	17,12%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-4,84%	-3,11%	-12,48%	-3,11%	17,31%	33,05%	1,00%	10,717%	18,07%
BANRISUL ÍNDICE FI AÇÕES	-5,59%	-1,63%	-13,37%	-1,63%	18,11%	41,30%	0,85%	11,068%	17,90%
IBX	-5,19%	-5,23%	-14,85%	-5,23%	14,67%	40,34%	-	-	-
BANRISUL INFRA-ESTRUTURA FI AÇÕES	-4,70%	9,23%	-2,48%	9,23%	30,25%	52,24%	2,50%	8,109%	15,86%
ICON	-4,55%	-18,21%	-15,77%	-18,21%	1,50%	11,51%	-	-	-
BB CONSUMO FIC AÇÕES	-4,47%	-18,37%	-15,90%	-18,37%	0,33%	8,69%	1,00%	11,400%	17,12%
IDIV	-4,33%	-6,87%	-15,61%	-6,87%	8,85%	48,78%	-	-	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-5,34%	-10,19%	-15,87%	-10,19%	2,90%	13,47%	1,72%	11,096%	16,19%
IFIX	-4,01%	-4,55%	-9,85%	-4,55%	2,46%	29,73%	-	-	-

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
AGÊNCIAS CAIXA FII - AGCX11	-8,30%	-15,34%	-15,67%	-15,34%	-21,31%	-	0,35%	8,497%	20,78%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-11,75%	-14,39%	-21,03%	-14,39%	-14,39%	-1,51%	1,20%	11,050%	23,25%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BANRISUL NOVAS FRONTEIRAS FII - BNFS11	-4,11%	-6,67%	-8,94%	-6,67%	-3,03%	9,38%	0,40%	14,439%	28,04%

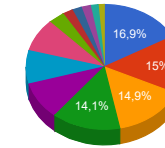
Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (junho / 2018)

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	11.530.218,30	37,22%
BANRISUL	8.925.677,68	28,81%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	8.919.001,27	28,79%
Austro Capital	568.167,29	1,83%
Oliveira Trust	410.480,00	1,32%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	389.483,29	1,26%
Geração Futuro	131.621,81	0,42%
Rio Bravo Investimentos	106.000,00	0,34%



- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
- BANRISUL
- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- Austro Capital
- Oliveira Trust
- DISPONIBILIDADE FINANCEIRA
- Geração Futuro
- Rio Bravo Investimentos

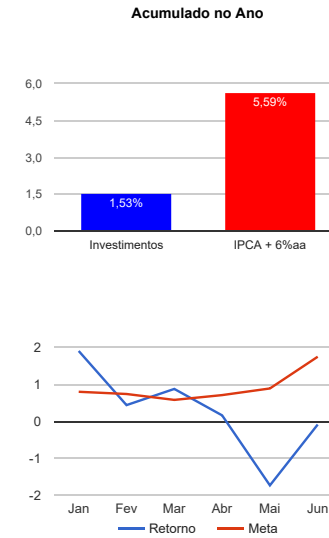
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	5.236.892,92	16,90%
CDI	4.646.888,84	15,00%
IMA-GERAL	4.618.177,95	14,91%
IDKA IPCA 2A	4.361.057,39	14,08%
IMA-GERAL EX-C	3.002.911,71	9,69%
IRF-M 1+	2.665.829,32	8,60%
IMA-B 5	2.646.431,58	8,54%
AÇÕES - LIVRES	1.059.140,16	3,42%
MULTIMERCADO	653.876,32	2,11%
FUNDO IMOBILIÁRIO	608.080,00	1,96%
AÇÕES - SETORIAIS	593.351,71	1,92%
IMA-B 5+	498.528,45	1,61%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	389.483,29	1,26%



- IMA-B
- CDI
- IMA-GERAL
- IDKA IPCA 2A
- IMA-GERAL EX-C
- IRF-M 1+
- IMA-B 5
- AÇÕES - LIVRES
- MULTIMERCADO
- FUNDO IMOBILIÁRIO
- AÇÕES - SETORIAIS
- IMA-B 5+
- DISPONIBILIDADE FINANCEIRA

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	29.745.826,63	560.087,84	515.000,00	30.358.501,08	567.586,61	1,91%	0,80%	237,72%	1,45%
Fevereiro	30.358.501,08	252.814,24	154.400,64	30.590.532,31	133.617,63	0,44%	0,74%	59,41%	2,01%
Março	30.590.532,31	229.461,16	56.800,00	31.033.016,07	269.822,60	0,88%	0,58%	151,96%	1,25%
Abril	31.033.016,07	42.943,21	17.400,00	31.108.489,42	49.930,14	0,16%	0,71%	22,71%	1,23%
Mai	31.108.489,42	164.000,00	549.442,29	30.182.797,02	-540.250,11	-1,74%	0,89%	-195,42%	2,12%
Junho	30.182.797,02	2.650.000,00	2.214.696,45	30.591.166,35	-26.934,22	-0,09%	1,75%	-5,02%	2,80%
Acumulado no ano					453.772,65	1,53%	5,59%	27,39%	



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(%)
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	657.370,00	0,00	0,00	666.510,00	9.140,00	1,39%	0,26%	1,39%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	805.628,40	0,00	0,00	816.822,69	11.194,29	1,39%	0,27%	1,39%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.332.853,00	0,00	0,00	1.351.201,00	18.348,00	1,38%	0,27%	1,38%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	912.485,25	0,00	0,00	922.783,50	10.298,25	1,13%	0,52%	1,13%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	258.272,53	0,00	0,00	261.162,55	2.890,02	1,12%	0,52%	1,12%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	2.650.000,00	0,00	2.665.829,32	15.829,32	0,60%	3,89%	-0,15%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.623.729,23	0,00	0,00	4.646.888,84	23.159,61	0,50%	0,01%	0,50%
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	4.089.122,61	0,00	0,00	4.099.894,84	10.772,23	0,26%	2,59%	0,26%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.997.202,14	0,00	0,00	3.002.911,71	5.709,57	0,19%	2,07%	0,19%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	850.561,78	0,00	0,00	851.792,91	1.231,13	0,14%	4,19%	0,14%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	3.982.125,55	0,00	35.500,00	3.951.667,95	5.042,40	0,13%	2,04%	0,13%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	372.073,11	0,00	0,00	372.447,08	373,97	0,10%	2,71%	0,10%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2.177.155,51	0,00	2.179.196,45	0,00	2.040,94	0,09%	3,80%	-0,36%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III FI RENDA FIXA REFERENCIAD...	109.228,48	0,00	0,00	108.882,45	-346,03	-0,32%	3,65%	-0,32%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.043.588,12	0,00	0,00	3.031.407,40	-12.180,72	-0,40%	3,87%	-0,40%
AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	430.277,59	0,00	0,00	427.987,47	-2.290,12	-0,53%	3,17%	-0,53%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	503.432,65	0,00	0,00	498.528,45	-4.904,20	-0,97%	5,00%	-0,97%
Total Renda Fixa					96.308,66	0,35%	2,07%	

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(%)
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	515.048,00	0,00	0,00	513.696,50	-1.351,50	-0,26%	2,65%	-0,26%
BRS PARTICIPAÇÕES FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	140.663,09	0,00	0,00	140.179,82	-483,27	-0,34%	0,21%	-0,34%
GERAÇÃO FI AÇÕES	135.795,53	0,00	0,00	131.621,81	-4.173,72	-3,07%	9,98%	-3,07%
BANRISUL NOVAS FRONTEIRAS FII - BNFS11	428.072,00	0,00	0,00	410.480,00	-17.592,00	-4,11%	14,44%	-4,11%
BB PIPE FIC AÇÕES	756.855,21	0,00	0,00	725.487,64	-31.367,57	-4,14%	11,54%	-4,14%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	58.067,02	0,00	0,00	55.468,95	-2.598,07	-4,47%	11,40%	-4,47%
BANRISUL INFRA-ESTRUTURA FI AÇÕES	34.148,15	0,00	0,00	32.542,95	-1.605,20	-4,70%	8,11%	-4,70%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	142.757,84	0,00	0,00	135.851,22	-6.906,62	-4,84%	10,72%	-4,84%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	493.581,83	0,00	0,00	467.243,61	-26.338,22	-5,34%	11,10%	-5,34%
BANRISUL ÍNDICE FI AÇÕES	70.097,21	0,00	0,00	66.179,49	-3.917,72	-5,59%	11,07%	-5,59%
AGÊNCIAS CAIXA FII - AGCX11	115.600,00	0,00	0,00	106.000,00	-9.600,00	-8,30%	8,50%	-8,30%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	103.800,00	0,00	0,00	91.600,00	-12.200,00	-11,75%	11,05%	-11,75%
BB PETROBRAS FI AÇÕES	43.205,19	0,00	0,00	38.096,20	-5.108,99	-11,82%	34,17%	-11,82%
				Total Renda Variável	-123.242,88	-4,06%	9,78%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2018

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.877.646,64	196.000,00	500.000,00	4.646.888,84	73.242,20	1,51%	1,52%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.314.902,00	0,00	0,00	1.351.201,00	36.299,00	2,76%	2,76%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	794.492,32	0,00	0,00	816.822,69	22.330,37	2,81%	2,81%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	901.503,00	0,00	0,00	922.783,50	21.280,50	2,36%	2,36%
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	648.320,00	0,00	0,00	666.510,00	18.190,00	2,81%	2,81%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	2.650.000,00	0,00	2.665.829,32	15.829,32	0,60%	-2,56%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	255.180,55	0,00	0,00	261.162,55	5.982,00	2,34%	2,34%
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	4.098.925,64	0,00	1.000,00	4.098.894,84	1.969,20	0,05%	0,05%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	371.664,84	0,00	0,00	372.447,08	782,24	0,21%	0,21%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III FI RENDA FIXA REFERENCIAD...	114.123,51	1.468,49	2.736,05	108.882,45	-3.973,50	-3,45%	-3,51%
AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	440.788,19	0,00	0,00	427.987,47	-12.800,72	-2,90%	-2,90%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	869.902,53	0,00	0,00	851.792,91	-18.109,62	-2,08%	-2,08%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	525.705,25	0,00	0,00	498.528,45	-27.176,80	-5,17%	-5,17%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.031.127,89	0,00	0,00	3.002.911,71	-28.216,18	-0,93%	-0,93%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	4.090.245,80	0,00	98.606,24	3.951.667,95	-39.971,61	-0,98%	-0,98%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2.249.108,09	0,00	2.179.196,45	0,00	-69.911,64	-3,11%	-3,55%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.138.241,34	9.474,72	0,00	3.031.407,40	-116.308,66	-3,70%	-3,70%
				Total Renda Fixa	-120.563,90	-0,44%	

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 (%)
BANRISUL INFRA-ESTRUTURA FI AÇÕES	33.369,85	0,00	0,00	32.542,95	-826,90	-2,48%	-2,48%
BRS PARTICIPAÇÕES FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	141.497,94	0,00	0,00	140.179,82	-1.318,12	-0,93%	-0,93%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	516.699,50	0,00	0,00	513.696,50	-3.003,00	-0,58%	-0,58%
BB PETROBRAS FI AÇÕES	46.474,35	0,00	0,00	38.096,20	-8.378,15	-18,03%	-18,03%
BANRISUL ÍNDICE FI AÇÕES	76.388,92	0,00	0,00	66.179,49	-10.209,43	-13,37%	-13,37%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	65.959,79	0,00	0,00	55.468,95	-10.490,84	-15,90%	-15,90%
GERAÇÃO FI AÇÕES	150.159,29	0,00	0,00	131.621,81	-18.537,48	-12,35%	-12,35%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	155.223,93	0,00	0,00	135.851,22	-19.372,71	-12,48%	-12,48%
AGÊNCIAS CAIXA FII - AGCX11	125.700,00	0,00	0,00	106.000,00	-19.700,00	-15,67%	-15,67%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	116.000,00	0,00	0,00	91.600,00	-24.400,00	-21,03%	-21,03%
BANRISUL NOVAS FRONTEIRAS FII - BNFS11	450.795,00	0,00	0,00	410.480,00	-40.315,00	-8,94%	-8,94%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	555.364,69	0,00	0,00	467.243,61	-88.121,08	-15,87%	-15,87%
BB PIPE FIC AÇÕES	877.505,22	0,00	0,00	725.487,64	-152.017,58	-17,32%	-17,32%
				Total Renda Variável	-396.690,29	-11,98%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 2018

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.135.502,12	364.000,00	1.000.000,00	4.646.888,84	147.386,72	3,04%	3,07%
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	4.049.052,56	0,00	72.800,00	4.099.894,84	123.642,28	3,06%	3,07%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	3.957.082,41	0,00	98.606,24	3.951.667,95	93.191,78	2,35%	2,35%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.868.629,56	60.087,84	0,00	3.002.911,71	74.194,31	2,53%	2,55%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.319.062,00	0,00	36.214,42	1.351.201,00	68.353,42	5,28%	2,44%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	797.578,48	0,00	22.793,26	816.822,69	42.037,47	5,37%	5,38%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	909.168,75	0,00	24.511,60	922.783,50	38.126,35	4,27%	1,50%
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	650.675,00	0,00	18.431,16	666.510,00	34.266,16	5,37%	2,43%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.923.752,90	81.135,88	0,00	3.031.407,40	26.518,62	0,99%	1,00%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.914.643,75	239.814,24	2.179.196,45	0,00	24.738,46	1,55%	1,14%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	853.776,21	0,00	22.642,52	851.792,91	20.659,22	2,42%	2,43%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	2.650.000,00	0,00	2.665.829,32	15.829,32	0,60%	2,00%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	369.124,14	0,00	9.597,95	372.447,08	12.920,89	3,55%	0,90%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	257.709,52	0,00	7.275,94	261.162,55	10.728,97	4,25%	4,25%
AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	418.352,58	0,00	0,00	427.987,47	9.634,89	2,30%	2,40%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III FI RENDA FIXA REFERENCIAD...	106.155,45	4.268,49	2.736,05	108.882,45	1.194,56	1,23%	1,17%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	510.490,40	0,00	12.933,79	498.528,45	971,84	0,08%	-2,34%
Total Renda Fixa					744.395,26	2,76%	

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 (%)
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	0,00	500.000,00	0,00	513.696,50	13.696,50	2,74%	-
BB PETROBRAS FI AÇÕES	34.232,59	0,00	0,00	38.096,20	3.863,61	11,29%	11,29%
BANRISUL INFRA-ESTRUTURA FI AÇÕES	29.793,32	0,00	0,00	32.542,95	2.749,63	9,23%	9,23%
BANRISUL ÍNDICE FI AÇÕES	67.278,56	0,00	0,00	66.179,49	-1.099,07	-1,63%	-1,63%
BRS PARTICIPAÇÕES FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	141.939,06	0,00	0,00	140.179,82	-1.759,24	-1,24%	-1,24%
GERAÇÃO FI AÇÕES	135.343,19	0,00	0,00	131.621,81	-3.721,38	-2,75%	-2,75%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	140.208,59	0,00	0,00	135.851,22	-4.357,37	-3,11%	-3,11%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	67.954,65	0,00	0,00	55.468,95	-12.485,70	-18,37%	-18,37%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	107.000,00	0,00	0,00	91.600,00	-15.400,00	-14,39%	-14,39%
AGÊNCIAS CAIXA FII - AGCX11	125.212,00	0,00	0,00	106.000,00	-19.212,00	-15,34%	-15,34%
BANRISUL NOVAS FRONTEIRAS FII - BNFS11	439.800,00	0,00	0,00	410.480,00	-29.320,00	-6,67%	-6,67%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	520.279,23	0,00	0,00	467.243,61	-53.035,62	-10,19%	-10,19%
BB PIPE FIC AÇÕES	896.029,61	0,00	0,00	725.487,64	-170.541,97	-19,03%	-19,03%
				Total Renda Variável	-290.622,61	-9,07%	