

Relatório Analítico dos Investimentos em maio 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 (maio / 2018)

| Produto / Fundo | Disponibilidade Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Qtde. Cotistas | % S/ PL Fundo | RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604 |
|--|-------------------------|------------|--------------|--------------------|----------------|---------------|-------------------------------------|
| DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS | | | 701.487,98 | 2,27% | | | Artigo 20 |
| CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | D+0 | 16/08/2020 | 372.073,11 | 1,20% | 107 | 0,04% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP | D+0 | 15/08/2024 | 657.370,00 | 2,13% | 96 | 0,57% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | D+0 | 15/08/2018 | 912.485,25 | 2,95% | 223 | 0,03% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | 15/08/2024 | 850.561,78 | 2,75% | 94 | 0,17% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | D+0 | 16/08/2018 | 1.332.853,00 | 4,32% | 163 | 0,10% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | D+0 | 15/08/2030 | 503.432,65 | 1,63% | 18 | 0,95% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | 15/08/2024 | 805.628,40 | 2,61% | 143 | 0,08% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | 15/08/2018 | 258.272,53 | 0,84% | 192 | 0,07% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA | D+1 | Não há | 4.089.122,61 | 13,24% | 336 | 0,97% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+3 | Não há | 2.997.202,14 | 9,70% | 262 | 0,10% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP | D+0 | Não há | 2.177.155,51 | 7,05% | 300 | 0,10% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " |
| BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 3.982.125,55 | 12,89% | 96 | 1,96% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | D+0 | Não há | 4.623.729,23 | 14,97% | 712 | 0,07% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA | D+4 | Não há | 430.277,59 | 1,39% | 25 | 0,35% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP | D+0 | Não há | 109.228,48 | 0,35% | 134 | 0,04% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+1 | Não há | 3.043.588,12 | 9,85% | 226 | 0,31% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| BANRISUL ÍNDICE FI AÇÕES | D+4 | Não há | 70.097,21 | 0,23% | 432 | 0,62% | Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a " |
| BB PIPE FIC AÇÕES | D+4 | 03/06/2018 | 756.855,21 | 2,45% | 33 | 1,00% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " |
| GERAÇÃO FI AÇÕES | D+4 | Não há | 135.795,53 | 0,44% | 2.060 | 0,09% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " |
| BANRISUL INFRA-ESTRUTURA FI AÇÕES | D+4 | Não há | 34.148,15 | 0,11% | 619 | 0,21% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " |
| CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES | D+33 | 23/08/2017 | 493.581,83 | 1,60% | 123 | 0,12% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " |

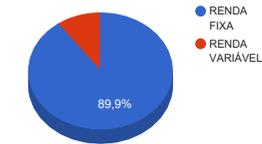
Carteira consolidada de investimentos - base (maio / 2018)

| Produto / Fundo | Disponibilidade Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Qtde. Cotistas | % S/ PL Fundo | RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604 |
|---|-------------------------|----------------|----------------------|--------------------|----------------|---------------|------------------------------------|
| BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO | D+4 | Não há | 142.757,84 | 0,46% | 39 | 0,19% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " |
| BB CONSUMO FIC AÇÕES | D+4 | Não há | 58.067,02 | 0,19% | 2.761 | 0,05% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " |
| BB PETROBRAS FI AÇÕES | D+4 | Não há | 43.205,19 | 0,14% | 55.647 | 0,01% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " |
| BRS PARTICIPAÇÕES FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO | D+1 | 4 anos | 140.663,09 | 0,46% | 33 | 0,13% | Artigo 8º, Inciso III |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO | D+2 | 02/01/2020 | 515.048,00 | 1,67% | 729 | 0,20% | Artigo 8º, Inciso III |
| BANRISUL NOVAS FRONTEIRAS FII - BNFS11 | Não se aplica | Não se aplica | 428.072,00 | 1,39% | | 0,52% | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b " |
| AGÊNCIAS CAIXA FII - AGCX11 | Não se aplica | Não se aplica | 115.600,00 | 0,37% | | 0,02% | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b " |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 | Não se aplica | Não se aplica | 103.800,00 | 0,34% | | 0,06% | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b " |
| | | TOTAL - | 30.884.285,00 | | | | |

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

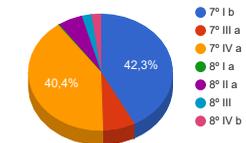
| Artigos - Renda Fixa | Resolução % | Carteira \$ | Carteira % | Estratégia de Alocação | | | GAP Superior |
|-------------------------------------|----------------|----------------------|---------------|------------------------|--------------|---------------|---------------|
| | | | | Inferior % | Alvo % | Superior % | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " | 100,00% | 12.779.001,47 | 41,38% | 25,00% | 35,00% | 60,00% | 5.751.569,53 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c " | 100,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 5,00% | 1.544.214,25 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 60,00% | 2.177.155,51 | 7,05% | 15,00% | 35,00% | 50,00% | 13.264.986,99 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " | 40,00% | 12.188.948,97 | 39,47% | 5,00% | 20,00% | 30,00% | -2.923.663,47 |
| Total Renda Fixa | 100,00% | 27.145.105,95 | 87,89% | 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% | 70.097,21 | 0,23% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 1.474.117,04 |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " | 20,00% | 1.664.410,77 | 5,39% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | -120.196,52 |
| Artigo 8º, Inciso III | 10,00% | 655.711,09 | 2,12% | 5,00% | 8,00% | 10,00% | 2.432.717,41 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a " | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 2,00% | 5,00% | 1.544.214,25 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b " | 5,00% | 647.472,00 | 2,10% | 0,00% | 2,00% | 5,00% | 896.742,25 |
| Total Renda Variável | 30,00% | 3.037.691,07 | 9,84% | 5,00 | 12,00 | 40,00 | - |

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

| Artigos - Renda Fixa | Base: maio / 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 " | 12.779.001,47 | 41,38% | 25,00% | 60,00% |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c " | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 2.177.155,51 | 7,05% | 15,00% | 50,00% |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b " | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 50,00% |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " | 12.188.948,97 | 39,47% | 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 | 27.145.105,95 | 87,89% | 45,00 | 245,00 |

| Artigos - Renda Variável | Base: maio / 2018 | | Limite Inferior (%) | Limite Superior (%) |
|------------------------------------|---------------------|--------------|---------------------|---------------------|
| | Carteira (\$) | Carteira (%) | | |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a " | 70.097,21 | 0,23% | 0,00% | 5,00% |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b " | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " | 1.664.410,77 | 5,39% | 0,00% | 5,00% |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b " | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% |
| Artigo 8º, Inciso III | 655.711,09 | 2,12% | 5,00% | 10,00% |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a " | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b " | 647.472,00 | 2,10% | 0,00% | 5,00% |
| Total Renda Variável | 3.037.691,07 | 9,84% | 5,00 | 40,00 |

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (maio / 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 | 10.540.576,75 | 34,13% | 0,00% |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 8.956.138,23 | 29,00% | 0,00% |
| BANRISUL CORRETORA | 8.942.092,00 | 28,95% | 0,09% |
| AUSTRO CAPITAL | 570.940,68 | 1,85% | 0,10% |
| VINCI PARTNERS | 493.581,83 | 1,60% | 0,00% |
| OLIVEIRA TRUST | 428.072,00 | 1,39% | 0,01% |
| GERAÇÃO FUTURO | 135.795,53 | 0,44% | 0,00% |
| RIO BRAVO INVESTIMENTOS | 115.600,00 | 0,37% | 0,01% |

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

| | Mês | Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|--|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| IPCA + 6,00% ao ano | 0,89% | 3,77% | 2,19% | 4,71% | 8,95% | 19,64% | - | - | - |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,72% | 3,94% | 2,16% | 4,68% | 9,09% | 20,75% | 0,20% | 0,105% | 0,34% |
| CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,69% | 1,05% | 2,11% | 1,76% | 2,96% | 7,32% | 0,20% | 0,106% | 3,90% |
| CDI | 0,52% | 2,64% | 1,57% | 3,19% | 7,66% | 21,92% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,50% | 2,56% | 1,53% | 3,10% | 7,55% | 21,83% | 0,20% | 0,005% | 0,09% |
| IPCA | 0,40% | 1,33% | 0,71% | 1,77% | 2,85% | 6,55% | - | - | - |
| BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP | 0,71% | 1,03% | 2,15% | 1,75% | 3,03% | 7,67% | 0,15% | 0,099% | 4,01% |
| IMA-B | -3,16% | 1,48% | -2,39% | 2,32% | 8,72% | 25,38% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,80% | 0,36% | 1,80% | 0,72% | 2,60% | 8,54% | 0,20% | 0,271% | 3,90% |
| CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | -0,81% | 0,80% | 1,75% | 1,86% | 5,50% | 12,66% | 0,20% | 1,061% | 3,99% |
| AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA | -2,24% | 2,95% | -1,32% | 2,73% | 7,19% | 20,16% | 0,30% | 1,639% | 3,56% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | -2,45% | 2,28% | -0,27% | 3,20% | 9,99% | 24,85% | 0,20% | 1,872% | 2,92% |
| BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP | -3,06% | 1,50% | -2,34% | 2,31% | 8,42% | 24,53% | 0,35% | 2,521% | 4,04% |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP | -3,07% | 1,51% | -2,32% | 2,34% | 8,46% | 24,98% | 0,20% | 2,566% | 4,04% |
| BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | -3,14% | 1,40% | -2,42% | 2,26% | 8,66% | 25,32% | 0,30% | 2,594% | 4,16% |
| CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | -3,92% | -1,38% | -3,54% | -0,62% | 2,75% | 12,70% | 0,20% | 3,086% | 5,75% |
| IMA Geral ex-C | -1,45% | 2,19% | -0,22% | 3,10% | 9,08% | 26,20% | - | - | - |

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

| | Mês | Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|---|--------|-------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | -1,34% | 2,36% | -0,13% | 3,28% | 9,07% | - | 0,30% | 1,225% | 2,26% |
| IMA Geral | -1,43% | 2,32% | -0,16% | 3,22% | 9,22% | 26,00% | - | - | - |
| BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP | -1,37% | 2,22% | -0,18% | 3,15% | 8,93% | 25,85% | 0,20% | 1,277% | 1,97% |
| IDKA IPCA 2 Anos | -1,02% | 2,81% | 1,39% | 4,00% | 10,66% | 25,09% | - | - | - |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,79% | 3,10% | 1,79% | 3,46% | 8,31% | 21,36% | 0,20% | 0,268% | 0,76% |
| BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA | -0,89% | 2,79% | 1,24% | 3,73% | 9,91% | 23,61% | 0,20% | 0,977% | 1,49% |
| Não definido | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

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

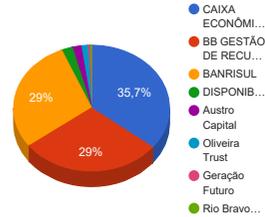
| | Mês | Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|---|---------|---------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| IPCA | 0,40% | 1,33% | 0,71% | 1,77% | 2,85% | 6,55% | - | - | - |
| BRS PARTICIPAÇÕES FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO | -0,50% | -0,90% | -0,85% | -0,68% | 12,68% | 28,33% | 1,50% | 7,036% | 15,82% |
| PETROBRAS PN - PETR4 | -17,21% | 18,12% | -11,38% | 23,65% | 46,74% | 136,54% | - | - | - |
| BB PETROBRAS FI AÇÕES | -12,14% | 26,21% | -6,66% | 33,07% | 54,98% | 114,68% | 2,00% | 46,969% | 40,43% |
| IBX | -10,91% | -0,04% | -10,11% | 6,31% | 21,31% | 57,62% | - | - | - |
| BANRISUL INFRA-ESTRUTURA FI AÇÕES | -1,62% | 14,62% | 3,20% | 19,55% | 41,00% | 64,22% | 2,50% | 11,765% | 15,38% |
| Ibovespa | -10,87% | 0,46% | -10,08% | 6,65% | 22,39% | 58,35% | - | - | - |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO | -0,84% | - | 1,61% | - | - | - | 1,60% | 1,165% | - |
| GERAÇÃO FI AÇÕES | -9,07% | 0,33% | -9,77% | 4,19% | 5,17% | 28,45% | 3,00% | 10,489% | 17,03% |
| BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO | -9,70% | 1,82% | -8,57% | 7,27% | 21,80% | 47,21% | 1,00% | 12,777% | 17,18% |
| BANRISUL ÍNDICE FI AÇÕES | -9,84% | 4,19% | -7,62% | 9,65% | 24,33% | 56,81% | 0,85% | 11,693% | 16,91% |
| BB PIPE FIC AÇÕES | -11,71% | -15,53% | -15,43% | -12,25% | 2,04% | 19,67% | 1,20% | 12,778% | 16,00% |
| ICON | -10,79% | -14,30% | -12,32% | -8,47% | 3,17% | 22,98% | - | - | - |
| BB CONSUMO FIC AÇÕES | -10,95% | -14,55% | -12,56% | -8,84% | 1,78% | 19,55% | 1,00% | 12,042% | 16,08% |
| IDIV | -10,53% | -2,66% | -10,87% | 2,16% | 12,39% | 67,47% | - | - | - |
| CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES | -10,58% | -5,13% | -10,56% | -0,17% | 8,56% | 22,86% | 1,72% | 11,370% | 15,02% |
| IFIX | -5,27% | -0,55% | -4,21% | 0,05% | 7,65% | 37,32% | - | - | - |

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

| | Mês | Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|--|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 | -1,14% | -2,99% | -8,79% | -2,99% | 2,77% | 13,15% | 1,20% | 11,320% | 22,94% |
| AGÊNCIAS CAIXA FII - AGCX11 | -6,77% | -7,68% | -9,69% | -7,51% | -12,49% | - | 0,35% | 12,518% | 20,50% |
| Não Informado | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| BANRISUL NOVAS FRONTEIRAS FII - BNFS11 | -2,67% | -2,67% | -1,85% | -8,04% | -1,18% | 14,51% | 0,40% | 13,875% | 27,24% |

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

| Administrador | Valor | % |
|----------------------------|---------------|--------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | 11.034.158,58 | 35,73% |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 8.956.138,23 | 29,00% |
| BANRISUL | 8.942.092,00 | 28,95% |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA | 701.487,98 | 2,27% |
| Austro Capital | 570.940,68 | 1,85% |
| Oliveira Trust | 428.072,00 | 1,39% |
| Geração Futuro | 135.795,53 | 0,44% |
| Rio Bravo Investimentos | 115.600,00 | 0,37% |



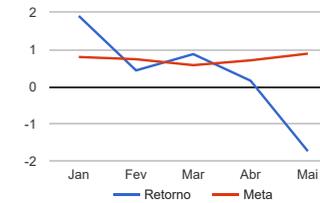
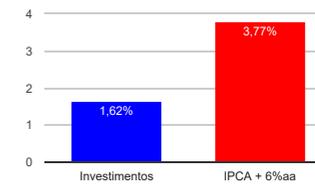
| Sub-segmento | Valor | % |
|----------------------------|--------------|--------|
| IMA-B | 7.416.439,88 | 24,01% |
| IMA-GERAL | 4.639.495,55 | 15,02% |
| CDI | 4.623.729,23 | 14,97% |
| IDKA IPCA 2A | 4.347.395,14 | 14,08% |
| IMA-GERAL EX-C | 2.997.202,14 | 9,70% |
| IMA-B 5 | 2.617.411,36 | 8,47% |
| AÇÕES - LIVRES | 1.105.505,79 | 3,58% |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA | 701.487,98 | 2,27% |
| MULTIMERCADO | 655.711,09 | 2,12% |
| FUNDO IMOBILIÁRIO | 647.472,00 | 2,10% |
| AÇÕES - SETORIAIS | 629.002,19 | 2,04% |
| IMA-B 5+ | 503.432,65 | 1,63% |



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% |
| Acumulado no ano | | | | | 480.706,87 | 1,62% | 3,77% | 42,98% | |

Acumulado no Ano



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

| Ativos de Renda Fixa | Sado Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | VaR - Mês (%) | Instituição(%) |
|---|---------------|------------|------------|-------------------------|--------------------|---------------|---------------|----------------|
| CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 905.244,75 | 0,00 | 0,00 | 912.485,25 | 7.240,50 | 0,80% | 0,27% | 0,80% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 256.238,05 | 0,00 | 0,00 | 258.272,53 | 2.034,48 | 0,79% | 0,27% | 0,79% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 799.893,21 | 0,00 | 0,00 | 805.628,40 | 5.735,19 | 0,72% | 0,11% | 0,72% |
| BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP | 652.745,00 | 0,00 | 0,00 | 657.370,00 | 4.625,00 | 0,71% | 0,10% | 0,71% |
| CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1.323.669,00 | 0,00 | 0,00 | 1.332.853,00 | 9.184,00 | 0,69% | 0,11% | 0,69% |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 4.934.581,80 | 164.000,00 | 500.000,00 | 4.623.729,23 | 25.147,43 | 0,49% | 0,00% | 0,50% |
| CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 375.115,58 | 0,00 | 0,00 | 372.073,11 | -3.042,47 | -0,81% | 1,06% | -0,81% |
| BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA | 4.125.842,55 | 0,00 | 0,00 | 4.089.122,61 | -36.719,94 | -0,89% | 0,98% | -0,89% |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 3.037.782,10 | 0,00 | 0,00 | 2.997.202,14 | -40.579,96 | -1,34% | 1,22% | -1,34% |
| BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP | 4.084.451,86 | 0,00 | 46.706,24 | 3.982.125,55 | -55.620,07 | -1,36% | 1,28% | -1,37% |
| AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA | 440.155,88 | 0,00 | 0,00 | 430.277,59 | -9.878,29 | -2,24% | 1,64% | -2,24% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 871.914,84 | 0,00 | 0,00 | 850.561,78 | -21.353,06 | -2,45% | 1,87% | -2,45% |
| BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III FI RENDA FIXA REFERENCIAD... | 115.419,05 | 0,00 | 2.736,05 | 109.228,48 | -3.454,52 | -2,99% | 2,52% | -3,06% |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP | 2.246.107,47 | 0,00 | 0,00 | 2.177.155,51 | -68.951,96 | -3,07% | 2,57% | -3,07% |
| BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 3.142.277,93 | 0,00 | 0,00 | 3.043.588,12 | -98.689,81 | -3,14% | 2,59% | -3,14% |
| CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 523.947,20 | 0,00 | 0,00 | 503.432,65 | -20.514,55 | -3,92% | 3,09% | -3,92% |
| | | | | Total Renda Fixa | -304.838,03 | -1,10% | 1,16% | |

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

| Ativos de Renda Variável | Sado Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | VaR - Mês (%) | Instituição(%) |
|--|---------------|------------|----------|-----------------------------|--------------------|---------------|---------------|----------------|
| BRS PARTICIPAÇÕES FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO | 141.375,48 | 0,00 | 0,00 | 140.663,09 | -712,39 | -0,50% | 7,04% | -0,50% |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVSPA II FIC MULTIMERCADO | 519.424,00 | 0,00 | 0,00 | 515.048,00 | -4.376,00 | -0,84% | 1,16% | -0,84% |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 | 105.000,00 | 0,00 | 0,00 | 103.800,00 | -1.200,00 | -1,14% | 11,32% | -1,14% |
| BANRISUL INFRA-ESTRUTURA FI AÇÕES | 34.709,80 | 0,00 | 0,00 | 34.148,15 | -561,65 | -1,62% | 11,77% | -1,62% |
| BANRISUL NOVAS FRONTEIRAS FII - BNFS11 | 439.800,00 | 0,00 | 0,00 | 428.072,00 | -11.728,00 | -2,67% | 13,88% | -2,67% |
| AGÊNCIAS CAIXA FII - AGCX11 | 124.000,00 | 0,00 | 0,00 | 115.600,00 | -8.400,00 | -6,77% | 12,52% | -6,77% |
| GERAÇÃO FI AÇÕES | 149.346,56 | 0,00 | 0,00 | 135.795,53 | -13.551,03 | -9,07% | 10,49% | -9,07% |
| BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO | 158.099,72 | 0,00 | 0,00 | 142.757,84 | -15.341,88 | -9,70% | 12,78% | -9,70% |
| BANRISUL ÍNDICE FI AÇÕES | 77.751,16 | 0,00 | 0,00 | 70.097,21 | -7.653,95 | -9,84% | 11,69% | -9,84% |
| CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES | 551.992,86 | 0,00 | 0,00 | 493.581,83 | -58.411,03 | -10,58% | 11,37% | -10,58% |
| BB CONSUMO FIC AÇÕES | 65.210,10 | 0,00 | 0,00 | 58.067,02 | -7.143,08 | -10,95% | 12,04% | -10,95% |
| BB PIPE FIC AÇÕES | 857.218,72 | 0,00 | 0,00 | 756.855,21 | -100.363,51 | -11,71% | 12,78% | -11,71% |
| BB PETROBRAS FI AÇÕES | 49.174,75 | 0,00 | 0,00 | 43.205,19 | -5.969,56 | -12,14% | 46,97% | -12,14% |
| | | | | Total Renda Variável | -235.412,08 | -7,19% | 10,74% | |