

Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2018



Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	11.074.632,42	9,00%	307	0,89%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	1.013.503,15	0,82%	23	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.553.930,08	6,14%	741	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.502.618,51	3,66%	1.264	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.330.154,80	5,14%	623	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	8.192.131,41	6,66%	1.457	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	6.990.219,79	5,68%	522	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	1.208.922,48	0,98%	107	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	351.999,88	0,29%	165	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	14.735.187,69	11,98%	674	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.571.859,73	2,90%	328	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	3.240.098,47	2,63%	185	0,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	5.531.863,64	4,50%	30	1,68%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	5.026.098,69	4,08%	315	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	5.005.826,64	4,07%	156	0,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	8.650.576,36	7,03%	679	0,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	5.997.278,15	4,87%	798	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.268.316,65	4,28%	442	0,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou D+1461	Não há	2.897.293,16	2,35%	17	1,44%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR 2	Não se aplica	Não se aplica	7.630,38	0,01%		1,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4	Não há	883.357,15	0,72%	47	0,39%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	D+4	Não há	885.532,69	0,72%	88	0,52%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2018)

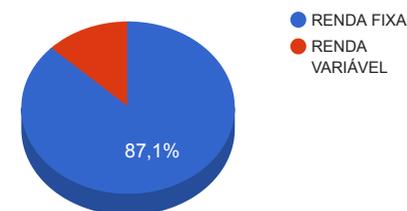
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	910.482,67	0,74%	118	0,35%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.793.506,01	1,46%	23.640	0,42%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	D+4	360 dias	161.979,80	0,13%	6	10,40%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	2.007.609,52	1,63%	132	0,20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	1.012.044,02	0,82%	31	0,23%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	2.585.470,47	2,10%	729	1,00%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	2.018.077,70	1,64%	956	0,46%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	1.874.195,44	1,52%	33	0,71%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
HAZ FII - ATCR11	Não se aplica	Não se aplica	747.735,91	0,61%		5,03%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	D+31 ou D+1800	1800 dias	1.007.837,08	0,82%	10	5,93%	Desenquadrado - RV
		TOTAL -	123.037.970,54				

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

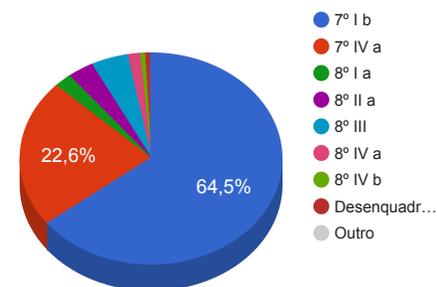
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	79.323.220,74	64,47%	0,00%	64,42%	100,00%	43.714.749,80
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,43%	15,00%	18.455.695,58
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	27.819.290,96	22,61%	0,00%	28,50%	30,00%	9.092.100,20
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	7.630,38	0,01%	0,00%	0,01%	5,00%	6.144.268,15
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	2.679.372,51	2,18%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.679.372,51
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	3.963.095,33	3,22%	0,00%	1,78%	15,00%	14.492.600,25
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	5.615.592,19	4,56%	0,00%	0,00%	5,00%	536.306,34
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	1.874.195,44	1,52%	0,00%	2,05%	5,00%	4.277.703,09
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	747.735,91	0,61%	0,00%	0,81%	5,00%	5.404.162,62
Desenquadrado - RV	0,00%	1.007.837,08	0,82%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.007.837,08
Total Carteira		123.037.970,54					

RENDA FIXA	107.150.142,08	87,09%
RENDA VARIÁVEL	15.887.828,46	12,91%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: agosto / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	79.323.220,74	64,47%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	27.819.290,96	22,61%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	7.630,38	0,01%	0,00%	5,00%
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%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	2.679.372,51	2,18%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	3.963.095,33	3,22%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso III	5.615.592,19	4,56%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	1.874.195,44	1,52%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	747.735,91	0,61%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RV	1.007.837,08	0,82%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	123.037.970,54	100,00%	0,00	235,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (agosto / 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	44.795.653,62	36,41%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	36.366.232,25	29,56%	0,00%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	26.140.429,57	21,25%	0,01%
ITAÚ UNIBANCO	7.013.436,16	5,70%	0,00%
Elleven Gestora de Recursos	3.645.029,07	2,96%	0,76%
SAFRA ASSET MANAGEMENT	2.025.547,17	1,65%	0,00%
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUTURADOS LTDA	1.881.825,82	1,53%	0,01%
ROMA ASSET	1.007.837,08	0,82%	0,21%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
120% do CDI	0,68%	5,21%	1,97%	3,90%	8,25%	24,09%	-	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR 2	-5,46%	-52,33%	-13,05%	-48,34%	-53,22%	-62,17%	0,00%	-	-
CDI	0,57%	4,32%	1,64%	3,24%	6,83%	19,70%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,55%	4,26%	1,58%	3,18%	6,86%	19,86%	0,20%	0,018%	0,07%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,55%	4,25%	1,60%	3,17%	6,76%	19,96%	0,20%	0,011%	0,05%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,52%	4,12%	1,56%	3,07%	6,64%	19,40%	0,20%	0,054%	0,08%
IRF-M 1	0,44%	4,21%	1,65%	3,04%	6,90%	20,96%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,41%	4,08%	1,59%	2,94%	6,70%	20,53%	0,20%	0,244%	0,51%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,40%	4,04%	1,58%	2,91%	6,66%	20,61%	0,00%	0,244%	0,52%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,40%	4,04%	1,58%	2,90%	6,64%	20,37%	0,10%	0,244%	0,52%
IDKA IPCA 2 Anos	0,10%	4,72%	1,86%	3,28%	8,04%	23,52%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,01%	4,50%	1,41%	2,93%	7,39%	21,63%	0,20%	1,406%	2,22%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,08%	4,36%	1,45%	2,79%	7,27%	21,51%	0,20%	1,427%	2,22%
IRF-M	-0,93%	2,91%	0,57%	0,48%	5,93%	25,00%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,08%	2,80%	0,52%	0,24%	5,61%	24,40%	0,20%	2,263%	3,18%
IMA-B 5+	-0,52%	1,88%	1,50%	-3,46%	2,62%	19,51%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,56%	1,73%	1,43%	-3,56%	2,34%	18,58%	0,20%	4,925%	6,83%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	-0,45%	3,04%	1,53%	-0,90%	4,57%	20,76%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,05%	4,58%	1,55%	2,90%	7,05%	21,51%	0,20%	1,397%	1,84%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	-0,12%	1,23%	0,94%	-1,88%	3,48%	19,22%	1,30%	2,307%	3,96%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,46%	2,88%	1,46%	-1,02%	4,31%	20,19%	0,20%	3,482%	4,81%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,46%	2,87%	1,46%	-1,02%	4,31%	20,36%	0,20%	3,476%	4,83%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	-0,85%	2,09%	0,86%	-1,68%	3,46%	18,91%	0,30%	3,745%	5,24%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,59%	-0,63%	-1,42%	0,31%	2,11%	10,58%	0,20%	4,500%	4,36%
IMA-B 5	-0,26%	4,06%	1,67%	2,14%	6,66%	21,49%	-	-	-
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-0,28%	3,90%	1,62%	2,03%	6,46%	21,03%	0,10%	1,969%	2,83%
IMA Geral ex-C	-0,24%	3,47%	1,26%	1,03%	5,91%	22,22%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,39%	3,55%	1,17%	1,03%	5,73%	21,15%	0,30%	1,908%	2,63%
IPCA	-0,09%	2,85%	1,50%	2,22%	4,19%	6,75%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,37%	4,87%	1,54%	2,56%	7,48%	-	0,40%	0,232%	1,54%

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

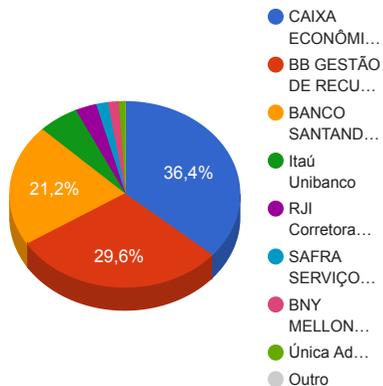
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
S&P 500	5,27%	9,73%	7,70%	8,10%	18,70%	35,14%	-	-	-
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	3,67%	11,15%	7,76%	8,95%	22,68%	55,96%	1,00%	3,557%	12,04%
IDIV	-3,70%	-3,80%	-1,17%	-11,91%	0,29%	33,84%	-	-	-
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	-2,11%	-1,46%	-0,79%	-10,73%	0,74%	15,19%	2,00%	9,810%	17,24%
Ibovespa	-3,21%	0,36%	-0,10%	-10,16%	8,25%	32,43%	-	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	-0,42%	-	0,44%	2,05%	-	-	1,60%	1,364%	-
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	-0,47%	-3,58%	-1,38%	-2,74%	-5,25%	-27,96%	4,00%	0,069%	0,17%
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	-2,60%	0,05%	-1,23%	-9,82%	5,98%	14,42%	3,00%	6,972%	14,88%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-3,71%	4,76%	-0,86%	-4,57%	11,40%	41,22%	2,50%	8,612%	16,58%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-4,58%	-2,15%	-1,70%	-11,91%	5,51%	28,72%	0,75%	11,696%	19,64%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	-	-	-	-	-	-	1,60%	-	-
IBX-50	-3,08%	0,65%	-0,03%	-10,29%	8,57%	32,44%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	-3,30%	-0,02%	-0,47%	-11,29%	9,25%	30,84%	0,70%	11,170%	20,10%
IGC	-2,54%	-3,65%	0,50%	-10,67%	2,40%	26,28%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-3,26%	-3,03%	0,09%	-10,00%	2,71%	25,87%	1,00%	11,022%	18,29%
IFIX	-0,70%	-3,91%	-3,37%	-7,44%	2,66%	21,07%	-	-	-
HAZ FII - ATCR11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	1,20%	-	-

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

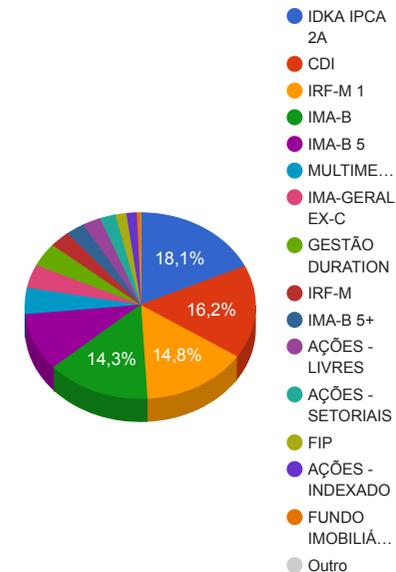
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA	-0,09%	2,85%	1,50%	2,22%	4,19%	6,75%	-	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,30%	0,001%	20,80%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	44.795.653,62	36,41%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	36.366.232,25	29,56%
BANCO SANTANDER	26.140.429,57	21,25%
Itaú Unibanco	7.013.436,16	5,70%
RJI Corretora de Valores	3.645.029,07	2,96%
SAFRA SERVIÇOS DE ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA LTDA.	2.025.547,17	1,65%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	1.874.195,44	1,52%
Única Administradora	1.169.816,88	0,95%
Brasil Plural	7.630,38	0,01%



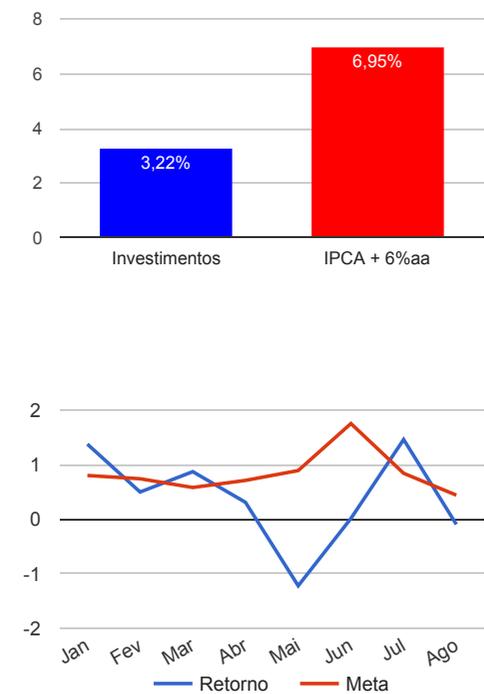
Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	22.289.117,77	18,12%
CDI	19.916.171,16	16,19%
IRF-M 1	18.226.613,56	14,81%
IMA-B	17.583.170,78	14,29%
IMA-B 5	12.283.554,90	9,98%
MULTIMERCADO	5.615.592,19	4,56%
IMA-GERAL EX-C	5.026.098,69	4,08%
GESTÃO DURATION	5.005.826,64	4,07%
IRF-M	3.571.859,73	2,90%
IMA-B 5+	3.240.098,47	2,63%
AÇÕES - LIVRES	3.177.426,40	2,58%
AÇÕES - SETORIAIS	2.703.988,68	2,20%
FIP	1.874.195,44	1,52%
AÇÕES - INDEXADO	1.768.889,84	1,44%
FUNDO IMOBILIÁRIO	747.735,91	0,61%
FIDC - FECHADO	7.630,38	0,01%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	114.216.440,46	10.266.099,47	8.846.346,38	117.224.289,56	1.588.096,01	1,37%	0,80%	171,35%	0,67%
Fevereiro	117.224.289,56	6.216.112,57	5.063.696,56	118.965.268,41	588.562,84	0,50%	0,74%	67,33%	1,12%
Março	118.965.268,41	28.408.298,69	26.934.670,37	121.486.183,10	1.047.286,37	0,87%	0,58%	150,65%	0,80%
Abril	121.486.183,10	7.412.643,47	8.996.306,33	120.276.744,69	374.224,45	0,31%	0,71%	43,52%	0,61%
Mai	120.276.744,69	7.697.824,50	3.687.760,55	122.772.012,67	-1.514.795,97	-1,22%	0,89%	-137,14%	1,42%
Junho	122.772.012,67	7.403.947,98	10.665.441,90	119.528.089,25	17.570,50	0,01%	1,75%	0,82%	2,21%
Julho	119.528.089,25	9.636.968,58	8.670.762,03	122.251.144,12	1.756.848,32	1,46%	0,84%	173,23%	0,96%
Agosto	122.251.144,12	25.340.232,81	24.436.528,77	123.037.970,54	-116.877,62	-0,09%	0,44%	-21,43%	1,95%
Acumulado no ano					3.740.914,90	3,22%	6,95%	46,41%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.158.968,71	0,00	0,00	8.192.131,41	33.162,70	0,41%	0,24%	0,41%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	6.669.865,48	2.361.259,83	3.070.000,00	5.997.278,15	36.152,84	0,40%	0,02%	0,55%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.069.660,77	1.276.780,21	99.336,00	5.268.316,65	21.211,67	0,40%	0,05%	0,52%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.484.887,85	0,00	0,00	4.502.618,51	17.730,66	0,40%	0,24%	0,40%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	856.389,91	0,00	859.771,88	0,00	3.381,97	0,39%	0,14%	0,61%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	15.148.088,63	3.505.000,00	10.070.000,00	8.650.576,36	67.487,73	0,36%	0,01%	0,55%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.502.104,35	0,00	3.000.000,00	5.531.863,64	29.759,29	0,35%	0,24%	0,40%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.016.268,17	0,00	6.037.256,56	0,00	20.988,39	0,35%	-	-
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.241.049,16	0,00	34.116,28	1.208.922,48	1.989,60	0,16%	4,50%	-2,59%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,00	5.000.000,00	0,00	5.005.826,64	5.826,64	0,12%	0,23%	0,37%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	617.491,95	0,00	266.048,05	351.999,88	555,98	0,09%	1,40%	-0,05%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.678.388,21	4.071.372,84	1.000.000,00	14.735.187,69	-14.573,36	-0,09%	1,41%	0,01%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.436.653,37	1.125.819,93	0,00	7.553.930,08	-8.543,22	-0,11%	1,43%	-0,08%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	2.900.745,78	0,00	0,00	2.897.293,16	-3.452,62	-0,12%	2,31%	-0,12%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	8.111.553,82	3.000.000,00	0,00	11.074.632,42	-36.921,40	-0,33%	1,97%	-0,28%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.045.668,58	0,00	0,00	5.026.098,69	-19.569,89	-0,39%	1,91%	-0,39%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.022.669,56	0,00	0,00	6.990.219,79	-32.449,77	-0,46%	3,48%	-0,46%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.359.701,04	0,00	0,00	6.330.154,80	-29.546,24	-0,46%	3,48%	-0,46%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.258.391,02	0,00	0,00	3.240.098,47	-18.292,55	-0,56%	4,92%	-0,56%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	1.022.150,66	0,00	0,00	1.013.503,15	-8.647,51	-0,85%	3,75%	-0,85%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.610.908,58	0,00	0,00	3.571.859,73	-39.048,85	-1,08%	2,26%	-1,08%
TRENBANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	8.070,91	0,00	0,00	7.630,38	-440,53	-5,46%	-	-5,46%
Total Renda Fixa					26.761,53	0,02%	1,45%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	0,00	1.000.000,00	0,00	1.012.044,02	12.044,02	1,20%	3,56%	3,67%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,00	2.000.000,00	0,00	2.018.077,70	18.077,70	0,90%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.007.609,52	7.609,52	0,38%	8,61%	-3,71%
HAZ FII - ATCR11	747.847,52	0,00	0,00	747.735,91	-111,61	-0,01%	-	0,00%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	1.874.718,87	0,00	0,00	1.874.195,44	-523,43	-0,03%	0,00%	-0,03%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	2.596.438,54	0,00	0,00	2.585.470,47	-10.968,07	-0,42%	1,36%	-0,42%
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	162.741,25	0,00	0,00	161.979,80	-761,45	-0,47%	0,07%	-0,47%
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.832.183,42	0,00	0,00	1.793.506,01	-38.677,41	-2,11%	9,81%	-2,11%
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	1.034.769,56	0,00	0,00	1.007.837,08	-26.932,48	-2,60%	6,97%	-2,60%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	941.190,16	0,00	0,00	910.482,67	-30.707,49	-3,26%	11,02%	-3,26%
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	915.780,07	0,00	0,00	885.532,69	-30.247,38	-3,30%	11,17%	-3,30%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	925.798,22	0,00	0,00	883.357,15	-42.441,07	-4,58%	11,70%	-4,58%
Total Renda Variável					-143.639,15	-0,90%	6,04%	