

Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º Trimestre de 2018



Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 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	11.170.622,32	8,97%	302	0,91%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	1.012.966,63	0,81%	22	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.642.405,75	6,14%	733	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.529.191,28	3,64%	1.267	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.318.722,44	5,08%	599	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	8.240.360,27	6,62%	1.471	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	6.978.923,56	5,61%	507	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	1.223.663,21	0,98%	107	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	355.840,25	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	14.904.983,07	11,97%	674	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.614.106,18	2,90%	313	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	3.206.871,25	2,58%	181	0,49%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	5.564.551,27	4,47%	27	1,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	5.056.272,54	4,06%	315	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	5.026.713,34	4,04%	171	0,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	10.147.099,85	8,15%	680	0,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	4.826.463,52	3,88%	814	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.736.929,22	4,61%	442	0,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou D+1461	Não há	2.875.558,56	2,31%	17	1,44%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR 2	Não se aplica	Não se aplica	7.200,30	0,01%		1,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4	Não há	915.495,05	0,74%	46	0,39%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	D+4	Não há	913.803,71	0,73%	88	0,51%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2018)

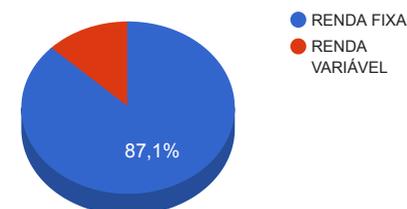
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	940.082,98	0,76%	114	0,35%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.838.817,47	1,48%	23.514	0,42%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	D+4	360 dias	161.371,61	0,13%	6	10,40%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.981.869,45	1,59%	139	0,19%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	1.016.850,45	0,82%	33	0,23%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	2.609.320,83	2,10%	729	1,00%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	2.031.667,81	1,63%	955	0,46%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	1.873.737,55	1,51%	33	0,71%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
HAZ FII - ATCR11	Não se aplica	Não se aplica	748.214,22	0,60%		5,04%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	D+31 ou D+1800	1800 dias	1.011.867,33	0,81%	8	6,44%	Desenquadrado - RV
		TOTAL -	124.482.543,27				

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

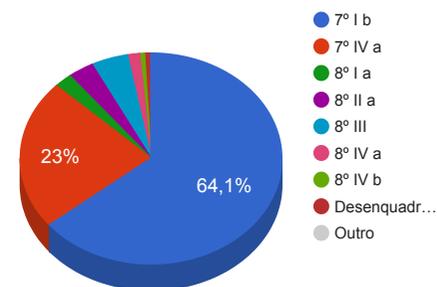
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	79.819.480,02	64,12%	0,00%	64,42%	100,00%	44.663.063,25
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,43%	15,00%	18.672.381,49
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	28.612.764,49	22,99%	0,00%	28,50%	30,00%	8.731.998,49
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	7.200,30	0,01%	0,00%	0,01%	5,00%	6.216.926,86
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	2.769.381,74	2,22%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.769.381,74
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	3.982.058,53	3,20%	0,00%	1,78%	15,00%	14.690.322,96
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	5.657.839,09	4,55%	0,00%	0,00%	5,00%	566.288,07
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	1.873.737,55	1,51%	0,00%	2,05%	5,00%	4.350.389,61
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	748.214,22	0,60%	0,00%	0,81%	5,00%	5.475.912,94
Desenquadrado - RV	0,00%	1.011.867,33	0,81%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.011.867,33
Total Carteira		124.482.543,27					

RENDA FIXA	108.439.444,81	87,11%
RENDA VARIÁVEL	16.043.098,46	12,89%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: setembro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	79.819.480,02	64,12%	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 "	28.612.764,49	22,99%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	7.200,30	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 "	2.769.381,74	2,22%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	3.982.058,53	3,20%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso III	5.657.839,09	4,55%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	1.873.737,55	1,51%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	748.214,22	0,60%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RV	1.011.867,33	0,81%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	124.482.543,27	100,00%	0,00	235,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (setembro / 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	45.593.556,74	36,63%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	35.374.868,60	28,42%	0,00%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	27.797.768,49	22,33%	0,01%
ITAÚ UNIBANCO	7.008.582,79	5,63%	0,00%
Elleven Gestora de Recursos	3.623.772,78	2,91%	0,76%
SAFRA ASSET MANAGEMENT	2.029.817,08	1,63%	0,00%
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUTURADOS LTDA	1.880.937,85	1,51%	0,01%
ROMA ASSET	1.011.867,33	0,81%	0,35%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	1,36%	6,14%	3,07%	3,04%	8,51%	23,34%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,17%	5,58%	2,34%	2,47%	7,60%	21,30%	0,20%	0,881%	2,27%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,15%	5,71%	2,36%	2,56%	7,66%	21,41%	0,20%	0,875%	2,27%
IRF-M	1,30%	4,24%	1,83%	0,46%	5,74%	24,19%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,18%	4,01%	1,68%	0,12%	5,34%	23,48%	0,20%	1,504%	3,25%
IMA-B 5	0,89%	4,98%	2,11%	1,40%	6,53%	20,86%	-	-	-
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,87%	4,80%	2,05%	1,28%	6,33%	20,40%	0,10%	1,235%	2,89%
IMA Geral ex-C	0,61%	4,11%	1,77%	0,69%	5,18%	21,05%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,60%	4,17%	1,58%	0,63%	4,99%	20,00%	0,30%	1,092%	2,60%
IRF-M 1	0,61%	4,85%	1,72%	2,99%	6,75%	20,26%	-	-	-
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,59%	4,65%	1,69%	2,86%	6,53%	19,94%	0,00%	0,158%	0,52%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,59%	4,66%	1,67%	2,86%	6,51%	19,70%	0,10%	0,163%	0,52%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,59%	4,69%	1,69%	2,89%	6,57%	19,83%	0,20%	0,154%	0,52%
120% do CDI	0,56%	5,80%	1,91%	3,82%	8,03%	23,14%	-	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	-5,63%	-55,01%	-14,57%	-38,83%	-59,85%	-71,89%	0,00%	-	-
IPCA	0,48%	3,34%	0,72%	2,62%	4,53%	7,18%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,42%	5,31%	1,37%	1,94%	6,32%	-	0,40%	0,054%	1,40%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,47%	4,81%	1,59%	3,17%	6,65%	18,95%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,49%	4,77%	1,57%	3,13%	6,69%	19,12%	0,20%	0,047%	0,07%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,47%	4,61%	1,54%	3,02%	6,44%	18,66%	0,20%	0,033%	0,08%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,47%	4,73%	1,56%	3,11%	6,56%	19,19%	0,20%	0,003%	0,03%
IMA-B 5+	-1,03%	0,83%	1,55%	-4,82%	-0,82%	16,33%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,03%	0,69%	1,48%	-4,85%	-1,01%	15,46%	0,20%	2,521%	6,89%
IMA-B	-0,15%	2,88%	1,71%	-1,96%	2,55%	18,72%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,22%	0,58%	-0,32%	-0,11%	2,20%	10,31%	0,20%	0,844%	4,37%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,09%	5,73%	2,06%	2,72%	7,28%	21,14%	0,20%	1,048%	1,92%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	-0,05%	2,04%	1,45%	-2,75%	1,56%	17,04%	0,30%	2,101%	5,31%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,16%	2,71%	1,66%	-2,06%	2,32%	18,15%	0,20%	1,875%	4,86%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,18%	2,69%	1,64%	-2,10%	2,28%	18,27%	0,20%	1,890%	4,88%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	-0,75%	0,47%	0,93%	-4,04%	1,42%	15,27%	1,30%	1,514%	4,03%

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

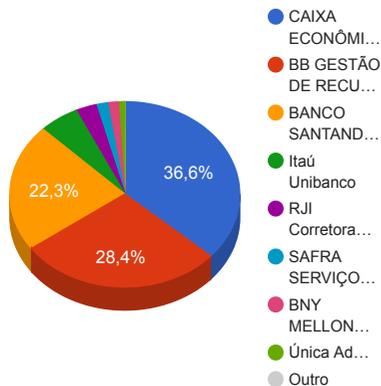
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IBX-50	3,73%	4,40%	9,50%	-7,00%	7,30%	36,21%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	3,19%	3,17%	8,82%	-8,16%	6,23%	34,13%	0,70%	9,911%	20,51%
Ibovespa	3,48%	3,85%	9,04%	-7,06%	6,80%	35,94%	-	-	-
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	3,64%	1,41%	7,39%	-8,11%	2,66%	31,91%	0,75%	9,701%	20,03%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	0,92%	-	1,63%	1,04%	-	-	1,60%	0,854%	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,67%	-	-	-	-	-	1,60%	1,252%	-
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	0,40%	0,45%	1,63%	-10,85%	1,60%	13,98%	3,00%	10,804%	15,85%
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	-0,38%	-3,94%	-1,30%	-2,67%	-5,20%	-24,76%	4,00%	0,000%	0,16%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-1,28%	3,42%	0,98%	-7,49%	4,64%	36,31%	2,50%	8,187%	16,78%
IGC	3,19%	-0,58%	8,51%	-6,87%	0,93%	30,38%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	3,25%	0,13%	8,09%	-6,12%	1,40%	30,07%	1,00%	9,653%	18,78%
IPCA	0,48%	3,34%	0,72%	2,62%	4,53%	7,18%	-	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,30%	0,001%	20,85%
S&P 500	0,43%	8,99%	7,20%	10,34%	15,66%	34,39%	-	-	-
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	0,47%	11,68%	8,13%	12,54%	20,70%	55,50%	1,00%	2,658%	12,08%
IDIV	0,17%	-3,63%	3,48%	-12,68%	-5,33%	34,44%	-	-	-
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	2,53%	1,03%	7,28%	-9,43%	-0,02%	19,59%	2,00%	8,130%	17,52%

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

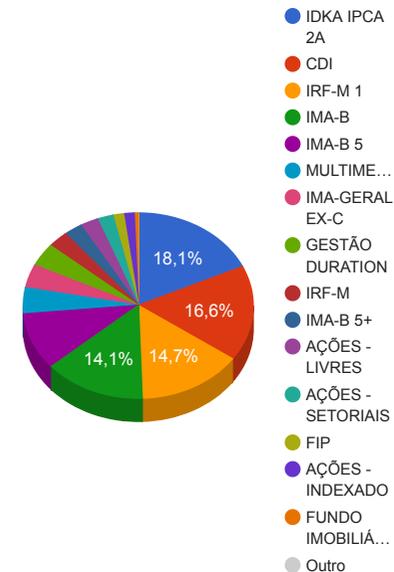
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	-0,21%	-4,12%	0,45%	-9,45%	-3,88%	17,55%	-	-	-
HAZ FII - ATCR11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	1,20%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	45.593.556,74	36,63%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	35.374.868,60	28,42%
BANCO SANTANDER	27.797.768,49	22,33%
Itaú Unibanco	7.008.582,79	5,63%
RJI Corretora de Valores	3.623.772,78	2,91%
SAFRA SERVIÇOS DE ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA LTDA.	2.029.817,08	1,63%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	1.873.737,55	1,51%
Única Administradora	1.173.238,94	0,94%
Brasil Plural	7.200,30	0,01%



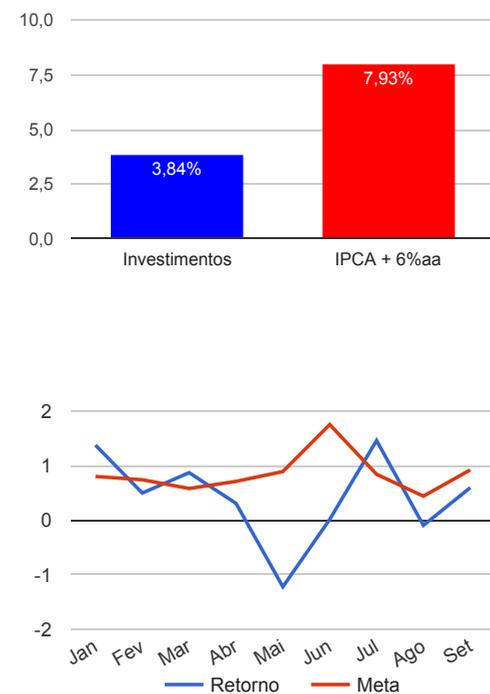
Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	22.547.388,82	18,11%
CDI	20.710.492,59	16,64%
IRF-M 1	18.334.102,82	14,73%
IMA-B	17.542.011,44	14,09%
IMA-B 5	12.394.285,53	9,96%
MULTIMERCADO	5.657.839,09	4,55%
IMA-GERAL EX-C	5.056.272,54	4,06%
GESTÃO DURATION	5.026.713,34	4,04%
IRF-M	3.614.106,18	2,90%
IMA-B 5+	3.206.871,25	2,58%
AÇÕES - LIVRES	3.155.108,39	2,53%
AÇÕES - SETORIAIS	2.778.900,45	2,23%
FIP	1.873.737,55	1,51%
AÇÕES - INDEXADO	1.829.298,76	1,47%
FUNDO IMOBILIÁRIO	748.214,22	0,60%
FIDC - FECHADO	7.200,30	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%
Setembro	123.037.970,54	4.039.397,61	3.331.959,07	124.482.543,27	737.134,19	0,60%	0,92%	64,58%	1,34%
Acumulado no ano					4.478.049,09	3,84%	7,93%	48,39%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)	
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.208.922,48	0,00	0,00	1.223.663,21	14.740,73	1,22%	0,84%	1,22%	
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.571.859,73	0,00	0,00	3.614.106,18	42.246,45	1,18%	1,50%	1,18%	
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.553.930,08	0,00	0,00	7.642.405,75	88.475,67	1,17%	0,88%	1,17%	
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.735.187,69	0,00	0,00	14.904.983,07	169.795,38	1,15%	0,88%	1,15%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	351.999,88	0,00	0,00	355.840,25	3.840,37	1,09%	1,05%	1,09%	
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	11.074.632,42	0,00	0,00	11.170.622,32	95.989,90	0,87%	1,24%	0,87%	
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.026.098,69	0,00	0,00	5.056.272,54	30.173,85	0,60%	1,09%	0,60%	
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.531.863,64	0,00	0,00	5.564.551,27	32.687,63	0,59%	0,16%	0,59%	
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.502.618,51	0,00	0,00	4.529.191,28	26.572,77	0,59%	0,16%	0,59%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.192.131,41	0,00	0,00	8.240.360,27	48.228,86	0,59%	0,15%	0,59%	
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	5.997.278,15	0,00	1.200.000,00	4.826.463,52	29.185,37	0,49%	0,05%	0,49%	
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	5.005.826,64	0,00	0,00	5.026.713,34	20.886,70	0,42%	0,05%	0,42%	
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.268.316,65	544.397,61	99.959,07	5.736.929,22	24.174,03	0,42%	0,03%	0,47%	
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	8.650.576,36	3.495.000,00	2.032.000,00	10.147.099,85	33.523,49	0,28%	0,00%	0,47%	
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	1.013.503,15	0,00	0,00	1.012.966,63	-536,52	-0,05%	2,10%	-0,05%	
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.990.219,79	0,00	0,00	6.978.923,56	-11.296,23	-0,16%	1,87%	-0,16%	
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.330.154,80	0,00	0,00	6.318.722,44	-11.432,36	-0,18%	1,89%	-0,18%	
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	2.897.293,16	0,00	0,00	2.875.558,56	-21.734,60	-0,75%	1,51%	-0,75%	
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.240.098,47	0,00	0,00	3.206.871,25	-33.227,22	-1,03%	2,52%	-1,03%	
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	7.630,38	0,00	0,00	7.200,30	-430,08	-5,64%	-	-5,63%	
Total Renda Fixa						581.864,19	0,54%	0,82%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	883.357,15	0,00	0,00	915.495,05	32.137,90	3,64%	9,70%	3,64%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	910.482,67	0,00	0,00	940.082,98	29.600,31	3,25%	9,65%	3,25%
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	885.532,69	0,00	0,00	913.803,71	28.271,02	3,19%	9,91%	3,19%
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.793.506,01	0,00	0,00	1.838.817,47	45.311,46	2,53%	8,13%	2,53%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	2.585.470,47	0,00	0,00	2.609.320,83	23.850,36	0,92%	0,85%	0,92%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	2.018.077,70	0,00	0,00	2.031.667,81	13.590,11	0,67%	1,25%	0,67%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	1.012.044,02	0,00	0,00	1.016.850,45	4.806,43	0,47%	2,66%	0,47%
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	1.007.837,08	0,00	0,00	1.011.867,33	4.030,25	0,40%	10,80%	0,40%
HAZ FII - ATCR11	747.735,91	0,00	0,00	748.214,22	478,31	0,06%	-	0,00%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	1.874.195,44	0,00	0,00	1.873.737,55	-457,89	-0,02%	0,00%	-0,02%
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	161.979,80	0,00	0,00	161.371,61	-608,19	-0,38%	0,00%	-0,38%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.007.609,52	0,00	0,00	1.981.869,45	-25.740,07	-1,28%	8,19%	-1,28%
Total Renda Variável					155.270,00	0,98%	5,01%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2018

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.541.128,63	4.071.372,84	1.000.000,00	14.904.983,07	292.481,60	2,26%	2,36%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	7.995.166,95	3.000.000,00	0,00	11.170.622,32	175.455,37	2,00%	2,05%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	14.360.508,14	13.393.000,00	17.780.000,00	10.147.099,85	173.591,71	0,99%	1,56%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.358.215,09	1.125.819,93	0,00	7.642.405,75	158.370,73	2,30%	2,34%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.103.578,01	0,00	0,00	8.240.360,27	136.782,26	1,69%	1,69%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.444.514,56	0,00	3.000.000,00	5.564.551,27	120.036,71	1,63%	1,69%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.865.210,78	0,00	0,00	6.978.923,56	113.712,78	1,66%	1,66%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.216.581,41	0,00	0,00	6.318.722,44	102.141,03	1,64%	1,64%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	4.642.946,40	4.361.256,74	4.270.000,00	4.826.463,52	92.260,38	1,30%	1,57%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.977.629,59	0,00	0,00	5.056.272,54	78.642,95	1,58%	1,58%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.454.791,05	0,00	0,00	4.529.191,28	74.400,23	1,67%	1,67%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.909.664,42	3.065.149,49	298.653,33	5.736.929,22	60.768,64	1,19%	1,54%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.554.471,90	0,00	0,00	3.614.106,18	59.634,28	1,68%	1,68%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.986.011,62	0,00	6.037.256,56	0,00	51.244,94	0,86%	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.160.129,57	0,00	0,00	3.206.871,25	46.741,68	1,48%	1,48%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.227.536,98	0,00	34.116,28	1.223.663,21	30.242,51	2,50%	-0,32%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,00	5.000.000,00	0,00	5.026.713,34	26.713,34	0,53%	1,37%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	2.849.020,27	0,00	0,00	2.875.558,56	26.538,29	0,93%	0,93%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	998.456,96	0,00	0,00	1.012.966,63	14.509,67	1,45%	1,45%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	611.301,32	0,00	266.048,05	355.840,25	10.586,98	2,21%	2,06%
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.883.053,27	0,00	2.893.403,77	0,00	10.350,50	0,36%	1,56%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	852.095,97	0,00	859.771,88	0,00	7.675,91	0,90%	1,57%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2018

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR 2	8.428,50	0,00	0,00	7.200,30	-1.228,20	-14,57%	-14,57%
				Total Renda Fixa	1.861.654,29	1,71%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2018

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.714.081,44	0,00	0,00	1.838.817,47	124.736,03	7,28%	7,28%
HAZ FII - ATCR11	649.795,55	0,00	0,00	748.214,22	98.418,67	15,15%	0,00%
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	839.706,67	0,00	0,00	913.803,71	74.097,04	8,82%	8,82%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	869.696,05	0,00	0,00	940.082,98	70.386,93	8,09%	8,09%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	852.457,57	0,00	0,00	915.495,05	63.037,48	7,39%	7,39%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	2.567.445,25	0,00	0,00	2.609.320,83	41.875,58	1,63%	1,63%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,00	2.000.000,00	0,00	2.031.667,81	31.667,81	1,58%	-
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	0,00	1.000.000,00	0,00	1.016.850,45	16.850,45	1,69%	8,13%
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	995.682,09	0,00	0,00	1.011.867,33	16.185,24	1,63%	1,63%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	1.875.279,72	0,00	0,00	1.873.737,55	-1.542,17	-0,08%	-
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	163.503,52	0,00	0,00	161.371,61	-2.131,91	-1,30%	-1,30%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	1.981.869,45	-18.130,55	-0,91%	0,98%
Total Renda Variável					515.450,60	4,86%	