

Relatório Analítico dos Investimentos em outubro de 2018



Carteira consolidada de investimentos - base (outubro / 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	11.517.060,06	8,98%	304	0,81%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	1.095.468,02	0,85%	22	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.802.111,23	6,08%	748	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.571.531,65	3,56%	1.268	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.771.170,82	5,28%	598	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	8.317.414,18	6,48%	1.473	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.472.335,15	5,82%	505	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	1.244.598,78	0,97%	107	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	364.686,81	0,28%	165	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	15.215.713,33	11,86%	693	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.753.492,29	2,93%	327	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	3.544.782,90	2,76%	176	0,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	5.616.354,95	4,38%	27	1,66%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	5.233.082,82	4,08%	311	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	5.052.289,75	3,94%	185	0,21%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	10.845.106,24	8,45%	678	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	5.752.634,95	4,48%	815	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.411.713,32	3,44%	437	0,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou D+1461	Não há	2.915.359,88	2,27%	17	1,44%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR 2	Não se aplica	Não se aplica	6.701,72	0,01%		1,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4	Não há	1.008.214,11	0,79%	49	0,37%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	D+4	Não há	1.000.365,21	0,78%	89	0,51%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (outubro / 2018)

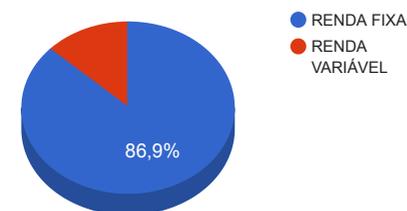
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	1.048.401,03	0,82%	120	0,34%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.012.339,95	1,57%	23.388	0,43%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	D+4	360 dias	161.313,55	0,13%	6	10,40%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	2.263.943,44	1,76%	146	0,19%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	949.271,81	0,74%	36	0,22%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	2.657.069,04	2,07%	729	1,00%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	2.094.752,62	1,63%	955	0,46%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	1.874.211,09	1,46%	33	0,71%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
HAZ FII - ATCR11	Não se aplica	Não se aplica	748.630,42	0,58%		5,04%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	D+31 ou D+1800	1800 dias	976.023,46	0,76%	7	8,35%	Desenquadrado - RV
		TOTAL -	128.298.144,58				

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

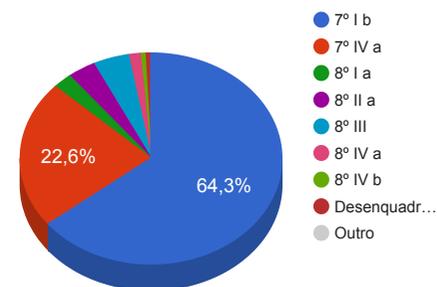
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	82.519.802,99	64,32%	0,00%	64,42%	100,00%	45.778.341,59
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,43%	15,00%	19.244.721,69
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	28.977.104,14	22,59%	0,00%	28,50%	30,00%	9.512.339,23
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	6.701,72	0,01%	0,00%	0,01%	5,00%	6.408.205,51
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	3.056.980,35	2,38%	0,00%	0,00%	0,00%	-3.056.980,35
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	4.437.596,94	3,46%	0,00%	1,78%	15,00%	14.807.124,75
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	5.701.093,47	4,44%	0,00%	0,00%	5,00%	713.813,76
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	1.874.211,09	1,46%	0,00%	2,05%	5,00%	4.540.696,14
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	748.630,42	0,58%	0,00%	0,81%	5,00%	5.666.276,81
Desenquadrado - RV	0,00%	976.023,46	0,76%	0,00%	0,00%	0,00%	-976.023,46
Total Carteira		128.298.144,58					

RENDA FIXA	111.503.608,85	86,91%
RENDA VARIÁVEL	16.794.535,73	13,09%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: outubro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	82.519.802,99	64,32%	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 "	28.977.104,14	22,59%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	6.701,72	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 "	3.056.980,35	2,38%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	4.437.596,94	3,46%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso III	5.701.093,47	4,44%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	1.874.211,09	1,46%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	748.630,42	0,58%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RV	976.023,46	0,76%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	128.298.144,58	100,00%	0,00	235,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (outubro / 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	45.466.289,59	35,44%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	37.801.906,49	29,46%	0,00%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	28.986.735,36	22,59%	0,01%
ITAÚ UNIBANCO	7.316.233,19	5,70%	0,00%
Elleven Gestora de Recursos	3.663.990,30	2,86%	0,67%
SAFRA ASSET MANAGEMENT	2.044.739,83	1,59%	0,00%
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUTURADOS LTDA	1.880.912,81	1,47%	0,01%
ROMA ASSET	976.023,46	0,76%	0,25%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	10,66%	11,58%	8,95%	5,99%	10,88%	27,81%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10,54%	11,30%	8,79%	5,85%	10,52%	26,71%	0,20%	5,987%	7,91%
IMA-B	7,14%	10,23%	6,50%	5,19%	10,29%	26,38%	-	-	-
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	8,14%	10,35%	7,17%	5,32%	10,43%	25,77%	0,30%	4,908%	6,18%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7,16%	10,04%	6,47%	5,08%	10,06%	25,93%	0,20%	3,998%	5,51%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7,07%	9,97%	6,40%	5,03%	10,00%	25,72%	0,20%	3,962%	5,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,49%	8,35%	3,55%	4,68%	9,22%	23,60%	0,20%	1,239%	2,05%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,71%	2,30%	0,29%	0,67%	3,32%	11,70%	0,20%	0,747%	4,38%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	1,38%	1,86%	0,50%	-1,18%	2,96%	16,83%	1,30%	0,835%	3,99%
IRF-M	3,59%	7,99%	3,96%	3,58%	9,43%	27,10%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,86%	8,02%	3,95%	3,61%	9,40%	26,60%	0,20%	2,183%	3,50%
IMA Geral ex-C	3,43%	7,67%	3,81%	3,83%	8,63%	23,97%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,50%	7,82%	3,71%	3,93%	8,65%	23,07%	0,30%	1,886%	2,83%
IMA-B 5	3,10%	8,23%	3,75%	4,10%	9,30%	24,04%	-	-	-
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	3,10%	8,05%	3,71%	4,01%	9,12%	23,59%	0,10%	1,599%	3,05%
IDKA IPCA 2 Anos	1,95%	8,21%	3,43%	4,19%	9,75%	25,22%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,09%	7,79%	3,21%	3,90%	9,03%	23,32%	0,20%	0,977%	2,33%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,08%	7,91%	3,27%	3,89%	9,10%	23,42%	0,20%	0,971%	2,33%
IRF-M 1	0,92%	5,81%	1,97%	3,41%	7,06%	20,23%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,94%	5,67%	1,94%	3,35%	6,90%	19,82%	0,20%	0,268%	0,55%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,93%	5,64%	1,93%	3,32%	6,85%	19,69%	0,10%	0,273%	0,55%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,93%	5,63%	1,94%	3,32%	6,85%	19,93%	0,00%	0,269%	0,55%
120% do CDI	0,65%	6,49%	1,91%	3,85%	7,91%	22,41%	-	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	-6,93%	-58,13%	-16,96%	-29,60%	-61,23%	-73,19%	0,00%	-	-
CDI	0,54%	5,38%	1,59%	3,20%	6,55%	18,35%	-	-	-
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,54%	5,30%	1,57%	3,14%	6,45%	18,57%	0,20%	0,004%	0,02%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,54%	5,17%	1,53%	3,06%	6,34%	18,07%	0,20%	0,033%	0,07%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,53%	5,32%	1,58%	3,15%	6,53%	18,49%	0,20%	0,009%	0,07%
IPCA	0,45%	3,81%	0,84%	2,86%	4,56%	7,38%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,51%	5,84%	1,30%	2,13%	6,82%	-	0,40%	0,000%	1,19%

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

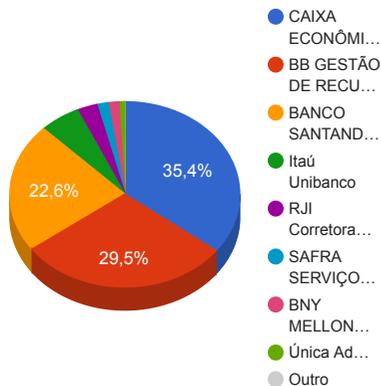
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDIV	11,44%	7,39%	7,50%	-1,29%	5,19%	30,43%	-	-	-
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	9,44%	10,57%	9,83%	-1,09%	10,89%	23,04%	2,00%	13,017%	18,90%
IGC	10,77%	10,13%	11,40%	2,38%	12,87%	33,01%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	11,52%	11,66%	11,39%	3,97%	14,22%	33,59%	1,00%	15,424%	20,63%
Ibovespa	10,19%	14,43%	10,35%	1,52%	17,65%	34,66%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	14,23%	18,14%	8,59%	2,95%	20,15%	43,49%	2,50%	15,935%	19,11%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	10,13%	11,69%	8,90%	0,54%	14,51%	30,60%	0,75%	15,335%	21,65%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	3,11%	-	-	-	-	-	1,60%	1,751%	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	1,83%	-	2,34%	2,35%	-	-	1,60%	0,931%	-
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	-0,04%	-3,98%	-0,88%	-2,23%	-4,81%	-20,32%	4,00%	1,254%	0,79%
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	-3,54%	-3,11%	-5,68%	-13,27%	-1,33%	6,18%	3,00%	5,667%	15,49%
IBX-50	9,71%	14,53%	10,29%	1,38%	17,73%	34,50%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	9,47%	12,95%	9,24%	0,08%	15,73%	32,63%	0,70%	15,916%	22,21%
IFIX	5,04%	0,72%	4,08%	-4,06%	0,73%	18,90%	-	-	-
HAZ FII - ATCR11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	1,20%	-	-
IPCA	0,45%	3,81%	0,84%	2,86%	4,56%	7,38%	-	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,30%	0,092%	20,81%

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

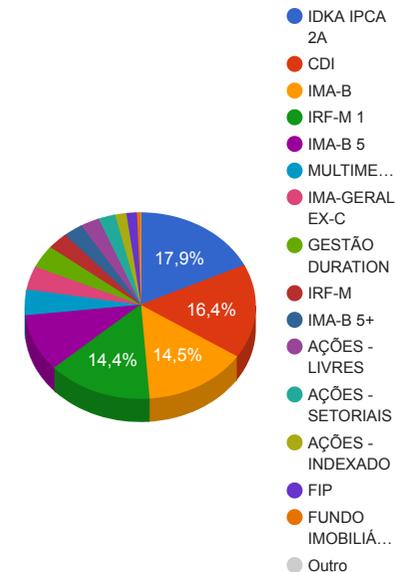
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
S&P 500	-6,94%	1,43%	-3,71%	2,41%	5,30%	27,54%	-	-	-
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	-6,65%	4,26%	-2,76%	4,45%	9,60%	46,38%	1,00%	9,873%	13,52%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	45.466.289,59	35,44%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	37.801.906,49	29,46%
BANCO SANTANDER	28.986.735,36	22,59%
Itaú Unibanco	7.316.233,19	5,70%
RJI Corretora de Valores	3.663.990,30	2,86%
SAFRA SERVIÇOS DE ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA LTDA.	2.044.739,83	1,59%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	1.874.211,09	1,46%
Única Administradora	1.137.337,01	0,89%
Brasil Plural	6.701,72	0,01%



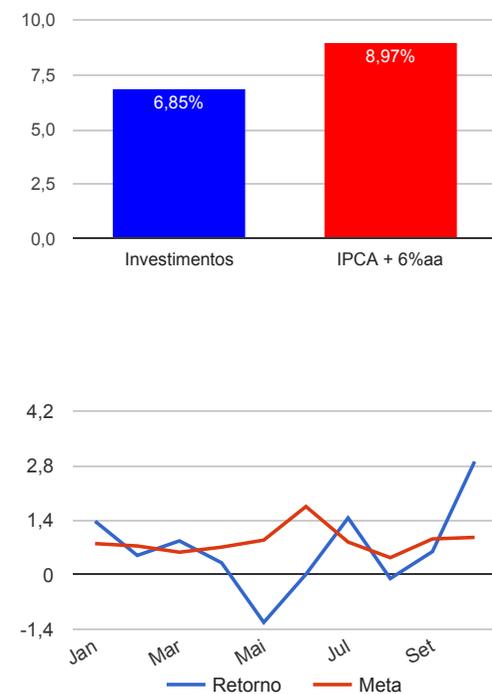
Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	23.017.824,56	17,94%
CDI	21.009.454,51	16,38%
IMA-B	18.619.020,68	14,51%
IRF-M 1	18.505.300,78	14,42%
IMA-B 5	12.761.658,84	9,95%
MULTIMERCADO	5.701.093,47	4,44%
IMA-GERAL EX-C	5.233.082,82	4,08%
GESTÃO DURATION	5.052.289,75	3,94%
IRF-M	3.753.492,29	2,93%
IMA-B 5+	3.544.782,90	2,76%
AÇÕES - LIVRES	3.401.280,45	2,65%
AÇÕES - SETORIAIS	3.060.740,98	2,39%
AÇÕES - INDEXADO	2.008.579,32	1,57%
FIP	1.874.211,09	1,46%
FUNDO IMOBILIÁRIO	748.630,42	0,58%
FIDC - FECHADO	6.701,72	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%
Outubro	124.482.543,27	7.337.713,36	7.140.052,67	128.298.144,58	3.617.940,62	2,90%	0,96%	301,55%	2,21%
Acumulado no ano					8.095.989,71	6,85%	8,97%	76,37%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.206.871,25	0,00	0,00	3.544.782,90	337.911,65	10,54%	5,99%	10,54%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	1.012.966,63	0,00	0,00	1.095.468,02	82.501,39	8,14%	4,91%	8,14%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.318.722,44	0,00	0,00	6.771.170,82	452.448,38	7,16%	4,00%	7,16%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.978.923,56	0,00	0,00	7.472.335,15	493.411,59	7,07%	3,96%	7,07%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.614.106,18	0,00	0,00	3.753.492,29	139.386,11	3,86%	2,18%	3,86%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.056.272,54	0,00	0,00	5.233.082,82	176.810,28	3,50%	1,89%	3,50%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	11.170.622,32	0,00	0,00	11.517.060,06	346.437,74	3,10%	1,60%	3,10%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	355.840,25	0,00	0,00	364.686,81	8.846,56	2,49%	1,24%	2,49%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.642.405,75	0,00	0,00	7.802.111,23	159.705,48	2,09%	0,98%	2,09%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.904.983,07	0,00	0,00	15.215.713,33	310.730,26	2,08%	0,97%	2,08%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.223.663,21	0,00	0,00	1.244.598,78	20.935,57	1,71%	0,75%	1,71%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	2.875.558,56	0,00	0,00	2.915.359,88	39.801,32	1,38%	0,83%	1,38%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.240.360,27	0,00	0,00	8.317.414,18	77.053,91	0,94%	0,27%	0,94%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.529.191,28	0,00	0,00	4.571.531,65	42.340,37	0,93%	0,27%	0,93%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.564.551,27	0,00	0,00	5.616.354,95	51.803,68	0,93%	0,27%	0,93%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	5.026.713,34	0,00	0,00	5.052.289,75	25.576,41	0,51%	0,00%	0,51%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	4.826.463,52	2.642.960,22	1.750.000,00	5.752.634,95	33.211,21	0,44%	0,01%	0,53%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.736.929,22	1.249.753,14	2.598.552,67	4.411.713,32	23.583,63	0,34%	0,03%	0,54%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	10.147.099,85	3.445.000,00	2.791.500,00	10.845.106,24	44.506,39	0,33%	0,00%	0,54%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	7.200,30	0,00	0,00	6.701,72	-498,58	-6,92%	-	-6,93%
Total Renda Fixa					2.866.503,35	2,64%	1,36%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.981.869,45	0,00	0,00	2.263.943,44	282.073,99	14,23%	15,94%	14,23%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	940.082,98	0,00	0,00	1.048.401,03	108.318,05	11,52%	15,42%	11,52%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	915.495,05	0,00	0,00	1.008.214,11	92.719,06	10,13%	15,34%	10,13%
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	913.803,71	0,00	0,00	1.000.365,21	86.561,50	9,47%	15,92%	9,47%
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.838.817,47	0,00	0,00	2.012.339,95	173.522,48	9,44%	13,02%	9,44%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	2.031.667,81	0,00	0,00	2.094.752,62	63.084,81	3,11%	1,75%	3,11%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	2.609.320,83	0,00	0,00	2.657.069,04	47.748,21	1,83%	0,93%	1,83%
HAZ FII - ATCR11	748.214,22	0,00	0,00	748.630,42	416,20	0,06%	-	0,00%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	1.873.737,55	0,00	0,00	1.874.211,09	473,54	0,03%	0,09%	0,03%
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	161.371,61	0,00	0,00	161.313,55	-58,06	-0,04%	1,25%	-0,04%
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	1.011.867,33	0,00	0,00	976.023,46	-35.843,87	-3,54%	5,67%	-3,54%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	1.016.850,45	0,00	0,00	949.271,81	-67.578,64	-6,65%	9,87%	-6,65%
Total Renda Variável					751.437,27	4,68%	8,18%	