

Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2018

SIRU 

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	159.908,57	0,03%	30	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	73.570.159,12	13,75%	522	1,95%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	58.402.955,04	10,91%	168	7,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	39.324.061,94	7,35%	715	0,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	26.630.029,70	4,98%	21	9,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	51.455.298,01	9,61%	209	3,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	6.000.505,68	1,12%	93	1,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	63.491.495,82	11,86%	678	1,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	101.143.107,93	18,90%	78	8,59%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	9.549.351,26	1,78%	3.106	7,62%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	775.795,54	0,14%	798	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	24.268.263,01	4,53%	156	1,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	7.824.853,87	1,46%	34	4,31%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	Não se aplica	Não se aplica	7.639,73	0,00%			Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	19.778,57	0,00%	47	0,37%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	7.768.054,42	1,45%	74	1,52%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BRADERCO H VALUATION IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	4.548.979,48	0,85%	845	6,05%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	D+4	Não há	4.503.008,32	0,84%	88	2,65%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	13.005.768,00	2,43%	1.918	2,94%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	13.375.445,73	2,50%	1.380	0,98%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	5.095.931,36	0,95%	2.440	2,50%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	9.543.100,36	1,78%	2.297	1,85%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

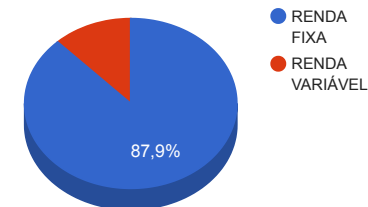
Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	4.863.930,37	0,91%	11.088	0,41%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	2.883.377,60	0,54%	33	1,09%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	Não se aplica	Não se aplica	3.463.305,66	0,65%	102	0,61%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se aplica	Não se aplica	1.241.487,14	0,23%		3,60%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	2.277.113,36	0,43%		3,41%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
TOTAL -			535.192.705,59				

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

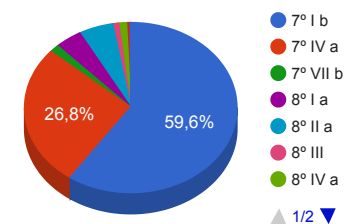
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	319.034.413,88	59,61%	0,00%	69,49%	100,00%	216.158.291,71
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	23,00%	60,00%	321.115.623,35
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	143.561.371,61	26,82%	0,00%	1,00%	40,00%	70.515.710,63
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	27.418,30	0,01%	0,00%	0,01%	5,00%	26.732.216,98
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	7.768.054,42	1,45%	0,00%	1,00%	5,00%	18.991.580,86
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	26.759.635,28
Em Enquadramento - RF	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	26.759.635,28
Total Renda Fixa	100,00%	470.391.258,21	87,89%	4,00	104,50	530,00	-

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%	22.057.755,80	4,12%	0,00%	0,00%	30,00%	138.500.055,88
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	28.014.477,45	5,23%	0,00%	3,00%	20,00%	79.024.063,67
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	4.863.930,37	0,91%	0,00%	1,00%	10,00%	48.655.340,19
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	6.346.683,26	1,19%	0,00%	1,00%	5,00%	20.412.952,02
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	3.518.600,50	0,66%	0,00%	0,05%	5,00%	23.241.034,78
Desenquadrado - RV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	26.759.635,28
Em Enquadramento - RV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	26.759.635,28
Total Renda Variável	30,00%	64.801.447,38	12,11%	4,00	15,05	130,00	-

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 " a "	0,00	0,00%	0,00%	50,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	319.034.413,88	59,61%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	143.561.371,61	26,82%	0,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	27.418,30	0,01%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	7.768.054,42	1,45%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Em Enquadramento - RF	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Total Renda Fixa	470.391.258,21	87,89%	4,00	530,00

Artigos - Renda Variável	Base: agosto / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	22.057.755,80	4,12%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	28.014.477,45	5,23%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	4.863.930,37	0,91%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	6.346.683,26	1,19%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	3.518.600,50	0,66%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RV	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Em Enquadramento - RV	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	64.801.447,38	12,11%	4,00	130,00

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	158.781.254,67	29,67%	0,04%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	151.606.010,58	28,33%	0,01%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	126.892.387,01	23,71%	0,01%
WESTERN ASSET	44.499.728,07	8,31%	0,10%
ITAÚ UNIBANCO	24.268.263,01	4,53%	0,00%
ICATU VANGUARDA	9.549.351,26	1,78%	0,04%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	9.543.100,36	1,78%	0,04%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	3.463.305,66	0,65%	0,02%
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUTURADOS LTDA	2.891.017,33	0,54%	0,02%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	2.277.113,36	0,43%	0,58%
AQ3 ASSET MANAGEMENT	1.241.487,14	0,23%	2,64%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	159.908,57	0,03%	0,00%
VILA RICA CAPITAL	19.778,57	0,00%	0,02%

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
CDI + 3,50% ao ano	0,88%	6,76%	2,56%	5,07%	10,54%	28,18%	-	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-24,63%	-78,04%	-44,36%	-65,87%	-72,74%	-93,69%	0,39%	39,243%	114,68%
110% do CDI	0,62%	4,76%	1,80%	3,57%	7,54%	21,87%	-	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-5,46%	-57,56%	-13,05%	-57,48%	-61,50%	-68,87%	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%
IRF-M 1	0,44%	4,21%	1,65%	3,04%	6,90%	20,96%	-	-	-
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%
IRF-M 1+	-1,47%	2,37%	0,16%	-0,49%	5,50%	26,52%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,65%	2,26%	0,11%	-0,80%	5,12%	25,78%	0,20%	3,056%	4,23%
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	-2,84%	0,69%	-0,60%	-3,01%	3,33%	24,86%	0,30%	4,564%	6,05%
IRF-M	-0,93%	2,91%	0,57%	0,48%	5,93%	25,00%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,96%	2,79%	0,53%	0,37%	5,71%	24,46%	0,20%	2,220%	3,07%
IMA-B 5+	-0,52%	1,88%	1,50%	-3,46%	2,62%	19,51%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,54%	1,76%	1,40%	-3,52%	2,41%	18,99%	0,20%	4,890%	6,82%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	-0,56%	1,76%	1,56%	-3,49%	2,38%	18,92%	0,20%	4,955%	6,85%
IMA-B	-0,45%	3,04%	1,53%	-0,90%	4,57%	20,76%	-	-	-

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
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,44%	3,84%	1,53%	1,25%	5,89%	21,97%	0,20%	2,798%	3,98%
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%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,64%	2,56%	1,25%	-1,34%	4,02%	20,63%	0,20%	3,782%	5,04%
IMA-B 5	-0,26%	4,06%	1,67%	2,14%	6,66%	21,49%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,27%	3,90%	1,61%	2,01%	6,42%	21,03%	0,20%	1,979%	2,83%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	-0,71%	3,56%	1,00%	0,99%	5,93%	22,60%	0,40%	2,785%	4,41%
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%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	-0,36%	5,40%	2,39%	3,38%	8,45%	26,33%	0,20%	1,888%	2,87%

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

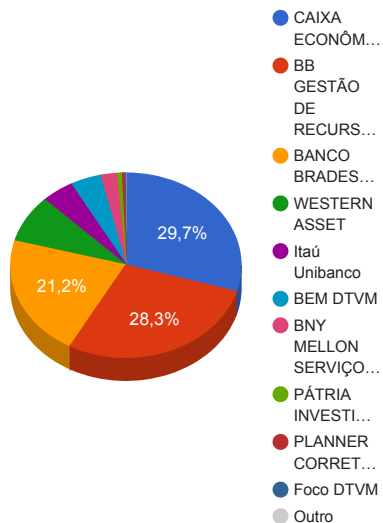
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Global BDRX	13,10%	35,75%	18,54%	35,26%	56,13%	77,70%	-	-	-
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	12,51%	32,99%	17,96%	35,01%	50,24%	68,73%	1,50%	5,596%	14,27%
S&P 500	5,27%	9,73%	7,70%	8,10%	18,70%	35,14%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	3,71%	11,14%	7,87%	9,04%	22,46%	55,06%	1,00%	3,604%	12,16%
SMLL	-4,25%	-8,44%	-3,06%	-11,92%	-2,33%	33,39%	-	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-3,94%	-8,95%	-3,06%	-12,66%	-2,00%	33,66%	1,50%	10,049%	18,31%
IDIV	-3,70%	-3,80%	-1,17%	-11,91%	0,29%	33,84%	-	-	-
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	-2,77%	2,84%	-0,12%	-9,12%	9,05%	38,68%	1,50%	9,817%	18,33%
Ibovespa	-3,21%	0,36%	-0,10%	-10,16%	8,25%	32,43%	-	-	-
BRADESCO H VALUATION IBOVESPA FI AÇÕES	-2,41%	4,42%	-0,36%	-9,15%	13,72%	42,56%	2,00%	9,933%	19,99%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-4,52%	7,36%	-1,93%	-7,48%	15,37%	36,02%	2,00%	11,330%	20,13%
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%
IFIX	-0,70%	-3,91%	-3,37%	-7,44%	2,66%	21,07%	-	-	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,00%	-	0,00%	0,00%	-	0,00%	0,14%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	-13,21%	-17,30%	-33,68%	-17,30%	-21,02%	-53,13%	1,50%	20,766%	37,24%
IPCA	-0,09%	2,85%	1,50%	2,22%	4,19%	6,75%	-	-	-

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

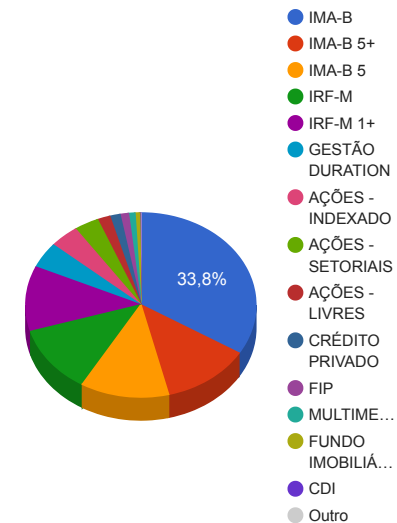
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,30%	0,001%	20,80%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	-	-	-	-	-	-	1,00%	0,273%	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	158.781.254,67	29,67%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	151.606.010,58	28,33%
BANCO BRADESCO	113.516.941,28	21,21%
WESTERN ASSET	44.499.728,07	8,31%
Itaú Unibanco	24.268.263,01	4,53%
BEM DTVM	22.924.796,99	4,28%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	12.426.477,96	2,32%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	3.463.305,66	0,65%
PLANNER CORRETORA	2.277.113,36	0,43%
Foco DTVM	1.241.487,14	0,23%
BANCO SANTANDER	159.908,57	0,03%
BRL Trust Investimentos	19.778,57	0,00%
Brasil Plural	7.639,73	0,00%



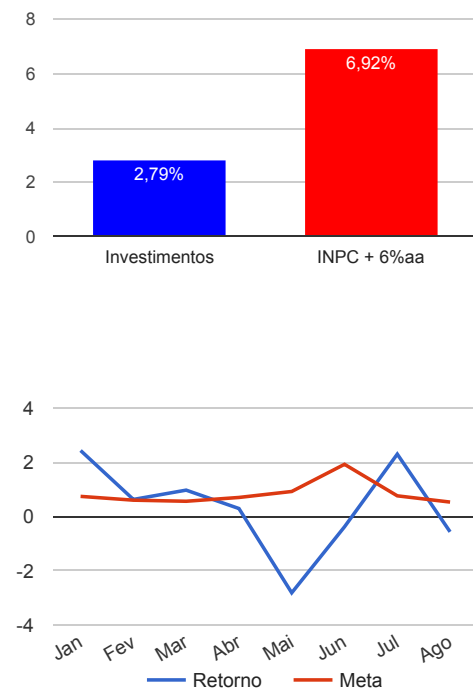
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	180.713.772,73	33,77%
IMA-B 5+	66.227.808,91	12,37%
IMA-B 5	65.954.091,64	12,32%
IRF-M	63.491.495,82	11,86%
IRF-M 1+	61.004.649,27	11,40%
GESTÃO DURATION	24.268.263,01	4,53%
AÇÕES - INDEXADO	22.057.755,80	4,12%
AÇÕES - SETORIAIS	18.471.377,09	3,45%
AÇÕES - LIVRES	9.543.100,36	1,78%
CRÉDITO PRIVADO	7.768.054,42	1,45%
FIP	6.346.683,26	1,19%
MULTIMERCADO	4.863.930,37	0,91%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.518.600,50	0,66%
CDI	775.795,54	0,14%
IRF-M 1	159.908,57	0,03%
FIDC - FECHADO	27.418,30	0,01%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	515.807.497,39	10.444.075,18	16.011.182,45	522.763.526,19	12.523.136,07	2,43%	0,74%	327,57%	1,65%
Fevereiro	522.763.526,19	13.340.335,05	11.777.052,88	527.612.975,14	3.286.166,78	0,63%	0,60%	104,84%	2,16%
Março	527.612.975,14	32.723.163,98	31.230.037,28	534.235.279,92	5.129.178,08	0,97%	0,56%	174,01%	1,73%
Abril	534.235.279,92	20.411.988,27	18.726.904,70	537.487.756,16	1.567.392,67	0,29%	0,70%	41,91%	1,73%
Mai	537.487.756,16	8.506.523,15	7.130.153,50	523.724.602,63	-15.139.523,18	-2,81%	0,92%	-305,77%	2,96%
Junho	523.724.602,63	7.572.161,76	6.073.377,41	523.228.651,46	-1.994.735,52	-0,38%	1,92%	-19,74%	4,26%
Julho	523.228.651,46	7.498.100,81	6.223.063,11	536.540.350,44	12.036.661,28	2,29%	0,76%	301,45%	2,10%
Agosto	536.540.350,44	41.953.463,45	40.258.770,10	535.192.705,59	-3.042.338,20	-0,57%	0,53%	-106,00%	3,75%
Acumulado no ano					14.365.937,98	2,79%	6,92%	40,30%	

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(%)
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	159.266,50	0,00	0,00	159.908,57	642,07	0,40%	0,24%	0,40%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	645.785,75	0,00	648.336,02	0,00	2.550,27	0,39%	0,14%	0,61%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.239.654,12	5.818.845,91	6.307.597,53	775.795,54	24.893,04	0,35%	0,02%	0,55%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	33.020.798,93	0,00	33.135.995,50	0,00	115.196,57	0,35%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	12.613.354,81	11.597.598,42	0,00	24.268.263,01	57.309,78	0,24%	0,23%	0,37%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	39.264.423,26	166.561,45	0,00	39.324.061,94	-106.922,77	-0,27%	1,98%	-0,27%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	7.796.493,10	0,00	0,00	7.768.054,42	-28.438,68	-0,36%	1,89%	-0,36%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.192.761,82	0,00	166.103,45	6.000.505,68	-26.152,69	-0,42%	2,80%	-0,44%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	7.868.587,49	0,00	0,00	7.824.853,87	-43.733,62	-0,56%	4,96%	-0,56%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	65.058.520,09	8.932.334,89	0,00	73.570.159,12	-420.695,86	-0,57%	3,48%	-0,46%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	101.795.575,75	0,00	0,00	101.143.107,93	-652.467,82	-0,64%	3,78%	-0,64%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	24.824.463,50	2.000.000,00	0,00	26.630.029,70	-194.433,80	-0,72%	2,78%	-0,71%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	50.376.113,39	8.467.723,45	0,00	58.402.955,04	-440.881,80	-0,75%	4,89%	-0,54%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	64.104.188,25	0,00	0,00	63.491.495,82	-612.692,43	-0,96%	2,22%	-0,96%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	52.320.865,06	0,00	0,00	51.455.298,01	-865.567,05	-1,65%	3,06%	-1,65%
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	9.828.350,91	0,00	0,00	9.549.351,26	-278.999,65	-2,84%	4,56%	-2,84%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR 1	8.080,81	0,00	0,00	7.639,73	-441,08	-5,46%	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR	26.241,30	0,00	737,60	19.778,57	-5.725,13	-21,82%	39,24%	-24,63%
Total Renda Fixa					-3.476.560,65	-0,73%	3,18%	

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(%)
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	11.559.958,57	0,00	0,00	13.005.768,00	1.445.809,43	12,51%	5,60%	12,51%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	4.690.115,88	0,00	0,00	4.863.930,37	173.814,49	3,71%	3,60%	3,71%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	2.269.835,92	0,00	0,00	2.277.113,36	7.277,44	0,32%	-	0,32%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	3.458.155,30	0,00	0,00	3.463.305,66	5.150,36	0,15%	0,27%	0,15%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	2.884.182,88	0,00	0,00	2.883.377,60	-805,28	-0,03%	0,00%	-0,03%
BRDESCO H VALUATION IBOVESPA FI AÇÕES	4.661.507,29	0,00	0,00	4.548.979,48	-112.527,81	-2,41%	9,93%	-2,41%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	4.819.211,11	4.970.399,33	0,00	9.543.100,36	-246.510,08	-2,52%	11,33%	-4,52%
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	13.756.132,15	0,00	0,00	13.375.445,73	-380.686,42	-2,77%	9,82%	-2,77%
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	4.656.818,80	0,00	0,00	4.503.008,32	-153.810,48	-3,30%	11,17%	-3,30%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	5.304.914,73	0,00	0,00	5.095.931,36	-208.983,37	-3,94%	10,05%	-3,94%
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.335.992,97	0,00	0,00	1.241.487,14	-94.505,83	-7,07%	20,77%	-13,21%
Total Renda Variável					434.222,45	0,67%	8,05%	