

# Relatório Analítico dos Investimentos em julho de 2018

SIRU 

## Carteira consolidada de investimentos - base (julho / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	33.020.798,93	6,15%	223	1,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	65.058.520,09	12,13%	530	1,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	50.376.113,39	9,39%	173	5,96%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	39.264.423,26	7,32%	709	0,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	52.320.865,06	9,75%	210	2,90%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	24.824.463,50	4,63%	20	9,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	645.785,75	0,12%	192	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	64.104.188,25	11,95%	694	1,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	159.266,50	0,03%	30	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	6.192.761,82	1,15%	93	1,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	101.795.575,75	18,97%	82	8,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	9.828.350,91	1,83%	3.460	7,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	1.239.654,12	0,23%	783	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	7.868.587,49	1,47%	35	4,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	12.613.354,81	2,35%	145	0,69%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	Não se aplica	Não se aplica	8.080,81	0,00%			Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	26.241,30	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	7.796.493,10	1,45%	72	1,61%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BRADERCO H VALUATION IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	4.661.507,29	0,87%	851	6,29%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	11.559.958,57	2,15%	1.270	3,14%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	D+4	Não há	4.656.818,80	0,87%	83	3,06%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	5.304.914,73	0,99%	2.531	2,35%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

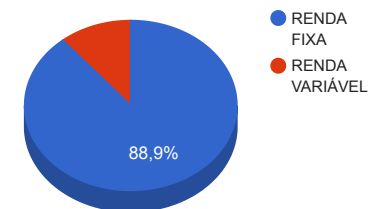
Carteira consolidada de investimentos - base (julho / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	4.819.211,11	0,90%	2.291	0,91%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	13.756.132,15	2,56%	1.385	0,97%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	4.690.115,88	0,87%	10.825	0,44%	Artigo 8º, Inciso III
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	Não se aplica	Não se aplica	3.458.155,30	0,64%	101	0,61%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	2.884.182,88	0,54%	33	1,09%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se aplica	Não se aplica	1.335.992,97	0,25%		3,37%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	2.269.835,92	0,42%		3,41%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
		<b>TOTAL -</b>	<b>536.540.350,44</b>				

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

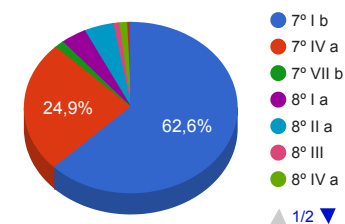
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	335.967.186,55	62,62%	0,00%	69,49%	100,00%	200.573.163,89
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	23,00%	60,00%	321.924.210,26
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	133.345.523,08	24,85%	0,00%	1,00%	40,00%	81.270.617,10
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	34.322,11	0,01%	0,00%	0,01%	5,00%	26.792.695,41
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	7.796.493,10	1,45%	0,00%	1,00%	5,00%	19.030.524,42
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	26.827.017,52
Em Enquadramento - RF	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	26.827.017,52
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>477.143.524,84</b>	<b>88,93%</b>	<b>4,00</b>	<b>104,50</b>	<b>530,00</b>	<b>-</b>

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%	20.878.284,66	3,89%	0,00%	0,00%	30,00%	140.083.820,47
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	23.880.257,99	4,45%	0,00%	3,00%	20,00%	83.427.812,10
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	4.690.115,88	0,87%	0,00%	1,00%	10,00%	48.963.919,16
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	6.342.338,18	1,18%	0,00%	1,00%	5,00%	20.484.679,34
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	3.605.828,89	0,67%	0,00%	0,05%	5,00%	23.221.188,63
Desenquadrado - RV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	26.827.017,52
Em Enquadramento - RV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	26.827.017,52
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>59.396.825,60</b>	<b>11,07%</b>	<b>4,00</b>	<b>15,05</b>	<b>130,00</b>	<b>-</b>

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: julho / 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 "	335.967.186,55	62,62%	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 "	133.345.523,08	24,85%	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 "	34.322,11	0,01%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	7.796.493,10	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%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>477.143.524,84</b>	<b>88,93%</b>	<b>4,00</b>	<b>530,00</b>

Artigos - Renda Variável	Base: julho / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	20.878.284,66	3,89%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	23.880.257,99	4,45%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	4.690.115,88	0,87%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	6.342.338,18	1,18%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	3.605.828,89	0,67%	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%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>59.396.825,60</b>	<b>11,07%</b>	<b>4,00</b>	<b>130,00</b>

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (julho / 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	184.943.934,17	34,47%	0,05%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	145.037.403,13	27,03%	0,01%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	128.081.802,68	23,87%	0,01%
WESTERN ASSET	41.074.537,95	7,66%	0,09%
ITAÚ UNIBANCO	12.613.354,81	2,35%	0,00%
ICATU VANGUARDA	9.828.350,91	1,83%	0,04%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	4.819.211,11	0,90%	0,02%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	3.458.155,30	0,64%	0,02%
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUTURADOS LTDA	2.892.263,69	0,54%	0,02%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	2.269.835,92	0,42%	0,58%
AQ3 ASSET MANAGEMENT	1.335.992,97	0,25%	19,12%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	159.266,50	0,03%	0,00%
VILA RICA CAPITAL	26.241,30	0,00%	0,08%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	3,15%	2,41%	-2,71%	-2,42%	4,57%	21,18%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	3,12%	2,33%	-2,66%	-2,43%	4,32%	20,61%	0,20%	2,891%	6,34%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,08%	2,31%	-2,72%	-2,48%	4,33%	20,61%	0,20%	2,868%	6,32%
IMA-B	2,32%	3,50%	-1,23%	0,09%	6,45%	22,38%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2,34%	3,22%	-1,48%	-0,16%	6,15%	22,53%	0,20%	1,942%	4,60%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,29%	3,35%	-1,29%	-0,03%	6,18%	21,82%	0,20%	1,855%	4,43%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,83%	4,30%	-0,52%	2,26%	7,94%	24,02%	0,20%	1,404%	3,64%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,51%	2,01%	2,45%	0,96%	2,01%	8,35%	0,20%	0,214%	3,87%
IRF-M 1+	1,79%	3,90%	-1,02%	2,31%	8,26%	29,52%	-	-	-
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	2,53%	3,63%	-2,01%	1,41%	7,47%	29,50%	0,30%	2,664%	5,41%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,94%	3,98%	-0,97%	2,29%	8,00%	29,04%	0,20%	1,816%	3,83%
IDKA IPCA 2 Anos	1,59%	4,62%	0,73%	3,82%	8,98%	24,99%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,50%	4,78%	2,44%	3,70%	7,68%	20,43%	0,20%	0,211%	0,64%
IMA-B 5	1,48%	4,33%	0,35%	2,95%	8,27%	23,13%	-	-	-
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	2,05%	4,31%	-0,81%	2,67%	8,00%	24,77%	0,40%	1,515%	4,08%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,46%	4,18%	0,27%	2,83%	8,03%	22,65%	0,20%	0,926%	2,58%
IRF-M	1,47%	3,88%	-0,36%	2,55%	8,06%	27,41%	-	-	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,48%	3,78%	-0,39%	2,46%	7,83%	26,90%	0,20%	1,337%	2,79%
CDI + 3,50% ao ano	0,84%	5,82%	2,48%	4,89%	10,80%	29,00%	-	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-19,31%	-70,86%	-51,43%	-78,41%	-64,99%	-91,65%	0,39%	32,115%	111,81%
IRF-M 1	0,66%	3,76%	1,41%	3,15%	7,39%	21,86%	-	-	-
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,68%	3,62%	1,36%	3,04%	7,17%	21,56%	0,00%	0,200%	0,50%
110% do CDI	0,60%	4,11%	1,75%	3,45%	7,82%	22,74%	-	-	-
TRENBANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-4,25%	-55,11%	-30,21%	-53,37%	-64,74%	-70,97%	0,00%	-	-
CDI	0,54%	3,73%	1,59%	3,13%	7,08%	20,47%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,52%	3,68%	1,54%	3,09%	7,11%	20,69%	0,20%	0,015%	0,08%
IPCA	0,33%	2,94%	2,00%	2,64%	4,48%	7,32%	-	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	2,64%	5,78%	1,44%	4,37%	10,34%	28,63%	0,20%	1,437%	2,65%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,57%	4,48%	0,81%	2,95%	8,34%	-	0,40%	0,063%	1,66%

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

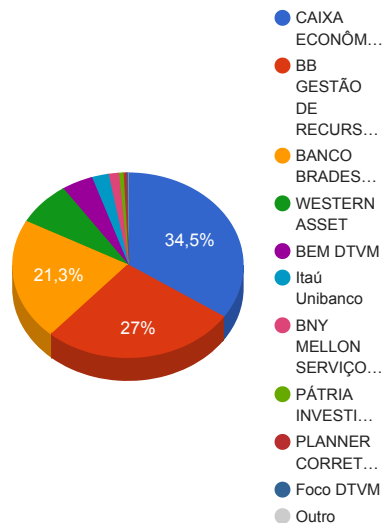
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IBX-50	8,91%	3,84%	-8,08%	-7,05%	20,17%	37,91%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	9,06%	3,40%	-8,39%	-7,63%	21,36%	35,09%	0,70%	7,453%	19,21%
Ibovespa	8,88%	3,69%	-8,01%	-6,70%	20,18%	38,24%	-	-	-
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	7,39%	12,45%	-6,14%	-1,18%	30,54%	44,84%	2,00%	8,368%	19,14%
BRAPRES H VALUATION IBOVESPA FI AÇÕES	6,38%	7,00%	-8,42%	-5,01%	26,53%	46,26%	2,00%	7,836%	19,31%
IDIV	7,27%	-0,10%	-8,17%	-9,08%	11,40%	41,60%	-	-	-
BRAPRES DIVIDENDOS FI AÇÕES	8,54%	5,76%	-8,47%	-4,99%	18,70%	43,11%	1,50%	6,331%	17,59%
SMLL	5,09%	-4,38%	-10,21%	-8,35%	10,75%	39,56%	-	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	5,55%	-5,21%	-10,27%	-9,36%	10,98%	38,00%	1,50%	6,045%	17,47%
S&P 500	2,61%	4,23%	5,24%	-1,31%	12,81%	28,21%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	3,85%	7,17%	7,51%	1,69%	19,36%	51,19%	1,00%	4,218%	12,25%
IFIX	1,37%	-3,23%	-7,82%	-5,72%	4,27%	24,10%	-	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,00%	-4,71%	-23,58%	-4,71%	-26,36%	-46,00%	1,50%	0,000%	37,67%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	-	-	0,00%	0,00%	-	0,00%	0,14%	-	-
Global BDRX	0,48%	20,02%	14,83%	18,09%	39,58%	56,79%	-	-	-
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,71%	18,20%	13,97%	16,62%	36,21%	48,51%	1,50%	5,856%	14,27%
IPCA	0,33%	2,94%	2,00%	2,64%	4,48%	7,32%	-	-	-

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

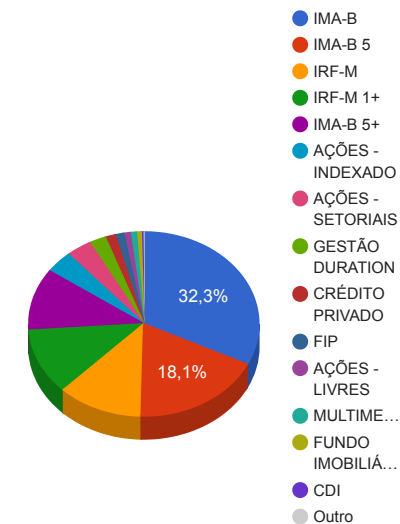
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,30%	0,006%	20,80%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	-	-	-	-	-	-	1,00%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	184.943.934,17	34,47%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	145.037.403,13	27,03%
BANCO BRADESCO	114.325.670,53	21,31%
WESTERN ASSET	41.074.537,95	7,66%
BEM DTVM	23.584.483,06	4,40%
Itaú Unibanco	12.613.354,81	2,35%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	7.703.393,99	1,44%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	3.458.155,30	0,64%
PLANNER CORRETORA	2.269.835,92	0,42%
Foco DTVM	1.335.992,97	0,25%
BANCO SANTANDER	159.266,50	0,03%
BRL Trust Investimentos	26.241,30	0,00%
Brasil Plural	8.080,81	0,00%



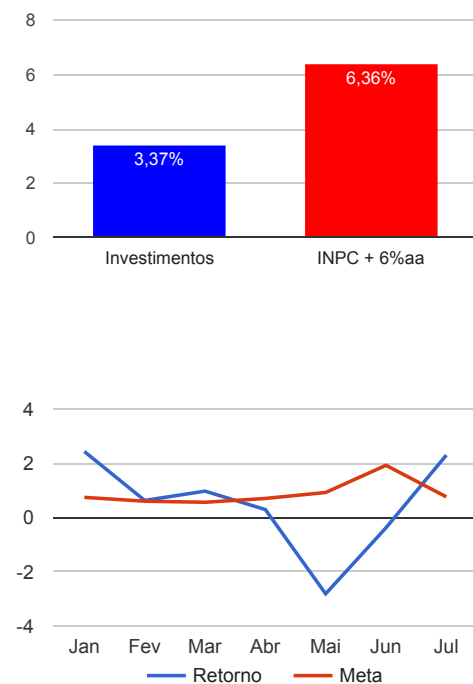
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	173.046.857,66	32,25%
IMA-B 5	97.109.685,69	18,10%
IRF-M	64.104.188,25	11,95%
IRF-M 1+	62.149.215,97	11,58%
IMA-B 5+	58.244.700,88	10,86%
AÇÕES - INDEXADO	20.878.284,66	3,89%
AÇÕES - SETORIAIS	19.061.046,88	3,55%
GESTÃO DURATION	12.613.354,81	2,35%
CRÉDITO PRIVADO	7.796.493,10	1,45%
FIP	6.342.338,18	1,18%
AÇÕES - LIVRES	4.819.211,11	0,90%
MULTIMERCADO	4.690.115,88	0,87%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.605.828,89	0,67%
CDI	1.239.654,12	0,23%
IDKA IPCA 2A	645.785,75	0,12%
IRF-M 1	159.266,50	0,03%
FIDC - FECHADO	34.322,11	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%
Acumulado no ano					17.408.276,18	3,37%	6,36%	53,08%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	7.630.361,49	0,00	0,00	7.868.587,49	238.226,00	3,12%	2,89%	3,12%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	48.870.599,85	0,00	0,00	50.376.113,39	1.505.513,54	3,08%	2,87%	3,08%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	7.595.834,51	0,00	0,00	7.796.493,10	200.658,59	2,64%	1,44%	2,64%
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	9.585.802,94	0,00	0,00	9.828.350,91	242.547,97	2,53%	2,66%	2,53%
BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	99.464.932,57	0,00	0,00	101.795.575,75	2.330.643,18	2,34%	1,94%	2,34%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	58.668.255,04	5.000.000,00	0,00	65.058.520,09	1.390.265,05	2,18%	1,86%	2,29%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	24.326.413,13	0,00	0,00	24.824.463,50	498.050,37	2,05%	1,52%	2,05%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	51.323.311,12	0,00	0,00	52.320.865,06	997.553,94	1,94%	1,82%	1,94%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.081.574,41	0,00	0,00	6.192.761,82	111.187,41	1,83%	1,40%	1,83%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	63.167.341,06	0,00	0,00	64.104.188,25	936.847,19	1,48%	1,34%	1,48%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	38.698.696,51	0,00	0,00	39.264.423,26	565.726,75	1,46%	0,93%	1,46%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	164.213,25	0,00	6.037,59	159.266,50	1.090,84	0,66%	0,20%	0,68%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	12.541.928,70	0,00	0,00	12.613.354,81	71.426,11	0,57%	0,06%	0,57%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	32.854.733,23	0,00	0,00	33.020.798,93	166.065,70	0,51%	0,21%	0,51%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	642.547,78	0,00	0,00	645.785,75	3.237,97	0,50%	0,21%	0,50%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	4.929.179,95	2.498.100,81	6.217.025,52	1.239.654,12	29.398,88	0,40%	0,02%	0,52%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	8.438,83	0,00	0,00	8.080,81	-358,02	-4,24%	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	32.519,21	0,00	0,00	26.241,30	-6.277,91	-19,31%	32,11%	-19,31%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>9.281.803,56</b>	<b>1,98%</b>	<b>1,67%</b>	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	4.269.979,16	0,00	0,00	4.656.818,80	386.839,64	9,06%	7,45%	9,06%
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	12.673.718,96	0,00	0,00	13.756.132,15	1.082.413,19	8,54%	6,33%	8,54%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	4.487.546,23	0,00	0,00	4.819.211,11	331.664,88	7,39%	8,37%	7,39%
BRADESCO H VALUATION IBOVESPA FI AÇÕES	4.381.896,20	0,00	0,00	4.661.507,29	279.611,09	6,38%	7,84%	6,38%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	5.026.027,38	0,00	0,00	5.304.914,73	278.887,35	5,55%	6,05%	5,55%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	4.516.317,45	0,00	0,00	4.690.115,88	173.798,43	3,85%	4,22%	3,85%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	11.365.952,12	0,00	0,00	11.559.958,57	194.006,45	1,71%	5,86%	1,71%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	2.237.056,71	0,00	0,00	2.269.835,92	32.779,21	1,47%	-	1,47%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP	2.885.045,72	0,00	0,00	2.884.182,88	-862,84	-0,03%	0,01%	-0,03%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	3.460.055,52	0,00	0,00	3.458.155,30	-1.900,22	-0,05%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.338.372,43	0,00	0,00	1.335.992,97	-2.379,46	-0,18%	0,00%	0,00%
Total Renda Variável					2.754.857,72	4,86%	5,93%	