

Relatório Analítico dos Investimentos em outubro de 2018

SIRU 

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	162.350,95	0,03%	27	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	54.535.946,04	9,60%	164	8,51%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	78.829.464,80	13,88%	505	2,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	84.932.586,93	14,95%	701	0,91%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	28.005.530,62	4,93%	21	9,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	27.386.345,88	4,82%	202	1,88%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	6.284.734,80	1,11%	93	1,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	33.290.406,11	5,86%	657	0,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	27.046.503,00	4,76%	815	0,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	8.555.451,08	1,51%	30	5,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	24.493.516,30	4,31%	185	1,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	10.458.875,03	1,84%	2.579	11,76%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	108.411.427,46	19,08%	78	9,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR 1	Não se aplica	Não se aplica	6.709,93	0,00%			Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ITÁLIA FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	6.819,41	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	8.063.107,64	1,42%	73	1,53%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	D+4	Não há	5.086.941,40	0,90%	89	2,59%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BRADERCO H VALUATION IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	5.230.776,24	0,92%	813	7,09%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	10.876.235,12	1,91%	1.993	2,77%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	11.062.715,40	1,95%	2.819	1,72%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	15.284.791,19	2,69%	1.395	0,96%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	5.584.304,40	0,98%	2.267	2,57%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

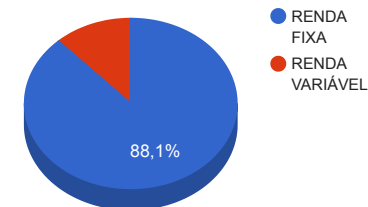
Carteira consolidada de investimentos - base (outubro / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	4.559.257,87	0,80%	10.820	0,42%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	2.883.401,68	0,51%	33	1,09%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	Não se aplica	Não se aplica	3.463.599,20	0,61%	102	0,61%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	2.333.170,73	0,41%		3,41%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se aplica	Não se aplica	1.237.350,16	0,22%		3,15%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
TOTAL -			568.072.319,37				

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

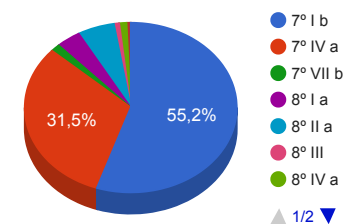
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	313.427.366,13	55,17%	0,00%	69,49%	100,00%	254.644.953,24
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	23,00%	60,00%	340.843.391,62
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	178.965.772,87	31,50%	0,00%	1,00%	40,00%	48.263.154,88
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	13.529,34	0,00%	0,00%	0,01%	5,00%	28.390.086,63
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	8.063.107,64	1,42%	0,00%	1,00%	5,00%	20.340.508,33
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	28.403.615,97
Em Enquadramento - RF	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	28.403.615,97
Total Renda Fixa	100,00%	500.469.775,98	88,10%	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%	21.193.952,76	3,73%	0,00%	0,00%	30,00%	149.227.743,05
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	31.931.810,99	5,62%	0,00%	3,00%	20,00%	81.682.652,88
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	4.559.257,87	0,80%	0,00%	1,00%	10,00%	52.247.974,07
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	6.347.000,88	1,12%	0,00%	1,00%	5,00%	22.056.615,09
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	3.570.520,89	0,63%	0,00%	0,05%	5,00%	24.833.095,08
Desenquadrado - RV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	28.403.615,97
Em Enquadramento - RV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	28.403.615,97
Total Renda Variável	30,00%	67.602.543,39	11,90%	4,00	15,05	130,00	-

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 " a "	0,00	0,00%	0,00%	50,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	313.427.366,13	55,17%	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 "	178.965.772,87	31,50%	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 "	13.529,34	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	8.063.107,64	1,42%	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	500.469.775,98	88,10%	4,00	530,00

Artigos - Renda Variável	Base: outubro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	21.193.952,76	3,73%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	31.931.810,99	5,62%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	4.559.257,87	0,80%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	6.347.000,88	1,12%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	3.570.520,89	0,63%	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	67.602.543,39	11,90%	4,00	130,00

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	177.526.124,65	31,25%	0,04%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	153.514.216,35	27,02%	0,01%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	137.482.445,97	24,20%	0,01%
WESTERN ASSET	43.441.023,61	7,65%	0,09%
ITAÚ UNIBANCO	24.493.516,30	4,31%	0,00%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	11.062.715,40	1,95%	0,04%
ICATU VANGUARDA	10.458.875,03	1,84%	0,04%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	3.463.599,20	0,61%	0,02%
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUTURADOS LTDA	2.890.111,61	0,51%	0,02%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	2.333.170,73	0,41%	1,13%
AQ3 ASSET MANAGEMENT	1.237.350,16	0,22%	2,20%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	162.350,95	0,03%	0,00%
VILA RICA CAPITAL	6.819,41	0,00%	0,01%

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%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10,50%	11,29%	8,77%	5,82%	10,54%	27,11%	0,20%	5,961%	7,89%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	10,50%	11,26%	8,73%	5,84%	10,52%	26,98%	0,20%	5,982%	7,92%
IMA-B	7,14%	10,23%	6,50%	5,19%	10,29%	26,38%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	7,43%	9,93%	6,50%	4,93%	9,96%	26,29%	0,20%	4,175%	5,76%
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 X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,15%	8,76%	4,27%	3,73%	9,36%	25,53%	0,20%	2,216%	4,25%
IRF-M 1+	4,71%	8,87%	4,79%	3,72%	10,37%	29,74%	-	-	-
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	7,52%	10,28%	6,42%	4,28%	11,71%	30,95%	0,30%	4,663%	6,87%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5,07%	8,97%	4,80%	3,78%	10,39%	29,14%	0,20%	2,989%	4,69%
IRF-M	3,59%	7,99%	3,96%	3,58%	9,43%	27,10%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,58%	7,83%	3,91%	3,50%	9,22%	26,51%	0,20%	2,131%	3,38%
IMA-B 5	3,10%	8,23%	3,75%	4,10%	9,30%	24,04%	-	-	-
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	4,11%	8,91%	4,41%	3,57%	9,92%	26,00%	0,40%	2,149%	4,64%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,10%	8,03%	3,70%	3,98%	9,07%	23,54%	0,20%	1,607%	3,05%
IRF-M 1	0,92%	5,81%	1,97%	3,41%	7,06%	20,23%	-	-	-
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%

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
CDI + 3,50% ao ano	0,85%	8,44%	2,48%	5,02%	10,25%	26,73%	-	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-55,58%	-92,43%	-74,01%	-87,38%	-89,96%	-92,86%	0,39%	182,175%	161,19%
110% do CDI	0,60%	5,93%	1,75%	3,52%	7,22%	20,36%	-	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-6,93%	-62,73%	-16,96%	-42,04%	-68,09%	-77,93%	0,00%	-	-
CDI	0,54%	5,38%	1,59%	3,20%	6,55%	18,35%	-	-	-
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%	-	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	2,89%	9,40%	3,42%	4,90%	10,69%	28,18%	0,20%	1,424%	3,01%
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)

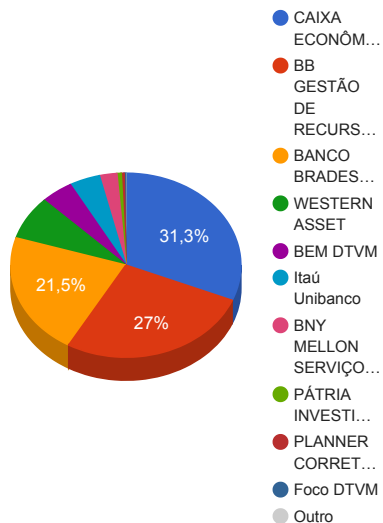
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	12,59%	1,07%	5,69%	-5,10%	5,55%	37,47%	-	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	12,00%	-0,22%	5,27%	-5,54%	4,20%	36,08%	1,50%	13,924%	20,00%
IDIV	11,44%	7,39%	7,50%	-1,29%	5,19%	30,43%	-	-	-
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	10,45%	17,51%	11,11%	1,70%	20,55%	44,41%	1,50%	14,343%	20,26%
Ibovespa	10,19%	14,43%	10,35%	1,52%	17,65%	34,66%	-	-	-
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	12,44%	24,46%	10,68%	3,89%	25,37%	41,38%	2,00%	16,479%	22,42%
BRADESCO H VALUATION IBOVESPA FI AÇÕES	11,18%	20,07%	12,21%	2,77%	22,66%	46,57%	2,00%	15,894%	21,68%
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%	-	-	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,00%	-	0,00%	0,00%	-	0,00%	0,14%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,00%	-5,88%	-1,23%	-24,53%	-5,88%	-20,81%	1,50%	0,000%	38,07%
IPCA	0,45%	3,81%	0,84%	2,86%	4,56%	7,38%	-	-	-
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	-	-	-	-	-	-	1,00%	0,249%	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,30%	0,092%	20,81%
Global BDRX	-14,26%	15,88%	-3,45%	10,87%	23,42%	55,12%	-	-	-
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-16,39%	11,21%	-5,91%	7,23%	17,75%	45,47%	1,50%	9,290%	15,92%

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

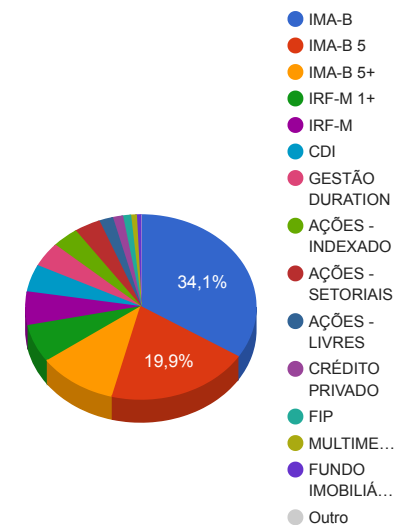
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
S&P 500	-6,94%	1,43%	-3,71%	2,41%	5,30%	27,54%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-6,70%	4,18%	-2,79%	4,51%	9,47%	45,37%	1,00%	10,008%	13,68%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	177.526.124,65	31,25%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	153.514.216,35	27,02%
BANCO BRADESCO	122.197.654,78	21,51%
WESTERN ASSET	43.441.023,61	7,65%
BEM DTVM	25.743.666,22	4,53%
Itaú Unibanco	24.493.516,30	4,31%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	13.946.117,08	2,45%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	3.463.599,20	0,61%
PLANNER CORRETORA	2.333.170,73	0,41%
Foco DTVM	1.237.350,16	0,22%
BANCO SANTANDER	162.350,95	0,03%
BRL Trust Investimentos	6.819,41	0,00%
Brasil Plural	6.709,93	0,00%



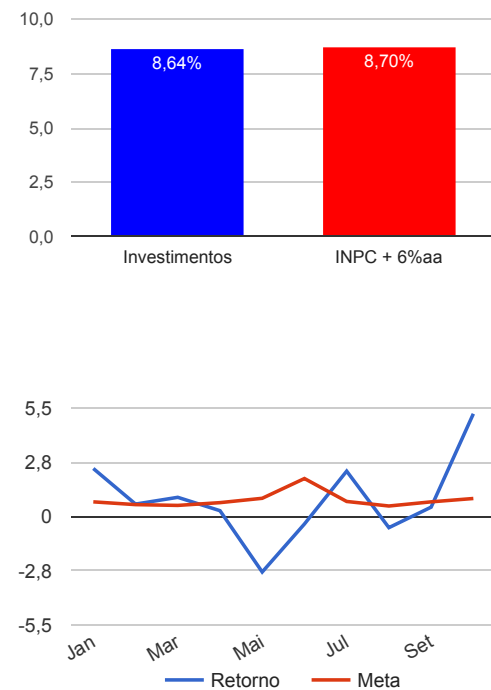
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	193.525.627,06	34,07%
IMA-B 5	112.938.117,55	19,88%
IMA-B 5+	63.091.397,12	11,11%
IRF-M 1+	37.845.220,91	6,66%
IRF-M	33.290.406,11	5,86%
CDI	27.046.503,00	4,76%
GESTÃO DURATION	24.493.516,30	4,31%
AÇÕES - INDEXADO	21.193.952,76	3,73%
AÇÕES - SETORIAIS	20.869.095,59	3,67%
AÇÕES - LIVRES	11.062.715,40	1,95%
CRÉDITO PRIVADO	8.063.107,64	1,42%
FIP	6.347.000,88	1,12%
MULTIMERCADO	4.559.257,87	0,80%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.570.520,89	0,63%
IRF-M 1	162.350,95	0,03%
FIDC - FECHADO	13.529,34	0,00%



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%
Setembro	535.192.705,59	74.007.383,09	73.031.633,87	538.700.119,78	2.531.664,97	0,47%	0,74%	63,67%	2,31%
Outubro	538.700.119,78	8.149.509,15	6.845.744,88	568.072.319,37	28.068.435,32	5,20%	0,91%	569,92%	4,17%
Acumulado no ano					44.966.038,27	8,64%	8,70%	99,35%	

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(%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	49.351.613,49	0,00	0,00	54.535.946,04	5.184.332,55	10,50%	5,96%	10,50%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	7.742.622,63	0,00	0,00	8.555.451,08	812.828,45	10,50%	5,98%	10,50%
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	9.727.244,44	0,00	0,00	10.458.875,03	731.630,59	7,52%	4,66%	7,52%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	100.916.833,19	0,00	0,00	108.411.427,46	7.494.594,27	7,43%	4,18%	7,43%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	73.451.269,36	183.183,00	0,00	78.829.464,80	5.195.012,44	7,06%	3,96%	7,07%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	26.065.895,73	0,00	0,00	27.386.345,88	1.320.450,15	5,07%	2,99%	5,07%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.034.346,15	0,00	0,00	6.284.734,80	250.388,65	4,15%	2,22%	4,15%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	26.900.073,43	0,00	0,00	28.005.530,62	1.105.457,19	4,11%	2,15%	4,11%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	32.139.198,81	0,00	0,00	33.290.406,11	1.151.207,30	3,58%	2,13%	3,58%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	74.473.035,26	7.965.829,89	0,00	84.932.586,93	2.493.721,78	3,02%	1,61%	3,10%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	7.836.921,46	0,00	0,00	8.063.107,64	226.186,18	2,89%	1,42%	2,89%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	160.853,47	0,00	0,00	162.350,95	1.497,48	0,93%	0,27%	0,93%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	24.369.521,82	0,00	0,00	24.493.516,30	123.994,48	0,51%	0,00%	0,51%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	33.718.382,02	496,26	6.842.752,46	27.046.503,00	170.377,18	0,51%	0,01%	0,53%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	7.209,13	0,00	0,00	6.709,93	-499,20	-6,92%	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	15.352,61	0,00	2.992,42	6.819,41	-5.540,78	-36,09%	182,18%	-55,58%
Total Renda Fixa					26.255.638,71	5,54%	3,13%	

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(%)
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	9.838.361,67	0,00	0,00	11.062.715,40	1.224.353,73	12,44%	16,48%	12,44%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	4.986.000,13	0,00	0,00	5.584.304,40	598.304,27	12,00%	13,92%	12,00%
BRADESCO H VALUATION IBOVESPA FI AÇÕES	4.704.963,74	0,00	0,00	5.230.776,24	525.812,50	11,18%	15,89%	11,18%
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	13.839.155,97	0,00	0,00	15.284.791,19	1.445.635,22	10,45%	14,34%	10,45%
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	4.646.768,83	0,00	0,00	5.086.941,40	440.172,57	9,47%	15,92%	9,47%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	2.296.288,05	0,00	0,00	2.333.170,73	36.882,68	1,61%	-	1,61%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	3.460.672,42	0,00	0,00	3.463.599,20	2.926,78	0,08%	0,25%	0,08%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	2.882.673,16	0,00	0,00	2.883.401,68	728,52	0,03%	0,09%	0,03%
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.239.500,28	0,00	0,00	1.237.350,16	-2.150,12	-0,17%	0,00%	0,00%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	4.886.681,62	0,00	0,00	4.559.257,87	-327.423,75	-6,70%	10,01%	-6,70%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	13.008.680,91	0,00	0,00	10.876.235,12	-2.132.445,79	-16,39%	9,29%	-16,39%
Total Renda Variável					1.812.796,61	2,76%	12,12%	