

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

SIRU 

## 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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	160.853,47	0,03%	27	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	73.451.269,36	13,63%	507	2,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	49.351.613,49	9,16%	164	6,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	74.473.035,26	13,82%	701	0,92%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	26.900.073,43	4,99%	21	9,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	26.065.895,73	4,84%	192	2,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	6.034.346,15	1,12%	93	1,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	32.139.198,81	5,97%	650	0,66%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	100.916.833,19	18,73%	79	9,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	9.727.244,44	1,81%	2.739	10,84%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	33.718.382,02	6,26%	814	0,59%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	24.369.521,82	4,52%	171	1,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	7.742.622,63	1,44%	32	4,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR 1	Não se aplica	Não se aplica	7.209,13	0,00%			Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ITÁLIA FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	15.352,61	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	7.836.921,46	1,45%	73	1,53%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BRADERCO H VALUATION IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	4.704.963,74	0,87%	831	6,12%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	D+4	Não há	4.646.768,83	0,86%	88	2,59%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	13.008.680,91	2,41%	2.500	2,59%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	13.839.155,97	2,57%	1.369	0,99%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	4.986.000,13	0,93%	2.337	2,58%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	9.838.361,67	1,83%	2.212	1,86%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

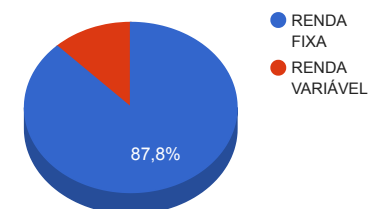
Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	4.886.681,62	0,91%	11.415	0,40%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	2.882.673,16	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	3.460.672,42	0,64%	102	0,61%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se aplica	Não se aplica	1.239.500,28	0,23%		3,15%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	2.296.288,05	0,43%		3,41%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
<b>TOTAL -</b>			<b>538.700.119,78</b>				

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

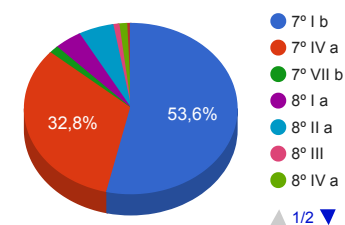
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	288.576.285,70	53,57%	0,00%	69,49%	100,00%	250.123.834,08
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	23,00%	60,00%	323.220.071,87
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	176.474.604,10	32,76%	0,00%	1,00%	40,00%	39.005.443,81
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	22.561,74	0,00%	0,00%	0,01%	5,00%	26.912.444,25
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	7.836.921,46	1,45%	0,00%	1,00%	5,00%	19.098.084,53
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	26.935.005,99
Em Enquadramento - RF	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	26.935.005,99
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>472.910.373,00</b>	<b>87,79%</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%	22.360.413,48	4,15%	0,00%	0,00%	30,00%	139.249.622,45
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	28.663.517,77	5,32%	0,00%	3,00%	20,00%	79.076.506,19
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	4.886.681,62	0,91%	0,00%	1,00%	10,00%	48.983.330,36
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	6.343.345,58	1,18%	0,00%	1,00%	5,00%	20.591.660,41
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	3.535.788,33	0,66%	0,00%	0,05%	5,00%	23.399.217,66
Desenquadrado - RV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	26.935.005,99
Em Enquadramento - RV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	26.935.005,99
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>65.789.746,78</b>	<b>12,21%</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: setembro / 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 "	288.576.285,70	53,57%	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 "	176.474.604,10	32,76%	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 "	22.561,74	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	7.836.921,46	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>472.910.373,00</b>	<b>87,79%</b>	<b>4,00</b>	<b>530,00</b>

Artigos - Renda Variável	Base: setembro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	22.360.413,48	4,15%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	28.663.517,77	5,32%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	4.886.681,62	0,91%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	6.343.345,58	1,18%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	3.535.788,33	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%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>65.789.746,78</b>	<b>12,21%</b>	<b>4,00</b>	<b>130,00</b>

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	159.523.313,44	29,61%	0,04%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	153.180.117,80	28,44%	0,01%
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	127.203.575,53	23,61%	0,01%
WESTERN ASSET	44.795.435,96	8,32%	0,10%
ITAÚ UNIBANCO	24.369.521,82	4,52%	0,00%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	9.838.361,67	1,83%	0,04%
ICATU VANGUARDA	9.727.244,44	1,81%	0,04%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	3.460.672,42	0,64%	0,02%
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUTURADOS LTDA	2.889.882,29	0,54%	0,02%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	2.296.288,05	0,43%	0,49%
AQ3 ASSET MANAGEMENT	1.239.500,28	0,23%	2,66%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	160.853,47	0,03%	0,00%
VILA RICA CAPITAL	15.352,61	0,00%	0,01%

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
IRF-M 1+	1,57%	3,98%	1,88%	-0,49%	5,33%	25,58%	-	-	-
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	1,86%	2,57%	1,48%	-2,89%	3,20%	23,99%	0,30%	3,243%	6,24%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,42%	3,72%	1,68%	-0,92%	4,85%	24,68%	0,20%	2,047%	4,32%
IRF-M	1,30%	4,24%	1,83%	0,46%	5,74%	24,19%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,28%	4,10%	1,80%	0,35%	5,53%	23,63%	0,20%	1,508%	3,14%
IMA-B 5	0,89%	4,98%	2,11%	1,40%	6,53%	20,86%	-	-	-
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	1,01%	4,61%	2,35%	-0,07%	5,80%	21,73%	0,40%	1,484%	4,47%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,86%	4,79%	2,05%	1,27%	6,28%	20,38%	0,20%	1,241%	2,90%
CDI + 3,50% ao ano	0,73%	7,53%	2,48%	4,98%	10,34%	27,33%	-	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-22,38%	-82,95%	-52,79%	-72,10%	-78,15%	-95,09%	0,39%	35,441%	116,70%
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%
110% do CDI	0,52%	5,30%	1,75%	3,49%	7,34%	21,03%	-	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-5,63%	-59,95%	-14,57%	-49,65%	-66,95%	-76,86%	0,00%	-	-
IPCA	0,48%	3,34%	0,72%	2,62%	4,53%	7,18%	-	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,89%	6,33%	3,17%	2,45%	8,05%	25,25%	0,20%	1,076%	2,91%
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%
IMA-B 5+	-1,03%	0,83%	1,55%	-4,82%	-0,82%	16,33%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,04%	0,71%	1,47%	-4,85%	-1,00%	15,83%	0,20%	2,515%	6,87%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	-1,05%	0,69%	1,47%	-4,84%	-1,03%	15,73%	0,20%	2,532%	6,90%
IMA-B	-0,15%	2,88%	1,71%	-1,96%	2,55%	18,72%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,56%	4,43%	1,95%	-0,17%	5,14%	21,05%	0,20%	1,572%	4,05%
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%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,22%	2,33%	1,46%	-2,50%	1,93%	18,39%	0,20%	1,939%	5,10%

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

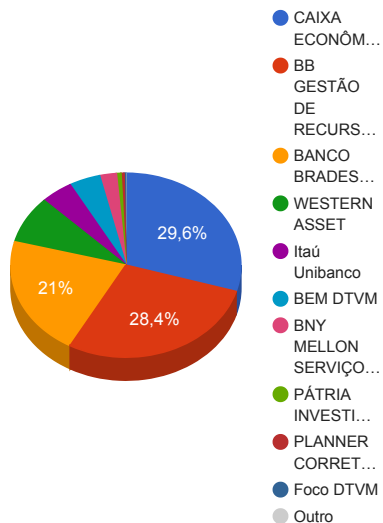
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IBX-50	3,73%	4,40%	9,50%	-7,00%	7,30%	36,21%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	3,19%	3,17%	8,82%	-8,16%	6,23%	34,13%	0,70%	9,911%	20,51%
Ibovespa	3,48%	3,85%	9,04%	-7,06%	6,80%	35,94%	-	-	-
BRADESCO H VALUATION IBOVESPA FI AÇÕES	3,43%	8,00%	7,37%	-7,04%	10,71%	46,36%	2,00%	8,052%	19,98%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	3,09%	10,68%	5,71%	-5,83%	11,78%	40,51%	2,00%	10,439%	20,56%
IPCA	0,48%	3,34%	0,72%	2,62%	4,53%	7,18%	-	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,30%	0,001%	20,85%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	-	-	-	-	-	-	1,00%	0,001%	-
S&P 500	0,43%	8,99%	7,20%	10,34%	15,66%	34,39%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	0,47%	11,66%	8,20%	12,67%	20,55%	54,56%	1,00%	2,649%	12,21%
IDIV	0,17%	-3,63%	3,48%	-12,68%	-5,33%	34,44%	-	-	-
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	3,47%	6,40%	9,20%	-7,54%	8,75%	45,21%	1,50%	8,793%	18,70%
SMLL	-1,96%	-10,24%	-1,35%	-13,71%	-7,65%	30,66%	-	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-2,16%	-10,91%	-0,80%	-14,10%	-8,14%	30,49%	1,50%	9,044%	18,51%
Global BDRX	-0,43%	35,16%	13,15%	38,35%	52,91%	75,30%	-	-	-
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,02%	33,02%	14,45%	38,05%	47,59%	67,67%	1,50%	6,757%	14,58%
IFIX	-0,21%	-4,12%	0,45%	-9,45%	-3,88%	17,55%	-	-	-

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

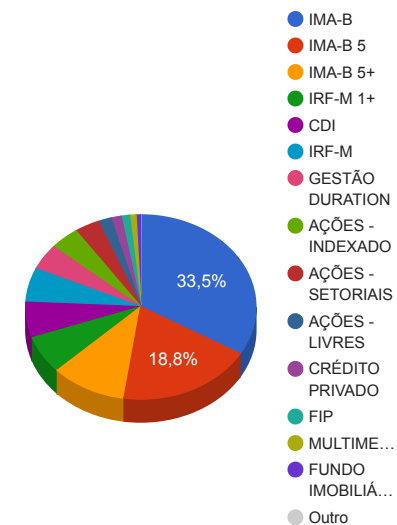
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
ÁQUILLA FII - AQLL11	13,80%	-5,88%	-1,23%	-24,53%	-10,96%	-46,67%	1,50%	16,019%	38,53%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,00%	-	-	0,00%	-	0,00%	0,14%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	159.523.313,44	29,61%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	153.180.117,80	28,44%
BANCO BRADESCO	113.364.419,56	21,04%
WESTERN ASSET	44.795.435,96	8,32%
Itaú Unibanco	24.369.521,82	4,52%
BEM DTVM	23.566.400,41	4,37%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	12.721.034,83	2,36%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	3.460.672,42	0,64%
PLANNER CORRETORA	2.296.288,05	0,43%
Foco DTVM	1.239.500,28	0,23%
BANCO SANTANDER	160.853,47	0,03%
BRL Trust Investimentos	15.352,61	0,00%
Brasil Plural	7.209,13	0,00%



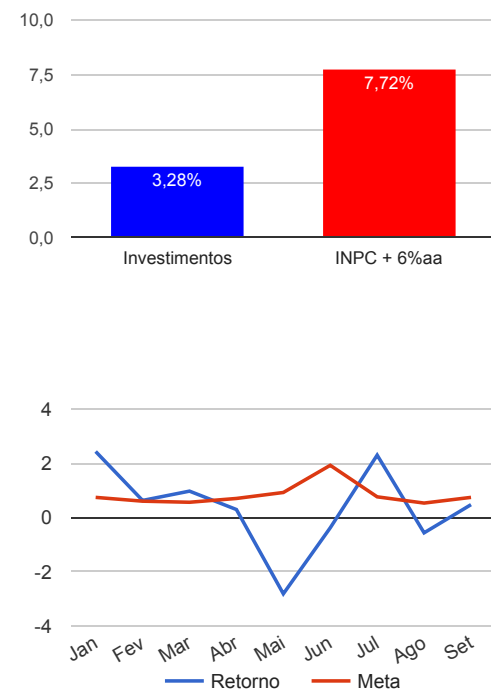
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	180.402.448,70	33,49%
IMA-B 5	101.373.108,69	18,82%
IMA-B 5+	57.094.236,12	10,60%
IRF-M 1+	35.793.140,17	6,64%
CDI	33.718.382,02	6,26%
IRF-M	32.139.198,81	5,97%
GESTÃO DURATION	24.369.521,82	4,52%
AÇÕES - INDEXADO	22.360.413,48	4,15%
AÇÕES - SETORIAIS	18.825.156,10	3,49%
AÇÕES - LIVRES	9.838.361,67	1,83%
CRÉDITO PRIVADO	7.836.921,46	1,45%
FIP	6.343.345,58	1,18%
MULTIMERCADO	4.886.681,62	0,91%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.535.788,33	0,66%
IRF-M 1	160.853,47	0,03%
FIDC - FECHADO	22.561,74	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%
Acumulado no ano					16.897.602,95	3,28%	7,72%	42,44%	

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(%)
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	9.549.351,26	0,00	0,00	9.727.244,44	177.893,18	1,86%	3,24%	1,86%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	51.455.298,01	0,00	26.027.046,98	26.065.895,73	637.644,70	1,24%	2,05%	1,42%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	63.491.495,82	0,00	32.090.576,63	32.139.198,81	738.279,62	1,16%	1,51%	1,28%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	26.630.029,70	0,00	0,00	26.900.073,43	270.043,73	1,01%	1,48%	1,01%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	7.768.054,42	0,00	0,00	7.836.921,46	68.867,04	0,89%	1,08%	0,89%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	39.324.061,94	34.678.146,36	0,00	74.473.035,26	470.826,96	0,64%	1,24%	0,86%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	159.908,57	0,00	0,00	160.853,47	944,90	0,59%	0,16%	0,59%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.000.505,68	0,00	0,00	6.034.346,15	33.840,47	0,56%	1,57%	0,56%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	24.268.263,01	0,00	0,00	24.369.521,82	101.258,81	0,42%	0,05%	0,42%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	775.795,54	39.329.236,73	6.445.227,98	33.718.382,02	58.577,73	0,15%	0,05%	0,49%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	73.570.159,12	0,00	0,00	73.451.269,36	-118.889,76	-0,16%	1,87%	-0,16%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	101.143.107,93	0,00	0,00	100.916.833,19	-226.274,74	-0,22%	1,94%	-0,22%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	58.402.955,04	0,00	8.467.723,45	49.351.613,49	-583.618,10	-1,00%	2,51%	-1,04%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	7.824.853,87	0,00	0,00	7.742.622,63	-82.231,24	-1,05%	2,53%	-1,05%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	7.639,73	0,00	0,00	7.209,13	-430,60	-5,64%	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	19.778,57	0,00	1.058,83	15.352,61	-3.367,13	-17,02%	35,44%	-18,12%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>1.543.365,57</b>	<b>0,33%</b>	<b>1,62%</b>	

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(%)
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	13.375.445,73	0,00	0,00	13.839.155,97	463.710,24	3,47%	8,79%	3,47%
BRADESCO H VALUATION IBOVESPA FI AÇÕES	4.548.979,48	0,00	0,00	4.704.963,74	155.984,26	3,43%	8,05%	3,43%
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	4.503.008,32	0,00	0,00	4.646.768,83	143.760,51	3,19%	9,91%	3,19%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	9.543.100,36	0,00	0,00	9.838.361,67	295.261,31	3,09%	10,44%	3,09%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	2.277.113,36	0,00	0,00	2.296.288,05	19.174,69	0,84%	-	0,84%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	4.863.930,37	0,00	0,00	4.886.681,62	22.751,25	0,47%	2,65%	0,47%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	13.005.768,00	0,00	0,00	13.008.680,91	2.912,91	0,02%	6,76%	0,02%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	2.883.377,60	0,00	0,00	2.882.673,16	-704,44	-0,02%	0,00%	-0,02%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	3.463.305,66	0,00	0,00	3.460.672,42	-2.633,24	-0,08%	0,00%	-0,08%
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.241.487,14	0,00	0,00	1.239.500,28	-1.986,86	-0,16%	16,02%	13,80%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	5.095.931,36	0,00	0,00	4.986.000,13	-109.931,23	-2,16%	9,04%	-2,16%
Total Renda Variável					988.299,40	1,53%	7,47%	

## 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 (%)
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	99.464.932,57	0,00	0,00	100.916.833,19	1.451.900,62	1,46%	1,46%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	63.167.341,06	0,00	32.090.576,63	32.139.198,81	1.062.434,38	1,68%	1,80%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	38.698.696,51	34.844.707,81	0,00	74.473.035,26	929.630,94	1,83%	2,05%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	58.668.255,04	13.932.334,89	0,00	73.451.269,36	850.679,43	1,44%	1,66%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	51.323.311,12	0,00	26.027.046,98	26.065.895,73	769.631,59	1,50%	1,68%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	24.326.413,13	2.000.000,00	0,00	26.900.073,43	573.660,30	2,34%	2,35%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	48.870.599,85	8.467.723,45	8.467.723,45	49.351.613,49	481.013,64	1,29%	1,47%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	32.854.733,23	0,00	33.135.995,50	0,00	281.262,27	0,86%	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	7.595.834,51	0,00	0,00	7.836.921,46	241.086,95	3,17%	3,17%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	12.541.928,70	11.597.598,42	0,00	24.369.521,82	229.994,70	1,23%	1,37%
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	9.585.802,94	0,00	0,00	9.727.244,44	141.441,50	1,48%	1,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.081.574,41	0,00	166.103,45	6.034.346,15	118.875,19	1,97%	1,95%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	4.929.179,95	47.646.183,45	18.969.851,03	33.718.382,02	112.869,65	0,90%	1,57%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	7.630.361,49	0,00	0,00	7.742.622,63	112.261,14	1,47%	1,47%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	642.547,78	0,00	648.336,02	0,00	5.788,24	0,90%	1,57%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	164.213,25	0,00	6.037,59	160.853,47	2.677,81	1,67%	1,69%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	8.438,83	0,00	0,00	7.209,13	-1.229,70	-14,57%	-14,57%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	32.519,21	0,00	1.796,43	15.352,61	-15.370,17	-47,65%	-52,79%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>7.348.608,48</b>	<b>1,57%</b>	

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 (%)
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	11.365.952,12	0,00	0,00	13.008.680,91	1.642.728,79	14,45%	14,45%
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	12.673.718,96	0,00	0,00	13.839.155,97	1.165.437,01	9,20%	9,20%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	4.487.546,23	4.970.399,33	0,00	9.838.361,67	380.416,11	7,93%	5,71%
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	4.269.979,16	0,00	0,00	4.646.768,83	376.789,67	8,82%	8,82%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	4.516.317,45	0,00	0,00	4.886.681,62	370.364,17	8,20%	8,20%
BRDESCO H VALUATION IBOVESPA FI AÇÕES	4.381.896,20	0,00	0,00	4.704.963,74	323.067,54	7,37%	7,37%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	2.237.056,71	0,00	0,00	2.296.288,05	59.231,34	2,65%	-
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	3.460.055,52	0,00	0,00	3.460.672,42	616,90	0,02%	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP	2.885.045,72	0,00	0,00	2.882.673,16	-2.372,56	-0,08%	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	5.026.027,38	0,00	0,00	4.986.000,13	-40.027,25	-0,80%	-0,80%
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.338.372,43	0,00	0,00	1.239.500,28	-98.872,15	-7,39%	-1,23%
Total Renda Variável					4.177.379,57	7,18%	