

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



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
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	365.813,88	0,27%	165	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.359.512,03	4,64%	599	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.637.872,88	4,85%	313	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	10.929.300,05	7,98%	315	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.007.716,80	5,12%	650	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.353.856,42	6,83%	674	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	6.678.982,34	4,88%	104	1,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	176.030,78	0,13%	101	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	6.258.693,38	4,57%	1.267	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	3.788.237,24	2,77%	95	0,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	10.055.351,41	7,34%	733	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.123.028,03	0,82%	59	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	617.746,88	0,45%	171	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	65.426,63	0,05%	680	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.733.748,21	2,73%	670	0,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	8.619.461,65	6,29%	310	0,35%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	25.614.925,28	18,70%	54	13,45%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	7.079.943,42	5,17%	449	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	2.966.923,79	2,17%	1.847	2,86%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	3.170.660,30	2,31%	76	2,26%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	4.530.366,63	3,31%	2.337	2,34%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	4.000.474,69	2,92%	1.348	1,97%	Artigo 8º, Inciso III

Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2018)

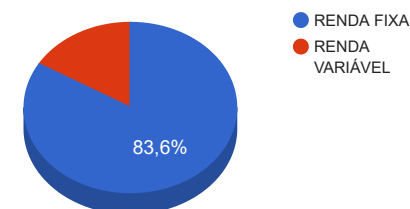
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	1.001.984,42	0,73%	33	0,22%	Artigo 8º, Inciso III
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.102.218,24	2,26%	73	2,21%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.755.761,03	2,74%	11.415	0,31%	Artigo 8º, Inciso III
TOTAL -			136.994.036,41				

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

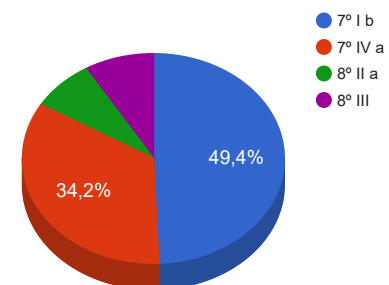
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	67.611.367,21	49,35%	15,00%	25,00%	90,00%	55.683.265,56
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	5,00%	60,00%	82.196.421,85
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	46.854.280,10	34,20%	5,00%	25,00%	40,00%	7.943.334,46
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	15,00%	15,00%	20.549.105,46
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	20.549.105,46
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	10.667.950,72	7,79%	0,00%	10,00%	15,00%	9.881.154,74
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	11.860.438,38	8,66%	0,00%	5,00%	10,00%	1.838.965,26
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	6.849.701,82
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	6.849.701,82
Total Carteira		136.994.036,41					

RENDA FIXA	114.465.647,31	83,56%
RENDA VARIÁVEL	22.528.389,10	16,44%

Distribuição por Segmento



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 " b "	67.611.367,21	49,35%	15,00%	90,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	46.854.280,10	34,20%	5,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	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 "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	10.667.950,72	7,79%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso III	11.860.438,38	8,66%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	136.994.036,41	100,00%	25,00	270,00

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	71.795.451,92	52,41%	0,02%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	42.314.891,75	30,89%	0,00%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	7.079.943,42	5,17%	0,00%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTO LTDA	6.137.584,09	4,48%	3,64%
WESTERN ASSET	3.755.761,03	2,74%	0,01%
INFINITY ASSET MANAGEMENT	3.102.218,24	2,26%	0,50%
ITAÚ UNIBANCO	1.740.774,91	1,27%	0,00%
SAFRA ASSET MANAGEMENT	1.001.984,42	0,73%	0,00%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	65.426,63	0,05%	0,00%

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
IDKA IPCA 2 Anos	1,36%	6,14%	3,07%	3,04%	8,51%	23,34%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,17%	5,58%	2,34%	2,47%	7,60%	21,30%	0,20%	0,881%	2,27%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,15%	5,71%	2,36%	2,56%	7,66%	21,41%	0,20%	0,875%	2,27%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,45%	5,89%	1,57%	3,95%	7,55%	19,27%	0,20%	0,000%	0,60%
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%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,18%	4,01%	1,68%	0,12%	5,34%	23,48%	0,20%	1,504%	3,25%
IPCA + 6,00% ao ano	0,92%	7,93%	2,22%	5,68%	10,72%	20,29%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,84%	4,22%	2,15%	-0,29%	5,20%	21,30%	0,15%	1,706%	4,39%
IMA Geral ex-C	0,61%	4,11%	1,77%	0,69%	5,18%	21,05%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,60%	4,17%	1,58%	0,63%	4,99%	20,00%	0,30%	1,092%	2,60%
IRF-M 1	0,61%	4,85%	1,72%	2,99%	6,75%	20,26%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,59%	4,66%	1,67%	2,86%	6,51%	19,70%	0,10%	0,163%	0,52%
IPCA	0,48%	3,34%	0,72%	2,62%	4,53%	7,18%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,66%	4,24%	1,75%	1,35%	5,79%	-	0,002	0,548%	1,69%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,42%	5,31%	1,37%	1,94%	6,32%	-	0,40%	0,054%	1,40%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,42%	5,29%	1,37%	1,94%	6,30%	22,30%	0,40%	0,055%	1,40%

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

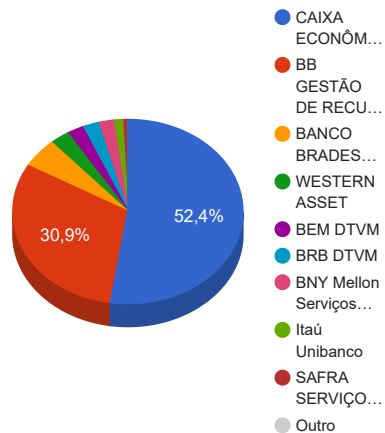
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Selic	0,47%	4,82%	1,59%	3,18%	6,66%	18,97%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,47%	4,74%	1,56%	3,10%	6,58%	19,58%	0,20%	0,007%	0,04%
CDI	0,47%	4,81%	1,59%	3,17%	6,65%	18,95%	-	-	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,47%	4,68%	1,56%	3,10%	6,51%	18,86%	0,20%	0,037%	0,04%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,47%	4,73%	1,56%	3,11%	6,56%	19,19%	0,20%	0,003%	0,03%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,39%	3,97%	1,31%	2,61%	5,52%	16,64%	1,00%	0,003%	0,03%
IMA-B	-0,15%	2,88%	1,71%	-1,96%	2,55%	18,72%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,09%	5,73%	2,06%	2,72%	7,28%	21,14%	0,20%	1,048%	1,92%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,18%	2,69%	1,64%	-2,10%	2,28%	18,27%	0,20%	1,890%	4,88%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,27%	-2,02%	-1,47%	-5,02%	-2,39%	7,18%	0,20%	2,174%	6,45%

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

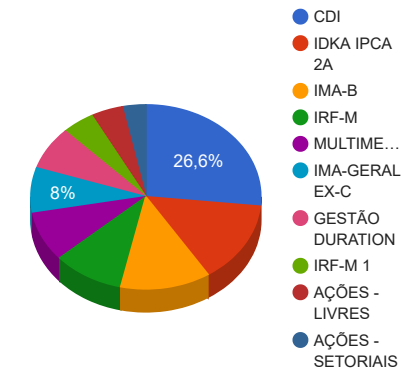
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	3,48%	3,85%	9,04%	-7,06%	6,80%	35,94%	-	-	-
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	3,23%	8,76%	9,34%	-4,22%	9,89%	36,94%	2,00%	10,820%	20,42%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-1,92%	-0,26%	2,87%	-8,76%	0,65%	37,16%	2,00%	6,799%	15,23%
CDI	0,47%	4,81%	1,59%	3,17%	6,65%	18,95%	-	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,81%	4,57%	2,44%	1,20%	6,33%	19,78%	0,50%	1,230%	2,95%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,52%	5,19%	1,62%	3,37%	7,13%	21,81%	1,00%	0,314%	0,55%
S&P 500	0,43%	8,99%	7,20%	10,34%	15,66%	34,39%	-	-	-
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	0,47%	11,68%	8,13%	12,54%	20,70%	55,50%	1,00%	2,658%	12,08%
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%
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%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	71.795.451,92	52,41%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	42.314.891,75	30,89%
BANCO BRADESCO	7.079.943,42	5,17%
WESTERN ASSET	3.755.761,03	2,74%
BEM DTVM	3.170.660,30	2,31%
BRB DTVM	3.102.218,24	2,26%
BNY Mellon Serviços Financeiros	2.966.923,79	2,17%
Itaú Unibanco	1.740.774,91	1,27%
SAFRA SERVIÇOS DE ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA LTDA.	1.001.984,42	0,73%
BANCO SANTANDER	65.426,63	0,05%

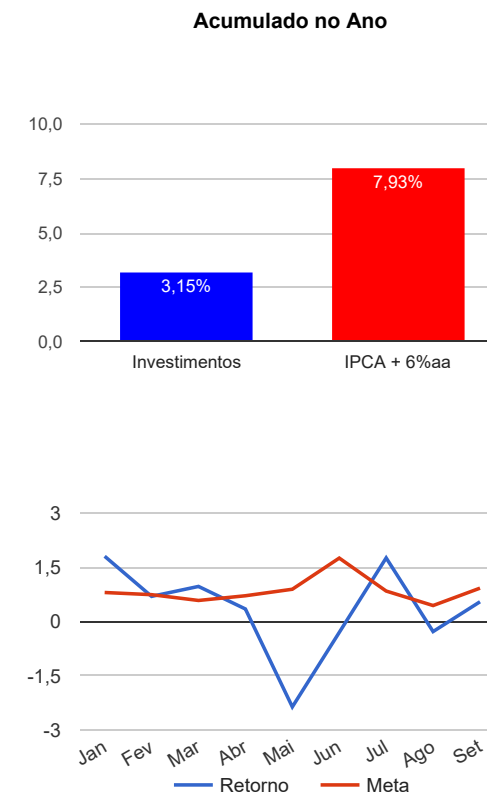


Sub-segmento	Valor	%
CDI	36.494.043,54	26,64%
IDKA IPCA 2A	19.585.238,61	14,30%
IMA-B	17.192.545,49	12,55%
IRF-M	13.645.589,68	9,96%
MULTIMERCADO	11.860.438,38	8,66%
IMA-GERAL EX-C	10.929.300,05	7,98%
GESTÃO DURATION	10.360.236,56	7,56%
IRF-M 1	6.258.693,38	4,57%
AÇÕES - LIVRES	6.137.584,09	4,48%
AÇÕES - SETORIAIS	4.530.366,63	3,31%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	105.724.325,65	42.751.442,59	36.725.304,21	113.762.419,68	2.011.955,65	1,80%	0,80%	224,64%	1,43%
Fevereiro	113.762.419,68	17.110.714,95	14.479.418,37	117.200.198,64	806.482,38	0,69%	0,74%	93,84%	2,18%
Março	117.200.198,64	6.221.758,25	3.503.728,27	121.078.344,57	1.160.115,95	0,97%	0,58%	167,61%	1,45%
Abril	121.078.344,57	5.098.702,39	1.201.041,89	125.406.874,85	430.869,78	0,34%	0,71%	48,71%	1,47%
Mai	125.406.874,85	909.126,24	1.067.848,93	122.291.546,94	-2.956.605,22	-2,36%	0,89%	-265,29%	2,57%
Junho	122.291.546,94	37.726.815,86	31.945.538,72	127.685.791,34	-387.032,74	-0,30%	1,75%	-17,24%	2,92%
Julho	127.685.791,34	3.921.852,98	988.292,21	132.911.407,28	2.292.055,17	1,75%	0,84%	208,48%	1,41%
Agosto	132.911.407,28	18.246.520,97	15.982.276,01	134.799.088,90	-376.563,34	-0,28%	0,44%	-62,92%	2,24%
Setembro	134.799.088,90	4.792.980,03	3.339.581,12	136.994.036,41	741.548,60	0,54%	0,92%	59,00%	1,49%
Acumulado no ano					3.722.826,23	3,15%	7,93%	39,64%	



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(%)
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.919.094,10	0,00	0,00	7.007.716,80	88.622,70	1,28%	1,51%	1,28%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.938.941,22	0,00	0,00	10.055.351,41	116.410,19	1,17%	0,88%	1,17%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.247.298,68	0,00	0,00	9.353.856,42	106.557,74	1,15%	0,88%	1,15%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	361.865,87	0,00	0,00	365.813,88	3.948,01	1,09%	1,05%	1,09%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.560.155,65	0,00	1.000.000,00	6.637.872,88	77.717,23	1,03%	1,50%	1,18%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.756.786,81	0,00	0,00	3.788.237,24	31.450,43	0,84%	1,71%	0,84%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	8.563.261,15	0,00	0,00	8.619.461,65	56.200,50	0,66%	0,55%	0,66%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.864.078,28	0,00	0,00	10.929.300,05	65.221,77	0,60%	1,09%	0,60%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.221.973,61	0,00	0,00	6.258.693,38	36.719,77	0,59%	0,16%	0,59%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.047.163,01	0,00	0,00	7.079.943,42	32.780,41	0,47%	0,01%	0,47%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	175.240,72	0,00	0,00	176.030,78	790,06	0,45%	0,00%	0,45%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	784.021,93	0,00	722.000,00	65.426,63	3.404,70	0,43%	0,00%	0,47%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	22.652.506,31	2.954.712,25	100.000,00	25.614.925,28	107.706,72	0,42%	0,04%	0,47%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	615.180,05	0,00	0,00	617.746,88	2.566,83	0,42%	0,05%	0,42%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.181.142,11	0,00	63.000,00	1.123.028,03	4.885,92	0,41%	0,05%	0,42%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.239.362,45	838.267,78	357.358,16	3.733.748,21	13.476,14	0,33%	0,00%	0,39%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.371.018,19	0,00	0,00	6.359.512,03	-11.506,16	-0,18%	1,89%	-0,18%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.697.234,48	0,00	0,00	6.678.982,34	-18.252,14	-0,27%	2,17%	-0,27%
Total Renda Fixa					718.700,82	0,63%	0,78%	

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(%)
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	3.071.473,07	0,00	0,00	3.170.660,30	99.187,23	3,23%	10,82%	3,23%
BRANCO SMALL CAP PLUS FI AÇÕES	1.083.298,99	0,00	1.097.222,96	0,00	13.923,97	1,29%	8,81%	1,29%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	3.968.351,25	0,00	0,00	4.000.474,69	32.123,44	0,81%	1,23%	0,81%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.086.025,54	0,00	0,00	3.102.218,24	16.192,70	0,52%	0,31%	0,52%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	3.738.275,09	0,00	0,00	3.755.761,03	17.485,94	0,47%	2,65%	0,47%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	0,00	1.000.000,00	0,00	1.001.984,42	1.984,42	0,20%	2,66%	0,47%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3.025.088,28	0,00	0,00	2.966.923,79	-58.164,49	-1,92%	6,80%	-1,92%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	4.630.252,06	0,00	0,00	4.530.366,63	-99.885,43	-2,16%	9,04%	-2,16%
Total Renda Variável					22.847,78	0,10%	5,06%	

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 (%)
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	14.649.891,25	10.875.921,88	200.000,00	25.614.925,28	289.112,15	1,32%	1,56%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.825.370,62	0,00	0,00	10.055.351,41	229.980,79	2,34%	2,34%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.138.133,46	0,00	0,00	9.353.856,42	215.722,96	2,36%	2,36%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	13.467.570,10	0,00	7.000.000,00	6.637.872,88	170.302,78	1,72%	1,68%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.759.310,72	0,00	0,00	10.929.300,05	169.989,33	1,58%	1,58%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.379.208,48	0,00	1.500.000,00	7.007.716,80	128.508,32	1,76%	1,80%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.155.882,92	0,00	0,00	6.258.693,38	102.810,46	1,67%	1,67%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.256.711,66	0,00	0,00	6.359.512,03	102.800,37	1,64%	1,64%
BRASECO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	5.980.230,92	1.000.000,00	0,00	7.079.943,42	99.712,50	1,51%	1,56%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	2.527.208,05	6.000.000,00	0,00	8.619.461,65	92.253,60	1,75%	1,75%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.778.407,45	0,00	190.306,50	6.678.982,34	90.881,39	1,33%	-1,47%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.811.455,40	0,00	105.044,68	3.788.237,24	81.826,52	2,17%	2,15%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.179.875,49	4.116.116,92	3.606.844,06	3.733.748,21	44.599,86	0,99%	1,31%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.433.543,48	0,00	2.469.315,18	0,00	35.771,70	1,47%	1,69%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.530.676,51	0,00	2.491.000,00	65.426,63	25.750,12	1,47%	1,56%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.242.377,12	0,00	136.000,00	1.123.028,03	16.650,91	1,36%	1,37%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	628.435,12	0,00	273.504,96	365.813,88	10.883,72	2,21%	2,06%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.230.378,00	0,00	1.240.911,00	0,00	10.533,00	0,86%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	609.426,30	0,00	0,00	617.746,88	8.320,58	1,37%	1,37%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	173.312,79	0,00	0,00	176.030,78	2.717,99	1,57%	1,57%
Total Renda Fixa					1.929.129,05	1,71%	

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 US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	3.471.109,94	0,00	0,00	3.755.761,03	284.651,09	8,20%	8,20%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	2.899.907,48	0,00	0,00	3.170.660,30	270.752,82	9,34%	9,34%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.884.043,35	0,00	0,00	2.966.923,79	82.880,44	2,87%	2,87%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.052.750,06	0,00	0,00	3.102.218,24	49.468,18	1,62%	1,62%
BRADESCO SMALL CAP PLUS FI AÇÕES	1.053.838,59	0,00	1.097.222,96	0,00	43.384,37	4,12%	4,12%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,00	3.969.315,18	0,00	4.000.474,69	31.159,51	0,79%	2,44%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	0,00	1.000.000,00	0,00	1.001.984,42	1.984,42	0,20%	8,13%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	4.566.736,08	0,00	0,00	4.530.366,63	-36.369,45	-0,80%	-0,80%
Total Renda Variável					727.911,38	4,27%	