

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 IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	2.715.918,69	1,92%	31	1,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	10.137.817,13	7,18%	57	4,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.444.688,76	6,69%	674	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BGT PACTUAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO NTN-B	D+1	Não há	2.643.547,00	1,87%	12	1,69%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	23.787.543,19	16,85%	1.471	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.373.351,77	2,39%	733	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	5.558.340,72	3,94%	420	2,86%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	20.788,50	0,01%	670	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	6.613.719,33	4,68%	171	0,29%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	6.822.996,72	4,83%	310	0,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	3.405.440,77	2,41%	814	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	10.751.963,48	7,61%	92	6,39%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	5.122.612,37	3,63%	81	0,96%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	521.463,98	0,37%	822	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	14.372.093,61	10,18%	115	1,20%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	77.977,55	0,06%	294	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BBIF MASTER FIDC LP	Não se aplica	27 meses	275.499,42	0,20%	13	0,93%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	5.918.973,60	4,19%	34	2,86%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	D+4	Não há	2.282.602,50	1,62%	3.102	0,67%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	2.310.152,18	1,64%	1.847	2,22%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.985.979,84	1,41%	1.958	1,41%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+63	Não há	1.962.229,80	1,39%	1.061	2,96%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2018)

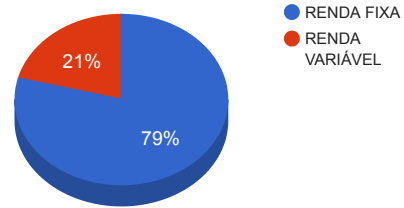
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	2.003.706,00	1,42%	1.362	0,68%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	5.280.738,70	3,74%	4.455	0,91%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	6.173.637,39	4,37%	73	4,41%	Artigo 8º, Inciso III
SULAMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+361	2 anos	2.949.049,48	2,09%	8	9,47%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	1.440.762,28	1,02%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	3.249.618,24	2,30%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
		TOTAL -	141.203.213,00				

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

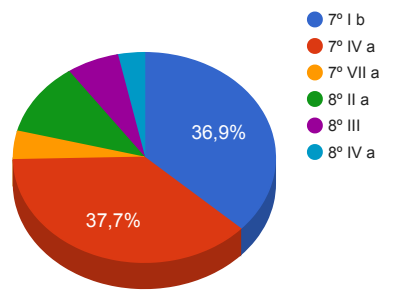
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	52.102.866,54	36,90%	15,00%	25,00%	70,00%	46.739.382,56
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	84.721.927,80
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	53.267.397,03	37,72%	5,00%	15,00%	40,00%	3.213.888,17
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	15,00%	21.180.481,95
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	6.194.473,02	4,39%	2,00%	5,00%	5,00%	865.687,63
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	7.060.160,65
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	15.825.409,02	11,21%	2,00%	12,00%	15,00%	5.355.072,93
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	9.122.686,87	6,46%	7,00%	10,00%	10,00%	4.997.634,43
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	4.690.380,52	3,32%	2,00%	4,00%	5,00%	2.369.780,13
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	4,00%	5,00%	7.060.160,65
Total Carteira		141.203.213,00					

RENDA FIXA	111.564.736,59	79,01%
RENDA VARIÁVEL	29.638.476,41	20,99%

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 "	52.102.866,54	36,90%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	53.267.397,03	37,72%	5,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	6.194.473,02	4,39%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	2,00%	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%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	15.825.409,02	11,21%	2,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso III	9.122.686,87	6,46%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	4.690.380,52	3,32%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Total Renda Fixa	141.203.213,00	100,00%	42,00	245,00

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	40.654.670,20	28,79%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	23.887.593,34	16,92%	0,00%
INFINITY ASSET MANAGEMENT	16.925.600,87	11,99%	2,75%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	15.260.429,50	10,81%	0,00%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	9.365.047,98	6,63%	0,01%
ITAÚ UNIBANCO	6.613.719,33	4,68%	0,00%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	5.558.340,72	3,94%	0,02%
A5 CAPITAL PARTNERS	3.249.618,24	2,30%	-
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS	2.949.049,48	2,09%	0,01%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	2.310.152,18	1,64%	1,37%
FRANKLIN TEMPLETON INVESTIMENTOS	2.282.602,50	1,62%	0,07%
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	2.003.706,00	1,42%	0,00%
PERFIN INVESTIMENTOS	1.985.979,84	1,41%	0,05%
HIX CAPITAL	1.962.229,80	1,39%	0,21%

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%
IDKA PRÉ 2 ANOS	1,21%	5,38%	1,94%	1,51%	7,62%	27,36%	-	-	-
BRABESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1,14%	5,06%	1,71%	1,22%	7,17%	26,20%	0,20%	1,496%	3,10%
IPCA + 7,00% ao ano	0,99%	8,69%	2,47%	6,18%	11,75%	22,54%	-	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-3,56%	-24,55%	-3,60%	-20,47%	-24,55%	-19,64%	1,65%	7,485%	15,86%
IPCA + 6,00% ao ano	0,92%	7,93%	2,22%	5,68%	10,72%	20,29%	-	-	-
BGT PACTUAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO NTN-B	0,55%	5,07%	2,64%	2,55%	4,57%	7,49%	0,15%	0,167%	3,96%
IMA-B 5	0,89%	4,98%	2,11%	1,40%	6,53%	20,86%	-	-	-
BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,86%	4,67%	2,03%	1,05%	6,06%	20,57%	0,20%	1,255%	3,04%
IRF-M 1	0,61%	4,85%	1,72%	2,99%	6,75%	20,26%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,59%	4,69%	1,69%	2,89%	6,57%	19,83%	0,20%	0,154%	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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,47%	4,00%	1,86%	-0,69%	4,69%	20,68%	0,20%	1,846%	4,47%
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)

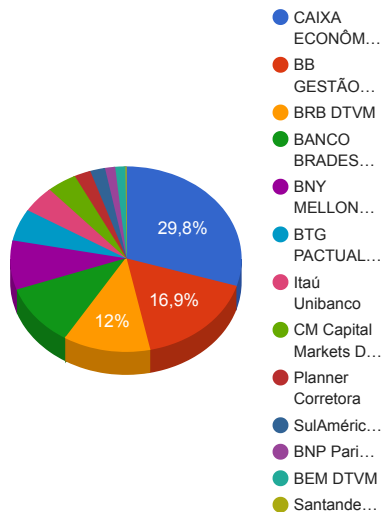
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,47%	4,81%	1,59%	3,17%	6,65%	18,95%	-	-	-
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,76%	5,06%	1,85%	3,41%	6,96%	19,67%	0,20%	0,497%	0,30%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	0,50%	5,28%	1,62%	3,33%	7,20%	21,27%	0,75%	0,164%	0,81%
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%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,44%	4,65%	1,53%	3,08%	6,48%	18,78%	0,20%	0,020%	0,04%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,40%	4,16%	1,37%	2,74%	5,79%	17,03%	0,80%	0,000%	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%
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	0,38%	3,48%	1,32%	1,47%	5,10%	18,16%	1,00%	0,079%	0,94%
Não Possui	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BBIF MASTER FIDC LP	-0,34%	1,80%	-1,06%	-2,31%	212.724.842.899,00%	83,92%	0,72%	0,027%	19.960.094.729.500,00%

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

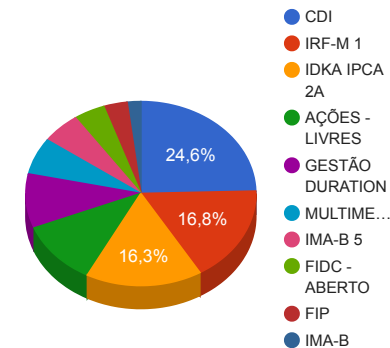
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	3,48%	3,85%	9,04%	-7,06%	6,80%	35,94%	-	-	-
PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3,03%	-5,19%	4,51%	-9,66%	-3,22%	26,23%	1,85%	8,188%	15,11%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,19%	0,61%	3,42%	-8,62%	0,74%	24,35%	3,00%	9,714%	17,76%
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	1,20%	-1,33%	2,70%	-12,61%	0,25%	33,87%	2,00%	8,400%	18,10%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-1,92%	-0,26%	2,87%	-8,76%	0,65%	37,16%	2,00%	6,799%	15,23%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-1,97%	-12,58%	-2,61%	-12,98%	-12,18%	10,07%	2,00%	6,809%	14,72%
IPCA + 8,00% ao ano	1,06%	9,45%	2,71%	6,68%	12,78%	24,82%	-	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-	-	-	-	-	-	2,00%	-	-
IPCA	0,48%	3,34%	0,72%	2,62%	4,53%	7,18%	-	-	-
SULAMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,77%	5,87%	2,14%	3,37%	7,70%	22,63%	1,50%	0,303%	0,76%
CDI	0,47%	4,81%	1,59%	3,17%	6,65%	18,95%	-	-	-
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,52%	5,19%	1,62%	3,37%	7,13%	21,81%	1,00%	0,314%	0,55%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-3,12%	-12,71%	0,05%	-14,94%	-9,27%	20,95%	2,00%	6,661%	13,73%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	42.095.432,48	29,81%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	23.887.593,34	16,92%
BRB DTVM	16.925.600,87	11,99%
BANCO BRADESCO	15.260.429,50	10,81%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	12.113.325,20	8,58%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	7.924.285,70	5,61%
Itaú Unibanco	6.613.719,33	4,68%
CM Capital Markets DTVM	5.918.973,60	4,19%
Planner Corretora	3.249.618,24	2,30%
SulAmérica Investimentos	2.949.049,48	2,09%
BNP Paribas	2.003.706,00	1,42%
BEM DTVM	1.985.979,84	1,41%
Santander Securities Services	275.499,42	0,20%

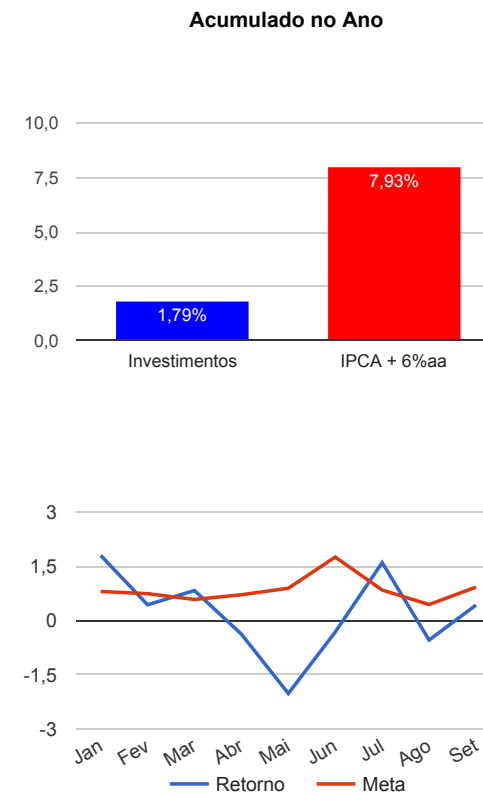


Sub-segmento	Valor	%
CDI	34.708.068,61	24,58%
IRF-M 1	23.787.543,19	16,85%
IDKA IPCA 2A	22.955.857,66	16,26%
AÇÕES - LIVRES	15.825.409,02	11,21%
GESTÃO DURATION	13.436.716,05	9,52%
MULTIMERCADO	9.122.686,87	6,46%
IMA-B 5	7.766.159,37	5,50%
FIDC - ABERTO	6.194.473,02	4,39%
FIP	4.690.380,52	3,32%
IMA-B	2.715.918,69	1,92%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	135.375.483,75	6.850.318,55	4.326.148,48	140.379.143,23	2.479.489,41	1,80%	0,80%	224,34%	1,46%
Fevereiro	140.379.143,23	2.305.721,89	2.117.805,09	141.176.912,13	609.852,10	0,43%	0,74%	58,75%	1,49%
Março	141.176.912,13	3.575.644,90	4.044.467,62	141.874.773,03	1.166.683,62	0,83%	0,58%	143,18%	1,36%
Abril	141.874.773,03	2.427.518,16	2.139.081,83	141.624.678,86	-538.530,50	-0,38%	0,71%	-53,52%	1,97%
Mai	141.624.678,86	42.769.884,17	41.894.262,42	139.628.883,83	-2.871.416,78	-2,02%	0,89%	-226,74%	2,43%
Junho	139.628.883,83	28.218.941,99	27.338.779,16	140.061.819,84	-447.226,82	-0,32%	1,75%	-18,16%	2,62%
Julho	140.061.819,84	1.859.398,35	1.992.502,58	142.166.248,17	2.237.532,56	1,60%	0,84%	189,80%	1,30%
Agosto	142.166.248,17	8.117.176,30	8.252.181,79	141.263.579,14	-767.663,54	-0,54%	0,44%	-121,96%	2,21%
Setembro	141.263.579,14	18.733.433,72	19.394.759,70	141.203.213,00	600.959,84	0,43%	0,92%	46,12%	1,70%
Acumulado no ano					2.469.679,89	1,79%	7,93%	22,53%	



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 IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.334.298,68	0,00	0,00	3.373.351,77	39.053,09	1,17%	0,88%	1,17%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	10.023.854,64	0,00	0,00	10.137.817,13	113.962,49	1,14%	1,50%	1,14%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.270.905,32	0,00	5.322.686,61	0,00	51.781,29	0,98%	1,24%	0,86%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	5.078.974,85	0,00	0,00	5.122.612,37	43.637,52	0,86%	1,26%	0,86%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	13.695.585,55	830.000,00	260.000,00	14.372.093,61	106.508,06	0,73%	0,50%	0,76%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	6.778.509,50	0,00	0,00	6.822.996,72	44.487,22	0,66%	0,55%	0,66%
BTG PACTUAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO NTN-B	2.629.116,80	0,00	0,00	2.643.547,00	14.430,20	0,55%	0,17%	0,55%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	10.698.559,75	0,00	0,00	10.751.963,48	53.403,73	0,50%	0,16%	0,50%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	3.388.782,72	0,00	0,00	3.405.440,77	16.658,05	0,49%	0,05%	0,49%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.075.899,86	5.323.277,77	0,00	9.444.688,76	45.511,13	0,48%	0,88%	1,15%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.703.297,66	0,00	0,00	2.715.918,69	12.621,03	0,47%	1,85%	0,47%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	20.353.305,51	4.589.790,09	1.270.000,00	23.787.543,19	114.447,59	0,46%	0,15%	0,59%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.104.529,04	140.000,00	3.740.361,72	521.463,98	17.296,66	0,41%	0,02%	0,44%
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	5.537.300,21	0,00	0,00	5.558.340,72	21.040,51	0,38%	0,08%	0,38%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,00	6.600.000,00	0,00	6.613.719,33	13.719,33	0,21%	0,05%	0,42%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.771.568,16	0,00	6.783.076,96	0,00	11.508,80	0,17%	1,09%	0,60%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	73.944,56	192.407,45	188.634,41	77.977,55	259,95	0,10%	0,00%	0,40%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	52.494,17	797.958,41	830.000,00	20.788,50	335,92	0,04%	0,00%	0,39%
BBIF MASTER FIDC LP	276.453,01	0,00	0,00	275.499,42	-953,59	-0,34%	0,03%	-0,34%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	6.137.181,01	0,00	0,00	5.918.973,60	-218.207,41	-3,56%	7,49%	-3,56%
Total Renda Fixa					501.501,57	0,45%	0,90%	

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(%)
PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.927.572,73	0,00	0,00	1.985.979,84	58.407,11	3,03%	8,19%	3,03%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.167.320,99	0,00	0,00	5.280.738,70	113.417,71	2,19%	9,71%	2,19%
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	2.255.635,66	0,00	0,00	2.282.602,50	26.966,84	1,20%	8,40%	1,20%
SULAMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	2.926.413,25	0,00	0,00	2.949.049,48	22.636,23	0,77%	0,30%	0,77%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	7.136.362,92	0,00	1.000.000,00	6.173.637,39	37.274,47	0,52%	0,31%	0,52%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	3.254.582,12	0,00	0,00	3.249.618,24	-4.963,88	-0,15%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	1.186.437,82	260.000,00	0,00	1.440.762,28	-5.675,54	-0,39%	-	-
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.355.441,12	0,00	0,00	2.310.152,18	-45.288,94	-1,92%	6,80%	-1,92%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	2.043.911,62	0,00	0,00	2.003.706,00	-40.205,62	-1,97%	6,81%	-1,97%
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FI AÇÕES	2.025.339,91	0,00	0,00	1.962.229,80	-63.110,11	-3,12%	6,66%	-3,12%
Total Renda Variável					99.458,27	0,33%	5,29%	

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.123.774,64	10.589.790,09	2.205.000,00	23.787.543,19	278.978,46	1,44%	1,69%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	11.904.031,67	2.485.000,00	260.000,00	14.372.093,61	243.061,94	1,78%	1,85%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	10.580.162,02	0,00	0,00	10.751.963,48	171.801,46	1,62%	1,62%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	9.967.658,90	0,00	0,00	10.137.817,13	170.158,23	1,71%	1,71%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.765.588,53	457.070,86	10.820.361,72	521.463,98	119.166,31	1,34%	1,53%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	6.705.444,45	0,00	0,00	6.822.996,72	117.552,27	1,75%	1,75%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.209.039,35	0,00	5.322.686,61	0,00	113.647,26	2,18%	2,05%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	5.020.688,19	0,00	0,00	5.122.612,37	101.924,18	2,03%	2,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.027.783,48	5.323.277,77	0,00	9.444.688,76	93.627,51	1,68%	2,36%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.296.198,22	0,00	0,00	3.373.351,77	77.153,55	2,34%	2,34%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.706.266,66	0,00	6.783.076,96	0,00	76.810,30	1,15%	1,58%
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	5.486.111,40	0,00	0,00	5.558.340,72	72.229,32	1,32%	1,32%
BTG PACTUAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO NTN-B	2.575.641,20	0,00	0,00	2.643.547,00	67.905,80	2,64%	2,64%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	3.352.669,17	0,00	0,00	3.405.440,77	52.771,60	1,57%	1,57%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.740.202,00	0,00	75.483,09	2.715.918,69	51.199,78	1,88%	1,86%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,00	6.600.000,00	0,00	6.613.719,33	13.719,33	0,21%	1,37%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	208.761,40	2.303.128,37	2.492.321,18	20.788,50	1.219,91	0,13%	1,31%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	65.629,68	691.741,28	680.514,51	77.977,55	1.121,10	0,37%	1,37%
BBIF MASTER FIDC LP	278.459,87	0,00	0,00	275.499,42	-2.960,45	-1,06%	-1,06%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	6.139.794,79	0,00	0,00	5.918.973,60	-220.821,19	-3,60%	-3,60%
Total Renda Fixa					1.600.266,67	1,45%	

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 (%)
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.106.131,53	0,00	0,00	5.280.738,70	174.607,17	3,42%	3,42%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	7.059.414,12	0,00	1.000.000,00	6.173.637,39	114.223,27	1,62%	1,62%
PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.900.256,59	0,00	0,00	1.985.979,84	85.723,25	4,51%	4,51%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.245.618,53	0,00	0,00	2.310.152,18	64.533,65	2,87%	2,87%
SULAMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	2.887.300,35	0,00	0,00	2.949.049,48	61.749,13	2,14%	2,14%
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	2.222.674,25	0,00	0,00	2.282.602,50	59.928,25	2,70%	2,70%
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FI AÇÕES	1.961.186,91	0,00	0,00	1.962.229,80	1.042,89	0,05%	0,05%
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	3.266.382,13	0,00	0,00	3.249.618,24	-16.763,89	-0,51%	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	1.201.493,11	260.000,00	0,00	1.440.762,28	-20.730,83	-1,64%	-
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	2.057.456,70	0,00	0,00	2.003.706,00	-53.750,70	-2,61%	-2,61%
Total Renda Variável					470.562,19	1,57%	