

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
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.784.266,54	9,16%	701	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	95.462,76	0,13%	1.267	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	71.532,92	0,10%	733	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	1.088.483,64	1,47%	73	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	609.807,04	0,82%	507	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	193.586,19	0,26%	599	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	720.929,89	0,97%	95	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.741.539,96	10,46%	313	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.376.009,28	1,86%	115	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	1.111.153,10	1,50%	107	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	9.843.978,77	13,30%	1.471	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2030	1.331.868,00	1,80%	34	0,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.257.158,99	3,05%	674	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+0	Não há	911.316,29	1,23%	263	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	3.066.375,69	4,14%	814	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.135.142,04	1,53%	449	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	2.536.850,39	3,43%	171	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	4.415.910,43	5,96%	12.167	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	8.595.612,38	11,61%	310	0,35%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.106.544,13	2,85%	54	1,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	1.033.439,04	1,40%	73	0,20%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.316.653,55	1,78%	36	1,86%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "

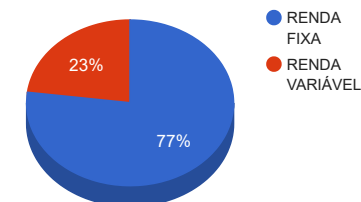
Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.642.624,85	2,22%	6	2,98%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	D+4	Não há	507.965,54	0,69%	85	0,09%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+33	Não há	494.175,12	0,67%	30	1,80%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	D+45	5 anos	735.593,28	0,99%	55	0,76%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.042.721,81	1,41%	139	0,10%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	2.339.072,88	3,16%	2.841	7,52%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.415.661,98	3,26%	1.369	0,17%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	2.654.658,51	3,59%	449	7,35%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	2.087.456,67	2,82%	729	0,80%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	1.015.461,46	1,37%	955	0,23%	Artigo 8º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	507.000,96	0,68%	217	0,11%	Artigo 8º, Inciso III
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	256.305,16	0,35%		0,01%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
TOTAL -			74.042.319,24				

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

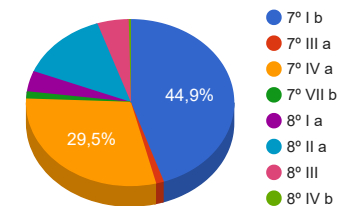
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	33.225.777,08	44,87%	15,00%	25,00%	90,00%	33.412.310,24
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	911.316,29	1,23%	5,00%	10,00%	60,00%	43.514.075,25
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	21.856.435,06	29,52%	5,00%	10,00%	40,00%	7.760.492,64
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	15,00%	15,00%	11.106.347,89
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	3.702.115,96
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	1.033.439,04	1,40%	0,00%	5,00%	5,00%	2.668.676,92
Total Renda Fixa	100,00%	57.026.967,47	77,02%	25,00	70,00	220,00	-

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%	2.959.278,40	4,00%	0,00%	5,00%	10,00%	4.444.953,52
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	10.189.849,12	13,76%	0,00%	5,00%	20,00%	4.618.614,73
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	3.609.919,09	4,88%	0,00%	10,00%	10,00%	3.794.312,83
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	3.702.115,96
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	256.305,16	0,35%	0,00%	5,00%	5,00%	3.445.810,80
Total Renda Variável	30,00%	17.015.351,77	22,98%	0,00	30,00	50,00	-

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 "	33.225.777,08	44,87%	15,00%	90,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	911.316,29	1,23%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	21.856.435,06	29,52%	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 "	1.033.439,04	1,40%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	57.026.967,47	77,02%	25,00	220,00

Artigos - Renda Variável	Base: setembro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	2.959.278,40	4,00%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	10.189.849,12	13,76%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	3.609.919,09	4,88%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	256.305,16	0,35%	0,00%	5,00%
Total Renda Variável	17.015.351,77	22,98%	0,00	50,00

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	56.302.687,03	76,04%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	7.974.732,70	10,77%	0,00%
ITAÚ UNIBANCO	5.222.197,05	7,05%	0,00%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	3.550.804,02	4,80%	0,00%
VINCI PARTNERS	735.593,28	0,99%	0,00%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	256.305,16	0,35%	0,02%

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%
IRF-M	1,30%	4,24%	1,83%	0,46%	5,74%	24,19%	-	-	-
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 IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,89%	11,40%	5,84%	8,75%	14,07%	23,86%	0,20%	1,552%	4,25%
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%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,55%	2,01%	-0,36%	2,41%	4,48%	6,93%	0,20%	0,161%	4,09%
IMA-B 5	0,89%	4,98%	2,11%	1,40%	6,53%	20,86%	-	-	-
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%
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%
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%	-	-	-
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%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,66%	4,24%	1,75%	1,35%	5,79%	-	0,002	0,548%	1,69%

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
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,42%	5,31%	1,37%	1,94%	6,32%	-	0,40%	0,054%	1,40%
Selic	0,47%	4,82%	1,59%	3,18%	6,66%	18,97%	-	-	-
BRADERCO 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%	-	-	-
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 MATRIZ FI RENDA FIXA	0,47%	4,68%	1,56%	3,10%	6,51%	18,86%	0,20%	0,037%	0,04%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,43%	4,63%	1,52%	3,05%	6,43%	18,72%	0,25%	0,034%	0,04%
IMA-B	-0,15%	2,88%	1,71%	-1,96%	2,55%	18,72%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,22%	0,58%	-0,32%	-0,11%	2,20%	10,31%	0,20%	0,844%	4,37%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,13%	2,87%	1,71%	-1,90%	2,54%	18,44%	0,20%	1,843%	4,76%
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%
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 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,26%	-1,93%	-1,37%	-4,92%	-2,30%	7,21%	0,20%	2,172%	6,42%

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

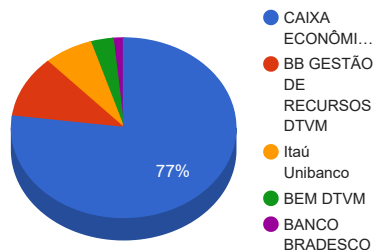
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	3,48%	3,85%	9,04%	-7,06%	6,80%	35,94%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	3,40%	3,55%	8,93%	-7,20%	6,29%	34,50%	0,50%	9,882%	20,06%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	0,92%	-	1,63%	1,04%	-	-	1,60%	0,854%	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,67%	-	-	-	-	-	1,60%	1,252%	-
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	-0,14%	-10,60%	-1,07%	-15,74%	-9,89%	7,30%	2,00%	10,544%	19,73%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-0,22%	-	5,11%	-14,04%	-	-	2,00%	10,959%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-1,28%	3,42%	0,98%	-7,49%	4,64%	36,31%	2,50%	8,187%	16,78%
IGCT	3,38%	1,94%	8,30%	-6,51%	4,47%	38,37%	-	-	-
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	3,35%	1,70%	8,25%	-6,70%	4,17%	37,41%	0,90%	9,707%	19,38%
ICON	0,51%	-16,76%	1,77%	-14,28%	-16,42%	0,47%	-	-	-
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	0,02%	-18,87%	0,76%	-16,26%	-18,77%	-1,24%	1,60%	10,492%	19,35%
CDI	0,47%	4,81%	1,59%	3,17%	6,65%	18,95%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,16%	5,07%	1,83%	3,22%	7,42%	20,45%	0,60%	1,599%	2,73%
IDIV	0,17%	-3,63%	3,48%	-12,68%	-5,33%	34,44%	-	-	-
BRAPRECO 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 VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	-0,86%	-5,90%	0,90%	-14,22%	-5,02%	11,36%	1,72%	8,079%	18,09%

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

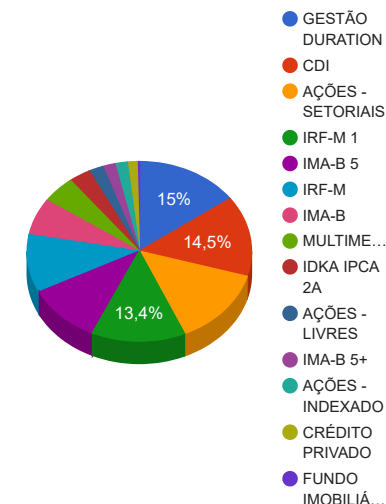
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Global BDRX	-0,43%	35,16%	13,15%	38,35%	52,91%	75,30%	-	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	-0,59%	32,87%	12,55%	36,43%	49,63%	69,31%	0,70%	7,748%	15,39%
IFIX	-0,21%	-4,12%	0,45%	-9,45%	-3,88%	17,55%	-	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	0,30%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	57.038.280,31	77,03%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	8.231.037,86	11,12%
Itaú Unibanco	5.222.197,05	7,05%
BEM DTVM	2.415.661,98	3,26%
BANCO BRADESCO	1.135.142,04	1,53%

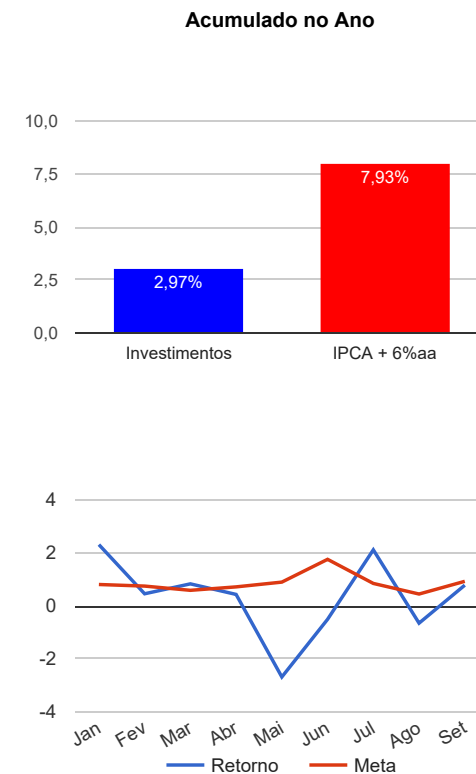


Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	11.132.462,77	15,04%
CDI	10.723.972,29	14,48%
AÇÕES - SETORIAIS	10.295.577,04	13,90%
IRF-M 1	9.939.441,53	13,42%
IMA-B 5	7.895.419,64	10,66%
IRF-M	7.741.539,96	10,46%
IMA-B	4.900.132,33	6,62%
MULTIMERCADO	3.609.919,09	4,88%
IDKA IPCA 2A	2.328.691,91	3,15%
AÇÕES - LIVRES	1.536.896,93	2,08%
IMA-B 5+	1.331.868,00	1,80%
AÇÕES - INDEXADO	1.316.653,55	1,78%
CRÉDITO PRIVADO	1.033.439,04	1,40%
FUNDO IMOBILIÁRIO	256.305,16	0,35%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	74.839.932,74	5.062.074,36	6.070.623,12	75.556.887,15	1.725.503,17	2,31%	0,80%	287,67%	2,05%
Fevereiro	75.556.887,15	2.895.072,78	3.934.061,59	74.857.607,11	339.708,77	0,45%	0,74%	60,89%	2,62%
Março	74.857.607,11	8.446.072,79	9.581.353,87	74.339.187,50	616.861,47	0,82%	0,58%	142,77%	1,69%
Abril	74.339.187,50	1.203.821,13	2.363.417,02	73.495.581,69	315.990,08	0,43%	0,71%	60,05%	1,68%
Mai	73.495.581,69	5.206.006,73	4.318.893,09	72.380.507,67	-2.002.187,66	-2,69%	0,89%	-302,88%	2,86%
Junho	72.380.507,67	3.803.919,33	3.198.156,10	72.610.861,35	-375.409,55	-0,51%	1,75%	-29,34%	3,30%
Julho	72.610.861,35	6.328.377,86	7.176.047,28	73.294.159,80	1.530.967,87	2,11%	0,84%	250,51%	1,82%
Agosto	73.294.159,80	7.606.206,99	7.360.650,48	73.054.238,59	-485.477,72	-0,66%	0,44%	-149,10%	2,99%
Setembro	73.054.238,59	2.991.304,10	2.572.414,83	74.042.319,24	569.191,38	0,77%	0,92%	83,99%	2,31%
Acumulado no ano					2.235.147,81	2,97%	7,93%	37,40%	



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(%)
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.097.767,71	0,00	0,00	1.111.153,10	13.385,39	1,22%	0,84%	1,22%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.651.046,60	0,00	0,00	7.741.539,96	90.493,36	1,18%	1,50%	1,18%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	70.704,79	0,00	0,00	71.532,92	828,13	1,17%	0,88%	1,17%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.231.445,76	0,00	0,00	2.257.158,99	25.713,23	1,15%	0,88%	1,15%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.363.894,98	0,00	0,00	1.376.009,28	12.114,30	0,89%	1,55%	0,89%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.024.357,68	0,00	0,00	1.033.439,04	9.081,36	0,89%	1,08%	0,89%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.726.634,03	0,00	0,00	6.784.266,54	57.632,51	0,86%	1,24%	0,86%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	714.944,64	0,00	0,00	720.929,89	5.985,25	0,84%	1,71%	0,84%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	8.539.567,39	0,00	0,00	8.595.612,38	56.044,99	0,66%	0,55%	0,66%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	94.902,68	0,00	0,00	95.462,76	560,08	0,59%	0,16%	0,59%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.324.528,00	0,00	0,00	1.331.868,00	7.340,00	0,55%	0,16%	0,55%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	3.012.973,90	40.594,79	2.014,67	3.066.375,69	14.821,67	0,49%	0,05%	0,49%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	2.096.670,55	0,00	0,00	2.106.544,13	9.873,58	0,47%	0,04%	0,47%
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.129.886,29	0,00	0,00	1.135.142,04	5.255,75	0,47%	0,01%	0,47%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.396.906,16	0,00	0,00	4.415.910,43	19.004,27	0,43%	0,03%	0,43%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	2.526.309,41	0,00	0,00	2.536.850,39	10.540,98	0,42%	0,05%	0,42%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.374.162,02	2.950.709,31	2.531.790,09	9.843.978,77	50.897,53	0,41%	0,15%	0,59%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	912.464,17	0,00	0,00	911.316,29	-1.147,88	-0,13%	1,84%	-0,13%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	610.794,08	0,00	0,00	609.807,04	-987,04	-0,16%	1,87%	-0,16%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	193.936,43	0,00	0,00	193.586,19	-350,24	-0,18%	1,89%	-0,18%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.091.345,24	0,00	0,00	1.088.483,64	-2.861,60	-0,26%	2,17%	-0,26%
Total Renda Fixa					384.225,62	0,68%	0,70%	

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(%)
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.334.720,09	0,00	0,00	2.415.661,98	80.941,89	3,47%	8,79%	3,47%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	1.273.317,18	0,00	0,00	1.316.653,55	43.336,37	3,40%	9,88%	3,40%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	1.589.425,91	0,00	0,00	1.642.624,85	53.198,94	3,35%	9,71%	3,35%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	501.184,49	0,00	0,00	507.000,96	5.816,47	1,16%	1,60%	1,16%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	291.744,58	0,00	38.610,07	256.305,16	3.170,65	1,09%	-	0,00%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	2.068.376,38	0,00	0,00	2.087.456,67	19.080,29	0,92%	0,85%	0,92%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	1.008.668,90	0,00	0,00	1.015.461,46	6.792,56	0,67%	1,25%	0,67%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	2.338.587,75	0,00	0,00	2.339.072,88	485,13	0,02%	10,49%	0,02%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	2.658.489,78	0,00	0,00	2.654.658,51	-3.831,27	-0,14%	10,54%	-0,14%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	495.243,29	0,00	0,00	494.175,12	-1.068,17	-0,22%	10,96%	-0,22%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	510.991,00	0,00	0,00	507.965,54	-3.025,46	-0,59%	7,75%	-0,59%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	741.982,29	0,00	0,00	735.593,28	-6.389,01	-0,86%	8,08%	-0,86%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.056.264,44	0,00	0,00	1.042.721,81	-13.542,63	-1,28%	8,19%	-1,28%
Total Renda Variável					184.965,76	1,10%	7,78%	

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	10.105.455,01	10.213.238,65	10.622.197,85	9.843.978,77	147.482,96	1,15%	1,69%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.647.681,79	0,00	0,00	6.784.266,54	136.584,75	2,05%	2,05%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.613.801,27	0,00	0,00	7.741.539,96	127.738,69	1,68%	1,68%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	4.871.853,78	3.600.000,00	0,00	8.595.612,38	123.758,60	1,46%	1,75%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.338.505,74	0,00	40.553,51	1.376.009,28	78.057,05	5,86%	5,84%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.725.368,88	0,00	3.600.000,00	193.586,19	68.217,31	1,21%	1,64%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.349.726,79	0,00	0,00	4.415.910,43	66.183,64	1,52%	1,52%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.205.103,34	0,00	0,00	2.257.158,99	52.055,65	2,36%	2,36%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	3.403.078,38	118.260,21	505.734,89	3.066.375,69	50.771,99	1,53%	1,57%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.336.648,00	0,00	39.950,87	1.331.868,00	35.170,87	2,65%	-0,36%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	2.074.215,03	0,00	0,00	2.106.544,13	32.329,10	1,56%	1,56%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.001.647,39	0,00	0,00	1.033.439,04	31.791,65	3,17%	3,17%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	2.012.355,45	494.390,09	0,00	2.536.850,39	30.104,85	1,31%	1,37%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.114.670,70	0,00	30.979,45	1.111.153,10	27.461,85	2,50%	-0,32%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.158.991,59	0,00	2.177.474,25	0,00	18.482,66	0,86%	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.117.735,19	0,00	0,00	1.135.142,04	17.406,85	1,56%	1,56%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	725.348,48	0,00	19.990,79	720.929,89	15.572,20	2,17%	2,15%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	896.038,62	0,00	0,00	911.316,29	15.277,67	1,71%	1,71%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.103.581,38	0,00	30.020,91	1.088.483,64	14.923,17	1,35%	-1,37%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	599.871,00	0,00	0,00	609.807,04	9.936,04	1,66%	1,66%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	69.896,86	0,00	0,00	71.532,92	1.636,06	2,34%	2,34%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	93.894,61	0,00	0,00	95.462,76	1.568,15	1,67%	1,67%
Total Renda Fixa					1.102.511,76	1,91%	

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 (%)
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.212.231,80	0,00	0,00	2.415.661,98	203.430,18	9,20%	9,20%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	1.517.428,18	0,00	0,00	1.642.624,85	125.196,67	8,25%	8,25%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	1.208.667,01	0,00	0,00	1.316.653,55	107.986,54	8,93%	8,93%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	2.053.956,20	0,00	0,00	2.087.456,67	33.500,47	1,63%	1,63%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	2.321.514,95	0,00	0,00	2.339.072,88	17.557,93	0,76%	0,76%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,00	1.000.000,00	0,00	1.015.461,46	15.461,46	1,55%	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	286.558,05	0,00	42.210,07	256.305,16	11.957,18	4,18%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.032.640,00	0,00	0,00	1.042.721,81	10.081,81	0,98%	0,98%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	0,00	500.000,00	0,00	507.965,54	7.965,54	1,59%	12,55%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	500.000,00	0,00	507.000,96	7.000,96	1,40%	1,83%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	729.043,45	0,00	0,00	735.593,28	6.549,83	0,90%	0,90%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	0,00	500.000,00	0,00	494.175,12	-5.824,88	-1,16%	5,11%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	2.683.352,43	0,00	0,00	2.654.658,51	-28.693,92	-1,07%	-1,07%
Total Renda Variável					512.169,77	3,96%	

