

Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2018



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 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	54.162.234,97	23,13%	715	0,67%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.322.562,49	3,55%	623	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	262.384,91	0,11%	57	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	987.159,72	0,42%	59	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	21.942.057,74	9,37%	741	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	25.855.422,92	11,04%	1.457	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	39.294.733,73	16,78%	674	0,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	18.709.512,75	7,99%	678	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.596.164,53	1,54%	298	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.768.544,32	2,46%	1.264	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	10.470.355,60	4,47%	209	0,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+0	Não há	9.397.234,92	4,01%	266	0,54%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	2.012.448,62	0,86%	156	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	10.558.125,63	4,51%	300	0,45%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou D+1461	Não há	642.763,20	0,27%	17	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	869.703,63	0,37%	798	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	7.544.751,86	3,22%	809	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	2.950,13	0,00%		0,31%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	22.326,21	0,01%	47	0,42%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.110.705,77	0,47%	21	2,99%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	999.082,25	0,43%	1.281	1,68%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	951.456,31	0,41%	478	2,11%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

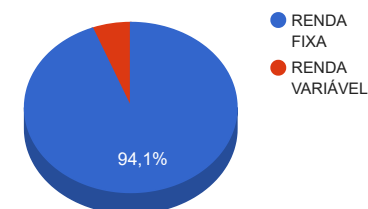
Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	2.007.947,56	0,86%	137	1,05%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	2.154.306,33	0,92%	2.440	1,06%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	3.096.238,41	1,32%	729	1,20%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	1.278.820,20	0,55%	45	0,38%	Artigo 8º, Inciso III
ÁTICO FLORESTAL MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	1.233.706,66	0,53%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	946.500,00	0,40%		0,63%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
		TOTAL -	234.200.201,37				

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

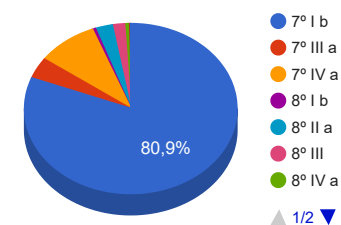
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	189.371.133,68	80,86%	40,00%	65,00%	100,00%	44.829.067,69
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	9.397.234,92	4,01%	5,00%	10,00%	20,00%	37.442.805,35
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	21.627.792,94	9,23%	10,00%	12,00%	40,00%	72.052.287,61
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	25.276,34	0,01%	0,00%	0,00%	3,00%	7.000.729,70
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	11.710.010,07
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	2,00%	4.684.004,03
Em Enquadramento - RF	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	2,00%	4.684.004,03
Total Renda Fixa	100,00%	220.421.437,88	94,12%	55,00	90,00	249,00	-

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%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	15,00%	35.130.030,21
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	30,00%	1.110.705,77	0,47%	0,00%	0,00%	10,00%	22.309.314,37
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	6.112.792,45	2,61%	1,00%	2,00%	15,00%	29.017.237,76
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	11.710.010,07
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	4.375.058,61	1,87%	0,00%	5,00%	10,00%	19.044.961,53
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	1.233.706,66	0,53%	0,00%	1,00%	3,00%	5.792.299,38
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	946.500,00	0,40%	0,00%	1,00%	2,00%	3.737.504,03
Desenquadrado - RV	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	2,00%	4.684.004,03
Em Enquadramento - RV	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	2,00%	4.684.004,03
Total Renda Variável	30,00%	13.778.763,49	5,88%	1,00	14,00	64,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: agosto / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	189.371.133,68	80,86%	40,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	9.397.234,92	4,01%	5,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	21.627.792,94	9,23%	10,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	2,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	25.276,34	0,01%	0,00%	3,00%
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%
Desenquadrado - RF	0,00	0,00%	0,00%	2,00%
Em Enquadramento - RF	0,00	0,00%	0,00%	2,00%
Total Renda Fixa	220.421.437,88	94,12%	55,00	249,00

Artigos - Renda Variável	Base: agosto / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	1.110.705,77	0,47%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	6.112.792,45	2,61%	1,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso III	4.375.058,61	1,87%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	1.233.706,66	0,53%	0,00%	3,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	946.500,00	0,40%	0,00%	2,00%
Desenquadrado - RV	0,00	0,00%	0,00%	2,00%
Em Enquadramento - RV	0,00	0,00%	0,00%	2,00%
Total Renda Variável	13.778.763,49	5,88%	1,00	64,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (agosto / 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	174.863.711,19	74,66%	0,04%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	47.289.818,44	20,19%	0,00%
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	5.604.112,09	2,39%	0,00%
ITAÚ UNIBANCO	3.261.993,25	1,39%	0,00%
WESTERN ASSET	1.278.820,20	0,55%	0,00%
ÁTICO ASSET MANAGEMENT	1.233.706,66	0,53%	1,43%
TMJ CAPITAL	642.763,20	0,27%	0,13%
VILA RICA CAPITAL	22.326,21	0,01%	0,02%
BRASIL PLURAL	2.950,13	0,00%	0,00%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI + 3,50% ao ano	0,88%	6,76%	2,56%	5,07%	10,54%	28,18%	-	-	-
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-9,06%	-96,25%	-17,96%	-36,64%	-92,70%	-74,56%	0,20%	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-24,63%	-78,04%	-44,36%	-65,87%	-72,74%	-93,69%	0,39%	39,243%	114,68%

CDI	0,57%	4,32%	1,64%	3,24%	6,83%	19,70%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,56%	4,19%	1,59%	3,15%	6,68%	19,56%	0,20%	0,006%	0,05%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,55%	4,26%	1,58%	3,18%	6,86%	19,86%	0,20%	0,018%	0,07%

IRF-M 1	0,44%	4,21%	1,65%	3,04%	6,90%	20,96%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,41%	4,08%	1,59%	2,94%	6,70%	20,53%	0,20%	0,244%	0,51%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,40%	4,01%	1,54%	2,89%	6,61%	20,35%	0,20%	0,234%	0,51%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,40%	4,04%	1,58%	2,90%	6,64%	20,37%	0,10%	0,244%	0,52%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,38%	4,01%	1,55%	2,88%	6,61%	20,42%	0,20%	0,244%	0,52%

IDKA IPCA 2 Anos	0,10%	4,72%	1,86%	3,28%	8,04%	23,52%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,01%	4,50%	1,41%	2,93%	7,39%	21,63%	0,20%	1,406%	2,22%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,08%	4,36%	1,45%	2,79%	7,27%	21,51%	0,20%	1,427%	2,22%

IRF-M 1+	-1,47%	2,37%	0,16%	-0,49%	5,50%	26,52%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,65%	2,26%	0,11%	-0,80%	5,12%	25,78%	0,20%	3,056%	4,23%

IRF-M	-0,93%	2,91%	0,57%	0,48%	5,93%	25,00%	-	-	-
-------	--------	-------	-------	-------	-------	--------	---	---	---

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

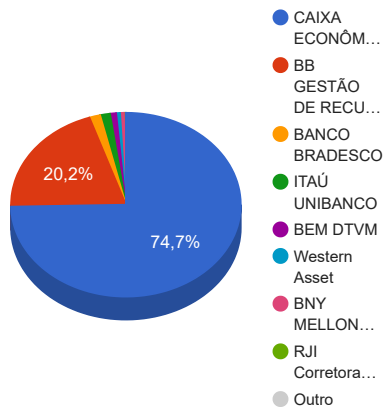
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,96%	2,79%	0,53%	0,37%	5,71%	24,46%	0,20%	2,220%	3,07%
IMA-B	-0,45%	3,04%	1,53%	-0,90%	4,57%	20,76%	-	-	-
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	-0,12%	1,23%	0,94%	-1,88%	3,48%	19,22%	1,30%	2,307%	3,96%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,45%	3,00%	1,47%	-0,88%	4,51%	20,38%	0,20%	3,380%	4,70%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,46%	2,87%	1,46%	-1,02%	4,31%	20,36%	0,20%	3,476%	4,83%
IMA-B 5	-0,26%	4,06%	1,67%	2,14%	6,66%	21,49%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,27%	3,90%	1,61%	2,01%	6,42%	21,03%	0,20%	1,979%	2,83%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	-0,29%	3,77%	1,56%	1,92%	6,23%	20,53%	0,40%	1,963%	2,82%
IPCA	-0,09%	2,85%	1,50%	2,22%	4,19%	6,75%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,37%	4,87%	1,54%	2,56%	7,48%	-	0,40%	0,232%	1,54%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,14%	3,56%	1,54%	1,87%	5,95%	-	0,002	0,894%	1,68%

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

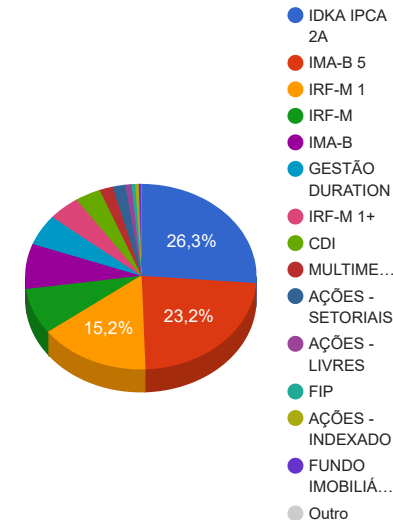
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,57%	4,32%	1,64%	3,24%	6,83%	19,70%	-	-	-
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	-0,43%	5,30%	0,59%	2,95%	7,90%	21,05%	2,00%	0,570%	1,52%
SMLL	-4,25%	-8,44%	-3,06%	-11,92%	-2,33%	33,39%	-	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-3,94%	-8,95%	-3,06%	-12,66%	-2,00%	33,66%	1,50%	10,049%	18,31%
IDIV	-3,70%	-3,80%	-1,17%	-11,91%	0,29%	33,84%	-	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-2,29%	-8,85%	-2,45%	-13,53%	-4,38%	8,38%	1,50%	8,407%	16,86%
Ibovespa	-3,21%	0,36%	-0,10%	-10,16%	8,25%	32,43%	-	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	-0,42%	-	0,44%	2,05%	-	-	1,60%	1,364%	-
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	-2,35%	6,91%	0,67%	-6,90%	16,08%	43,21%	1,50%	10,224%	19,77%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	-3,07%	0,17%	-0,09%	-10,13%	7,60%	31,41%	0,50%	11,007%	19,65%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	-4,43%	-10,47%	-5,32%	-16,36%	-6,08%	6,14%	2,00%	11,341%	19,08%
IFIX	-0,70%	-3,91%	-3,37%	-7,44%	2,66%	21,07%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-3,41%	-11,54%	-8,82%	-16,83%	-7,11%	-4,74%	1,20%	9,122%	22,06%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ÁTICO FLORESTAL MULTIELABORATÓRIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	174.863.711,19	74,66%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	47.289.818,44	20,19%
BANCO BRADESCO	3.596.164,53	1,54%
ITAÚ UNIBANCO	3.261.993,25	1,39%
BEM DTVM	2.007.947,56	0,86%
Western Asset	1.278.820,20	0,55%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	1.233.706,66	0,53%
RJI Corretora de Valores	642.763,20	0,27%
BRL Trust Investimentos	22.326,21	0,01%
Geração Futuro	2.950,13	0,00%

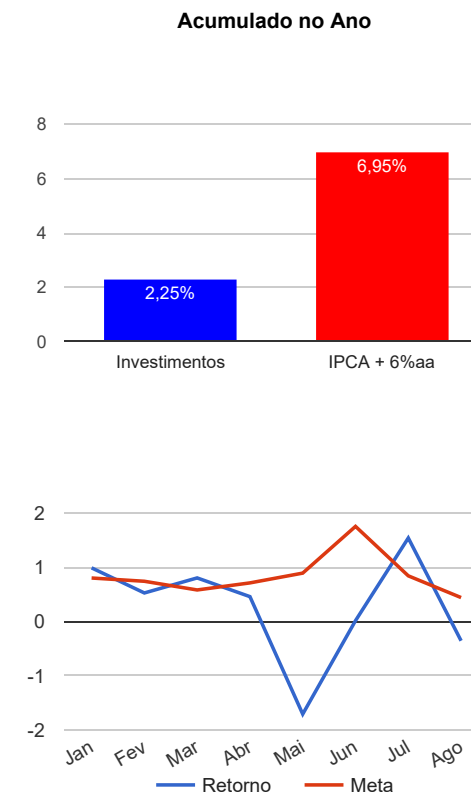


Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	61.236.791,47	26,15%
IMA-B 5	54.162.234,97	23,13%
IRF-M 1	35.482.516,68	15,15%
IRF-M	18.709.512,75	7,99%
IMA-B	18.362.560,61	7,84%
GESTÃO DURATION	12.570.574,25	5,37%
IRF-M 1+	10.470.355,60	4,47%
CDI	8.414.455,49	3,59%
MULTIMERCADO	4.375.058,61	1,87%
AÇÕES - SETORIAIS	4.104.844,89	1,75%
AÇÕES - LIVRES	2.007.947,56	0,86%
FIP	1.233.706,66	0,53%
AÇÕES - INDEXADO	1.110.705,77	0,47%
FUNDO IMOBILIÁRIO	946.500,00	0,40%
FIDC - FECHADO	25.276,34	0,01%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	218.358.197,99	3.256.598,24	584.529,28	223.211.271,45	2.181.004,50	0,99%	0,80%	123,12%	0,58%
Fevereiro	223.211.271,45	32.046.177,92	29.063.833,93	227.380.909,32	1.187.293,88	0,52%	0,74%	71,09%	0,64%
Março	227.380.909,32	5.700.509,83	3.998.503,56	230.919.074,26	1.836.158,67	0,80%	0,58%	138,87%	0,60%
Abril	230.919.074,26	131.368.431,63	130.651.708,81	232.694.872,29	1.059.075,21	0,46%	0,71%	64,59%	0,84%
Mai	232.694.872,29	1.685.173,82	1.066.270,58	229.336.706,31	-3.977.069,22	-1,70%	0,89%	-191,81%	1,71%
Junho	229.336.706,31	1.804.315,46	1.051.639,34	230.123.823,29	34.440,86	0,01%	1,75%	0,85%	3,02%
Julho	230.123.823,29	9.361.449,78	8.674.997,13	234.356.082,82	3.545.806,88	1,54%	0,84%	182,52%	1,22%
Agosto	234.356.082,82	22.612.546,59	21.934.415,70	234.200.201,37	-834.012,34	-0,35%	0,44%	-80,15%	1,88%
Acumulado no ano					5.032.698,44	2,25%	6,95%	32,38%	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de agosto / 2018

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	864.915,53	0,00	0,00	869.703,63	4.788,10	0,55%	0,02%	0,55%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	6.817.234,61	1.739.603,20	1.053.639,70	7.544.751,86	41.553,75	0,49%	0,01%	0,56%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	869.099,24	0,00	872.943,39	0,00	3.844,15	0,44%	0,14%	0,61%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	261.351,24	0,00	0,00	262.384,91	1.033,67	0,40%	0,23%	0,40%
BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.582.551,62	0,00	0,00	3.596.164,53	13.612,91	0,38%	0,24%	0,38%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	2.004.979,94	0,00	0,00	2.012.448,62	7.468,68	0,37%	0,23%	0,37%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.875.448,53	872.943,39	0,00	5.768.544,32	20.152,40	0,35%	0,24%	0,40%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.794.784,72	20.000.000,00	0,00	25.855.422,92	60.638,20	0,24%	0,24%	0,41%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	10.543.360,24	0,00	0,00	10.558.125,63	14.765,39	0,14%	0,89%	0,14%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	39.292.674,25	0,00	0,00	39.294.733,73	2.059,48	0,01%	1,41%	0,01%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	21.958.925,23	0,00	0,00	21.942.057,74	-16.867,49	-0,08%	1,43%	-0,08%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	643.529,16	0,00	0,00	642.763,20	-765,96	-0,12%	2,31%	-0,12%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	54.309.009,89	0,00	0,00	54.162.234,97	-146.774,92	-0,27%	1,98%	-0,27%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	990.028,70	0,00	0,00	987.159,72	-2.868,98	-0,29%	1,96%	-0,29%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	9.439.766,26	0,00	0,00	9.397.234,92	-42.531,34	-0,45%	3,38%	-0,45%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.361.408,36	0,00	0,00	8.322.562,49	-38.845,87	-0,46%	3,48%	-0,46%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	30.753.834,84	0,00	20.000.000,00	10.470.355,60	-283.479,24	-0,92%	3,06%	-1,65%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	18.890.059,40	0,00	0,00	18.709.512,75	-180.546,65	-0,96%	2,22%	-0,96%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	3.244,00	0,00	0,00	2.950,13	-293,87	-9,06%	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	29.621,40	0,00	832,61	22.326,21	-6.462,58	-21,82%	39,24%	-24,63%
Total Renda Fixa					-549.520,17	-0,25%	1,59%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de agosto / 2018

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
ÁTICO FLORESTAL MULTISTRATÉGIA FIP	1.233.706,66	0,00	0,00	1.233.706,66	0,00	0,00%	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	3.109.373,25	0,00	0,00	3.096.238,41	-13.134,84	-0,42%	1,36%	-0,42%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1.284.394,28	0,00	0,00	1.278.820,20	-5.574,08	-0,43%	0,57%	-0,43%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.022.500,45	0,00	0,00	999.082,25	-23.418,20	-2,29%	8,41%	-2,29%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	2.056.314,80	0,00	0,00	2.007.947,56	-48.367,24	-2,35%	10,22%	-2,35%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	979.870,00	0,00	7.000,00	946.500,00	-26.370,00	-2,69%	9,12%	-3,41%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	1.145.882,32	0,00	0,00	1.110.705,77	-35.176,55	-3,07%	11,01%	-3,07%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	2.242.654,11	0,00	0,00	2.154.306,33	-88.347,78	-3,94%	10,05%	-3,94%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	995.559,79	0,00	0,00	951.456,31	-44.103,48	-4,43%	11,34%	-4,43%
Total Renda Variável					-284.492,17	-2,02%	6,95%	