

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
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	995.596,92	0,42%	72	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	264.045,54	0,11%	58	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	22.199.054,85	9,37%	733	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	39.747.531,71	16,78%	674	0,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	26.007.639,41	10,98%	1.471	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	18.949.152,15	8,00%	650	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRASESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	3.618.289,92	1,53%	298	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.802.588,12	2,45%	1.267	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	10.619.222,77	4,48%	192	0,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	54.626.286,66	23,06%	701	0,67%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.307.531,79	3,51%	599	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+0	Não há	9.385.413,11	3,96%	263	0,54%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	873.978,78	0,37%	814	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou D+1461	Não há	637.941,38	0,27%	17	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	8.269.011,73	3,49%	822	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	10.627.418,38	4,49%	310	0,43%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	2.020.845,52	0,85%	171	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	2.774,79	0,00%		0,31%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	17.330,17	0,01%	47	0,42%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.147.795,64	0,48%	21	2,99%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "
BRASESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	2.093.378,95	0,88%	144	0,98%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	2.107.832,88	0,89%	2.337	1,09%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

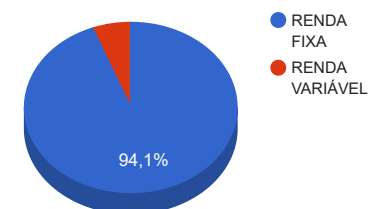
Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	950.085,13	0,40%	449	2,63%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	994.386,51	0,42%	1.250	1,70%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	3.124.800,49	1,32%	729	1,20%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	1.286.041,15	0,54%	45	0,39%	Artigo 8º, Inciso III
ÁTICO FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	1.233.706,66	0,52%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	955.000,00	0,40%		0,63%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
		TOTAL -	236.864.681,11				

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

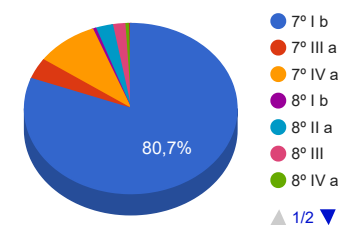
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	191.136.939,84	80,69%	40,00%	65,00%	100,00%	45.727.741,27
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	9.385.413,11	3,96%	5,00%	10,00%	20,00%	37.987.523,11
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	22.429.195,79	9,47%	10,00%	12,00%	40,00%	72.316.676,65
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	20.104,96	0,01%	0,00%	0,00%	3,00%	7.085.835,47
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	11.843.234,06
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	2,00%	4.737.293,62
Em Enquadramento - RF	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	2,00%	4.737.293,62
Total Renda Fixa	100,00%	222.971.653,70	94,13%	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%	35.529.702,17
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	30,00%	1.147.795,64	0,48%	0,00%	0,00%	10,00%	22.538.672,47
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	6.145.683,47	2,59%	1,00%	2,00%	15,00%	29.384.018,70
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	11.843.234,06
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	4.410.841,64	1,86%	0,00%	5,00%	10,00%	19.275.626,47
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	1.233.706,66	0,52%	0,00%	1,00%	3,00%	5.872.233,77
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	955.000,00	0,40%	0,00%	1,00%	2,00%	3.782.293,62
Desenquadrado - RV	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	2,00%	4.737.293,62
Em Enquadramento - RV	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	2,00%	4.737.293,62
Total Renda Variável	30,00%	13.893.027,41	5,87%	1,00	14,00	64,00	-

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 " a "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	191.136.939,84	80,69%	40,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	9.385.413,11	3,96%	5,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	22.429.195,79	9,47%	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 "	20.104,96	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	222.971.653,70	94,13%	55,00	249,00

Artigos - Renda Variável	Base: setembro / 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 "	1.147.795,64	0,48%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	6.145.683,47	2,59%	1,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso III	4.410.841,64	1,86%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	1.233.706,66	0,52%	0,00%	3,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	955.000,00	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	13.893.027,41	5,87%	1,00	64,00

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	176.869.956,21	74,67%	0,04%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	47.824.773,90	20,19%	0,00%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	5.711.668,87	2,41%	0,00%
ITAÚ UNIBANCO	3.280.487,98	1,38%	0,00%
WESTERN ASSET	1.286.041,15	0,54%	0,00%
ÁTICO ASSET MANAGEMENT	1.233.706,66	0,52%	1,46%
Elleven Gestora de Recursos	637.941,38	0,27%	0,13%
VILA RICA CAPITAL	17.330,17	0,01%	0,01%
BRASIL PLURAL	2.774,79	0,00%	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
IRF-M 1+	1,57%	3,98%	1,88%	-0,49%	5,33%	25,58%	-	-	-
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%
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%	-	-	-
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%	-	-	-
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%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	0,85%	4,66%	2,01%	1,19%	6,10%	19,91%	0,40%	1,232%	2,89%
CDI + 3,50% ao ano	0,73%	7,53%	2,48%	4,98%	10,34%	27,33%	-	-	-
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-5,94%	-96,47%	-18,75%	-19,49%	-56,31%	-73,67%	0,20%	1,005%	756,71%
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%	-	-	-
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,63%	4,67%	1,68%	2,88%	6,53%	19,72%	0,20%	0,154%	0,51%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,62%	4,65%	1,66%	2,85%	6,51%	19,76%	0,20%	0,160%	0,53%
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%

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

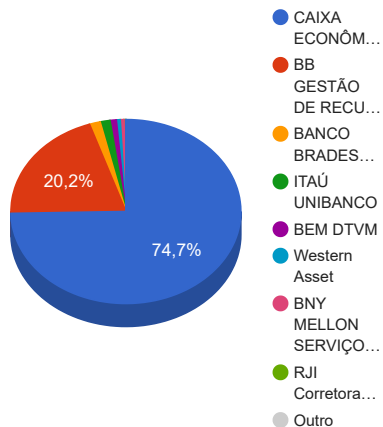
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,59%	4,69%	1,69%	2,89%	6,57%	19,83%	0,20%	0,154%	0,52%
IPCA	0,48%	3,34%	0,72%	2,62%	4,53%	7,18%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,66%	4,24%	1,75%	1,35%	5,79%	-	0,002	0,548%	1,69%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,42%	5,31%	1,37%	1,94%	6,32%	-	0,40%	0,054%	1,40%
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 FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,44%	4,65%	1,53%	3,08%	6,48%	18,78%	0,20%	0,020%	0,04%
IMA-B	-0,15%	2,88%	1,71%	-1,96%	2,55%	18,72%	-	-	-
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%
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%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	-0,75%	0,47%	0,93%	-4,04%	1,42%	15,27%	1,30%	1,514%	4,03%

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

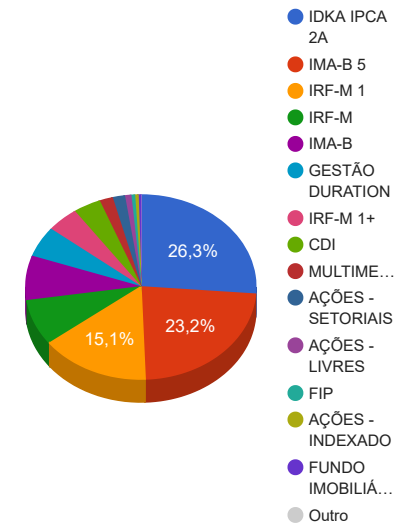
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	3,48%	3,85%	9,04%	-7,06%	6,80%	35,94%	-	-	-
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	4,25%	11,45%	9,58%	-4,84%	14,49%	50,30%	1,50%	8,916%	20,00%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	3,34%	3,52%	8,91%	-7,17%	6,11%	34,47%	0,50%	9,227%	20,03%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	0,92%	-	1,63%	1,04%	-	-	1,60%	0,854%	-
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	-0,14%	-10,60%	-1,07%	-15,74%	-9,89%	7,30%	2,00%	10,544%	19,73%
CDI	0,47%	4,81%	1,59%	3,17%	6,65%	18,95%	-	-	-
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	0,56%	5,90%	0,46%	2,66%	7,26%	20,75%	2,00%	0,447%	1,48%
IDIV	0,17%	-3,63%	3,48%	-12,68%	-5,33%	34,44%	-	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-0,47%	-9,28%	3,59%	-12,35%	-7,55%	9,16%	1,50%	6,737%	16,70%
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%
IFIX	-0,21%	-4,12%	0,45%	-9,45%	-3,88%	17,55%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	0,90%	-10,75%	4,26%	-17,67%	-13,18%	-3,44%	1,20%	13,966%	22,74%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ÁTICO FLORESTAL MULTIELABORAÇÃO FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	176.869.956,21	74,67%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	47.824.773,90	20,19%
BANCO BRADESCO	3.618.289,92	1,53%
ITAÚ UNIBANCO	3.280.487,98	1,38%
BEM DTVM	2.093.378,95	0,88%
Western Asset	1.286.041,15	0,54%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	1.233.706,66	0,52%
RJI Corretora de Valores	637.941,38	0,27%
BRL Trust Investimentos	17.330,17	0,01%
Geração Futuro	2.774,79	0,00%



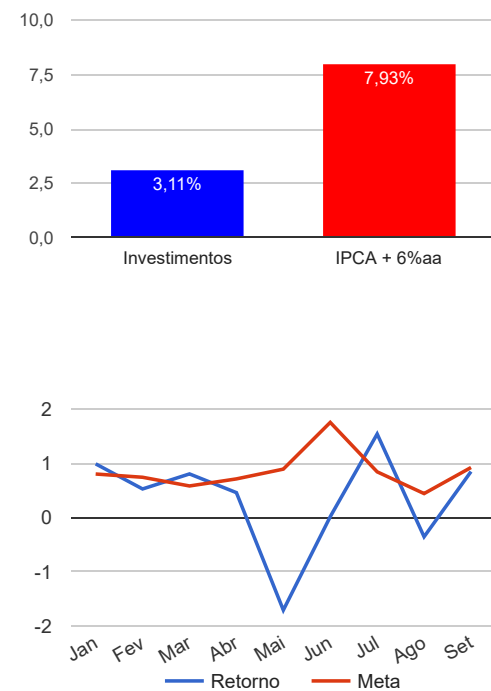
Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	61.946.586,56	26,15%
IMA-B 5	54.626.286,66	23,06%
IRF-M 1	35.692.562,99	15,07%
IRF-M	18.949.152,15	8,00%
IMA-B	18.330.886,28	7,74%
GESTÃO DURATION	12.648.263,90	5,34%
IRF-M 1+	10.619.222,77	4,48%
CDI	9.142.990,51	3,86%
MULTIMERCADO	4.410.841,64	1,86%
AÇÕES - SETORIAIS	4.052.304,52	1,71%
AÇÕES - LIVRES	2.093.378,95	0,88%
FIP	1.233.706,66	0,52%
AÇÕES - INDEXADO	1.147.795,64	0,48%
FUNDO IMOBILIÁRIO	955.000,00	0,40%
FIDC - FECHADO	20.104,96	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%
Setembro	234.200.201,37	1.733.536,84	1.053.482,58	236.864.681,11	1.984.425,48	0,84%	0,92%	91,59%	1,28%
Acumulado no ano					7.017.123,92	3,11%	7,93%	39,24%	

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(%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.470.355,60	0,00	0,00	10.619.222,77	148.867,17	1,42%	2,05%	1,42%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	18.709.512,75	0,00	0,00	18.949.152,15	239.639,40	1,28%	1,51%	1,28%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	21.942.057,74	0,00	0,00	22.199.054,85	256.997,11	1,17%	0,88%	1,17%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	39.294.733,73	0,00	0,00	39.747.531,71	452.797,98	1,15%	0,88%	1,15%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	54.162.234,97	0,00	0,00	54.626.286,66	464.051,69	0,86%	1,24%	0,86%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	987.159,72	0,00	0,00	995.596,92	8.437,20	0,85%	1,23%	0,85%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	10.558.125,63	0,00	0,00	10.627.418,38	69.292,75	0,66%	0,55%	0,66%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	262.384,91	0,00	0,00	264.045,54	1.660,63	0,63%	0,15%	0,63%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.596.164,53	0,00	0,00	3.618.289,92	22.125,39	0,62%	0,16%	0,62%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.768.544,32	0,00	0,00	5.802.588,12	34.043,80	0,59%	0,16%	0,59%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	25.855.422,92	0,00	0,00	26.007.639,41	152.216,49	0,59%	0,15%	0,59%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	869.703,63	0,00	0,00	873.978,78	4.275,15	0,49%	0,05%	0,49%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	2.012.448,62	0,00	0,00	2.020.845,52	8.396,90	0,42%	0,05%	0,42%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	7.544.751,86	1.733.536,84	1.045.287,37	8.269.011,73	36.010,40	0,39%	0,02%	0,44%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	9.397.234,92	0,00	0,00	9.385.413,11	-11.821,81	-0,13%	1,84%	-0,13%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.322.562,49	0,00	0,00	8.307.531,79	-15.030,70	-0,18%	1,89%	-0,18%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	642.763,20	0,00	0,00	637.941,38	-4.821,82	-0,75%	1,51%	-0,75%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	2.950,13	0,00	0,00	2.774,79	-175,34	-5,94%	1,00%	-5,94%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	22.326,21	0,00	1.195,21	17.330,17	-3.800,83	-17,02%	35,44%	-18,12%
Total Renda Fixa					1.863.161,56	0,84%	0,99%	

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(%)
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	2.007.947,56	0,00	0,00	2.093.378,95	85.431,39	4,25%	8,92%	4,25%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	1.110.705,77	0,00	0,00	1.147.795,64	37.089,87	3,34%	9,23%	3,34%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	946.500,00	0,00	7.000,00	955.000,00	15.500,00	1,64%	13,97%	0,90%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	3.096.238,41	0,00	0,00	3.124.800,49	28.562,08	0,92%	0,85%	0,92%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1.278.820,20	0,00	0,00	1.286.041,15	7.220,95	0,56%	0,45%	0,56%
ÁTICO FLORESTAL MULTIELSTRATÉGIA FIP	1.233.706,66	0,00	0,00	1.233.706,66	0,00	0,00%	-	-
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	951.456,31	0,00	0,00	950.085,13	-1.371,18	-0,14%	10,54%	-0,14%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	999.082,25	0,00	0,00	994.386,51	-4.695,74	-0,47%	6,74%	-0,47%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	2.154.306,33	0,00	0,00	2.107.832,88	-46.473,45	-2,16%	9,04%	-2,16%
Total Renda Variável					121.263,92	0,88%	6,45%	

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 IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	53.526.518,84	0,00	0,00	54.626.286,66	1.099.767,82	2,05%	2,05%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	38.830.855,74	0,00	0,00	39.747.531,71	916.675,97	2,36%	2,36%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	21.691.329,56	0,00	0,00	22.199.054,85	507.725,29	2,34%	2,34%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	34.132.560,93	0,00	24.000.000,00	10.619.222,77	486.661,84	2,32%	1,68%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	18.613.991,64	0,00	0,00	18.949.152,15	335.160,51	1,80%	1,80%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.755.444,29	20.000.000,00	0,00	26.007.639,41	252.195,12	1,51%	1,69%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	10.444.320,37	0,00	0,00	10.627.418,38	183.098,01	1,75%	1,75%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	9.228.072,32	0,00	0,00	9.385.413,11	157.340,79	1,71%	1,71%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.173.242,03	0,00	0,00	8.307.531,79	134.289,76	1,64%	1,64%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	6.088.947,19	5.274.483,23	3.206.817,61	8.269.011,73	112.398,92	1,32%	1,53%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.842.730,79	872.943,39	0,00	5.802.588,12	86.913,94	1,62%	1,67%
BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	3.560.106,59	0,00	3.618.289,92	58.183,33	1,63%	1,66%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,00	2.000.000,00	0,00	2.020.845,52	20.845,52	1,04%	1,37%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	975.978,38	0,00	0,00	995.596,92	19.618,54	2,01%	2,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	860.435,38	0,00	0,00	873.978,78	13.543,40	1,57%	1,57%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	864.741,57	0,00	872.943,39	0,00	8.201,82	0,95%	1,57%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	632.053,88	0,00	0,00	637.941,38	5.887,50	0,93%	0,93%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	259.682,79	0,00	0,00	264.045,54	4.362,75	1,68%	1,68%
BRADERCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	3.559.363,03	0,00	3.560.106,59	0,00	743,56	0,02%	-
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	3.415,12	0,00	0,00	2.774,79	-640,33	-18,75%	-18,75%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	36.707,95	0,00	2.027,82	17.330,17	-17.349,96	-47,65%	-52,79%
Total Renda Fixa					4.385.624,10	2,01%	

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 (%)
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	1.053.938,16	0,00	0,00	1.147.795,64	93.857,48	8,91%	8,91%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.093.378,95	93.378,95	4,67%	9,58%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	916.000,00	0,00	21.000,00	955.000,00	60.000,00	6,55%	4,26%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	3.074.652,25	0,00	0,00	3.124.800,49	50.148,24	1,63%	1,63%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	959.880,48	0,00	0,00	994.386,51	34.506,03	3,59%	3,59%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1.280.145,03	0,00	0,00	1.286.041,15	5.896,12	0,46%	0,46%
ÁTICO FLORESTAL MULTISTRATÉGIA FIP	1.233.706,66	0,00	0,00	1.233.706,66	0,00	0,00%	-
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	960.354,51	0,00	0,00	950.085,13	-10.269,38	-1,07%	-1,07%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	2.124.754,40	0,00	0,00	2.107.832,88	-16.921,52	-0,80%	-0,80%
Total Renda Variável					310.595,92	2,28%	