

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
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			6.459.886,94	0,99%			Artigo 20
TÍTULOS PÚBLICOS			244.474.498,74	37,57%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
BRADERCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	D+1	16/05/2019	121.750,02	0,02%	11	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2022	10.020.562,50	1,54%	17	12,91%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	21.111.850,96	3,24%	1.267	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	18/08/2020	6.607.830,00	1,02%	19	5,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	27.117.233,46	4,17%	1.471	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	14.418.597,71	2,22%	95	3,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	24.551.410,98	3,77%	507	0,67%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	48.543.376,77	7,46%	298	3,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	10.020.277,50	1,54%	38	5,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	11.245.087,42	1,73%	27	9,36%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	5.025.331,96	0,77%	171	0,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	12.027.034,75	1,85%	814	0,21%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	39.785.763,15	6,11%	310	1,62%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	54.470.113,94	8,37%	449	0,66%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	26.621,14	0,00%		3,01%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	5.788.824,00	0,89%	79	3,77%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
KINEA PIPE FI AÇÕES	D+30	Não há	368.777,39	0,06%	23	1,26%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	4.910.708,91	0,75%	36	6,92%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	D+13	Não há	2.072.501,26	0,32%	203	3,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.074.986,96	0,47%	2.212	0,58%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2018)

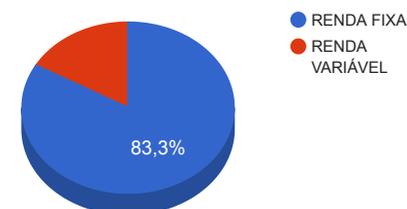
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	5.283.773,43	0,81%	76	3,77%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	D+45	Não há	4.589.707,88	0,71%	55	4,75%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	5.999.776,21	0,92%	5.123	1,04%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	2.159.720,15	0,33%	139	0,21%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	9.037.457,34	1,39%	47	9,23%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou D+18 (isento de taxa de	Não há	1.550.097,72	0,24%	784	0,80%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	resgate) D+33	Não há	5.025.265,55	0,77%	757	8,36%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	5.114.230,72	0,79%	217	1,07%	Artigo 8º, Inciso III
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	D+6	Não há	2.484.702,66	0,38%	2.688	1,88%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	10.888.188,25	1,67%	3.737	2,08%	Artigo 8º, Inciso III
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	7.515.155,48	1,15%	73	5,36%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	4.173.290,58	0,64%	729	1,61%	Artigo 8º, Inciso III
LA SHOPPING CENTERS MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	9.055.593,52	1,39%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	Não se aplica	Não se aplica	9.999.998,75	1,54%		4,84%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	4.271.752,51	0,66%		0,18%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	11.300.448,88	1,74%		16,80%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
TOTAL -			650.692.186,09				

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

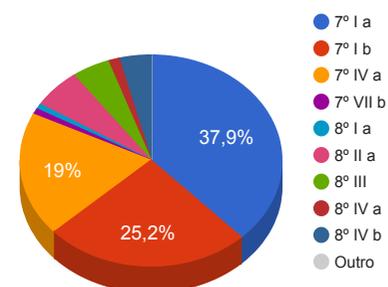
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	244.474.498,74	37,57%	0,00%	30,00%	50,00%	80.871.594,31
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	162.512.889,90	24,98%	15,00%	25,00%	70,00%	292.971.640,36
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	390.415.311,65
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	122.553.331,22	18,83%	5,00%	10,00%	30,00%	72.654.324,61
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	7,00%	15,00%	15,00%	97.603.827,91
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	26.621,14	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	32.507.988,16
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5.788.824,00	0,89%	2,00%	5,00%	5,00%	26.745.785,30
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	5.279.486,30	0,81%	2,00%	5,00%	10,00%	59.789.732,31
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	38.793.286,50	5,96%	2,00%	5,00%	10,00%	26.275.932,11
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	30.175.567,69	4,64%	7,00%	10,00%	10,00%	34.893.650,92
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	9.055.593,52	1,39%	2,00%	5,00%	5,00%	23.479.015,78
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	25.572.200,14	3,93%	2,00%	5,00%	5,00%	6.962.409,16
Total Carteira		644.232.299,15					

RENDA FIXA	541.816.051,94	84,10%
RENDA VARIÁVEL	108.876.134,15	16,90%

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 " a "	244.474.498,74	37,57%	0,00%	50,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	162.512.889,90	24,98%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	122.553.331,22	18,83%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	26.621,14	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5.788.824,00	0,89%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	5.279.486,30	0,81%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	38.793.286,50	5,96%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	30.175.567,69	4,64%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	9.055.593,52	1,39%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	25.572.200,14	3,93%	2,00%	5,00%
Total Renda Fixa	644.232.299,15	99,01%	51,00	280,00

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
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	244.474.498,74	37,57%	-
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	119.312.678,35	18,34%	0,03%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	114.380.328,15	17,58%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	86.260.582,46	13,26%	0,01%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	13.372.950,14	2,06%	2,86%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	11.559.465,83	1,78%	0,05%
ZION Invest	9.999.998,75	1,54%	2,04%
LEGATUS ASSET MANAGEMENT	9.055.593,52	1,39%	-
INFINITY ASSET MANAGEMENT	7.515.155,48	1,15%	1,22%
ITAÚ UNIBANCO	7.185.052,11	1,10%	0,00%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTO LTDA	5.283.773,43	0,81%	3,13%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	5.025.265,55	0,77%	0,01%
VINCI PARTNERS	4.589.707,88	0,71%	0,02%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	4.271.752,51	0,66%	0,27%
Occam Brasil	1.550.097,72	0,24%	0,01%

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
KINEA INVESTIMENTOS	368.777,39	0,06%	0,00%
BRASIL PLURAL	26.621,14	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
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%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,55%	2,13%	-0,29%	2,46%	4,59%	7,30%	0,20%	0,161%	3,98%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,55%	2,08%	-0,31%	2,44%	4,53%	7,13%	0,20%	0,161%	4,01%
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,54%	2,05%	-0,32%	2,41%	4,49%	7,10%	0,20%	0,161%	3,99%
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%
IRF-M 1	0,61%	4,85%	1,72%	2,99%	6,75%	20,26%	-	-	-
BRADERCO 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%
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 IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,16%	4,21%	2,37%	2,16%	5,83%	16,45%	0,20%	0,864%	2,07%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,66%	4,24%	1,75%	1,35%	5,79%	-	0,002	0,548%	1,69%
BRADERCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,50%	3,72%	1,50%	0,30%	-	-	0,40%	0,980%	-
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%	-	-	-

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
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%	-	-	-
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%
IMA-B	-0,15%	2,88%	1,71%	-1,96%	2,55%	18,72%	-	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	0,90%	2,57%	1,92%	0,45%	2,09%	5,55%	0,20%	0,220%	3,82%
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%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

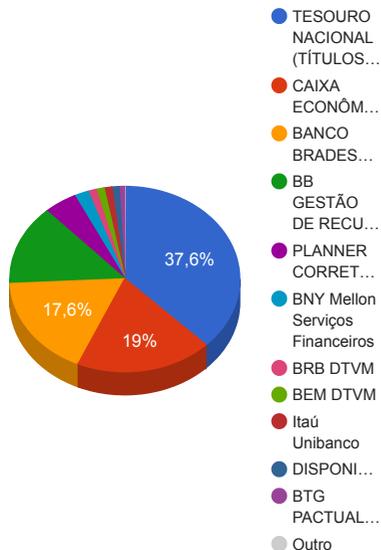
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	3,48%	3,85%	9,04%	-7,06%	6,80%	35,94%	-	-	-
OCCAM FIC AÇÕES	4,05%	9,83%	9,87%	-5,43%	12,58%	40,80%	3,00%	8,813%	19,70%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	3,67%	7,26%	10,70%	-3,11%	9,16%	31,64%	1,00%	9,137%	19,39%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	3,40%	3,55%	8,93%	-7,20%	6,29%	34,50%	0,50%	9,882%	20,06%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	3,23%	8,76%	9,34%	-4,22%	9,89%	36,94%	2,00%	10,820%	20,42%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	3,09%	10,68%	5,71%	-5,83%	11,78%	40,51%	2,00%	10,439%	20,56%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	0,92%	-	1,63%	1,04%	-	-	1,60%	0,854%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-1,28%	3,42%	0,98%	-7,49%	4,64%	36,31%	2,50%	8,187%	16,78%
IBX	3,23%	3,15%	8,84%	-7,32%	5,85%	34,89%	-	-	-
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	1,31%	-0,22%	2,04%	-10,63%	0,04%	18,17%	2,00%	8,102%	16,10%
IPCA + 8,00% ao ano	1,06%	9,45%	2,71%	6,68%	12,78%	24,82%	-	-	-
LA SHOPPING CENTERS MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,20%	-	-
CDI	0,47%	4,81%	1,59%	3,17%	6,65%	18,95%	-	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1,24%	3,85%	3,34%	-0,31%	5,93%	21,87%	1,00%	2,934%	5,78%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,16%	5,07%	1,83%	3,22%	7,42%	20,45%	0,60%	1,599%	2,73%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,52%	5,19%	1,62%	3,37%	7,13%	21,81%	1,00%	0,314%	0,55%
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	0,31%	-	-	-	-	-	1,50%	0,611%	2,06%

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

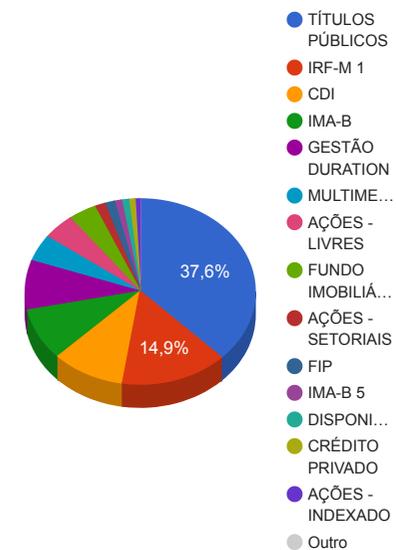
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDIV	0,17%	-3,63%	3,48%	-12,68%	-5,33%	34,44%	-	-	-
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	3,25%	-7,41%	4,58%	-13,08%	-7,23%	9,22%	2,50%	8,530%	16,22%
IVBX-2	0,01%	-7,45%	0,87%	-9,40%	-6,79%	12,30%	-	-	-
KINEA PIPE FI AÇÕES	-57,55%	-88,78%	-55,02%	-86,69%	-88,77%	-85,09%	1,50%	96,299%	85,58%
SMLL	-1,96%	-10,24%	-1,35%	-13,71%	-7,65%	30,66%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-0,59%	0,12%	-3,37%	-12,31%	1,11%	44,41%	2,00%	8,602%	17,96%
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%
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%	-	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,00%	-	-	0,00%	-	0,00%	0,14%	-	-
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	0,00%	-14,09%	-22,86%	-19,57%	5,00%	30,34%	1,60%	27,700%	95,99%

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

Administrador	Valor	%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	244.474.498,74	37,57%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	123.902.386,23	19,04%
BANCO BRADESCO	114.380.328,15	17,58%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	90.532.334,97	13,91%
PLANNER CORRETORA	30.356.041,15	4,67%
BNY Mellon Serviços Financeiros	13.109.563,55	2,01%
BRB DTVM	7.515.155,48	1,15%
BEM DTVM	7.356.274,69	1,13%
Itaú Unibanco	7.185.052,11	1,10%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	6.459.886,94	0,99%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	5.025.265,55	0,77%
INTRAG DTVM	368.777,39	0,06%
Geração Futuro	26.621,14	0,00%



Sub-segmento	Valor	%
TÍTULOS PÚBLICOS	244.474.498,74	37,57%
IRF-M 1	96.772.461,19	14,87%
CDI	66.497.148,69	10,22%
IMA-B	59.132.598,71	9,09%
GESTÃO DURATION	56.056.182,53	8,61%
MULTIMERCADO	30.175.567,69	4,64%
AÇÕES - LIVRES	29.547.090,46	4,54%
FUNDO IMOBILIÁRIO	25.572.200,14	3,93%
AÇÕES - SETORIAIS	9.614.973,43	1,48%
FIP	9.055.593,52	1,39%
IMA-B 5	6.607.830,00	1,02%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	6.459.886,94	0,99%
CRÉDITO PRIVADO	5.788.824,00	0,89%
AÇÕES - INDEXADO	4.910.708,91	0,75%
FIDC - FECHADO	26.621,14	0,00%



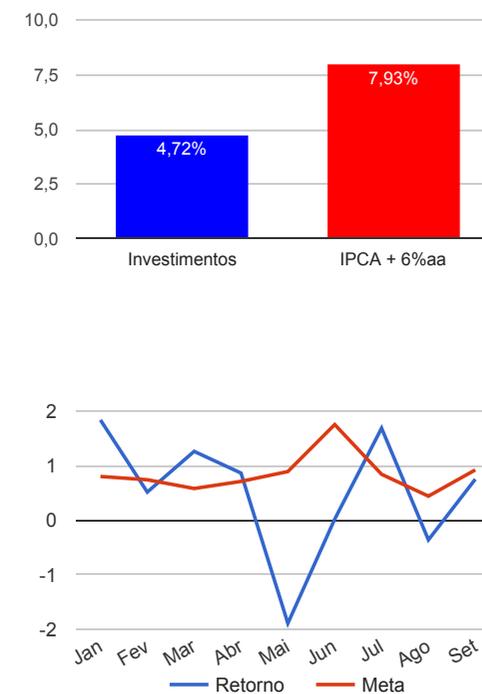
Carteira de Títulos Públicos - base (setembro / 2018)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	GAP (Atual - Pago)
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	10/11/2016	7000	3.029,485123	3.312,767964	21.206.395,86	23.189.375,75	1.982.979,89
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	29/08/2016	10000	2.967,972738	3.312,767964	29.679.727,38	33.127.679,64	3.447.952,26
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	12/09/2016	10000	2.980,886631	3.312,767964	29.808.866,31	33.127.679,64	3.318.813,33
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	14/09/2016	10000	2.971,010111	3.312,767964	29.710.101,11	33.127.679,64	3.417.578,53
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2022	27/07/2016	15000	2.963,303079	3.224,922859	44.449.546,19	48.373.842,89	3.924.296,70
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2022	04/08/2016	13000	2.979,58205	3.224,922859	38.734.566,65	41.923.997,17	3.189.430,52
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2022	30/06/2016	9800	2.911,042410	3.224,922859	28.528.215,62	31.604.244,02	3.076.028,40

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	584.156.333,20	14.667.688,99	7.486.328,56	602.182.628,02	10.844.934,39	1,83%	0,80%	228,82%	1,60%
Fevereiro	602.182.628,02	11.777.406,35	8.473.572,86	608.602.220,65	3.115.759,14	0,51%	0,74%	69,69%	2,54%
Março	608.602.220,65	39.755.038,41	35.345.681,01	620.732.257,86	7.720.679,81	1,26%	0,58%	218,21%	1,17%
Abril	620.732.257,86	14.351.803,63	10.996.132,53	629.470.189,75	5.382.260,79	0,86%	0,71%	121,84%	1,28%
Mai	629.470.189,75	39.726.924,20	35.000.331,75	622.227.880,47	-11.968.901,73	-1,89%	0,89%	-212,36%	1,98%
Junho	622.227.880,47	17.203.200,48	13.564.899,66	625.987.467,33	121.286,04	0,02%	1,75%	1,11%	4,27%
Julho	625.987.467,33	8.434.036,63	5.660.895,91	639.346.495,06	10.585.887,01	1,68%	0,84%	200,03%	3,07%
Agosto	639.346.495,06	54.750.987,21	50.112.611,11	641.666.290,85	-2.318.580,31	-0,36%	0,44%	-81,32%	3,21%
Setembro	641.666.290,85	27.421.624,04	29.667.285,81	644.232.299,15	4.811.670,07	0,75%	0,92%	81,29%	2,37%
Acumulado no ano					28.294.995,21	4,72%	7,93%	59,47%	

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 IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	5.722.488,00	0,00	0,00	5.788.824,00	66.336,00	1,16%	0,86%	1,16%
TÍTULOS PÚBLICOS	242.020.989,35	0,00	0,00	244.474.498,74	2.453.509,39	1,01%	-	-
BRANCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	120.666,55	0,00	0,00	121.750,02	1.083,47	0,90%	0,22%	0,90%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.298.892,66	0,00	0,00	14.418.597,71	119.705,05	0,84%	1,71%	0,84%
BRANCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	48.234.191,77	12.369,96	0,00	48.543.376,77	296.815,04	0,62%	0,16%	0,62%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.348.173,98	643.501,20	0,00	21.111.850,96	120.175,78	0,57%	0,16%	0,59%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.571.685,00	0,00	0,00	6.607.830,00	36.145,00	0,55%	0,16%	0,55%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.965.580,00	0,00	0,00	10.020.277,50	54.697,50	0,55%	0,16%	0,55%
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.966.352,50	0,00	0,00	10.020.562,50	54.210,00	0,54%	0,16%	0,54%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	28.746.663,85	5.223.264,82	7.021.976,81	27.117.233,46	169.281,60	0,50%	0,15%	0,59%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	11.189.449,17	0,00	0,00	11.245.087,42	55.638,25	0,50%	0,98%	0,50%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	23.513.630,70	16.076.443,70	0,00	39.785.763,15	195.688,75	0,49%	0,55%	0,66%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	11.968.203,32	0,00	0,00	12.027.034,75	58.831,43	0,49%	0,05%	0,49%
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	54.217.915,22	0,00	0,00	54.470.113,94	252.198,72	0,47%	0,01%	0,47%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	5.004.451,00	0,00	0,00	5.025.331,96	20.880,96	0,42%	0,05%	0,42%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24.591.150,41	0,00	0,00	24.551.410,98	-39.739,43	-0,16%	1,87%	-0,16%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	16.127.855,23	0,00	16.080.889,36	0,00	-46.965,87	-0,29%	1,89%	-0,18%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	28.303,43	0,00	0,00	26.621,14	-1.682,29	-5,94%	1,00%	-5,94%
Total Renda Fixa					3.866.809,35	0,73%	0,44%	

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	0,00	5.000.000,00	0,00	5.283.773,43	283.773,43	5,68%	10,82%	3,23%
OCCAM FIC AÇÕES	1.489.741,08	0,00	0,00	1.550.097,72	60.356,64	4,05%	8,81%	4,05%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	8.717.873,10	0,00	0,00	9.037.457,34	319.584,24	3,67%	9,14%	3,67%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	4.749.077,74	0,00	0,00	4.910.708,91	161.631,17	3,40%	9,88%	3,40%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	4.866.895,92	0,00	0,00	5.025.265,55	158.369,63	3,25%	8,53%	3,25%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	2.982.702,82	0,00	0,00	3.074.986,96	92.284,14	3,09%	10,44%	3,09%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	5.966.199,00	0,00	6.098.375,28	0,00	132.176,28	2,22%	9,13%	1,79%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	2.045.780,60	0,00	0,00	2.072.501,26	26.720,66	1,31%	8,10%	1,31%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	10.754.737,94	0,00	0,00	10.888.188,25	133.450,31	1,24%	2,93%	1,24%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	5.055.558,71	0,00	0,00	5.114.230,72	58.672,01	1,16%	1,60%	1,16%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	4.135.144,83	0,00	0,00	4.173.290,58	38.145,75	0,92%	0,85%	0,92%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	11.206.086,74	0,00	0,00	11.300.448,88	94.362,14	0,84%	-	0,84%
LA SHOPPING CENTERS MULTISTRATÉGIA FIP	8.988.721,37	0,00	0,00	9.055.593,52	66.872,15	0,74%	-	-
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	7.475.928,51	0,00	0,00	7.515.155,48	39.226,97	0,52%	0,31%	0,52%
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	2.011.484,20	466.044,36	0,00	2.484.702,66	7.174,10	0,29%	0,61%	0,31%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	9.999.998,75	0,00	0,00	9.999.998,75	0,00	0,00%	27,70%	0,00%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	6.035.330,23	0,00	0,00	5.999.776,21	-35.554,02	-0,59%	8,60%	-0,59%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	4.629.571,86	0,00	0,00	4.589.707,88	-39.863,98	-0,86%	8,08%	-0,86%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.187.770,10	0,00	0,00	2.159.720,15	-28.049,95	-1,28%	8,19%	-1,28%
KINEA PIPE FI AÇÕES	868.635,61	0,00	466.044,36	368.777,39	-33.813,86	-3,89%	96,30%	-57,55%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	4.862.409,60	0,00	0,00	4.271.752,51	-590.657,09	-12,15%	-	0,00%
Total Renda Variável					944.860,72	0,87%	9,02%	

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 (%)
TÍTULOS PÚBLICOS	242.366.127,31	0,00	3.502.804,47	244.474.498,74	5.611.175,90	2,33%	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	53.136.029,17	500.000,00	0,00	54.470.113,94	834.084,77	1,56%	1,56%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	47.738.405,72	12.369,96	0,00	48.543.376,77	792.601,09	1,66%	1,66%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	20.638.721,29	22.347.258,57	16.282.472,72	27.117.233,46	413.726,32	1,40%	1,69%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24.151.376,64	0,00	0,00	24.551.410,98	400.034,34	1,66%	1,66%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	18.365.571,25	21.024.149,70	0,00	39.785.763,15	396.042,20	1,52%	1,75%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.104.608,01	671.010,90	0,00	21.111.850,96	336.232,05	1,65%	1,67%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.506.969,50	0,00	399.815,77	14.418.597,71	311.443,98	2,17%	2,15%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.051.560,00	0,00	294.037,27	10.020.277,50	262.754,77	2,63%	-0,31%
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.053.225,00	0,00	293.739,48	10.020.562,50	261.076,98	2,61%	-0,32%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15.838.495,02	0,00	16.080.889,36	0,00	242.394,34	1,53%	1,64%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	24.607.560,00	0,00	24.818.220,00	0,00	210.660,00	0,86%	-
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.627.025,00	0,00	192.665,51	6.607.830,00	173.470,51	2,63%	-0,29%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.307.287,01	0,00	10.450.373,17	0,00	143.086,16	1,39%	1,58%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	5.654.804,00	0,00	0,00	5.788.824,00	134.020,00	2,37%	2,37%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	7.489.720,16	3.641.760,31	0,00	11.245.087,42	113.606,95	1,47%	1,50%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	11.942.832,98	0,00	12.027.034,75	84.201,77	0,71%	1,57%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,00	5.000.000,00	0,00	5.025.331,96	25.331,96	0,51%	1,37%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.386.374,55	0,00	1.398.863,39	0,00	12.488,84	0,90%	1,57%
BRDESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	119.451,16	0,00	0,00	121.750,02	2.298,86	1,92%	1,92%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	32.764,45	0,00	0,00	26.621,14	-6.143,31	-18,75%	-18,75%
Total Renda Fixa					10.754.588,48	2,03%	

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 (%)
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	2.925.466,11	5.501.221,10	0,00	9.037.457,34	610.770,13	13,54%	10,70%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	4.507.952,67	0,00	0,00	4.910.708,91	402.756,24	8,93%	8,93%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	11.008.960,73	0,00	0,00	11.300.448,88	291.488,15	2,65%	-
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	0,00	5.000.000,00	0,00	5.283.773,43	283.773,43	5,68%	9,34%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	5.816.502,78	0,00	6.098.375,28	0,00	281.872,50	4,85%	4,41%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	5.633.872,01	5.000.000,00	0,00	10.888.188,25	254.316,24	3,68%	3,34%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	4.804.991,48	0,00	0,00	5.025.265,55	220.274,07	4,58%	4,58%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	5.004.462,87	0,00	5.162.492,05	0,00	158.029,18	3,16%	1,54%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	5.413.410,71	2.000.000,00	0,00	7.515.155,48	101.744,77	1,53%	1,62%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	5.022.198,05	0,00	0,00	5.114.230,72	92.032,67	1,83%	1,83%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	0,00	3.000.000,00	0,00	3.074.986,96	74.986,96	2,50%	5,71%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	4.106.315,69	0,00	0,00	4.173.290,58	66.974,89	1,63%	1,63%
OCCAM FIC AÇÕES	0,00	1.500.000,00	0,00	1.550.097,72	50.097,72	3,34%	9,87%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	2.031.003,89	0,00	0,00	2.072.501,26	41.497,37	2,04%	2,04%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	4.548.840,46	0,00	0,00	4.589.707,88	40.867,42	0,90%	0,90%
LA SHOPPING CENTERS MULTISTRATÉGIA FIP	9.023.894,24	0,00	0,00	9.055.593,52	31.699,28	0,35%	-
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	0,00	2.466.044,36	0,00	2.484.702,66	18.658,30	0,87%	-
KINEA PIPE FI AÇÕES	819.839,16	0,00	466.044,36	368.777,39	14.982,59	1,83%	-55,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.158.642,31	1.000.000,00	0,00	2.159.720,15	1.077,84	0,05%	0,98%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	9.999.998,75	0,00	0,00	9.999.998,75	0,00	0,00%	-22,86%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	6.209.072,63	0,00	0,00	5.999.776,21	-209.296,42	-3,37%	-3,37%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	4.775.967,55	0,00	0,00	4.271.752,51	-504.215,04	-10,56%	0,00%
Total Renda Variável					2.324.388,29	2,50%	