

Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º Trimestre 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 (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 IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	41.078.211,23	26,82%	674	0,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	1.585.948,37	1,04%	315	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.053.454,58	1,99%	701	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.685.666,05	3,06%	164	0,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.936.825,89	3,22%	164	0,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.103.624,86	5,94%	599	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	17.019.543,69	11,11%	733	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.345.444,39	1,53%	650	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	2.006.941,23	1,31%	45	1,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.685.725,34	1,10%	370	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	207.563,28	0,14%	99	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	1.879.570,10	1,23%	181	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	18.596.366,34	12,14%	1.471	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	6.081.157,83	3,97%	1.267	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.198.651,95	4,70%	507	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	5.498.988,41	3,59%	107	0,57%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	6.215.349,81	4,06%	73	0,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	1.012.253,23	0,66%	27	0,84%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	1.964.741,76	1,28%	814	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	10.963.412,27	7,16%	294	1,78%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	2.014.752,57	1,32%	1.348	0,99%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	2.012.278,17	1,31%	3.737	0,38%	Artigo 8º, Inciso III

Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2018)

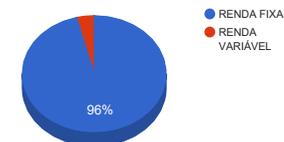
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	2.031.296,26	1,33%	955	0,46%	Artigo 8º, Inciso III
TOTAL -			153.177.767,61				

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

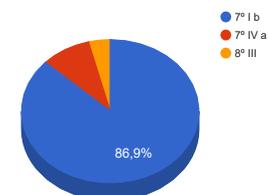
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	133.179.033,35	86,94%	15,00%	25,00%	100,00%	19.998.734,26
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	91.906.660,57
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	13.940.407,26	9,10%	5,00%	10,00%	40,00%	47.330.699,78
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	15,00%	15,00%	22.976.665,14
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	7.658.888,38
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	7.658.888,38
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	30.635.553,52
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	30.635.553,52
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	6.058.327,00	3,96%	0,00%	10,00%	10,00%	9.259.449,76
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	7.658.888,38
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	7.658.888,38
Total Carteira		153.177.767,61					

RENDA FIXA	147.119.440,61	96,04%
RENDA VARIÁVEL	6.058.327,00	3,96%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: setembro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	133.179.033,35	86,94%	15,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	13.940.407,26	9,10%	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 "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	6.058.327,00	3,96%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	153.177.767,61	100,00%	20,00	290,00

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	110.190.226,44	71,94%	0,03%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	41.975.287,94	27,40%	0,00%
Bradesco Asset Management	1.012.253,23	0,66%	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
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%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,87%	4,83%	2,07%	1,31%	6,32%	20,44%	0,20%	1,232%	2,89%
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%
IMA Geral	0,64%	4,33%	1,84%	0,83%	5,39%	21,00%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,58%	3,90%	1,69%	0,51%	4,88%	20,44%	0,20%	1,067%	2,55%
IMA Geral ex-C	0,61%	4,11%	1,77%	0,69%	5,18%	21,05%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,60%	4,17%	1,58%	0,63%	4,99%	20,00%	0,30%	1,092%	2,60%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,58%	3,92%	1,69%	0,55%	4,91%	20,46%	0,20%	1,040%	2,52%
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%	-	-	-

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

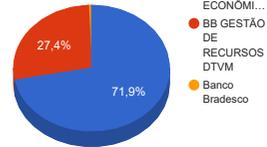
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,50%	3,72%	1,50%	0,30%	-	-	0,40%	0,980%	-
CDI	0,47%	4,81%	1,59%	3,17%	6,65%	18,95%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,49%	4,77%	1,57%	3,13%	6,69%	19,12%	0,20%	0,047%	0,07%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,40%	4,16%	1,37%	2,74%	5,79%	17,03%	0,80%	0,000%	0,03%
IMA-B 5+	-1,03%	0,83%	1,55%	-4,82%	-0,82%	16,33%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,03%	0,69%	1,48%	-4,85%	-1,01%	15,46%	0,20%	2,521%	6,89%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,04%	0,71%	1,47%	-4,85%	-1,00%	15,83%	0,20%	2,515%	6,87%
IDKA IPCA 5 Anos	-0,18%	3,32%	1,55%	-1,93%	3,73%	20,39%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,83%	4,21%	2,13%	-0,21%	5,19%	21,01%	0,20%	1,705%	4,32%
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%
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)

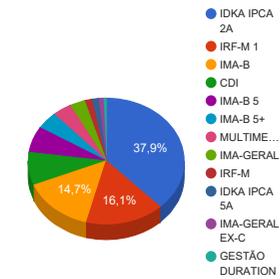
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	3,48%	3,85%	9,04%	-7,06%	6,80%	35,94%	-	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,67%	-	-	-	-	-	1,60%	1,252%	-
CDI	0,47%	4,81%	1,59%	3,17%	6,65%	18,95%	-	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1,24%	3,85%	3,34%	-0,31%	5,93%	21,87%	1,00%	2,934%	5,78%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,81%	4,57%	2,44%	1,20%	6,33%	19,78%	0,50%	1,230%	2,95%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	110.190.226,44	71,94%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	41.975.287,94	27,40%
Banco Bradesco	1.012.253,23	0,66%

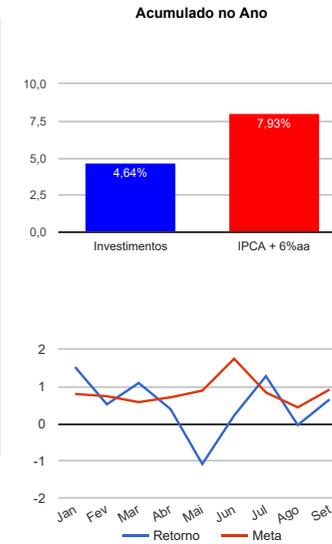


Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	58.097.754,92	37,93%
IRF-M 1	24.677.524,17	16,11%
IMA-B	22.517.626,62	14,70%
CDI	12.928.154,03	8,44%
IMA-B 5	10.238.168,33	6,68%
IMA-B 5+	6.816.395,99	4,45%
MULTIMERCADO	6.058.327,00	3,96%
IMA-GERAL	4.893.229,33	3,19%
IRF-M	2.345.444,39	1,53%
IDKA IPCA 5A	2.006.941,23	1,31%
IMA-GERAL EX-C	1.585.948,37	1,04%
GESTÃO DURATION	1.012.253,23	0,66%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	134.674.306,49	1.650.000,00	1.591.908,75	136.788.194,08	2.055.796,34	1,53%	0,80%	190,38%	0,74%
Fevereiro	136.788.194,08	3.825.353,65	1.884.524,83	139.451.659,61	722.636,71	0,52%	0,74%	70,54%	1,37%
Março	139.451.659,61	2.198.840,34	1.472.849,40	141.714.894,67	1.537.244,12	1,10%	0,58%	190,00%	0,82%
Abril	141.714.894,67	2.321.615,85	766.052,42	143.834.972,44	564.514,34	0,39%	0,71%	55,67%	0,52%
Maio	143.834.972,44	0,00	0,00	142.272.640,00	-1.562.332,44	-1,09%	0,89%	-122,22%	1,18%
Junho	142.272.640,00	4.022.815,85	1.751.187,22	144.861.972,77	317.704,14	0,22%	1,75%	12,54%	2,29%
Julho	144.861.972,77	6.336.735,68	6.620.603,84	146.432.690,13	1.854.585,52	1,28%	0,84%	152,11%	0,89%
Agosto	146.432.690,13	19.724.174,93	17.144.046,97	148.957.506,87	-55.311,22	-0,04%	0,44%	-8,38%	1,90%
Setembro	148.957.506,87	5.767.248,59	2.541.996,29	153.177.767,61	995.008,44	0,65%	0,92%	70,88%	1,00%
Acumulado no ano					6.429.845,95	4,64%	7,93%	58,43%	



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.315.782,86	0,00	0,00	2.345.444,39	29.661,53	1,28%	1,51%	1,28%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	1.000.000,00	0,00	1.012.253,23	12.253,23	1,23%	0,98%	0,50%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.432.745,39	0,00	0,00	5.498.988,41	66.243,02	1,22%	0,84%	1,22%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.822.509,46	0,00	0,00	17.019.543,69	197.034,23	1,17%	0,88%	1,17%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	40.610.254,35	0,00	0,00	41.078.211,23	467.956,88	1,15%	0,88%	1,15%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.671.262,70	0,00	0,00	1.685.725,34	14.462,64	0,87%	1,23%	0,87%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.027.515,40	0,00	0,00	3.053.454,58	25.939,18	0,86%	1,24%	0,86%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.990.393,74	0,00	0,00	2.006.941,23	16.547,49	0,83%	1,70%	0,83%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.576.484,05	0,00	0,00	1.585.948,37	9.464,32	0,60%	1,09%	0,60%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	18.487.526,26	0,00	0,00	18.596.366,34	108.840,08	0,59%	0,15%	0,59%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	206.365,35	0,00	0,00	207.563,28	1.197,93	0,58%	1,04%	0,58%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.658.662,19	0,00	0,00	4.685.666,05	27.003,86	0,58%	1,07%	0,58%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.047.940,07	2.000.000,00	0,00	6.081.157,83	33.217,76	0,55%	0,16%	0,59%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.955.131,03	0,00	0,00	1.964.741,76	9.610,73	0,49%	0,05%	0,49%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	10.701.433,53	2.767.248,59	2.541.996,29	10.963.412,27	36.726,44	0,27%	0,00%	0,40%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.210.303,84	0,00	0,00	7.198.651,95	-11.651,89	-0,16%	1,87%	-0,16%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.120.095,91	0,00	0,00	9.103.624,86	-16.471,05	-0,18%	1,89%	-0,18%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.231.689,84	0,00	0,00	6.215.349,81	-16.340,03	-0,26%	2,17%	-0,26%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.899.044,81	0,00	0,00	1.879.570,10	-19.474,71	-1,03%	2,52%	-1,03%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.988.468,32	0,00	0,00	4.936.825,89	-51.642,43	-1,04%	2,51%	-1,04%
				Total Renda Fixa	940.579,21	0,64%	0,96%	

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(%)
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1.987.614,83	0,00	0,00	2.012.278,17	24.663,34	1,24%	2,93%	1,24%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.998.574,30	0,00	0,00	2.014.752,57	16.178,27	0,81%	1,23%	0,81%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	2.017.708,64	0,00	0,00	2.031.296,26	13.587,62	0,67%	1,25%	0,67%
Total Renda Variável					54.429,23	0,91%	1,80%	

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 IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	33.523.226,61	6.706.225,87	0,00	41.078.211,23	848.758,75	2,27%	2,36%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.737.047,32	1.920.123,00	0,00	17.019.543,69	362.373,37	2,32%	2,34%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.844.894,36	5.495.266,16	0,00	18.596.366,34	256.205,82	1,60%	1,69%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	18.363.658,78	3.660.393,40	11.231.292,57	10.963.412,27	170.652,66	1,14%	1,37%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.956.466,40	0,00	0,00	9.103.624,86	147.158,46	1,64%	1,64%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.516.396,64	0,00	153.314,27	5.498.988,41	135.906,04	2,50%	-0,32%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.081.358,98	0,00	0,00	7.198.651,95	117.292,97	1,66%	1,66%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.301.559,42	0,00	171.422,35	6.215.349,81	85.212,74	1,35%	-1,37%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.607.891,94	0,00	0,00	4.685.666,05	77.774,11	1,69%	1,69%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.388.471,80	0,00	8.460.283,70	0,00	71.811,90	0,86%	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.865.477,18	0,00	0,00	4.936.825,89	71.348,71	1,47%	1,47%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.991.980,86	0,00	0,00	3.053.454,58	61.473,92	2,05%	2,05%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	554.435,97	5.470.124,63	0,00	6.081.157,83	56.597,23	1,41%	1,67%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.019.650,89	0,00	55.696,26	2.006.941,23	42.986,60	2,15%	2,13%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.303.959,67	0,00	0,00	2.345.444,39	41.484,72	1,80%	1,80%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.651.487,27	0,00	0,00	1.685.725,34	34.238,07	2,07%	2,07%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	885.534,28	1.050.000,00	0,00	1.964.741,76	29.207,48	1,51%	1,57%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.230.572,16	0,00	3.258.200,86	0,00	27.628,70	0,86%	1,57%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.852.174,46	0,00	0,00	1.879.570,10	27.395,64	1,48%	1,48%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.561.281,26	0,00	0,00	1.585.948,37	24.667,11	1,58%	1,58%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.351.201,00	0,00	1.375.712,00	0,00	24.511,00	1,81%	-
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	1.000.000,00	0,00	1.012.253,23	12.253,23	1,23%	1,50%

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 (%)
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	521.898,12	0,00	526.350,51	0,00	4.452,39	0,85%	1,57%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	204.109,32	0,00	0,00	207.563,28	3.453,96	1,69%	1,69%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	547.238,28	526.026,14	1.074.374,58	0,00	1.110,16	0,11%	0,30%
				Total Renda Fixa	2.735.955,74	1,89%	

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 CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,00	2.000.000,00	0,00	2.031.296,26	31.296,26	1,56%	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,00	2.000.000,00	0,00	2.014.752,57	14.752,57	0,74%	2,44%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,00	2.000.000,00	0,00	2.012.278,17	12.278,17	0,61%	3,34%
Total Renda Variável					58.327,00	0,97%	