

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
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	337.275,26	0,03%	650	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	354.899,95	0,04%	119	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	12.633.590,00	1,27%	45	5,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	168.649.181,58	17,02%	674	2,60%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	138.922.637,72	14,02%	733	2,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	12.606.500,00	1,27%	17	7,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	48.957.283,64	4,94%	1.267	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2030	10.654.944,00	1,08%	34	5,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	79.033.379,17	7,98%	1.471	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.102.936,65	0,11%	165	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	1.426.023,71	0,14%	51	0,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	60.425.283,24	6,10%	315	1,79%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.174.808,30	0,12%	294	0,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	10.597.415,17	1,07%	670	0,81%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	85.988.217,55	8,68%	310	3,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	76.292.485,20	7,70%	814	1,34%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	41.872.013,37	4,23%	442	1,38%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	120.728.137,27	12,18%	822	1,45%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CASAN SANEAMENTO FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	4.058.776,85	0,41%	27	2,08%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	18.348.277,78	1,85%	114	6,85%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	D+4	Não há	17.321.929,54	1,75%	88	9,66%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	24.777.700,19	2,50%	217	5,20%	Artigo 8º, Inciso III

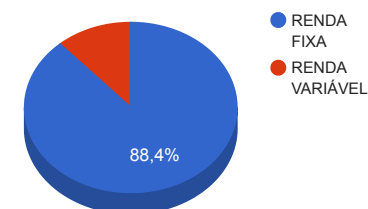
Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	35.725.437,14	3,61%	2.438	5,91%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	13.603.652,83	1,37%	3.737	2,60%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	5.317.274,28	0,54%	19	5,67%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
		TOTAL -	990.910.060,39				

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

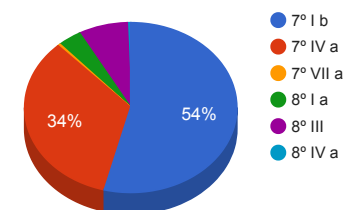
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	535.103.934,92	54,00%	15,00%	25,00%	70,00%	158.533.107,35
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	594.546.036,23
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	336.653.076,86	33,97%	5,00%	10,00%	30,00%	-39.380.058,74
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	7,00%	15,00%	15,00%	148.636.509,06
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	4.058.776,85	0,41%	2,00%	5,00%	5,00%	45.486.726,17
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	49.545.503,02
Total Renda Fixa	100,00%	875.815.788,63	88,38%	36,00	70,00	190,00	-

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%	35.670.207,32	3,60%	2,00%	5,00%	10,00%	63.420.798,72
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	10,00%	99.091.006,04
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	74.106.790,16	7,48%	7,00%	10,00%	10,00%	24.984.215,88
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	5.317.274,28	0,54%	2,00%	5,00%	5,00%	44.228.228,74
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	49.545.503,02
Total Renda Variável	30,00%	115.094.271,76	11,62%	15,00	30,00	40,00	-

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 "	535.103.934,92	54,00%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	336.653.076,86	33,97%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	4.058.776,85	0,41%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	875.815.788,63	88,38%	36,00	190,00

Artigos - Renda Variável	Base: setembro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	35.670.207,32	3,60%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	74.106.790,16	7,48%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5.317.274,28	0,54%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	115.094.271,76	11,62%	15,00	40,00

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	609.367.841,88	61,50%	0,14%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	381.542.218,51	38,50%	0,03%

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%
IPCA + 9,00% ao ano	1,13%	10,21%	2,95%	7,18%	13,82%	27,12%	-	-	-
CASAN SANEAMENTO FIDC SÊNIOR	-2,08%	-13,17%	-5,31%	-9,76%	-16,38%	-19,50%	0,45%	0,074%	5,17%
IPCA + 6,00% ao ano	0,92%	7,93%	2,22%	5,68%	10,72%	20,29%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,22%	6,17%	2,13%	3,47%	7,87%	21,37%	0,15%	0,841%	1,38%
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,35%	3,88%	2,05%	-0,91%	4,36%	20,33%	0,15%	2,053%	4,75%
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%
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)

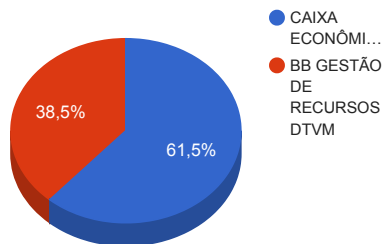
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,66%	4,24%	1,75%	1,35%	5,79%	-	0,002	0,548%	1,69%
CDI	0,47%	4,81%	1,59%	3,17%	6,65%	18,95%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,49%	4,77%	1,57%	3,13%	6,69%	19,12%	0,20%	0,047%	0,07%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,47%	4,61%	1,54%	3,02%	6,44%	18,66%	0,20%	0,033%	0,08%
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%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,40%	4,16%	1,37%	2,74%	5,79%	17,03%	0,80%	0,000%	0,03%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,39%	3,97%	1,31%	2,61%	5,52%	16,64%	1,00%	0,003%	0,03%
IMA-B	-0,15%	2,88%	1,71%	-1,96%	2,55%	18,72%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,22%	0,59%	-0,31%	-0,11%	2,20%	10,47%	0,20%	0,844%	4,36%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,09%	5,73%	2,06%	2,72%	7,28%	21,14%	0,20%	1,048%	1,92%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,27%	-2,02%	-1,46%	-5,01%	-2,39%	7,18%	0,20%	2,174%	6,45%

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

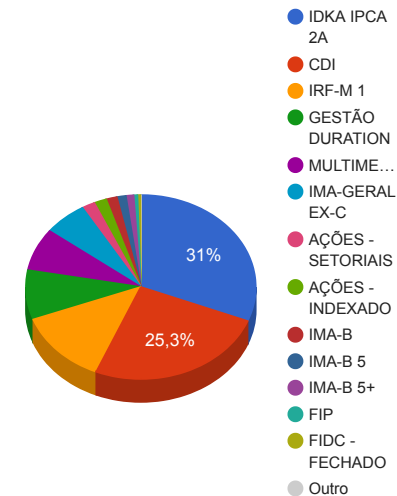
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IBX-50	3,73%	4,40%	9,50%	-7,00%	7,30%	36,21%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	3,19%	3,17%	8,82%	-8,16%	6,23%	34,13%	0,70%	9,911%	20,51%
IGC	3,19%	-0,58%	8,51%	-6,87%	0,93%	30,38%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	3,25%	0,13%	8,09%	-6,12%	1,40%	30,07%	1,00%	9,653%	18,78%
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%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,54%	3,99%	1,53%	2,71%	5,75%	18,06%	0,70%	0,197%	0,34%
Não Possui	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	0,000%	0,40%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	609.367.841,88	61,50%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	381.542.218,51	38,50%



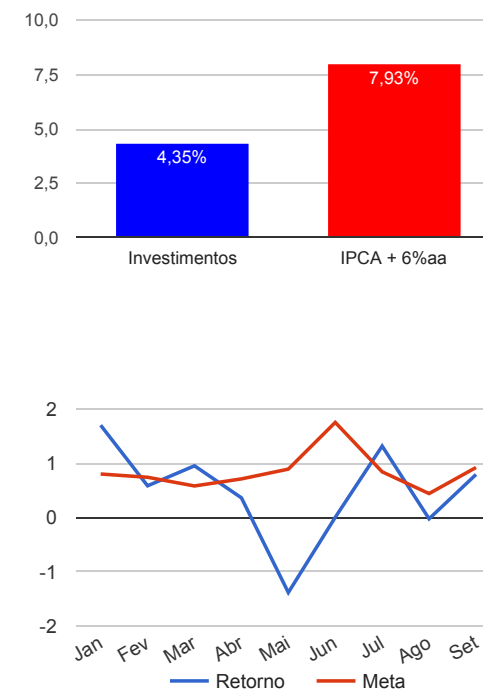
Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	307.571.819,30	31,04%
CDI	250.664.859,31	25,30%
IRF-M 1	127.990.662,81	12,92%
GESTÃO DURATION	85.988.217,55	8,68%
MULTIMERCADO	74.106.790,16	7,48%
IMA-GERAL EX-C	60.425.283,24	6,10%
AÇÕES - SETORIAIS	18.348.277,78	1,85%
AÇÕES - INDEXADO	17.321.929,54	1,75%
IMA-B	15.135.460,36	1,53%
IMA-B 5	12.633.590,00	1,27%
IMA-B 5+	10.654.944,00	1,08%
FIP	5.317.274,28	0,54%
FIDC - FECHADO	4.058.776,85	0,41%
IDKA IPCA 3A	354.899,95	0,04%
IRF-M	337.275,26	0,03%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	933.648.480,12	14.230.629,36	13.710.840,62	950.031.832,33	15.863.563,47	1,70%	0,80%	211,88%	0,94%
Fevereiro	950.031.832,33	31.465.524,43	35.002.606,62	952.031.956,71	5.537.206,57	0,58%	0,74%	78,93%	1,21%
Março	952.031.956,71	28.016.920,03	19.882.549,32	969.295.718,62	9.129.391,20	0,95%	0,58%	164,73%	0,91%
Abril	969.295.718,62	18.214.808,81	19.599.741,91	971.415.739,89	3.504.954,37	0,36%	0,71%	51,09%	0,79%
Mai	971.415.739,89	72.431.493,70	66.577.399,97	963.770.150,06	-13.499.683,56	-1,38%	0,89%	-155,44%	1,47%
Junho	963.770.150,06	182.999.827,61	184.932.891,74	961.865.457,27	28.371,34	0,00%	1,75%	0,17%	1,98%
Julho	961.865.457,27	28.012.793,62	21.323.444,87	981.282.016,98	12.727.210,96	1,31%	0,84%	156,12%	0,83%
Agosto	981.282.016,98	146.080.746,99	144.796.523,47	982.327.608,34	-238.632,16	-0,02%	0,44%	-5,49%	1,52%
Setembro	982.327.608,34	361.814.126,15	361.008.848,58	990.910.060,39	7.777.174,48	0,79%	0,92%	85,76%	0,90%
Acumulado no ano					40.829.556,67	4,35%	7,93%	54,76%	

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 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.481.580,00	0,00	0,00	12.633.590,00	152.010,00	1,22%	0,84%	1,22%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	350.634,00	0,00	0,00	354.899,95	4.265,95	1,22%	0,84%	1,22%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.091.033,30	0,00	0,00	1.102.936,65	11.903,35	1,09%	1,05%	1,09%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.762.586,47	0,00	15.585.703,51	337.275,26	160.392,30	1,02%	1,51%	1,28%
CASAN SANEAMENTO FIDC SÊNIOR	4.144.798,12	0,00	123.247,84	4.058.776,85	37.226,57	0,90%	0,07%	0,91%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	23.200.003,13	0,00	23.402.868,54	0,00	202.865,41	0,87%	1,23%	0,87%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	77.425.665,86	60.500.000,00	0,00	138.922.637,72	996.971,86	0,72%	0,88%	1,17%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	88.789.654,91	78.700.000,00	0,00	168.649.181,58	1.159.526,67	0,69%	0,88%	1,15%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	85.427.558,34	0,00	0,00	85.988.217,55	560.659,21	0,66%	0,55%	0,66%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	21.804.719,59	0,00	21.941.442,95	0,00	136.723,36	0,63%	1,50%	1,18%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	60.064.688,87	0,00	0,00	60.425.283,24	360.594,37	0,60%	1,09%	0,60%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	48.670.051,14	0,00	0,00	48.957.283,64	287.232,50	0,59%	0,16%	0,59%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	76.978.989,65	1.595.000,00	0,00	79.033.379,17	459.389,52	0,58%	0,15%	0,59%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.596.224,00	0,00	0,00	10.654.944,00	58.720,00	0,55%	0,16%	0,55%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	75.919.292,94	0,00	0,00	76.292.485,20	373.192,26	0,49%	0,05%	0,49%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	41.677.615,09	0,00	0,00	41.872.013,37	194.398,28	0,47%	0,03%	0,47%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	56.535.696,08	0,00	56.793.003,51	0,00	257.307,43	0,46%	1,24%	0,86%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	120.754.921,05	1.840.000,00	2.407.000,00	120.728.137,27	540.216,22	0,44%	0,02%	0,44%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	30.863.293,78	0,00	30.996.448,35	0,00	133.154,57	0,43%	1,04%	0,58%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.420.988,66	0,00	0,00	1.426.023,71	5.035,05	0,35%	2,05%	0,35%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	37.901.761,72	0,00	38.011.363,83	0,00	109.602,11	0,29%	1,07%	0,58%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.998.739,41	51.612.536,60	49.051.526,39	10.597.415,17	37.665,55	0,06%	0,00%	0,39%

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 DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	2.543.320,38	121.296.589,55	122.696.243,66	1.174.808,30	31.142,03	0,03%	0,00%	0,40%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.640.990,00	0,00	0,00	12.606.500,00	-34.490,00	-0,27%	2,17%	-0,27%
				Total Renda Fixa	6.235.704,57	0,68%	0,52%	

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(%)
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	17.169.355,72	600.000,00	0,00	18.348.277,78	578.922,06	3,26%	9,65%	3,25%
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	16.786.028,23	0,00	0,00	17.321.929,54	535.901,31	3,19%	9,91%	3,19%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	13.436.920,60	0,00	0,00	13.603.652,83	166.732,23	1,24%	2,93%	1,24%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	14.566.705,20	10.000.000,00	0,00	24.777.700,19	210.994,99	0,86%	1,60%	1,16%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,00	35.670.000,00	0,00	35.725.437,14	55.437,14	0,16%	0,20%	0,54%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	5.323.792,10	0,00	0,00	5.317.274,28	-6.517,82	-0,12%	0,00%	-0,12%
Total Renda Variável					1.541.469,91	1,36%	3,78%	

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 IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	78.362.832,39	88.200.000,00	0,00	168.649.181,58	2.086.349,19	1,86%	2,36%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	71.615.746,19	65.500.000,00	0,00	138.922.637,72	1.806.891,53	1,87%	2,34%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	108.705.260,95	15.050.000,00	4.820.500,00	120.728.137,27	1.793.376,32	1,51%	1,53%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	72.636.354,89	12.000.000,00	0,00	85.988.217,55	1.351.862,66	1,72%	1,75%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	75.110.236,93	0,00	0,00	76.292.485,20	1.182.248,27	1,57%	1,57%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	61.274.914,48	16.595.000,00	0,00	79.033.379,17	1.163.464,69	1,65%	1,69%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	63.668.248,27	0,00	22.611.395,86	41.872.013,37	815.160,96	1,46%	1,54%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	49.132.525,61	10.512.057,55	0,00	60.425.283,24	780.700,08	1,55%	1,58%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	42.199.515,16	6.000.000,00	0,00	48.957.283,64	757.768,48	1,66%	1,67%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	43.092.825,23	13.000.000,00	56.793.003,51	0,00	700.178,28	1,59%	2,05%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	23.525.375,74	0,00	24.210.297,23	0,00	684.921,49	2,91%	1,66%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	25.165.814,15	0,00	25.769.405,95	0,00	603.591,80	2,40%	1,64%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	37.488.707,21	0,00	38.011.363,83	0,00	522.656,62	1,39%	1,69%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	30.525.888,40	0,00	30.996.448,35	0,00	470.559,95	1,54%	1,69%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	18.015.870,68	5.000.000,00	23.402.868,54	0,00	386.997,86	2,00%	2,07%
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.673.240,00	0,00	351.308,86	12.633.590,00	311.658,86	2,49%	-0,31%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	12.636.114,79	0,00	12.937.659,10	0,00	301.544,31	2,39%	1,71%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.693.184,00	0,00	319.606,99	10.654.944,00	281.366,99	2,65%	-0,36%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	21.698.574,10	0,00	21.941.442,95	0,00	242.868,85	1,12%	1,68%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.682.110,84	0,00	15.585.703,51	337.275,26	240.867,93	1,54%	1,80%
CASAN SANEAMENTO FIDC SÊNIOR	4.273.082,29	0,00	418.532,26	4.058.776,85	204.226,82	4,89%	-5,31%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.793.330,00	0,00	358.236,60	12.606.500,00	171.406,60	1,33%	-1,46%

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 FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.189.670,27	63.191.115,65	59.898.567,46	10.597.415,17	115.196,71	0,58%	1,31%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	4.762.581,47	182.002.723,61	185.648.544,60	1.174.808,30	58.047,82	0,13%	1,37%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.894.745,25	0,00	824.623,25	1.102.936,65	32.814,65	2,21%	2,06%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.397.309,02	0,00	0,00	1.426.023,71	28.714,69	2,05%	2,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.041.430,26	0,00	701.288,65	354.899,95	14.758,34	2,24%	2,13%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	523.552,91	0,00	528.019,42	0,00	4.466,51	0,85%	1,57%
Total Renda Fixa					17.114.667,26	1,88%	

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 IBX 50 FI AÇÕES	14.493.005,64	2.020.000,00	500.000,00	17.321.929,54	1.308.923,90	8,74%	8,82%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	15.239.812,29	2.350.000,00	500.000,00	18.348.277,78	1.258.465,49	8,13%	8,09%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	7.324.298,10	6.000.000,00	0,00	13.603.652,83	279.354,73	3,33%	3,34%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	11.753.789,59	12.750.000,00	0,00	24.777.700,19	273.910,60	1,52%	1,83%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,00	35.670.000,00	0,00	35.725.437,14	55.437,14	0,16%	1,53%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	5.275.510,17	66.769,95	0,00	5.317.274,28	-25.005,84	-0,47%	-
Total Renda Variável					3.151.086,02	4,79%	