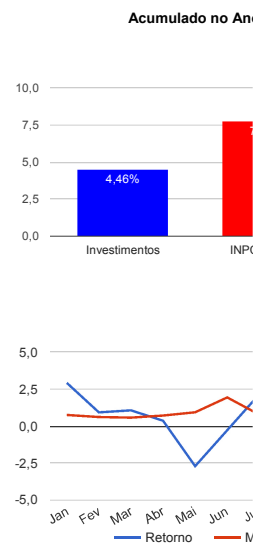




Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	738.769.539,32	7.841.548,52	12.438.769,34	755.609.230,89	21.436.912,39	2,90%	0,74%	391,51%	2,79%
Fevereiro	755.609.230,89	68.530.624,04	47.930.793,67	783.301.999,29	7.092.938,03	0,91%	0,60%	152,85%	3,27%
Março	783.301.999,29	17.615.635,72	27.136.892,96	782.009.473,47	8.228.731,42	1,05%	0,56%	188,57%	2,39%
Abril	782.009.473,47	35.685.788,33	35.104.413,82	785.341.714,56	2.750.866,58	0,35%	0,70%	50,38%	2,26%
Mai	785.341.714,56	24.092.270,64	21.417.291,85	766.666.054,97	-21.350.638,38	-2,71%	0,92%	-294,87%	3,49%
Junho	766.666.054,97	19.348.696,51	17.514.008,40	766.288.836,47	-2.211.906,61	-0,29%	1,92%	-14,96%	4,79%
Julho	766.288.836,47	55.852.236,09	54.193.720,35	784.339.664,43	16.392.312,22	2,13%	0,76%	280,40%	2,82%
Agosto	784.339.664,43	11.960.572,97	10.203.008,94	784.149.475,51	-1.947.752,95	-0,25%	0,53%	-46,47%	4,28%
Setembro	784.149.475,51	11.070.023,40	9.899.605,73	788.201.397,71	2.881.504,53	0,37%	0,74%	49,48%	3,33%
Acumulado no ano					33.272.967,23	4,46%	7,72%	57,76%	





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 -
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	24.792.776,78	0,00	0,00	25.110.470,75	317.693,97	1,28%	1
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	19.772.394,70	0,00	0,00	20.025.647,95	253.253,25	1,28%	1
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	62.179.563,89	0,00	0,00	62.914.997,55	735.433,66	1,18%	1
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	23.366.226,10	457.178,66	0,00	24.030.539,03	207.134,27	0,87%	1
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	71.112.322,70	847.844,74	0,00	72.579.901,56	619.734,12	0,86%	1
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	27.879.309,68	0,00	0,00	28.118.843,04	239.533,36	0,86%	1
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	53.694.596,80	0,00	0,00	54.154.641,84	460.045,04	0,86%	1
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	7.041.254,20	0,00	0,00	7.101.435,43	60.181,23	0,85%	1
CARTÃO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	7.233.598,99	0,00	0,00	7.273.571,19	39.972,20	0,55%	0
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.687.514,70	0,00	0,00	7.723.273,75	35.759,05	0,47%	0
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	27.195.720,54	0,00	0,00	27.309.081,33	113.360,79	0,42%	0
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	16.387.512,98	0,00	0,00	16.449.781,90	62.268,92	0,38%	0
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	189.107,51	250.000,00	214.000,00	226.623,12	1.515,61	0,35%	0
SANTANDER MASTER FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	590.151,41	9.515.000,00	9.501.980,68	612.303,84	9.133,11	0,09%	0
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	12.386.842,94	0,00	0,00	12.380.385,79	-6.457,15	-0,05%	2
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	52.087.270,60	0,00	0,00	52.000.107,66	-87.162,94	-0,17%	1
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	47.311.870,19	0,00	0,00	47.206.025,28	-105.844,91	-0,22%	1
TÍTULOS PÚBLICOS	163.406.151,82	0,00	0,00	162.688.969,53	-717.182,29	-0,44%	
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	33.116,19	0,00	0,00	32.365,45	-750,74	-2,27%	2
TRENBANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	37.919,63	0,00	0,00	35.782,35	-2.137,28	-5,64%	
				Total Renda Fixa	2.235.483,27	0,36%	1



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 -
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	1.144.557,59	0,00	128.244,63	1.401.098,52	384.785,56	33,62%	56
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	2.576.244,20	0,00	0,00	2.655.952,60	79.708,40	3,09%	10
ARX INCOME FI AÇÕES	21.641.718,29	0,00	0,00	22.058.789,51	417.071,22	1,93%	10
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	35.190.110,54	0,00	0,00	35.819.697,55	629.587,01	1,79%	9
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	8.914.610,39	0,00	0,00	9.000.923,38	86.312,99	0,97%	8
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	3.772.751,99	0,00	0,00	3.790.399,20	17.647,21	0,47%	2
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	25.825.700,27	0,00	0,00	25.831.484,47	5.784,20	0,02%	6
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	14.012.947,18	0,00	0,00	14.005.985,59	-6.961,59	-0,05%	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP	402.109,28	0,00	0,00	401.574,15	-535,13	-0,13%	0
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	9.245.540,78	0,00	55.380,42	9.172.146,34	-18.014,02	-0,19%	9
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	19.034.887,07	0,00	0,00	18.922.752,91	-112.134,16	-0,59%	8
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	6.124.497,37	0,00	0,00	6.045.973,65	-78.523,72	-1,28%	8
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	6.260.646,27	0,00	0,00	6.165.900,67	-94.745,60	-1,51%	7
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	5.488.000,00	0,00	0,00	4.840.000,00	-648.000,00	-11,81%	30
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I MULTISTRATÉG...	129.931,94	0,00	0,00	113.970,83	-15.961,11	-12,28%	
Total Renda Variável					646.021,26	0,40%	9