

Relatório Analítico dos Investimentos em outubro de 2018



Carteira consolidada de investimentos - base (outubro / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			7.943,81	0,00%			Artigo 20
TÍTULOS PÚBLICOS			231.479.828,25	20,55%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	106.086.773,81	9,42%	701	1,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	87.181.604,31	7,74%	327	3,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	4.968.784,02	0,44%	21	1,69%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	36.291.662,79	3,22%	657	0,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	13.388.602,80	1,19%	22	4,85%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	36.426.620,94	3,23%	16	2,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	7.318.490,13	0,65%	73	0,60%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	46.214.113,61	4,10%	376	1,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	116.105.359,60	10,31%	304	8,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+0	Não há	22.818.135,90	2,03%	264	1,24%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	50.711.783,41	4,50%	78	4,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA	D+1	Não há	5.572.840,66	0,49%	15	2,47%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER MASTER FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	622.839,09	0,06%	69.140	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	36.230.567,29	3,22%	59	2,43%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	213.910,88	0,02%	1.379	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	43.974.988,78	3,90%	81	8,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	16.593.623,79	1,47%	393	8,52%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	7.764.702,54	0,69%	445	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	55.686.854,08	4,94%	189	5,99%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	28.425,14	0,00%		4,29%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "

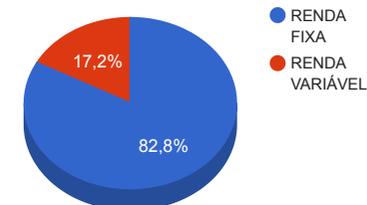
Carteira consolidada de investimentos - base (outubro / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CARTÃO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	D+45 a D+75	Não há	7.320.198,48	0,65%	238	1,45%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
TRENBANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	Não se aplica	Não se aplica	33.304,61	0,00%			Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	40.105.954,26	3,56%	55	5,12%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	21.053.437,10	1,87%	1.993	5,35%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	29.318.560,98	2,60%	4.999	4,41%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	7.303.782,99	0,65%	2.819	1,14%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	6.941.195,17	0,62%	115	1,65%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	10.124.979,92	0,90%	269	4,64%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ARX INCOME FI AÇÕES	D+4	Não há	25.241.062,49	2,24%	2.020	9,45%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	4.582.820,74	0,41%	4.581	1,66%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	11.050.368,53	0,98%	146	0,91%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	7.022.033,52	0,62%	10.820	0,64%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	1.397.953,67	0,12%	39	0,40%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	13.996.444,69	1,24%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	229.582,48	0,02%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP	Não se aplica	Não se aplica	400.852,22	0,04%	19	0,22%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	S/Info	Não se aplica	9.463.565,44	0,84%		5,83%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	Não se aplica	Não se aplica	5.020.100,00	0,45%		4,16%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
		TOTAL -	1.126.294.652,92				

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

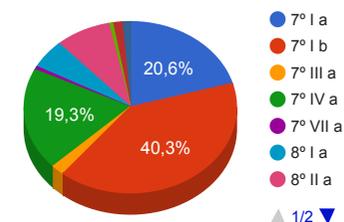
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	231.479.828,25	20,55%	17,00%	40,00%	40,00%	219.038.032,92
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	453.982.012,01	40,31%	35,00%	50,00%	50,00%	109.165.314,45
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	22.818.135,90	2,03%	21,00%	35,00%	35,00%	371.384.992,62
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	217.372.110,52	19,30%	4,00%	10,00%	20,00%	7.886.820,06
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	7.381.928,23	0,66%	0,70%	1,00%	2,00%	15.143.964,83
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00	0,00%	1,00%	2,00%	3,00%	33.788.839,59
Em Enquadramento - RF	0,00%	0,00	0,00%	1,00%	2,00%	3,00%	33.788.839,59
Total Renda Fixa	100,00%	933.034.014,91	82,84%	79,70	140,00	154,00	-

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%	61.159.391,36	5,43%	5,00%	6,00%	7,00%	17.681.234,34
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	94.562.770,82	8,40%	6,00%	6,00%	7,00%	-15.722.145,12
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	20,00%	0,00	0,00%	0,70%	1,00%	2,00%	22.525.893,06
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	7.022.033,52	0,62%	1,00%	3,00%	5,00%	49.292.699,13
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	16.024.833,06	1,42%	1,00%	2,00%	4,00%	29.026.953,06
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	14.483.665,44	1,29%	1,00%	2,00%	3,00%	19.305.174,15
Desenquadrado - RV	0,00%	0,00	0,00%	1,00%	2,00%	3,00%	33.788.839,59
Em Enquadramento - RV	0,00%	0,00	0,00%	1,00%	2,00%	3,00%	33.788.839,59
Total Renda Variável	30,00%	193.252.694,20	17,16%	16,70	24,00	34,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: outubro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	231.479.828,25	20,55%	17,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	453.982.012,01	40,31%	35,00%	50,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	22.818.135,90	2,03%	21,00%	35,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	217.372.110,52	19,30%	4,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	7.381.928,23	0,66%	0,70%	2,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	1,00%
Desenquadrado - RF	0,00	0,00%	1,00%	3,00%
Em Enquadramento - RF	0,00	0,00%	1,00%	3,00%
Total Renda Fixa	933.034.014,91	82,84%	79,70	154,00

Artigos - Renda Variável	Base: outubro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	61.159.391,36	5,43%	5,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	94.562.770,82	8,40%	6,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,70%	5,00%
Artigo 8º, Inciso III	7.022.033,52	0,62%	1,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	16.024.833,06	1,42%	1,00%	4,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	14.483.665,44	1,29%	1,00%	3,00%
Desenquadrado - RV	0,00	0,00%	1,00%	3,00%
Em Enquadramento - RV	0,00	0,00%	1,00%	3,00%
Total Renda Variável	193.252.694,20	17,16%	16,70	68,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (outubro / 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	216.086.514,02	19,19%	0,05%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	153.368.730,51	13,62%	0,03%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	138.192.630,48	12,27%	0,01%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	102.451.474,73	9,10%	0,01%
ITAÚ UNIBANCO	64.724.405,87	5,75%	0,01%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	53.215.967,76	4,72%	0,21%
ITAÚ DTVM	40.105.954,26	3,56%	0,00%
WESTERN ASSET	33.044.254,64	2,93%	0,07%
ARX INVESTIMENTOS	25.241.062,49	2,24%	0,32%
KINEA INVESTIMENTOS	14.226.027,17	1,26%	0,00%
SAFRA ASSET MANAGEMENT	13.388.602,80	1,19%	0,01%
RB CAPITAL ASSET MANAGEMENT	9.463.565,44	0,84%	1,02%
OLIVEIRA TRUST	7.320.198,48	0,65%	0,10%
VINCI PARTNERS	6.941.195,17	0,62%	0,03%
Icatu Vanguarda	5.572.840,66	0,49%	0,02%

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
REAG GESTORA DE RECURSOS	5.020.100,00	0,45%	0,82%%
XP GESTÃO DE RECURSOS	4.582.820,74	0,41%	0,00%%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	1.397.953,67	0,12%	0,00%%
BRZ INVESTIMENTOS	400.852,22	0,04%	0,02%%
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUTURADOS LTDA	33.304,61	0,00%	0,00%%
BRASIL PLURAL	28.425,14	0,00%	0,00%%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	7,14%	10,23%	6,50%	5,19%	10,29%	26,38%	-	-	-
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	8,14%	10,35%	7,17%	5,32%	10,43%	25,77%	0,45%	4,908%	6,18%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	7,43%	9,93%	6,50%	4,93%	9,96%	26,29%	0,20%	4,175%	5,76%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7,09%	10,04%	6,43%	5,11%	10,12%	26,16%	0,30%	3,956%	5,46%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	7,05%	10,12%	6,43%	5,15%	10,20%	25,73%	0,20%	3,924%	5,38%
IRF-M	3,59%	7,99%	3,96%	3,58%	9,43%	27,10%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,86%	8,02%	3,95%	3,61%	9,40%	26,60%	0,20%	2,183%	3,50%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3,62%	7,78%	3,93%	3,46%	9,17%	27,48%	0,10%	2,143%	3,45%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,58%	7,83%	3,91%	3,50%	9,22%	26,51%	0,20%	2,131%	3,38%
IMA-B 5	3,10%	8,23%	3,75%	4,10%	9,30%	24,04%	-	-	-
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	4,11%	8,91%	4,41%	3,57%	9,92%	26,00%	0,40%	2,149%	4,64%
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	3,17%	7,99%	3,70%	3,85%	9,01%	23,77%	0,20%	1,654%	3,19%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA	3,15%	8,21%	3,78%	4,06%	9,29%	24,01%	0,25%	1,640%	3,10%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	3,10%	8,05%	3,71%	4,01%	9,12%	23,59%	0,10%	1,599%	3,05%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,10%	8,03%	3,70%	3,98%	9,07%	23,54%	0,20%	1,607%	3,05%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3,07%	8,05%	3,70%	4,01%	9,09%	23,59%	0,20%	1,588%	3,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	3,06%	7,86%	3,64%	3,88%	8,85%	23,05%	0,40%	1,587%	3,04%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI + 3,50% ao ano	0,85%	8,44%	2,48%	5,02%	10,25%	26,73%	-	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-12,17%	-69,05%	-19,70%	-25,99%	-17,70%	-41,75%	0,20%	33,004%	206,19%
120% do CDI	0,65%	6,49%	1,91%	3,85%	7,91%	22,41%	-	-	-
TRENBANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	-6,93%	-58,13%	-16,96%	-29,60%	-61,23%	-73,19%	0,00%	-	-
115% do CDI	0,62%	6,21%	1,83%	3,69%	7,56%	21,38%	-	-	-
CARTÃO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	0,64%	6,36%	1,87%	3,78%	7,69%	21,55%	0,20%	0,364%	0,27%
Selic	0,54%	5,39%	1,59%	3,20%	6,56%	18,38%	-	-	-
BRABESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,54%	5,31%	1,56%	3,13%	6,46%	18,83%	0,20%	0,002%	0,03%
CDI	0,54%	5,38%	1,59%	3,20%	6,55%	18,35%	-	-	-
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	0,87%	4,39%	1,62%	1,98%	5,76%	18,14%	1,00%	0,271%	0,78%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,54%	5,31%	1,57%	3,15%	6,46%	18,48%	0,20%	0,003%	0,02%
SANTANDER MASTER FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,47%	4,61%	1,36%	2,73%	5,62%	16,62%	1,00%	0,003%	0,02%
IPCA	0,45%	3,81%	0,84%	2,86%	4,56%	7,38%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,51%	5,82%	1,31%	2,13%	6,81%	21,70%	0,40%	0,001%	1,19%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

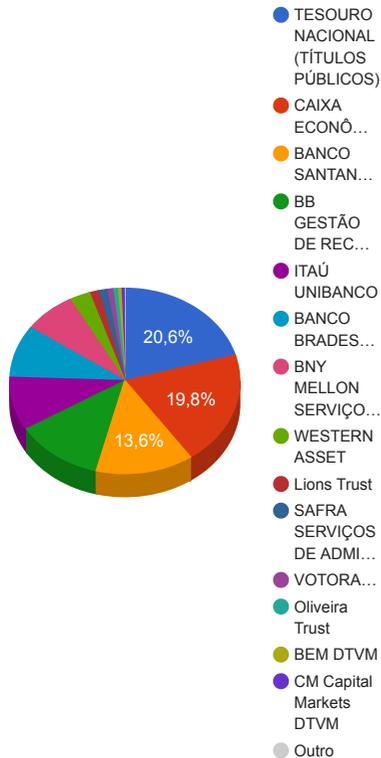
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	12,59%	1,07%	5,69%	-5,10%	5,55%	37,47%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	14,87%	15,01%	8,87%	-0,33%	15,93%	51,46%	2,00%	17,235%	20,34%
IDIV	11,44%	7,39%	7,50%	-1,29%	5,19%	30,43%	-	-	-
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	15,80%	6,76%	8,27%	-1,80%	10,93%	21,01%	3,00%	17,105%	20,34%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	12,57%	1,70%	7,92%	-4,15%	3,69%	13,73%	1,72%	14,035%	18,65%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	12,49%	13,08%	8,54%	0,67%	11,96%	29,38%	1,50%	15,209%	21,14%
Ibovespa	10,19%	14,43%	10,35%	1,52%	17,65%	34,66%	-	-	-
ARX INCOME FI AÇÕES	14,43%	24,61%	11,88%	3,38%	25,73%	38,37%	3,00%	16,200%	23,19%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	14,23%	18,14%	8,59%	2,95%	20,15%	43,49%	2,50%	15,935%	19,11%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	12,44%	24,46%	10,68%	3,89%	25,37%	41,38%	2,00%	16,479%	22,42%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	11,97%	12,59%	9,15%	1,18%	14,89%	31,98%	1,50%	14,488%	20,07%
IFIX	5,04%	0,72%	4,08%	-4,06%	0,73%	18,90%	-	-	-
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	3,72%	-18,90%	20,97%	-4,94%	-28,28%	-7,04%	0,95%	32,323%	63,24%
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	3,19%	9,08%	2,87%	1,74%	3,59%	34,94%	0,00%	6,077%	17,07%
IPCA + 9,50% ao ano	1,25%	11,96%	3,19%	7,71%	14,41%	28,61%	-	-	-
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP	-	-	-	-	-	-	1,30%	0,045%	14,47%
IPC-FIPE + 6% a.a. (Meta Atuarial)	0,99%	7,86%	2,80%	5,82%	9,78%	19,03%	-	-	-

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

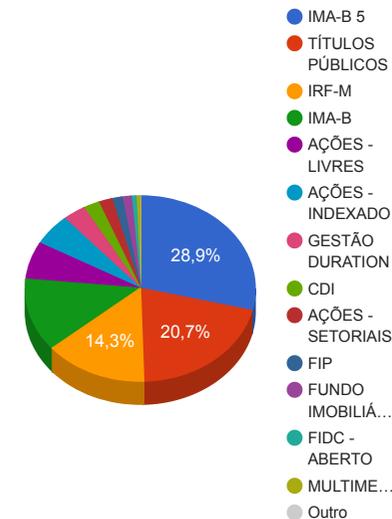
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	2,00%	-	-
IPCA	0,45%	3,81%	0,84%	2,86%	4,56%	7,38%	-	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	-	-	-	-	-	-	0,00%	-	-
Global BDRX	-14,26%	15,88%	-3,45%	10,87%	23,42%	55,12%	-	-	-
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-16,39%	11,21%	-5,91%	7,23%	17,75%	45,47%	1,50%	9,290%	15,92%
S&P 500	-6,94%	1,43%	-3,71%	2,41%	5,30%	27,54%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-6,70%	4,18%	-2,79%	4,51%	9,47%	45,37%	1,00%	10,008%	13,68%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	-	-	-	-	-	-	2,00%	0,071%	111,22%

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

Administrador	Valor	%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	231.479.828,25	20,55%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	223.027.709,19	19,80%
BANCO SANTANDER	153.368.730,51	13,62%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	138.593.482,70	12,31%
ITAÚ UNIBANCO	104.830.360,13	9,31%
BANCO BRADESCO	102.451.474,73	9,10%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	83.039.850,99	7,37%
WESTERN ASSET	33.044.254,64	2,93%
Lions Trust	14.226.027,17	1,26%
SAFRA SERVIÇOS DE ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA LTDA.	13.388.602,80	1,19%
VOTORANTIM ASSET MANAGEMENT	9.463.565,44	0,84%
Oliveira Trust	7.320.198,48	0,65%
BEM DTVM	5.572.840,66	0,49%
CM Capital Markets DTVM	5.020.100,00	0,45%
Santander Securities Services	1.397.953,67	0,12%
Brasil Plural	33.304,61	0,00%
Geração Futuro	28.425,14	0,00%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	7.943,81	0,00%



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	322.922.860,48	28,67%
TÍTULOS PÚBLICOS	231.479.828,25	20,55%
IRF-M	159.899.888,04	14,20%
IMA-B	142.605.376,19	12,66%
AÇÕES - LIVRES	72.913.774,99	6,47%
AÇÕES - INDEXADO	61.159.391,36	5,43%
GESTÃO DURATION	36.230.567,29	3,22%
CDI	25.195.076,30	2,24%
AÇÕES - SETORIAIS	21.648.995,83	1,92%
FIP	16.024.833,06	1,42%
FUNDO IMOBILIÁRIO	14.483.665,44	1,29%
FIDC - ABERTO	7.320.198,48	0,65%
MULTIMERCADO	7.022.033,52	0,62%
FIDC - FECHADO	61.729,75	0,01%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	7.943,81	0,00%



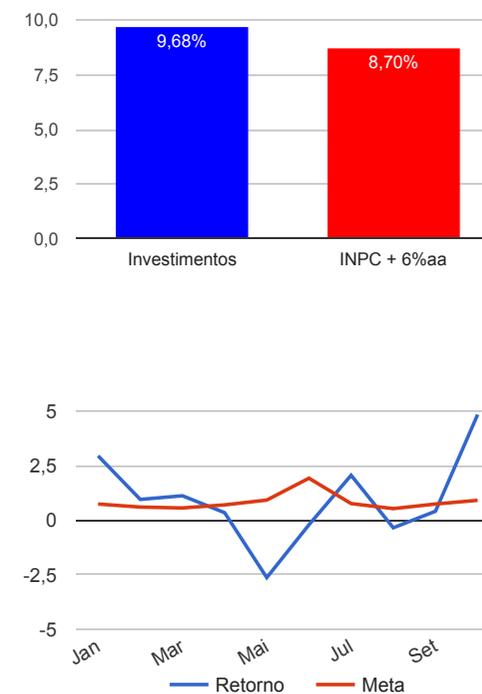
Carteira de Títulos Públicos - base (outubro / 2018)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	GAP (Atual - Pago)
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2019	11/03/2015	8000	3.023,981475	3.302,364097	24.191.851,80	26.418.912,78	2.227.060,98
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2019	11/03/2015	4000	2.584,200138	3.302,364097	10.336.800,55	13.209.456,39	2.872.655,84
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	06/12/2016	3450	2.926,773673	3.399,146683	10.097.369,17	11.727.056,06	1.629.686,88
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	11/03/2015	7600	3.031,376224	3.421,999442	23.038.459,30	26.007.195,76	2.968.736,46
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	23/03/2015	2000	2.593,340767	3.421,999442	5.186.681,53	6.843.998,88	1.657.317,35
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	06/12/2016	3400	2.955,347610	3.436,261508	10.048.181,87	11.683.289,13	1.635.107,25
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/03/2015	8500	3.097,511439	3.554,126324	26.328.847,23	30.210.073,75	3.881.226,52
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/03/2015	6000	3.097,511438	3.554,126324	18.585.068,63	21.324.757,94	2.739.689,32
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/03/2015	3200	2.350,172187	3.554,126324	7.520.551,00	11.373.204,24	3.852.653,24
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	06/12/2016	3450	2.896,880939	3.554,126324	9.994.239,24	12.261.735,82	2.267.496,58
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	24/07/2018	13000	3.271,84902100	3.554,126324	42.534.037,27	46.203.642,21	3.669.604,94
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	24/07/2018	4000	3.271,84902100	3.554,126324	13.087.396,08	14.216.505,30	1.129.109,21

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	967.325.794,34	7.921.414,33	14.141.261,27	989.570.302,26	28.464.354,86	2,94%	0,74%	397,02%	2,50%
Fevereiro	989.570.302,26	73.503.137,19	49.249.739,52	1.023.462.107,99	9.638.408,06	0,95%	0,60%	159,03%	2,94%
Março	1.023.462.107,99	22.227.044,71	27.141.951,87	1.029.977.263,83	11.430.063,00	1,12%	0,56%	200,47%	2,18%
Abril	1.029.977.263,83	50.469.185,72	45.087.220,80	1.038.918.854,98	3.559.626,23	0,34%	0,70%	49,27%	2,02%
Mai	1.038.918.854,98	30.092.585,17	22.295.411,00	1.019.219.218,08	-27.496.811,07	-2,63%	0,92%	-285,90%	3,20%
Junho	1.019.219.218,08	27.822.808,26	21.002.923,21	1.023.878.503,83	-2.160.599,30	-0,21%	1,92%	-10,95%	4,50%
Julho	1.023.878.503,83	74.084.991,89	67.302.067,85	1.051.845.772,08	21.184.344,21	2,06%	0,76%	270,00%	2,54%
Agosto	1.051.845.772,08	17.711.414,76	10.544.235,65	1.055.333.309,61	-3.679.641,58	-0,35%	0,53%	-65,16%	3,90%
Setembro	1.055.333.309,61	28.642.930,77	21.938.088,95	1.066.371.858,93	4.333.707,50	0,41%	0,74%	55,02%	2,96%
Outubro	1.066.371.858,93	19.765.916,62	11.739.747,03	1.126.286.709,11	51.888.680,59	4,83%	0,91%	529,54%	4,64%
Acumulado no ano					97.162.132,50	9,68%	8,70%	111,23%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	12.380.385,79	0,00	0,00	13.388.602,80	1.008.217,01	8,14%	4,91%	8,14%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	47.206.025,28	0,00	0,00	50.711.783,41	3.505.758,13	7,43%	4,18%	7,43%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	52.000.107,66	0,00	0,00	55.686.854,08	3.686.746,42	7,09%	3,96%	7,09%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	21.316.042,71	0,00	0,00	22.818.135,90	1.502.093,19	7,05%	3,92%	7,05%
TÍTULOS PÚBLICOS	216.493.588,38	0,00	0,00	231.479.828,25	14.986.239,87	6,92%	-	-
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	4.772.652,12	0,00	0,00	4.968.784,02	196.131,90	4,11%	2,15%	4,11%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	83.944.111,48	0,00	0,00	87.181.604,31	3.237.492,83	3,86%	2,18%	3,86%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	35.154.659,05	0,00	0,00	36.426.620,94	1.271.961,89	3,62%	2,14%	3,62%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	35.036.669,77	0,00	0,00	36.291.662,79	1.254.993,02	3,58%	2,13%	3,58%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	42.623.928,46	0,00	0,00	43.974.988,78	1.351.060,32	3,17%	1,65%	3,17%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA	5.402.835,31	0,00	0,00	5.572.840,66	170.005,35	3,15%	1,64%	3,15%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	110.578.778,11	2.095.599,87	25.463,37	116.105.359,60	3.456.444,99	3,07%	1,60%	3,10%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	7.101.435,43	0,00	0,00	7.318.490,13	217.054,70	3,06%	1,59%	3,06%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	44.366.349,50	477.596,53	0,00	46.214.113,61	1.370.167,58	3,06%	1,59%	3,07%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	97.406.323,96	5.579.720,22	0,00	106.086.773,81	3.100.729,63	3,01%	1,61%	3,10%
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	16.449.781,90	0,00	0,00	16.593.623,79	143.841,89	0,87%	0,27%	0,87%
CARTÃO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	7.273.571,19	0,00	0,00	7.320.198,48	46.627,29	0,64%	0,36%	0,64%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.723.273,75	0,00	0,00	7.764.702,54	41.428,79	0,54%	0,00%	0,54%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	36.047.022,26	0,00	0,00	36.230.567,29	183.545,03	0,51%	0,00%	0,51%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	255.938,64	240.000,00	283.967,72	213.910,88	1.939,96	0,39%	0,00%	0,54%
SANTANDER MASTER FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	612.303,84	11.373.000,00	11.374.946,32	622.839,09	12.481,57	0,10%	0,00%	0,47%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	35.782,35	0,00	0,00	33.304,61	-2.477,74	-6,92%	-	-

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	32.365,45	0,00	0,00	28.425,14	-3.940,31	-12,17%	33,00%	-12,17%
Total Renda Fixa					40.738.543,31	4,57%	2,10%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	3.957.433,32	0,00	0,00	4.582.820,74	625.387,42	15,80%	17,10%	15,80%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	25.522.641,36	0,00	0,00	29.318.560,98	3.795.919,62	14,87%	17,24%	14,87%
ARX INCOME FI AÇÕES	22.058.789,51	0,00	0,00	25.241.062,49	3.182.272,98	14,43%	16,20%	14,43%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	9.673.557,84	0,00	0,00	11.050.368,53	1.376.810,69	14,23%	15,94%	14,23%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	6.165.900,67	0,00	0,00	6.941.195,17	775.294,50	12,57%	14,03%	12,57%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	9.000.923,38	0,00	0,00	10.124.979,92	1.124.056,54	12,49%	15,21%	12,49%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	6.495.444,92	0,00	0,00	7.303.782,99	808.338,07	12,44%	16,48%	12,44%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	35.819.697,55	0,00	0,00	40.105.954,26	4.286.256,71	11,97%	14,49%	11,97%
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	9.172.146,34	0,00	55.369,62	9.463.565,44	346.788,72	3,78%	6,08%	3,19%
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	4.840.000,00	0,00	0,00	5.020.100,00	180.100,00	3,72%	32,32%	3,72%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	14.005.985,59	0,00	0,00	13.996.444,69	-9.540,90	-0,07%	-	-
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP	401.574,15	0,00	0,00	400.852,22	-721,93	-0,18%	0,05%	-0,18%
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	1.401.098,52	0,00	0,00	1.397.953,67	-3.144,85	-0,22%	0,07%	-0,22%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	7.526.321,85	0,00	0,00	7.022.033,52	-504.288,33	-6,70%	10,01%	-6,70%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	25.831.484,47	0,00	0,00	21.053.437,10	-4.778.047,37	-18,50%	9,29%	-16,39%
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I MULTISTRATÉG...	284.927,07	0,00	0,00	229.582,48	-55.344,59	-19,42%	-	-
Total Renda Variável					11.150.137,28	6,12%	14,56%	