

Relatório Analítico dos Inv  
em ago



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 (agosto / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			13.995,35	0,00%			
TÍTULOS PÚBLICOS			217.438.440,18	20,60%			Ar
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	95.016.599,36	9,00%	328	4,22%	Ar
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	4.724.740,55	0,45%	21	1,68%	Ar
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	34.593.580,46	3,28%	678	0,68%	Ar
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	12.386.842,94	1,17%	23	4,73%	Ar
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	34.709.887,49	3,29%	16	2,00%	Ar
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	43.527.565,98	4,12%	371	1,79%	Ar
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	7.041.254,20	0,67%	59	0,59%	Ar
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	96.769.308,18	9,17%	307	7,78%	Ar
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	96.578.854,80	9,15%	715	1,19%	Ar
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+0	Não há	21.342.892,29	2,02%	266	1,22%	Art
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	35.897.390,02	3,40%	59	2,36%	Art
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	225.351,53	0,02%	1.379	0,00%	Art
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	16.387.512,98	1,55%	447	8,40%	Art
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	7.687.514,70	0,73%	456	0,09%	Art
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	52.087.270,60	4,94%	201	5,26%	Art
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	47.311.870,19	4,48%	78	4,02%	Art
SANTANDER MASTER FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	590.151,41	0,06%	70.322	0,01%	Art
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	36.671.589,56	3,47%	80	6,84%	Art
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA	D+1	Não há	5.357.546,18	0,51%	16	2,39%	Art
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	Não se aplica	Não se aplica	37.919,63	0,00%			Art



## Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2018)

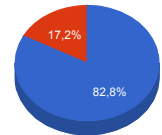
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	33.116,19	0,00%		4,29%	Art
CARTÃO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	D+45 a D+75	Não há	7.233.598,99	0,69%	227	1,53%	Art
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	35.190.110,54	3,33%	55	5,10%	Ar
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	25.825.700,27	2,45%	1.918	5,83%	Ar
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	6.300.508,64	0,60%	2.297	1,22%	Ar
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	3.966.869,53	0,38%	4.981	1,55%	Ar
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	25.673.885,74	2,43%	5.334	4,42%	Ar
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	6.260.646,27	0,59%	121	1,60%	Ar
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	9.799.195,79	0,93%	132	0,98%	Ar
ARX INCOME FI AÇÕES	D+4	Não há	21.641.718,29	2,05%	1.848	10,22%	Ar
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	8.914.610,39	0,84%	276	4,48%	Ar
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	7.491.281,06	0,71%	11.088	0,63%	
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	324.829,85	0,03%			Art
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	1.144.557,59	0,11%	39	0,40%	Art
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	14.012.947,18	1,33%			Art
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP	Não se aplica	Não se aplica	402.109,28	0,04%	19	0,22%	Art
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	S/Info	Não se aplica	9.245.540,78	0,88%		5,83%	Art
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	Não se aplica	Não se aplica	5.488.000,00	0,52%		4,16%	Art
		<b>TOTAL -</b>	<b>1.055.347.304,96</b>				



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

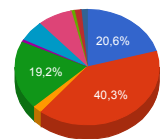
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	217.438.440,18	20,60%	17,00%	40,00%	40,00%	204.700.481,80
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	425.348.633,96	40,30%	35,00%	50,00%	50,00%	102.325.018,52
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	21.342.892,29	2,02%	21,00%	35,00%	35,00%	348.028.664,45
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	202.216.197,17	19,16%	4,00%	10,00%	20,00%	8.853.263,82
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	7.304.634,81	0,69%	0,70%	1,00%	2,00%	13.802.311,29
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00	0,00%	1,00%	2,00%	3,00%	31.660.419,15
Em Enquadramento - RF	0,00%	0,00	0,00%	1,00%	2,00%	3,00%	31.660.419,15
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>873.650.798,41</b>	<b>82,78%</b>	<b>79,70</b>	<b>140,00</b>	<b>154,00</b>	<b>-</b>

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%	61.015.810,81	5,78%	5,00%	6,00%	7,00%	12.858.500,54
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	82.557.434,65	7,82%	6,00%	6,00%	7,00%	-8.683.123,30
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	20,00%	0,00	0,00%	0,70%	1,00%	2,00%	21.106.946,10
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	7.491.281,06	0,71%	1,00%	3,00%	5,00%	45.276.084,19
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	15.884.443,90	1,51%	1,00%	2,00%	4,00%	26.329.448,30
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	14.733.540,78	1,40%	1,00%	2,00%	3,00%	16.926.878,37
Desenquadrado - RV	0,00%	0,00	0,00%	1,00%	2,00%	3,00%	31.660.419,15
Em Enquadramento - RV	0,00%	0,00	0,00%	1,00%	2,00%	3,00%	31.660.419,15
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>181.682.511,20</b>	<b>17,22%</b>	<b>16,70</b>	<b>24,00</b>	<b>34,00</b>	<b>-</b>

Distribuição por Artigo / Re





## Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: agosto / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)	Artigos - Renda Variável	Base: agosto / 2018		Li Infe
	Carteira (\$)	Carteira (%)				Carteira (\$)	Carteira (%)	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	217.438.440,18	20,60%	17,00%	40,00%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	61.015.810,81	5,78%	5
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	425.348.633,96	40,30%	35,00%	50,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	82.557.434,65	7,82%	6
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	21.342.892,29	2,02%	21,00%	35,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	202.216.197,17	19,16%	4,00%	20,00%	Artigo 8º, Inciso III	7.491.281,06	0,71%	1
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	7.304.634,81	0,69%	0,70%	2,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	15.884.443,90	1,51%	1
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	14.733.540,78	1,40%	1
Desenquadrado - RF	0,00	0,00%	1,00%	3,00%	Desenquadrado - RV	0,00	0,00%	1
Em Enquadramento - RF	0,00	0,00%	1,00%	3,00%	Em Enquadramento - RV	0,00	0,00%	1
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>873.650.798,41</b>	<b>82,78%</b>	<b>79,70</b>	<b>154,00</b>	<b>Total Renda Variável</b>	<b>181.682.511,20</b>	<b>17,22%</b>	<b>1</b>



## Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (agosto / 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	212.938.346,45	20,18%	0,05%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	132.294.698,61	12,54%	0,03%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	130.208.417,04	12,34%	0,01%
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	91.670.974,45	8,69%	0,01%
ITAÚ UNIBANCO	61.652.450,40	5,84%	0,00%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	48.361.907,36	4,58%	0,21%
WESTERN ASSET	38.041.721,88	3,60%	0,08%
ITAÚ DTVM	35.190.110,54	3,33%	0,00%
ARX INVESTIMENTOS	21.641.718,29	2,05%	0,23%
KINEA INVESTIMENTOS	14.337.777,03	1,36%	0,00%
SAFRA ASSET MANAGEMENT	12.386.842,94	1,17%	0,01%
RB CAPITAL ASSET MANAGEMENT	9.245.540,78	0,88%	1,24%
OLIVEIRA TRUST	7.233.598,99	0,69%	0,10%
VINCI PARTNERS	6.260.646,27	0,59%	0,03%
REAG GESTORA DE RECURSOS	5.488.000,00	0,52%	0,93%

Gestão	Valor	% s
Icatu Vanguarda	5.357.546,18	
XP GESTÃO DE RECURSOS	3.966.869,53	
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	1.144.557,59	
BRZ INVESTIMENTOS	402.109,28	
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUTURADOS	37.919,63	
LTD BRASIL PLURAL	33.116,19	



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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês
CDI + 3,50% ao ano	0,88%	6,76%	2,56%	5,07%	10,54%	28,18%	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-6,45%	-63,95%	-13,90%	-16,68%	-48,89%	-27,40%	0,20%	-
120% do CDI	0,68%	5,21%	1,97%	3,90%	8,25%	24,09%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	-5,46%	-52,33%	-13,05%	-48,34%	-53,22%	-62,17%	0,00%	-
115% do CDI	0,65%	4,99%	1,88%	3,73%	7,90%	22,97%	-	-
CARTÃO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	0,67%	5,10%	1,93%	3,81%	8,00%	23,11%	0,20%	0,000%
Selic	0,57%	4,33%	1,64%	3,24%	6,84%	19,73%	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,55%	4,26%	1,60%	3,16%	6,79%	20,33%	0,20%	0,001%
CDI	0,57%	4,32%	1,64%	3,24%	6,83%	19,70%	-	-
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,55%	4,26%	1,61%	3,18%	6,78%	19,85%	0,20%	0,010%
SANTANDER MASTER FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,48%	3,70%	1,39%	2,76%	5,93%	17,96%	1,00%	0,010%
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	0,36%	3,09%	0,97%	1,83%	6,24%	18,85%	1,00%	0,434%
IRF-M	-0,93%	2,91%	0,57%	0,48%	5,93%	25,00%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,96%	2,79%	0,53%	0,37%	5,71%	24,46%	0,20%	2,220%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,97%	2,70%	0,50%	0,27%	5,53%	26,14%	0,10%	2,218%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,08%	2,80%	0,52%	0,24%	5,61%	24,40%	0,20%	2,263%
IMA-B	-0,45%	3,04%	1,53%	-0,90%	4,57%	20,76%	-	-



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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,45%	3,00%	1,47%	-0,88%	4,51%	20,38%	0,20%	3,380%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,45%	2,93%	1,50%	-0,95%	4,45%	20,72%	0,30%	3,478%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,64%	2,56%	1,25%	-1,34%	4,02%	20,63%	0,20%	3,782%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	-0,85%	2,09%	0,86%	-1,68%	3,46%	18,91%	0,45%	3,745%
IMA-B 5	-0,26%	4,06%	1,67%	2,14%	6,66%	21,49%	-	-
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA	-0,23%	4,03%	1,69%	2,10%	6,60%	21,41%	0,25%	1,991%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	-0,26%	3,93%	1,63%	2,05%	6,45%	21,07%	0,20%	1,988%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,27%	3,90%	1,61%	2,01%	6,42%	21,03%	0,20%	1,979%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-0,28%	3,90%	1,62%	2,03%	6,46%	21,03%	0,10%	1,969%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	-0,29%	3,77%	1,56%	1,92%	6,23%	20,53%	0,40%	1,963%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	-0,34%	3,78%	1,55%	1,84%	6,22%	21,22%	0,20%	2,077%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	-0,71%	3,56%	1,00%	0,99%	5,93%	22,60%	0,40%	2,785%
IPCA	-0,09%	2,85%	1,50%	2,22%	4,19%	6,75%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,37%	4,85%	1,54%	2,56%	7,46%	23,99%	0,40%	0,232%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-





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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês
Global BDRX	13,10%	35,75%	18,54%	35,26%	56,13%	77,70%	-	-
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	12,51%	32,99%	17,96%	35,01%	50,24%	68,73%	1,50%	5,596%
S&P 500	5,27%	9,73%	7,70%	8,10%	18,70%	35,14%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	3,71%	11,14%	7,87%	9,04%	22,46%	55,06%	1,00%	3,604%
IPC-FIPE + 6% a.a. (Meta Atuarial)	0,95%	5,92%	3,22%	4,90%	9,20%	18,15%	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	2,00%	-
IPCA + 9,50% ao ano	0,74%	9,30%	3,94%	7,09%	14,01%	27,86%	-	-
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP	-	-	-	-	-	-	1,30%	0,002%
SMLL	-4,25%	-8,44%	-3,06%	-11,92%	-2,33%	33,39%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-4,67%	0,71%	-5,32%	-9,14%	7,63%	43,19%	2,00%	9,761%
IDIV	-3,70%	-3,80%	-1,17%	-11,91%	0,29%	33,84%	-	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-2,66%	-8,28%	-3,31%	-13,52%	-3,00%	9,30%	1,72%	8,844%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	-4,43%	-0,44%	-1,05%	-11,75%	4,56%	32,61%	1,50%	11,747%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	-6,29%	-7,59%	-4,40%	-11,76%	-5,04%	14,76%	3,00%	11,952%
Ibovespa	-3,21%	0,36%	-0,10%	-10,16%	8,25%	32,43%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-3,71%	4,76%	-0,86%	-4,57%	11,40%	41,22%	2,50%	8,612%
ARX INCOME FI AÇÕES	-4,07%	6,84%	-1,13%	-7,56%	11,90%	33,79%	3,00%	12,335%



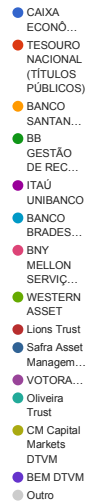
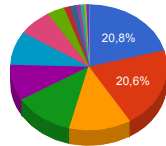
## Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (agosto / 2018)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-4,23%	-1,21%	-2,13%	-11,00%	4,88%	26,31%	1,50%	10,836%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-4,52%	7,36%	-1,93%	-7,48%	15,37%	36,02%	2,00%	11,330%
IFIX	-0,70%	-3,91%	-3,37%	-7,44%	2,66%	21,07%	-	-
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	32,24%	-11,34%	13,15%	-6,98%	21,69%	19,30%	0,95%	46,957%
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	0,52%	6,58%	2,87%	-0,36%	3,93%	31,87%	0,00%	5,757%
IPCA	-0,09%	2,85%	1,50%	2,22%	4,19%	6,75%	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	-	-	-	-	-	-	0,00%	-
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	-	-	-	-	-	-	2,00%	22,181%

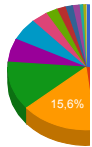


## Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (agosto / 2018)

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	219.198.992,72	20,77%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	217.438.440,18	20,60%
BANCO SANTANDER	132.294.698,61	12,54%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	130.610.526,32	12,38%
ITAÚ UNIBANCO	96.842.560,94	9,18%
BANCO BRADESCO	91.670.974,45	8,69%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	73.970.495,18	7,01%
WESTERN ASSET	38.041.721,88	3,60%
Lions Trust	14.337.777,03	1,36%
Safra Asset Management	12.386.842,94	1,17%
VOTORANTIM ASSET MANAGEMENT	9.245.540,78	0,88%
Oliveira Trust	7.233.598,99	0,69%
CM Capital Markets DTVM	5.488.000,00	0,52%
BEM DTVM	5.357.546,18	0,51%
Santander Securities Services	1.144.557,59	0,11%
Brasil Plural	37.919,63	0,00%
Geração Futuro	33.116,19	0,00%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	13.995,35	0,00%



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	290.670.859,45	27,54%
TÍTULOS PÚBLICOS	217.438.440,18	20,60%
IRF-M	164.320.067,31	15,57%
IMA-B	133.128.876,02	12,61%
AÇÕES - LIVRES	63.415.308,46	6,01%
AÇÕES - INDEXADO	61.015.810,81	5,78%
GESTÃO DURATION	35.897.390,02	3,40%
CDI	24.890.530,62	2,36%
AÇÕES - SETORIAIS	19.142.126,19	1,81%
FIP	15.884.443,90	1,51%
FUNDO IMOBILIÁRIO	14.733.540,78	1,40%
MULTIMERCADO	7.491.281,06	0,71%
FIDC - ABERTO	7.233.598,99	0,69%
FIDC - FECHADO	71.035,82	0,01%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	13.995,35	0,00%





## Carteira de Títulos Públicos - base (agosto / 2018)

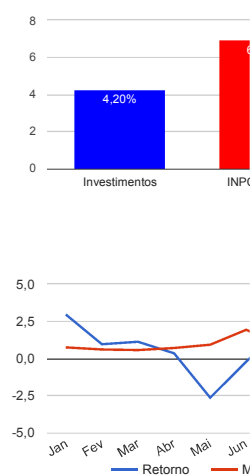
Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2019	11/03/2015	8000	3.023,981475	3.247,238919	24.191.851,80	25.977.911,;
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2019	11/03/2015	4000	2.584,200138	3.247,238919	10.336.800,55	12.988.955,;
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	06/12/2016	3450	2.926,773673	3.274,280697	10.097.369,17	11.296.268,;
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	11/03/2015	7600	3.031,376224	3.246,878446	23.038.459,30	24.676.276,;
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	23/03/2015	2000	2.593,340767	3.246,878446	5.186.681,53	6.493.756,8
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	06/12/2016	3400	2.955,347610	3.219,883686	10.048.181,87	10.947.604,;
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/03/2015	8500	3.097,511439	3.278,051563	26.328.847,23	27.863.438,;
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/03/2015	6000	3.097,511438	3.278,051563	18.585.068,63	19.668.309,;
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/03/2015	3200	2.350,172187	3.278,051563	7.520.551,00	10.489.765,;
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	06/12/2016	3450	2.896,880939	3.278,051563	9.994.239,24	11.309.277,;
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	24/07/2018	13000	3271,84902100	3.278,051563	4.253.403.727.300.000,00	42.614.670,;
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	24/07/2018	4000	3271,84902100	3.278,051563	1.308.739.608.400.000,00	13.112.206,;



## 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%
Acumulado no ano					40.939.744,41	4,20%	6,92%	60,64%	

Acumulado no An





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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR -
CARTÃO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	7.185.505,38	0,00	0,00	7.233.598,99	48.093,61	0,67%	0
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.645.136,84	0,00	0,00	7.687.514,70	42.377,86	0,55%	0
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	240.687,62	245.000,00	262.379,84	225.351,53	2.043,75	0,42%	0
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	35.763.742,91	0,00	0,00	35.897.390,02	133.647,11	0,37%	0
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	16.329.160,06	0,00	0,00	16.387.512,98	58.352,92	0,36%	0
SANTANDER MASTER FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	618.565,89	9.680.000,00	9.722.801,56	590.151,41	14.387,08	0,14%	0
TÍTULOS PÚBLICOS	217.708.523,02	0,00	315.846,87	217.438.440,18	45.764,03	0,02%	
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	43.194.022,30	447.058,38	0,00	43.527.565,98	-113.514,70	-0,26%	1
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	96.840.575,08	0,00	0,00	96.578.854,80	-261.720,28	-0,27%	1
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	95.137.643,77	1.900.850,46	0,00	96.769.308,18	-269.186,05	-0,28%	1
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	7.061.718,14	0,00	0,00	7.041.254,20	-20.463,94	-0,29%	1
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA	0,00	5.374.994,92	0,00	5.357.546,18	-17.448,74	-0,32%	1
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	36.796.149,49	0,00	0,00	36.671.589,56	-124.559,93	-0,34%	2
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	21.439.488,98	0,00	0,00	21.342.892,29	-96.596,69	-0,45%	3
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	52.323.368,88	0,00	0,00	52.087.270,60	-236.098,08	-0,45%	3
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	47.617.076,08	0,00	0,00	47.311.870,19	-305.205,89	-0,64%	3
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	4.758.748,58	0,00	0,00	4.724.740,55	-34.008,03	-0,71%	2
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	12.492.531,25	0,00	0,00	12.386.842,94	-105.688,31	-0,85%	3
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	34.927.408,24	0,00	0,00	34.593.580,46	-333.827,78	-0,96%	2
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	35.050.415,66	0,00	0,00	34.709.887,49	-340.528,17	-0,97%	2
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	96.055.354,71	0,00	0,00	95.016.599,36	-1.038.755,35	-1,08%	2
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	40.108,90	0,00	0,00	37.919,63	-2.189,27	-5,46%	



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR -
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	35.398,04	0,00	0,00	33.116,19	-2.281,85	-6,45%	
				Total Renda Fixa	-2.957.406,70	-0,34%	2



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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR -
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	4.150.000,00	0,00	0,00	5.488.000,00	1.338.000,00	32,24%	46
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	22.954.740,18	0,00	0,00	25.825.700,27	2.870.960,09	12,51%	5
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	7.223.577,14	0,00	0,00	7.491.281,06	267.703,92	3,71%	3
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	9.190.494,95	0,00	55.175,34	9.245.540,78	110.221,17	1,20%	5
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	14.025.497,64	0,00	0,00	14.012.947,18	-12.550,46	-0,09%	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP	402.707,48	0,00	0,00	402.109,28	-598,20	-0,15%	0
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	1.271.720,07	63.511,00	188.032,04	1.144.557,59	-2.641,44	-0,20%	22
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	6.431.602,05	0,00	0,00	6.260.646,27	-170.955,78	-2,66%	8
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	10.176.659,58	0,00	0,00	9.799.195,79	-377.463,79	-3,71%	8
ARX INCOME FI AÇÕES	22.560.688,95	0,00	0,00	21.641.718,29	-918.970,66	-4,07%	12
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	36.744.289,94	0,00	0,00	35.190.110,54	-1.554.179,40	-4,23%	10
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	9.328.025,04	0,00	0,00	8.914.610,39	-413.414,65	-4,43%	11
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	6.598.807,27	0,00	0,00	6.300.508,64	-298.298,63	-4,52%	11
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	26.931.010,48	0,00	0,00	25.673.885,74	-1.257.124,74	-4,67%	9
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	4.232.949,97	0,00	0,00	3.966.869,53	-266.080,44	-6,29%	11
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I MULTIESTRATÉG...	361.671,72	0,00	0,00	324.829,85	-36.841,87	-10,19%	
				<b>Total Renda Variável</b>	<b>-722.234,88</b>	<b>-0,40%</b>	<b>10</b>