

# Relatório Analítico dos Investimentos em julho de 2018

Carteira consolidada de investimentos - base (julho / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	38.580.314,25	10,19%	709	0,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	31.839.134,24	8,41%	282	1,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	32.562.820,41	8,60%	1.448	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	D+0 ou D+1	Não há	13.050.963,00	3,45%	12	8,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	D+1	16/05/2019	12.023.044,47	3,17%	11	15,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	16.862.100,32	4,45%	308	1,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	59.022.044,13	15,58%	294	3,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	14.794.440,57	3,91%	95	3,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	20.239.153,21	5,34%	20	7,59%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.531.134,70	0,67%	59	0,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	40.796.073,02	10,77%	783	0,86%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	9.861.399,60	2,60%	26	5,31%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	20.302.697,67	5,36%	465	0,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	7.960.495,41	2,10%	72	1,64%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	16.618.973,19	4,39%	117	1,99%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	2.212.363,67	0,58%	121	0,56%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	5.211.250,81	1,38%	5.425	0,85%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	13.205.583,78	3,49%	10.825	1,25%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	959.696,55	0,25%	19	1,02%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	Não se aplica	Não se aplica	4.122.785,75	1,09%	101	0,73%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	Não se aplica	Não se aplica	1.334.065,19	0,35%		0,72%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	4.934.965,32	1,30%		0,20%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "

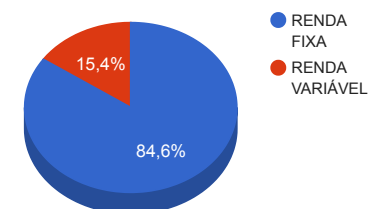
Carteira consolidada de investimentos - base (julho / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	9.752.841,38	2,57%	42	2,94%	Desenquadrado - RV
		<b>TOTAL -</b>	<b>378.778.340,64</b>				

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

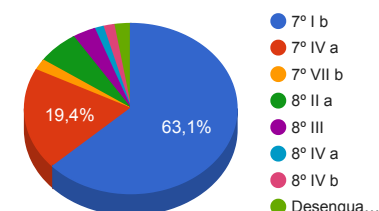
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	238.974.014,60	63,09%	15,00%	35,00%	70,00%	26.170.823,85
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	15,00%	60,00%	227.267.004,38
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	73.491.304,99	19,40%	5,00%	20,00%	40,00%	78.020.031,27
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	18.938.917,03
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	7.960.495,41	2,10%	0,00%	2,50%	5,00%	10.978.421,62
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>320.425.815,00</b>	<b>84,59%</b>	<b>25,00</b>	<b>75,00</b>	<b>185,00</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%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	10,00%	37.877.834,06
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	24.042.587,67	6,35%	2,00%	5,00%	10,00%	13.835.246,39
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	13.205.583,78	3,49%	2,00%	9,00%	10,00%	24.672.250,28
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	5.082.482,30	1,34%	1,00%	3,00%	5,00%	13.856.434,73
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	6.269.030,51	1,66%	1,00%	3,00%	5,00%	12.669.886,52
Desenquadrado - RV	0,00%	9.752.841,38	2,57%	0,00%	0,00%	0,00%	-9.752.841,38
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>58.352.525,64</b>	<b>15,41%</b>	<b>8,00</b>	<b>25,00</b>	<b>40,00</b>	<b>-</b>

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: julho / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	238.974.014,60	63,09%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	73.491.304,99	19,40%	5,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	7.960.495,41	2,10%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>320.425.815,00</b>	<b>84,59%</b>	<b>25,00</b>	<b>185,00</b>

Artigos - Renda Variável	Base: julho / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	24.042.587,67	6,35%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	13.205.583,78	3,49%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5.082.482,30	1,34%	1,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	6.269.030,51	1,66%	1,00%	5,00%
Desenquadrado - RV	9.752.841,38	<b>2,57%</b>	0,00%	0,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>58.352.525,64</b>	<b>15,41%</b>	<b>8,00</b>	<b>40,00</b>

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (julho / 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
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	95.390.143,24	25,18%	0,01%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	91.347.786,27	24,12%	0,01%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	72.102.831,21	19,04%	0,02%
WESTERN ASSET	43.197.578,37	11,40%	0,09%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	26.723.499,92	7,06%	0,01%
ITAÚ UNIBANCO	19.150.107,89	5,06%	0,00%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	13.050.963,00	3,45%	0,02%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	5.211.250,81	1,38%	0,02%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	4.934.965,32	1,30%	0,32%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	4.122.785,75	1,09%	0,02%
VINCI PARTNERS	2.212.363,67	0,58%	0,01%
BRASIL PLURAL	1.334.065,19	0,35%	0,01%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	2,32%	3,50%	-1,23%	0,09%	6,45%	22,38%	-	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	0,65%	1,29%	-1,19%	0,51%	2,43%	7,25%	0,20%	0,278%	3,82%
IMA-B 5	1,48%	4,33%	0,35%	2,95%	8,27%	23,13%	-	-	-
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	2,05%	4,31%	-0,81%	2,67%	8,00%	24,77%	0,40%	1,515%	4,08%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,46%	4,18%	0,27%	2,83%	8,03%	22,65%	0,20%	0,926%	2,58%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,46%	4,19%	0,29%	2,84%	8,07%	22,69%	0,10%	0,923%	2,58%
IMA Geral ex-C	1,39%	3,72%	0,02%	2,00%	7,28%	23,79%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,37%	3,96%	0,20%	2,19%	7,29%	-	0,30%	1,008%	2,43%
IPCA + 6,00% ao ano	0,84%	6,48%	3,52%	5,63%	10,70%	20,50%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,98%	4,05%	-0,64%	2,18%	8,03%	24,24%	0,15%	1,429%	4,00%
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	1,34%	3,74%	0,59%	2,65%	4,75%	8,16%	0,15%	0,206%	3,95%
IRF-M 1	0,66%	3,76%	1,41%	3,15%	7,39%	21,86%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,68%	3,66%	1,38%	3,07%	7,21%	21,45%	0,20%	0,201%	0,49%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,66%	3,62%	1,33%	3,03%	7,14%	21,37%	0,20%	0,213%	0,50%
Selic	0,54%	3,74%	1,59%	3,14%	7,09%	20,50%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,53%	3,68%	1,54%	3,09%	7,25%	21,13%	0,20%	0,007%	0,10%
CDI	0,54%	3,73%	1,59%	3,13%	7,08%	20,47%	-	-	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,52%	3,68%	1,54%	3,09%	7,11%	20,69%	0,20%	0,015%	0,08%
IPCA	0,33%	2,94%	2,00%	2,64%	4,48%	7,32%	-	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	2,64%	5,78%	1,44%	4,37%	10,34%	28,63%	0,20%	1,437%	2,65%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,57%	4,46%	0,81%	2,93%	8,32%	24,66%	0,40%	0,064%	1,66%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,51%	1,45%	-1,80%	-0,09%	3,81%	-	0,40%	0,002%	1,88%

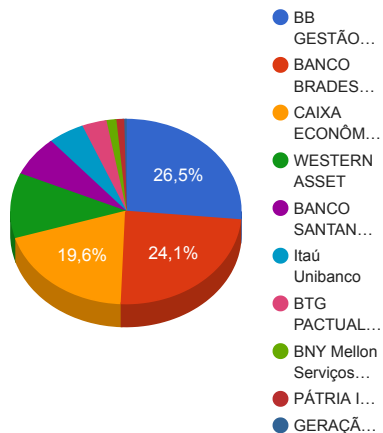


Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (julho / 2018)

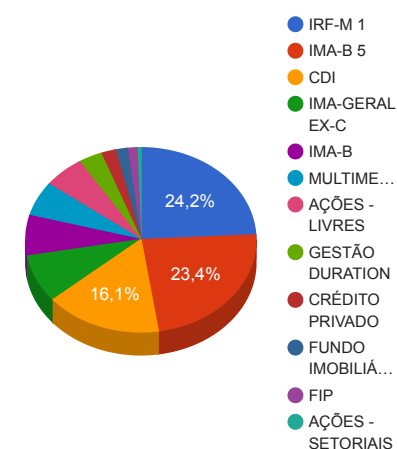
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	8,88%	3,69%	-8,01%	-6,70%	20,18%	38,24%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	6,23%	8,80%	-5,19%	0,98%	24,65%	-	2,50%	7,691%	16,00%
IDIV	7,27%	-0,10%	-8,17%	-9,08%	11,40%	41,60%	-	-	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	4,92%	-5,77%	-11,18%	-10,86%	6,13%	13,26%	1,72%	5,703%	16,14%
SMLL	5,09%	-4,38%	-10,21%	-8,35%	10,75%	39,56%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1,96%	5,64%	-8,44%	-3,27%	22,47%	47,27%	2,00%	7,126%	17,13%
S&P 500	2,61%	4,23%	5,24%	-1,31%	12,81%	28,21%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	3,85%	7,17%	7,51%	1,69%	19,36%	51,19%	1,00%	4,218%	12,25%
IFIX	1,37%	-3,23%	-7,82%	-5,72%	4,27%	24,10%	-	-	-
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	3,70%	-4,93%	-13,05%	-8,45%	-0,96%	12,24%	0,40%	16,946%	21,53%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	0,30%	-	-
CDI	0,54%	3,73%	1,59%	3,13%	7,08%	20,47%	-	-	-
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	0,33%	5,76%	1,33%	4,60%	9,10%	23,47%	2,00%	0,559%	1,50%
IPCA	0,33%	2,94%	2,00%	2,64%	4,48%	7,32%	-	-	-
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	-	-	-	-	-	-	1,00%	-	-
Não Possui	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	0,450%	0,40%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	100.325.108,56	26,49%
BANCO BRADESCO	91.347.786,27	24,12%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	74.315.194,88	19,62%
WESTERN ASSET	43.197.578,37	11,40%
BANCO SANTANDER	26.723.499,92	7,06%
Itaú Unibanco	19.150.107,89	5,06%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	13.050.963,00	3,45%
BNY Mellon Serviços Financeiros	5.211.250,81	1,38%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	4.122.785,75	1,09%
GERAÇÃO FUTURO	1.334.065,19	0,35%



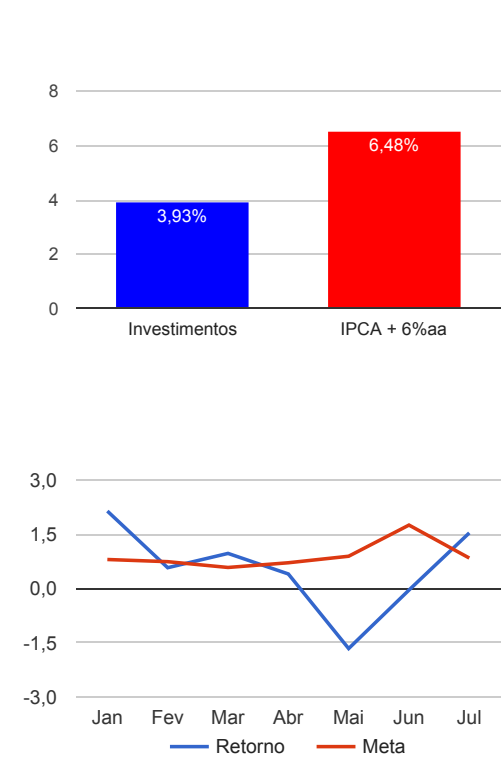
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	91.584.864,54	24,18%
IMA-B 5	88.732.530,78	23,43%
CDI	61.098.770,69	16,13%
IMA-GERAL EX-C	31.839.134,24	8,41%
IMA-B	26.817.485,04	7,08%
MULTIMERCADO	22.958.425,16	6,06%
AÇÕES - LIVRES	21.830.224,00	5,76%
GESTÃO DURATION	12.392.534,30	3,27%
CRÉDITO PRIVADO	7.960.495,41	2,10%
FUNDO IMOBILIÁRIO	6.269.030,51	1,66%
FIP	5.082.482,30	1,34%
AÇÕES - SETORIAIS	2.212.363,67	0,58%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	352.247.338,48	13.890.830,75	7.263.121,96	366.543.099,38	7.668.052,11	2,14%	0,80%	266,60%	1,31%
Fevereiro	366.543.099,38	29.643.789,41	26.899.037,56	371.404.803,94	2.116.952,71	0,57%	0,74%	77,63%	1,67%
Março	371.404.803,94	12.417.000,00	13.972.040,50	373.445.166,24	3.595.402,80	0,97%	0,58%	167,72%	1,50%
Abril	373.445.166,24	9.351.800,00	11.048.137,57	373.245.319,50	1.496.490,83	0,40%	0,71%	56,61%	1,27%
Mai	373.245.319,50	49.660.879,19	51.438.094,60	365.278.227,77	-6.189.876,32	-1,66%	0,89%	-186,61%	2,23%
Junho	365.278.227,77	9.323.200,00	14.142.540,02	360.299.566,55	-159.321,20	-0,04%	1,75%	-2,49%	2,82%
Julho	360.299.566,55	135.958.988,71	135.915.610,47	365.871.842,08	5.528.897,29	1,53%	0,84%	182,30%	1,18%
Acumulado no ano					14.056.598,22	3,93%	6,48%	60,70%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	7.755.615,89	0,00	0,00	7.960.495,41	204.879,52	2,64%	1,44%	2,64%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	19.833.097,38	0,00	0,00	20.239.153,21	406.055,83	2,05%	1,52%	2,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.506.969,50	0,00	0,00	14.794.440,57	287.471,07	1,98%	1,43%	1,98%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	38.024.444,21	0,00	0,00	38.580.314,25	555.870,04	1,46%	0,93%	1,46%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	31.409.795,16	0,00	0,00	31.839.134,24	429.339,08	1,37%	1,01%	1,37%
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	12.878.206,00	0,00	0,00	13.050.963,00	172.757,00	1,34%	0,21%	1,34%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.663.472,52	15.001.415,54	0,00	16.862.100,32	197.212,26	1,18%	0,92%	1,46%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	32.341.753,51	0,00	0,00	32.562.820,41	221.066,90	0,68%	0,20%	0,68%
BRDESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	11.945.116,29	0,00	0,00	12.023.044,47	77.928,18	0,65%	0,28%	0,65%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	58.306.982,13	0,00	58.679.349,97	0,00	372.367,84	0,64%	1,94%	2,34%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	58.679.349,97	0,00	59.022.044,13	342.694,16	0,58%	0,21%	0,66%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.516.760,34	0,00	0,00	2.531.134,70	14.374,36	0,57%	0,06%	0,57%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	9.811.758,24	0,00	0,00	9.861.399,60	49.641,36	0,51%	0,00%	0,51%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	40.790.385,11	9.612.000,00	9.812.100,00	40.796.073,02	205.787,91	0,41%	0,02%	0,52%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	14.952.812,87	0,00	15.001.415,54	0,00	48.602,67	0,33%	1,86%	2,29%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	20.182.936,14	52.654.204,61	52.654.204,61	20.302.697,67	119.761,53	0,16%	0,01%	0,53%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>3.705.809,71</b>	<b>1,17%</b>	<b>0,54%</b>	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	15.644.643,10	0,00	0,00	16.618.973,19	974.330,09	6,23%	7,69%	6,23%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	2.108.523,98	0,00	0,00	2.212.363,67	103.839,69	4,92%	5,70%	4,92%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	4.775.967,55	0,00	27.500,00	4.934.965,32	186.497,77	3,90%	-	0,00%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	12.716.233,46	0,00	0,00	13.205.583,78	489.350,32	3,85%	4,22%	3,85%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	5.111.008,86	0,00	0,00	5.211.250,81	100.241,95	1,96%	7,13%	1,96%
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	1.320.192,21	0,00	10.040,35	1.334.065,19	23.913,33	1,81%	16,95%	3,70%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	9.720.575,37	0,00	0,00	9.752.841,38	32.266,01	0,33%	0,56%	0,33%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	4.125.051,18	0,00	0,00	4.122.785,75	-2.265,43	-0,05%	-	-
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	949.591,83	12.018,59	0,00	959.696,55	-1.913,87	-0,20%	0,45%	0,07%
Total Renda Variável					1.906.259,86	3,38%	5,31%	