

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 IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+2 | Não há | 554.017,04 | 0,67% | 181 | 0,08% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 3.872.939,68 | 4,69% | 674 | 0,06% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | D+0 | Não há | 10.322.673,57 | 12,49% | 1.471 | 0,05% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+1 | Não há | 2.256.644,38 | 2,73% | 733 | 0,03% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 1.153.105,25 | 1,40% | 164 | 0,14% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA | D+0 | Não há | 284.159,90 | 0,34% | 57 | 0,12% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | D+1 | Não há | 10.240.121,63 | 12,39% | 298 | 0,67% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 973.315,06 | 1,18% | 192 | 0,08% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | Não há | 4.564.040,35 | 5,52% | 1.267 | 0,04% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+1 | Não há | 8.612.551,53 | 10,42% | 507 | 0,24% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 764.156,80 | 0,92% | 701 | 0,01% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5 | D+1471 | Não há | 267.315,27 | 0,32% | 26 | 0,33% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | D+0 | Não há | 2.192.141,36 | 2,65% | 12.167 | 0,01% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP | D+0 | Não há | 3.570.548,82 | 4,32% | 814 | 0,06% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA | D+0 | Não possui | 6.449.656,38 | 7,80% | 310 | 0,26% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| TOWER BRIDGE RENDA FIXA FI IMA-B 5 | D+1471 | Não há | 852.475,59 | 1,03% | 31 | 0,23% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | D+4 | Não há | 3.479.268,15 | 4,21% | 27 | 2,90% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5 | D+1 | Não há | 8.565.680,13 | 10,37% | 81 | 1,61% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA | D+1 | Não há | 4.855,40 | 0,01% | 79 | 0,00% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | D+0 | Não há | 377.716,04 | 0,46% | 449 | 0,00% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA | D+1 | Não há | 986.685,85 | 1,19% | 32 | 0,52% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| PREMIUM FIDC SÊNIOR | Não se aplica | Não se aplica | 2.033.823,10 | 2,46% | 98 | 2,14% | Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a " |

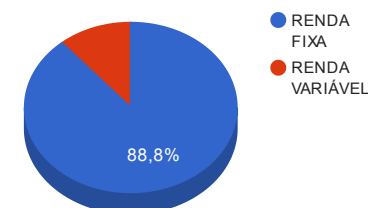
Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2018)

| Produto / Fundo | Disponibilidade Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Qtde. Cotistas | % S/ PL Fundo | RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604 |
|---|-------------------------|----------------|----------------------|--------------------|----------------|---------------|-------------------------------------|
| MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR | Não se aplica | Não se aplica | 8.322,24 | 0,01% | | 1,10% | Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a " |
| SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP | D+90 ou D+150 a D+450 | 18 meses | 955.380,30 | 1,16% | 14 | 8,35% | Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b " |
| BRADESCO SELECTION FI AÇÕES | D+4 | Não há | 917.350,41 | 1,11% | 144 | 0,43% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " |
| CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES | D+33 | 23/08/2017 | 1.309.878,10 | 1,59% | 118 | 0,35% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " |
| ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP | D+4382 | Não há | 0,01 | 0,00% | 5 | -0,00% | Artigo 8º, Inciso III |
| BRADESCO PLUS I FI MULTIMERCADO | D+0 | Não há | 915.092,08 | 1,11% | 24 | 2,65% | Artigo 8º, Inciso III |
| CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11 | Não se aplica | Não se aplica | 3.052.821,52 | 3,69% | | | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a " |
| ÁQUILLA FII - AQLL11 | Não se aplica | Não se aplica | 3.099.465,22 | 3,75% | | 7,89% | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b " |
| | | TOTAL - | 82.636.201,16 | | | | |

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

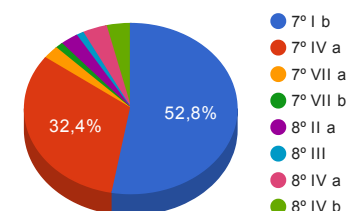
| Artigos - Renda Fixa | Resolução % | Carteira \$ | Carteira % | Estratégia de Alocação | | | GAP Superior |
|-------------------------------------|----------------|----------------------|---------------|------------------------|--------------|---------------|---------------|
| | | | | Inferior % | Alvo % | Superior % | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " | 100,00% | 43.597.725,19 | 52,76% | 15,00% | 25,00% | 70,00% | 14.247.615,62 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 60,00% | 0,00 | 0,00% | 5,00% | 10,00% | 60,00% | 49.581.720,70 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " | 40,00% | 26.746.342,99 | 32,37% | 5,00% | 10,00% | 30,00% | -1.955.482,64 |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a " | 15,00% | 0,00 | 0,00% | 7,00% | 15,00% | 15,00% | 12.395.430,17 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a " | 5,00% | 2.042.145,34 | 2,47% | 2,00% | 5,00% | 5,00% | 2.089.664,72 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b " | 5,00% | 955.380,30 | 1,16% | 2,00% | 5,00% | 5,00% | 3.176.429,76 |
| Total Renda Fixa | 100,00% | 73.341.593,82 | 88,75% | 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% | 0,00 | 0,00% | 2,00% | 5,00% | 10,00% | 8.263.620,12 |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " | 20,00% | 2.227.228,51 | 2,70% | 2,00% | 5,00% | 10,00% | 6.036.391,61 |
| Artigo 8º, Inciso III | 10,00% | 915.092,09 | 1,11% | 7,00% | 10,00% | 10,00% | 7.348.528,03 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a " | 5,00% | 3.052.821,52 | 3,69% | 2,00% | 5,00% | 5,00% | 1.078.988,54 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b " | 5,00% | 3.099.465,22 | 3,75% | 2,00% | 5,00% | 5,00% | 1.032.344,84 |
| Total Renda Variável | 30,00% | 9.294.607,34 | 11,25% | 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 " | 43.597.725,19 | 52,76% | 15,00% | 70,00% |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 0,00 | 0,00% | 5,00% | 60,00% |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " | 26.746.342,99 | 32,37% | 5,00% | 30,00% |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a " | 0,00 | 0,00% | 7,00% | 15,00% |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a " | 2.042.145,34 | 2,47% | 2,00% | 5,00% |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b " | 955.380,30 | 1,16% | 2,00% | 5,00% |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c " | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% |
| Total Renda Fixa | 73.341.593,82 | 88,75% | 36,00 | 190,00 |

| Artigos - Renda Variável | Base: setembro / 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 " | 2.227.228,51 | 2,70% | 2,00% | 10,00% |
| Artigo 8º, Inciso III | 915.092,09 | 1,11% | 7,00% | 10,00% |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a " | 3.052.821,52 | 3,69% | 2,00% | 5,00% |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b " | 3.099.465,22 | 3,75% | 2,00% | 5,00% |
| Total Renda Variável | 9.294.607,34 | 11,25% | 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 |
|-------------------------------------|---------------|---------------|----------------|
| BRADESCO ASSET MANAGEMENT | 25.770.929,59 | 31,19% | 0,00% |
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | 25.727.988,10 | 31,13% | 0,01% |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 19.557.802,12 | 23,67% | 0,00% |
| AQ3 ASSET MANAGEMENT | 3.099.465,22 | 3,75% | 6,65% |
| ROMA ASSET | 3.052.821,52 | 3,69% | 1,04% |
| FINAXIS CORRETORA | 2.033.823,10 | 2,46% | 2,14% |
| VINCI PARTNERS | 1.309.878,10 | 1,59% | 0,01% |
| Única Administradora | 1.119.790,86 | 1,36% | 0,10% |
| SECURITY ADMINISTRADORA DE RECURSOS | 955.380,30 | 1,16% | 8,35% |
| BRASIL PLURAL | 8.322,25 | 0,01% | 0,00% |

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 |
|---|--------|---------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| IRF-M 1+ | 1,57% | 3,98% | 1,88% | -0,49% | 5,33% | 25,58% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,42% | 3,72% | 1,68% | -0,92% | 4,85% | 24,68% | 0,20% | 2,047% | 4,32% |
| 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% |
| IDKA PRÉ 2 ANOS | 1,21% | 5,38% | 1,94% | 1,51% | 7,62% | 27,36% | - | - | - |
| BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA | 1,14% | 5,06% | 1,71% | 1,22% | 7,17% | 26,20% | 0,20% | 1,496% | 3,10% |
| IMA-B 5 | 0,89% | 4,98% | 2,11% | 1,40% | 6,53% | 20,86% | - | - | - |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5 | 0,86% | 4,67% | 2,03% | 1,05% | 6,06% | 20,57% | 0,20% | 1,255% | 3,04% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,86% | 4,79% | 2,05% | 1,27% | 6,28% | 20,38% | 0,20% | 1,241% | 2,90% |
| TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5 | 0,30% | -11,01% | 1,64% | -13,31% | -7,93% | -0,40% | 0,70% | 0,816% | 8,54% |
| TOWER BRIDGE RENDA FIXA FI IMA-B 5 | 0,20% | -19,57% | -10,99% | -22,38% | -20,99% | -13,30% | 0,70% | 0,541% | 14,92% |
| 101,50% do IPCA + 5,75% ao ano | 0,79% | 6,51% | 1,76% | 4,74% | 8,79% | 16,07% | - | - | - |
| PREMIUM FIDC SÊNIOR | -0,23% | -6,19% | -0,99% | -3,47% | -5,29% | -12,97% | 0,15% | 0,073% | 3,42% |
| CDI + 3,50% ao ano | 0,73% | 7,53% | 2,48% | 4,98% | 10,34% | 27,33% | - | - | - |
| MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR | -2,27% | -64,76% | -13,85% | -17,59% | -12,76% | -82,53% | 0,20% | 23,029% | 205,60% |
| IRF-M 1 | 0,61% | 4,85% | 1,72% | 2,99% | 6,75% | 20,26% | - | - | - |

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 |
|--|--------|-------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,62% | 4,65% | 1,66% | 2,85% | 6,51% | 19,76% | 0,20% | 0,160% | 0,53% |
| 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% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA | 0,66% | 4,24% | 1,75% | 1,35% | 5,79% | - | 0,002 | 0,548% | 1,69% |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 0,50% | 3,72% | 1,50% | 0,30% | - | - | 0,40% | 0,980% | - |
| Selic | 0,47% | 4,82% | 1,59% | 3,18% | 6,66% | 18,97% | - | - | - |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 0,47% | 4,74% | 1,56% | 3,10% | 6,58% | 19,58% | 0,20% | 0,007% | 0,04% |
| 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 MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,43% | 4,63% | 1,52% | 3,05% | 6,43% | 18,72% | 0,25% | 0,034% | 0,04% |
| SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP | 0,21% | 2,21% | 0,75% | 1,46% | 3,06% | 8,51% | 1,00% | 0,032% | 0,07% |
| IMA-B 5+ | -1,03% | 0,83% | 1,55% | -4,82% | -0,82% | 16,33% | - | - | - |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | -1,03% | 0,69% | 1,48% | -4,85% | -1,01% | 15,46% | 0,20% | 2,521% | 6,89% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | -1,04% | 0,71% | 1,47% | -4,85% | -1,00% | 15,83% | 0,20% | 2,515% | 6,87% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA | -1,05% | 0,69% | 1,47% | -4,84% | -1,03% | 15,73% | 0,20% | 2,532% | 6,90% |

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

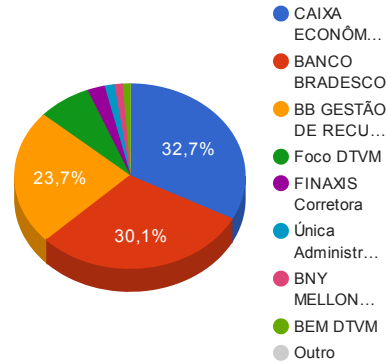
| | Mês | Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|--|--------|-------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| IMA-B | -0,15% | 2,88% | 1,71% | -1,96% | 2,55% | 18,72% | - | - | - |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | -0,16% | 2,71% | 1,66% | -2,06% | 2,32% | 18,15% | 0,20% | 1,875% | 4,86% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA | -0,22% | 2,33% | 1,46% | -2,50% | 1,93% | 18,39% | 0,20% | 1,939% | 5,10% |

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

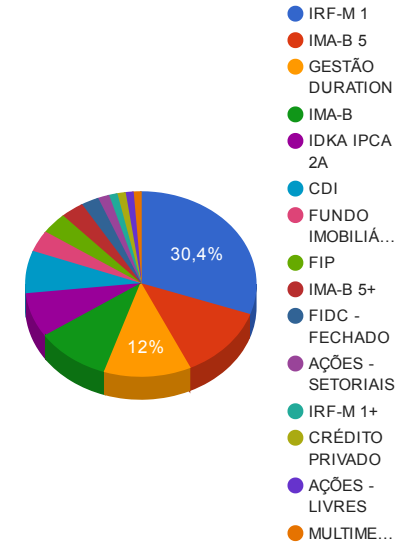
| | Mês | Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|--|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| Ibovespa | 3,48% | 3,85% | 9,04% | -7,06% | 6,80% | 35,94% | - | - | - |
| BRADESCO SELECTION FIAÇÕES | 4,25% | 11,45% | 9,58% | -4,84% | 14,49% | 50,30% | 1,50% | 8,916% | 20,00% |
| IPCA + 8,00% ao ano | 1,06% | 9,45% | 2,71% | 6,68% | 12,78% | 24,82% | - | - | - |
| ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP | 5,40% | 81,34% | 17,92% | 42,38% | -102,64% | -100,55% | 0,12% | 9,577% | 102,33% |
| CDI | 0,47% | 4,81% | 1,59% | 3,17% | 6,65% | 18,95% | - | - | - |
| BRADESCO PLUS I FI MULTIMERCADO | 0,50% | 4,22% | 1,46% | 2,33% | 5,92% | 18,93% | 0,50% | 0,200% | 0,51% |
| IDIV | 0,17% | -3,63% | 3,48% | -12,68% | -5,33% | 34,44% | - | - | - |
| CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES | -1,51% | -9,66% | 0,59% | -15,37% | -8,54% | 7,63% | 1,72% | 7,085% | 16,83% |
| IFIX | -0,21% | -4,12% | 0,45% | -9,45% | -3,88% | 17,55% | - | - | - |
| ÁQUILLA FII - AQLL11 | 13,80% | -5,88% | -1,23% | -24,53% | -10,96% | -46,67% | 1,50% | 16,019% | 38,53% |
| Não definido | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11 | - | - | - | - | - | - | 0,30% | - | - |

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

| Administrador | Valor | % |
|---------------------------------|---------------|--------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | 27.037.866,20 | 32,72% |
| BANCO BRADESCO | 24.853.579,18 | 30,08% |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 19.557.802,12 | 23,67% |
| Foco DTVM | 6.152.286,74 | 7,45% |
| FINAXIS Corretora | 2.033.823,10 | 2,46% |
| Única Administradora | 1.119.790,87 | 1,36% |
| BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS | 955.380,30 | 1,16% |
| BEM DTVM | 917.350,41 | 1,11% |
| Geração Futuro | 8.322,24 | 0,01% |



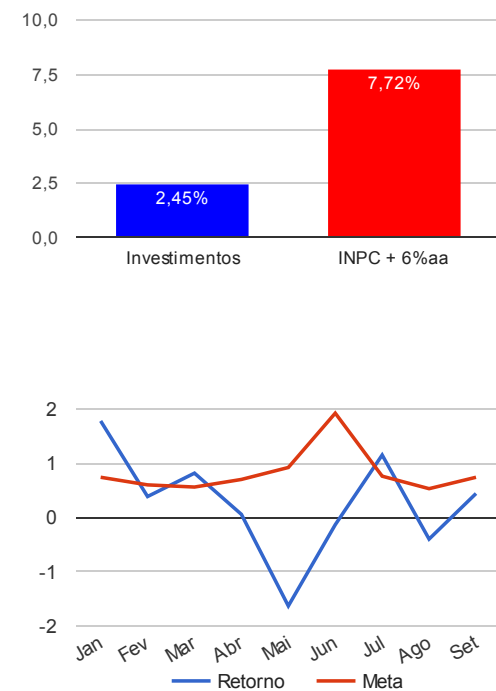
| Sub-segmento | Valor | % |
|-------------------|---------------|--------|
| IRF-M 1 | 25.126.835,55 | 30,41% |
| IMA-B 5 | 10.449.627,79 | 12,65% |
| GESTÃO DURATION | 9.928.924,53 | 12,02% |
| IMA-B | 8.617.406,93 | 10,43% |
| IDKA IPCA 2A | 6.413.743,96 | 7,76% |
| CDI | 6.140.406,22 | 7,43% |
| FUNDO IMOBILIÁRIO | 3.099.465,22 | 3,75% |
| FIP | 3.052.821,52 | 3,69% |
| IMA-B 5+ | 2.693.808,14 | 3,26% |
| FIDC - FECHADO | 2.042.145,34 | 2,47% |
| AÇÕES - SETORIAIS | 1.309.878,10 | 1,59% |
| IRF-M 1+ | 973.315,06 | 1,18% |
| CRÉDITO PRIVADO | 955.380,30 | 1,16% |
| AÇÕES - LIVRES | 917.350,41 | 1,11% |
| MULTIMERCADO | 915.092,09 | 1,11% |



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

| Mês | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (\$) | Retorno (%) | Meta (%) | Gap (%) | VaR (%) |
|------------------|----------------|---------------|---------------|---------------|---------------|-------------|----------|----------|---------|
| Janeiro | 79.252.010,83 | 2.135.008,78 | 1.491.073,39 | 81.315.309,08 | 1.419.362,86 | 1,78% | 0,74% | 239,69% | 1,06% |
| Fevereiro | 81.315.309,08 | 577.688,15 | 782.665,89 | 81.423.749,70 | 313.418,36 | 0,39% | 0,60% | 64,47% | 1,22% |
| Março | 81.423.749,70 | 1.614.103,74 | 1.472.876,12 | 82.230.439,61 | 665.462,29 | 0,82% | 0,56% | 146,45% | 2,59% |
| Abril | 82.230.439,61 | 897.312,32 | 1.469.709,20 | 81.705.047,90 | 47.005,17 | 0,06% | 0,70% | 8,19% | 0,93% |
| Mai | 81.705.047,90 | 1.088.968,72 | 4.063.275,52 | 77.400.356,20 | -1.330.384,90 | -1,63% | 0,92% | -177,21% | 1,57% |
| Junho | 77.400.356,20 | 247.792,32 | 2.061.462,70 | 75.483.726,33 | -102.959,49 | -0,13% | 1,92% | -6,91% | 3,97% |
| Julho | 75.483.726,33 | 10.347.479,58 | 9.338.328,03 | 77.372.170,17 | 879.292,29 | 1,15% | 0,76% | 151,00% | 1,14% |
| Agosto | 77.372.170,17 | 1.118.251,31 | 1.501.455,44 | 76.681.323,07 | -307.642,97 | -0,40% | 0,53% | -74,57% | 2,40% |
| Setembro | 76.681.323,07 | 13.143.573,35 | 13.152.279,16 | 77.010.587,03 | 337.969,77 | 0,44% | 0,74% | 59,43% | 1,53% |
| Acumulado no ano | | | | | 1.921.523,38 | 2,45% | 7,72% | 31,80% | |

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 IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 959.670,49 | 0,00 | 0,00 | 973.315,06 | 13.644,57 | 1,42% | 2,05% | 1,42% |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2.230.519,35 | 0,00 | 0,00 | 2.256.644,38 | 26.125,03 | 1,17% | 0,88% | 1,17% |
| BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA | 280.965,57 | 0,00 | 0,00 | 284.159,90 | 3.194,33 | 1,14% | 1,50% | 1,14% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 4.582.032,82 | 0,00 | 760.624,86 | 3.872.939,68 | 51.531,72 | 1,12% | 0,88% | 1,15% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,00 | 756.271,97 | 0,00 | 764.156,80 | 7.884,83 | 1,04% | 1,24% | 0,86% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5 | 7.736.870,51 | 756.271,97 | 0,00 | 8.565.680,13 | 72.537,65 | 0,85% | 1,26% | 0,86% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA | 0,00 | 6.396.547,21 | 0,00 | 6.449.656,38 | 53.109,17 | 0,83% | 0,55% | 0,66% |
| BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 10.974.369,08 | 0,00 | 801.007,62 | 10.240.121,63 | 66.760,17 | 0,61% | 0,16% | 0,62% |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 0,00 | 3.458.422,40 | 0,00 | 3.479.268,15 | 20.845,75 | 0,60% | 0,98% | 0,50% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 4.537.263,12 | 0,00 | 0,00 | 4.564.040,35 | 26.777,23 | 0,59% | 0,16% | 0,59% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 10.262.257,43 | 0,00 | 0,00 | 10.322.673,57 | 60.416,14 | 0,59% | 0,15% | 0,59% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP | 3.553.083,12 | 0,00 | 0,00 | 3.570.548,82 | 17.465,70 | 0,49% | 0,05% | 0,49% |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 375.967,20 | 0,00 | 0,00 | 377.716,04 | 1.748,84 | 0,47% | 0,01% | 0,47% |
| CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 2.182.707,29 | 0,00 | 0,00 | 2.192.141,36 | 9.434,07 | 0,43% | 0,03% | 0,43% |
| TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5 | 266.524,17 | 0,00 | 0,00 | 267.315,27 | 791,10 | 0,30% | 0,82% | 0,30% |
| SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP | 953.410,13 | 0,00 | 0,00 | 955.380,30 | 1.970,17 | 0,21% | 0,03% | 0,21% |
| TOWER BRIDGE RENDA FIXA FI IMA-B 5 | 850.751,86 | 0,00 | 0,00 | 852.475,59 | 1.723,73 | 0,20% | 0,54% | 0,20% |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 8.626.491,99 | 0,00 | 0,00 | 8.612.551,53 | -13.940,46 | -0,16% | 1,87% | -0,16% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA | 4.866,29 | 0,00 | 0,00 | 4.855,40 | -10,89 | -0,22% | 1,94% | -0,22% |
| PREMIUM FIDC SÊNIOR | 2.038.491,75 | 0,00 | 0,00 | 2.033.823,10 | -4.668,65 | -0,23% | 0,07% | -0,23% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 6.424.465,08 | 0,00 | 6.396.547,21 | 0,00 | -27.917,87 | -0,43% | 1,89% | -0,18% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA | 5.277.045,69 | 0,00 | 5.234.482,23 | 0,00 | -42.563,46 | -0,81% | 1,88% | -0,18% |

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(%) |
|---|---------------|------------|-----------|--------------|-------------------|--------------|---------------|----------------|
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 559.757,35 | 0,00 | 0,00 | 554.017,04 | -5.740,31 | -1,03% | 2,52% | -1,03% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1.205.953,07 | 0,00 | 40.382,76 | 1.153.105,25 | -12.465,06 | -1,03% | 2,51% | -1,04% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA | 997.165,04 | 0,00 | 0,00 | 986.685,85 | -10.479,19 | -1,05% | 2,53% | -1,05% |
| MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR | 8.515,28 | 0,00 | 0,00 | 8.322,24 | -193,04 | -2,27% | 23,03% | -2,27% |
| Total Renda Fixa | | | | | 317.981,27 | 0,42% | 0,75% | |

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(%) |
|--|---------------|------------|----------|--------------|---------------|-------------|---------------|----------------|
| BRADESCO SELECTION FI AÇÕES | 0,00 | 864.213,00 | 0,00 | 917.350,41 | 53.137,41 | 6,15% | 8,92% | 4,25% |
| BRADESCO PLUS I FI MULTIMERCADO | 0,00 | 911.846,80 | 0,00 | 915.092,08 | 3.245,28 | 0,36% | 0,20% | 0,50% |
| ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP | 0,01 | 0,00 | 0,00 | 0,01 | 0,00 | 0,00% | 9,58% | 5,40% |
| CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11 | 3.053.603,21 | 0,00 | 0,00 | 3.052.821,52 | -781,69 | -0,03% | - | - |
| ÁQUILLA FII - AQLL11 | 3.104.433,51 | 0,00 | 0,00 | 3.099.465,22 | -4.968,29 | -0,16% | 16,02% | 13,80% |
| CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES | 1.330.005,77 | 0,00 | 0,00 | 1.309.878,10 | -20.127,67 | -1,51% | 7,09% | -1,51% |
| Total Renda Variável | | | | | 30.505,04 | 0,33% | 10,78% | |

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 (%) |
|--|---------------|---------------|--------------|---------------|---------------|-------------|-----------------|
| BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,00 | 10.935.264,30 | 863.845,74 | 10.240.121,63 | 168.703,07 | 1,58% | 1,66% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 8.353.586,09 | 1.806.910,87 | 0,00 | 10.322.673,57 | 162.176,61 | 1,63% | 1,69% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5 | 7.648.081,67 | 756.271,97 | 0,00 | 8.565.680,13 | 161.326,49 | 2,02% | 2,03% |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 8.472.220,84 | 0,00 | 0,00 | 8.612.551,53 | 140.330,69 | 1,66% | 1,66% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 7.769.882,57 | 0,00 | 7.890.484,37 | 0,00 | 120.601,80 | 1,43% | 1,64% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 4.527.941,49 | 0,00 | 760.624,86 | 3.872.939,68 | 105.623,05 | 2,33% | 2,36% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA | 6.643.623,29 | 0,00 | 6.728.419,39 | 0,00 | 84.796,10 | 1,05% | 1,61% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 4.489.067,66 | 0,00 | 0,00 | 4.564.040,35 | 74.972,69 | 1,67% | 1,67% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP | 3.515.218,66 | 0,00 | 0,00 | 3.570.548,82 | 55.330,16 | 1,57% | 1,57% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA | 0,00 | 6.396.547,21 | 0,00 | 6.449.656,38 | 53.109,17 | 0,83% | 1,75% |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2.205.031,58 | 0,00 | 0,00 | 2.256.644,38 | 51.612,80 | 2,34% | 2,34% |
| CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 2.159.286,55 | 0,00 | 0,00 | 2.192.141,36 | 32.854,81 | 1,52% | 1,52% |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 0,00 | 3.458.422,40 | 0,00 | 3.479.268,15 | 20.845,75 | 0,60% | 1,50% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1.271.499,25 | 0,00 | 138.701,12 | 1.153.105,25 | 20.307,12 | 1,50% | 1,47% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 957.208,86 | 0,00 | 0,00 | 973.315,06 | 16.106,20 | 1,68% | 1,68% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA | 1.006.765,87 | 0,00 | 35.480,24 | 986.685,85 | 15.400,22 | 1,47% | 1,47% |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 545.941,98 | 0,00 | 0,00 | 554.017,04 | 8.075,06 | 1,48% | 1,48% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,00 | 756.271,97 | 0,00 | 764.156,80 | 7.884,83 | 1,04% | 2,05% |
| SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP | 948.282,21 | 0,00 | 0,00 | 955.380,30 | 7.098,09 | 0,75% | 0,75% |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 371.923,96 | 0,00 | 0,00 | 377.716,04 | 5.792,08 | 1,56% | 1,56% |
| BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA | 279.390,42 | 0,00 | 0,00 | 284.159,90 | 4.769,48 | 1,71% | 1,71% |
| TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5 | 263.012,56 | 0,00 | 0,00 | 267.315,27 | 4.302,71 | 1,64% | 1,64% |

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 (%) |
|---|---------------|------------|--------------|-------------------------|---------------------|--------------|-----------------|
| BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA | 9.126.446,90 | 0,00 | 9.128.353,43 | 0,00 | 1.906,53 | 0,02% | - |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA | 4.785,55 | 0,00 | 0,00 | 4.855,40 | 69,85 | 1,46% | 1,46% |
| MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR | 9.660,67 | 0,00 | 0,00 | 8.322,24 | -1.338,43 | -13,85% | -13,85% |
| PREMIUM FIDC SÊNIOR | 2.054.242,74 | 0,00 | 0,00 | 2.033.823,10 | -20.419,64 | -0,99% | -0,99% |
| TOWER BRIDGE RENDA FIXA FI IMA-B 5 | 957.707,46 | 0,00 | 0,00 | 852.475,59 | -105.231,87 | -10,99% | -10,99% |
| | | | | Total Renda Fixa | 1.197.005,42 | 1,61% | |

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 (%) |
|--|---------------|------------|----------|--------------|---------------|-------------|-----------------|
| BRADESCO SELECTION FI AÇÕES | 0,00 | 864.213,00 | 0,00 | 917.350,41 | 53.137,41 | 6,15% | 9,58% |
| CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES | 1.302.193,58 | 0,00 | 0,00 | 1.309.878,10 | 7.684,52 | 0,59% | 0,59% |
| BRADESCO PLUS I FI MULTIMERCADO | 0,00 | 911.846,80 | 0,00 | 915.092,08 | 3.245,28 | 0,36% | 1,46% |
| ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP | 0,01 | 0,00 | 0,00 | 0,01 | 0,00 | 0,00% | 17,92% |
| CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11 | 3.055.976,30 | 0,00 | 0,00 | 3.052.821,52 | -3.154,78 | -0,10% | - |
| ÁQUILLA FII - AQLL11 | 3.346.702,59 | 0,00 | 0,00 | 3.099.465,22 | -247.237,37 | -7,39% | -1,23% |
| Total Renda Variável | | | | | -186.324,94 | -2,49% | |