

# Relatório Analítico dos Investimentos em março e 1º Trimestre de 2018

Carteira consolidada de investimentos - base (março / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	1.321.240,00	1,38%	26	0,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	422.641,78	0,44%	62	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.922.552,87	4,09%	65	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.119.400,99	8,47%	753	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.506.796,87	2,62%	343	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	8.613.005,30	8,99%	1.417	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	17/08/2020	2.101.012,50	2,19%	20	3,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	195.671,36	0,20%	732	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	86.656,29	0,09%	590	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.439.571,11	3,59%	1.219	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.707.257,32	4,91%	639	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.082.626,56	2,17%	729	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	339.407,05	0,35%	232	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	10.173.766,01	10,62%	177	0,78%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	1.847.266,62	1,93%	67	1,68%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	4.645.064,97	4,85%	722	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.891.072,36	5,10%	307	0,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.690.730,40	2,81%	481	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	982.844,27	1,03%	129	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	66.594,09	0,07%	98	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY IMA-B 5+ TIGER FI RENDA FIXA	D+1	Não há	0,01	0,00%	19	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	3.302.265,11	3,45%	83	0,67%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "

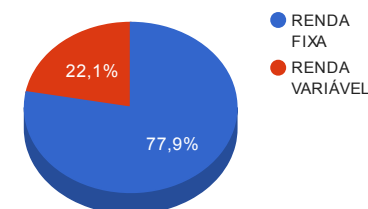
Carteira consolidada de investimentos - base (março / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	7.419.204,48	7,74%	734	0,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	708.334,00	0,74%	100	0,31%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	1.838.536,42	1,92%	110	0,72%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.317.957,12	2,42%	5.424	1,61%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.335.383,84	2,44%	1.156	0,16%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FI AÇÕES	D+24	Não há	3.356.504,17	3,50%	79	0,66%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	2.898.313,00	3,02%	3.352	0,43%	Artigo 8º, Inciso III
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.141.119,67	3,28%	60	3,04%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	2.962.572,93	3,09%	43	3,78%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	2.320.000,00	2,42%		1,27%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	Término do fundo	Não há	80.312,10	0,08%	750	0,63%	Desenquadrado - RF
<b>TOTAL -</b>			<b>95.835.681,57</b>				

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

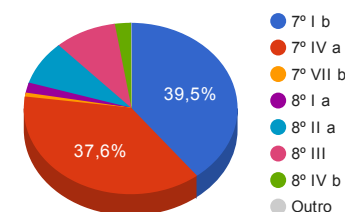
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	37.857.840,00	39,50%	15,00%	25,00%	70,00%	29.227.137,10
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	57.501.408,94
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	36.018.808,32	37,58%	5,00%	10,00%	30,00%	-7.268.103,85
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	7,00%	15,00%	15,00%	14.375.352,24
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.791.784,08
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	708.334,00	0,74%	2,00%	5,00%	5,00%	4.083.450,08
Desenquadrado - RF	0,00%	80.312,10	0,08%	0,00%	0,00%	0,00%	-80.312,10
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>74.665.294,42</b>	<b>77,91%</b>	<b>36,00</b>	<b>70,00</b>	<b>190,00</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%	1.838.536,42	1,92%	2,00%	5,00%	10,00%	7.745.031,74
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	8.009.845,13	8,36%	2,00%	5,00%	10,00%	1.573.723,03
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	9.002.005,60	9,39%	7,00%	10,00%	10,00%	581.562,56
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.791.784,08
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	2.320.000,00	2,42%	2,00%	5,00%	5,00%	2.471.784,08
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>21.170.387,15</b>	<b>22,09%</b>	<b>15,00</b>	<b>30,00</b>	<b>40,00</b>	<b>-</b>

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: março / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	37.857.840,00	39,50%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	36.018.808,32	37,58%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	708.334,00	0,74%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	80.312,10	0,08%	0,00%	0,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>74.665.294,42</b>	<b>77,91%</b>	<b>36,00</b>	<b>190,00</b>

Artigos - Renda Variável	Base: março / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	1.838.536,42	1,92%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	8.009.845,13	8,36%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	9.002.005,60	9,39%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	2.320.000,00	2,42%	2,00%	5,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>21.170.387,15</b>	<b>22,09%</b>	<b>15,00</b>	<b>40,00</b>

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (março / 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	55.427.296,93	57,84%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	15.297.596,78	15,96%	0,00%
ITAÚ UNIBANCO	11.647.116,02	12,15%	0,00%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	8.394.973,44	8,76%	0,00%
INFINITY ASSET MANAGEMENT	4.988.386,30	5,21%	1,08%
MACROINVEST GESTÃO DE RECURSOS	80.312,10	0,08%	0,17%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5	1,62%	3,53%	3,53%	5,06%	11,97%	27,76%	-	-	-
BRASESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1,65%	3,58%	3,58%	4,96%	11,89%	27,81%	0,20%	1,111%	3,72%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,60%	3,48%	3,48%	4,95%	11,77%	27,29%	0,20%	1,064%	3,48%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	1,58%	3,42%	3,42%	4,85%	11,53%	26,76%	0,40%	1,063%	3,48%
IDKA IPCA 2 Anos	1,59%	3,01%	3,01%	5,31%	12,41%	28,22%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,52%	3,06%	3,06%	4,97%	11,52%	26,84%	0,20%	0,980%	2,67%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,48%	3,03%	3,03%	5,01%	11,50%	26,80%	0,20%	0,939%	2,73%
IRF-M 1+	1,57%	4,50%	4,50%	5,86%	14,14%	41,99%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,54%	4,68%	4,68%	5,82%	13,89%	41,70%	0,20%	0,966%	5,82%
IRF-M	1,32%	3,77%	3,77%	5,26%	12,87%	36,62%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,30%	3,89%	3,89%	5,21%	12,64%	36,34%	0,20%	0,732%	4,47%
IMA-B	0,94%	4,94%	4,94%	4,60%	10,73%	34,61%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,19%	3,16%	3,16%	2,76%	7,10%	21,20%	0,20%	1,535%	7,59%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,63%	0,72%	0,72%	2,33%	6,17%	15,97%	0,20%	1,089%	5,13%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,92%	4,89%	4,89%	4,47%	10,50%	34,14%	0,20%	1,454%	9,05%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	0,91%	4,86%	4,86%	4,53%	10,38%	33,87%	0,20%	1,427%	8,65%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,90%	4,86%	4,86%	4,47%	10,44%	33,99%	0,20%	1,448%	9,05%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	0,66%	1,80%	1,80%	3,65%	9,34%	24,73%	-	-	-
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,65%	1,75%	1,75%	3,56%	9,14%	24,30%	0,20%	0,133%	0,66%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,64%	1,74%	1,74%	3,54%	9,14%	24,11%	0,20%	0,124%	0,64%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,64%	1,75%	1,75%	3,57%	9,16%	24,36%	0,20%	0,127%	0,64%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,63%	1,75%	1,75%	3,55%	9,11%	24,19%	0,10%	0,128%	0,65%
Selic	0,53%	1,59%	1,59%	3,38%	8,40%	23,33%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,52%	1,60%	1,60%	3,37%	8,80%	24,09%	0,20%	0,003%	0,14%
CDI	0,53%	1,59%	1,59%	3,37%	8,39%	23,30%	-	-	-
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	0,58%	1,89%	1,89%	3,75%	9,52%	26,36%	0,75%	0,248%	8,44%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,54%	1,59%	1,59%	3,45%	8,48%	23,44%	0,20%	0,010%	0,11%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	0,52%	1,55%	1,55%	3,31%	8,29%	23,29%	0,18%	0,004%	0,10%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,51%	1,53%	1,53%	3,30%	8,32%	23,24%	0,20%	0,007%	0,11%
IMA-B 5+	0,38%	5,94%	5,94%	4,21%	10,24%	38,98%	-	-	-
INFINITY IMA-B 5+ TIGER FI RENDA FIXA	0,86%	4,47%	4,47%	5,39%	14,83%	71,30%	0,50%	0,926%	4,96%
IPCA	0,09%	0,70%	0,70%	1,85%	2,68%	7,37%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1,18%	2,85%	2,85%	4,39%	9,77%	-	0,002	0,711%	4,16%



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

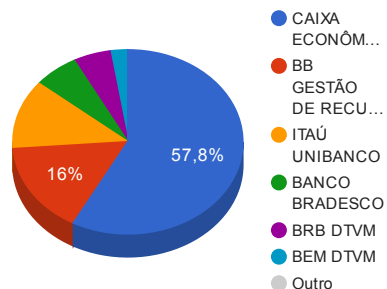
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,59%	2,01%	2,01%	3,60%	8,23%	21,39%	0,20%	0,047%	1,23%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,64%	4,89%	4,89%	5,24%	-6,37%	59,58%	2,00%	0,207%	18,28%

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

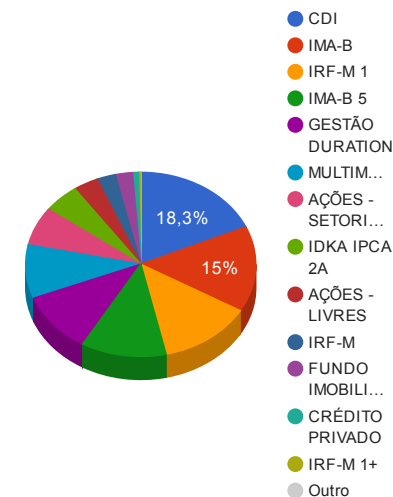
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	2,00%	5,89%	5,89%	6,15%	15,97%	58,68%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1,93%	8,41%	8,41%	5,46%	10,48%	41,47%	1,20%	7,884%	22,00%
IFNC	1,73%	20,67%	20,67%	19,17%	34,84%	79,64%	-	-	-
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	1,63%	20,14%	20,14%	18,23%	32,55%	74,70%	1,00%	6,412%	22,74%
IDIV	1,05%	10,36%	10,36%	8,41%	21,26%	88,12%	-	-	-
BRADESCO DIVIDENDOS FIAÇÕES	1,70%	15,08%	15,08%	17,61%	30,21%	78,44%	1,50%	5,787%	18,50%
CDI	0,53%	1,59%	1,59%	3,37%	8,39%	23,30%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	0,70%	1,77%	1,77%	3,42%	7,54%	22,57%	0,35%	0,230%	0,84%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,62%	1,76%	1,76%	3,64%	9,45%	27,59%	1,00%	0,124%	4,66%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,44%	1,25%	1,25%	2,97%	7,81%	23,14%	0,70%	0,065%	0,60%
Ibovespa	0,01%	11,73%	11,73%	14,90%	31,36%	70,54%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIAÇÕES	1,83%	11,79%	11,79%	13,10%	31,89%	-	2,50%	6,223%	17,44%
IGC	-1,02%	6,76%	6,76%	8,38%	26,52%	60,19%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FIAÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-1,01%	6,65%	6,65%	8,01%	25,62%	58,17%	1,00%	5,869%	17,55%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	55.427.296,93	57,84%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	15.297.596,78	15,96%
ITAÚ UNIBANCO	11.647.116,02	12,15%
BANCO BRADESCO	6.059.589,60	6,32%
BRB DTVM	4.988.386,30	5,21%
BEM DTVM	2.335.383,84	2,44%
ICLA Trust	80.312,10	0,08%



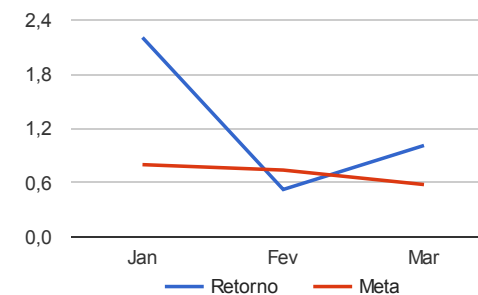
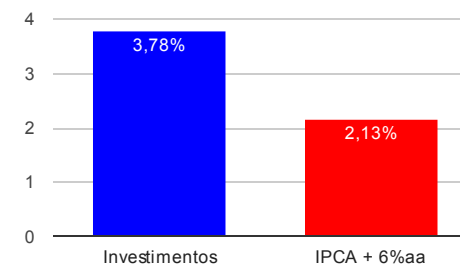
Sub-segmento	Valor	%
CDI	17.585.110,74	18,35%
IMA-B	14.418.369,64	15,04%
IRF-M 1	12.541.812,28	13,09%
IMA-B 5	11.408.457,04	11,90%
GESTÃO DURATION	10.173.766,01	10,62%
MULTIMERCADO	9.002.005,60	9,39%
AÇÕES - SETORIAIS	6.491.877,38	6,77%
IDKA IPCA 2A	4.902.928,68	5,12%
AÇÕES - LIVRES	3.356.504,17	3,50%
IRF-M	2.506.796,87	2,62%
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.320.000,00	2,42%
CRÉDITO PRIVADO	788.646,10	0,82%
IRF-M 1+	339.407,05	0,35%
IMA-B 5+	0,01	0,00%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	90.709.916,42	14.666.421,45	14.203.028,25	93.182.708,73	2.009.399,11	2,20%	0,80%	274,99%	1,59%
Fevereiro	93.182.708,73	2.588.930,81	2.361.161,19	93.901.609,06	491.130,71	0,53%	0,74%	71,20%	1,99%
Março	93.901.609,06	1.542.391,06	568.253,17	95.835.681,57	959.934,62	1,01%	0,58%	175,29%	1,35%
Acumulado no ano					3.460.464,44	3,78%	2,13%	177,34%	

**Acumulado no Ano**



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.292.943,00	0,00	0,00	1.321.240,00	28.297,00	2,19%	1,53%	2,19%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	3.248.628,22	0,00	0,00	3.302.265,11	53.636,89	1,65%	1,11%	1,65%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.067.280,50	0,00	0,00	2.101.012,50	33.732,00	1,63%	1,09%	1,63%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.049.837,78	0,00	0,00	2.082.626,56	32.788,78	1,60%	1,06%	1,60%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	3.861.418,59	0,00	0,00	3.922.552,87	61.134,28	1,58%	1,06%	1,58%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	334.262,28	0,00	0,00	339.407,05	5.144,77	1,54%	0,97%	1,54%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	183.894,76	8.955,59	0,00	195.671,36	2.821,01	1,46%	0,94%	1,48%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.494.562,17	1.146.508,33	0,00	4.707.257,32	66.186,82	1,43%	0,98%	1,52%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.474.673,16	0,00	0,00	2.506.796,87	32.123,71	1,30%	0,73%	1,30%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	9.669.765,56	386.927,14	0,00	10.173.766,01	117.073,31	1,16%	0,71%	1,18%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.045.669,58	0,00	0,00	8.119.400,99	73.731,41	0,92%	1,45%	0,92%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	4.846.979,15	0,00	0,00	4.891.072,36	44.093,21	0,91%	1,43%	0,91%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	85.885,66	0,00	0,00	86.656,29	770,63	0,90%	1,45%	0,90%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	66.164,50	0,00	0,00	66.594,09	429,59	0,65%	0,13%	0,65%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	419.942,83	0,00	0,00	422.641,78	2.698,95	0,64%	0,12%	0,64%
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	79.800,75	0,00	0,00	80.312,10	511,35	0,64%	0,21%	0,64%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.558.304,72	0,00	0,00	8.613.005,30	54.700,58	0,64%	0,13%	0,64%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.417.908,41	0,00	0,00	3.439.571,11	21.662,70	0,63%	0,13%	0,63%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	704.159,00	0,00	0,00	708.334,00	4.175,00	0,59%	0,05%	0,59%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	1.836.526,80	0,00	0,00	1.847.266,62	10.739,82	0,58%	0,25%	0,58%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.457.638,35	0,00	78.507,70	7.419.204,48	40.073,83	0,54%	0,01%	0,54%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.676.742,86	0,00	0,00	2.690.730,40	13.987,54	0,52%	0,00%	0,52%

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	977.781,54	0,00	0,00	982.844,27	5.062,73	0,52%	0,00%	0,52%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.094.908,50	0,00	475.745,47	4.645.064,97	25.901,94	0,51%	0,01%	0,51%
INFINITY IMA-B 5+ TIGER FI RENDA FIXA	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	0,93%	0,86%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>731.477,85</b>	<b>0,99%</b>	<b>0,67%</b>	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.276.000,00	0,00	14.000,00	2.320.000,00	58.000,00	2,55%	7,88%	1,93%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIAÇÕES	3.296.067,05	0,00	0,00	3.356.504,17	60.437,12	1,83%	6,22%	1,83%
BRADESCO DIVIDENDOS FIAÇÕES	2.296.348,20	0,00	0,00	2.335.383,84	39.035,64	1,70%	5,79%	1,70%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	2.280.781,18	0,00	0,00	2.317.957,12	37.175,94	1,63%	6,41%	1,63%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	2.941.976,57	0,00	0,00	2.962.572,93	20.596,36	0,70%	0,23%	0,70%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.121.835,02	0,00	0,00	3.141.119,67	19.284,65	0,62%	0,12%	0,62%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	2.885.630,41	0,00	0,00	2.898.313,00	12.682,59	0,44%	0,07%	0,44%
BB GOVERNANÇA FIAÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1.857.291,95	0,00	0,00	1.838.536,42	-18.755,53	-1,01%	5,87%	-1,01%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>228.456,77</b>	<b>1,09%</b>	<b>3,76%</b>	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre / 2018

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	10.541.862,65	0,00	6.000.000,00	4.891.072,36	349.209,71	4,17%	4,86%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	9.060.847,13	842.836,99	0,00	10.173.766,01	270.081,89	2,84%	2,85%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.872.526,71	6.000.000,00	0,00	8.119.400,99	246.874,28	3,14%	4,89%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.083.144,24	1.146.508,33	7.700.000,00	4.707.257,32	177.604,75	2,84%	3,06%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.774.345,66	694.366,22	0,00	8.613.005,30	144.293,42	1,71%	1,75%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	3.792.655,23	0,00	0,00	3.922.552,87	129.897,64	3,42%	3,42%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	3.188.093,48	0,00	0,00	3.302.265,11	114.171,63	3,58%	3,58%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.588.650,23	1.317.953,72	596.686,16	7.419.204,48	109.286,69	1,52%	1,59%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.413.002,28	0,00	0,00	2.506.796,87	93.794,59	3,89%	3,89%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.578.498,70	379.327,81	1.395.745,47	4.645.064,97	82.983,93	1,50%	1,53%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.280.760,00	0,00	32.962,15	1.321.240,00	73.442,15	5,79%	3,16%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.012.684,09	0,00	0,00	2.082.626,56	69.942,47	3,48%	3,48%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.306.965,08	372.293,89	1.308.334,58	3.439.571,11	68.646,72	1,69%	1,75%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.086.027,50	0,00	53.314,25	2.101.012,50	68.299,25	3,32%	0,72%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.648.448,60	0,00	0,00	2.690.730,40	42.281,80	1,60%	1,60%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	1.812.947,05	0,00	0,00	1.847.266,62	34.319,57	1,89%	1,89%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	967.824,58	0,00	0,00	982.844,27	15.019,69	1,55%	1,55%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	694.349,00	0,00	0,00	708.334,00	13.985,00	2,01%	2,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	329.981,43	0,00	339.407,05	9.425,62	3,51%	4,68%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	415.425,81	0,00	0,00	422.641,78	7.215,97	1,74%	1,74%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	181.126,35	8.955,59	0,00	195.671,36	5.589,42	3,01%	3,03%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	82.636,52	0,00	0,00	86.656,29	4.019,77	4,86%	4,86%



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre / 2018

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	76.571,35	0,00	0,00	80.312,10	3.740,75	4,89%	4,89%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	59.941,94	5.519,34	0,00	66.594,09	1.132,81	1,73%	1,75%
INFINITY IMA-B 5+ TIGER FI RENDA FIXA	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	4,47%
Total Renda Fixa					2.135.259,52	2,85%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre / 2018

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIAÇÕES	2.224.160,67	800.000,00	0,00	3.356.504,17	332.343,50	10,99%	11,79%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	1.210.296,19	800.000,00	0,00	2.317.957,12	307.660,93	15,30%	20,14%
BRADESCO DIVIDENDOS FIAÇÕES	1.277.330,24	800.000,00	0,00	2.335.383,84	258.053,60	12,42%	15,08%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.140.000,00	0,00	45.400,00	2.320.000,00	225.400,00	10,56%	8,41%
BB GOVERNANÇA FIAÇÕES PREVIDENCIÁRIO	961.692,18	800.000,00	0,00	1.838.536,42	76.844,24	4,36%	6,65%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	1.593.171,96	1.500.000,00	0,00	3.141.119,67	47.947,71	1,55%	1,76%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	1.416.497,95	1.500.000,00	0,00	2.962.572,93	46.074,98	1,58%	1,77%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	1.367.433,04	1.500.000,00	0,00	2.898.313,00	30.879,96	1,08%	1,25%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>1.325.204,92</b>	<b>6,67%</b>	