

# 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
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	22.453.912,58	5,61%	346	1,74%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	2.486.308,81	0,62%	192	0,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	12.486.759,32	3,12%	223	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	19.386.867,62	4,84%	590	0,41%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	1.509.410,49	0,38%	18	2,73%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	3.326.669,09	0,83%	52	1,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	22.810.690,90	5,70%	729	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	6.841.281,47	1,71%	72	0,67%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	2.359.396,08	0,59%	107	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	2.035.048,07	0,51%	122	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	15/05/2019	5.880.113,70	1,47%	11	6,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.897.469,89	1,22%	343	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.681.004,79	0,67%	1.005	4,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.208.318,85	1,80%	639	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.302.729,93	0,33%	116	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	6.772.803,69	1,69%	94	1,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	3.394.994,85	0,85%	46	1,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2018	1.972.353,00	0,49%	163	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	3.659.785,24	0,91%	26	1,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+3	Não há	2.057.291,12	0,51%	246	4,79%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.102.049,02	2,27%	203	0,76%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	18/08/2018	10.669.223,49	2,67%	99	0,97%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "

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 TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	15.445.520,49	3,86%	167	1,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	D+2	Não há	4.435.903,49	1,11%	736	4,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	20.253.513,21	5,06%	99	1,34%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	677.415,17	0,17%	1.021	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	11.121.390,90	2,78%	70	15,79%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	11.391.243,22	2,85%	250	2,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	17.796.525,64	4,45%	63	1,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	21.677.309,31	5,42%	107	1,78%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	9.491.617,46	2,37%	1.388	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	22.439.472,24	5,61%	661	1,78%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	24.792.821,45	6,19%	57	2,65%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	2.112.814,18	0,53%	722	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	982.519,85	0,25%	83	0,20%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
WESTERN ASSET CRÉDITO CORPORATIVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+91	Não há	573.279,61	0,14%	2	0,88%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	3.499.920,92	0,87%	60	0,79%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	2.550.002,40	0,64%	100	1,10%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
RIO BRAVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	1.570.920,93	0,39%	4.770	0,39%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.121.852,68	0,28%	7.475	0,14%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	7.525.938,37	1,88%	4.931	1,28%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	8.048.925,74	2,01%	253	1,49%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	20.682.349,93	5,17%	4.799	3,34%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	1.705.172,94	0,43%	43	1,47%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

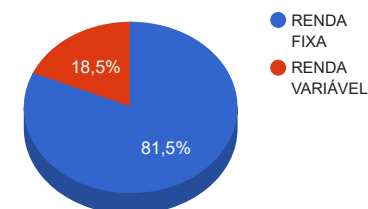
Carteira consolidada de investimentos - base (março / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+33	Não há	6.136.935,01	1,53%	943	7,66%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	D+4	Não há	4.380.013,90	1,09%	16	3,10%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULTIMERCADO	D+2	Não há	1.132.135,86	0,28%	1.248	1,27%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	4.153.438,93	1,04%	21	1,05%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	6.456.134,94	1,61%	13.215	0,54%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	6.342.291,04	1,58%	2.042	0,27%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	3.553.726,04	0,89%	35	1,50%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	1.222.008,41	0,31%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	1.740.000,00	0,43%		0,95%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
<b>TOTAL -</b>			<b>400.307.596,26</b>				

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

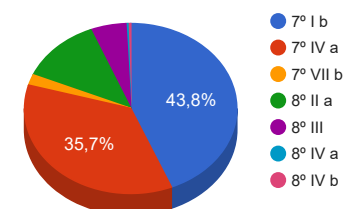
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	175.175.905,98	43,76%	30,00%	45,00%	70,00%	105.039.411,40
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	15,00%	15,00%	60,00%	240.184.557,76
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	142.736.642,63	35,66%	5,00%	10,00%	30,00%	-22.644.363,75
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	7,00%	15,00%	15,00%	60.046.139,44
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	20.015.379,81
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	8.194.123,86	2,05%	2,00%	2,50%	5,00%	11.821.255,95
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>326.106.672,47</b>	<b>81,46%</b>	<b>59,00</b>	<b>89,50</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%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	2,00%	8.006.151,93
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	49.601.188,57	12,39%	5,00%	13,00%	20,00%	30.460.330,68
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	21.637.726,81	5,41%	1,00%	4,00%	5,00%	-1.622.347,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	1.222.008,41	0,31%	1,00%	3,00%	5,00%	18.793.371,40
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	1.740.000,00	0,43%	1,00%	3,00%	5,00%	18.275.379,81
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>74.200.923,79</b>	<b>18,54%</b>	<b>8,00</b>	<b>25,00</b>	<b>37,00</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 "	175.175.905,98	43,76%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	142.736.642,63	35,66%	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%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	8.194.123,86	2,05%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>326.106.672,47</b>	<b>81,46%</b>	<b>59,00</b>	<b>190,00</b>

Artigos - Renda Variável	Base: março / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	2,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	49.601.188,57	12,39%	5,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	21.637.726,81	5,41%	1,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	1.222.008,41	0,31%	1,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	1.740.000,00	0,43%	1,00%	5,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>74.200.923,79</b>	<b>18,54%</b>	<b>8,00</b>	<b>37,00</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
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	92.464.732,14	23,10%	0,01%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	91.773.709,92	22,93%	0,02%
ITAÚ UNIBANCO	56.475.339,55	14,11%	0,00%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	46.028.854,51	11,50%	0,00%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	33.067.382,72	8,26%	0,01%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	32.477.196,84	8,11%	0,05%
WESTERN ASSET	15.640.569,66	3,91%	0,03%
SAFRA ASSET MANAGEMENT	10.495.729,97	2,62%	0,01%
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	8.048.925,74	2,01%	0,02%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	7.525.938,37	1,88%	0,04%
GERAÇÃO FUTURO	2.681.004,79	0,67%	0,02%
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	2.057.291,12	0,51%	0,09%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	1.570.920,93	0,39%	0,11%

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
IDKA IPCA 5 Anos	2,17%	5,35%	5,35%	5,77%	13,54%	34,00%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,05%	4,43%	4,43%	5,41%	12,72%	32,30%	0,20%	1,550%	5,56%

IMA-B 5	1,62%	3,53%	3,53%	5,06%	11,97%	27,76%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1,65%	3,58%	3,58%	4,96%	11,89%	27,81%	0,20%	1,111%	3,69%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,61%	3,47%	3,47%	4,98%	11,75%	27,29%	0,10%	1,066%	3,46%
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%	3,46%
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,57%	3,31%	3,31%	4,67%	11,22%	26,23%	0,50%	1,075%	3,47%

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%	2,65%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,00%	2,13%	2,13%	1,46%	4,58%	12,72%	0,20%	0,555%	4,71%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,57%	1,87%	1,87%	3,47%	8,64%	-	0,20%	0,116%	1,62%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,57%	1,86%	1,86%	3,47%	8,62%	22,58%	0,20%	0,114%	1,61%

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%	4,43%

IMA Geral	0,96%	3,47%	3,47%	4,52%	10,78%	31,65%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	1,01%	3,65%	3,65%	4,55%	10,87%	32,97%	0,25%	0,745%	4,82%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,93%	3,37%	3,37%	4,35%	10,56%	31,42%	0,20%	0,683%	4,31%



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	0,94%	4,94%	4,94%	4,60%	10,73%	34,61%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,19%	3,15%	3,15%	2,76%	7,08%	20,96%	0,20%	1,535%	7,55%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,00%	4,61%	4,61%	5,32%	12,57%	32,46%	0,20%	1,396%	5,44%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,64%	0,69%	0,69%	2,31%	6,15%	15,51%	0,20%	1,090%	5,12%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,27%	2,92%	2,92%	4,44%	10,67%	26,52%	0,20%	0,732%	3,08%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,97%	4,96%	4,96%	4,55%	10,73%	35,26%	0,20%	1,514%	9,10%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	0,96%	4,92%	4,92%	4,45%	9,62%	33,22%	0,15%	1,536%	9,46%
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%	8,97%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	0,89%	4,88%	4,88%	4,39%	10,17%	33,56%	0,50%	1,451%	9,19%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,73%	2,97%	2,97%	2,08%	4,52%	22,22%	0,20%	1,791%	10,94%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,72%	2,98%	2,98%	2,09%	4,56%	22,72%	0,20%	1,791%	10,93%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,58%	-0,84%	-0,84%	0,72%	2,89%	10,07%	0,20%	0,116%	4,15%
IPCA + 6,00% ao ano	0,58%	2,13%	2,13%	4,77%	8,72%	20,53%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,01%	4,83%	4,83%	5,31%	12,48%	33,36%	0,15%	1,436%	6,23%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10%	2,60%	2,60%	4,25%	10,28%	25,91%	0,15%	0,573%	2,57%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,73%	-0,32%	-0,32%	2,09%	3,06%	8,15%	0,20%	0,039%	3,89%

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
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,73%	2,44%	2,44%	4,90%	8,90%	20,93%	0,20%	0,039%	0,34%
CDI	0,53%	1,59%	1,59%	3,37%	8,39%	23,30%	-	-	-
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	0,89%	2,48%	2,48%	4,08%	9,46%	26,11%	0,40%	0,384%	1,29%
RIO BRAVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,54%	1,63%	1,63%	3,44%	8,73%	24,46%	0,45%	0,022%	0,14%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,53%	1,58%	1,58%	3,36%	8,51%	23,57%	0,20%	0,006%	0,11%
WESTERN ASSET CRÉDITO CORPORATIVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,53%	1,69%	1,69%	4,01%	9,93%	22,77%	0,50%	0,115%	0,41%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,51%	1,53%	1,53%	3,30%	8,32%	23,24%	0,20%	0,007%	0,10%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,46%	1,38%	1,38%	2,97%	7,53%	21,30%	0,80%	0,003%	0,09%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,44%	1,32%	1,32%	2,84%	7,29%	21,16%	1,00%	0,004%	0,09%
IMA-B 5+	0,38%	5,94%	5,94%	4,21%	10,24%	38,98%	-	-	-
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	0,34%	5,82%	5,82%	3,99%	9,85%	38,19%	0,20%	1,971%	11,85%
IPCA	0,09%	0,70%	0,70%	1,85%	2,68%	7,37%	-	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,81%	3,79%	3,79%	5,47%	13,10%	33,24%	0,20%	1,104%	4,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	1,03%	3,30%	3,30%	4,30%	9,88%	-	0,40%	0,881%	5,50%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,03%	3,28%	3,28%	4,28%	9,87%	32,31%	0,40%	0,881%	5,51%
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%	1,22%

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

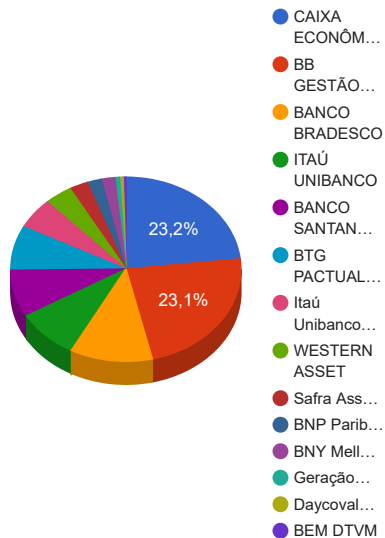
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	2,00%	5,89%	5,89%	6,15%	15,97%	58,68%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1,93%	8,41%	8,41%	5,46%	10,48%	41,47%	1,20%	7,884%	22,38%
IDIV	1,05%	10,36%	10,36%	8,41%	21,26%	88,12%	-	-	-
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1,15%	6,52%	6,52%	6,73%	22,08%	38,34%	2,50%	4,786%	13,84%
IPCA + 8,00% ao ano	0,73%	2,60%	2,60%	5,72%	10,73%	25,09%	-	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-	-	-	-	-	-	2,00%	-	-
CDI	0,53%	1,59%	1,59%	3,37%	8,39%	23,30%	-	-	-
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	0,85%	3,15%	3,15%	4,48%	8,28%	26,70%	2,00%	0,800%	1,52%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	0,50%	2,00%	2,00%	4,10%	9,39%	25,27%	0,50%	0,594%	1,53%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	-2,73%	-0,77%	-0,77%	7,25%	19,48%	54,96%	1,00%	9,310%	11,76%
SMLL	0,07%	4,03%	4,03%	7,03%	33,83%	91,97%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	3,00%	14,17%	14,17%	15,30%	41,10%	89,67%	2,00%	6,685%	20,07%
Ibovespa	0,01%	11,73%	11,73%	14,90%	31,36%	70,54%	-	-	-
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1,90%	10,10%	10,10%	10,24%	31,92%	53,15%	3,00%	5,923%	15,48%
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	1,39%	8,77%	8,77%	6,85%	25,63%	64,76%	2,50%	6,354%	16,49%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULTIMERCADO	0,51%	3,73%	3,73%	5,63%	13,31%	34,29%	1,60%	0,146%	3,87%
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	0,43%	7,10%	7,10%	10,09%	29,69%	72,08%	2,00%	6,808%	18,00%

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

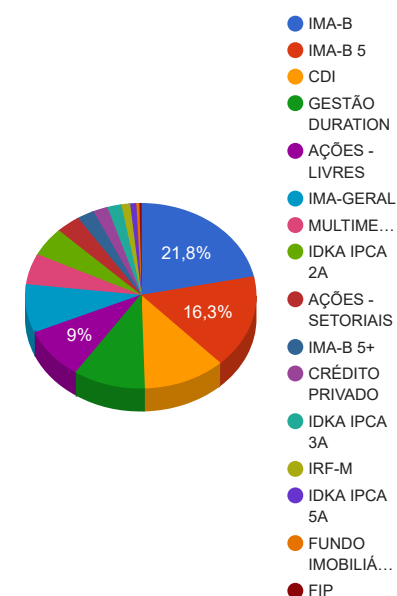
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	0,30%	0,46%	0,46%	0,92%	10,92%	44,90%	2,00%	4,269%	10,32%
BB PIPE FIC AÇÕES	-1,94%	-2,07%	-2,07%	-2,18%	19,57%	40,60%	1,20%	5,884%	16,24%
S&P 500	-2,69%	-1,22%	-1,22%	4,82%	11,77%	28,21%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-2,77%	-0,90%	-0,90%	6,99%	18,92%	53,88%	1,00%	9,416%	11,82%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	92.995.718,33	23,23%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	92.464.732,14	23,10%
BANCO BRADESCO	46.028.854,51	11,50%
ITAÚ UNIBANCO	34.798.030,24	8,69%
BANCO SANTANDER	33.067.382,72	8,26%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	31.255.188,43	7,81%
Itaú Unibanco S.A.	21.677.309,31	5,42%
WESTERN ASSET	15.640.569,66	3,91%
Safra Asset Management	10.495.729,97	2,62%
BNP Paribas	8.048.925,74	2,01%
BNY Mellon Serviços Financeiros	7.525.938,37	1,88%
Geração Futuro	2.681.004,79	0,67%
Daycoval Asset Management	2.057.291,12	0,51%
BEM DTVM	1.570.920,93	0,39%



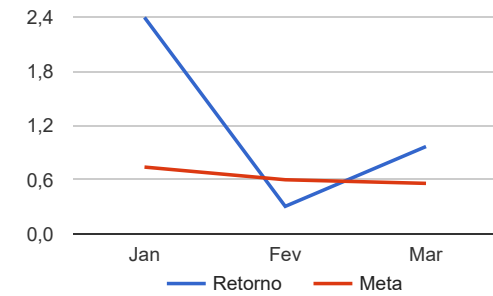
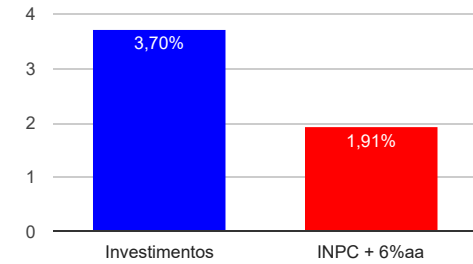
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	87.131.781,19	21,77%
IMA-B 5	65.122.922,85	16,27%
CDI	46.112.562,27	11,52%
GESTÃO DURATION	39.473.834,95	9,86%
AÇÕES - LIVRES	35.938.315,19	8,98%
IMA-GERAL	33.894.870,47	8,47%
MULTIMERCADO	21.637.726,81	5,41%
IDKA IPCA 2A	20.363.851,15	5,09%
AÇÕES - SETORIAIS	13.662.873,38	3,41%
IMA-B 5+	9.605.099,22	2,40%
CRÉDITO PRIVADO	8.194.123,86	2,05%
IDKA IPCA 3A	7.915.161,77	1,98%
IRF-M	4.897.469,89	1,22%
IDKA IPCA 5A	3.394.994,85	0,85%
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.740.000,00	0,43%
FIP	1.222.008,41	0,31%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	370.364.777,04	6.417.082,30	753.770,54	385.026.326,77	8.998.237,97	2,39%	0,74%	322,87%	1,72%
Fevereiro	385.026.326,77	42.232.155,15	36.739.594,47	391.714.871,55	1.195.984,10	0,31%	0,60%	51,23%	2,11%
Março	391.714.871,55	38.732.327,38	33.972.525,88	400.307.596,26	3.832.923,21	0,97%	0,56%	173,53%	1,70%
Acumulado no ano					14.027.145,28	3,70%	1,91%	193,89%	

**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 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.694.573,74	0,00	0,00	6.841.281,47	146.707,73	2,19%	1,54%	2,19%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.326.888,44	0,00	0,00	3.394.994,85	68.106,41	2,05%	1,55%	2,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.261.055,70	0,00	0,00	3.326.669,09	65.613,39	2,01%	1,44%	2,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.640.095,10	0,00	0,00	6.772.803,69	132.708,59	2,00%	1,40%	2,00%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	3.437.716,71	0,00	0,00	3.499.920,92	62.204,21	1,81%	1,10%	1,81%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	966.561,31	0,00	0,00	982.519,85	15.958,54	1,65%	1,11%	1,65%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.321.376,70	0,00	0,00	2.359.396,08	38.019,38	1,64%	1,09%	1,64%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	22.099.044,47	0,00	0,00	22.453.912,58	354.868,11	1,61%	1,07%	1,61%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	22.451.560,41	0,00	0,00	22.810.690,90	359.130,49	1,60%	1,06%	1,60%
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.025.577,20	0,00	0,00	2.057.291,12	31.713,92	1,57%	1,08%	1,57%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.100.674,68	0,00	0,00	7.208.318,85	107.644,17	1,52%	0,98%	1,52%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.834.710,55	0,00	0,00	4.897.469,89	62.759,34	1,30%	0,73%	1,30%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.252.461,44	0,00	0,00	15.445.520,49	193.059,05	1,27%	0,73%	1,27%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.012.901,89	0,00	0,00	2.035.048,07	22.146,18	1,10%	0,57%	1,10%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	21.456.665,60	0,00	0,00	21.677.309,31	220.643,71	1,03%	0,88%	1,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	17.615.476,82	0,00	0,00	17.796.525,64	181.048,82	1,03%	0,88%	1,03%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	24.544.855,59	0,00	0,00	24.792.821,45	247.965,86	1,01%	0,74%	1,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.821.904,07	0,00	0,00	5.880.113,70	58.209,63	1,00%	0,55%	1,00%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	20.058.999,73	0,00	0,00	20.253.513,21	194.513,48	0,97%	1,51%	0,97%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	2.655.480,82	0,00	0,00	2.681.004,79	25.523,97	0,96%	1,54%	0,96%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	19.214.462,00	0,00	0,00	19.386.867,62	172.405,62	0,90%	1,45%	0,90%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	11.023.103,60	0,00	0,00	11.121.390,90	98.287,30	0,89%	1,45%	0,89%

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(%)
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	671.452,50	0,00	0,00	677.415,17	5.962,67	0,89%	0,38%	0,89%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.958.013,00	0,00	0,00	1.972.353,00	14.340,00	0,73%	0,04%	0,73%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.293.321,90	0,00	0,00	1.302.729,93	9.408,03	0,73%	0,04%	0,73%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.633.440,36	0,00	0,00	3.659.785,24	26.344,88	0,73%	1,79%	0,73%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.498.574,40	0,00	0,00	1.509.410,49	10.836,09	0,72%	1,79%	0,72%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2.534.972,40	0,00	0,00	2.550.002,40	15.030,00	0,59%	0,05%	0,59%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.415.277,54	0,00	0,00	12.486.759,32	71.481,78	0,58%	0,12%	0,58%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.608.265,03	0,00	0,00	10.669.223,49	60.958,46	0,57%	0,12%	0,57%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.472.154,51	0,00	0,00	2.486.308,81	14.154,30	0,57%	0,11%	0,57%
WESTERN ASSET CRÉDITO CORPORATIVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	570.253,20	0,00	0,00	573.279,61	3.026,41	0,53%	0,11%	0,53%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.101.989,16	0,00	0,00	2.112.814,18	10.825,02	0,51%	0,01%	0,51%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	22.340.416,82	0,00	0,00	22.439.472,24	99.055,42	0,44%	0,00%	0,44%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	37.744.637,24	6.633.746,36	33.150.660,10	11.391.243,22	163.519,72	0,37%	0,00%	0,46%
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	4.420.980,72	0,00	0,00	4.435.903,49	14.922,77	0,34%	1,97%	0,34%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	5.214.656,89	5.054.648,08	811.365,78	9.491.617,46	33.678,27	0,33%	0,01%	0,53%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.074.511,23	7.000.000,00	0,00	9.102.049,02	27.537,79	0,30%	0,68%	0,93%
RIO BRAVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	566.562,06	1.000.000,00	0,00	1.570.920,93	4.358,87	0,28%	0,02%	0,54%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>3.444.678,38</b>	<b>1,02%</b>	<b>0,84%</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	1.707.000,00	0,00	10.500,00	1.740.000,00	43.500,00	2,55%	7,88%	1,93%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.690.157,09	5.700.000,00	0,00	7.525.938,37	135.781,28	1,84%	6,69%	3,00%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	16.507.252,24	3.821.966,47	0,00	20.682.349,93	353.131,22	1,74%	5,92%	1,90%
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	4.319.776,79	0,00	0,00	4.380.013,90	60.237,11	1,39%	6,35%	1,39%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	4.365.869,27	1.700.000,00	0,00	6.136.935,01	71.065,74	1,17%	4,79%	1,15%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULTIMERCADO	1.126.362,59	0,00	0,00	1.132.135,86	5.773,27	0,51%	0,15%	0,51%
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	1.117.081,28	0,00	0,00	1.121.852,68	4.771,40	0,43%	6,81%	0,43%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	4.317.945,63	2.000.000,00	0,00	6.342.291,04	24.345,41	0,39%	0,59%	0,50%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1.541.340,63	2.000.000,00	0,00	3.553.726,04	12.385,41	0,35%	0,80%	0,85%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	4.208.810,26	3.821.966,47	0,00	8.048.925,74	18.149,01	0,23%	4,27%	0,30%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	1.228.700,31	0,00	0,00	1.222.008,41	-6.691,90	-0,54%	-	-
BB PIPE FIC AÇÕES	1.738.993,03	0,00	0,00	1.705.172,94	-33.820,09	-1,94%	5,88%	-1,94%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	4.270.147,16	0,00	0,00	4.153.438,93	-116.708,23	-2,73%	9,31%	-2,73%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	6.639.809,74	0,00	0,00	6.456.134,94	-183.674,80	-2,77%	9,42%	-2,77%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>388.244,83</b>	<b>0,53%</b>	<b>5,51%</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 (%)
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	19.296.477,00	0,00	0,00	20.253.513,21	957.036,21	4,96%	4,96%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	18.487.558,70	0,00	0,00	19.386.867,62	899.308,92	4,86%	4,86%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	23.920.611,81	0,00	0,00	24.792.821,45	872.209,64	3,65%	3,65%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	19.311.472,91	0,00	9.000.000,00	11.121.390,90	809.917,99	4,61%	4,88%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	22.044.621,72	0,00	0,00	22.810.690,90	766.069,18	3,48%	3,48%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	21.699.914,64	0,00	0,00	22.453.912,58	753.997,94	3,47%	3,47%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	17.230.522,14	0,00	0,00	17.796.525,64	566.003,50	3,28%	3,28%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	12.150.367,83	9.000.000,00	0,00	21.677.309,31	526.941,48	3,13%	3,30%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.420.982,62	0,00	419.197,31	15.445.520,49	443.735,18	2,91%	2,92%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	21.424.684,62	34.201.278,41	44.664.170,10	11.391.243,22	429.450,29	1,12%	1,38%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.632.278,56	0,00	171.781,92	6.841.281,47	380.784,83	5,80%	3,15%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.647.249,16	0,00	176.287,98	6.772.803,69	301.842,51	4,59%	4,61%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.998.687,79	1.156.031,83	0,00	22.439.472,24	284.752,62	1,31%	1,32%
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	4.191.933,37	0,00	0,00	4.435.903,49	243.970,12	5,82%	5,82%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.592.937,98	0,00	339.511,32	12.486.759,32	233.332,66	1,87%	-0,84%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.993.988,22	0,00	0,00	7.208.318,85	214.330,63	3,06%	3,06%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.777.308,58	0,00	307.261,78	10.669.223,49	199.176,69	1,86%	1,87%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.554.310,60	0,00	90.718,04	3.659.785,24	196.192,68	5,54%	2,97%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.714.225,60	0,00	0,00	4.897.469,89	183.244,29	3,89%	3,89%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.173.543,67	0,00	0,00	3.326.669,09	153.125,42	4,83%	4,83%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.339.444,98	0,00	89.646,74	3.394.994,85	145.196,61	4,40%	4,43%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	3.372.022,83	0,00	0,00	3.499.920,92	127.898,09	3,79%	3,79%

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 (%)
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	2.555.182,79	0,00	0,00	2.681.004,79	125.822,00	4,92%	4,92%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.757.493,54	0,00	0,00	5.880.113,70	122.620,16	2,13%	2,13%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	5.886.391,41	5.843.321,65	2.331.879,54	9.491.617,46	93.783,94	1,35%	1,58%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.465.725,45	0,00	37.135,62	1.509.410,49	80.820,66	5,53%	2,98%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.343.267,23	0,00	60.929,51	2.359.396,08	77.058,36	3,33%	0,69%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.025.504,37	7.000.000,00	0,00	9.102.049,02	76.544,65	2,73%	3,37%
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.991.403,12	0,00	0,00	2.057.291,12	65.888,00	3,31%	3,31%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.038.476,57	0,00	55.711,01	2.035.048,07	52.282,51	2,59%	2,60%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2.499.656,40	0,00	0,00	2.550.002,40	50.346,00	2,01%	2,01%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.978.593,00	0,00	54.321,63	1.972.353,00	48.081,63	2,45%	-0,32%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.510.949,44	0,00	70.891,88	2.486.308,81	46.251,25	1,86%	1,86%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	948.550,47	0,00	0,00	982.519,85	33.969,38	3,58%	3,58%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.080.940,11	0,00	0,00	2.112.814,18	31.874,07	1,53%	1,53%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.308.164,76	0,00	37.035,13	1.302.729,93	31.600,30	2,44%	2,44%
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	661.051,83	0,00	0,00	677.415,17	16.363,34	2,48%	2,48%
RIO BRAVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	560.437,44	1.000.000,00	0,00	1.570.920,93	10.483,49	1,37%	1,63%
WESTERN ASSET CRÉDITO CORPORATIVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	563.747,52	0,00	0,00	573.279,61	9.532,09	1,69%	1,69%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>10.661.839,31</b>	<b>3,28%</b>	

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 (%)
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	15.278.118,72	3.821.966,47	0,00	20.682.349,93	1.582.264,74	9,92%	10,10%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	8.023.066,65	0,00	8.487.865,87	0,00	464.799,22	5,79%	5,41%
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	4.026.895,30	0,00	0,00	4.380.013,90	353.118,60	8,77%	8,77%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	4.722.462,02	0,00	5.037.495,51	0,00	315.033,49	6,67%	10,58%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.524.873,99	5.700.000,00	0,00	7.525.938,37	301.064,38	12,88%	14,17%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	2.721.063,02	3.200.000,00	0,00	6.136.935,01	215.871,99	7,15%	6,52%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.605.000,00	0,00	34.050,00	1.740.000,00	169.050,00	10,56%	8,41%
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	1.047.447,72	0,00	0,00	1.121.852,68	74.404,96	7,10%	7,10%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1.506.848,04	2.000.000,00	0,00	3.553.726,04	46.878,00	2,65%	3,15%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULTIMERCADO	1.091.408,24	0,00	0,00	1.132.135,86	40.727,62	3,73%	3,73%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	4.202.245,60	3.821.966,47	0,00	8.048.925,74	24.713,67	0,38%	0,46%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	0,00	6.318.500,00	0,00	6.342.291,04	23.791,04	0,37%	2,00%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	1.208.683,99	0,00	0,00	1.222.008,41	13.324,42	1,10%	-
BB PIPE FIC AÇÕES	1.741.169,69	0,00	0,00	1.705.172,94	-35.996,75	-2,07%	-2,07%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	6.514.813,28	0,00	0,00	6.456.134,94	-58.678,34	-0,90%	-0,90%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	0,00	4.318.500,00	0,00	4.153.438,93	-165.061,07	-3,82%	-0,77%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>3.365.305,97</b>	<b>5,95%</b>	