

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
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	6.350.100,63	5,23%	732	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	5.024.400,85	4,14%	214	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	607.384,50	0,50%	167	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.454.055,92	5,31%	753	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	1.041.587,83	0,86%	20	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	12.117.950,09	9,97%	639	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	1.224.958,81	1,01%	107	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	9.307.193,71	7,66%	1.417	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	8.055.847,12	6,63%	346	0,62%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.125.371,62	5,87%	590	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	5.847.966,97	4,81%	223	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	832.578,43	0,69%	192	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	7.000.711,34	5,76%	1.219	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	8.347.913,32	6,87%	24	2,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.609.739,81	2,97%	343	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	3.370.467,48	2,77%	228	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	10.865.435,03	8,94%	697	0,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou D+1461	Não há	2.996.509,48	2,47%	17	1,43%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	5.805.788,52	4,78%	481	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.617.264,69	1,33%	435	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.939.007,15	4,07%	734	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	Não se aplica	Não se aplica	11.772,30	0,01%	11	0,92%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "

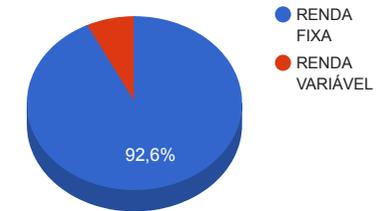
Carteira consolidada de investimentos - base (março / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4	Não há	490.142,27	0,40%	42	0,21%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	488.476,74	0,40%	110	0,19%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	D+4	Não há	487.866,64	0,40%	79	0,38%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	D+4	360 dias	165.802,54	0,14%	6	10,40%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.054.567,72	0,87%	2.059	1,48%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	43832	2.582.454,19	2,13%	729	1,00%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	1.876.963,49	1,55%	33	0,71%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
HAZ FII - ATCR11	Não se aplica	Não se aplica	650.889,44	0,54%		4,38%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	D+31 ou D+1800	1800 dias	1.135.014,47	0,93%	10	5,51%	Desenquadrado - RV
		TOTAL -	121.486.183,10				

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

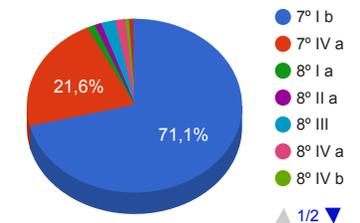
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	86.318.228,43	71,05%	0,00%	64,42%	100,00%	35.167.954,67
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,43%	15,00%	18.222.927,47
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	26.224.004,87	21,59%	0,00%	28,50%	30,00%	10.221.850,06
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	11.772,30	0,01%	0,00%	0,01%	5,00%	6.062.536,86
Total Renda Fixa	100,00%	112.554.005,60	92,65%	0,00	95,36	205,00	-

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%	1.466.485,65	1,21%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.466.485,65
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	1.220.370,26	1,00%	0,00%	1,78%	15,00%	17.002.557,21
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.582.454,19	2,13%	0,00%	0,00%	5,00%	3.491.854,97
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	1.876.963,49	1,55%	0,00%	2,05%	5,00%	4.197.345,67
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	650.889,44	0,54%	0,00%	0,81%	5,00%	5.423.419,72
Desenquadrado - RV	0,00%	1.135.014,47	0,93%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.135.014,47
Total Renda Variável	30,00%	8.932.177,50	7,35%	0,00	4,64	30,00	-

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 "	86.318.228,43	71,05%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	26.224.004,87	21,59%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	11.772,30	0,01%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	112.554.005,60	92,65%	0,00	205,00

Artigos - Renda Variável	Base: março / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	1.466.485,65	1,21%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	1.220.370,26	1,00%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso III	2.582.454,19	2,13%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	1.876.963,49	1,55%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	650.889,44	0,54%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RV	1.135.014,47	0,93%	0,00%	0,00%
Total Renda Variável	8.932.177,50	7,35%	0,00	30,00

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	43.249.450,83	35,60%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	35.738.498,74	29,42%	0,00%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	27.759.337,74	22,85%	0,01%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	5.805.788,52	4,78%	0,00%
TMJ CAPITAL	3.647.398,92	3,00%	1,06%
Brasil Plural	1.876.963,49	1,55%	0,74%
ROMA ASSET	1.135.014,47	0,93%	0,36%
GERAÇÃO FUTURO	1.054.567,72	0,87%	0,01%
SAFRA ASSET MANAGEMENT	1.041.587,83	0,86%	0,00%
LHYNQZ GESTÃO DE RECURSOS	165.802,54	0,14%	10,40%
BRASIL PLURAL	11.772,30	0,01%	0,00%

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%	-	-	-
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%
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%
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%	2,70%
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 ex-C	0,95%	3,39%	3,39%	4,45%	10,83%	31,89%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,00%	3,52%	3,52%	4,32%	10,28%	-	0,30%	0,751%	4,77%
IMA-B	0,94%	4,94%	4,94%	4,60%	10,73%	34,61%	-	-	-
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%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	1,48%	4,70%	4,70%	5,69%	12,07%	30,08%	1,30%	1,283%	4,67%
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%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	1,05%	4,92%	4,92%	4,43%	10,37%	32,82%	0,45%	1,507%	9,29%
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%	8,97%
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%

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

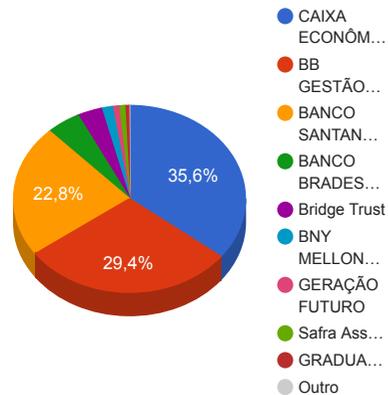
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,58%	-0,84%	-0,84%	0,72%	2,89%	10,07%	0,20%	0,116%	4,15%
IRF-M 1	0,66%	1,80%	1,80%	3,65%	9,34%	24,73%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,64%	1,75%	1,75%	3,57%	9,16%	24,36%	0,20%	0,127%	0,63%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,64%	1,74%	1,74%	3,56%	9,21%	24,57%	0,00%	0,128%	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%	0,64%
120% do CDI	0,64%	1,91%	1,91%	4,06%	10,15%	28,57%	-	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	-20,30%	-26,45%	-26,45%	-34,36%	-45,87%	-56,29%	0,00%	17,825%	-
Selic	0,53%	1,59%	1,59%	3,38%	8,40%	23,33%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,52%	1,60%	1,60%	3,37%	8,80%	24,09%	0,20%	0,003%	0,12%
CDI	0,53%	1,59%	1,59%	3,37%	8,39%	23,30%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,54%	1,59%	1,59%	3,45%	8,48%	23,44%	0,20%	0,010%	0,11%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,53%	1,58%	1,58%	3,35%	8,52%	23,80%	0,20%	0,006%	0,11%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,52%	1,54%	1,54%	3,32%	8,27%	23,13%	0,20%	0,007%	0,14%
IMA-B 5+	0,38%	5,94%	5,94%	4,21%	10,24%	38,98%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,32%	5,82%	5,82%	4,04%	9,75%	38,00%	0,20%	1,955%	11,78%

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

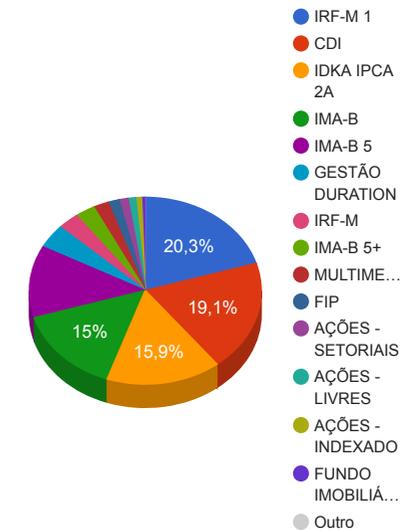
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	2,00%	5,89%	5,89%	6,15%	15,97%	58,68%	-	-	-
HAZ FII - ATCR11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	1,20%	-	-
IDIV	1,05%	10,36%	10,36%	8,41%	21,26%	88,12%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	-0,35%	10,51%	10,51%	6,75%	5,15%	19,68%	3,00%	7,448%	-
IPCA	0,09%	0,70%	0,70%	1,85%	2,68%	7,37%	-	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	0,021%	20,80%
IBX-50	0,06%	12,26%	12,26%	15,38%	32,09%	69,32%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	-0,33%	12,34%	12,34%	15,67%	33,10%	62,49%	0,70%	6,767%	19,31%
Ibovespa	0,01%	11,73%	11,73%	14,90%	31,36%	70,54%	-	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	1,93%	-	-	-	-	-	1,60%	1,293%	-
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	1,56%	12,67%	12,67%	13,96%	27,39%	48,72%	3,00%	4,823%	14,85%
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	-0,45%	-1,31%	-1,31%	-2,59%	-5,15%	6,45%	4,00%	0,073%	0,17%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-0,64%	10,37%	10,37%	11,72%	28,45%	67,23%	0,75%	6,386%	18,52%
IGC	-1,02%	6,76%	6,76%	8,38%	26,52%	60,19%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-1,01%	6,65%	6,65%	8,01%	25,62%	58,17%	1,00%	5,869%	17,48%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	43.249.450,83	35,60%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	35.738.498,74	29,42%
BANCO SANTANDER	27.759.337,74	22,85%
BANCO BRADESCO	5.805.788,52	4,78%
Bridge Trust	4.131.523,95	3,40%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	1.876.963,49	1,55%
GERAÇÃO FUTURO	1.054.567,72	0,87%
Safra Asset Management	1.041.587,83	0,86%
GRADUAL INVESTIMENTOS	662.661,74	0,55%
ICLA Trust	165.802,54	0,14%



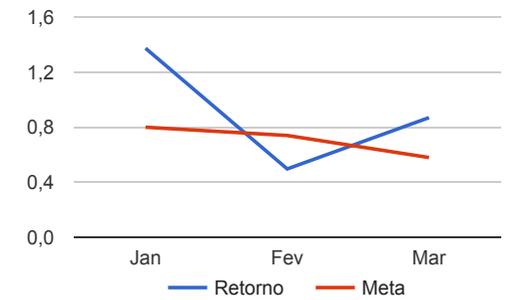
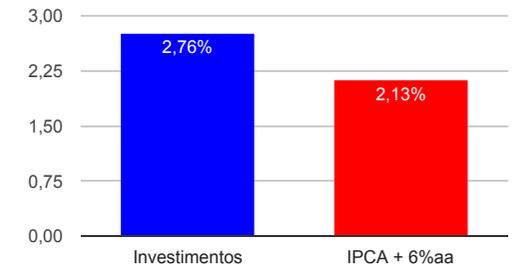
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	24.655.818,37	20,30%
CDI	23.227.495,39	19,12%
IDKA IPCA 2A	19.300.629,15	15,89%
IMA-B	18.224.909,35	15,00%
IMA-B 5	15.128.772,90	12,45%
GESTÃO DURATION	5.024.400,85	4,14%
IRF-M	3.609.739,81	2,97%
IMA-B 5+	3.370.467,48	2,77%
MULTIMERCADO	2.582.454,19	2,13%
FIP	1.876.963,49	1,55%
AÇÕES - SETORIAIS	1.543.044,46	1,27%
AÇÕES - LIVRES	1.300.817,01	1,07%
AÇÕES - INDEXADO	978.008,91	0,81%
FUNDO IMOBILIÁRIO	650.889,44	0,54%
FIDC - FECHADO	11.772,30	0,01%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	114.216.440,46	10.266.099,47	8.846.346,38	117.224.289,56	1.588.096,01	1,37%	0,80%	171,35%	0,67%
Fevereiro	117.224.289,56	6.216.112,57	5.063.696,56	118.965.268,41	588.562,84	0,50%	0,74%	67,33%	1,12%
Março	118.965.268,41	28.408.298,69	26.934.670,37	121.486.183,10	1.047.286,37	0,87%	0,58%	150,65%	0,80%
Acumulado no ano					3.223.945,22	2,76%	2,13%	129,61%	

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 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.205.219,79	0,00	0,00	1.224.958,81	19.739,02	1,64%	1,09%	1,64%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	7.928.530,19	0,00	0,00	8.055.847,12	127.316,93	1,61%	1,07%	1,61%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	2.952.735,14	0,00	0,00	2.996.509,48	43.774,34	1,48%	1,28%	1,48%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.257.352,49	0,00	0,00	6.350.100,63	92.748,14	1,48%	0,94%	1,48%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.252.921,03	692.824,68	0,00	12.117.950,09	172.204,38	1,44%	0,98%	1,52%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.563.482,28	0,00	0,00	3.609.739,81	46.257,53	1,30%	0,73%	1,30%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	599.792,58	0,00	0,00	607.384,50	7.591,92	1,27%	0,73%	1,27%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	1.030.806,75	0,00	0,00	1.041.587,83	10.781,08	1,05%	1,51%	1,05%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.395.447,35	0,00	0,00	6.454.055,92	58.608,57	0,92%	1,45%	0,92%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.062.006,36	0,00	0,00	7.125.371,62	63.365,26	0,90%	1,45%	0,90%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.295.144,75	0,00	0,00	8.347.913,32	52.768,57	0,64%	0,13%	0,64%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.956.620,30	0,00	0,00	7.000.711,34	44.091,04	0,63%	0,13%	0,63%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.816.346,62	537.423,64	102.389,56	9.307.193,71	55.813,01	0,60%	0,13%	0,64%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.814.489,65	0,00	0,00	5.847.966,97	33.477,32	0,58%	0,12%	0,58%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	827.838,65	0,00	0,00	832.578,43	4.739,78	0,57%	0,11%	0,57%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	5.775.607,63	0,00	0,00	5.805.788,52	30.180,89	0,52%	0,00%	0,52%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.609.280,18	0,00	365,98	1.617.264,69	8.350,49	0,52%	0,01%	0,52%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	5.000.000,00	0,00	5.024.400,85	24.400,85	0,49%	0,75%	1,00%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.359.587,30	0,00	0,00	3.370.467,48	10.880,18	0,32%	1,95%	0,32%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.219.265,45	7.656.817,09	7.970.003,09	4.939.007,15	32.927,70	0,26%	0,01%	0,54%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	14.521.233,28	3.684.000,00	10.865.435,03	28.201,75	0,19%	0,01%	0,53%
SANTANDER TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.751.689,62	0,00	2.756.678,46	0,00	4.988,84	0,18%	0,00%	0,51%

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(%)
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	12.399.367,45	0,00	12.421.233,28	0,00	21.865,83	0,18%	0,01%	0,53%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	14.771,22	0,00	0,00	11.772,30	-2.998,92	-20,30%	17,83%	-12,85%
Total Renda Fixa					992.074,50	0,89%	0,63%	

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 CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	2.533.488,97	0,00	0,00	2.582.454,19	48.965,22	1,93%	1,29%	1,93%
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	1.117.552,98	0,00	0,00	1.135.014,47	17.461,49	1,56%	4,82%	1,56%
HAZ FII - ATCR11	647.668,05	0,00	0,00	650.889,44	3.221,39	0,50%	-	0,00%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP	1.877.191,16	0,00	0,00	1.876.963,49	-227,67	-0,01%	0,02%	-0,04%
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	489.461,42	0,00	0,00	487.866,64	-1.594,78	-0,33%	6,77%	-0,33%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.058.290,11	0,00	0,00	1.054.567,72	-3.722,39	-0,35%	7,45%	-0,35%
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	166.549,40	0,00	0,00	165.802,54	-746,86	-0,45%	0,07%	-0,45%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	493.303,69	0,00	0,00	490.142,27	-3.161,42	-0,64%	6,39%	-0,64%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	493.459,85	0,00	0,00	488.476,74	-4.983,11	-1,01%	5,87%	-1,01%
				Total Renda Variável	55.211,87	0,62%	3,14%	

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 BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.083.847,67	692.824,68	0,00	12.117.950,09	341.277,74	2,99%	3,06%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.794.843,22	0,00	0,00	7.125.371,62	330.528,40	4,86%	4,86%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.153.378,39	0,00	0,00	6.454.055,92	300.677,53	4,89%	4,89%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	7.785.333,36	0,00	0,00	8.055.847,12	270.513,76	3,47%	3,47%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.163.152,37	0,00	0,00	6.350.100,63	186.948,26	3,03%	3,03%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.185.016,29	0,00	0,00	3.370.467,48	185.451,19	5,82%	5,82%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.150.367,11	1.617.097,62	604.918,69	9.307.193,71	144.647,67	1,62%	1,75%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.204.932,15	0,00	0,00	8.347.913,32	142.981,17	1,74%	1,74%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	11.063.467,87	1.802.000,00	13.005.733,28	0,00	140.265,41	1,14%	1,58%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.474.677,36	0,00	0,00	3.609.739,81	135.062,45	3,89%	3,89%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	2.862.032,45	0,00	0,00	2.996.509,48	134.477,03	4,70%	4,70%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.265.151,98	2.660.592,28	2.051.643,76	7.000.711,34	126.610,84	1,69%	1,75%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.897.693,98	0,00	159.004,51	5.847.966,97	109.277,50	1,87%	-0,84%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	6.712.210,06	0,00	1.000.000,00	5.805.788,52	93.578,46	1,55%	1,60%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.949.714,81	8.731.957,60	8.829.779,21	4.939.007,15	87.113,95	1,19%	1,59%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	992.731,76	0,00	0,00	1.041.587,83	48.856,07	4,92%	4,92%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.216.584,98	0,00	31.633,58	1.224.958,81	40.007,41	3,33%	0,69%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.391.368,70	190.638,09	3.001.097,94	1.617.264,69	36.355,84	1,37%	1,54%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	14.521.233,28	3.684.000,00	10.865.435,03	28.201,75	0,19%	1,58%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	5.000.000,00	0,00	5.024.400,85	24.400,85	0,49%	3,52%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	606.419,57	0,00	16.484,65	607.384,50	17.449,58	2,91%	2,92%
SANTANDER TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.746.244,26	5.674.167,18	8.436.678,46	0,00	16.267,02	0,38%	1,51%

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 (%)
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	840.829,72	0,00	23.739,23	832.578,43	15.487,94	1,86%	1,86%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	15.998,21	0,00	0,00	11.772,30	-4.225,91	-26,41%	-26,45%
				Total Renda Fixa	2.952.211,91	2,70%	

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 (%)
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	1.007.346,77	0,00	0,00	1.135.014,47	127.667,70	12,67%	12,67%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	954.311,05	0,00	0,00	1.054.567,72	100.256,67	10,51%	10,51%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	0,00	2.500.000,00	0,00	2.582.454,19	82.454,19	3,30%	-
HAZ FII - ATCR11	648.913,19	0,00	0,00	650.889,44	1.976,25	0,30%	0,00%
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	167.998,29	0,00	0,00	165.802,54	-2.195,75	-1,31%	-1,31%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	1.881.874,89	0,00	0,00	1.876.963,49	-4.911,40	-0,26%	-
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	0,00	500.000,00	0,00	490.142,27	-9.857,73	-1,97%	10,37%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	0,00	500.000,00	0,00	488.476,74	-11.523,26	-2,30%	6,65%
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	0,00	500.000,00	0,00	487.866,64	-12.133,36	-2,43%	12,34%
				Total Renda Variável	271.733,31	3,60%	