

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
TÍTULOS PÚBLICOS			249.777.428,40	40,24%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	1.354.619,18	0,22%	192	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	25.770.838,72	4,15%	1.219	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	9.781.957,50	1,58%	38	5,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	60.635.812,02	9,77%	206	7,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2022	9.785.197,50	1,58%	17	12,91%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	D+1	16/05/2019	121.208,68	0,02%	11	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.787.677,49	0,93%	729	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	24.040.080,00	3,87%	223	0,75%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	10.004.449,02	1,61%	214	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	14.861.480,23	2,39%	95	3,67%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	19.590.067,22	3,16%	753	0,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	18/08/2020	6.449.055,00	1,04%	19	5,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	22.576.447,73	3,64%	590	0,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.326.459,68	1,18%	732	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	18.582.672,75	2,99%	1.417	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.295,58	0,00%	160	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	98.932,50	0,02%	734	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	52.341.686,25	8,43%	481	0,59%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	12.012.185,02	1,94%	177	0,92%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	33.064,52	0,01%		3,01%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	5.666.672,00	0,91%	100	2,44%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "

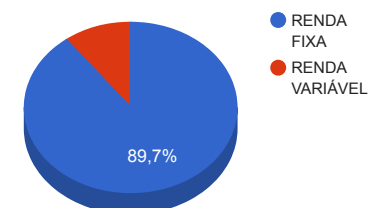
Carteira consolidada de investimentos - base (março / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
KINEA PIPE FI AÇÕES	D+363 a D+723 ou D+30 a D+1830	Não há	2.769.842,69	0,45%	23	1,26%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	6.183.390,10	1,00%	51	0,81%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	3.527.742,18	0,57%	110	1,38%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	5.291.800,28	0,85%	31	9,12%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	D+13	Não há	2.319.091,17	0,37%	294	3,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	6.841.770,10	1,10%	4.931	1,16%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	D+43	5 anos	5.350.343,63	0,86%	53	4,76%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+33	Não há	5.781.581,08	0,93%	943	7,21%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB CONSUMO FIC AÇÕES	D+4	Não há	5.950.956,42	0,96%	3.010	4,50%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	43832	4.130.320,66	0,67%	729	1,60%	Artigo 8º, Inciso III
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	11.053.837,42	1,78%		39,59%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	4.930.295,14	0,79%		0,20%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
TOTAL -			620.732.257,86				

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

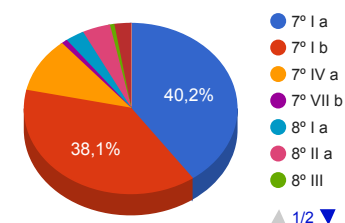
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	249.777.428,40	40,24%	0,00%	0,00%	0,00%	-249.777.428,40
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	236.668.022,72	38,13%	15,00%	25,00%	70,00%	197.844.557,78
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	372.439.354,72
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	64.456.099,35	10,38%	5,00%	10,00%	30,00%	121.763.578,01
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	7,00%	15,00%	15,00%	93.109.838,68
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	33.064,52	0,01%	2,00%	5,00%	5,00%	31.003.548,37
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5.666.672,00	0,91%	2,00%	5,00%	5,00%	25.369.940,89
Total Renda Fixa	100,00%	556.601.286,99	89,67%	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%	17.772.775,25	2,86%	2,00%	5,00%	10,00%	44.300.450,54
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	26.243.742,40	4,23%	2,00%	5,00%	10,00%	35.829.483,39
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	4.130.320,66	0,67%	7,00%	10,00%	10,00%	57.942.905,13
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	31.036.612,89
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	15.984.132,56	2,58%	2,00%	5,00%	5,00%	15.052.480,33
Total Renda Variável	30,00%	64.130.970,87	10,33%	15,00	30,00	40,00	-

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 " a "	249.777.428,40	40,24%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	236.668.022,72	38,13%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	64.456.099,35	10,38%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	33.064,52	0,01%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5.666.672,00	0,91%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	556.601.286,99	89,67%	36,00	190,00

Artigos - Renda Variável	Base: março / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	17.772.775,25	2,86%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	26.243.742,40	4,23%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	4.130.320,66	0,67%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	15.984.132,56	2,58%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	64.130.970,87	10,33%	15,00	40,00

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	121.117.685,42	19,51%	0,03%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	113.102.002,53	18,22%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	91.471.925,66	14,74%	0,01%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	13.372.928,59	2,15%	8,59%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	6.841.770,10	1,10%	0,04%
ITAÚ DTVM	6.183.390,10	1,00%	0,00%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	5.781.581,08	0,93%	0,01%
VINCI PARTNERS	5.350.343,63	0,86%	0,03%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	4.930.295,14	0,79%	0,34%
KINEA INVESTIMENTOS	2.769.842,69	0,45%	0,00%
BRASIL PLURAL	33.064,52	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%	-	-	-
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%
IDKA IPCA 2 Anos	1,59%	3,01%	3,01%	5,31%	12,41%	28,22%	-	-	-
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,57%	1,86%	1,86%	3,47%	8,62%	22,58%	0,20%	0,114%	1,63%
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%	4,81%
IMA-B	0,94%	4,94%	4,94%	4,60%	10,73%	34,61%	-	-	-
BRASESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	0,99%	2,12%	2,12%	1,63%	4,83%	10,06%	0,20%	0,554%	4,53%
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%
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%
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%	4,18%
CDI + 3,50% ao ano	0,82%	2,44%	2,44%	5,11%	12,11%	32,01%	-	-	-
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-25,98%	-95,62%	-95,62%	-45,74%	-51,50%	-74,35%	0,20%	28,467%	989,14%
IRF-M 1	0,66%	1,80%	1,80%	3,65%	9,34%	24,73%	-	-	-
BRASESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,65%	1,75%	1,75%	3,56%	9,15%	24,26%	0,20%	0,132%	0,65%
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%

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 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%
IPCA + 6,00% ao ano	0,58%	2,13%	2,13%	4,77%	8,72%	20,53%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,10%	4,52%	4,52%	5,50%	12,92%	33,09%	0,15%	1,592%	5,77%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,73%	-0,32%	-0,32%	2,08%	3,05%	8,07%	0,20%	0,039%	3,92%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,73%	-0,35%	-0,35%	2,04%	2,98%	7,91%	0,20%	0,038%	3,96%
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,73%	-0,34%	-0,34%	2,03%	2,96%	7,91%	0,20%	0,039%	3,92%
Selic	0,53%	1,59%	1,59%	3,38%	8,40%	23,33%	-	-	-
BRADERCO 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%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,54%	1,59%	1,59%	3,45%	8,48%	23,44%	0,20%	0,010%	0,11%
BRADERCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	0,51%	1,52%	1,52%	3,26%	8,25%	22,78%	0,20%	0,003%	0,11%
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%
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%

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

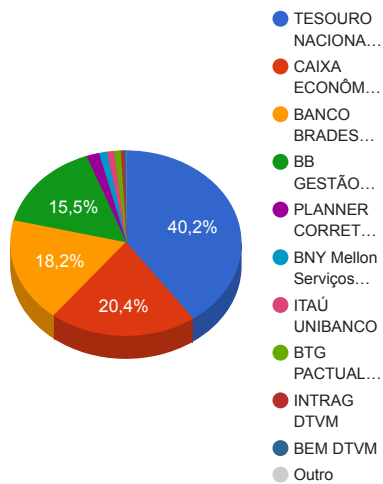
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	2,00%	5,89%	5,89%	6,15%	15,97%	58,68%	-	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	0,30%	-	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,00%	-	-	-	0,00%	0,00%	0,14%	-	-
IDIV	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%	13,72%
IBX	0,08%	11,29%	11,29%	14,21%	31,26%	70,33%	-	-	-
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	2,65%	11,65%	11,65%	11,94%	27,40%	50,02%	2,00%	4,937%	14,40%
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%	20,19%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	2,31%	9,70%	9,70%	10,72%	32,96%	9,07%	1,72%	6,170%	16,12%
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%	-
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	-0,02%	11,58%	11,58%	14,54%	30,53%	68,67%	0,50%	6,467%	18,90%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-0,20%	10,77%	10,77%	12,07%	28,83%	64,77%	1,50%	5,720%	17,29%
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%	17,55%
IVBX-2	-0,83%	2,15%	2,15%	2,88%	20,20%	40,75%	-	-	-

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

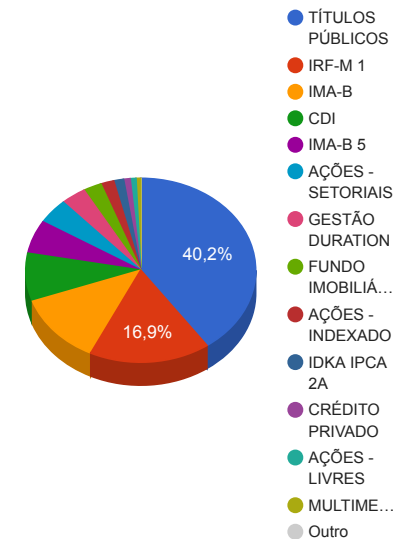
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
KINEA PIPE FI AÇÕES	-3,87%	-15,76%	-15,76%	-15,66%	5,40%	41,34%	1,50%	9,137%	22,79%
ICON	-0,64%	-2,89%	-2,89%	-2,50%	23,73%	36,85%	-	-	-
BB CONSUMO FIC AÇÕES	-0,67%	-2,94%	-2,94%	-3,05%	21,98%	33,18%	1,00%	7,231%	17,24%

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

Administrador	Valor	%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	249.777.428,40	40,24%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	126.468.029,05	20,37%
BANCO BRADESCO	113.102.002,53	18,22%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	96.402.220,80	15,53%
PLANNER CORRETORA	11.053.837,42	1,78%
BNY Mellon Serviços Financeiros	6.841.770,10	1,10%
ITAÚ UNIBANCO	6.183.390,10	1,00%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	5.781.581,08	0,93%
INTRAG DTVM	2.769.842,69	0,45%
BEM DTVM	2.319.091,17	0,37%
Geração Futuro	33.064,52	0,01%



Sub-segmento	Valor	%
TÍTULOS PÚBLICOS	249.777.428,40	40,24%
IRF-M 1	104.989.323,49	16,91%
IMA-B	76.716.358,86	12,36%
CDI	52.443.914,33	8,45%
IMA-B 5	36.276.812,49	5,84%
AÇÕES - SETORIAIS	27.452.393,41	4,42%
GESTÃO DURATION	22.016.634,04	3,55%
FUNDO IMOBILIÁRIO	15.984.132,56	2,58%
AÇÕES - INDEXADO	11.475.190,38	1,85%
IDKA IPCA 2A	8.681.078,86	1,40%
CRÉDITO PRIVADO	5.666.672,00	0,91%
AÇÕES - LIVRES	5.088.933,86	0,82%
MULTIMERCADO	4.130.320,66	0,67%
FIDC - FECHADO	33.064,52	0,01%



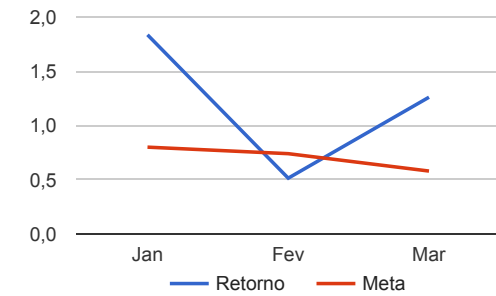
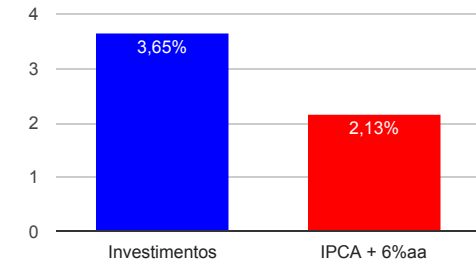
Carteira de Títulos Públicos - base (março / 2018)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	GAP (Atual - Pago)
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	10/11/2016	7000	3.029,485123	3.354,222591	21.206.395,86	23.479.558,14	2.273.162,28
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	29/08/2016	10000	2.967,972738	3.354,222591	29.679.727,38	33.542.225,91	3.862.498,53
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	12/09/2016	10000	2.980,886631	3.354,222591	29.808.866,31	33.542.225,91	3.733.359,60
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	14/09/2016	10000	2.971,010111	3.354,222591	29.710.101,11	33.542.225,91	3.832.124,80
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2022	27/07/2016	15000	2.963,303079	3.324,634723	44.449.546,19	49.869.520,85	5.419.974,66
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2022	04/08/2016	13000	2.979,58205	3.324,634723	38.734.566,65	43.220.251,40	4.485.684,75
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2022	30/06/2016	9800	2.911,042410	3.324,634723	28.528.215,62	32.581.420,29	4.053.204,67

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	584.156.333,20	14.667.688,99	7.486.328,56	602.182.628,02	10.844.934,39	1,83%	0,80%	228,82%	1,60%
Fevereiro	602.182.628,02	11.777.406,35	8.473.572,86	608.602.220,65	3.115.759,14	0,51%	0,74%	69,69%	2,54%
Março	608.602.220,65	39.755.038,41	35.345.681,01	620.732.257,86	7.720.679,81	1,26%	0,58%	218,21%	1,17%
Acumulado no ano					21.681.373,34	3,65%	2,13%	171,07%	

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(%)
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.556.430,32	0,00	0,00	14.861.480,23	305.049,91	2,10%	1,59%	2,10%
TÍTULOS PÚBLICOS	244.805.171,90	0,00	0,00	249.777.428,40	4.972.256,50	2,03%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.696.556,55	0,00	0,00	5.787.677,49	91.120,94	1,60%	1,06%	1,60%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.219.451,08	0,00	0,00	7.326.459,68	107.008,60	1,48%	0,94%	1,48%
BRADESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	120.014,99	0,00	0,00	121.208,68	1.193,69	0,99%	0,55%	0,99%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	19.412.171,94	0,00	0,00	19.590.067,22	177.895,28	0,92%	1,45%	0,92%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	22.375.677,47	0,00	0,00	22.576.447,73	200.770,26	0,90%	1,45%	0,90%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.402.190,00	0,00	0,00	6.449.055,00	46.865,00	0,73%	0,04%	0,73%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.711.015,00	0,00	0,00	9.781.957,50	70.942,50	0,73%	0,04%	0,73%
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.714.720,00	0,00	0,00	9.785.197,50	70.477,50	0,73%	0,04%	0,73%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	35.520.303,21	31.000,00	10.000.000,00	25.770.838,72	219.535,51	0,62%	0,13%	0,63%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	5.633.272,00	0,00	0,00	5.666.672,00	33.400,00	0,59%	0,05%	0,59%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	23.902.460,00	0,00	0,00	24.040.080,00	137.620,00	0,58%	0,12%	0,58%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.346.907,47	0,00	0,00	1.354.619,18	7.711,71	0,57%	0,11%	0,57%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	27.668.333,06	5.067.146,65	14.338.324,94	18.582.672,75	185.517,98	0,57%	0,13%	0,64%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	48.020.323,00	12.279.017,96	0,00	60.635.812,02	336.471,06	0,56%	0,13%	0,65%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	98.401,56	0,00	0,00	98.932,50	530,94	0,54%	0,01%	0,54%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	52.069.592,50	0,00	0,00	52.341.686,25	272.093,75	0,52%	0,00%	0,52%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	3.278,86	0,00	0,00	3.295,58	16,72	0,51%	0,00%	0,51%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00	12.000.000,00	0,00	12.012.185,02	12.185,02	0,10%	0,71%	1,18%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	10.000.000,00	0,00	10.004.449,02	4.449,02	0,04%	0,75%	1,00%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	44.668,16	0,00	7.356,07	33.064,52	-4.247,57	-9,51%	28,47%	-25,98%
Total Renda Fixa					7.248.864,32	1,32%	0,43%	

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(%)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	6.642.212,04	0,00	0,00	6.841.770,10	199.558,06	3,00%	6,69%	3,00%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	5.229.492,83	0,00	0,00	5.350.343,63	120.850,80	2,31%	6,17%	2,31%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	4.052.006,76	0,00	0,00	4.130.320,66	78.313,90	1,93%	1,29%	1,93%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	4.869.730,39	0,00	0,00	4.930.295,14	60.564,75	1,24%	-	0,00%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	5.715.821,67	0,00	0,00	5.781.581,08	65.759,41	1,15%	4,79%	1,15%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	10.943.883,89	0,00	0,00	11.053.837,42	109.953,53	1,00%	-	0,00%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	13.279.070,61	0,00	11.000.000,00	2.319.091,17	40.020,56	0,30%	4,94%	2,65%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	5.292.732,92	0,00	0,00	5.291.800,28	-932,64	-0,02%	6,47%	-0,02%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	5.820.035,19	377.873,80	0,00	6.183.390,10	-14.518,89	-0,23%	5,72%	-0,20%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	5.991.307,37	0,00	0,00	5.950.956,42	-40.350,95	-0,67%	7,23%	-0,67%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	3.563.729,87	0,00	0,00	3.527.742,18	-35.987,69	-1,01%	5,87%	-1,01%
KINEA PIPE FI AÇÕES	2.881.258,04	0,00	0,00	2.769.842,69	-111.415,35	-3,87%	9,14%	-3,87%
Total Renda Variável					471.815,49	0,64%	5,85%	

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 (%)
TÍTULOS PÚBLICOS	242.720.835,28	0,00	3.412.561,28	249.777.428,40	10.469.154,40	4,34%	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	21.529.182,06	0,00	0,00	22.576.447,73	1.047.265,67	4,86%	4,86%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	18.677.417,39	0,00	0,00	19.590.067,22	912.649,83	4,89%	4,89%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	44.495.017,39	15.306.377,56	0,00	60.635.812,02	834.417,07	1,63%	1,75%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	51.519.195,44	0,00	0,00	52.341.686,25	822.490,81	1,60%	1,60%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.602.602,34	0,00	390.409,10	14.861.480,23	649.286,99	4,50%	4,52%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	32.828.752,78	2.350.042,63	10.000.000,00	25.770.838,72	592.043,31	1,72%	1,75%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	19.955.210,86	22.165.839,76	23.987.838,03	18.582.672,75	449.460,16	1,46%	1,75%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	24.244.500,00	0,00	653.642,71	24.040.080,00	449.222,71	1,87%	-0,84%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.816.525,00	0,00	272.643,46	9.781.957,50	238.075,96	2,45%	-0,35%
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.818.842,50	0,00	270.272,43	9.785.197,50	236.627,43	2,43%	-0,34%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.110.767,22	0,00	0,00	7.326.459,68	215.692,46	3,03%	3,03%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.593.305,41	0,00	0,00	5.787.677,49	194.372,08	3,48%	3,48%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.469.770,00	0,00	177.878,08	6.449.055,00	157.163,08	2,45%	-0,32%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	5.554.792,00	0,00	0,00	5.666.672,00	111.880,00	2,01%	2,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.368.044,18	0,00	38.624,13	1.354.619,18	25.199,13	1,86%	1,86%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00	12.000.000,00	0,00	12.012.185,02	12.185,02	0,10%	2,85%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	10.000.000,00	0,00	10.004.449,02	4.449,02	0,04%	3,52%
BRADESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	118.696,34	0,00	0,00	121.208,68	2.512,34	2,12%	2,12%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	755.188,16	0,00	723.839,41	33.064,52	1.715,77	1,81%	-95,62%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	97.387,34	0,00	0,00	98.932,50	1.545,16	1,59%	1,59%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	3.246,20	0,00	0,00	3.295,58	49,38	1,52%	1,52%
				Total Renda Fixa	17.427.457,78	3,30%	

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 (%)
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	12.208.941,04	0,00	11.000.000,00	2.319.091,17	1.110.150,13	9,09%	11,65%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	5.992.659,77	0,00	0,00	6.841.770,10	849.110,33	14,17%	14,17%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	5.243.394,98	377.873,80	0,00	6.183.390,10	562.121,32	10,74%	10,77%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	4.742.486,91	0,00	0,00	5.291.800,28	549.313,37	11,58%	11,58%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	4.877.362,52	0,00	0,00	5.350.343,63	472.981,11	9,70%	9,70%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	5.427.609,50	0,00	0,00	5.781.581,08	353.971,58	6,52%	6,52%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	10.816.217,16	0,00	0,00	11.053.837,42	237.620,26	2,20%	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	3.307.651,55	0,00	0,00	3.527.742,18	220.090,63	6,65%	6,65%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	0,00	4.000.000,00	0,00	4.130.320,66	130.320,66	3,26%	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	4.841.873,21	0,00	0,00	4.930.295,14	88.421,93	1,83%	0,00%
KINEA PIPE FI AÇÕES	3.287.923,99	0,00	377.873,80	2.769.842,69	-140.207,50	-4,71%	-15,76%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	6.130.934,68	0,00	0,00	5.950.956,42	-179.978,26	-2,94%	-2,94%
Total Renda Variável					4.253.915,56	6,01%	