

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 IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	64.202.365,21	6,62%	639	1,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	13.271.920,00	1,37%	17	7,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	1.477.948,82	0,15%	52	0,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	42.427.992,26	4,38%	729	0,56%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	1.027.945,48	0,11%	122	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	511.560,76	0,05%	192	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	54.555.578,68	5,63%	203	4,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	30.873.899,60	3,19%	114	6,56%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	45.262.226,14	4,67%	590	0,95%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	48.072.876,21	4,96%	214	1,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2030	10.404.560,00	1,07%	34	5,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.882.604,96	0,19%	167	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	46.329.131,90	4,78%	753	1,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	41.716.053,75	4,30%	1.219	0,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	12.647.150,00	1,30%	45	5,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	37.460.483,07	3,86%	343	1,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	53.502.721,72	5,52%	1.417	0,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	67.515.428,22	6,97%	732	1,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	18.151.044,43	1,87%	363	0,82%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	15.908.446,63	1,64%	713	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	21.094.034,08	2,18%	239	1,89%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	54.997.971,32	5,67%	307	2,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "

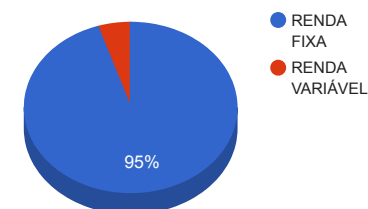
Carteira consolidada de investimentos - base (março / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	7.475.235,35	0,77%	250	1,43%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	49.262.784,77	5,08%	734	1,29%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	34.269.959,41	3,54%	722	0,55%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	70.894.488,58	7,31%	435	3,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.555.084,08	0,47%	661	0,36%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	66.416.178,11	6,85%	177	5,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CASAN SANEAMENTO FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	4.497.690,93	0,46%	27	2,08%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	D+4	Não há	14.792.562,61	1,53%	79	11,38%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	15.899.977,00	1,64%	110	6,24%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	10.106.616,89	1,04%	147	3,84%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	2.533.862,80	0,26%	3.906	0,80%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	5.297.334,85	0,55%	19	5,67%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
TOTAL -			969.295.718,62				

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

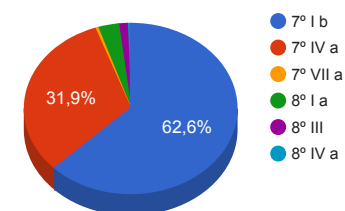
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	607.201.937,84	62,64%	15,00%	25,00%	70,00%	71.305.065,19
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	581.577.431,17
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	308.965.735,70	31,88%	5,00%	10,00%	30,00%	-18.177.020,11
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	7,00%	15,00%	15,00%	145.394.357,79
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	4.497.690,93	0,46%	2,00%	5,00%	5,00%	43.967.095,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	48.464.785,93
Total Renda Fixa	100,00%	920.665.364,47	94,98%	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%	30.692.539,61	3,17%	2,00%	5,00%	10,00%	66.237.032,25
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	10,00%	96.929.571,86
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	12.640.479,69	1,30%	7,00%	10,00%	10,00%	84.289.092,17
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	5.297.334,85	0,55%	2,00%	5,00%	5,00%	43.167.451,08
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	48.464.785,93
Total Renda Variável	30,00%	48.630.354,15	5,02%	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 " b "	607.201.937,84	62,64%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	308.965.735,70	31,88%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	4.497.690,93	0,46%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	920.665.364,47	94,98%	36,00	190,00

Artigos - Renda Variável	Base: março / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30.692.539,61	3,17%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	12.640.479,69	1,30%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5.297.334,85	0,55%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	48.630.354,15	5,02%	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	595.977.186,80	61,49%	0,15%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	373.318.531,82	38,51%	0,03%

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%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,60%	3,47%	3,47%	4,94%	11,79%	27,36%	0,20%	1,068%	3,49%
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%	-	-	-
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%
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%
IRF-M	1,32%	3,77%	3,77%	5,26%	12,87%	36,62%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,30%	3,74%	3,74%	5,16%	12,58%	36,15%	0,20%	0,758%	4,45%
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 Geral	0,96%	3,47%	3,47%	4,52%	10,78%	31,65%	-	-	-
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%	4,35%
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%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,93%	3,36%	3,36%	4,34%	10,53%	31,38%	0,20%	0,682%	4,50%
IMA-B	0,94%	4,94%	4,94%	4,60%	10,73%	34,61%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,19%	3,16%	3,16%	2,76%	7,09%	21,19%	0,20%	1,535%	7,60%

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 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,64%	0,69%	0,69%	2,31%	6,16%	15,96%	0,20%	1,090%	5,15%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,27%	2,92%	2,92%	4,44%	10,67%	26,52%	0,20%	0,732%	3,11%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92%	4,87%	4,87%	4,50%	10,60%	34,46%	0,30%	1,438%	9,06%
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%
IPCA + 9,00% ao ano	0,81%	2,82%	2,82%	6,19%	11,73%	27,40%	-	-	-
CASAN SANEAMENTO FIDC SÊNIOR	-1,16%	-3,78%	-3,78%	-7,34%	-10,75%	-10,95%	0,45%	3,878%	-
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%	0,64%
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%
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%	6,27%
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%	2,60%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,74%	-0,39%	-0,39%	2,02%	2,93%	7,75%	0,20%	0,039%	4,04%
CDI	0,53%	1,59%	1,59%	3,37%	8,39%	23,30%	-	-	-

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

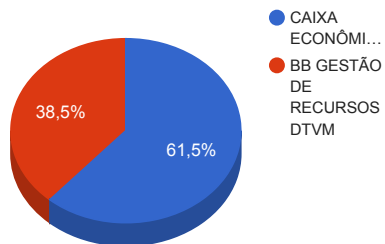
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,54%	1,59%	1,59%	3,45%	8,48%	23,44%	0,20%	0,010%	0,11%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,52%	1,54%	1,54%	3,32%	8,27%	23,13%	0,20%	0,007%	0,14%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,51%	1,53%	1,53%	3,30%	8,32%	23,24%	0,20%	0,007%	0,11%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,46%	1,38%	1,38%	2,97%	7,53%	21,30%	0,80%	0,003%	0,10%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,44%	1,32%	1,32%	2,84%	7,29%	21,16%	1,00%	0,004%	0,10%
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 Variável e Benchmark's - base (março / 2018)

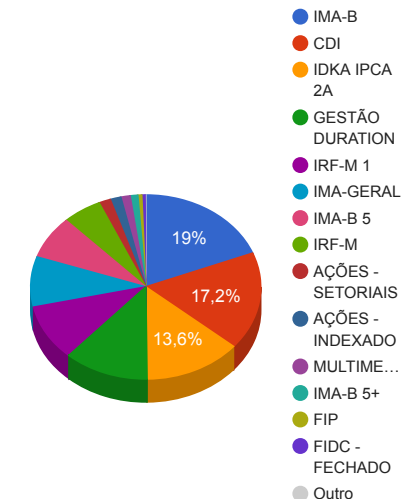
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,53%	1,59%	1,59%	3,37%	8,39%	23,30%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,86%	1,78%	1,78%	4,07%	11,20%	26,82%	0,60%	0,379%	2,41%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,30%	4,17%	4,17%	6,26%	13,65%	33,53%	1,00%	1,869%	6,35%
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%	19,35%
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%
Não Possui	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	0,001%	17,69%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	595.977.186,80	61,49%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	373.318.531,82	38,51%



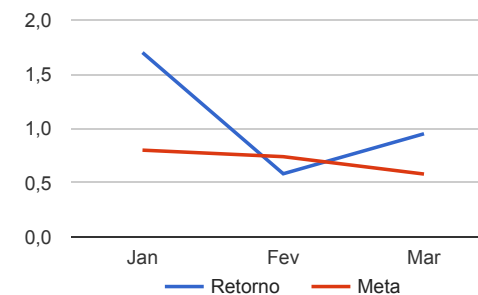
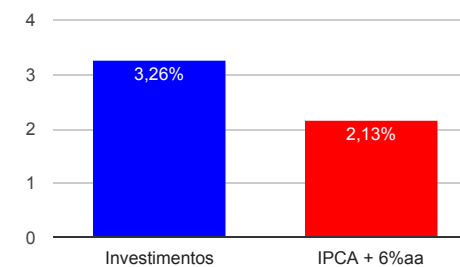
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	184.315.837,22	19,02%
CDI	166.457.552,19	17,17%
IDKA IPCA 2A	132.229.354,19	13,64%
GESTÃO DURATION	114.489.054,32	11,81%
IRF-M 1	95.218.775,47	9,82%
IMA-GERAL	85.429.478,28	8,81%
IMA-B 5	73.226.186,69	7,55%
IRF-M	53.368.929,70	5,51%
AÇÕES - SETORIAIS	15.899.977,00	1,64%
AÇÕES - INDEXADO	14.792.562,61	1,53%
MULTIMERCADO	12.640.479,69	1,30%
IMA-B 5+	10.404.560,00	1,07%
FIP	5.297.334,85	0,55%
FIDC - FECHADO	4.497.690,93	0,46%
IDKA IPCA 3A	1.027.945,48	0,11%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	933.648.480,12	14.230.629,36	13.710.840,62	950.031.832,33	15.863.563,47	1,70%	0,80%	211,88%	0,94%
Fevereiro	950.031.832,33	31.465.524,43	35.002.606,62	952.031.956,71	5.537.206,57	0,58%	0,74%	78,93%	1,21%
Março	952.031.956,71	28.016.920,03	19.882.549,32	969.295.718,62	9.129.391,20	0,95%	0,58%	164,73%	0,91%
Acumulado no ano					30.530.161,24	3,26%	2,13%	153,08%	

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 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.987.500,00	0,00	0,00	13.271.920,00	284.420,00	2,19%	1,54%	2,19%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.448.798,57	0,00	0,00	1.477.948,82	29.150,25	2,01%	1,44%	2,01%
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.443.570,00	0,00	0,00	12.647.150,00	203.580,00	1,64%	1,09%	1,64%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	17.864.793,00	0,00	0,00	18.151.044,43	286.251,43	1,60%	1,07%	1,60%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	40.765.239,93	1.000.000,00	0,00	42.427.992,26	662.752,33	1,59%	1,06%	1,60%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	63.243.610,71	0,00	0,00	64.202.365,21	958.754,50	1,52%	0,98%	1,52%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	66.529.313,21	0,00	0,00	67.515.428,22	986.115,01	1,48%	0,94%	1,48%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.704.105,99	0,00	0,00	15.908.446,63	204.340,64	1,30%	0,76%	1,30%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	35.986.702,79	1.000.000,00	0,00	37.460.483,07	473.780,28	1,28%	0,73%	1,30%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.859.073,61	0,00	0,00	1.882.604,96	23.531,35	1,27%	0,73%	1,27%
CASAN SANEAMENTO FIDC SÊNIOR	4.550.537,68	0,00	107.766,56	4.497.690,93	54.919,81	1,21%	3,88%	-1,16%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	64.648.591,93	1.000.000,00	0,00	66.416.178,11	767.586,18	1,17%	0,71%	1,18%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.016.758,98	0,00	0,00	1.027.945,48	11.186,50	1,10%	0,57%	1,10%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	47.597.637,92	0,00	0,00	48.072.876,21	475.238,29	1,00%	0,75%	1,00%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	54.052.573,48	0,00	0,00	54.555.578,68	503.005,20	0,93%	0,68%	0,93%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	30.590.353,66	0,00	0,00	30.873.899,60	283.545,94	0,93%	0,68%	0,93%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.901.212,49	0,00	0,00	21.094.034,08	192.821,59	0,92%	1,44%	0,92%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	45.908.422,04	0,00	0,00	46.329.131,90	420.709,86	0,92%	1,45%	0,92%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	54.502.162,33	0,00	0,00	54.997.971,32	495.808,99	0,91%	1,43%	0,91%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	44.859.713,36	0,00	0,00	45.262.226,14	402.512,78	0,90%	1,45%	0,90%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.328.472,00	0,00	0,00	10.404.560,00	76.088,00	0,74%	0,04%	0,74%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	52.165.579,62	1.000.000,00	0,00	53.502.721,72	337.142,10	0,63%	0,13%	0,64%

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	41.453.322,66	0,00	0,00	41.716.053,75	262.731,09	0,63%	0,13%	0,63%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	508.648,49	0,00	0,00	511.560,76	2.912,27	0,57%	0,11%	0,57%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	48.998.403,98	0,00	0,00	49.262.784,77	264.380,79	0,54%	0,01%	0,54%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	34.094.376,96	0,00	0,00	34.269.959,41	175.582,45	0,51%	0,01%	0,51%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	73.410.431,43	1.818.000,00	4.715.750,00	70.894.488,58	381.807,15	0,51%	0,01%	0,52%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.881.831,06	15.011,97	2.370.710,07	4.555.084,08	28.951,12	0,42%	0,00%	0,44%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	502.231,42	19.643.908,06	12.688.322,69	7.475.235,35	17.418,56	0,09%	0,00%	0,46%
Total Renda Fixa					9.267.024,46	1,02%	0,74%	

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(%)
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	10.020.291,68	0,00	0,00	10.106.616,89	86.325,21	0,86%	0,38%	0,86%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	5.304.599,98	0,00	0,00	5.297.334,85	-7.265,13	-0,14%	0,00%	-0,14%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,00	2.540.000,00	0,00	2.533.862,80	-6.137,20	-0,24%	1,87%	0,30%
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	14.840.917,72	0,00	0,00	14.792.562,61	-48.355,11	-0,33%	6,77%	-0,33%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	16.062.178,03	0,00	0,00	15.899.977,00	-162.201,03	-1,01%	5,87%	-1,01%
Total Renda Variável					-137.633,26	-0,28%	4,15%	

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	52.448.211,15	0,00	0,00	54.997.971,32	2.549.760,17	4,86%	4,86%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	44.170.779,19	0,00	0,00	46.329.131,90	2.158.352,71	4,89%	4,89%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	43.162.623,22	0,00	0,00	45.262.226,14	2.099.602,92	4,86%	4,86%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	65.527.760,27	0,00	0,00	67.515.428,22	1.987.667,95	3,03%	3,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	62.293.385,74	0,00	0,00	64.202.365,21	1.908.979,47	3,06%	3,06%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	60.939.621,23	3.677.000,00	0,00	66.416.178,11	1.799.556,88	2,83%	2,85%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	52.775.671,91	0,00	0,00	54.555.578,68	1.779.906,77	3,37%	3,37%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	36.220.108,96	10.432.000,00	0,00	48.072.876,21	1.420.767,25	3,44%	3,52%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	37.552.583,19	3.500.000,00	0,00	42.427.992,26	1.375.409,07	3,43%	3,48%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	35.089.884,55	1.000.000,00	0,00	37.460.483,07	1.370.598,52	3,87%	3,89%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	74.530.746,19	4.179.000,00	8.948.750,00	70.894.488,58	1.133.492,39	1,52%	1,54%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	29.870.943,75	0,00	0,00	30.873.899,60	1.002.955,85	3,36%	3,36%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.114.176,98	0,00	0,00	21.094.034,08	979.857,10	4,87%	4,87%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	50.003.048,88	2.600.000,00	0,00	53.502.721,72	899.672,84	1,74%	1,75%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	58.408.278,80	0,00	10.000.000,00	49.262.784,77	854.505,97	1,56%	1,59%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.865.850,00	0,00	332.078,92	13.271.920,00	738.148,92	5,79%	3,16%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	40.997.027,67	0,00	0,00	41.716.053,75	719.026,08	1,75%	1,75%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	17.542.163,77	0,00	0,00	18.151.044,43	608.880,66	3,47%	3,47%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.335.408,45	0,00	0,00	15.908.446,63	573.038,18	3,74%	3,74%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	32.161.667,93	1.600.000,00	0,00	34.269.959,41	508.291,48	1,52%	1,53%
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.560.100,00	0,00	325.427,57	12.647.150,00	412.477,57	3,33%	0,69%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.445.296,00	0,00	295.815,57	10.404.560,00	255.079,57	2,46%	-0,39%

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 (%)
CASAN SANEAMENTO FIDC SÊNIOR	4.674.243,23	0,00	343.664,63	4.497.690,93	167.112,33	3,66%	-3,78%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.387.072,91	10.141.507,09	14.074.314,35	4.555.084,08	100.818,43	1,08%	1,32%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.409.919,35	0,00	0,00	1.477.948,82	68.029,47	4,83%	4,83%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.879.614,12	0,00	51.094,62	1.882.604,96	54.085,46	2,91%	2,92%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	4.632.837,67	34.043.566,73	31.250.124,02	7.475.235,35	48.954,97	0,33%	1,38%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.029.677,29	0,00	28.140,80	1.027.945,48	26.408,99	2,59%	2,60%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	516.630,59	0,00	14.586,08	511.560,76	9.516,25	1,86%	1,86%
Total Renda Fixa					27.610.954,22	3,10%	

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 (%)
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	15.518.431,58	0,00	2.500.000,00	14.792.562,61	1.774.131,03	11,47%	12,34%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	14.908.000,87	0,00	0,00	15.899.977,00	991.976,13	6,65%	6,65%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	10.358.416,47	0,00	432.000,00	10.106.616,89	180.200,42	1,78%	1,78%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,00	2.540.000,00	0,00	2.533.862,80	-6.137,20	-0,24%	4,17%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	5.318.298,21	0,00	0,00	5.297.334,85	-20.963,36	-0,39%	-
Total Renda Variável					2.919.207,02	6,34%	