

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 TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	844.934,38	0,37%	192	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	29.781.669,09	12,90%	1.219	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	15.901.371,28	6,89%	729	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.485.461,31	3,67%	753	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	983.868,43	0,43%	65	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	10.037.098,95	4,35%	732	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	256.651,08	0,11%	62	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.741.651,46	3,79%	639	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	78.672.304,37	34,07%	1.417	0,49%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.873.360,65	1,68%	713	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	10.485.975,35	4,54%	177	0,80%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	33.871.657,80	14,67%	722	0,54%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	847.435,24	0,37%	734	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.567.339,87	4,14%	307	0,38%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRASESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.518.136,04	1,52%	98	0,52%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou D+1461	Não há	664.774,29	0,29%	17	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	62.106,27	0,03%	47	0,42%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PRASS II FIDC SÊNIOR	D+540	Não há	1.623.809,45	0,70%	21	1,03%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	3.446,39	0,00%		0,31%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.236.399,40	0,54%	20	2,72%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.134.439,57	0,49%	1.406	1,21%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	2.453.730,29	1,06%	3.403	0,80%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

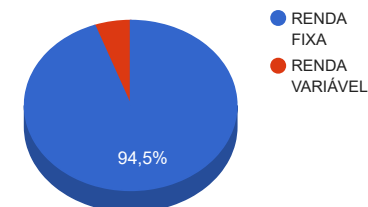
Carteira consolidada de investimentos - base (março / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.127.601,62	0,49%	639	1,40%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	1.252.712,89	0,54%	35	0,53%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	43832	3.092.626,25	1,34%	729	1,20%	Artigo 8º, Inciso III
ÁTICO FLORESTAL MULTIELABOR FIP	Não se aplica	Não se aplica	1.238.512,54	0,54%	21	0,71%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	1.160.000,00	0,50%		0,63%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
TOTAL -			230.919.074,26				

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

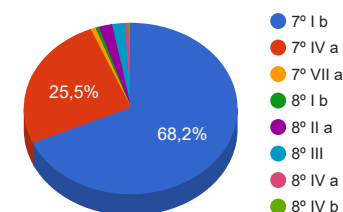
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	157.578.371,00	68,24%	40,00%	65,00%	70,00%	4.064.980,98
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	20,00%	46.183.814,85
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	58.955.318,59	25,53%	10,00%	12,00%	40,00%	33.412.311,11
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	1.689.362,11	0,73%	0,00%	0,00%	3,00%	5.238.210,12
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	11.545.953,71
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	2,00%	4.618.381,49
Em Enquadramento - RF	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	2,00%	4.618.381,49
Total Renda Fixa	100,00%	218.223.051,70	94,50%	55,00	90,00	217,00	-

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%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	15,00%	34.637.861,14
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	30,00%	1.236.399,40	0,54%	0,00%	0,00%	10,00%	21.855.508,03
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	4.715.771,48	2,04%	1,00%	2,00%	15,00%	29.922.089,66
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	11.545.953,71
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	4.345.339,14	1,88%	0,00%	5,00%	10,00%	18.746.568,29
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	1.238.512,54	0,54%	0,00%	1,00%	3,00%	5.689.059,69
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	1.160.000,00	0,50%	0,00%	1,00%	2,00%	3.458.381,49
Desenquadrado - RV	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	2,00%	4.618.381,49
Em Enquadramento - RV	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	2,00%	4.618.381,49
Total Renda Variável	30,00%	12.696.022,56	5,50%	1,00	14,00	64,00	-

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 "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	157.578.371,00	68,24%	40,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	2,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	58.955.318,59	25,53%	10,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	1.689.362,11	0,73%	0,00%	3,00%
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%
Desenquadrado - RF	0,00	0,00%	0,00%	2,00%
Em Enquadramento - RF	0,00	0,00%	0,00%	2,00%
Total Renda Fixa	218.223.051,70	94,50%	55,00	219,00

Artigos - Renda Variável	Base: março / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	1.236.399,40	0,54%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	4.715.771,48	2,04%	1,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso III	4.345.339,14	1,88%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	1.238.512,54	0,54%	0,00%	3,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	1.160.000,00	0,50%	0,00%	2,00%
Desenquadrado - RV	0,00	0,00%	0,00%	2,00%
Em Enquadramento - RV	0,00	0,00%	0,00%	2,00%
Total Renda Variável	12.696.022,56	5,50%	1,00	64,00

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	175.930.558,57	76,19%	0,04%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	45.384.498,31	19,65%	0,00%
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	3.518.136,04	1,52%	0,00%
QUATÁ INVESTIMENTOS	1.623.809,45	0,70%	0,21%
WESTERN ASSET	1.252.712,89	0,54%	0,00%
ITAÚ UNIBANCO	1.240.519,51	0,54%	0,00%
ÁTICO ASSET MANAGEMENT	1.238.512,54	0,54%	0,49%
TMJ CAPITAL	664.774,29	0,29%	0,19%
VILA RICA CAPITAL	62.106,27	0,03%	0,08%
BRASIL PLURAL	3.446,39	0,00%	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%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	1,58%	3,42%	3,42%	4,85%	11,53%	26,76%	0,40%	1,063%	3,48%
IDKA IPCA 2 Anos	1,59%	3,01%	3,01%	5,31%	12,41%	28,22%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,52%	3,06%	3,06%	4,97%	11,52%	26,84%	0,20%	0,980%	2,67%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,48%	3,03%	3,03%	5,01%	11,50%	26,80%	0,20%	0,939%	2,73%
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%
IMA-B	0,94%	4,94%	4,94%	4,60%	10,73%	34,61%	-	-	-
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	1,48%	4,70%	4,70%	5,69%	12,07%	30,08%	1,30%	1,283%	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%
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%
CDI + 3,50% ao ano	0,82%	2,44%	2,44%	5,11%	12,11%	32,01%	-	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-5,06%	-38,90%	-38,90%	-21,69%	-34,08%	-82,66%	0,39%	-	-
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%	-	-	-

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

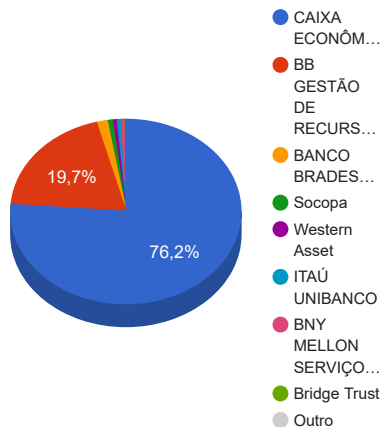
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,65%	1,75%	1,75%	3,56%	9,14%	24,30%	0,20%	0,133%	0,66%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,64%	1,74%	1,74%	3,54%	9,14%	24,11%	0,20%	0,124%	0,64%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,64%	1,75%	1,75%	3,57%	9,16%	24,36%	0,20%	0,127%	0,64%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,63%	1,75%	1,75%	3,55%	9,11%	24,19%	0,10%	0,128%	0,65%
IPCA + 7,00% ao ano	0,66%	2,36%	2,36%	5,25%	9,72%	22,80%	-	-	-
PRASS II FIDC SÊNIOR	0,71%	2,13%	2,13%	4,55%	11,40%	26,90%	1,70%	0,004%	-
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%
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%
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)

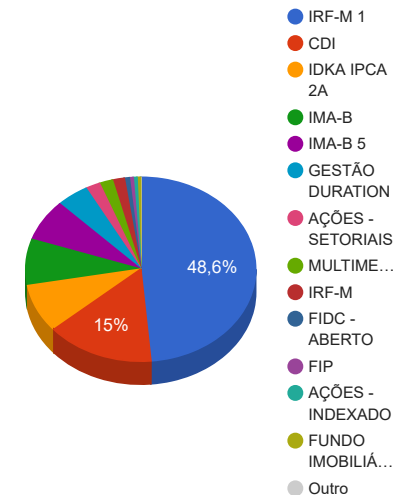
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	2,00%	5,89%	5,89%	6,15%	15,97%	58,68%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1,93%	8,41%	8,41%	5,46%	10,48%	41,47%	1,20%	7,884%	22,00%
IDIV	1,05%	10,36%	10,36%	8,41%	21,26%	88,12%	-	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-1,81%	3,50%	3,50%	5,47%	18,96%	34,10%	1,50%	5,488%	18,10%
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%	1,56%
SMLL	0,07%	4,03%	4,03%	7,03%	33,83%	91,97%	-	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-0,52%	3,71%	3,71%	6,93%	34,00%	80,37%	1,50%	5,462%	17,92%
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 ETF IBOVESPA FI AÇÕES	0,04%	11,51%	11,51%	14,31%	30,33%	68,88%	0,50%	6,557%	19,05%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	-0,88%	6,11%	6,11%	6,94%	18,53%	56,27%	2,00%	6,746%	19,22%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ÁTICO FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	0,002%	0,01%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	175.930.558,57	76,19%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	45.384.498,31	19,65%
BANCO BRADESCO	3.518.136,04	1,52%
Socopa	1.623.809,45	0,70%
Western Asset	1.252.712,89	0,54%
ITAÚ UNIBANCO	1.240.519,51	0,54%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	1.238.512,54	0,54%
Bridge Trust	664.774,29	0,29%
BRL Trust Investimentos	62.106,27	0,03%
Geração Futuro	3.446,39	0,00%



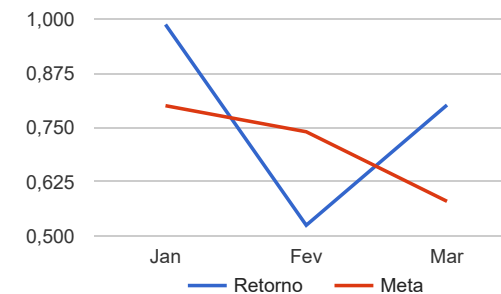
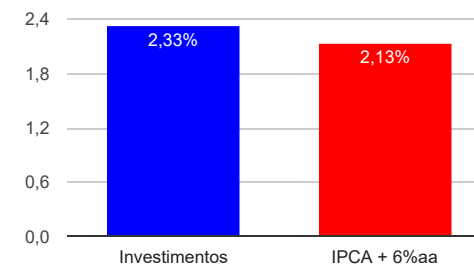
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	112.228.760,58	48,60%
CDI	34.719.093,04	15,04%
IDKA IPCA 2A	19.623.684,79	8,50%
IMA-B	18.717.575,47	8,11%
IMA-B 5	16.885.239,71	7,31%
GESTÃO DURATION	10.485.975,35	4,54%
AÇÕES - SETORIAIS	4.715.771,48	2,04%
MULTIMERCADO	4.345.339,14	1,88%
IRF-M	3.873.360,65	1,68%
FIDC - ABERTO	1.623.809,45	0,70%
FIP	1.238.512,54	0,54%
AÇÕES - INDEXADO	1.236.399,40	0,54%
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.160.000,00	0,50%
FIDC - FECHADO	65.552,66	0,03%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	218.358.197,99	3.256.598,24	584.529,28	223.211.271,45	2.181.004,50	0,99%	0,80%	123,12%	0,58%
Fevereiro	223.211.271,45	32.046.177,92	29.063.833,93	227.380.909,32	1.187.293,88	0,52%	0,74%	71,09%	0,64%
Março	227.380.909,32	5.700.509,83	3.998.503,56	230.919.074,26	1.836.158,67	0,80%	0,58%	138,87%	0,60%
Acumulado no ano					5.204.457,05	2,33%	2,13%	109,32%	

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 IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15.651.020,78	0,00	0,00	15.901.371,28	250.350,50	1,60%	1,06%	1,60%	
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	968.534,52	0,00	0,00	983.868,43	15.333,91	1,58%	1,06%	1,58%	
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.611.109,58	0,00	0,00	8.741.651,46	130.541,88	1,52%	0,98%	1,52%	
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	655.062,97	0,00	0,00	664.774,29	9.711,32	1,48%	1,28%	1,48%	
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.890.499,36	0,00	0,00	10.037.098,95	146.599,59	1,48%	0,94%	1,48%	
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.823.608,16	0,00	0,00	3.873.360,65	49.752,49	1,30%	0,76%	1,30%	
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	10.364.003,16	0,00	0,00	10.485.975,35	121.972,19	1,18%	0,71%	1,18%	
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	9.481.089,90	0,00	0,00	9.567.339,87	86.249,97	0,91%	1,43%	0,91%	
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.420.167,11	3.000.000,00	0,00	8.485.461,31	65.294,20	0,78%	1,45%	0,92%	
PRASS II FIDC SÊNIOR	1.612.320,84	0,00	0,00	1.623.809,45	11.488,61	0,71%	0,00%	0,71%	
BRADERCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	3.495.440,73	0,00	0,00	3.518.136,04	22.695,31	0,65%	0,13%	0,65%	
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	255.012,13	0,00	0,00	256.651,08	1.638,95	0,64%	0,12%	0,64%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	78.172.662,07	0,00	0,00	78.672.304,37	499.642,30	0,64%	0,13%	0,64%	
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	29.594.101,73	0,00	0,00	29.781.669,09	187.567,36	0,63%	0,13%	0,63%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	840.124,26	0,00	0,00	844.934,38	4.810,12	0,57%	0,11%	0,57%	
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	842.887,27	0,00	0,00	847.435,24	4.547,97	0,54%	0,01%	0,54%	
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	34.983.567,70	2.700.509,83	3.987.632,59	33.871.657,80	175.212,86	0,46%	0,01%	0,51%	
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	65.418,41	0,00	3.104,23	62.106,27	-207,91	-0,32%	-	-	
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	4.655,87	0,00	766,74	3.446,39	-442,74	-9,51%	28,47%	-25,98%	
Total Renda Fixa						1.782.758,88	0,82%	0,40%	

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	1.138.000,00	0,00	7.000,00	1.160.000,00	29.000,00	2,55%	7,88%	1,93%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	3.033.987,80	0,00	0,00	3.092.626,25	58.638,45	1,93%	1,29%	1,93%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1.242.200,96	0,00	0,00	1.252.712,89	10.511,93	0,85%	0,80%	0,85%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	1.235.955,75	0,00	0,00	1.236.399,40	443,65	0,04%	6,56%	0,04%
ÁTICO FLORESTAL MULTISTRATÉGIA FIP	1.240.093,21	0,00	0,00	1.238.512,54	-1.580,67	-0,13%	0,00%	-0,13%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	2.466.444,87	0,00	0,00	2.453.730,29	-12.714,58	-0,52%	5,46%	-0,52%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	1.137.559,33	0,00	0,00	1.127.601,62	-9.957,71	-0,88%	6,75%	-0,88%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.155.380,85	0,00	0,00	1.134.439,57	-20.941,28	-1,81%	5,49%	-1,81%
Total Renda Variável					53.399,79	0,42%	3,90%	

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	72.362.912,09	5.000.000,00	0,00	78.672.304,37	1.309.392,28	1,73%	1,75%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	53.605.380,74	9.979.194,46	30.415.980,16	33.871.657,80	703.062,76	1,38%	1,53%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	29.268.346,41	0,00	0,00	29.781.669,09	513.322,68	1,75%	1,75%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.435.143,78	5.000.000,00	0,00	15.901.371,28	466.227,50	3,45%	3,48%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.741.604,71	0,00	0,00	10.037.098,95	295.494,24	3,03%	3,03%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	4.292.292,52	5.000.000,00	0,00	9.567.339,87	275.047,35	4,76%	4,86%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.481.729,06	0,00	0,00	8.741.651,46	259.922,40	3,06%	3,06%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	5.259.622,55	5.000.000,00	0,00	10.485.975,35	226.352,80	2,70%	2,85%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.285.991,11	8.000.000,00	3.000.000,00	8.485.461,31	199.470,20	4,46%	4,89%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.733.838,32	0,00	0,00	3.873.360,65	139.522,33	3,74%	3,74%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	101.650,07	0,00	108.647,56	62.106,27	69.103,76	67,69%	-38,90%
BRANCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	3.457.716,70	0,00	0,00	3.518.136,04	60.419,34	1,75%	1,75%
PRASS II FIDC SÊNIOR	1.589.920,94	0,00	0,00	1.623.809,45	33.888,51	2,13%	2,13%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	951.287,05	0,00	0,00	983.868,43	32.581,38	3,42%	3,42%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	634.940,62	0,00	0,00	664.774,29	29.833,67	4,70%	4,70%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	853.308,12	0,00	24.091,53	844.934,38	15.717,79	1,86%	1,86%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	810.337,29	24.091,53	0,00	847.435,24	13.006,42	1,58%	1,59%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	252.269,15	0,00	0,00	256.651,08	4.381,93	1,74%	1,74%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	78.715,09	0,00	75.447,52	3.446,39	178,82	1,81%	-95,62%
				Total Renda Fixa	4.646.926,16	2,19%	

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 ETF IBOVESPA FI AÇÕES	1.108.808,94	0,00	0,00	1.236.399,40	127.590,46	11,51%	11,51%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.070.000,00	0,00	22.700,00	1.160.000,00	112.700,00	10,56%	8,41%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	0,00	3.000.000,00	0,00	3.092.626,25	92.626,25	3,09%	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	2.366.036,80	0,00	0,00	2.453.730,29	87.693,49	3,71%	3,71%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	1.062.687,02	0,00	0,00	1.127.601,62	64.914,60	6,11%	6,11%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.096.082,69	0,00	0,00	1.134.439,57	38.356,88	3,50%	3,50%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1.214.402,60	0,00	0,00	1.252.712,89	38.310,29	3,15%	3,15%
ÁTICO FLORESTAL MULTIELSTRATÉGIA FIP	1.243.173,62	0,00	0,00	1.238.512,54	-4.661,08	-0,37%	-
Total Renda Variável					557.530,89	5,87%	