

Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2018



Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.823.608,16	1,68%	698	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	29.594.101,73	13,02%	1.225	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	15.651.020,78	6,88%	716	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.420.167,11	2,38%	745	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	968.534,52	0,43%	66	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	9.890.499,36	4,35%	727	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	255.012,13	0,11%	63	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.611.109,58	3,79%	632	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	78.172.662,07	34,38%	1.417	0,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	840.124,26	0,37%	192	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.495.440,73	1,54%	98	0,52%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	34.983.567,70	15,39%	733	0,54%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	10.364.003,16	4,56%	144	1,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	842.887,27	0,37%	748	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou D+1461	Não há	655.062,97	0,29%	17	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.481.089,90	4,17%	310	0,37%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	4.655,87	0,00%		0,31%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PRASS II FIDC SÊNIOR	D+540	Não há	1.612.320,84	0,71%	22	1,02%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	65.418,41	0,03%	47	0,42%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.235.955,75	0,54%	19	3,10%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.155.380,85	0,51%	1.348	1,55%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	2.466.444,87	1,08%	3.660	0,78%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

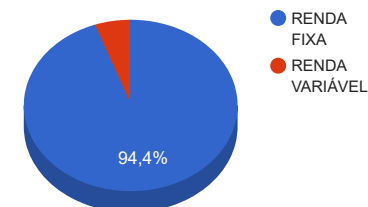
Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2018)

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	1.137.559,33	0,50%	598	1,51%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	1.242.200,96	0,55%	34	0,55%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	43832	3.033.987,80	1,33%	729	1,20%	Artigo 8º, Inciso III
ÁTICO FLORESTAL MULTIELABOR FIP	Não se aplica	Não se aplica	1.240.093,21	0,55%	21	0,71%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	1.138.000,00	0,50%		0,63%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
TOTAL -			227.380.909,32				

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

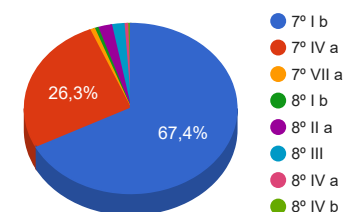
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	153.226.839,70	67,39%	40,00%	65,00%	70,00%	5.939.796,82
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	20,00%	45.476.181,86
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	59.822.051,73	26,31%	10,00%	12,00%	40,00%	31.130.312,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	1.682.395,12	0,74%	0,00%	0,00%	3,00%	5.139.032,16
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	11.369.045,47
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	2,00%	4.547.618,19
Em Enquadramento - RF	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	2,00%	4.547.618,19
Total Renda Fixa	100,00%	214.731.286,55	94,44%	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%	34.107.136,40
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	30,00%	1.235.955,75	0,54%	0,00%	0,00%	10,00%	21.502.135,18
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	4.759.385,05	2,09%	1,00%	2,00%	15,00%	29.347.751,35
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	11.369.045,47
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	4.276.188,76	1,88%	0,00%	5,00%	10,00%	18.461.902,17
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	1.240.093,21	0,55%	0,00%	1,00%	3,00%	5.581.334,07
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	1.138.000,00	0,50%	0,00%	1,00%	2,00%	3.409.618,19
Desenquadrado - RV	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	2,00%	4.547.618,19
Em Enquadramento - RV	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	2,00%	4.547.618,19
Total Renda Variável	30,00%	12.649.622,77	5,56%	1,00	14,00	64,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: fevereiro / 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 "	153.226.839,70	67,39%	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 "	59.822.051,73	26,31%	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 "	1.682.395,12	0,74%	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	214.731.286,55	94,44%	55,00	219,00

Artigos - Renda Variável	Base: fevereiro / 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 "	1.235.955,75	0,54%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	4.759.385,05	2,09%	1,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso III	4.276.188,76	1,88%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	1.240.093,21	0,55%	0,00%	3,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	1.138.000,00	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	12.649.622,77	5,56%	1,00	64,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (fevereiro / 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	172.850.948,90	76,02%	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	44.991.220,78	19,79%	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	3.495.440,73	1,54%	-
QUATÁ INVESTIMENTOS	1.612.320,84	0,71%	-
WESTERN ASSET	1.242.200,96	0,55%	-
ÁTICO ASSET MANAGEMENT	1.240.093,21	0,55%	-
ITAÚ UNIBANCO	1.223.546,65	0,54%	-
TMJ CAPITAL	655.062,97	0,29%	-
VILA RICA CAPITAL	65.418,41	0,03%	-
BRASIL PLURAL	4.655,87	0,00%	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M	1,10%	2,42%	3,69%	5,42%	13,07%	39,45%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10%	2,40%	3,66%	5,32%	12,77%	38,94%	0,20%	0,815%	4,49%
IPCA + 7,00% ao ano	0,81%	1,70%	2,69%	5,29%	9,96%	23,25%	-	-	-
PRASS II FIDC SÊNIOR	0,62%	1,41%	2,14%	4,70%	12,17%	27,59%	1,70%	0,005%	-
CDI + 3,50% ao ano	0,71%	1,60%	2,43%	5,21%	12,71%	32,85%	-	-	-
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-18,11%	-94,09%	-41,79%	-88,48%	-36,41%	-63,47%	0,20%	68,594%	985,55%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-52,33%	-35,64%	-10,79%	-20,11%	-32,54%	-82,02%	0,39%	93,124%	129,36%
IDKA IPCA 2 Anos	0,63%	1,40%	2,58%	4,61%	12,44%	26,40%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,57%	1,53%	2,41%	4,33%	11,41%	25,72%	0,20%	0,651%	2,63%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,56%	1,53%	2,40%	4,36%	11,42%	25,61%	0,20%	0,660%	2,69%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,24%	1,28%	1,64%	3,39%	9,43%	22,90%	0,20%	0,356%	1,65%
IMA-B	0,55%	3,97%	4,83%	5,51%	10,85%	40,45%	-	-	-
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	0,59%	3,92%	4,77%	5,45%	10,43%	39,60%	0,20%	1,827%	8,67%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,54%	3,93%	4,77%	5,39%	10,63%	39,99%	0,20%	1,843%	9,06%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	0,52%	3,17%	4,46%	5,46%	11,56%	30,05%	1,30%	1,255%	4,54%
IRF-M 1	0,54%	1,14%	1,71%	3,74%	9,85%	25,47%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,53%	1,11%	1,68%	3,65%	9,68%	25,09%	0,20%	0,075%	0,64%

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

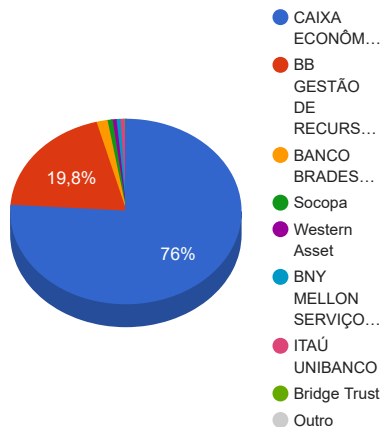
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,52%	1,11%	1,68%	3,63%	9,62%	24,91%	0,10%	0,074%	0,65%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,52%	1,09%	1,65%	3,62%	9,62%	24,87%	0,20%	0,072%	0,64%
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,51%	1,09%	1,65%	3,62%	9,64%	25,06%	0,20%	0,083%	0,66%
IMA-B 5	0,54%	1,88%	2,78%	4,42%	11,72%	26,68%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,53%	1,85%	2,73%	4,32%	11,52%	26,20%	0,20%	0,783%	3,43%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	0,51%	1,81%	2,68%	4,22%	11,28%	25,69%	0,40%	0,784%	3,43%
CDI	0,46%	1,05%	1,59%	3,48%	8,95%	24,07%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,47%	1,04%	1,63%	3,56%	9,05%	24,14%	0,20%	0,010%	0,12%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,44%	1,01%	1,54%	3,42%	8,91%	24,05%	0,20%	0,021%	0,12%
IPCA	0,32%	0,61%	1,05%	1,92%	2,84%	7,74%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,64%	1,66%	2,47%	4,01%	10,06%	-	0,002	0,447%	4,23%

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

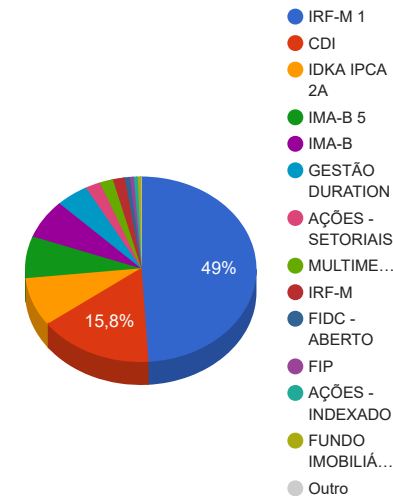
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	1,15%	3,82%	4,44%	10,91%	13,93%	69,83%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-2,32%	6,36%	6,36%	11,68%	5,37%	53,78%	1,20%	11,351%	23,15%
Ibovespa	0,52%	11,72%	18,59%	20,50%	28,04%	99,46%	-	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	1,18%	-	-	-	-	-	1,60%	0,532%	-
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	0,50%	11,47%	18,37%	19,73%	26,90%	96,80%	0,50%	11,197%	19,51%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	-0,22%	7,05%	11,62%	12,29%	18,56%	81,10%	2,00%	9,975%	19,41%
CDI	0,46%	1,05%	1,59%	3,48%	8,95%	24,07%	-	-	-
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1,16%	2,29%	2,88%	4,81%	8,04%	26,84%	2,00%	0,472%	1,58%
IDIV	-0,61%	9,21%	14,61%	13,85%	17,78%	124,49%	-	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,56%	5,41%	13,57%	10,58%	19,99%	56,15%	1,50%	7,918%	18,32%
SMLL	-0,37%	3,95%	11,26%	10,88%	31,79%	113,67%	-	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-0,31%	4,24%	11,74%	12,20%	32,52%	92,26%	1,50%	8,131%	18,31%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ÁTICO FLORESTAL MULTIELABORATÓRIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	0,002%	0,01%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	172.850.948,90	76,02%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	44.991.220,78	19,79%
BANCO BRADESCO	3.495.440,73	1,54%
Socopa	1.612.320,84	0,71%
Western Asset	1.242.200,96	0,55%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	1.240.093,21	0,55%
ITAÚ UNIBANCO	1.223.546,65	0,54%
Bridge Trust	655.062,97	0,29%
BRL Trust Investimentos	65.418,41	0,03%
Geração Futuro	4.655,87	0,00%



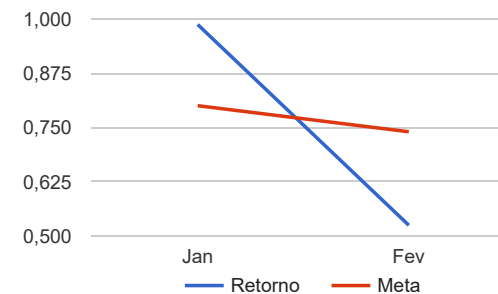
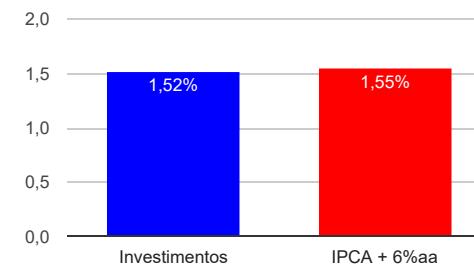
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	111.517.216,66	49,04%
CDI	35.826.454,97	15,76%
IDKA IPCA 2A	19.341.733,20	8,51%
IMA-B 5	16.619.555,30	7,31%
IMA-B	15.556.319,98	6,84%
GESTÃO DURATION	10.364.003,16	4,56%
AÇÕES - SETORIAIS	4.759.385,05	2,09%
MULTIMERCADO	4.276.188,76	1,88%
IRF-M	3.823.608,16	1,68%
FIDC - ABERTO	1.612.320,84	0,71%
FIP	1.240.093,21	0,55%
AÇÕES - INDEXADO	1.235.955,75	0,54%
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.138.000,00	0,50%
FIDC - FECHADO	70.074,28	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%
Acumulado no ano					3.368.298,38	1,52%	1,55%	98,13%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de fevereiro / 2018

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	5.685,86	0,00	1.749,25	4.655,87	719,26	12,65%	68,59%	-18,11%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.781.894,17	0,00	0,00	3.823.608,16	41.713,99	1,10%	0,81%	1,10%
PRASS II FIDC SÊNIOR	1.602.333,23	0,00	0,00	1.612.320,84	9.987,61	0,62%	0,00%	0,62%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.562.611,05	0,00	0,00	8.611.109,58	48.498,53	0,57%	0,65%	0,57%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.835.373,80	0,00	0,00	9.890.499,36	55.125,56	0,56%	0,66%	0,56%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	29.439.635,31	0,00	0,00	29.594.101,73	154.466,42	0,52%	0,07%	0,52%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	651.671,06	0,00	0,00	655.062,97	3.391,91	0,52%	1,25%	0,52%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	253.698,85	0,00	0,00	255.012,13	1.313,28	0,52%	0,07%	0,52%
BRAPRESIR IRF-M 1 FI RENDA FIXA	3.477.534,97	0,00	0,00	3.495.440,73	17.905,76	0,51%	0,08%	0,51%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	72.775.278,81	5.000.000,00	0,00	78.172.662,07	397.383,26	0,51%	0,07%	0,53%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.571.557,28	5.000.000,00	0,00	15.651.020,78	79.463,50	0,51%	0,78%	0,53%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	963.624,84	0,00	0,00	968.534,52	4.909,68	0,51%	0,78%	0,51%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	5.312.545,05	5.000.000,00	0,00	10.364.003,16	51.458,11	0,50%	0,45%	0,64%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	4.434.060,89	5.000.000,00	0,00	9.481.089,90	47.029,01	0,50%	1,83%	0,59%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	814.964,67	24.091,53	0,00	842.887,27	3.831,07	0,46%	0,01%	0,47%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	56.705.271,20	4.022.086,39	25.958.507,80	34.983.567,70	214.717,91	0,35%	0,02%	0,44%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.396.864,61	5.000.000,00	3.000.000,00	5.420.167,11	23.302,50	0,28%	1,84%	0,54%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	862.160,51	0,00	24.091,53	840.124,26	2.055,28	0,24%	0,36%	0,24%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	137.230,73	0,00	71.985,35	65.418,41	173,03	0,13%	93,12%	-52,33%
				Total Renda Fixa	1.157.445,67	0,54%	0,36%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de fevereiro / 2018

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1.227.945,65	0,00	0,00	1.242.200,96	14.255,31	1,16%	0,47%	1,16%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	0,00	3.000.000,00	0,00	3.033.987,80	33.987,80	1,13%	0,53%	1,18%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.148.895,34	0,00	0,00	1.155.380,85	6.485,51	0,56%	7,92%	0,56%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	1.229.772,85	0,00	0,00	1.235.955,75	6.182,90	0,50%	11,20%	0,50%
ÁTICO FLORESTAL MULTISTRATÉGIA FIP	1.241.453,65	0,00	0,00	1.240.093,21	-1.360,44	-0,11%	0,00%	-0,11%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	1.140.027,46	0,00	0,00	1.137.559,33	-2.468,13	-0,22%	9,97%	-0,22%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	2.474.179,61	0,00	0,00	2.466.444,87	-7.734,74	-0,31%	8,13%	-0,31%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.165.000,00	0,00	7.500,00	1.138.000,00	-19.500,00	-1,67%	11,35%	-2,32%
Total Renda Variável					29.848,21	0,24%	5,50%	