

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
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	17.116.456,26	5,13%	109	2,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	4.348.074,27	1,30%	52	1,49%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	5.044.877,58	1,51%	180	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.525.444,04	1,06%	203	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	822.633,36	0,25%	213	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	778.008,69	0,23%	17	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.131.757,57	0,94%	199	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	24.709.223,38	7,40%	727	0,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	5.820.234,23	1,74%	347	0,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	16.687.154,79	5,00%	745	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	3.101.099,84	0,93%	22	13,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.658.384,16	2,00%	1.417	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.485.884,60	2,24%	698	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.702.185,80	1,71%	632	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	4.209.896,06	1,26%	192	1,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	914.147,76	0,27%	716	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	2.626.519,62	0,79%	143	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	41.983.452,49	12,58%	223	1,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.415.760,58	0,42%	1.225	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.272.003,15	0,38%	427	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.208.288,10	1,26%	236	0,39%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.706.905,02	1,11%	36	1,57%	Artigo 7º, Inciso IV, 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
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.014.417,97	0,60%	18	2,88%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	2.906.947,50	0,87%	15	0,81%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRAPRESA IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.173.809,31	0,35%	98	0,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRAPRESA PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	16.212.596,55	4,86%	501	0,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRAPRESA INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	5.030.461,61	1,51%	81	1,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	6.905.555,29	2,07%	748	0,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	30.198.172,45	9,05%	144	2,91%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.648.575,98	0,49%	239	0,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	22.420.988,51	6,72%	310	0,88%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	1.792.072,97	0,54%	60	0,41%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	1.408.318,00	0,42%	100	0,61%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
XP INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	2.846.784,47	0,85%	4.867	0,68%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.804.339,27	0,54%	5.096	1,40%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRAPRESA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	10.412.603,01	3,12%	998	0,84%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	3.322.273,81	1,00%	33	5,81%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	3.534.273,63	1,06%	598	4,68%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	22.787.864,83	6,83%	3.660	7,16%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	D+4	Não há	3.341.270,86	1,00%	6.792	2,21%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	1.330.615,08	0,40%	43	1,13%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB CONSUMO FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.860.903,58	1,16%	3.040	2,63%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB CIELO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.773.712,54	0,53%	4.596	1,57%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	D+4	Não há	4.572.950,21	1,37%	7.189	0,55%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

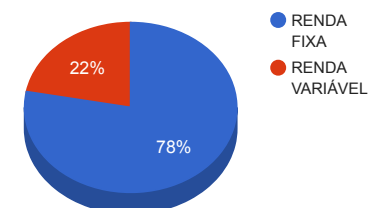
Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.753.301,31	0,53%	6.141	0,47%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	12.133.826,58	3,64%	13.782	0,93%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	3.297.888,94	0,99%	7	2,27%	Desenquadrado - RF
		TOTAL -	333.752.915,61				

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

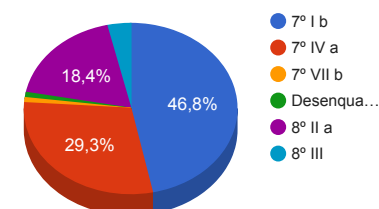
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	156.081.195,08	46,77%	15,00%	25,00%	70,00%	77.545.845,85
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	200.251.749,37
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	97.698.721,44	29,27%	5,00%	10,00%	30,00%	2.427.153,24
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	7,00%	15,00%	15,00%	50.062.937,34
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	16.687.645,78
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	3.200.390,97	0,96%	2,00%	5,00%	5,00%	13.487.254,81
Desenquadrado - RF	0,00%	3.297.888,94	0,99%	0,00%	0,00%	0,00%	-3.297.888,94
Total Renda Fixa	100,00%	260.278.196,43	77,99%	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%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	10,00%	33.375.291,56
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	61.340.892,60	18,38%	2,00%	5,00%	10,00%	-27.965.601,04
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	12.133.826,58	3,64%	7,00%	10,00%	10,00%	21.241.464,98
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	16.687.645,78
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	16.687.645,78
Total Renda Variável	30,00%	73.474.719,18	22,01%	15,00	30,00	40,00	-

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 " b "	156.081.195,08	46,77%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	97.698.721,44	29,27%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	3.200.390,97	0,96%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	3.297.888,94	0,99%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	260.278.196,43	77,99%	36,00	190,00

Artigos - Renda Variável	Base: fevereiro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	61.340.892,60	18,38%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	12.133.826,58	3,64%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	73.474.719,18	22,01%	15,00	40,00

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	163.473.365,21	48,98%	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	81.280.367,43	24,35%	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	53.652.831,76	16,08%	-
WESTERN ASSET	15.431.715,52	4,62%	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	12.407.602,41	3,72%	-
XP GESTÃO DE RECURSOS	4.600.085,78	1,38%	-
SAFRA ASSET MANAGEMENT	2.906.947,50	0,87%	-

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+	1,31%	2,88%	4,38%	6,02%	14,22%	47,09%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,41%	3,09%	4,52%	5,97%	13,86%	46,86%	0,20%	1,148%	5,87%
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 + 6,00% ao ano	0,74%	1,55%	2,47%	4,82%	8,94%	20,97%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,65%	1,74%	2,46%	4,76%	9,34%	22,24%	0,20%	0,160%	0,35%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,57%	2,76%	3,76%	4,57%	12,06%	35,67%	0,15%	1,306%	6,27%
IMA Geral ex-C	0,72%	2,41%	3,33%	4,83%	11,12%	35,03%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,76%	2,49%	3,42%	4,65%	10,51%	-	0,30%	0,871%	4,83%
IMA Geral	0,72%	2,48%	3,39%	4,91%	11,06%	34,86%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,73%	2,42%	3,31%	4,72%	10,84%	34,56%	0,20%	0,800%	4,37%
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 5+	0,56%	5,53%	6,36%	6,30%	10,78%	49,94%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,54%	5,48%	6,28%	6,15%	10,58%	49,15%	0,20%	2,744%	11,78%

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
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	0,53%	5,43%	6,24%	6,08%	10,23%	48,95%	0,20%	2,738%	12,06%
IMA-B	0,55%	3,97%	4,83%	5,51%	10,85%	40,45%	-	-	-
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	0,80%	4,41%	5,47%	5,77%	11,44%	41,79%	0,50%	2,091%	10,11%
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%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,55%	3,91%	4,79%	5,45%	10,73%	40,10%	0,30%	1,835%	9,08%
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%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,53%	3,92%	4,76%	5,36%	10,34%	39,46%	0,20%	1,848%	9,09%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,04%	0,95%	1,55%	2,03%	6,04%	23,40%	0,20%	4,322%	7,58%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,43%	-1,41%	-1,06%	0,64%	3,66%	9,89%	0,20%	4,703%	4,18%
IRF-M 1	0,54%	1,14%	1,71%	3,74%	9,85%	25,47%	-	-	-
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	0,65%	1,22%	1,85%	3,88%	9,89%	26,11%	0,50%	0,153%	1,07%
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%
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%
BRADERCO 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%	-	-	-
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,57%	1,90%	2,78%	4,30%	11,67%	26,64%	0,20%	0,779%	3,68%

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
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%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,52%	1,84%	2,73%	4,35%	11,51%	26,22%	0,10%	0,792%	3,44%
Selic	0,47%	1,05%	1,60%	3,49%	8,96%	24,10%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,49%	1,07%	1,60%	3,52%	9,37%	24,86%	0,20%	0,024%	0,14%
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 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,45%	1,02%	1,57%	3,46%	8,84%	23,93%	0,20%	0,005%	0,16%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,41%	0,92%	1,39%	3,08%	8,07%	22,06%	0,80%	0,003%	0,11%
IDKA IPCA 20 Anos	0,38%	8,97%	9,80%	8,07%	8,33%	84,19%	-	-	-
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,54%	6,76%	7,12%	6,46%	8,03%	62,30%	0,20%	3,859%	17,23%
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%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,60%	2,16%	3,00%	3,74%	-	-	0,40%	0,735%	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,58%	1,95%	2,99%	4,90%	13,03%	33,18%	0,20%	0,838%	4,03%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,42%	1,41%	1,83%	3,51%	8,92%	23,58%	0,20%	0,193%	1,26%

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

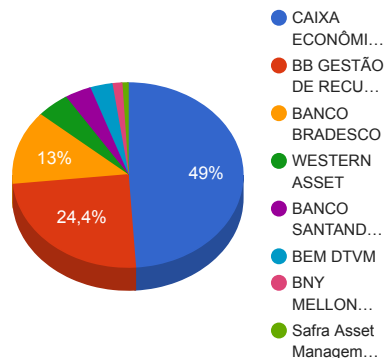
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	0,52%	11,72%	18,59%	20,50%	28,04%	99,46%	-	-	-
XP INVESTOR FI AÇÕES	2,05%	11,25%	18,96%	16,75%	27,88%	105,76%	2,00%	7,782%	18,37%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1,26%	11,36%	17,32%	21,40%	23,74%	72,51%	1,00%	11,412%	19,41%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	-0,22%	7,05%	11,62%	12,29%	18,56%	81,10%	2,00%	9,975%	19,41%
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	-0,78%	6,65%	12,53%	18,74%	27,91%	87,11%	2,00%	10,120%	18,30%
BB PIPE FIC AÇÕES	-3,55%	-0,13%	3,76%	6,73%	23,35%	55,14%	1,20%	8,545%	16,24%
CIELO ON NM - CIEL3	-10,01%	2,85%	6,16%	10,13%	9,86%	18,40%	-	-	-
BB CIELO FI AÇÕES	-9,96%	2,68%	5,85%	9,39%	8,43%	14,89%	1,50%	14,976%	26,75%
S&P 500	-3,89%	1,50%	2,50%	9,80%	14,64%	40,45%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-3,29%	1,92%	3,66%	12,30%	23,41%	70,05%	1,00%	12,586%	9,50%
ICON	-3,58%	-2,27%	4,39%	5,21%	24,82%	47,64%	-	-	-
BB CONSUMO FIC AÇÕES	-3,58%	-2,28%	4,26%	4,48%	23,02%	43,49%	1,00%	8,705%	17,32%
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	-3,44%	5,44%	11,75%	8,37%	8,22%	35,91%	-	-	-
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	-3,57%	5,08%	11,22%	7,46%	6,26%	31,00%	1,5%	13,715%	24,47%
IDIV	-0,61%	9,21%	14,61%	13,85%	17,78%	124,49%	-	-	-
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	1,65%	13,15%	19,69%	20,00%	25,83%	97,66%	1,50%	10,769%	18,82%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	-0,71%	4,73%	10,72%	7,62%	13,91%	71,76%	3,00%	7,150%	16,72%

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

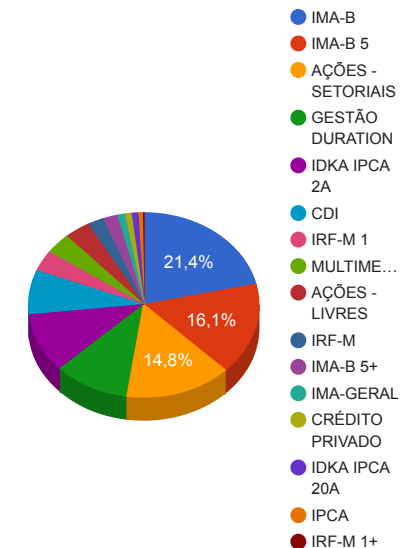
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFNC	-0,56%	18,62%	23,80%	24,75%	29,83%	117,76%	-	-	-
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	-0,53%	18,21%	23,30%	23,63%	27,67%	111,26%	1,00%	12,854%	23,02%
SMLL	-0,37%	3,95%	11,26%	10,88%	31,79%	113,67%	-	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-0,31%	4,24%	11,74%	12,20%	32,52%	92,26%	1,50%	8,131%	18,31%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	163.473.365,21	48,98%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	81.280.367,43	24,35%
BANCO BRADESCO	43.240.228,75	12,96%
WESTERN ASSET	15.431.715,52	4,62%
BANCO SANTANDER	12.407.602,41	3,72%
BEM DTVM	10.412.603,01	3,12%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	4.600.085,78	1,38%
Safra Asset Management	2.906.947,50	0,87%



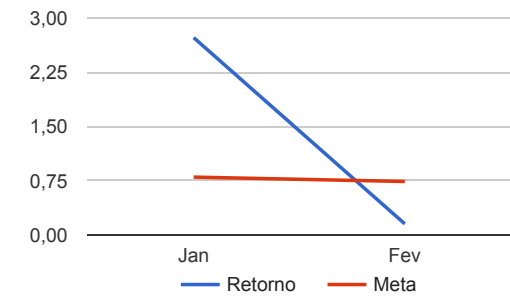
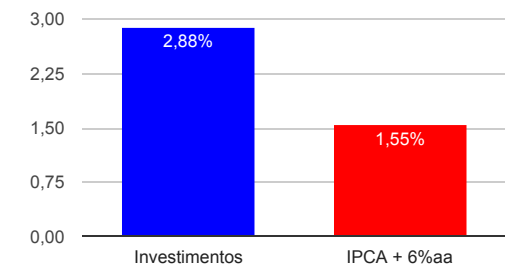
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	71.483.379,18	21,42%
IMA-B 5	53.748.296,09	16,10%
AÇÕES - SETORIAIS	49.268.269,03	14,76%
GESTÃO DURATION	35.243.050,03	10,56%
IDKA IPCA 2A	34.621.305,24	10,37%
CDI	26.038.730,97	7,80%
IRF-M 1	12.154.901,55	3,64%
MULTIMERCADO	12.133.826,58	3,64%
AÇÕES - LIVRES	12.072.623,57	3,62%
IRF-M	7.485.884,60	2,24%
IMA-B 5+	6.838.662,59	2,05%
IMA-GERAL	3.525.444,04	1,06%
CRÉDITO PRIVADO	3.200.390,97	0,96%
IDKA IPCA 20A	3.101.099,84	0,93%
IPCA	2.014.417,97	0,60%
IRF-M 1+	822.633,36	0,25%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	325.218.072,19	12.171.088,33	12.155.217,07	334.098.767,58	8.864.824,13	2,73%	0,80%	340,08%	2,25%
Fevereiro	334.098.767,58	73.235.343,81	74.097.437,92	333.752.915,61	516.242,14	0,15%	0,74%	20,93%	3,49%
Acumulado no ano					9.381.066,27	2,88%	1,55%	186,60%	

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(%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	811.201,27	0,00	0,00	822.633,36	11.432,09	1,41%	1,15%	1,41%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	913.626,47	2.342.573,47	0,00	3.297.889,94	41.689,00	1,28%	2,09%	0,80%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.209.225,57	196.889,00	0,00	7.485.884,60	79.770,03	1,08%	0,81%	1,10%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	5.000.000,00	0,00	5.044.877,58	44.877,58	0,90%	0,87%	0,76%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.500.034,82	0,00	0,00	3.525.444,04	25.409,22	0,73%	0,80%	0,73%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,00	2.000.000,00	0,00	2.014.417,97	14.417,97	0,72%	0,74%	0,60%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00	30.000.000,00	0,00	30.198.172,45	198.172,45	0,66%	0,45%	0,64%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	2.888.154,86	0,00	0,00	2.906.947,50	18.792,64	0,65%	0,15%	0,65%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.685.264,14	0,00	75.915,96	2.626.519,62	17.171,44	0,64%	0,16%	0,65%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	7.010.569,84	10.000.000,00	0,00	17.116.456,26	105.886,42	0,62%	1,85%	0,53%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,00	5.000.000,00	0,00	5.030.461,61	30.461,61	0,61%	0,78%	0,57%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	22.288.664,35	0,00	0,00	22.420.988,51	132.324,16	0,59%	1,83%	0,59%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.781.700,59	0,00	0,00	1.792.072,97	10.372,38	0,58%	0,84%	0,58%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.670.070,58	0,00	0,00	5.702.185,80	32.115,22	0,57%	0,65%	0,57%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.323.588,78	0,00	0,00	4.348.074,27	24.485,49	0,57%	1,31%	0,57%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24.571.504,36	0,00	0,00	24.709.223,38	137.719,02	0,56%	0,66%	0,56%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.185.370,83	0,00	0,00	4.208.288,10	22.917,27	0,55%	1,83%	0,55%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.114.821,34	0,00	0,00	3.131.757,57	16.936,23	0,54%	2,74%	0,54%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	16.503.131,02	93.810,41	0,00	16.687.154,79	90.213,36	0,54%	1,84%	0,54%
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.084.524,43	0,00	0,00	3.101.099,84	16.575,41	0,54%	3,86%	0,54%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.623.031,77	0,00	0,00	6.658.384,16	35.352,39	0,53%	0,07%	0,53%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	909.312,27	0,00	0,00	914.147,76	4.835,49	0,53%	0,78%	0,53%

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(%)
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	3.687.348,74	0,00	0,00	3.706.905,02	19.556,28	0,53%	2,74%	0,53%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.408.371,01	0,00	0,00	1.415.760,58	7.389,57	0,52%	0,07%	0,52%
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1.167.796,35	0,00	0,00	1.173.809,31	6.012,96	0,51%	0,08%	0,51%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.873.407,21	0,00	0,00	6.905.555,29	32.148,08	0,47%	0,01%	0,47%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	794.218,23	0,00	19.893,00	778.008,69	3.683,46	0,46%	4,32%	-2,04%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.402.410,00	0,00	0,00	1.408.318,00	5.908,00	0,42%	0,19%	0,42%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	7.790.868,74	0,00	2.000.000,00	5.820.234,23	29.365,49	0,38%	0,79%	0,52%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	31.125.566,97	0,00	15.000.000,00	16.212.596,55	87.029,58	0,28%	0,02%	0,49%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.320.320,65	0,00	120.723,64	4.209.896,06	10.299,05	0,24%	0,36%	0,24%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	43.029.382,76	0,00	1.148.090,11	41.983.452,49	102.159,84	0,24%	4,70%	-2,43%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	196.639,60	196.889,00	0,00	249,40	0,13%	0,01%	0,39%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	31.251.143,44	0,00	30.000.000,00	1.272.003,15	20.859,71	0,07%	0,01%	0,45%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1.430.074,34	9.425.035,48	9.212.956,89	1.648.575,98	6.423,05	0,06%	0,00%	0,41%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	4.489.640,16	4.490.755,69	0,00	1.115,53	0,02%	0,01%	0,45%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	4.506.253,62	0,00	4.489.640,16	0,00	-16.613,46	-0,37%	1,95%	0,49%
Total Renda Fixa					1.427.513,41	0,55%	1,61%	

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(%)
XP INVESTOR FI AÇÕES	2.789.704,54	0,00	0,00	2.846.784,47	57.079,93	2,05%	7,78%	2,05%
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	0,00	4.490.755,69	0,00	4.572.950,21	82.194,52	1,83%	10,12%	-0,78%
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	10.243.806,02	0,00	0,00	10.412.603,01	168.796,99	1,65%	10,77%	1,65%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	3.280.896,74	0,00	0,00	3.322.273,81	41.377,07	1,26%	11,41%	1,26%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	2.337.823,09	0,00	2.342.573,47	0,00	4.750,38	0,20%	0,47%	1,16%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	3.541.941,86	0,00	0,00	3.534.273,63	-7.668,23	-0,22%	9,97%	-0,22%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	22.859.327,24	0,00	0,00	22.787.864,83	-71.462,41	-0,31%	8,13%	-0,31%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.765.918,26	0,00	0,00	1.753.301,31	-12.616,95	-0,71%	7,15%	-0,71%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	12.546.292,67	0,00	0,00	12.133.826,58	-412.466,09	-3,29%	12,59%	-3,29%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	7.053.115,47	0,00	5.000.000,00	1.804.339,27	-248.776,20	-3,53%	12,85%	-0,53%
BB PIPE FIC AÇÕES	1.379.595,10	0,00	0,00	1.330.615,08	-48.980,02	-3,55%	8,55%	-3,55%
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	3.465.128,74	0,00	0,00	3.341.270,86	-123.857,88	-3,57%	13,72%	-3,57%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	4.004.239,39	0,00	0,00	3.860.903,58	-143.335,81	-3,58%	8,70%	-3,58%
BB CIELO FI AÇÕES	1.970.019,11	0,00	0,00	1.773.712,54	-196.306,57	-9,96%	14,98%	-9,96%
Total Renda Variável					-911.271,27	-1,18%	10,14%	