

Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2018

SIRU 

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 TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	6.089.174,14	1,15%	94	1,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	31.913.320,42	6,05%	223	1,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	63.255.937,26	11,99%	698	1,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	13.603.279,40	2,58%	25	2,88%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	60.350.017,40	11,44%	587	1,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	19.484.299,89	3,69%	15	12,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	37.264.034,99	7,06%	199	4,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	58.094.957,37	11,01%	716	0,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	624.255,84	0,12%	192	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.411.226,11	0,27%	1.417	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	61.734.224,23	11,70%	213	3,93%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	8.107.441,76	1,54%	36	3,44%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	102.515.427,33	19,43%	99	6,91%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	5.760.949,50	1,09%	748	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	5.048.197,63	0,96%	100	0,48%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	Não se aplica	Não se aplica	14.789,33	0,00%	1	0,83%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	57.953,51	0,01%	47	0,37%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	7.513.735,95	1,42%	60	1,72%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	9.632.895,56	1,83%	363	3,68%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	6.807.475,75	1,29%	998	0,55%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	8.110.316,83	1,54%	2.103	10,34%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	5.834.283,45	1,11%	3.660	1,83%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

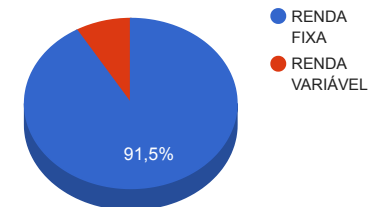
Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	4.460.492,88	0,85%	13.782	0,34%	Artigo 8º, Inciso III
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	Não se aplica	Não se aplica	3.471.603,12	0,66%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	2.887.986,40	0,55%	33	1,09%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se aplica	Não se aplica	1.340.866,21	0,25%		3,22%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	2.223.832,88	0,42%		3,41%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
		TOTAL -	527.612.975,14				

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

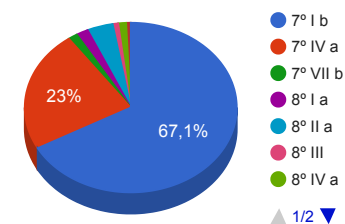
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	353.824.727,05	67,06%	0,00%	69,49%	100,00%	173.788.248,09
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	23,00%	60,00%	316.567.785,08
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	121.432.016,22	23,02%	0,00%	1,00%	40,00%	89.613.173,84
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	72.742,84	0,01%	0,00%	0,01%	5,00%	26.307.905,92
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	7.513.735,95	1,42%	0,00%	1,00%	5,00%	18.866.912,81
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	26.380.648,76
Em Enquadramento - RF	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	26.380.648,76
Total Renda Fixa	100,00%	482.843.222,06	91,51%	4,00	104,50	530,00	-

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%	9.632.895,56	1,83%	0,00%	0,00%	30,00%	148.650.996,98
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	20.752.076,03	3,93%	0,00%	3,00%	20,00%	84.770.519,00
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	4.460.492,88	0,85%	0,00%	1,00%	10,00%	48.300.804,63
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	6.359.589,52	1,21%	0,00%	1,00%	5,00%	20.021.059,24
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	3.564.699,09	0,68%	0,00%	0,05%	5,00%	22.815.949,67
Desenquadrado - RV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	26.380.648,76
Em Enquadramento - RV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	26.380.648,76
Total Renda Variável	30,00%	44.769.753,08	8,49%	4,00	15,05	130,00	-

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%	50,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	353.824.727,05	67,06%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	121.432.016,22	23,02%	0,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	72.742,84	0,01%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	7.513.735,95	1,42%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Em Enquadramento - RF	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Total Renda Fixa	482.843.222,06	91,51%	4,00	530,00

Artigos - Renda Variável	Base: fevereiro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	9.632.895,56	1,83%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20.752.076,03	3,93%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	4.460.492,88	0,85%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	6.359.589,52	1,21%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	3.564.699,09	0,68%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RV	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Em Enquadramento - RV	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	44.769.753,08	8,49%	4,00	130,00

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	196.252.046,57	37,20%	0,05%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	143.594.070,09	27,22%	0,01%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	117.430.344,84	22,26%	0,01%
WESTERN ASSET	33.577.688,33	6,36%	0,06%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	13.603.279,40	2,58%	0,00%
GERAÇÃO FUTURO	8.110.316,83	1,54%	0,05%
ITAÚ UNIBANCO	5.048.197,63	0,96%	0,00%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	3.471.603,12	0,66%	-
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUTURADOS LTDA	2.902.775,73	0,55%	0,02%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	2.223.832,88	0,42%	1,42%
AQ3 ASSET MANAGEMENT	1.340.866,21	0,25%	1,95%
VILA RICA CAPITAL	57.953,51	0,01%	0,12%

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%
CDI + 3,50% ao ano	0,71%	1,60%	2,43%	5,21%	12,71%	32,85%	-	-	-
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%	-	-	-
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%
BRDESCO 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%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,55%	2,56%	3,48%	4,58%	12,03%	33,47%	0,20%	1,126%	5,47%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,55%	3,95%	4,83%	5,44%	10,83%	40,77%	0,20%	1,877%	9,20%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,53%	3,93%	4,77%	5,39%	10,57%	39,87%	0,20%	1,841%	9,07%
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%	-	-	-

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

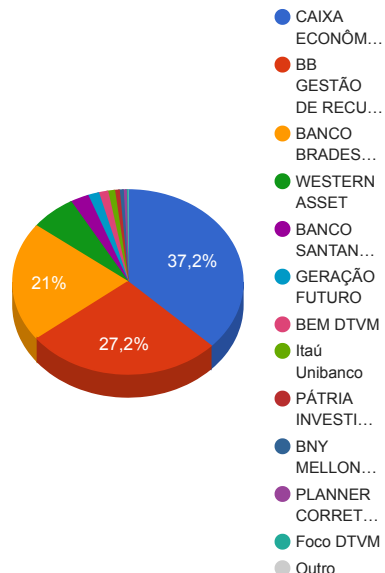
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,53%	1,11%	1,68%	3,65%	9,68%	25,09%	0,20%	0,075%	0,64%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,53%	1,10%	1,67%	3,64%	9,72%	25,26%	0,00%	0,074%	0,64%
IMA-B 5	0,54%	1,88%	2,78%	4,42%	11,72%	26,68%	-	-	-
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	0,94%	2,55%	3,75%	4,89%	12,91%	30,29%	0,40%	1,091%	4,88%
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%
110% do CDI	0,51%	1,16%	1,76%	3,84%	9,89%	26,77%	-	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	3,68%	-0,19%	-11,25%	-9,44%	-34,07%	-46,11%	0,00%	4,477%	-
CDI	0,46%	1,05%	1,59%	3,48%	8,95%	24,07%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,47%	1,04%	1,63%	3,56%	9,05%	24,14%	0,20%	0,010%	0,12%
IPCA	0,32%	0,61%	1,05%	1,92%	2,84%	7,74%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,75%	2,25%	3,06%	4,79%	10,21%	-	0,40%	0,858%	5,61%
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%

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

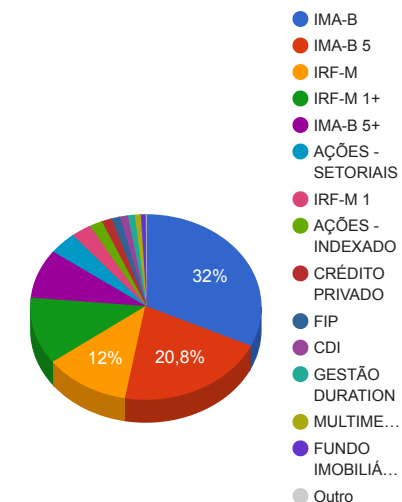
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	1,15%	3,82%	4,44%	10,91%	13,93%	69,83%	-	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,00%	-0,00%	-0,00%	-4,50%	-15,86%	-43,33%	1,50%	0,000%	17,91%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,00%	-	-	-	0,00%	0,00%	0,14%	-	-
IPCA	0,32%	0,61%	1,05%	1,92%	2,84%	7,74%	-	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,30%	0,001%	20,84%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	-	-	-	-	-	-	1,00%	-	-
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%
Global BDRX	-1,26%	0,36%	4,73%	15,43%	23,83%	18,65%	-	-	-
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-2,82%	-1,50%	2,20%	11,28%	20,73%	12,68%	1,50%	8,968%	13,47%
IDIV	-0,61%	9,21%	14,61%	13,85%	17,78%	124,49%	-	-	-
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	1,65%	13,15%	19,69%	20,00%	25,83%	97,66%	1,50%	10,769%	18,82%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	1,19%	10,90%	12,87%	9,31%	3,46%	12,54%	3,00%	8,849%	17,04%
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	196.252.046,57	37,20%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	143.594.070,09	27,22%
BANCO BRADESCO	110.622.869,09	20,97%
WESTERN ASSET	33.577.688,33	6,36%
BANCO SANTANDER	13.603.279,40	2,58%
GERAÇÃO FUTURO	8.110.316,83	1,54%
BEM DTVM	6.807.475,75	1,29%
Itaú Unibanco	5.048.197,63	0,96%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	3.471.603,12	0,66%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	2.887.986,40	0,55%
PLANNER CORRETORA	2.223.832,88	0,42%
Foco DTVM	1.340.866,21	0,25%
BRL Trust Investimentos	57.953,51	0,01%
Brasil Plural	14.789,33	0,00%



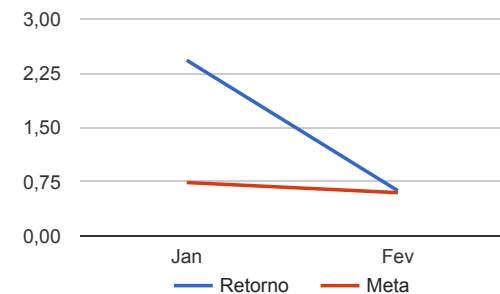
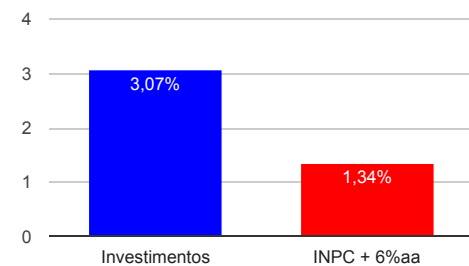
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	168.954.618,87	32,02%
IMA-B 5	109.492.577,68	20,75%
IRF-M	63.255.937,26	11,99%
IRF-M 1+	61.734.224,23	11,70%
IMA-B 5+	45.371.476,75	8,60%
AÇÕES - SETORIAIS	20.752.076,03	3,93%
IRF-M 1	15.014.505,51	2,85%
AÇÕES - INDEXADO	9.632.895,56	1,83%
CRÉDITO PRIVADO	7.513.735,95	1,42%
FIP	6.359.589,52	1,21%
CDI	5.760.949,50	1,09%
GESTÃO DURATION	5.048.197,63	0,96%
MULTIMERCADO	4.460.492,88	0,85%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.564.699,09	0,68%
IDKA IPCA 2A	624.255,84	0,12%
FIDC - FECHADO	72.742,84	0,01%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	515.807.497,39	10.444.075,18	16.011.182,45	522.763.526,19	12.523.136,07	2,43%	0,74%	327,57%	1,65%
Fevereiro	522.763.526,19	13.340.335,05	11.777.052,88	527.612.975,14	3.286.166,78	0,63%	0,60%	104,84%	2,16%
Acumulado no ano					15.809.302,85	3,07%	1,34%	228,51%	

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	60.876.306,91	0,00	0,00	61.734.224,23	857.917,32	1,41%	1,15%	1,41%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	62.565.841,18	0,00	0,00	63.255.937,26	690.096,08	1,10%	0,81%	1,10%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,00	5.000.000,00	0,00	5.048.197,63	48.197,63	0,96%	0,86%	0,75%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	19.303.653,30	0,00	0,00	19.484.299,89	180.646,59	0,94%	1,09%	0,94%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	28.861.300,85	8.160.747,90	0,00	37.264.034,99	241.986,24	0,65%	2,74%	0,54%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	7.470.247,01	0,00	0,00	7.513.735,95	43.488,94	0,58%	0,84%	0,58%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	101.956.827,05	0,00	0,00	102.515.427,33	558.600,28	0,55%	1,88%	0,55%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.217.446,32	0,00	161.661,58	6.089.174,14	33.389,40	0,54%	1,13%	0,55%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.404.532,37	0,00	799,30	1.411.226,11	7.493,04	0,53%	0,07%	0,53%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	57.608.378,90	179.587,15	0,00	58.094.957,37	306.991,32	0,53%	0,78%	0,53%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	8.064.669,88	0,00	0,00	8.107.441,76	42.771,88	0,53%	2,74%	0,53%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	60.032.128,09	0,00	0,00	60.350.017,40	317.889,31	0,53%	1,84%	0,53%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	11.374.406,08	0,00	5.660.209,90	5.760.949,50	46.753,32	0,41%	0,01%	0,47%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	18.528.342,65	0,00	5.000.000,00	13.603.279,40	74.936,75	0,40%	0,07%	0,53%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	640.629,92	0,00	17.901,26	624.255,84	1.527,18	0,24%	0,36%	0,24%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	32.708.374,31	0,00	872.709,73	31.913.320,42	77.655,84	0,24%	4,70%	-2,43%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	121.571,33	0,00	63.771,11	57.953,51	153,29	0,13%	93,12%	-52,33%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	15.411,92	0,00	0,00	14.789,33	-622,59	-4,04%	4,48%	-4,14%
Total Renda Fixa					3.529.871,82	0,74%	1,64%	

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(%)
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	6.697.120,90	0,00	0,00	6.807.475,75	110.354,85	1,65%	10,77%	1,65%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	8.014.991,50	0,00	0,00	8.110.316,83	95.325,33	1,19%	8,85%	1,19%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	2.214.930,22	0,00	0,00	2.223.832,88	8.902,66	0,40%	-	0,40%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	3.474.239,84	0,00	0,00	3.471.603,12	-2.636,72	-0,08%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	2.891.171,92	0,00	0,00	2.887.986,40	-3.185,52	-0,11%	0,00%	-0,11%
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.343.561,27	0,00	0,00	1.340.866,21	-2.695,06	-0,20%	0,00%	0,00%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	5.852.579,68	0,00	0,00	5.834.283,45	-18.296,23	-0,31%	8,13%	-0,31%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9.912.744,04	0,00	0,00	9.632.895,56	-279.848,48	-2,82%	8,97%	-2,82%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	4.612.118,75	0,00	0,00	4.460.492,88	-151.625,87	-3,29%	12,59%	-3,29%
Total Renda Variável					-243.705,04	-0,54%	8,57%	