

Relatório Analítico dos Investimentos em março e 1º Trimestre de 2018

SIRU 

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 IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	64.079.018,70	11,99%	713	1,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	15.125.346,94	2,83%	24	3,85%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	627.830,01	0,12%	192	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	60.891.520,05	11,40%	590	1,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	6.210.872,05	1,16%	94	1,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	32.097.063,48	6,01%	223	1,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	44.528.432,10	8,33%	210	5,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	48.992.271,83	9,17%	729	0,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	52.670.023,71	9,86%	232	2,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	24.913.606,74	4,66%	16	13,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	103.509.526,30	19,38%	99	6,85%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	5.100.109,38	0,95%	107	0,42%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	133.209,91	0,02%	734	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	8.136.326,08	1,52%	37	3,37%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	Não se aplica	Não se aplica	11.786,73	0,00%	1	0,76%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	55.019,32	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	7.649.694,22	1,43%	60	1,72%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	9.422.880,83	1,76%	32	3,40%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	D+4	Não há	2.020.705,07	0,38%	79	1,55%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BRADERCO H VALUATION IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	2.019.928,40	0,38%	878	2,95%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	10.923.196,07	2,04%	1.156	0,74%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	4.013.805,86	0,75%	2.059	5,64%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

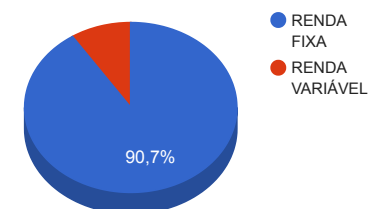
Carteira consolidada de investimentos - base (março / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	5.804.207,58	1,09%	3.403	1,89%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.000.000,00	0,19%	1.643	0,30%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	4.337.103,77	0,81%	13.215	0,36%	Artigo 8º, Inciso III
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	Não se aplica	Não se aplica	3.468.590,68	0,65%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	2.887.636,14	0,54%	33	1,09%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	2.246.175,80	0,42%		3,41%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se aplica	Não se aplica	1.342.923,60	0,25%		2,59%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	10.016.468,57	1,87%	4.355	5,48%	Desenquadrado - RF
		TOTAL -	534.235.279,92				

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

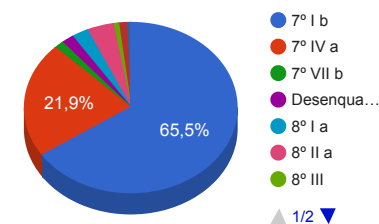
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	350.135.985,61	65,54%	0,00%	69,49%	100,00%	184.099.294,31
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	23,00%	60,00%	320.541.167,95
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	116.879.171,67	21,88%	0,00%	1,00%	40,00%	96.814.940,30
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	66.806,05	0,01%	0,00%	0,01%	5,00%	26.644.957,95
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	7.649.694,22	1,43%	0,00%	1,00%	5,00%	19.062.069,78
Desenquadrado - RF	0,00%	10.016.468,57	1,87%	2,00%	5,00%	5,00%	16.695.295,43
Em Enquadramento - RF	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	26.711.764,00
Total Renda Fixa	100,00%	484.748.126,12	90,74%	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%	13.463.514,30	2,52%	0,00%	0,00%	30,00%	146.807.069,68
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	21.741.209,51	4,07%	0,00%	3,00%	20,00%	85.105.846,47
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	4.337.103,77	0,81%	0,00%	1,00%	10,00%	49.086.424,22
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	6.356.226,82	1,19%	0,00%	1,00%	5,00%	20.355.537,18
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	3.589.099,40	0,67%	0,00%	0,05%	5,00%	23.122.664,60
Desenquadrado - RV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	26.711.764,00
Em Enquadramento - RV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	26.711.764,00
Total Renda Variável	30,00%	49.487.153,80	9,26%	4,00	15,05	130,00	-

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%	50,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	350.135.985,61	65,54%	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 "	116.879.171,67	21,88%	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 "	66.806,05	0,01%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	7.649.694,22	1,43%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	10.016.468,57	1,87%	2,00%	5,00%
Em Enquadramento - RF	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Total Renda Fixa	484.748.126,12	90,74%	4,00	530,00

Artigos - Renda Variável	Base: março / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	13.463.514,30	2,52%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	21.741.209,51	4,07%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	4.337.103,77	0,81%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	6.356.226,82	1,19%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	3.589.099,40	0,67%	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	49.487.153,80	9,26%	4,00	130,00

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	186.112.703,77	34,84%	0,05%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	139.592.144,94	26,13%	0,01%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	124.588.976,85	23,32%	0,01%
WESTERN ASSET	38.673.591,34	7,24%	0,07%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	15.125.346,94	2,83%	0,00%
ICATU VANGUARDA	10.016.468,57	1,87%	0,04%
ITAÚ UNIBANCO	5.100.109,38	0,95%	0,00%
GERAÇÃO FUTURO	4.013.805,86	0,75%	0,03%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	3.468.590,68	0,65%	0,17%
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUTURADOS LTDA	2.899.422,87	0,54%	0,02%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	2.246.175,80	0,42%	1,44%
AQ3 ASSET MANAGEMENT	1.342.923,60	0,25%	1,02%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	1.000.000,00	0,19%	0,01%
VILA RICA CAPITAL	55.019,32	0,01%	0,07%

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%	-	-	-
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	2,08%	4,68%	4,68%	5,87%	13,47%	31,79%	0,40%	1,557%	4,89%
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%	3,46%
IDKA IPCA 2 Anos	1,59%	3,01%	3,01%	5,31%	12,41%	28,22%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,57%	1,86%	1,86%	3,47%	8,62%	22,58%	0,20%	0,114%	1,61%
IRF-M 1+	1,57%	4,50%	4,50%	5,86%	14,14%	41,99%	-	-	-
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	1,74%	5,62%	5,62%	6,27%	14,63%	46,04%	0,30%	1,267%	7,94%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,54%	4,68%	4,68%	5,82%	13,89%	41,70%	0,20%	0,966%	5,77%
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%	4,41%
IMA-B	0,94%	4,94%	4,94%	4,60%	10,73%	34,61%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,00%	4,61%	4,61%	5,32%	12,57%	32,46%	0,20%	1,396%	5,44%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,97%	4,96%	4,96%	4,55%	10,73%	35,26%	0,20%	1,514%	9,10%
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%	8,97%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,58%	-0,84%	-0,84%	0,72%	2,89%	10,07%	0,20%	0,116%	4,15%
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%	-	117,80%

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
IRF-M 1	0,66%	1,80%	1,80%	3,65%	9,34%	24,73%	-	-	-
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,64%	1,74%	1,74%	3,56%	9,21%	24,57%	0,00%	0,128%	0,64%
110% do CDI	0,58%	1,75%	1,75%	3,72%	9,26%	25,90%	-	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-20,30%	-20,45%	-20,45%	-34,36%	-45,87%	-56,29%	0,00%	17,825%	-
CDI	0,53%	1,59%	1,59%	3,37%	8,39%	23,30%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,54%	1,59%	1,59%	3,45%	8,48%	23,44%	0,20%	0,010%	0,11%
IMA-B 5+	0,38%	5,94%	5,94%	4,21%	10,24%	38,98%	-	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	0,36%	5,81%	5,81%	4,00%	9,74%	38,08%	0,20%	1,980%	11,94%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,35%	5,85%	5,85%	4,05%	10,04%	38,15%	0,20%	1,953%	11,67%
IPCA	0,09%	0,70%	0,70%	1,85%	2,68%	7,37%	-	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,81%	3,79%	3,79%	5,47%	13,10%	33,24%	0,20%	1,104%	4,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	1,03%	3,30%	3,30%	4,30%	9,88%	-	0,40%	0,881%	5,50%

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

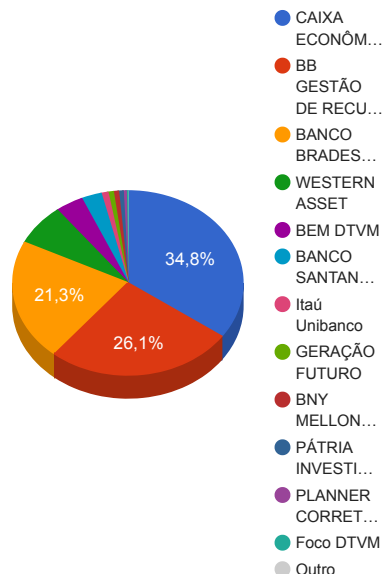
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	2,00%	5,89%	5,89%	6,15%	15,97%	58,68%	-	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	24,71%	24,70%	24,70%	17,97%	4,93%	-29,33%	1,50%	40,638%	30,62%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,00%	-	-	-	0,00%	0,00%	0,14%	-	-
IDIV	1,05%	10,36%	10,36%	8,41%	21,26%	88,12%	-	-	-
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	1,70%	15,08%	15,08%	17,61%	30,21%	78,44%	1,50%	5,787%	18,42%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	-0,35%	10,51%	10,51%	6,75%	5,15%	19,68%	3,00%	7,448%	-
IPCA	0,09%	0,70%	0,70%	1,85%	2,68%	7,37%	-	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,30%	0,021%	20,80%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	-	-	-	-	-	-	1,00%	-	-
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%	17,89%
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%	19,31%
Ibovespa	0,01%	11,73%	11,73%	14,90%	31,36%	70,54%	-	-	-
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	1,29%	17,54%	17,54%	18,70%	38,85%	72,07%	2,00%	6,481%	19,57%
BRADESCO H VALUATION IBOVESPA FI AÇÕES	1,08%	16,17%	16,17%	19,09%	43,31%	88,50%	2,00%	6,600%	20,91%
S&P 500	-2,69%	-1,22%	-1,22%	4,82%	11,77%	28,21%	-	-	-

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

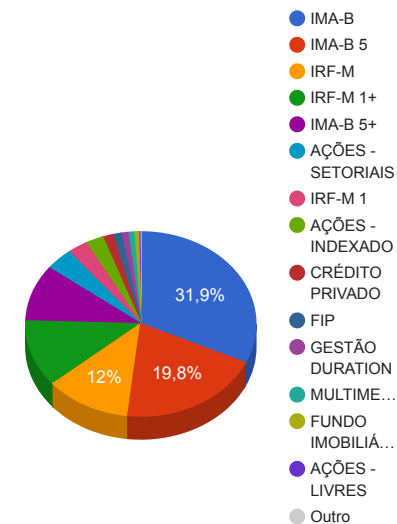
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-2,77%	-0,90%	-0,90%	6,99%	18,92%	53,88%	1,00%	9,416%	11,82%
Global BDRX	-2,65%	-2,31%	-2,31%	10,53%	19,88%	20,54%	-	-	-
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-2,18%	-3,65%	-3,65%	6,91%	16,72%	15,15%	1,50%	8,559%	14,40%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	186.112.703,77	34,84%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	139.592.144,94	26,13%
BANCO BRADESCO	113.665.780,78	21,28%
WESTERN ASSET	38.673.591,34	7,24%
BEM DTVM	20.939.664,64	3,92%
BANCO SANTANDER	15.125.346,94	2,83%
Itaú Unibanco	5.100.109,38	0,95%
GERAÇÃO FUTURO	4.013.805,86	0,75%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	3.887.636,14	0,73%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	3.468.590,68	0,65%
PLANNER CORRETORA	2.246.175,80	0,42%
Foco DTVM	1.342.923,60	0,25%
BRL Trust Investimentos	55.019,32	0,01%
Brasil Plural	11.786,73	0,00%



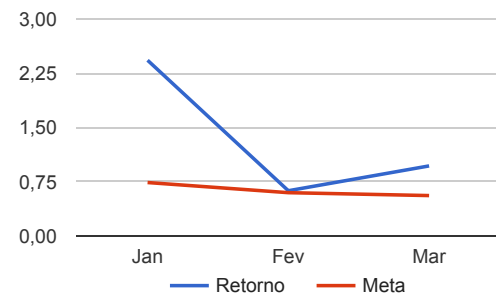
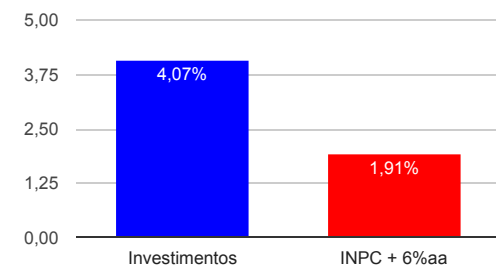
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	170.611.918,40	31,94%
IMA-B 5	106.002.942,05	19,84%
IRF-M	64.079.018,70	11,99%
IRF-M 1+	62.686.492,28	11,73%
IMA-B 5+	52.664.758,18	9,86%
AÇÕES - SETORIAIS	20.741.209,51	3,88%
IRF-M 1	15.125.346,94	2,83%
AÇÕES - INDEXADO	13.463.514,30	2,52%
CRÉDITO PRIVADO	7.649.694,22	1,43%
FIP	6.356.226,82	1,19%
GESTÃO DURATION	5.100.109,38	0,95%
MULTIMERCADO	4.337.103,77	0,81%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.589.099,40	0,67%
AÇÕES - LIVRES	1.000.000,00	0,19%
IDKA IPCA 2A	627.830,01	0,12%
CDI	133.209,91	0,02%
FIDC - FECHADO	66.806,05	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%
Março	527.612.975,14	32.723.163,98	31.230.037,28	534.235.279,92	5.129.178,08	0,97%	0,56%	174,01%	1,73%
Acumulado no ano					20.938.480,93	4,07%	1,91%	213,26%	

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(%)
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.089.174,14	0,00	0,00	6.210.872,05	121.697,91	2,00%	1,40%	2,00%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	7.513.735,95	0,00	0,00	7.649.694,22	135.958,27	1,81%	1,10%	1,81%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	19.484.299,89	5.000.000,00	0,00	24.913.606,74	429.306,85	1,75%	1,56%	2,08%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	58.094.957,37	0,00	10.000.000,00	48.992.271,83	897.314,46	1,54%	1,06%	1,60%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	61.734.224,23	0,00	10.000.000,00	52.670.023,71	935.799,48	1,52%	0,97%	1,54%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	63.255.937,26	0,00	0,00	64.079.018,70	823.081,44	1,30%	0,76%	1,30%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	5.048.197,63	0,00	0,00	5.100.109,38	51.911,75	1,03%	0,88%	1,03%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	102.515.427,33	0,00	0,00	103.509.526,30	994.098,97	0,97%	1,51%	0,97%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	60.350.017,40	0,00	0,00	60.891.520,05	541.502,65	0,90%	1,45%	0,90%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.603.279,40	1.588.014,24	159.920,09	15.125.346,94	93.973,39	0,62%	0,13%	0,64%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	31.913.320,42	0,00	0,00	32.097.063,48	183.743,06	0,58%	0,12%	0,58%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	624.255,84	0,00	0,00	627.830,01	3.574,17	0,57%	0,11%	0,57%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	5.760.949,50	0,00	5.654.147,85	133.209,91	26.408,26	0,46%	0,01%	0,54%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	8.107.441,76	0,00	0,00	8.136.326,08	28.884,32	0,36%	1,98%	0,36%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	37.264.034,99	7.135.149,74	0,00	44.528.432,10	129.247,37	0,29%	1,95%	0,35%
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	0,00	10.000.000,00	0,00	10.016.468,57	16.468,57	0,16%	1,27%	1,74%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.411.226,11	0,00	1.413.219,33	0,00	1.993,22	0,14%	0,13%	0,64%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	57.953,51	0,00	2.750,01	55.019,32	-184,18	-0,32%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	14.789,33	0,00	0,00	11.786,73	-3.002,60	-20,30%	17,83%	-12,85%
Total Renda Fixa					5.411.777,36	1,12%	1,19%	

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(%)
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	6.807.475,75	4.000.000,00	0,00	10.923.196,07	115.720,32	1,07%	5,79%	1,70%
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.020.705,07	20.705,07	1,04%	6,77%	-0,33%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	2.223.832,88	0,00	0,00	2.246.175,80	22.342,92	1,00%	-	1,00%
BRADESCO H VALUATION IBOVESPA FI AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.019.928,40	19.928,40	1,00%	6,60%	1,08%
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.340.866,21	0,00	0,00	1.342.923,60	2.057,39	0,15%	40,64%	24,71%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	1.000.000,00	0,00	0,00%	6,48%	1,29%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	2.887.986,40	0,00	0,00	2.887.636,14	-350,26	-0,01%	0,02%	-0,04%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	3.471.603,12	0,00	0,00	3.468.590,68	-3.012,44	-0,09%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	5.834.283,45	0,00	0,00	5.804.207,58	-30.075,87	-0,52%	5,46%	-0,52%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	8.110.316,83	0,00	4.000.000,00	4.013.805,86	-96.510,97	-1,19%	7,45%	-0,35%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9.632.895,56	0,00	0,00	9.422.880,83	-210.014,73	-2,18%	8,56%	-2,18%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	4.460.492,88	0,00	0,00	4.337.103,77	-123.389,11	-2,77%	9,42%	-2,77%
Total Renda Variável					-282.599,28	-0,57%	7,64%	

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 (%)
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	98.618.406,32	0,00	0,00	103.509.526,30	4.891.119,98	4,96%	4,96%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	58.066.912,77	0,00	0,00	60.891.520,05	2.824.607,28	4,86%	4,86%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	59.884.388,06	0,00	10.000.000,00	52.670.023,71	2.785.635,65	4,65%	4,68%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	61.770.828,25	0,00	0,00	64.079.018,70	2.308.190,45	3,74%	3,74%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	56.865.010,73	179.587,15	10.000.000,00	48.992.271,83	1.947.673,95	3,42%	3,48%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	27.076.287,67	15.739.972,82	0,00	44.528.432,10	1.712.171,61	5,87%	5,85%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	19.000.289,51	5.000.000,00	0,00	24.913.606,74	913.317,23	4,35%	4,68%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	32.369.994,42	0,00	872.709,73	32.097.063,48	599.778,79	1,87%	-0,84%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	7.689.608,77	0,00	0,00	8.136.326,08	446.717,31	5,81%	5,81%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	28.390.141,86	1.588.014,24	15.159.920,09	15.125.346,94	307.110,93	1,52%	1,74%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	7.370.150,38	0,00	0,00	7.649.694,22	279.543,84	3,79%	3,79%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.095.734,64	0,00	161.661,58	6.210.872,05	276.798,99	4,59%	4,61%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	11.949.369,80	0,00	11.954.571,58	133.209,91	138.411,69	1,42%	1,59%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,00	5.000.000,00	0,00	5.100.109,38	100.109,38	2,00%	3,30%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	90.050,78	0,00	96.249,79	55.019,32	61.218,33	67,69%	-38,90%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.710.843,96	0,00	6.755.258,58	0,00	44.414,62	1,20%	1,75%
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	0,00	10.000.000,00	0,00	10.016.468,57	16.468,57	0,16%	5,62%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	634.052,14	0,00	17.901,26	627.830,01	11.679,13	1,86%	1,86%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	16.017,82	0,00	0,00	11.786,73	-4.231,09	-26,41%	-20,45%
Total Renda Fixa					19.660.736,64	4,13%	

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 (%)
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	6.016.098,55	4.000.000,00	0,00	10.923.196,07	907.097,52	14,37%	15,08%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	7.313.462,40	0,00	4.000.000,00	4.013.805,86	700.343,46	9,58%	10,51%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	5.596.771,90	0,00	0,00	5.804.207,58	207.435,68	3,71%	3,71%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	2.197.890,59	0,00	0,00	2.246.175,80	48.285,21	2,20%	-
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.020.705,07	20.705,07	1,04%	12,34%
BRADERCO H VALUATION IBOVESPA FI AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.019.928,40	19.928,40	1,00%	16,17%
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.336.041,82	0,00	0,00	1.342.923,60	6.881,78	0,52%	24,70%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	1.000.000,00	0,00	0,00%	17,54%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	2.895.192,14	0,00	0,00	2.887.636,14	-7.556,00	-0,26%	-
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	3.477.429,39	0,00	0,00	3.468.590,68	-8.838,71	-0,25%	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	4.376.522,72	0,00	0,00	4.337.103,77	-39.418,95	-0,90%	-0,90%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	10.000.000,00	0,00	9.422.880,83	-577.119,17	-5,77%	-3,65%
Total Renda Variável					1.277.744,29	3,02%	