

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
TÍTULOS PÚBLICOS			120.767.861,62	11,21%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	20.615.219,38	1,91%	16	11,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	16.815.332,48	1,56%	167	1,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	65.605.274,10	6,09%	346	5,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	78.745.642,53	7,31%	713	1,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	4.200.553,02	0,39%	223	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	7.309.444,01	0,68%	228	0,79%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	3.598.334,62	0,33%	107	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	12.955.853,68	1,20%	72	1,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	57.478.068,75	5,34%	3.026	11,75%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	39.008.293,91	3,62%	65	2,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	13.419.948,24	1,25%	26	5,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	11.866.129,26	1,10%	363	0,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	6.507.280,75	0,60%	6	13,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	10.769.491,13	1,00%	20	3,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	112.611.189,18	10,45%	753	2,49%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	830.989,71	0,08%	192	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	15/05/2019	6.524.542,53	0,61%	11	7,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	37.334.101,27	3,47%	639	0,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	29.730.451,07	2,76%	435	1,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.612.208,37	0,24%	661	0,21%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	40.641.770,39	3,77%	107	3,33%	Artigo 7º, Inciso IV, 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
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	5.941.260,68	0,55%	67	5,39%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	156.500.377,92	14,53%	99	10,36%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	12.832.449,81	1,19%	63	0,84%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	11.618,72	0,00%	697	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	Não se aplica	Não se aplica	86.400,67	0,01%	127	2,50%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
GÁVEA SUL FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1 LP	Não se aplica	Não se aplica	1.119.556,74	0,10%	18	5,20%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	Não se aplica	Não se aplica	628.464,89	0,06%	22	1,16%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
HSBC NILO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	D+4	Não há	25.853.081,00	2,40%	10	5,18%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	17.731.443,51	1,65%	51	2,32%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BRADERCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES	D+5	Não há	15.392.325,00	1,43%	11	17,08%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	13.138.979,81	1,22%	4.931	2,23%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	3.265.786,31	0,30%	5.974	0,95%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	13.469.625,19	1,25%	73	10,66%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	10.867.176,40	1,01%	3.403	3,53%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
KONDOR EQUITIES INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+33	Não há	22.427.469,68	2,08%	732	6,67%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+180	Não há	1.260.086,22	0,12%	13	1,03%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	7.343.580,76	0,68%	35	3,09%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	23.420.956,82	2,17%	13.215	1,95%	Artigo 8º, Inciso III
SULAMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+361	2 anos	4.345.503,30	0,40%	9	12,59%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	10.484.414,82	0,97%	2.042	0,44%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	916.506,31	0,09%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
LSH FIP	Não se aplica	Não se aplica	4.630.302,07	0,43%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "

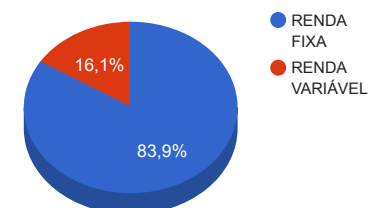
Carteira consolidada de investimentos - base (março / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	5.473.361,42	0,51%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	472.154,17	0,04%		0,18%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	7.761.269,25	0,72%		27,79%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	Não se aplica	Não se aplica	1.180.000,00	0,11%		1,14%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
MÉRITO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - MFII11	Não se aplica	Não se aplica	6.394.108,00	0,59%		7,37%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
SUL AMÉRICA CRÉDITO ATIVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	D+30	Não há	4.234.157,49	0,39%	338	0,91%	Desenquadrado - RF
		TOTAL -	1.077.130.396,96				

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

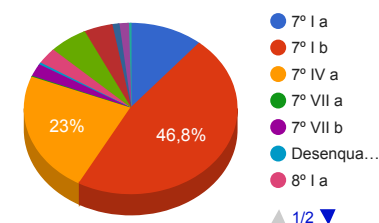
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	120.767.861,62	11,21%	0,00%	0,00%	0,00%	-120.767.861,62
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	506.195.688,55	46,99%	15,00%	25,00%	70,00%	247.795.589,32
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	646.278.238,18
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	248.270.136,96	23,05%	5,00%	10,00%	30,00%	74.868.982,13
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	7,00%	15,00%	15,00%	161.569.559,54
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	1.834.422,30	0,17%	2,00%	5,00%	5,00%	52.022.097,55
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	25.853.081,00	2,40%	2,00%	5,00%	5,00%	28.003.438,85
Desenquadrado - RF	0,00%	4.234.157,49	0,39%	0,00%	0,00%	0,00%	-4.234.157,49
Total Renda Fixa	100,00%	907.155.347,92	84,22%	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%	33.123.768,51	3,08%	2,00%	5,00%	10,00%	74.589.271,19
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	63.169.037,39	5,86%	2,00%	5,00%	10,00%	44.544.002,31
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	46.854.541,92	4,35%	7,00%	10,00%	10,00%	60.858.497,78
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	11.492.323,97	1,07%	2,00%	5,00%	5,00%	42.364.195,88
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	15.335.377,25	1,42%	2,00%	5,00%	5,00%	38.521.142,60
Desenquadrado - RV	0,00%	4.234.157,49	0,39%	0,00%	0,00%	0,00%	-4.234.157,49
Total Renda Variável	30,00%	174.209.206,53	16,17%	15,00	30,00	40,00	-

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 "	120.767.861,62	11,21%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	506.195.688,55	46,99%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	248.270.136,96	23,05%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	1.834.422,30	0,17%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	25.853.081,00	2,40%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	4.234.157,49	0,39%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	907.155.347,92	84,22%	36,00	190,00

Artigos - Renda Variável	Base: março / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	33.123.768,51	3,08%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	63.169.037,39	5,86%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	46.854.541,92	4,35%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	11.492.323,97	1,07%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	15.335.377,25	1,42%	2,00%	5,00%
Desenquadrado - RV	4.234.157,49	0,39%	0,00%	0,00%
Total Renda Variável	174.209.206,53	16,17%	15,00	40,00

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	224.717.607,48	20,86%	0,06%
BRASESCO ASSET MANAGEMENT	197.745.783,92	18,36%	0,02%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	118.179.746,36	10,97%	0,01%
ITAÚ UNIBANCO	99.007.056,64	9,19%	0,01%
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS	66.057.729,54	6,13%	0,23%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	65.616.892,82	6,09%	0,02%
WESTERN ASSET	51.379.756,96	4,77%	0,10%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	26.608.605,00	2,47%	0,16%
KONDOR INVEST	22.427.469,68	2,08%	0,80%
SAFRA ASSET MANAGEMENT	21.253.905,95	1,97%	0,01%
ITAÚ DTVM	17.731.443,51	1,65%	0,00%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	7.761.269,25	0,72%	4,98%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	7.423.787,06	0,69%	0,01%
MÉRITO INVESTIMENTOS	6.394.108,00	0,59%	-
INFINITY ASSET MANAGEMENT	5.941.260,68	0,55%	1,28%

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
A5 CAPITAL PARTNERS	5.473.361,42	0,51%	-%
ROMA ASSET	4.630.302,07	0,43%	1,48%%
XP GESTÃO DE RECURSOS	3.265.786,31	0,30%	0,00%%
CAPITÂNIA	1.260.086,22	0,12%	0,03%%
REAG GESTORA DE RECURSOS	1.180.000,00	0,11%	0,05%%
BELVEDERE INVESTIMENTOS	1.119.556,74	0,10%	0,17%%
BRZ Investimentos	628.464,89	0,06%	0,02%%
BRASIL PLURAL	472.154,17	0,04%	0,00%%
Gradual Investimentos	86.400,67	0,01%	0,13%%

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%	4,92%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,61%	3,47%	3,47%	4,98%	11,75%	27,29%	0,10%	1,066%	3,48%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,60%	3,47%	3,47%	4,94%	11,79%	27,36%	0,20%	1,068%	3,49%
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%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,00%	2,13%	2,13%	1,46%	4,58%	12,72%	0,20%	0,555%	4,75%
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%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,19%	3,15%	3,15%	2,76%	7,08%	20,96%	0,20%	1,535%	7,60%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,64%	0,69%	0,69%	2,31%	6,15%	15,51%	0,20%	1,090%	5,17%
HSBC NILO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	1,34%	5,90%	5,90%	5,75%	12,63%	40,66%	0,30%	1,633%	10,60%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,27%	2,92%	2,92%	4,44%	10,67%	26,52%	0,20%	0,732%	3,11%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	1,05%	4,92%	4,92%	4,43%	10,37%	32,82%	0,45%	1,507%	9,36%

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
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,97%	4,96%	4,96%	4,55%	10,73%	35,26%	0,20%	1,514%	9,18%
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 BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,73%	2,97%	2,97%	2,08%	4,52%	22,22%	0,20%	1,791%	11,04%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	0,71%	5,29%	5,29%	4,53%	12,57%	37,43%	0,40%	1,239%	8,94%
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%	4,18%
135% do CDI	0,72%	2,15%	2,15%	4,58%	11,49%	32,67%	-	-	-
GÁVEA SUL FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1 LP	-9,35%	-23,39%	-23,39%	-37,25%	-52,21%	-50,23%	0,40%	16,454%	-
IPCA + 7,50% ao ano	0,70%	2,48%	2,48%	5,48%	10,22%	23,94%	-	-	-
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	-19,64%	-31,72%	-31,72%	-29,80%	-35,49%	-37,12%	0,18%	32,884%	-
130% do CDI	0,69%	2,07%	2,07%	4,41%	11,04%	31,29%	-	-	-
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	-3,10%	-5,87%	-5,87%	-10,91%	-19,98%	-93,32%	2,50%	-	-
CDI	0,53%	1,59%	1,59%	3,37%	8,39%	23,30%	-	-	-
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	0,58%	1,89%	1,89%	3,75%	9,52%	26,36%	0,75%	0,248%	8,44%
SUL AMÉRICA CRÉDITO ATIVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	0,57%	1,62%	1,62%	3,37%	9,02%	25,58%	0,60%	0,058%	0,33%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,53%	1,58%	1,58%	3,35%	8,52%	23,80%	0,20%	0,006%	0,12%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,52%	1,54%	1,54%	3,32%	8,27%	23,13%	0,20%	0,007%	0,14%

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
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,44%	1,32%	1,32%	2,84%	7,29%	21,16%	1,00%	0,004%	0,10%
IMA-B 5+	0,38%	5,94%	5,94%	4,21%	10,24%	38,98%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,32%	5,82%	5,82%	4,04%	9,75%	38,00%	0,20%	1,955%	11,87%
IPCA	0,09%	0,70%	0,70%	1,85%	2,68%	7,37%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	1,03%	3,30%	3,30%	4,30%	9,88%	-	0,40%	0,881%	5,58%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,03%	3,28%	3,28%	4,28%	9,87%	32,31%	0,40%	0,881%	5,58%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,80%	1,54%	1,54%	2,25%	6,67%	17,77%	0,15%	1,345%	6,52%

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

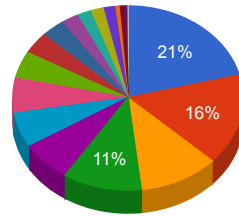
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	2,00%	5,89%	5,89%	6,15%	15,97%	58,68%	-	-	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,00%	-	-	-	0,00%	0,00%	0,14%	-	-
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	0,00%	-4,68%	-4,68%	-21,33%	19,36%	9,26%	0,95%	16,959%	90,00%
IDIV	1,05%	10,36%	10,36%	8,41%	21,26%	88,12%	-	-	-
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	1,38%	6,17%	6,17%	6,07%	20,34%	54,77%	3,00%	5,962%	15,94%
IPCA + 8,00% ao ano	0,73%	2,60%	2,60%	5,72%	10,73%	25,09%	-	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-	-	-	-	-	-	2,00%	-	-
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%
SUL AMÉRICA CRÉDITO ATIVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	0,57%	1,62%	1,62%	3,37%	9,02%	25,58%	0,60%	0,058%	0,33%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	0,50%	2,00%	2,00%	4,10%	9,39%	25,27%	0,50%	0,594%	1,54%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,26%	0,46%	0,46%	-0,14%	2,33%	17,16%	0,55%	0,079%	8,82%
IPCA	0,09%	0,70%	0,70%	1,85%	2,68%	7,37%	-	-	-
SULAMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,83%	2,42%	2,42%	4,19%	10,34%	23,46%	1,50%	0,328%	1,59%
SMLL	0,07%	4,03%	4,03%	7,03%	33,83%	91,97%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	3,00%	14,17%	14,17%	15,30%	41,10%	89,67%	2,00%	6,685%	20,19%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-0,52%	3,71%	3,71%	6,93%	34,00%	80,37%	1,50%	5,462%	17,92%

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
Ibovespa	0,01%	11,73%	11,73%	14,90%	31,36%	70,54%	-	-	-
KONDOR EQUITIES INSTITUCIONAL FI AÇÕES	2,75%	18,92%	18,92%	21,37%	35,29%	105,72%	1,50%	5,638%	19,17%
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	0,62%	13,55%	13,55%	14,74%	29,31%	61,12%	2,00%	6,965%	17,40%
BRDESCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES	0,45%	10,68%	10,68%	11,75%	24,97%	56,98%	1,00%	5,479%	16,57%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-0,20%	10,77%	10,77%	12,07%	28,83%	64,77%	1,50%	5,720%	17,29%
S&P 500	-2,69%	-1,22%	-1,22%	4,82%	11,77%	28,21%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-2,77%	-0,90%	-0,90%	6,99%	18,92%	53,88%	1,00%	9,416%	10,91%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
MÉRITO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - MFII11	9,91%	-4,86%	-4,86%	10,37%	26,07%	30,71%	0,15%	8,989%	21,12%
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,65%	0,000%	335,60%
LSH FIP	-	-	-	-	-	-	0,08%	-	-
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	-	-

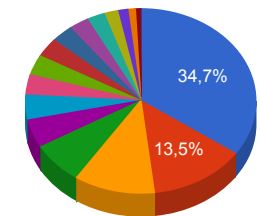
Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (março / 2018)

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	226.106.267,96	20,99%
BANCO BRADESCO	171.892.702,92	15,96%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	120.767.861,62	11,21%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	118.179.746,36	10,97%
ITAÚ UNIBANCO	76.096.729,76	7,06%
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS	66.057.729,54	6,13%
BANCO SANTANDER	65.616.892,82	6,09%
WESTERN ASSET	51.379.756,96	4,77%
Itaú Unibanco S.A.	40.641.770,39	3,77%
BEM DTVM	35.897.094,87	3,33%
HSBC Bank Brasil	25.853.081,00	2,40%
Safra Asset Management	21.253.905,95	1,97%
Planner Corretora	19.628.738,67	1,82%
BNY Mellon Serviços Financeiros	17.664.852,34	1,64%
BTG Pactual Serviços Financeiros	6.507.280,75	0,60%
BRB DTVM	5.941.260,68	0,55%
Orla DTVM	4.630.302,07	0,43%
Socopa	1.748.021,63	0,16%
CM Capital Markets DTVM	1.180.000,00	0,11%
Gradual Investimentos	86.400,67	0,01%



- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
- BANCO BRADESCO
- TESOURO NACIONAL
- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- ITAÚ UNIBANCO
- SULAMÉRICA INVESTIMENTOS
- BANCO SANTANDER
- WESTERN ASSET
- Itaú Unibanco S.A.
- BEM DTVM
- HSBC Bank Brasil
- Safra Asset Management
- Planner Corretora
- BNY Mellon Serviços Financeiros
- BTG Pactual Serviços Financeiros
- BRB DTVM
- Oria DTVM
- Socopa
- Outro

Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	373.637.593,89	34,69%
IMA-B 5	144.893.804,29	13,45%
TÍTULOS PÚBLICOS	120.767.861,62	11,21%
IRF-M	78.745.642,53	7,31%
GESTÃO DURATION	53.474.220,20	4,96%
MULTIMERCADO	46.854.541,92	4,35%
CDI	38.295.538,84	3,56%
IDKA IPCA 2A	38.165.090,98	3,54%
AÇÕES - LIVRES	35.897.094,87	3,33%
AÇÕES - INDEXADO	33.123.768,51	3,08%
CRÉDITO PRIVADO	30.087.238,49	2,79%
AÇÕES - SETORIAIS	27.271.942,52	2,53%
IMA-B 5+	20.729.392,25	1,92%
FUNDO IMOBILIÁRIO	15.335.377,25	1,42%
FIP	11.492.323,97	1,07%
IDKA IPCA 3A	6.524.542,53	0,61%
FIDC - FECHADO	1.834.422,30	0,17%



- IMA-B
- IMA-B 5
- TÍTULOS PÚBLICOS
- IRF-M
- GESTÃO DURATION
- MULTIMERCADO
- CDI
- IDKA IPCA 2A
- AÇÕES - LIVRES
- AÇÕES - INDEXADO
- CRÉDITO PRIVADO
- AÇÕES - SETORIAIS
- IMA-B 5+
- FUNDO IMOBILIÁRIO
- FIP
- IDKA IPCA 3A
- FIDC - FECHADO

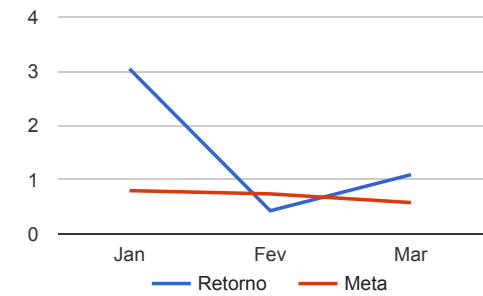
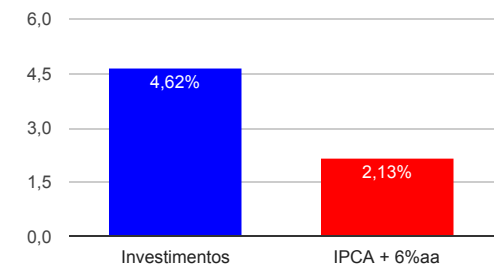
Carteira de Títulos Públicos - base (março / 2018)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	GAP (Atual - Pago)
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2019	25/08/2015	7659	2.636,195170	3.263,285572	20.190.618,81	24.993.504,20	4.802.885,39
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	17/08/2016	4750	2.964,257204	3.354,222591	14.080.221,72	15.932.557,31	1.852.335,59
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	03/09/2015	6730	2.515,509771	3.374,960461	16.929.380,76	22.713.483,90	5.784.103,14
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	14/03/2014	6185	2.315,991673	3.368,492330	14.324.408,50	20.834.125,06	6.509.716,56
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	27/04/2016	2200	2.838,144079	3.384,668789	6.243.916,97	7.446.271,34	1.202.354,36
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	21/12/2015	8310	2.412,107871	3.471,470496	20.044.616,41	28.847.919,82	8.803.303,41

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	999.461.943,98	70.417.723,46	49.580.859,52	1.051.332.128,94	31.033.321,02	3,04%	0,80%	379,50%	2,13%
Fevereiro	1.051.332.128,94	37.653.204,40	36.236.509,81	1.057.268.702,96	4.519.879,43	0,43%	0,74%	58,14%	2,70%
Março	1.057.268.702,96	43.881.957,34	43.077.919,20	1.069.642.781,73	11.570.040,63	1,09%	0,58%	189,45%	1,97%
Acumulado no ano					47.123.241,08	4,62%	2,13%	216,50%	

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 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.678.022,14	0,00	0,00	12.955.853,68	277.831,54	2,19%	1,54%	2,19%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.392.002,72	0,00	0,00	6.507.280,75	115.278,03	1,80%	1,35%	1,80%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.540.350,96	0,00	0,00	3.598.334,62	57.983,66	1,64%	1,09%	1,64%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	11.678.994,22	0,00	0,00	11.866.129,26	187.135,04	1,60%	1,07%	1,60%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	74.426.161,35	0,00	10.000.000,00	65.605.274,10	1.179.112,75	1,58%	1,07%	1,61%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	38.400.336,81	0,00	0,00	39.008.293,91	607.957,10	1,58%	1,06%	1,58%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	36.776.579,17	0,00	0,00	37.334.101,27	557.522,10	1,52%	0,98%	1,52%
TÍTULOS PÚBLICOS	119.038.940,88	0,00	0,00	120.767.861,62	1.728.920,74	1,45%	-	-
HSBC NILO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	25.511.499,40	0,00	0,00	25.853.081,00	341.581,60	1,34%	1,63%	1,34%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	77.734.171,40	0,00	0,00	78.745.642,53	1.011.471,13	1,30%	0,76%	1,30%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.605.151,67	0,00	0,00	16.815.332,48	210.180,81	1,27%	0,73%	1,27%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	10.658.020,28	0,00	0,00	10.769.491,13	111.470,85	1,05%	1,51%	1,05%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	40.228.095,87	0,00	0,00	40.641.770,39	413.674,52	1,03%	0,88%	1,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	12.701.901,87	0,00	0,00	12.832.449,81	130.547,94	1,03%	0,88%	1,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.459.953,45	0,00	0,00	6.524.542,53	64.589,08	1,00%	0,55%	1,00%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	154.997.358,18	0,00	0,00	156.500.377,92	1.503.019,74	0,97%	1,51%	0,97%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	111.588.579,13	0,00	0,00	112.611.189,18	1.022.610,05	0,92%	1,45%	0,92%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	10.377.583,07	20.593.801,65	10.593.801,65	20.615.219,38	237.636,31	0,77%	1,56%	2,08%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.323.345,06	0,00	0,00	13.419.948,24	96.603,18	0,73%	1,79%	0,73%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	57.072.100,01	0,00	0,00	57.478.068,75	405.968,74	0,71%	1,24%	0,71%
GÁVEA SUL FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1 LP	1.235.065,60	0,00	123.719,41	1.119.556,74	8.210,55	0,66%	16,45%	-9,35%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	5.906.718,80	0,00	0,00	5.941.260,68	34.541,88	0,58%	0,25%	0,58%

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 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.176.506,51	0,00	0,00	4.200.553,02	24.046,51	0,58%	0,12%	0,58%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	826.258,97	0,00	0,00	830.989,71	4.730,74	0,57%	0,11%	0,57%
SUL AMÉRICA CRÉDITO ATIVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	4.210.340,05	0,00	0,00	4.234.157,49	23.817,44	0,57%	0,06%	0,57%
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	782.098,03	0,00	157.004,00	628.464,89	3.370,86	0,43%	32,88%	-19,64%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.583.270,16	349.000,00	332.000,00	2.612.208,37	11.938,21	0,41%	0,00%	0,44%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.207.008,31	0,00	1.200.000,00	11.618,72	4.610,41	0,38%	0,01%	0,53%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	33.281.793,21	16.939.155,69	20.671.394,14	29.730.451,07	180.896,31	0,36%	0,01%	0,52%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.285.848,44	0,00	0,00	7.309.444,01	23.595,57	0,32%	1,95%	0,32%
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	89.163,48	0,00	0,00	86.400,67	-2.762,81	-3,10%	-	-
Total Renda Fixa					10.578.090,58	1,17%	1,22%	

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(%)
MÉRITO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - MFII11	5.817.676,76	0,00	0,00	6.394.108,00	576.431,24	9,91%	8,99%	9,91%
KONDOR EQUITIES INSTITUCIONAL FI AÇÕES	21.826.978,50	0,00	0,00	22.427.469,68	600.491,18	2,75%	5,64%	2,75%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	6.879.795,67	6.000.000,00	0,00	13.138.979,81	259.184,14	2,01%	6,69%	3,00%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	3.221.400,41	0,00	0,00	3.265.786,31	44.385,90	1,38%	5,96%	1,38%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	7.684.067,19	0,00	0,00	7.761.269,25	77.202,06	1,00%	-	0,00%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	7.281.958,31	0,00	0,00	7.343.580,76	61.622,45	0,85%	0,80%	0,85%
SULAMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	4.309.554,11	0,00	0,00	4.345.503,30	35.949,19	0,83%	0,33%	0,83%
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	13.386.677,41	0,00	0,00	13.469.625,19	82.947,78	0,62%	6,97%	0,62%
SUL AMÉRICA CRÉDITO ATIVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	4.210.340,05	0,00	0,00	4.234.157,49	23.817,44	0,57%	0,06%	0,57%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	10.432.662,64	0,00	0,00	10.484.414,82	51.752,18	0,50%	0,59%	0,50%
BRADERCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES	15.322.782,76	0,00	0,00	15.392.325,00	69.542,24	0,45%	5,48%	0,45%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.256.831,75	0,00	0,00	1.260.086,22	3.254,47	0,26%	0,08%	0,26%
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	1.180.000,00	0,00	0,00	1.180.000,00	0,00	0,00%	16,96%	0,00%
LSH FIP	4.631.447,06	0,00	0,00	4.630.302,07	-1.144,99	-0,02%	-	-
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL MULTISTRATÉGIA FIP	472.389,95	0,00	0,00	472.154,17	-235,78	-0,05%	0,00%	-0,00%
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	5.482.698,14	0,00	0,00	5.473.361,42	-9.336,72	-0,17%	-	-
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	17.767.714,10	0,00	0,00	17.731.443,51	-36.270,59	-0,20%	5,72%	-0,20%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	10.923.487,24	0,00	0,00	10.867.176,40	-56.310,84	-0,52%	5,46%	-0,52%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	921.525,22	0,00	0,00	916.506,31	-5.018,91	-0,54%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	24.087.274,94	0,00	0,00	23.420.956,82	-666.318,12	-2,77%	9,42%	-2,77%
Total Renda Variável					1.111.944,32	0,64%	5,69%	

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 (%)
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	149.105.289,27	0,00	0,00	156.500.377,92	7.395.088,65	4,96%	4,96%
TÍTULOS PÚBLICOS	116.135.193,83	0,00	756.992,75	120.767.861,62	5.389.660,54	4,65%	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	99.496.958,79	8.111.967,30	0,00	112.611.189,18	5.002.263,09	4,91%	4,89%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	54.588.809,13	0,00	0,00	57.478.068,75	2.889.259,62	5,29%	5,29%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	69.291.925,53	6.654.989,20	0,00	78.745.642,53	2.798.727,80	3,70%	3,74%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	73.081.953,70	0,00	10.000.000,00	65.605.274,10	2.523.320,40	3,45%	3,47%
HSBC NILO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	24.412.569,92	0,00	0,00	25.853.081,00	1.440.511,08	5,90%	5,90%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	39.343.107,89	0,00	0,00	40.641.770,39	1.298.662,50	3,30%	3,30%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	37.716.511,41	0,00	0,00	39.008.293,91	1.291.782,50	3,42%	3,42%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	36.224.017,05	0,00	0,00	37.334.101,27	1.110.084,22	3,06%	3,06%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.560.049,01	0,00	325.316,44	12.955.853,68	721.121,11	5,80%	3,15%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.033.186,60	0,00	332.651,10	13.419.948,24	719.412,74	5,54%	2,97%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	10.264.344,06	0,00	0,00	10.769.491,13	505.147,07	4,92%	4,92%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	10.119.793,05	20.593.801,65	10.593.801,65	20.615.219,38	495.426,33	3,33%	4,68%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.788.618,44	0,00	456.374,53	16.815.332,48	483.088,57	2,91%	2,92%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.451.428,38	95.009.129,10	76.186.729,11	29.730.451,07	456.622,70	0,84%	1,54%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	12.424.324,57	0,00	0,00	12.832.449,81	408.125,24	3,28%	3,28%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.907.260,91	0,00	0,00	7.309.444,01	402.183,10	5,82%	5,82%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	11.468.077,42	0,00	0,00	11.866.129,26	398.051,84	3,47%	3,47%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.408.423,70	0,00	175.308,78	6.507.280,75	274.165,83	4,33%	1,54%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	7.863.690,60	0,00	8.111.967,30	0,00	248.276,70	3,16%	4,86%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.388.483,88	0,00	0,00	6.524.542,53	136.058,65	2,13%	2,13%

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 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.573.736,38	0,00	92.924,12	3.598.334,62	117.522,36	3,33%	0,69%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	5.830.880,59	0,00	0,00	5.941.260,68	110.380,09	1,89%	1,89%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.236.271,58	0,00	114.211,80	4.200.553,02	78.493,24	1,87%	-0,84%
SUL AMÉRICA CRÉDITO ATIVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	4.166.716,54	0,00	0,00	4.234.157,49	67.440,95	1,62%	1,62%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.043.232,90	999.991,85	461.000,00	2.612.208,37	29.983,62	1,21%	1,32%
GÁVEA SUL FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1 LP	1.461.289,03	0,00	368.620,79	1.119.556,74	26.888,50	2,00%	-23,39%
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	920.424,53	0,00	312.690,13	628.464,89	20.730,49	2,33%	-31,72%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	839.225,25	0,00	23.693,93	830.989,71	15.458,39	1,86%	1,86%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	1.200.000,00	1.200.000,00	11.618,72	11.618,72	0,97%	1,58%
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	91.793,32	0,00	0,00	86.400,67	-5.392,65	-5,87%	-5,87%
Total Renda Fixa					36.860.163,99	4,21%	

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 (%)
KONDOR EQUITIES INSTITUCIONAL FI AÇÕES	16.185.980,33	2.780.315,43	0,00	22.427.469,68	3.461.173,92	18,25%	18,92%
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	11.862.048,39	5.892.797,79	5.892.797,79	13.469.625,19	1.607.576,80	9,68%	13,55%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	10.486.629,90	5.680.634,72	0,00	17.731.443,51	1.564.178,89	9,67%	10,77%
BRADESCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES	13.907.228,54	0,00	0,00	15.392.325,00	1.485.096,46	10,68%	10,68%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	6.207.009,73	6.000.000,00	0,00	13.138.979,81	931.970,08	13,07%	14,17%
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	4.864.348,19	0,00	0,00	5.473.361,42	609.013,23	12,52%	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	10.478.796,06	0,00	0,00	10.867.176,40	388.380,34	3,71%	3,71%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	7.119.000,39	0,00	0,00	7.343.580,76	224.580,37	3,15%	3,15%
APEX AÇÕES 30 FIC AÇÕES	8.266.908,49	0,00	8.460.950,15	0,00	194.041,66	2,35%	15,02%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	3.075.978,16	0,00	0,00	3.265.786,31	189.808,15	6,17%	6,17%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	7.594.428,10	0,00	0,00	7.761.269,25	166.841,15	2,20%	-
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	5.326.211,05	5.029.258,16	0,00	10.484.414,82	128.945,61	1,86%	2,00%
SULAMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	4.242.782,87	0,00	0,00	4.345.503,30	102.720,43	2,42%	2,42%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	4.990.438,95	0,00	5.029.258,16	0,00	38.819,21	0,78%	1,76%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	906.512,98	0,00	0,00	916.506,31	9.993,33	1,10%	-
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.254.319,84	0,00	0,00	1.260.086,22	5.766,38	0,46%	0,46%
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL MULTISTRATÉGIA FIP	472.927,50	0,00	0,00	472.154,17	-773,33	-0,16%	-
LSH FIP	4.633.799,38	0,00	0,00	4.630.302,07	-3.497,31	-0,08%	-
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	1.238.000,00	0,00	0,00	1.180.000,00	-58.000,00	-4,68%	-4,68%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	23.633.824,57	0,00	0,00	23.420.956,82	-212.867,75	-0,90%	-0,90%
MÉRITO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - MFII11	6.720.544,04	0,00	0,00	6.394.108,00	-326.436,04	-4,86%	-4,86%
Total Renda Variável					10.507.331,58	6,68%	