

Relatório Analítico dos In
em fevere



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	23.751.381,14	2,08%	15	0,97%	Ar
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	44.013.814,99	3,86%	347	3,31%	Ar
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	25.114.076,18	2,20%	94	4,98%	Ar
CAIXA BRASIL 2018 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	23.893.940,00	2,10%	21	16,52%	Ar
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	26.773.107,71	2,35%	63	8,63%	Ar
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	71.826.385,97	6,30%	223	2,25%	Ar
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	15.765.759,98	1,38%	143	1,51%	Ar
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	59.181.013,64	5,19%	25	12,51%	Ar
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	15/05/2019	10.244.614,26	0,90%	11	11,32%	Ar
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	89.999.400,97	7,90%	1.225	0,72%	Ar
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2018	15.664.104,00	1,37%	163	1,20%	Ar
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	9.157.686,27	0,80%	192	2,61%	Ar
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	18/08/2020	23.047.884,00	2,02%	19	18,00%	Ar
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	17/08/2020	13.781.870,00	1,21%	20	21,42%	Ar
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	174.612.450,69	15,32%	180	7,14%	Ar
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	18/08/2018	89.142.344,98	7,82%	99	8,13%	Ar
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	79.482.188,02	6,97%	204	9,60%	Ar
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	60.007.519,82	5,27%	1.417	0,34%	Ar
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	297.444,89	0,03%	733	0,00%	Art
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	5.955.698,96	0,52%	100	0,56%	Art
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	67.525.696,34	5,92%	748	1,68%	Art
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.594.858,53	0,32%	236	0,33%	Art

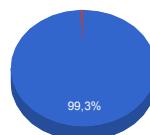
Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	8.358.479,05	0,73%	501	0,09%	Art
ITAU INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	600.279,67	0,05%	134	0,05%	Art
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	70.008.630,42	6,14%	693	1,31%	Art
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	106.648.569,33	9,36%	63	7,14%	Art
CASAN SANEAMENTO FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	6.370.752,75	0,56%	27	2,92%	Art
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	7.019.366,53	0,62%	100	3,04%	Art
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FI AÇÕES	D+24	Não há	4.483.233,38	0,39%	72	0,97%	Ar
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	3.414.000,00	0,30%		1,90%	Art
TOTAL -			1.139.736.552,47				

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

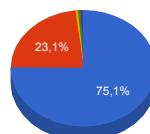
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	855.459.542,62	75,06%	50,00%	60,00%	80,00%	56.329.699,36
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	2,00%	7,00%	10,00%	113.973.655,25
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	262.989.657,19	23,07%	15,00%	20,00%	40,00%	192.904.963,80
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	6.370.752,75	0,56%	0,50%	1,00%	3,00%	27.821.343,82
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	7.019.366,53	0,62%	0,50%	2,00%	4,00%	38.570.095,57
Total Renda Fixa	100,00%	1.131.839.319,09	99,31%	68,00	90,00	137,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,00%	5,00%	56.986.827,62
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	4.483.233,38	0,39%	0,00%	4,00%	5,00%	52.503.594,24
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	3,00%	34.192.096,57
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	1,00%	11.397.365,52
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	3.414.000,00	0,30%	0,00%	0,50%	1,00%	7.983.365,52
Total Renda Variável	30,00%	7.897.233,38	0,69%	0,00	10,00	15,00	-

Distribuição por Artigo / Re



Estratégia de Alocção para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: fevereiro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	855.459.542,62	75,06%	50,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	262.989.657,19	23,07%	15,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	6.370.752,75	0,56%	0,50%	3,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	7.019.366,53	0,62%	0,50%	4,00%
Total Renda Fixa	1.131.839.319,09	99,31%	68,00	137,00

Artigos - Renda Variável	Base: fevereiro / 2018		Li Infer
	Carteira (\$)	Carteira (%)	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	4.483.233,38	0,39%	0,
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	0,
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	3.414.000,00	0,30%	0,
Total Renda Variável	7.897.233,38	0,69%	0

Enquadramentos na Resolução 4. 04 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
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	474.912.273,94	41,67%	-
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	225.323.267,96	19,77%	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	196.954.840,19	17,28%	-
ITAÚ UNIBANCO	154.705.503,31	13,57%	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	87.840.667,07	7,71%	-

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Bens - mês - base (fevereiro / 2018)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês
IRF-M	1,10%	2,42%	3,69%	5,42%	13,07%	39,45%	-	-
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,12%	2,43%	3,67%	5,25%	12,82%	45,56%	0,10%	0,822%
IPCA + 9,00% ao ano	0,94%	2,00%	3,15%	6,23%	11,99%	27,87%	-	-
CASAN SANEAMENTO FIDC SÉNIOR	-1,53%	-2,65%	-3,97%	-7,41%	-9,50%	-9,98%	0,45%	4,638%
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%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,08%	-1,04%	-0,34%	1,85%	3,17%	8,63%	0,20%	4,802%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,09%	-1,04%	-0,35%	1,84%	3,16%	8,55%	0,20%	4,809%
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%
ID A IPCA 2 Anos	0,63%	1,40%	2,58%	4,61%	12,44%	26,40%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,33%	1,12%	1,83%	1,20%	5,01%	12,31%	0,20%	0,493%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,24%	1,28%	1,64%	3,39%	9,43%	22,90%	0,20%	0,356%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,24%	1,29%	1,64%	3,40%	9,45%	-	0,20%	0,359%
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%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,55%	3,91%	4,79%	5,45%	10,73%	40,10%	0,30%	1,835%

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Bens - marcos - base (fevereiro / 2018)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,89%	-0,90%	0,14%	1,81%	6,18%	15,38%	0,20%	4,272%
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%
IRF-M 1	0,54%	1,14%	1,71%	3,74%	9,85%	25,47%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,53%	1,11%	1,68%	3,65%	9,68%	25,09%	0,20%	0,075%
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%
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%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,52%	1,10%	1,66%	3,62%	9,64%	25,02%	0,20%	0,078%
ITÁU SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,52%	1,09%	1,65%	3,62%	9,62%	24,87%	0,20%	0,072%
IMA-B 5	0,54%	1,88%	2,78%	4,42%	11,72%	26,68%	-	-
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	0,52%	1,84%	2,73%	4,35%	11,51%	26,22%	0,10%	0,792%
Selic	0,47%	1,05%	1,60%	3,49%	8,96%	24,10%	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,49%	1,07%	1,60%	3,52%	9,37%	24,86%	0,20%	0,024%
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%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	0,45%	1,03%	1,56%	3,43%	8,88%	24,08%	0,18%	0,003%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,45%	1,04%	1,57%	3,48%	9,13%	24,51%	0,20%	0,006%

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Bens - base (fevereiro / 2018)

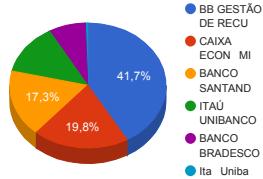
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,44%	1,01%	1,54%	3,42%	8,91%	24,05%	0,20%	0,021%
IPCA	0,32%	0,61%	1,05%	1,92%	2,84%	7,74%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,75%	2,25%	3,06%	4,79%	10,21%	-	0,40%	0,858%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,74%	2,23%	3,05%	4,78%	10,19%	35,96%	0,40%	0,845%
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%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2018 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,43%	-1,41%	-1,07%	0,63%	3,65%	10,06%	0,20%	4,702%

Retorno dos investimentos de Renda Variável e Bens - base (fevereiro / 2018)

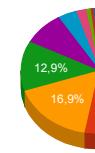
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês
IFIX	1,15%	3,82%	4,44%	10,91%	13,93%	69,83%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-2,32%	6,36%	6,36%	11,68%	5,37%	53,78%	1,20%	11,351%
Ibovespa	0,52%	11,72%	18,59%	20,50%	28,04%	99,46%	-	-
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FI AÇÕES	1,89%	9,77%	16,04%	16,73%	27,80%	-	2,50%	9,039%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	474.912.273,94	41,67%
CAIXA ECON MICA FEDERAL	225.323.267,96	19,77%
BANCO SANTANDER	196.954.840,19	17,28%
ITAU UNIBANCO	148.749.804,35	13,05%
BANCO BRADESCO	87.840.667,07	7,71%
Ita Unibanco S.A.	5.955.698,96	0,52%

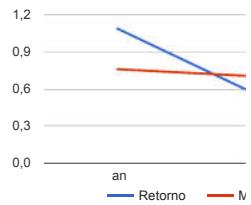


Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	315.443.230,16	27,68%
GESTÃO DURATION	287.216.718,98	25,20%
IMA-B 5	192.227.998,96	16,87%
CDI	146.790.530,37	12,88%
ID A IPCA 2A	98.300.031,25	8,62%
IMA-B	44.474.694,69	3,90%
IRF-M	23.751.381,14	2,08%
ID A IPCA 3A	10.244.614,26	0,90%
CRÉDITO PRIVADO	7.019.366,53	0,62%
FIDC - FECHADO	6.370.752,75	0,56%
AÇÕES - LIVRES	4.483.233,38	0,39%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.414.000,00	0,30%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno ()	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	1.099.169.661,50	27.236.531,08	16.362.674,29	1.122.154.566,01	12.111.047,72	1,09%	0,76%	143,58%	0,49%
Fevereiro	1.122.154.566,01	35.229.103,23	23.773.135,74	1.139.736.552,47	6.126.018,97	0,54%	0,70%	76,72%	1,06%
Acumulado no ano				18.237.066,69	1,64%	1,47%	111,41%		



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

Ativos de Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR -
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	23.489.122,06	0,00	0,00	23.751.381,14	262.259,08	1,12%	0
CASAN SANEAMENTO FIDC SÉNIOR	6.470.053,01	0,00	169.813,96	6.370.752,75	70.513,70	1,09%	4
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	5.911.219,20	0,00	0,00	5.955.698,96	44.479,76	0,75%	0
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	166.928.109,42	6.383.269,02	0,00	174.612.450,69	1.301.072,25	0,75%	0
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	105.869.835,80	0,00	0,00	106.648.569,33	778.733,53	0,74%	0
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.047.140,00	0,00	355.428,32	13.781.870,00	90.158,32	0,64%	4
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.118.375,63	0,00	455.687,74	15.765.759,98	103.072,09	0,64%	0
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.997.260,00	0,00	434.572,99	15.664.104,00	101.416,99	0,63%	4
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	23.539.050,00	0,00	640.361,10	23.047.884,00	149.195,10	0,63%	4
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.575.281,84	0,00	0,00	3.594.858,53	19.576,69	0,55%	1
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	25.643.119,58	0,00	666.753,99	25.114.076,18	137.710,59	0,54%	1
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	58.870.211,74	0,00	0,00	59.181.013,64	310.801,90	0,53%	0
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	89.529.649,08	0,00	0,00	89.999.400,97	469.751,89	0,52%	0
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	43.785.473,64	0,00	0,00	44.013.814,99	228.341,35	0,52%	0
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	79.071.899,64	0,00	0,00	79.482.188,02	410.288,38	0,52%	0
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	26.635.228,86	0,00	0,00	26.773.107,71	137.878,85	0,52%	0
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	55.463.620,84	4.240.139,74	0,00	60.007.519,82	303.759,24	0,51%	0
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	8.317.630,30	0,00	0,00	8.358.479,05	40.848,75	0,49%	0
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	597.567,75	0,00	0,00	600.279,67	2.711,92	0,45%	0
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	66.967.467,31	2.735.000,00	0,00	70.008.630,42	306.163,11	0,44%	0
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	6.989.919,76	0,00	0,00	7.019.366,53	29.446,77	0,42%	0
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	60.923.005,96	21.193.000,00	14.896.500,00	67.525.696,34	306.190,38	0,37%	0

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

Ativos de Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR -
ITAU INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.210.422,47	0,00	0,00	10.244.614,26	34.191,79	0,33%	0
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	298.126,50	677.694,47	680.744,64	297.444,89	2.368,56	0,24%	0
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.397.890,22	0,00	262.607,24	9.157.686,27	22.403,29	0,24%	0
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	73.615.790,76	0,00	1.964.182,51	71.826.385,97	174.777,72	0,24%	4
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	91.507.450,20	0,00	2.581.952,39	89.142.344,98	216.847,17	0,24%	0
CAIXA BRASIL 2018 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	24.489.420,00	0,00	653.280,86	23.893.940,00	57.800,86	0,24%	4
Total Renda Fixa					6.112.760,03	0,54%	1

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

Ativos de Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR -
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FI AÇÕES	4.400.224,44	0,00	0,00	4.483.233,38	83.008,94	1,89%	9
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	3.495.000,00	0,00	11.250,00	3.414.000,00	-69.750,00	-2,00%	11
Total Renda Variável				13.258,94	0,17%	10	