

# 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
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.501.719,80	1,75%	210	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	280.745,27	0,33%	30	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	9.604.272,47	11,19%	1.417	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	982.325,81	1,14%	232	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	8.793.280,20	10,24%	590	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	582.279,82	0,68%	228	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	9.705.845,23	11,30%	110	1,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.519.053,55	5,26%	639	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.437.353,42	5,17%	1.219	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.668.343,46	11,26%	753	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.202.217,48	2,56%	732	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.098.233,99	1,28%	31	0,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	366.363,98	0,43%	481	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	7.731.311,47	9,00%	98	1,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	7.722.267,50	8,99%	83	1,56%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	661.968,68	0,77%	9.154	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.980,15	0,01%	99	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.462.107,95	4,03%	734	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.201.938,73	1,40%	37	0,50%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	308.362,71	0,36%	26	0,33%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	2.106.915,11	2,45%	98	2,14%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	10.098,83	0,01%		1,10%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "

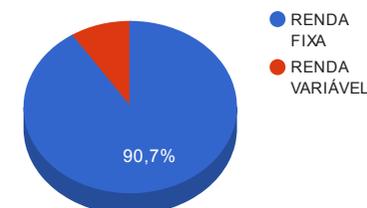
Carteira consolidada de investimentos - base (março / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	D+90 ou D+150 a D+450	18 meses	941.625,20	1,10%	14	8,35%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	1.547.784,34	1,80%	120	0,36%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	D+4382	Não há	0,01	0,00%	5	-0,00%	Artigo 8º, Inciso III
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	Não se aplica	Não se aplica	3.058.987,91	3,56%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se aplica	Não se aplica	3.358.083,13	3,91%		6,47%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
<b>TOTAL -</b>			<b>85.858.466,20</b>				

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

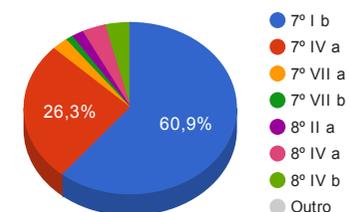
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	52.277.436,51	60,89%	15,00%	25,00%	70,00%	7.823.489,83
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	51.515.079,72
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	22.557.535,16	26,27%	5,00%	10,00%	30,00%	3.200.004,70
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	7,00%	15,00%	15,00%	12.878.769,93
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	2.117.013,94	2,47%	2,00%	5,00%	5,00%	2.175.909,37
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	941.625,20	1,10%	2,00%	5,00%	5,00%	3.351.298,11
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>77.893.610,81</b>	<b>90,72%</b>	<b>36,00</b>	<b>70,00</b>	<b>190,00</b>	<b>-</b>

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	10,00%	8.585.846,62
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	1.547.784,34	1,80%	2,00%	5,00%	10,00%	7.038.062,28
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,01	0,00%	7,00%	10,00%	10,00%	8.585.846,61
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	3.058.987,91	3,56%	2,00%	5,00%	5,00%	1.233.935,40
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	3.358.083,13	3,91%	2,00%	5,00%	5,00%	934.840,18
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>7.964.855,39</b>	<b>9,28%</b>	<b>15,00</b>	<b>30,00</b>	<b>40,00</b>	<b>-</b>

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 " b "	52.277.436,51	60,89%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	22.557.535,16	26,27%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	2.117.013,94	2,47%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	941.625,20	1,10%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>77.893.610,81</b>	<b>90,72%</b>	<b>36,00</b>	<b>190,00</b>

Artigos - Renda Variável	Base: março / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	1.547.784,34	1,80%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,01	0,00%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	3.058.987,91	3,56%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	3.358.083,13	3,91%	2,00%	5,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>7.964.855,39</b>	<b>9,28%</b>	<b>15,00</b>	<b>40,00</b>

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
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	27.013.452,33	31,46%	0,00%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	26.937.683,77	31,37%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	19.477.238,87	22,69%	0,00%
AQ3 ASSET MANAGEMENT	3.358.083,13	3,91%	2,54%
ROMA ASSET	3.058.987,91	3,56%	0,98%
FINAXIS CORRETORA	2.106.915,11	2,45%	2,14%
VINCI PARTNERS	1.547.784,34	1,80%	0,01%
BRIDGE TRUST	1.406.596,70	1,64%	0,12%
SECURITY ADMINISTRADORA DE RECURSOS	941.625,20	1,10%	8,35%
BRASIL PLURAL	10.098,84	0,01%	0,00%

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
IDKA PRÉ 2 ANOS	1,62%	3,81%	3,81%	6,02%	14,71%	37,51%	-	-	-
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1,61%	3,80%	3,80%	5,88%	14,19%	-	0,20%	0,855%	3,82%
IMA-B 5	1,62%	3,53%	3,53%	5,06%	11,97%	27,76%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1,65%	3,58%	3,58%	4,96%	11,89%	27,81%	0,20%	1,111%	3,72%
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,24%	3,61%	3,61%	1,79%	7,10%	20,92%	0,70%	0,771%	5,05%
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,10%	2,66%	2,66%	6,21%	8,65%	-	0,70%	0,853%	3,74%
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%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,48%	3,03%	3,03%	5,01%	11,50%	26,80%	0,20%	0,939%	2,73%
IRF-M 1+	1,57%	4,50%	4,50%	5,86%	14,14%	41,99%	-	-	-
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%	5,82%
IMA-B	0,94%	4,94%	4,94%	4,60%	10,73%	34,61%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,97%	4,96%	4,96%	4,55%	10,73%	35,26%	0,20%	1,514%	9,18%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,93%	4,89%	4,89%	4,47%	10,25%	33,64%	0,20%	1,471%	9,07%
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%
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%	9,05%
CDI + 3,50% ao ano	0,82%	2,44%	2,44%	5,11%	12,11%	32,01%	-	-	-

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
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-1,18%	-57,24%	-57,24%	5,87%	20,73%	-82,66%	0,20%	12,206%	299,10%
IRF-M 1	0,66%	1,80%	1,80%	3,65%	9,34%	24,73%	-	-	-
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,65%	1,75%	1,75%	3,56%	9,14%	24,30%	0,20%	0,133%	0,66%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,64%	1,75%	1,75%	3,57%	9,16%	24,36%	0,20%	0,127%	0,64%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,63%	1,75%	1,75%	3,55%	9,11%	24,19%	0,10%	0,128%	0,65%
Selic	0,53%	1,59%	1,59%	3,38%	8,40%	23,33%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,52%	1,60%	1,60%	3,37%	8,80%	24,09%	0,20%	0,003%	0,14%
CDI	0,53%	1,59%	1,59%	3,37%	8,39%	23,30%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,54%	1,59%	1,59%	3,45%	8,48%	23,44%	0,20%	0,010%	0,11%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,51%	1,53%	1,53%	3,28%	8,26%	23,24%	0,25%	0,006%	0,11%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,22%	0,74%	0,74%	1,58%	3,75%	-1,95%	1,00%	0,035%	0,28%
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,42%	1,69%	1,69%	3,86%	6,81%	16,30%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,46%	-2,82%	-2,82%	-1,89%	-6,31%	-18,68%	0,25%	0,670%	3,50%
IMA-B 5+	0,38%	5,94%	5,94%	4,21%	10,24%	38,98%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	0,36%	5,81%	5,81%	4,00%	9,74%	38,08%	0,20%	1,980%	12,04%
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%	11,76%

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

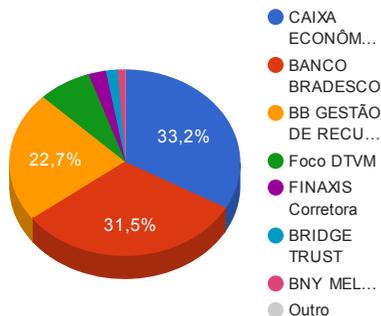
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,32%	5,82%	5,82%	4,04%	9,75%	38,00%	0,20%	1,955%	11,87%

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

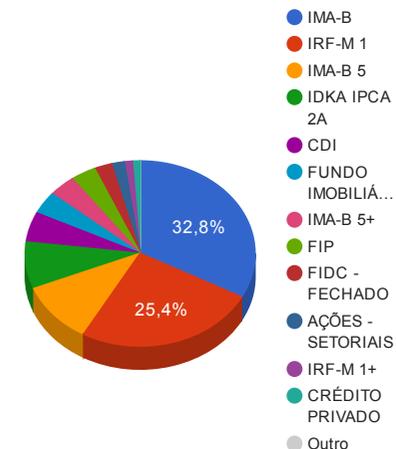
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	2,00%	5,89%	5,89%	6,15%	15,97%	58,68%	-	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	24,71%	24,70%	24,70%	17,97%	4,93%	-29,33%	1,50%	40,638%	30,81%
IDIV	1,05%	10,36%	10,36%	8,41%	21,26%	88,12%	-	-	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	0,64%	6,74%	6,74%	8,07%	20,24%	38,24%	1,72%	5,470%	17,35%
IPCA + 8,00% ao ano	0,73%	2,60%	2,60%	5,72%	10,73%	25,09%	-	-	-
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	8,56%	27,36%	27,36%	-101,85%	-100,57%	-100,42%	0,12%	2,042%	116,54%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	-	-	-	-	-	-	0,30%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	28.485.468,11	33,18%
BANCO BRADESCO	27.013.452,33	31,46%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	19.477.238,87	22,69%
Foco DTVM	6.417.071,04	7,47%
FINAXIS Corretora	2.106.915,11	2,45%
BRIDGE TRUST	1.406.596,71	1,64%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	941.625,20	1,10%
Geração Futuro	10.098,83	0,01%



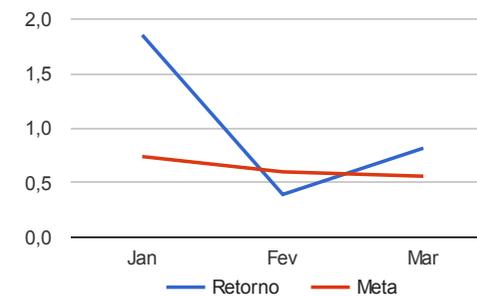
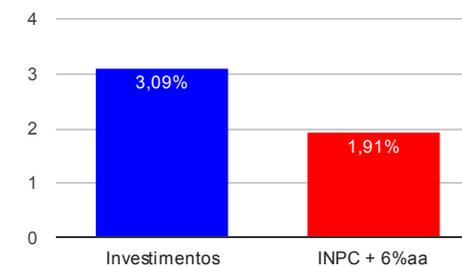
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	28.172.449,04	32,81%
IRF-M 1	21.772.937,36	25,36%
IMA-B 5	9.128.864,20	10,63%
IDKA IPCA 2A	7.002.016,30	8,16%
CDI	4.490.440,61	5,23%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.358.083,13	3,91%
IMA-B 5+	3.285.938,35	3,83%
FIP	3.058.987,91	3,56%
FIDC - FECHADO	2.117.013,94	2,47%
AÇÕES - SETORIAIS	1.547.784,34	1,80%
IRF-M 1+	982.325,81	1,14%
CRÉDITO PRIVADO	941.625,20	1,10%
MULTIMERCADO	0,01	0,00%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	82.946.104,15	2.135.008,78	1.550.336,53	85.077.991,13	1.547.214,73	1,85%	0,74%	249,91%	1,06%
Fevereiro	85.077.991,13	577.688,15	935.829,37	85.054.173,22	334.323,31	0,39%	0,60%	65,73%	1,22%
Março	85.054.173,22	1.614.103,74	1.505.323,12	85.858.466,20	695.512,36	0,82%	0,56%	146,60%	2,59%
Acumulado no ano					2.577.050,40	3,09%	1,91%	161,82%	

**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(%)
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	7.596.838,91	0,00	0,00	7.722.267,50	125.428,59	1,65%	1,11%	1,65%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	276.305,49	0,00	0,00	280.745,27	4.439,78	1,61%	0,85%	1,61%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	967.435,63	0,00	0,00	982.325,81	14.890,18	1,54%	0,97%	1,54%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.451.569,07	0,00	0,00	4.519.053,55	67.484,48	1,52%	0,98%	1,52%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.170.052,39	0,00	0,00	2.202.217,48	32.165,09	1,48%	0,94%	1,48%
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.084.736,05	0,00	0,00	1.098.233,99	13.497,94	1,24%	0,77%	1,24%
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	305.018,00	0,00	0,00	308.362,71	3.344,71	1,10%	0,85%	1,10%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.932,32	0,00	0,00	4.980,15	47,83	0,97%	1,51%	0,97%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.702.189,43	12.974,37	0,00	8.793.280,20	78.116,40	0,90%	1,45%	0,90%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	9.551.770,32	792.452,93	728.326,31	9.705.845,23	89.948,29	0,87%	1,47%	0,93%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.793.881,13	792.452,94	0,00	9.668.343,46	82.009,39	0,86%	1,45%	0,92%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	7.681.437,19	0,00	0,00	7.731.311,47	49.874,28	0,65%	0,13%	0,65%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.267.474,75	0,00	728.326,31	9.604.272,47	65.124,03	0,63%	0,13%	0,64%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.409.406,61	0,00	0,00	4.437.353,42	27.946,81	0,63%	0,13%	0,63%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.443.527,71	0,00	0,00	3.462.107,95	18.580,24	0,54%	0,01%	0,54%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	364.459,46	0,00	0,00	366.363,98	1.904,52	0,52%	0,00%	0,52%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	658.604,20	0,00	0,00	661.968,68	3.364,48	0,51%	0,01%	0,51%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	1.213.803,37	0,00	16.223,50	1.201.938,73	4.358,86	0,36%	1,98%	0,36%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.512.595,27	16.223,50	32.447,00	1.501.719,80	5.348,03	0,35%	1,95%	0,35%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	580.400,17	0,00	0,00	582.279,82	1.879,65	0,32%	1,95%	0,32%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	939.576,52	0,00	0,00	941.625,20	2.048,68	0,22%	0,04%	0,22%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.116.734,26	0,00	0,00	2.106.915,11	-9.819,15	-0,46%	0,67%	-0,46%

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(%)
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	10.219,74	0,00	0,00	10.098,83	-120,91	-1,18%	12,21%	-1,18%
Total Renda Fixa					681.862,20	0,88%	0,89%	

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(%)
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.538.004,52	0,00	0,00	1.547.784,34	9.779,82	0,64%	5,47%	0,64%
ÁQUILLA FII - AQLL11	3.352.938,49	0,00	0,00	3.358.083,13	5.144,64	0,15%	40,64%	24,71%
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	2,04%	8,56%
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	3.060.262,21	0,00	0,00	3.058.987,91	-1.274,30	-0,04%	-	-
<b>Total Renda Variável</b>					<b>13.650,16</b>	<b>0,17%</b>	<b>29,54%</b>	

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 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	9.191.436,63	792.452,93	728.326,31	9.705.845,23	450.281,98	4,82%	4,89%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.461.030,98	792.452,94	0,00	9.668.343,46	414.859,54	4,82%	4,89%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.372.976,45	12.974,37	0,00	8.793.280,20	407.329,38	4,86%	4,86%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	7.455.279,89	0,00	0,00	7.722.267,50	266.987,61	3,58%	3,58%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	11.227.410,69	425.855,02	2.234.861,27	9.604.272,47	185.868,03	1,72%	1,75%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.384.684,97	0,00	0,00	4.519.053,55	134.368,58	3,06%	3,06%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	6.981.974,02	1.341.887,47	723.869,07	7.731.311,47	131.319,05	1,70%	1,75%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.534.663,86	16.223,50	138.660,41	1.501.719,80	89.492,85	5,86%	5,85%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.360.870,33	0,00	0,00	4.437.353,42	76.483,09	1,75%	1,75%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	1.251.973,18	0,00	122.436,71	1.201.938,73	72.402,26	5,83%	5,81%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.137.383,75	0,00	0,00	2.202.217,48	64.833,73	3,03%	3,03%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.408.035,33	0,00	0,00	3.462.107,95	54.072,62	1,59%	1,59%
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.059.924,65	0,00	0,00	1.098.233,99	38.309,34	3,61%	3,61%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	944.954,44	0,00	982.325,81	37.371,37	3,95%	4,68%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	550.241,39	0,00	0,00	582.279,82	32.038,43	5,82%	5,82%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	270.469,40	0,00	0,00	280.745,27	10.275,87	3,80%	3,80%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	651.999,54	0,00	0,00	661.968,68	9.969,14	1,53%	1,53%
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	300.380,51	0,00	0,00	308.362,71	7.982,20	2,66%	2,66%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	934.685,49	0,00	0,00	941.625,20	6.939,71	0,74%	0,74%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	360.606,98	0,00	0,00	366.363,98	5.757,00	1,60%	1,60%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.744,82	0,00	0,00	4.980,15	235,33	4,96%	4,96%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	23.618,76	0,00	12.669,17	10.098,83	-850,76	-8,04%	-57,24%

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 (%)
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.168.020,33	0,00	1.744,09	2.106.915,11	-59.361,13	-2,74%	-2,82%
				Total Renda Fixa	2.436.965,22	3,22%	

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 (%)
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.450.002,25	0,00	28.921,99	1.547.784,34	126.704,08	8,76%	6,74%
ÁQUILLA FII - AQLL11	3.340.874,72	0,00	0,00	3.358.083,13	17.208,41	0,52%	24,70%
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	27,36%
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	3.062.815,22	0,00	0,00	3.058.987,91	-3.827,31	-0,12%	-
Total Renda Variável					140.085,18	1,78%	

