

Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2018



Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			659.095,34	0,06%			Artigo 20
TÍTULOS PÚBLICOS			166.236.628,29	16,23%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	6.908.403,54	0,67%	66	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	55.871.508,59	5,46%	347	4,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	40.158.431,52	3,92%	357	1,84%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	7.101.831,35	0,69%	1.043	11,94%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	94.590.799,27	9,24%	716	1,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	157.710.479,49	15,40%	321	5,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	12.598.324,37	1,23%	20	3,99%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	47.290.410,22	4,62%	698	0,94%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	52.587.120,09	5,13%	236	4,88%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER MASTER FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	12.612.603,86	1,23%	70.863	0,15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	117.352,68	0,01%	1.395	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	35.001.669,24	3,42%	63	2,34%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	21.533.342,77	2,10%	310	0,84%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES LP	D+0	Não há	7.408.265,05	0,72%	1.443	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	16.092.457,66	1,57%	494	8,45%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	47.953.802,19	4,68%	99	3,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	36.007.861,01	3,52%	81	8,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	13.795.828,65	1,35%	501	0,15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CARTÃO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	D+45 a D+75	Não há	6.967.841,07	0,68%	189	1,69%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	39.744,83	0,00%		4,29%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "

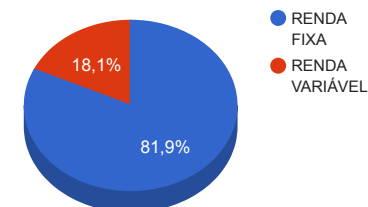
Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR 2	Não se aplica	Não se aplica	73.406,49	0,01%	11	4,98%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	39.539.232,96	3,86%	50	5,17%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	19.128.149,44	1,87%	363	7,30%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	7.239.744,72	0,71%	113	1,96%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ARX INCOME FI AÇÕES	D+4	Não há	23.412.838,67	2,29%	1.106	11,78%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	28.255.520,08	2,76%	4.335	5,28%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	6.809.982,16	0,66%	1.069	2,39%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	10.102.010,56	0,99%	285	4,56%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	4.495.668,85	0,44%	6.141	1,20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	6.869.918,61	0,67%	13.782	0,53%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ INSTITUCIONAL CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA FI MULTIMERCADO	D+1	19/06/2018	8.561.724,00	0,84%	10	24,62%	Artigo 8º, Inciso III
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	14.029.388,29	1,37%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP	Não se aplica	Não se aplica	464.087,99	0,05%	19	0,22%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	765.299,27	0,07%	39	0,40%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	S/Info	Não se aplica	9.230.430,16	0,90%		5,80%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	Não se aplica	Não se aplica	5.900.000,00	0,58%		5,71%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
		TOTAL -	1.024.121.203,33				

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

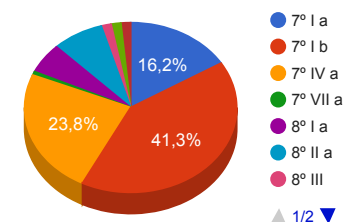
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	166.236.628,29	16,23%	17,00%	40,00%	40,00%	243.411.853,04
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	422.230.188,35	41,23%	35,00%	50,00%	50,00%	89.830.413,32
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	21,00%	35,00%	35,00%	358.442.421,17
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	243.110.303,20	23,74%	4,00%	10,00%	20,00%	-38.286.062,53
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	7.080.992,39	0,69%	0,70%	1,00%	2,00%	13.401.431,68
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00	0,00%	1,00%	2,00%	3,00%	30.723.636,10
Em Enquadramento - RF	0,00%	0,00	0,00%	1,00%	2,00%	3,00%	30.723.636,10
Total Renda Fixa	100,00%	838.658.112,23	81,89%	79,70	140,00	154,00	-

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%	58.667.382,40	5,73%	5,00%	6,00%	7,00%	13.021.101,83
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	80.315.765,04	7,84%	6,00%	6,00%	7,00%	-8.627.280,81
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	20,00%	0,00	0,00%	0,70%	1,00%	2,00%	20.482.424,07
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	15.431.642,61	1,51%	1,00%	3,00%	5,00%	35.774.417,56
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	15.258.775,55	1,49%	1,00%	2,00%	4,00%	25.706.072,58
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	15.130.430,16	1,48%	1,00%	2,00%	3,00%	15.593.205,94
Desenquadrado - RV	0,00%	0,00	0,00%	1,00%	2,00%	3,00%	30.723.636,10
Em Enquadramento - RV	0,00%	0,00	0,00%	1,00%	2,00%	3,00%	30.723.636,10
Total Renda Variável	30,00%	184.803.995,76	18,05%	16,70	24,00	34,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: fevereiro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	166.236.628,29	16,23%	17,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	422.230.188,35	41,23%	35,00%	50,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	21,00%	35,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	243.110.303,20	23,74%	4,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	7.080.992,39	0,69%	0,70%	2,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	1,00%
Desenquadrado - RF	0,00	0,00%	1,00%	3,00%
Em Enquadramento - RF	0,00	0,00%	1,00%	3,00%
Total Renda Fixa	838.658.112,23	81,89%	79,70	154,00

Artigos - Renda Variável	Base: fevereiro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	58.667.382,40	5,73%	5,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	80.315.765,04	7,84%	6,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,70%	5,00%
Artigo 8º, Inciso III	15.431.642,61	1,51%	1,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	15.258.775,55	1,49%	1,00%	4,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	15.130.430,16	1,48%	1,00%	3,00%
Desenquadrado - RV	0,00	0,00%	1,00%	3,00%
Em Enquadramento - RV	0,00	0,00%	1,00%	3,00%
Total Renda Variável	184.803.995,76	18,05%	16,70	68,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (fevereiro / 2018)

Artigo 14º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	273.834.621,53	26,74%	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	140.035.961,83	13,67%	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	97.757.491,85	9,55%	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	68.601.465,13	6,70%	-
ITAÚ UNIBANCO	67.982.072,39	6,64%	-
AZ QUEST INVESTIMENTOS	51.157.959,90	5,00%	-
ITAÚ DTVM	39.539.232,96	3,86%	-
WESTERN ASSET	25.998.068,05	2,54%	-
ARX INVESTIMENTOS	23.412.838,67	2,29%	-
KINEA INVESTIMENTOS	14.029.388,29	1,37%	-
SAFRA ASSET MANAGEMENT	12.598.324,37	1,23%	-
RB CAPITAL ASSET MANAGEMENT	9.230.430,16	0,90%	-
VINCI PARTNERS	7.239.744,72	0,71%	-
GERAÇÃO FUTURO	7.101.831,35	0,69%	-
OLIVEIRA TRUST	6.967.841,07	0,68%	-

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
REAG GESTORA DE RECURSOS	5.900.000,00	0,58%	-%
XP GESTÃO DE RECURSOS	4.495.668,85	0,44%	-%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	765.299,27	0,07%	-%
BRZ INVESTIMENTOS	464.087,99	0,05%	-%
BRASIL PLURAL	113.151,32	0,01%	-%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M	1,10%	2,42%	3,69%	5,42%	13,07%	39,45%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,17%	2,56%	3,77%	5,36%	12,78%	39,17%	0,20%	0,838%	4,51%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10%	2,40%	3,66%	5,32%	12,77%	38,94%	0,20%	0,815%	4,49%
CDI + 3,50% ao ano	0,71%	1,60%	2,43%	5,21%	12,71%	32,85%	-	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-7,17%	-56,73%	5,40%	-38,66%	10,28%	-82,70%	0,20%	17,737%	297,97%
120% do CDI	0,56%	1,26%	1,92%	4,19%	10,83%	29,53%	-	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	-4,14%	-7,71%	-11,25%	-9,44%	-34,07%	-46,11%	0,00%	4,448%	-
IMA-B	0,55%	3,97%	4,83%	5,51%	10,85%	40,45%	-	-	-
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	0,59%	3,92%	4,77%	5,45%	10,43%	39,60%	0,20%	1,827%	8,67%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,55%	3,95%	4,83%	5,44%	10,83%	40,77%	0,20%	1,877%	9,20%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,55%	3,91%	4,79%	5,45%	10,73%	40,10%	0,30%	1,835%	9,08%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	0,51%	3,93%	4,77%	5,30%	9,77%	38,28%	0,15%	1,912%	9,56%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	0,49%	3,84%	4,71%	5,23%	10,57%	37,49%	0,45%	1,952%	9,39%
IMA-B 5	0,54%	1,88%	2,78%	4,42%	11,72%	26,68%	-	-	-
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,57%	1,90%	2,78%	4,30%	11,67%	26,64%	0,20%	0,779%	3,68%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,53%	1,85%	2,73%	4,32%	11,52%	26,20%	0,20%	0,783%	3,43%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,52%	1,84%	2,73%	4,35%	11,51%	26,22%	0,10%	0,792%	3,44%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,52%	1,84%	2,72%	4,31%	11,55%	26,29%	0,20%	0,784%	3,45%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	0,51%	1,81%	2,68%	4,22%	11,28%	25,69%	0,40%	0,784%	3,43%
115% do CDI	0,53%	1,21%	1,84%	4,02%	10,36%	28,14%	-	-	-
CARTÃO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	0,54%	1,24%	1,84%	4,03%	10,38%	28,19%	0,20%	0,095%	0,25%
Selic	0,47%	1,05%	1,60%	3,49%	8,96%	24,10%	-	-	-
BRABESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,49%	1,07%	1,60%	3,52%	9,37%	24,86%	0,20%	0,024%	0,14%
CDI	0,46%	1,05%	1,59%	3,48%	8,95%	24,07%	-	-	-
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	0,47%	1,24%	1,88%	4,33%	9,55%	25,74%	1,00%	0,366%	4,91%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,46%	1,04%	1,58%	3,48%	9,09%	24,32%	0,20%	0,005%	0,12%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES LP	0,45%	1,02%	1,56%	3,43%	8,91%	23,80%	0,15%	0,004%	0,11%
SANTANDER MASTER FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,40%	0,91%	1,39%	3,09%	8,23%	22,36%	1,00%	0,005%	0,12%
IPCA	0,32%	0,61%	1,05%	1,92%	2,84%	7,74%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,74%	2,23%	3,05%	4,78%	10,19%	35,96%	0,40%	0,845%	5,62%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

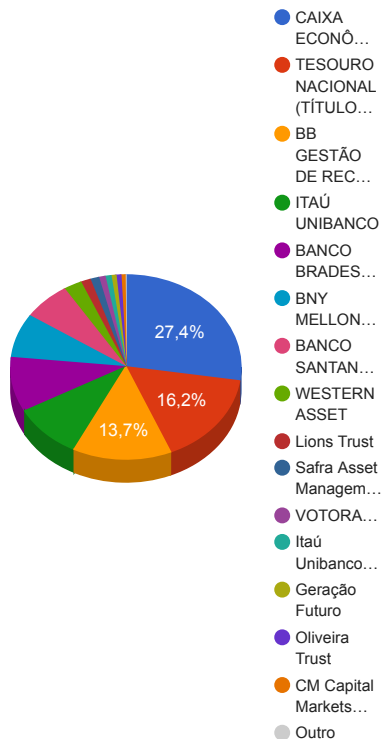
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	1,15%	3,82%	4,44%	10,91%	13,93%	69,83%	-	-	-
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	5,36%	-4,68%	-1,66%	30,82%	13,46%	8,25%	0,95%	27,772%	89,42%
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	4,31%	6,97%	6,91%	4,31%	19,11%	71,04%	0,00%	5,819%	16,42%
IPCA + 9,50% ao ano	0,97%	2,07%	3,26%	6,46%	12,49%	29,04%	-	-	-
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP	-	-	-	-	-	-	1,30%	0,007%	6,32%
Ibovespa	0,52%	11,72%	18,59%	20,50%	28,04%	99,46%	-	-	-
ARX INCOME FI AÇÕES	3,19%	15,59%	22,82%	21,06%	27,86%	91,48%	3,00%	11,242%	20,82%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	1,98%	16,04%	23,30%	24,70%	31,68%	84,73%	2,00%	12,050%	20,02%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	1,17%	11,00%	17,42%	17,85%	26,68%	81,30%	1,50%	9,469%	17,67%
IPCA	0,32%	0,61%	1,05%	1,92%	2,84%	7,74%	-	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	-	-	-	-	-	-	0,00%	-	-
S&P 500	-3,89%	1,50%	2,50%	9,80%	14,64%	40,45%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-3,29%	1,92%	3,66%	12,30%	23,41%	70,05%	1,00%	12,586%	9,50%
Global BDRX	-1,26%	0,36%	4,73%	15,43%	23,83%	18,65%	-	-	-
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-2,82%	-1,50%	2,20%	11,28%	20,73%	12,68%	1,50%	8,968%	13,47%
IDIV	-0,61%	9,21%	14,61%	13,85%	17,78%	124,49%	-	-	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	0,34%	6,07%	11,62%	12,17%	18,24%	42,73%	1,72%	8,323%	17,55%

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

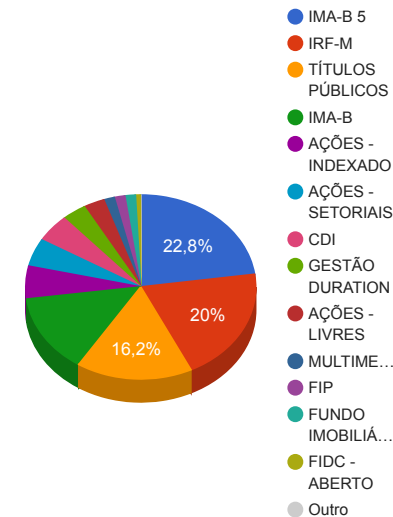
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,24%	12,82%	18,82%	18,49%	15,71%	105,50%	1,50%	9,938%	23,47%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	-0,71%	4,73%	10,72%	7,62%	13,91%	71,76%	3,00%	7,150%	16,72%
SMLL	-0,37%	3,95%	11,26%	10,88%	31,79%	113,67%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1,49%	10,84%	16,41%	18,45%	33,77%	86,78%	2,00%	10,192%	20,52%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA FI MULTIMERCADO	0,36%	0,17%	1,02%	2,76%	-	-	0,18%	1,516%	-
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	-	-	-	-	-	-	2,00%	172,165%	95,50%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	281.074.366,25	27,45%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	166.236.628,29	16,23%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	140.500.049,82	13,72%
ITAÚ UNIBANCO	98.959.581,35	9,66%
BANCO BRADESCO	97.757.491,85	9,55%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	79.066.467,42	7,72%
BANCO SANTANDER	68.601.465,13	6,70%
WESTERN ASSET	25.998.068,05	2,54%
Lions Trust	14.029.388,29	1,37%
Safra Asset Management	12.598.324,37	1,23%
VOTORANTIM ASSET MANAGEMENT	9.230.430,16	0,90%
Itaú Unibanco S.A.	8.561.724,00	0,84%
Geração Futuro	7.141.576,18	0,70%
Oliveira Trust	6.967.841,07	0,68%
CM Capital Markets DTVM	5.900.000,00	0,58%
Santander Securities Services	765.299,27	0,07%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	659.095,34	0,06%
GRADUAL INVESTIMENTOS	73.406,49	0,01%



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	233.537.003,93	22,80%
IRF-M	205.000.889,71	20,02%
TÍTULOS PÚBLICOS	166.236.628,29	16,23%
IMA-B	141.774.420,77	13,84%
AÇÕES - INDEXADO	58.667.382,40	5,73%
AÇÕES - SETORIAIS	50.092.944,21	4,89%
CDI	50.026.507,90	4,88%
GESTÃO DURATION	35.001.669,24	3,42%
AÇÕES - LIVRES	30.222.820,83	2,95%
MULTIMERCADO	15.431.642,61	1,51%
FIP	15.258.775,55	1,49%
FUNDO IMOBILIÁRIO	15.130.430,16	1,48%
FIDC - ABERTO	6.967.841,07	0,68%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	659.095,34	0,06%
FIDC - FECHADO	113.151,32	0,01%



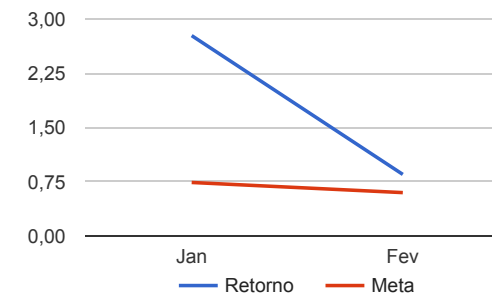
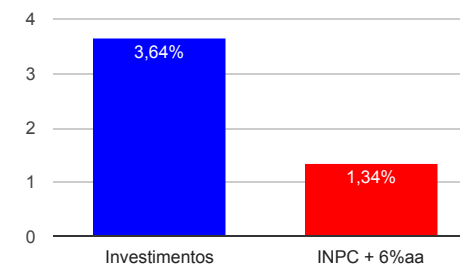
Carteira de Títulos Públicos - base (fevereiro / 2018)

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	11/03/2015	8000	3.023,981475	3.230,241378	24.191.851,80	25.841.931,02	1.650.079,22
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2019	11/03/2015	4000	2.584,200138	3.230,241378	10.336.800,55	12.920.965,51	2.584.164,96
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	06/12/2016	3450	2.926,773673	3.290,141765	10.097.369,17	11.350.989,09	1.253.619,92
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	11/03/2015	7600	3.031,376224	3.307,828068	23.038.459,30	25.139.493,32	2.101.034,01
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	23/03/2015	2000	2.593,340767	3.307,828068	5.186.681,53	6.615.656,14	1.428.974,60
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	06/12/2016	3400	2.955,347610	3.329,260822	10.048.181,87	11.319.486,79	1.271.304,92
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/03/2015	8500	3.097,511439	3.453,811178	26.328.847,23	29.357.395,01	3.028.547,78
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/03/2015	6000	3.097,511438	3.453,811178	18.585.068,63	20.722.867,07	2.137.798,44
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/03/2015	3200	2.350,172187	3.453,811178	7.520.551,00	11.052.195,77	3.531.644,77
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	06/12/2016	3450	2.896,880939	3.453,811178	9.994.239,24	11.915.648,56	1.921.409,32

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	967.325.794,34	7.921.414,33	19.997.653,99	982.019.860,97	26.770.306,29	2,77%	0,74%	373,39%	2,44%
Fevereiro	982.019.860,97	73.502.867,19	40.700.678,25	1.023.462.107,99	8.640.058,08	0,85%	0,60%	142,41%	2,94%
Acumulado no ano					35.410.364,37	3,64%	1,34%	271,13%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	155.887.504,16	0,00	0,00	157.710.479,49	1.822.975,33	1,17%	0,84%	1,17%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	46.774.491,84	0,00	0,00	47.290.410,22	515.918,38	1,10%	0,81%	1,10%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	34.746.091,76	0,00	0,00	35.001.669,24	255.577,48	0,74%	0,85%	0,74%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	21.406.257,32	0,00	0,00	21.533.342,77	127.085,45	0,59%	1,83%	0,59%
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	35.803.080,65	0,00	0,00	36.007.861,01	204.780,36	0,57%	0,78%	0,57%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	47.692.504,85	0,00	0,00	47.953.802,19	261.297,34	0,55%	1,88%	0,55%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	52.300.743,96	0,00	0,00	52.587.120,09	286.376,13	0,55%	1,83%	0,55%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	38.650.893,14	16.918.057,34	0,00	55.871.508,59	302.558,11	0,54%	0,79%	0,52%
CARTÃO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	6.930.698,34	0,00	0,00	6.967.841,07	37.142,73	0,54%	0,09%	0,51%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	94.090.449,75	0,00	0,00	94.590.799,27	500.349,52	0,53%	0,78%	0,53%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	39.283.279,91	665.658,75	0,00	40.158.431,52	209.492,86	0,52%	0,78%	0,52%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	7.065.699,40	0,00	0,00	7.101.831,35	36.131,95	0,51%	1,91%	0,51%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	6.873.383,62	0,00	0,00	6.908.403,54	35.019,92	0,51%	0,78%	0,51%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	12.536.419,89	0,00	0,00	12.598.324,37	61.904,48	0,49%	1,95%	0,49%
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	13.728.407,02	0,00	0,00	13.795.828,65	67.421,63	0,49%	0,02%	0,49%
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	16.016.713,97	0,00	0,00	16.092.457,66	75.743,69	0,47%	0,37%	0,47%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES LP	7.374.910,70	0,00	0,00	7.408.265,05	33.354,35	0,45%	0,00%	0,45%
TÍTULOS PÚBLICOS	166.025.250,63	0,00	306.949,95	166.236.628,29	518.327,61	0,31%	-	-
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.204.626,84	290.000,00	4.387.478,69	117.352,68	10.204,53	0,23%	0,01%	0,46%
SANTANDER MASTER FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	397.113,34	36.513.000,00	24.335.945,77	12.612.603,86	38.436,29	0,10%	0,01%	0,40%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	76.484,05	0,00	0,00	73.406,49	-3.077,56	-4,02%	4,45%	-4,14%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	42.814,93	0,00	0,00	39.744,83	-3.070,10	-7,17%	17,74%	-7,17%
Total Renda Fixa					5.393.950,48	0,65%	0,97%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	13.041.587,75	0,00	51.059,27	14.029.388,29	1.038.859,81	7,97%	-	-
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	5.600.000,00	0,00	0,00	5.900.000,00	300.000,00	5,36%	27,77%	5,36%
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	8.846.188,68	0,00	53.534,76	9.230.430,16	437.776,24	4,95%	5,82%	4,31%
ARX INCOME FI AÇÕES	22.689.739,14	0,00	0,00	23.412.838,67	723.099,53	3,19%	11,24%	3,19%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	6.677.861,30	0,00	0,00	6.809.982,16	132.120,86	1,98%	12,05%	1,98%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	27.841.815,43	0,00	0,00	28.255.520,08	413.704,65	1,49%	10,19%	1,49%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	39.081.745,59	0,00	0,00	39.539.232,96	457.487,37	1,17%	9,47%	1,17%
ITAÚ INSTITUCIONAL CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA FI MULTIMERCAD...	8.530.889,60	0,00	0,00	8.561.724,00	30.834,40	0,36%	1,52%	0,36%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	7.215.427,69	0,00	0,00	7.239.744,72	24.317,03	0,34%	8,32%	0,34%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	10.077.348,43	0,00	0,00	10.102.010,56	24.662,13	0,24%	9,94%	0,24%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	19.116.151,10	0,00	19.128.149,44	11.998,34	0,06%	8,97%	-2,82%
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP	464.560,20	0,00	0,00	464.087,99	-472,21	-0,10%	0,01%	-0,10%
BNP PARIBAS ACE IBRX FIC AÇÕES	11.637.742,41	0,00	11.565.709,81	0,00	-72.032,60	-0,62%	9,66%	0,16%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	4.528.020,24	0,00	0,00	4.495.668,85	-32.351,39	-0,71%	7,15%	-0,71%
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	775.666,17	0,00	0,00	765.299,27	-10.366,90	-1,34%	172,17%	-1,34%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	7.103.448,27	0,00	0,00	6.869.918,61	-233.529,66	-3,29%	12,59%	-3,29%
Total Renda Variável					3.246.107,60	1,79%	10,66%	