

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



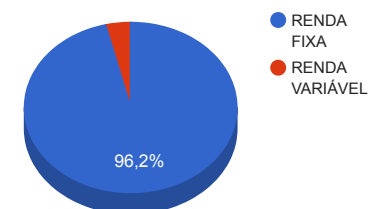
Carteira consolidada de investimentos - base (março / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	1.950.502,64	8,46%	214	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.020.629,26	4,43%	729	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.390.516,48	6,03%	713	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.063.545,75	4,61%	343	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.314.539,00	5,70%	1.219	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	755.668,75	3,28%	732	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	755.731,75	3,28%	639	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.481.203,95	6,42%	753	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.212.100,01	13,93%	1.417	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	702.074,25	3,05%	210	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.677.628,97	7,28%	590	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.624.141,55	7,04%	39	1,95%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	1.591.010,02	6,90%	177	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	61.249,03	0,27%	435	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.068.677,89	8,97%	734	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.507.745,39	6,54%	722	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	43832	878.389,15	3,81%	729	0,34%	Artigo 8º, Inciso III
		TOTAL -	23.055.353,84				

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

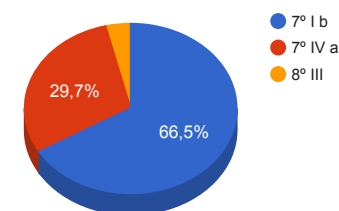
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	15.324.140,81	66,47%	15,00%	40,00%	100,00%	7.731.213,03
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	13.833.212,30
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	6.852.823,88	29,72%	5,00%	10,00%	40,00%	2.369.317,66
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	10,00%	2.305.535,38
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.152.767,69
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.152.767,69
Total Renda Fixa	100,00%	22.176.964,69	96,19%	20,00	80,00	405,00	-

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%	5,00%	13,00%	2.997.196,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	10,00%	2.305.535,38
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	878.389,15	3,81%	0,00%	5,00%	10,00%	1.427.146,23
Total Renda Variável	30,00%	878.389,15	3,81%	0,00	20,00	53,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: março / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	50,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	15.324.140,81	66,47%	15,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	50,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	6.852.823,88	29,72%	5,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	22.176.964,69	96,19%	20,00	405,00

Artigos - Renda Variável	Base: março / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	13,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	878.389,15	3,81%	0,00%	10,00%
Total Renda Variável	878.389,15	3,81%	0,00	53,00

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	13.897.820,11	60,28%	0,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	9.157.533,73	39,72%	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
IMA-B 5	1,62%	3,53%	3,53%	5,06%	11,97%	27,76%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,60%	3,48%	3,48%	4,95%	11,77%	27,29%	0,20%	1,064%	3,48%
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%
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	1,32%	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%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,30%	3,89%	3,89%	5,21%	12,64%	36,34%	0,20%	0,732%	4,47%
IMA Geral ex-C	0,95%	3,39%	3,39%	4,45%	10,83%	31,89%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,00%	3,52%	3,52%	4,32%	10,28%	-	0,30%	0,751%	4,81%
IMA-B	0,94%	4,94%	4,94%	4,60%	10,73%	34,61%	-	-	-
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%
IRF-M 1	0,66%	1,80%	1,80%	3,65%	9,34%	24,73%	-	-	-
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%
CDI	0,53%	1,59%	1,59%	3,37%	8,39%	23,30%	-	-	-

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

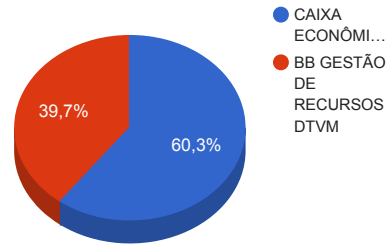
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,54%	1,59%	1,59%	3,45%	8,48%	23,44%	0,20%	0,010%	0,11%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,52%	1,54%	1,54%	3,32%	8,27%	23,13%	0,20%	0,007%	0,14%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,51%	1,53%	1,53%	3,30%	8,32%	23,24%	0,20%	0,007%	0,11%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,51%	1,54%	1,54%	3,32%	8,35%	23,27%	0,20%	0,008%	0,11%
IMA-B 5+	0,38%	5,94%	5,94%	4,21%	10,24%	38,98%	-	-	-
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%
IPCA	0,09%	0,70%	0,70%	1,85%	2,68%	7,37%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1,18%	2,85%	2,85%	4,39%	9,77%	-	0,002	0,711%	4,16%

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

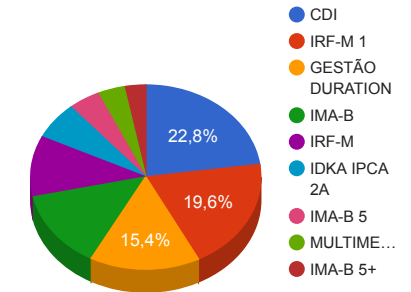
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	0,01%	11,73%	11,73%	14,90%	31,36%	70,54%	-	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	1,93%	-	-	-	-	-	1,60%	1,293%	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	13.897.820,11	60,28%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	9.157.533,73	39,72%



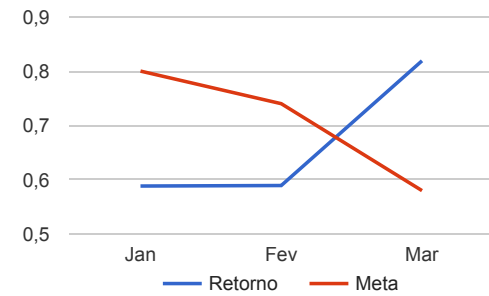
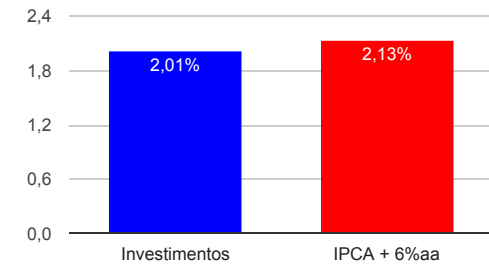
Sub-segmento	Valor	%
CDI	5.261.813,86	22,82%
IRF-M 1	4.526.639,01	19,63%
GESTÃO DURATION	3.541.512,66	15,36%
IMA-B	3.158.832,92	13,70%
IRF-M	2.454.062,23	10,64%
IDKA IPCA 2A	1.511.400,50	6,56%
IMA-B 5	1.020.629,26	4,43%
MULTIMERCADO	878.389,15	3,81%
IMA-B 5+	702.074,25	3,05%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	17.114.796,24	3.180.488,84	1.411.492,78	18.994.909,23	111.116,93	0,59%	0,80%	73,42%	0,17%
Fevereiro	18.994.909,23	6.671.522,96	6.235.311,54	19.545.644,06	114.523,41	0,59%	0,74%	79,82%	0,52%
Março	19.545.644,06	7.876.624,97	4.554.186,22	23.055.353,84	187.271,03	0,82%	0,58%	141,88%	0,64%
Acumulado no ano					412.911,37	2,01%	2,13%	94,28%	

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 IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.004.560,52	0,00	0,00	1.020.629,26	16.068,74	1,60%	1,06%	1,60%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.332.404,57	40.700,24	0,00	1.390.516,48	17.411,67	1,27%	0,76%	1,30%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1.442.974,87	130.006,11	0,00	1.591.010,02	18.029,04	1,15%	0,71%	1,18%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.467.753,30	0,00	0,00	1.481.203,95	13.450,65	0,92%	1,45%	0,92%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.304.533,63	628.903,35	0,00	1.950.502,64	17.065,66	0,88%	0,75%	1,00%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.391.677,96	272.009,08	0,00	1.677.628,97	13.941,93	0,84%	1,45%	0,90%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	750.000,00	0,00	755.731,75	5.731,75	0,76%	0,98%	1,52%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	750.000,00	0,00	755.668,75	5.668,75	0,76%	0,94%	1,48%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	1.057.101,21	0,00	1.063.545,75	6.444,54	0,61%	0,73%	1,30%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	60.932,80	0,00	0,00	61.249,03	316,23	0,52%	0,01%	0,52%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.434.204,36	0,00	2.250.000,00	3.212.100,01	27.895,65	0,51%	0,13%	0,64%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.548.854,13	0,00	2.250.000,00	1.314.539,00	15.684,87	0,44%	0,13%	0,63%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.016.966,63	538.647,61	54.186,22	1.507.745,39	6.317,37	0,41%	0,01%	0,51%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	558.745,75	1.503.526,92	0,00	2.068.677,89	6.405,22	0,31%	0,01%	0,54%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	120.301,29	1.500.000,00	0,00	1.624.141,55	3.840,26	0,24%	0,01%	0,51%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	705.730,45	0,00	702.074,25	-3.656,20	-0,52%	1,95%	0,35%
Total Renda Fixa					170.616,13	0,78%	0,61%	

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 CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	861.734,25	0,00	0,00	878.389,15	16.654,90	1,93%	1,29%	1,93%
Total Renda Variável					16.654,90	1,93%	1,29%	

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.235.911,42	1.429.176,20	6.558.922,72	3.212.100,01	105.935,11	1,37%	1,75%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.497.669,56	0,00	4.250.000,00	1.314.539,00	66.869,44	1,38%	1,75%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	283.136,62	1.072.557,39	0,00	1.390.516,48	34.822,47	3,51%	3,74%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00	1.564.652,22	0,00	1.591.010,02	26.357,80	1,76%	2,85%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	1.924.314,20	0,00	1.950.502,64	26.188,44	1,59%	3,52%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	176.260,53	1.475.790,42	0,00	1.677.628,97	25.578,02	4,68%	4,86%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	1.458.922,72	0,00	1.481.203,95	22.281,23	1,89%	4,89%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	1.000.000,00	0,00	1.020.629,26	20.629,26	2,06%	3,48%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.796.671,37	1.510.580,76	1.258.081,34	2.068.677,89	19.507,10	1,05%	1,59%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	945.744,27	679.811,20	133.986,48	1.507.745,39	16.176,40	1,39%	1,53%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	1.057.101,21	0,00	1.063.545,75	6.444,54	0,61%	3,89%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	750.000,00	0,00	755.731,75	5.731,75	0,76%	3,06%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	750.000,00	0,00	755.668,75	5.668,75	0,76%	3,03%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	119.083,93	1.500.000,00	0,00	1.624.141,55	5.057,62	1,26%	1,54%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	60.318,54	0,00	0,00	61.249,03	930,49	1,54%	1,54%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	705.730,45	0,00	702.074,25	-3.656,20	-0,52%	5,85%
Total Renda Fixa					384.522,22	1,96%	

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 CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	0,00	850.000,00	0,00	878.389,15	28.389,15	3,34%	-
Total Renda Variável					28.389,15		

Microsoft
 VBScript runtime
 error '800a000d'
 Type mismatch:
 'FormatNumber'
 /plataforma/relatorios/uRetornoTriRV.asp,
 line 143