

Relatório Analítico dos Investimentos
em dezembro, 4º Trimestre e ano de 2018

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 (dezembro / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			16.883,15	0,00%			Artigo 20
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	47.417.388,21	3,60%	306	2,88%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	195.629.688,40	14,83%	732	2,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	115.347.332,51	8,75%	351	2,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	100.387.951,10	7,61%	758	1,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	17/08/2020	14.373.490,00	1,09%	20	21,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	26.360.099,22	2,00%	93	5,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	15.146.640,93	1,15%	140	1,81%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	207.083.342,98	15,70%	1.266	1,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	15/05/2019	10.179.697,75	0,77%	11	11,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	18/08/2020	24.278.850,00	1,84%	19	18,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	176.402.174,84	13,38%	301	12,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	269.029,01	0,02%	827	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	205.853.691,00	15,61%	57	17,56%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	17.437.460,08	1,32%	668	0,40%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	39.911.337,10	3,03%	803	0,83%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	24.617.115,91	1,87%	196	0,97%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CASAN SANEAMENTO FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	5.379.379,20	0,41%	27	2,92%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	7.456.711,89	0,57%	77	4,91%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BRADESCO PLUS IBOVESPA FI AÇÕES	D+3	Não há	19.583.826,03	1,48%	56	7,84%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	25.493.994,14	1,93%	158	5,79%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	17.412.809,31	1,32%	151	1,24%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2018)

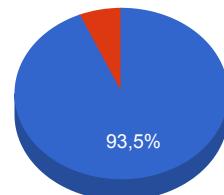
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO		
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	D+4	Não há	19.809.380,42	1,50%	4.953	3,24%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea "a"		
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	3.028.080,00	0,23%		1,90%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea "b"		
		TOTAL -	1.318.876.353,18						

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	932.606.655,94	70,71%	25,00%	60,00%	80,00%	122.494.426,60
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	7,00%	10,00%	131.887.635,32
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	288.088.633,10	21,84%	5,00%	20,00%	40,00%	239.461.908,17
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5.379.379,20	0,41%	0,00%	1,00%	3,00%	34.186.911,40
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	7.456.711,89	0,57%	0,00%	2,00%	4,00%	45.298.342,24
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	19.583.826,03	1,48%	0,00%	4,00%	5,00%	46.359.991,63
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	62.716.183,87	4,76%	0,00%	4,00%	5,00%	3.227.633,79
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	3,00%	39.566.290,60
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	1,00%	13.188.763,53
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	3.028.080,00	0,23%	0,00%	0,50%	1,00%	10.160.683,53
Total Carteira		1.318.859.470,03					

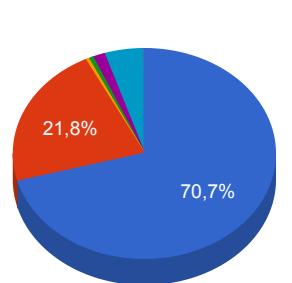
RENDA FIXA	1.233.548.263,28	93,53%
RENDA VARIÁVEL	85.328.089,90	6,47%

Distribuição por Segmento



- RENDA FIXA
- RENDA VARIÁVEL

Distribuição por Artigo / Resolução



- 7º I b
- 7º IV a
- 7º VII a
- 7º VII b
- 8º I a
- 8º II a
- 8º IV b

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: dezembro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	932.606.655,94	70,71%	25,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	288.088.633,10	21,84%	5,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5.379.379,20	0,41%	0,00%	3,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	7.456.711,89	0,57%	0,00%	4,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	19.583.826,03	1,48%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	62.716.183,87	4,76%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	0,00%	3,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	1,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	3.028.080,00	0,23%	0,00%	1,00%
Total Renda Fixa	1.318.859.470,03	100,00%	30,00	152,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (dezembro / 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	504.236.703,84	38,23%	0,04%
ITAÚ UNIBANCO	258.063.313,97	19,57%	0,02%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	250.415.228,50	18,99%	0,06%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	213.649.015,34	16,20%	0,05%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	92.495.208,38	7,01%	0,01%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	1,65%	13,06%	9,89%	11,77%	13,06%	27,52%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,51%	10,61%	5,92%	7,98%	10,61%	25,64%	0,20%	0,782%	4,20%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,93%	3,36%	2,75%	2,42%	3,36%	11,15%	0,20%	0,331%	4,34%

IMA-B 5	1,36%	9,87%	4,65%	6,86%	9,87%	23,68%	-	-	-
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,34%	9,65%	4,62%	6,77%	9,65%	23,22%	0,10%	0,586%	3,05%

IDKA IPCA 2 Anos	1,25%	9,75%	3,40%	6,58%	9,75%	24,69%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,22%	9,22%	3,45%	5,87%	9,22%	22,77%	0,20%	0,419%	2,35%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,16%	9,30%	3,40%	5,84%	9,30%	22,79%	0,20%	0,419%	2,35%
ITAU INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,39%	0,48%	-1,90%	-0,00%	0,48%	7,10%	0,20%	0,243%	4,07%

IMA Geral ex-C	1,18%	9,80%	5,47%	7,33%	9,80%	23,95%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,17%	9,90%	5,50%	7,17%	9,90%	23,38%	0,30%	0,652%	2,77%

IPCA + 9,00% ao ano	0,84%	13,01%	2,54%	5,57%	13,01%	26,68%	-	-	-
CASAN SANEAMENTO FIDC SÊNIOR	-2,25%	-17,80%	-5,33%	-10,36%	-17,80%	-23,66%	0,45%	5,314%	5,25%

IPCA + 6,00% ao ano	0,61%	9,92%	1,84%	4,10%	9,92%	19,87%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,40%	17,99%	5,19%	11,96%	17,99%	28,97%	0,20%	0,670%	5,00%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,35%	4,24%	2,06%	1,77%	4,24%	7,30%	0,20%	0,169%	3,97%

IRF-M 1	0,56%	6,97%	2,03%	3,78%	6,97%	18,87%	-	-	-
---------	-------	-------	-------	-------	-------	--------	---	---	---

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,54%	6,72%	1,98%	3,67%	6,72%	18,37%	0,20%	0,046%	0,55%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,54%	6,76%	2,00%	3,71%	6,76%	18,35%	0,10%	0,045%	0,55%
CDI	0,49%	6,42%	1,54%	3,15%	6,42%	16,98%	-	-	-
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,50%	6,35%	1,55%	3,13%	6,35%	17,16%	0,20%	0,013%	0,02%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,48%	6,23%	1,51%	3,06%	6,23%	16,79%	0,20%	0,006%	0,02%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,47%	6,33%	1,49%	3,09%	6,33%	17,05%	0,20%	0,024%	0,04%
IPCA	0,15%	3,75%	0,39%	1,11%	3,75%	6,80%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,51%	8,22%	2,78%	4,19%	8,22%	22,15%	0,40%	0,943%	1,40%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	1,50%	8,23%	2,78%	4,18%	8,23%	22,14%	0,40%	0,937%	1,40%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,17%	7,73%	3,38%	5,83%	7,73%	17,88%	0,20%	0,414%	2,22%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

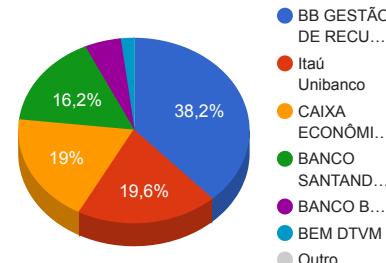
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (dezembro / 2018)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	2,22%	5,62%	10,16%	10,65%	5,62%	26,12%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-0,65%	-5,67%	5,69%	10,19%	-5,67%	-1,04%	1,20%	7,989%	21,23%

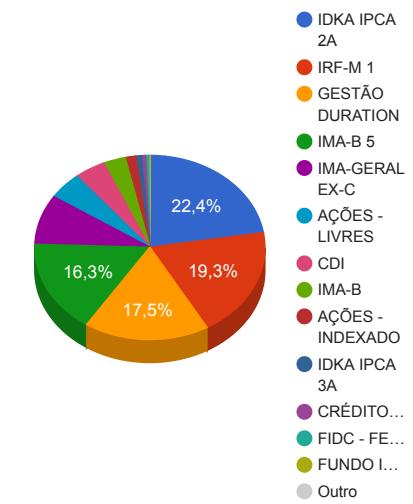
Ibovespa	-1,81%	15,03%	10,77%	20,79%	15,03%	45,93%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	3,67%	26,02%	21,85%	23,04%	26,02%	68,49%	2,50%	7,843%	19,23%
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	0,41%	14,95%	14,33%	22,41%	14,95%	57,18%	2,00%	7,625%	21,43%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	0,30%	26,08%	13,12%	23,96%	26,08%	68,94%	1,50%	8,367%	21,56%
BRADESCO PLUS IBOVESPA FI AÇÕES	-1,74%	15,06%	10,82%	20,91%	15,06%	45,40%	0,50%	8,195%	22,00%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	504.236.703,84	38,23%
Itaú Unibanco	258.063.313,97	19,57%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	250.415.228,50	18,99%
BANCO SANTANDER	213.649.015,34	16,20%
BANCO BRADESCO	67.001.214,24	5,08%
BEM DTVM	25.493.994,14	1,93%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	16.883,15	0,00%



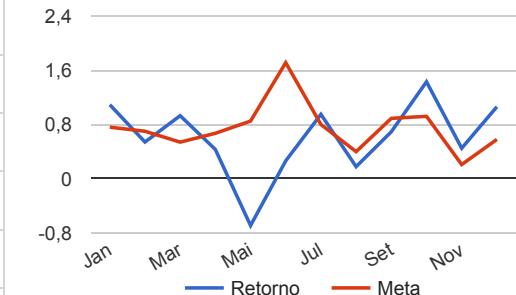
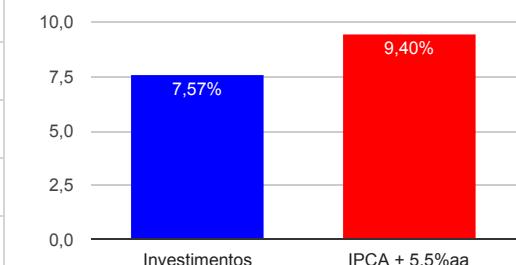
Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	296.017.639,50	22,44%
IRF-M 1	254.500.731,19	19,30%
GESTÃO DURATION	230.470.806,91	17,47%
IMA-B 5	215.054.514,84	16,31%
IMA-GERAL EX-C	115.347.332,51	8,75%
AÇÕES - LIVRES	62.716.183,87	4,76%
CDI	57.617.826,19	4,37%
IMA-B	41.506.740,15	3,15%
AÇÕES - INDEXADO	19.583.826,03	1,48%
IDKA IPCA 3A	10.179.697,75	0,77%
CRÉDITO PRIVADO	7.456.711,89	0,57%
FIDC - FECHADO	5.379.379,20	0,41%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.028.080,00	0,23%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	16.883,15	0,00%



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	23.784.385,74	1.139.736.552,47	6.137.268,97	0,54%	0,70%	76,86%	1,06%
Março	1.139.736.552,47	230.657.871,91	220.226.269,47	1.160.857.771,62	10.689.616,71	0,93%	0,54%	172,89%	0,71%
Abril	1.160.857.771,62	125.834.550,55	117.297.638,60	1.174.449.594,87	5.054.911,30	0,43%	0,67%	64,70%	0,62%
Maio	1.174.449.594,87	27.656.428,35	18.379.029,94	1.175.585.244,43	-8.141.748,85	-0,69%	0,85%	-81,02%	1,12%
Junho	1.175.585.244,43	433.684.627,13	420.963.748,81	1.191.448.735,55	3.142.612,80	0,26%	1,71%	15,44%	0,89%
Julho	1.191.448.735,55	30.854.599,75	19.753.793,92	1.213.968.296,47	11.418.755,09	0,95%	0,80%	118,68%	0,54%
Agosto	1.213.968.296,47	346.104.178,91	336.935.958,05	1.225.327.906,97	2.191.389,64	0,18%	0,40%	44,86%	0,97%
Setembro	1.225.327.906,97	29.634.063,69	20.311.393,99	1.243.203.083,72	8.552.507,05	0,69%	0,89%	78,14%	0,57%
Outubro	1.243.203.083,72	36.701.275,06	27.607.166,92	1.270.186.138,12	17.888.946,26	1,43%	0,92%	155,17%	0,85%
Novembro	1.270.186.138,12	315.563.129,22	317.977.922,25	1.273.491.160,83	5.719.815,74	0,45%	0,21%	209,51%	0,97%
Dezembro	1.273.491.160,83	116.776.878,55	85.253.383,69	1.318.859.470,03	13.844.814,34	1,06%	0,58%	184,03%	0,98%
Acumulado no ano					88.609.936,77	7,57%	9,40%	80,44%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	202.785.508,30	0,00	0,00	205.853.691,00	3.068.182,70	1,51%	0,94%	1,51%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	25.968.565,51	0,00	0,00	26.360.099,22	391.533,71	1,51%	0,78%	1,51%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	24.252.999,05	0,00	0,00	24.617.115,91	364.116,86	1,50%	0,94%	1,50%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.938.009,53	0,00	0,00	15.146.640,93	208.631,40	1,40%	0,67%	1,40%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	172.758.440,97	1.316.306,16	0,00	176.402.174,84	2.327.427,71	1,34%	0,59%	1,34%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	7.370.255,61	0,00	0,00	7.456.711,89	86.456,28	1,17%	0,41%	1,17%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	111.853.219,36	2.161.259,24	0,00	115.347.332,51	1.332.853,91	1,17%	0,65%	1,17%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	193.193.738,36	197.045,75	0,00	195.629.688,40	2.238.904,29	1,16%	0,42%	1,16%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	82.363.009,81	16.888.513,33	0,00	100.387.951,10	1.136.427,96	1,14%	0,42%	1,22%
CASAN SANEAMENTO FIDC SÉNIOR	5.503.309,33	0,00	175.355,07	5.379.379,20	51.424,94	0,93%	5,31%	-2,25%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.241.400,00	0,00	0,00	14.373.490,00	132.090,00	0,93%	0,33%	0,93%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	19.214.937,00	4.551.398,74	6.526.101,68	17.437.460,08	197.226,02	0,83%	0,01%	0,50%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	205.979.261,36	0,00	0,00	207.083.342,98	1.104.081,62	0,54%	0,04%	0,54%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	278.150,84	0,00	10.422,15	269.029,01	1.300,32	0,47%	0,01%	0,48%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.140.524,90	0,00	0,00	10.179.697,75	39.172,85	0,39%	0,24%	0,39%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	24.194.448,00	0,00	0,00	24.278.850,00	84.402,00	0,35%	0,17%	0,35%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	92.218.830,83	0,00	45.055.476,86	47.417.388,21	254.034,24	0,28%	0,05%	0,54%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	26.664.077,12	33.732.930,85	20.588.500,00	39.911.337,10	102.829,13	0,17%	0,02%	0,47%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	12.873.945,62	12.876.527,93	0,00	2.582,31	0,02%	0,00%	0,41%
				Total Renda Fixa	13.123.678,25	1,06%	0,49%	

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

Ativos de Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	16.796.305,52	0,00	0,00	17.412.809,31	616.503,79	3,67%	7,84%	3,67%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	0,00	25.055.478,86	0,00	25.493.994,14	438.515,28	1,75%	8,37%	0,30%
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	19.728.169,43	0,00	0,00	19.809.380,42	81.210,99	0,41%	7,63%	0,41%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	3.048.000,00	0,00	21.000,00	3.028.080,00	1.080,00	0,04%	7,99%	-0,65%
BRADESCO PLUS IBOVESPA FI AÇÕES	0,00	20.000.000,00	0,00	19.583.826,03	-416.173,97	-2,08%	8,20%	-1,74%
				Total Renda Variável	721.136,09	0,85%	8,04%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre / 2018

Ativos de Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	181.821.153,79	7.531.137,85	0,00	195.629.688,40	6.277.396,76	3,40%	3,40%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	315.388.444,35	0,00	114.014.478,60	207.083.342,98	5.709.377,23	2,00%	2,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	200.278.565,06	0,00	0,00	205.853.691,00	5.575.125,94	2,78%	2,78%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	70.281.654,16	27.350.106,16	0,00	100.387.951,10	2.756.190,78	3,23%	3,45%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,00	174.161.112,93	0,00	176.402.174,84	2.241.061,91	1,29%	4,62%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	90.918.702,41	0,00	45.055.476,86	47.417.388,21	1.554.162,66	1,71%	1,98%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24.887.944,65	0,00	0,00	26.360.099,22	1.472.154,57	5,92%	5,92%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	190.757.812,49	10.187.425,02	184.905.379,86	17.437.460,08	1.397.602,43	1,46%	1,55%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	114.014.478,60	0,00	115.347.332,51	1.332.853,91	1,17%	5,50%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.398.895,41	0,00	0,00	15.146.640,93	747.745,52	5,19%	5,19%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	23.657.966,01	295.975,62	0,00	24.617.115,91	663.174,28	2,77%	2,78%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	23.788.188,00	0,00	0,00	24.278.850,00	490.662,00	2,06%	2,06%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	35.001.086,60	77.275.930,85	72.817.600,00	39.911.337,10	451.919,65	0,77%	1,49%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.988.660,00	0,00	0,00	14.373.490,00	384.830,00	2,75%	2,75%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	7.213.192,87	0,00	0,00	7.456.711,89	243.519,02	3,38%	3,38%
CASAN SANEAMENTO FIDC SÊNIOR	5.682.287,58	0,00	498.609,64	5.379.379,20	195.701,26	3,53%	-5,33%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.377.079,37	0,00	295.691,32	10.179.697,75	98.309,70	0,96%	-1,90%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	280.647,73	0,00	15.733,03	269.029,01	4.114,31	1,48%	1,51%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	12.873.945,62	12.876.527,93	0,00	2.582,31	0,02%	1,27%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES LP	0,00	295.691,32	295.975,62	0,00	284,30	0,10%	1,50%
Total Renda Fixa					31.598.768,54	2,60%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre / 2018

Ativos de Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	14.289.933,58	0,00	0,00	17.412.809,31	3.122.875,73	21,85%	21,85%
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	17.325.869,66	0,00	0,00	19.809.380,42	2.483.510,76	14,33%	14,33%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	0,00	25.055.478,86	0,00	25.493.994,14	438.515,28	1,75%	13,12%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.865.000,00	0,00	63.000,00	3.028.080,00	226.080,00	7,92%	5,69%
BRADESCO PLUS IBOVESPA FI AÇÕES	0,00	20.000.000,00	0,00	19.583.826,03	-416.173,97	-2,08%	10,82%
				Total Renda Variável	5.854.807,80	15,87%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2018

Ativos de Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	87.909.468,56	219.789.914,39	114.014.478,60	207.083.342,98	13.398.438,63	6,48%	6,76%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	104.317.956,01	90.000.000,00	0,00	205.853.691,00	11.535.734,99	8,07%	8,22%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	185.987.111,64	0,00	195.629.688,40	9.642.576,76	7,31%	9,30%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	64.348.592,38	225.624.876,84	278.340.752,45	17.437.460,08	5.804.743,31	5,21%	6,35%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	78.620.825,02	8.406.212,34	45.055.476,86	47.417.388,21	5.445.827,71	6,43%	6,72%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	90.562.835,37	0,00	95.155.794,98	0,00	4.592.959,61	5,18%	7,46%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	164.099.176,46	180.743.298,72	233.563.887,21	115.347.332,51	4.068.744,54	3,29%	9,90%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	72.854.208,92	0,00	76.542.407,88	0,00	3.688.198,96	5,17%	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	97.091.995,32	0,00	100.387.951,10	3.295.955,78	4,03%	9,22%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	52.385.009,77	367.270.067,47	382.922.025,90	39.911.337,10	3.178.285,76	3,72%	6,33%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	43.218.883,40	251.281.957,59	121.091.506,12	176.402.174,84	2.992.839,97	3,34%	9,65%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.945.356,90	0,00	3.430.479,59	15.146.640,93	2.631.763,62	18,09%	17,99%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	25.141.134,19	0,00	1.351.827,97	26.360.099,22	2.570.793,00	10,61%	10,61%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	23.291.172,00	0,00	1.333.956,93	24.278.850,00	2.321.634,93	10,28%	4,24%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	5.824.678,04	17.321.268,71	0,00	24.617.115,91	1.471.169,16	8,20%	8,23%
CAIXA BRASIL 2018 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	24.236.480,00	0,00	25.459.480,86	0,00	1.223.000,86	5,15%	-
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.906.850,00	0,00	744.636,06	14.373.490,00	1.211.276,06	9,01%	3,36%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.828.744,00	0,00	16.943.116,99	0,00	1.114.372,99	7,19%	-
CASAN SANEAMENTO FIDC SÉNIOR	6.543.940,52	18.803,54	2.084.352,68	5.379.379,20	900.987,82	15,97%	-17,80%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	58.537.399,45	0,00	59.197.057,76	0,00	659.658,31	1,13%	6,84%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	55.149.347,22	4.240.139,74	60.024.101,11	0,00	634.614,15	1,11%	6,81%
ITAU INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.131.273,15	0,00	583.555,27	10.179.697,75	631.979,87	6,36%	0,48%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2018

Ativos de Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	6.921.576,14	0,00	0,00	7.456.711,89	535.135,75	7,73%	7,73%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.301.395,68	0,00	9.771.296,58	0,00	469.900,90	5,16%	7,44%
ITAU SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	26.485.128,23	0,00	26.782.054,40	0,00	296.926,17	1,12%	6,72%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	8.270.126,47	0,00	8.406.212,34	0,00	136.085,87	1,65%	6,33%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	802.667,75	1.246.042,22	1.796.379,32	269.029,01	16.698,36	4,99%	6,23%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.459.494,08	0,00	3.468.612,47	0,00	9.118,39	0,26%	12,83%
ITAU INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	594.166,89	0,00	600.429,08	0,00	6.262,19	1,05%	6,28%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	12.873.945,62	12.876.527,93	0,00	2.582,31	0,02%	5,29%
ITAU SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES LP	0,00	295.691,32	295.975,62	0,00	284,30	0,10%	6,26%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	23.187.718,46	19.700.830,21	42.759.882,71	0,00	-128.665,96	1,39%	10,54%
Total Renda Fixa					84.359.885,07	7,41%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2018

Ativos de Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	4.084.056,44	10.645.054,34	0,00	17.412.809,31	2.683.698,53	26,35%	26,02%
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	0,00	18.340.548,56	0,00	19.809.380,42	1.468.831,86	8,01%	14,95%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	0,00	25.055.478,86	0,00	25.493.994,14	438.515,28	1,75%	26,08%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	3.210.000,00	0,00	257.100,00	3.028.080,00	75.180,00	2,52%	-5,67%
BRADESCO PLUS IBOVESPA FI AÇÕES	0,00	20.000.000,00	0,00	19.583.826,03	-416.173,97	-2,08%	15,06%
Total Renda Variável				4.250.051,70	18,48%		