

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



Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	10.738.665,58	7,33%	69	3,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.766.164,53	6,67%	732	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.803.840,78	3,28%	758	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL FI RENDA FIXA REFERENCIA DO NTN-B	D+1	Não há	2.621.939,40	1,79%	12	1,69%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	21.071.474,34	14,39%	1.477	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	2.900.271,48	1,98%	31	1,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	682.958,30	0,47%	827	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	7.056.909,05	4,82%	345	0,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	14.588.732,73	9,96%	106	1,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	3.456.343,58	2,36%	803	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	10.952.546,73	7,48%	99	5,90%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	46.665,94	0,03%	307	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+1	Não há	2.663.432,06	1,82%	29	3,99%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	6.797.581,87	4,64%	196	0,27%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	448.315,44	0,31%	663	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	8.423.320,62	5,75%	44	5,54%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BBIF MASTER FIDC LP	Não se aplica	27 meses	186.980,37	0,13%	13	0,93%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	6.582.200,85	4,49%	33	2,93%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIAÇÕES	D+15	Não há	2.845.352,20	1,94%	2.358	1,99%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FIAÇÕES	D+63	Não há	2.236.141,03	1,53%	1.035	3,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIAÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	6.349.343,08	4,34%	4.475	0,72%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FIAÇÕES	D+4	Não há	2.666.756,01	1,82%	2.985	0,71%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2018)

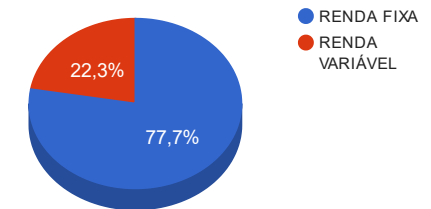
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.334.265,34	1,59%	1.816	1,44%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	2.335.312,35	1,59%	1.167	0,85%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	6.269.727,56	4,28%	77	4,14%	Artigo 8º, Inciso III
SULAMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+361	2 anos	2.979.123,66	2,03%	7	10,57%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	1.420.664,96	0,97%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	3.233.455,25	2,21%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
		<b>TOTAL -</b>	<b>146.458.485,09</b>				

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

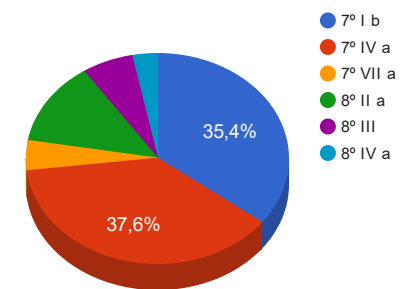
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	51.902.356,11	35,44%	15,00%	25,00%	70,00%	50.618.583,45
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	87.875.091,05
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	55.116.806,32	37,63%	5,00%	15,00%	40,00%	3.466.587,72
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	15,00%	21.968.772,76
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	6.769.181,22	4,62%	2,00%	5,00%	5,00%	553.743,03
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	7.322.924,25
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	18.767.170,01	12,81%	2,00%	12,00%	15,00%	3.201.602,75
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	9.248.851,22	6,31%	7,00%	10,00%	10,00%	5.396.997,29
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	4.654.120,21	3,18%	2,00%	4,00%	5,00%	2.668.804,04
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	4,00%	5,00%	7.322.924,25
<b>Total Carteira</b>		<b>146.458.485,09</b>					

RENDA FIXA	113.788.343,65	77,69%
RENDA VARIÁVEL	32.670.141,44	22,31%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



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 "	51.902.356,11	35,44%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	55.116.806,32	37,63%	5,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	6.769.181,22	4,62%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	18.767.170,01	12,81%	2,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso III	9.248.851,22	6,31%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	4.654.120,21	3,18%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>146.458.485,09</b>	<b>100,00%</b>	<b>42,00</b>	<b>245,00</b>

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
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	38.624.172,16	26,37%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	26.197.504,01	17,89%	0,00%
INFINITY ASSET MANAGEMENT	19.885.706,35	13,58%	2,95%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	19.161.986,20	13,08%	0,00%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	10.391.947,44	7,10%	0,01%
ITAÚ UNIBANCO	6.797.581,87	4,64%	0,00%
Horus GGR	6.582.200,85	4,49%	1,77%
A5 CAPITAL PARTNERS	3.233.455,25	2,21%	-
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS	2.979.123,66	2,03%	0,01%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	2.845.352,20	1,94%	0,73%
FRANKLIN TEMPLETON INVESTIMENTOS	2.666.756,01	1,82%	0,07%
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	2.335.312,35	1,59%	0,00%
PERFIN INVESTIMENTOS	2.334.265,34	1,59%	0,06%
HIX CAPITAL	2.236.141,03	1,53%	0,21%

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 5+	1,88%	15,41%	14,46%	16,23%	15,41%	30,12%	-	-	-
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	0,78%	9,67%	5,38%	7,28%	9,67%	27,49%	0,50%	0,299%	3,73%
IDKA PRÉ 2 ANOS	1,66%	11,63%	5,93%	7,98%	11,63%	29,95%	-	-	-
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1,66%	11,29%	5,93%	7,74%	11,29%	28,89%	0,20%	0,751%	3,29%
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%
IPCA + 7,00% ao ano	0,69%	10,95%	2,07%	4,59%	10,95%	22,12%	-	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	0,77%	-16,38%	10,83%	6,85%	-16,38%	-13,14%	1,65%	0,338%	17,46%
IPCA + 6,00% ao ano	0,61%	9,92%	1,84%	4,10%	9,92%	19,87%	-	-	-
BTG PACTUAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO NTN-B	0,35%	4,21%	-0,82%	1,80%	4,21%	7,45%	0,15%	0,178%	3,98%
IRF-M 1	0,56%	6,97%	2,03%	3,78%	6,97%	18,87%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,54%	6,81%	2,02%	3,74%	6,81%	18,48%	0,20%	0,044%	0,55%
CDI	0,49%	6,42%	1,54%	3,15%	6,42%	16,98%	-	-	-
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	0,51%	7,25%	1,87%	3,52%	7,25%	19,36%	0,75%	0,083%	0,81%
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%

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
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,47%	6,65%	1,51%	3,39%	6,65%	17,52%	0,20%	0,038%	0,29%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,43%	5,55%	1,33%	2,72%	5,55%	15,10%	0,80%	0,000%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,41%	5,29%	1,27%	2,60%	5,29%	14,62%	1,00%	0,004%	0,01%
IPCA	0,15%	3,75%	0,39%	1,11%	3,75%	6,80%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,69%	11,06%	6,79%	8,77%	11,06%	26,27%	0,20%	0,949%	4,71%
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 GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1,33%	7,82%	3,43%	5,24%	7,82%	19,91%	0,002	0,617%	1,81%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,23%	9,50%	5,58%	7,16%	9,50%	-	0,40%	0,701%	2,88%
Não Possui	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BBIF MASTER FIDC LP	-0,56%	-30,91%	-32,13%	-32,85%	-30,91%	-88,50%	0,72%	0,093%	31,69%

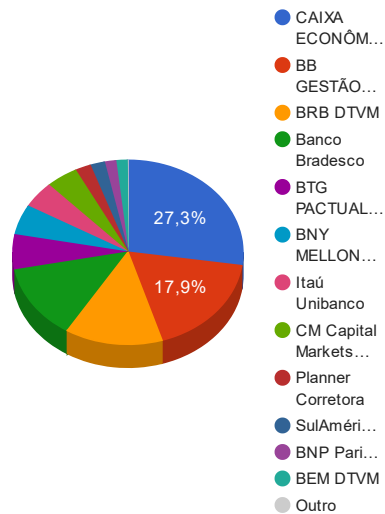


Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (dezembro / 2018)

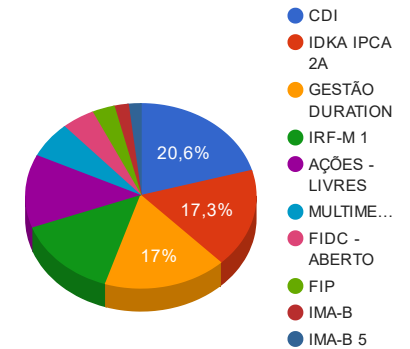
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 8,00% ao ano	0,76%	11,98%	2,31%	5,08%	11,98%	24,39%	-	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-	-	-	-	-	-	2,00%	-	-
CDI	0,49%	6,42%	1,54%	3,15%	6,42%	16,98%	-	-	-
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,45%	6,83%	1,56%	3,20%	6,83%	19,25%	1,00%	0,034%	0,54%
IPCA	0,15%	3,75%	0,39%	1,11%	3,75%	6,80%	-	-	-
SULAMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,57%	6,95%	1,02%	3,18%	6,95%	20,05%	1,50%	0,270%	0,97%
Ibovespa	-1,81%	15,03%	10,77%	20,79%	15,03%	45,93%	-	-	-
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,88%	20,97%	20,24%	24,35%	20,97%	56,92%	3,00%	8,085%	19,71%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1,81%	22,85%	23,17%	26,71%	22,85%	62,79%	2,00%	6,815%	17,45%
PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1,70%	11,44%	17,54%	22,84%	11,44%	41,60%	1,85%	5,858%	16,12%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	1,07%	1,89%	16,55%	13,50%	1,89%	19,56%	2,00%	6,704%	17,07%
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	0,34%	15,28%	16,83%	19,98%	15,28%	53,29%	2,00%	8,077%	19,98%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3,16%	-0,53%	13,96%	14,02%	-0,53%	38,60%	2,00%	5,568%	14,15%
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	40.044.837,12	27,34%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	26.197.504,01	17,89%
BRB DTVM	19.885.706,35	13,58%
Banco Bradesco	19.161.986,20	13,08%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	8.971.282,48	6,13%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	7.748.249,24	5,29%
Itaú Unibanco	6.797.581,87	4,64%
CM Capital Markets DTVM	6.582.200,85	4,49%
Planner Corretora	3.233.455,25	2,21%
SulAmérica Investimentos	2.979.123,66	2,03%
BNP Paribas	2.335.312,35	1,59%
BEM DTVM	2.334.265,34	1,59%
Santander Securities Services	186.980,37	0,13%



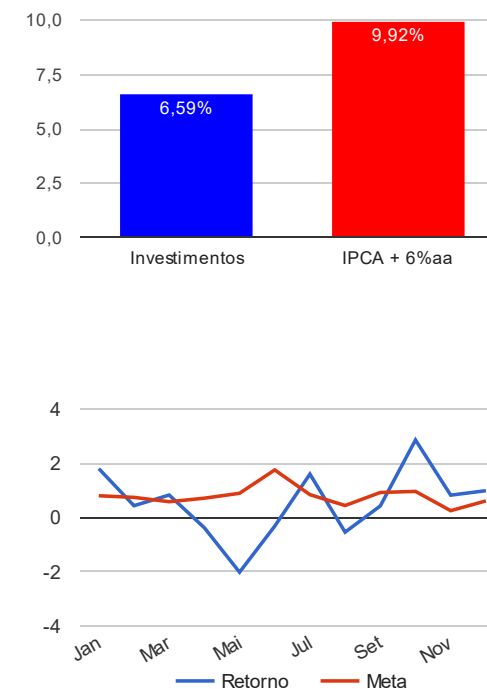
Sub-segmento	Valor	%
CDI	30.175.562,72	20,60%
IDKA IPCA 2A	25.308.670,89	17,28%
GESTÃO DURATION	24.941.243,60	17,03%
IRF-M 1	21.071.474,34	14,39%
AÇÕES - LIVRES	18.767.170,01	12,81%
MULTIMERCADO	9.248.851,22	6,31%
FIDC - ABERTO	6.769.181,22	4,62%
FIP	4.654.120,21	3,18%
IMA-B	2.900.271,48	1,98%
IMA-B 5	2.621.939,40	1,79%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	135.375.483,75	6.850.318,55	4.326.148,48	140.379.143,23	2.479.489,41	1,80%	0,80%	224,34%	1,46%
Fevereiro	140.379.143,23	2.305.721,89	2.117.805,09	141.176.912,13	609.852,10	0,43%	0,74%	58,75%	1,49%
Março	141.176.912,13	3.575.644,90	4.044.467,62	141.874.773,03	1.166.683,62	0,83%	0,58%	143,18%	1,36%
Abril	141.874.773,03	2.427.518,16	2.139.081,83	141.624.678,86	-538.530,50	-0,38%	0,71%	-53,52%	1,97%
Mai	141.624.678,86	42.769.884,17	41.894.262,42	139.628.883,83	-2.871.416,78	-2,02%	0,89%	-226,74%	2,43%
Junho	139.628.883,83	28.218.941,99	27.338.779,16	140.061.819,84	-447.226,82	-0,32%	1,75%	-18,16%	2,62%
Julho	140.061.819,84	1.859.398,35	1.992.502,58	142.166.248,17	2.237.532,56	1,60%	0,84%	189,80%	1,30%
Agosto	142.166.248,17	8.117.176,30	8.252.181,79	141.263.579,14	-767.663,54	-0,54%	0,44%	-121,96%	2,21%
Setembro	141.263.579,14	18.733.433,72	19.394.759,70	141.203.213,00	600.959,84	0,43%	0,92%	46,12%	1,70%
Outubro	141.203.213,00	7.660.958,36	8.098.136,93	144.795.023,41	4.028.988,98	2,85%	0,96%	296,51%	2,58%
Novembro	144.795.023,41	980.477,17	1.617.761,90	145.346.989,70	1.189.251,02	0,82%	0,25%	325,22%	1,66%
Dezembro	145.346.989,70	13.388.164,55	13.710.054,44	146.458.485,09	1.433.385,28	0,99%	0,61%	160,56%	1,23%
Acumulado no ano					9.121.305,17	6,59%	9,92%	66,47%	

**Acumulado no Ano**



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.852.197,45	0,00	0,00	2.900.271,48	48.074,03	1,69%	0,95%	1,69%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	10.563.747,61	0,00	0,00	10.738.665,58	174.917,97	1,66%	0,75%	1,66%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	6.697.037,43	0,00	0,00	6.797.581,87	100.544,44	1,50%	0,94%	1,50%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	6.964.560,61	0,00	0,00	7.056.909,05	92.348,44	1,33%	0,62%	1,33%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.123.541,73	625.000,00	0,00	4.803.840,78	55.299,05	1,16%	0,42%	1,22%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.654.353,68	0,00	0,00	9.766.164,53	111.810,85	1,16%	0,42%	1,16%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	6.510.014,72	0,00	0,00	6.582.200,85	72.186,13	1,11%	0,34%	0,77%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	5.340.145,07	3.000.000,00	0,00	8.423.320,62	83.175,55	1,00%	0,70%	1,23%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	10.896.433,97	0,00	0,00	10.952.546,73	56.112,76	0,51%	0,08%	0,51%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	22.231.482,73	135.000,00	1.410.000,00	21.071.474,34	114.991,61	0,51%	0,04%	0,54%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	3.440.240,30	0,00	0,00	3.456.343,58	16.103,28	0,47%	0,02%	0,47%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	14.521.206,31	0,00	0,00	14.588.732,73	67.526,42	0,47%	0,04%	0,47%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	634.992,77	145.000,00	100.000,00	682.958,30	2.965,53	0,38%	0,01%	0,48%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	0,00	2.654.193,40	0,00	2.663.432,06	9.238,66	0,35%	0,30%	0,78%
BTG PACTUAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO NTN-B	2.612.847,80	0,00	0,00	2.621.939,40	9.091,60	0,35%	0,18%	0,35%
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	5.639.159,00	0,00	5.654.193,40	0,00	15.034,40	0,27%	0,37%	0,73%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	55.297,59	358.533,85	367.459,07	46.665,94	293,57	0,07%	0,00%	0,43%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	154.801,60	6.470.437,30	6.178.401,97	448.315,44	1.478,51	0,02%	0,00%	0,41%
BBIF MASTER FIDC LP	188.038,12	0,00	0,00	186.980,37	-1.057,75	-0,56%	0,09%	-0,56%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>1.030.135,05</b>	<b>0,91%</b>	<b>0,35%</b>	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FIAÇÕES	2.167.594,51	0,00	0,00	2.236.141,03	68.546,52	3,16%	5,57%	3,16%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.171.405,84	0,00	0,00	6.349.343,08	177.937,24	2,88%	8,09%	2,88%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIAÇÕES	2.794.763,49	0,00	0,00	2.845.352,20	50.588,71	1,81%	6,81%	1,81%
PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.295.170,16	0,00	0,00	2.334.265,34	39.095,18	1,70%	5,86%	1,70%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	2.310.485,03	0,00	0,00	2.335.312,35	24.827,32	1,07%	6,70%	1,07%
SULAMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	2.962.308,45	0,00	0,00	2.979.123,66	16.815,21	0,57%	0,27%	0,57%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	6.241.456,41	0,00	0,00	6.269.727,56	28.271,15	0,45%	0,03%	0,45%
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FIAÇÕES	2.657.825,72	0,00	0,00	2.666.756,01	8.930,29	0,34%	8,08%	0,34%
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	3.238.665,32	0,00	0,00	3.233.455,25	-5.210,07	-0,16%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	1.427.216,28	0,00	0,00	1.420.664,96	-6.551,32	-0,46%	-	-
Total Renda Variável					403.250,23	1,25%	4,82%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	5.918.973,60	0,00	0,00	6.582.200,85	663.227,25	11,21%	10,83%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	10.137.817,13	0,00	0,00	10.738.665,58	600.848,45	5,93%	5,93%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	23.787.543,19	1.541.902,78	4.706.902,78	21.071.474,34	448.931,15	1,89%	2,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.444.688,76	0,00	0,00	9.766.164,53	321.475,77	3,40%	3,40%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	8.126.880,15	0,00	8.423.320,62	296.440,47	5,20%	5,58%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	6.822.996,72	0,00	0,00	7.056.909,05	233.912,33	3,43%	3,43%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	14.372.093,61	0,00	0,00	14.588.732,73	216.639,12	1,51%	1,51%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	10.751.963,48	0,00	0,00	10.952.546,73	200.583,25	1,87%	1,87%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.715.918,69	0,00	0,00	2.900.271,48	184.352,79	6,79%	6,79%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	6.613.719,33	0,00	0,00	6.797.581,87	183.862,54	2,78%	2,78%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.373.351,77	1.298.000,00	0,00	4.803.840,78	132.489,01	3,22%	3,45%
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	5.558.340,72	0,00	5.654.193,40	0,00	95.852,68	1,72%	2,20%
BTG PACTUAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO NTN-B	2.643.547,00	0,00	75.652,44	2.621.939,40	54.044,84	2,05%	-0,82%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	3.405.440,77	0,00	0,00	3.456.343,58	50.902,81	1,49%	1,49%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	0,00	2.654.193,40	0,00	2.663.432,06	9.238,66	0,35%	5,38%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	521.463,98	415.000,00	262.000,00	682.958,30	8.494,32	1,20%	1,51%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	5.122.612,37	0,00	5.126.880,15	0,00	4.267,78	0,08%	4,73%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.788,50	7.232.968,31	6.807.374,18	448.315,44	1.932,81	0,13%	1,27%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	77.977,55	760.655,44	792.950,32	46.665,94	983,27	0,32%	1,33%
BBIF MASTER FIDC LP	275.499,42	0,00	0,00	186.980,37	-88.519,05	-32,13%	-32,13%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>3.619.960,25</b>	<b>3,26%</b>	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.280.738,70	0,00	0,00	6.349.343,08	1.068.604,38	20,24%	20,24%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIAÇÕES	2.310.152,18	0,00	0,00	2.845.352,20	535.200,02	23,17%	23,17%
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FIAÇÕES	2.282.602,50	0,00	0,00	2.666.756,01	384.153,51	16,83%	16,83%
PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.985.979,84	0,00	0,00	2.334.265,34	348.285,50	17,54%	17,54%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	2.003.706,00	0,00	0,00	2.335.312,35	331.606,35	16,55%	16,55%
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FIAÇÕES	1.962.229,80	0,00	0,00	2.236.141,03	273.911,23	13,96%	13,96%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	6.173.637,39	0,00	0,00	6.269.727,56	96.090,17	1,56%	1,56%
SULAMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	2.949.049,48	0,00	0,00	2.979.123,66	30.074,18	1,02%	1,02%
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	3.249.618,24	0,00	0,00	3.233.455,25	-16.162,99	-0,50%	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	1.440.762,28	0,00	0,00	1.420.664,96	-20.097,32	-1,39%	-
Total Renda Variável					3.031.665,03	10,23%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 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	17.837.797,29	12.131.692,87	10.121.902,78	21.071.474,34	1.223.886,96	6,34%	6,81%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.198.088,61	6.285.000,00	22.500.000,00	4.803.840,78	820.752,17	8,82%	9,22%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	10.527.940,35	11.241.000,00	7.960.000,00	14.588.732,73	779.792,38	6,19%	6,65%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	0,00	10.000.000,00	0,00	10.738.665,58	738.665,58	7,39%	11,29%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.900.351,12	5.323.277,77	0,00	9.766.164,53	542.535,64	8,58%	9,30%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	6.545.378,46	0,00	0,00	7.056.909,05	511.530,59	7,82%	7,82%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	0,00	10.500.000,00	0,00	10.952.546,73	452.546,73	4,43%	7,25%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.966.799,32	0,00	10.322.686,61	0,00	355.887,29	4,88%	9,67%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	6.753.239,12	17.117.438,85	23.509.361,72	682.958,30	321.642,05	5,28%	6,23%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	8.126.880,15	0,00	8.423.320,62	296.440,47	5,20%	9,50%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.755.362,27	0,00	148.463,05	2.900.271,48	293.372,26	11,07%	11,06%
BTG PACTUAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO NTN-B	2.516.088,60	0,00	147.437,54	2.621.939,40	253.288,34	10,25%	4,21%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.539.228,46	0,00	6.783.076,96	0,00	243.848,50	3,73%	9,90%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	3.255.370,20	0,00	5.000,00	3.456.343,58	205.973,38	6,33%	6,33%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,00	6.600.000,00	0,00	6.797.581,87	197.581,87	2,99%	8,23%
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	0,00	5.500.000,00	5.654.193,40	0,00	154.193,40	2,80%	5,76%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,00	5.000.000,00	5.126.880,15	0,00	126.880,15	2,54%	9,62%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.016.187,99	0,00	2.040.503,30	0,00	24.315,31	1,21%	10,71%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	8.196.484,92	0,00	8.213.865,53	0,00	17.380,61	0,21%	12,94%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	73.720,33	23.137.626,64	22.772.768,77	448.315,44	9.737,24	0,54%	5,29%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	0,00	2.654.193,40	0,00	2.663.432,06	9.238,66	0,35%	9,67%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.829.030,41	0,00	4.833.924,84	0,00	4.894,43	0,10%	12,84%



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	17.433,50	3.810.528,43	3.785.877,29	46.665,94	4.581,30	1,39%	5,55%
BBIF MASTER FIDC LP	270.621,61	0,00	0,00	186.980,37	-83.641,24	-30,91%	-30,91%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	7.845.384,55	0,00	0,00	6.582.200,85	-1.263.183,70	-16,10%	-16,38%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>6.242.140,37</b>	<b>5,65%</b>	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.248.743,15	0,00	0,00	6.349.343,08	1.100.599,93	20,97%	20,97%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIAÇÕES	2.316.092,18	0,00	0,00	2.845.352,20	529.260,02	22,85%	22,85%
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FIAÇÕES	2.313.309,30	0,00	0,00	2.666.756,01	353.446,71	15,28%	15,28%
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	2.918.608,91	0,00	0,00	3.233.455,25	314.846,34	10,79%	-
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,00	7.000.000,00	1.000.000,00	6.269.727,56	269.727,56	4,08%	6,83%
SULAMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	2.785.594,63	0,00	0,00	2.979.123,66	193.529,03	6,95%	6,95%
PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	2.200.000,00	0,00	2.334.265,34	134.265,34	6,10%	11,44%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	2.291.943,10	0,00	0,00	2.335.312,35	43.369,25	1,89%	1,89%
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FIAÇÕES	2.248.001,38	0,00	0,00	2.236.141,03	-11.860,35	-0,53%	-0,53%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	1.208.683,99	260.000,00	0,00	1.420.664,96	-48.019,03	-3,59%	-
Total Renda Variável					2.879.164,80	11,84%	