

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
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	369.540,48	0,28%	165	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.554.982,02	3,45%	1.266	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.611.480,37	5,76%	508	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	1.257.523,69	0,95%	107	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	12.181.086,03	9,22%	395	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	3.667.123,62	2,78%	200	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	10.319.779,81	7,81%	351	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	10.018.227,19	7,58%	643	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.990.991,53	7,56%	350	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	8.406.706,49	6,36%	1.477	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.852.451,97	5,94%	758	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	1.136.518,08	0,86%	22	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	15.412.314,83	11,67%	732	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou D+1461	Não há	2.779.845,05	2,10%	16	1,45%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.364.952,42	1,03%	668	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.477.722,85	4,90%	425	0,27%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	6.353.992,96	4,81%	803	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	5.166.456,84	3,91%	196	0,20%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR 2	Não se aplica	Não se aplica	5.697,60	0,00%		1,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	D+4	Não há	995.566,10	0,75%	92	0,47%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	1.067.012,12	0,81%	128	0,30%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	D+4	360 dias	160.605,20	0,12%	6	10,40%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2018)

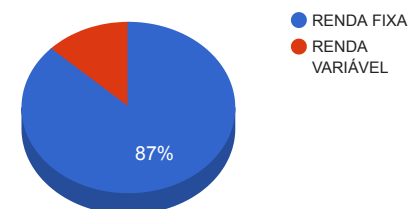
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.130.308,88	1,61%	25.141	0,36%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	3.534.023,49	2,68%	151	0,25%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	886.946,36	0,67%	36	0,24%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	2.695.241,12	2,04%	729	1,01%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	2.140.831,86	1,62%	955	0,46%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	1.872.953,41	1,42%	33	0,71%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
HAZ FII - ATCR11	Não se aplica	Não se aplica	749.092,11	0,57%		5,04%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	D+31 ou D+1800	1800 dias	942.169,75	0,71%	7	8,35%	Desenquadrado - RV
		TOTAL -	132.102.144,23				

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

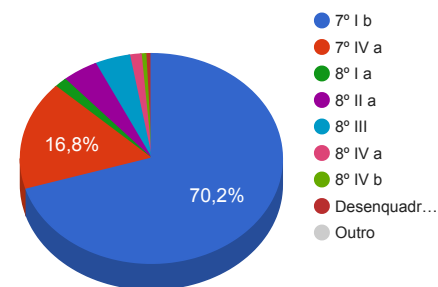
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	92.778.726,11	70,23%	0,00%	64,42%	100,00%	39.323.418,12
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,43%	15,00%	19.815.321,63
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	22.142.970,12	16,76%	0,00%	28,50%	30,00%	17.487.673,15
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5.697,60	0,00%	0,00%	0,01%	5,00%	6.599.409,61
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	2.062.578,22	1,56%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.062.578,22
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	5.824.937,57	4,41%	0,00%	1,78%	15,00%	13.990.384,06
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	5.723.019,34	4,33%	0,00%	0,00%	5,00%	882.087,87
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	1.872.953,41	1,42%	0,00%	2,05%	5,00%	4.732.153,80
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	749.092,11	0,57%	0,00%	0,81%	5,00%	5.856.015,10
Desenquadrado - RV	0,00%	942.169,75	0,71%	0,00%	0,00%	0,00%	-942.169,75
Total Carteira		132.102.144,23					

RENDA FIXA	114.927.393,83	87,00%
RENDA VARIÁVEL	17.174.750,40	13,00%

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 "	92.778.726,11	70,23%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	22.142.970,12	16,76%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5.697,60	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%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	2.062.578,22	1,56%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	5.824.937,57	4,41%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso III	5.723.019,34	4,33%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	1.872.953,41	1,42%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	749.092,11	0,57%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RV	942.169,75	0,71%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	132.102.144,23	100,00%	0,00	235,00

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
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	57.395.125,66	43,45%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	56.107.758,26	42,47%	0,00%
ITAÚ UNIBANCO	8.700.480,33	6,59%	0,00%
Elleven Gestora de Recursos	3.528.937,16	2,67%	0,49%
SAFRA ASSET MANAGEMENT	2.023.464,44	1,53%	0,00%
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUTURADOS LTDA	1.878.651,01	1,42%	0,02%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	1.364.952,42	1,03%	0,00%
ROMA ASSET	942.169,75	0,71%	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%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,84%	15,14%	14,35%	16,04%	15,14%	29,14%	0,20%	1,777%	7,86%
IMA-B	1,65%	13,06%	9,89%	11,77%	13,06%	27,52%	-	-	-
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	2,15%	14,48%	12,20%	13,83%	14,48%	28,61%	0,30%	2,064%	6,35%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,63%	12,84%	9,88%	11,69%	12,84%	27,00%	0,20%	1,223%	5,47%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,62%	12,76%	9,79%	11,61%	12,76%	26,88%	0,20%	1,222%	5,44%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	9,80%	3,85%	5,99%	9,80%	23,13%	0,20%	0,465%	2,08%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,93%	3,37%	2,77%	2,44%	3,37%	11,02%	0,20%	0,331%	4,36%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	-5,13%	-2,87%	-3,33%	-2,43%	-2,87%	9,39%	1,30%	11,185%	7,65%
IRF-M	1,53%	10,73%	6,22%	8,17%	10,73%	27,56%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,48%	10,71%	6,44%	8,22%	10,71%	27,09%	0,20%	0,909%	3,50%
IMA-B 5	1,36%	9,87%	4,65%	6,86%	9,87%	23,68%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,35%	9,65%	4,60%	6,77%	9,65%	23,27%	0,20%	0,585%	3,03%
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%
IMA Geral ex-C	1,18%	9,80%	5,47%	7,33%	9,80%	23,95%	-	-	-

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 ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,17%	9,90%	5,50%	7,17%	9,90%	23,38%	0,30%	0,652%	2,77%
120% do CDI	0,59%	7,75%	1,85%	3,79%	7,75%	20,71%	-	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	-7,85%	-64,40%	-20,87%	-32,40%	-64,40%	-75,73%	0,00%	-	-
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%
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 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,48%	6,18%	1,50%	3,06%	6,18%	16,70%	0,20%	0,010%	0,07%
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 II FIC RENDA FIXA	1,50%	8,23%	2,78%	4,18%	8,23%	22,14%	0,40%	0,937%	1,40%

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

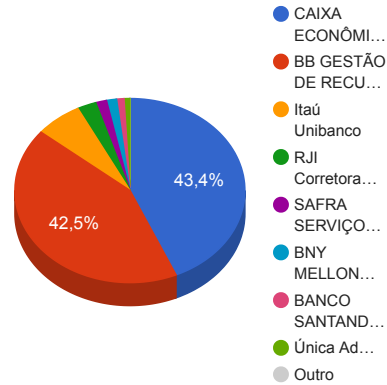
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	2,22%	5,62%	10,16%	10,65%	5,62%	26,12%	-	-	-
HAZ FII - ATCR11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	1,20%	-	-
IDIV	0,65%	15,95%	20,32%	24,50%	15,95%	45,28%	-	-	-
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	0,34%	17,05%	15,85%	24,28%	17,05%	41,59%	2,00%	6,889%	18,91%
IPCA	0,15%	3,75%	0,39%	1,11%	3,75%	6,80%	-	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,30%	0,009%	0,07%
S&P 500	-9,18%	-6,24%	-13,97%	-7,78%	-6,24%	11,97%	-	-	-
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	-8,22%	-2,59%	-12,78%	-5,69%	-2,59%	26,76%	1,00%	10,377%	15,43%
IBX-50	-2,11%	14,53%	9,70%	20,12%	14,53%	45,24%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	-2,21%	12,40%	8,95%	18,56%	12,40%	42,80%	0,70%	8,204%	22,19%
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%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	1,39%	-	5,37%	-	-	-	1,60%	0,663%	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	0,83%	-	3,29%	4,98%	-	-	1,60%	0,295%	-
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	-0,22%	-4,40%	-0,47%	-1,77%	-4,40%	-9,44%	4,00%	0,123%	0,79%
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	-1,54%	-6,49%	-6,91%	-5,39%	-6,49%	10,35%	3,00%	1,690%	14,14%
IGC	-0,59%	11,72%	12,37%	21,93%	11,72%	45,14%	-	-	-

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

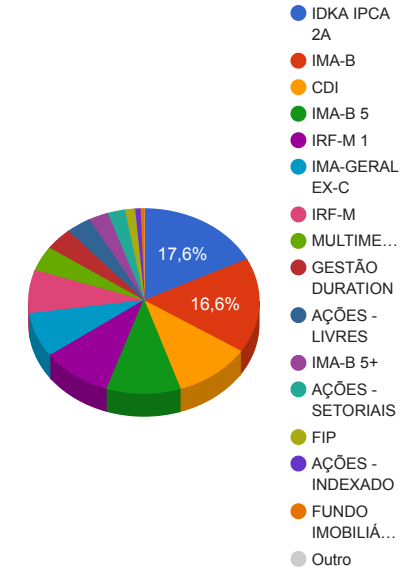
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-0,87%	13,64%	13,50%	22,69%	13,64%	46,38%	1,00%	8,014%	20,77%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	57.395.125,66	43,45%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	56.107.758,26	42,47%
Itaú Unibanco	8.700.480,33	6,59%
RJI Corretora de Valores	3.528.937,16	2,67%
SAFRA SERVIÇOS DE ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA LTDA.	2.023.464,44	1,53%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	1.872.953,41	1,42%
BANCO SANTANDER	1.364.952,42	1,03%
Única Administradora	1.102.774,95	0,83%
Brasil Plural	5.697,60	0,00%



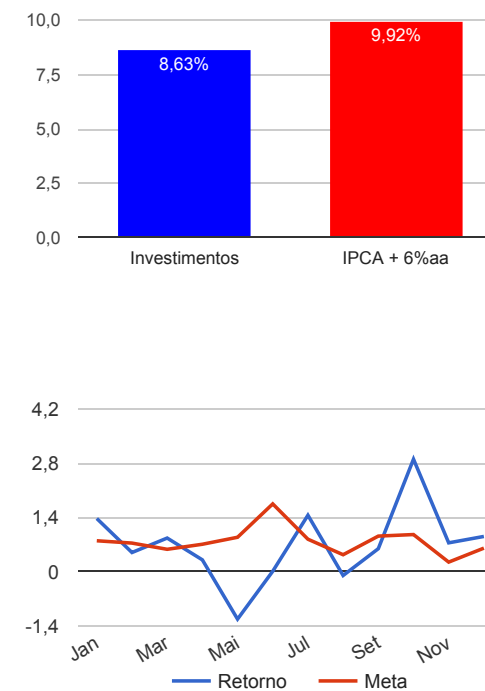
Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	23.264.766,80	17,61%
IMA-B	21.915.611,17	16,59%
CDI	14.196.668,23	10,75%
IMA-B 5	13.438.609,72	10,17%
IRF-M 1	12.961.688,51	9,81%
IMA-GERAL EX-C	10.319.779,81	7,81%
IRF-M	9.990.991,53	7,56%
MULTIMERCADO	5.723.019,34	4,33%
GESTÃO DURATION	5.166.456,84	3,91%
AÇÕES - LIVRES	4.636.798,44	3,51%
IMA-B 5+	3.667.123,62	2,78%
AÇÕES - SETORIAIS	3.197.321,00	2,42%
FIP	1.872.953,41	1,42%
AÇÕES - INDEXADO	995.566,10	0,75%
FUNDO IMOBILIÁRIO	749.092,11	0,57%
FIDC - FECHADO	5.697,60	0,00%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	114.216.440,46	10.266.099,47	8.846.346,38	117.224.289,56	1.588.096,01	1,37%	0,80%	171,35%	0,67%
Fevereiro	117.224.289,56	6.216.112,57	5.063.696,56	118.965.268,41	588.562,84	0,50%	0,74%	67,33%	1,12%
Março	118.965.268,41	28.408.298,69	26.934.670,37	121.486.183,10	1.047.286,37	0,87%	0,58%	150,65%	0,80%
Abril	121.486.183,10	7.412.643,47	8.996.306,33	120.276.744,69	374.224,45	0,31%	0,71%	43,52%	0,61%
Mai	120.276.744,69	7.697.824,50	3.687.760,55	122.772.012,67	-1.514.795,97	-1,22%	0,89%	-137,14%	1,42%
Junho	122.772.012,67	7.403.947,98	10.665.441,90	119.528.089,25	17.570,50	0,01%	1,75%	0,82%	2,21%
Julho	119.528.089,25	9.636.968,58	8.670.762,03	122.251.144,12	1.756.848,32	1,46%	0,84%	173,23%	0,96%
Agosto	122.251.144,12	25.340.232,81	24.436.528,77	123.037.970,54	-116.877,62	-0,09%	0,44%	-21,43%	1,95%
Setembro	123.037.970,54	4.039.397,61	3.331.959,07	124.482.543,27	737.134,19	0,60%	0,92%	64,58%	1,34%
Outubro	124.482.543,27	7.337.713,36	7.140.052,67	128.298.144,58	3.617.940,62	2,90%	0,96%	301,55%	2,21%
Novembro	128.298.144,58	33.524.755,06	32.791.520,08	129.994.733,59	963.354,03	0,75%	0,25%	295,63%	1,50%
Dezembro	129.994.733,59	7.192.514,04	6.278.040,79	132.102.144,23	1.192.937,39	0,91%	0,61%	148,36%	1,31%
Acumulado no ano					10.252.281,13	8,63%	9,92%	87,02%	

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(%)
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	1.112.569,55	0,00	0,00	1.136.518,08	23.948,53	2,15%	2,06%	2,15%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.600.869,03	0,00	0,00	3.667.123,62	66.254,59	1,84%	1,78%	1,84%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.857.593,06	0,00	0,00	10.018.227,19	160.634,13	1,63%	1,22%	1,63%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.540.209,67	0,00	50.021,01	7.611.480,37	121.291,71	1,61%	1,22%	1,62%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	5.090.038,71	0,00	0,00	5.166.456,84	76.418,13	1,50%	0,94%	1,50%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.845.536,69	0,00	0,00	9.990.991,53	145.454,84	1,48%	0,91%	1,48%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	12.019.065,81	0,00	0,00	12.181.086,03	162.020,22	1,35%	0,59%	1,35%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.810.581,65	0,00	53.357,67	7.852.451,97	95.227,99	1,22%	0,42%	1,22%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.300.016,26	900.000,00	0,00	10.319.779,81	119.763,55	1,17%	0,65%	1,17%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	365.296,52	0,00	0,00	369.540,48	4.243,96	1,16%	0,46%	1,16%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15.235.862,35	0,00	0,00	15.412.314,83	176.452,48	1,16%	0,42%	1,16%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.245.897,38	0,00	0,00	1.257.523,69	11.626,31	0,93%	0,33%	0,93%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.361.358,72	0,00	0,00	8.406.706,49	45.347,77	0,54%	0,04%	0,54%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.595.326,44	0,00	64.822,49	4.554.982,02	24.478,07	0,53%	0,04%	0,54%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	5.137.570,80	2.329.062,09	1.136.982,00	6.353.992,96	24.342,07	0,33%	0,02%	0,47%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.191.962,32	2.663.451,95	1.400.327,61	6.477.722,85	22.636,19	0,29%	0,01%	0,48%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.631.213,33	1.300.000,00	3.572.000,00	1.364.952,42	5.739,09	0,12%	0,01%	0,50%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	2.930.237,27	0,00	0,00	2.779.845,05	-150.392,22	-5,13%	11,18%	-5,13%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	6.182,97	0,00	0,00	5.697,60	-485,37	-7,85%	-	-7,85%
Total Renda Fixa					1.135.002,04	1,00%	0,87%	

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(%)
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	3.408.900,73	0,00	0,00	3.534.023,49	125.122,76	3,67%	7,84%	3,67%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	2.111.573,24	0,00	0,00	2.140.831,86	29.258,62	1,39%	0,66%	1,39%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	2.673.085,07	0,00	0,00	2.695.241,12	22.156,05	0,83%	0,30%	0,83%
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	2.123.053,00	0,00	0,00	2.130.308,88	7.255,88	0,34%	6,89%	0,34%
HAZ FII - ATCR11	748.753,59	0,00	530,01	749.092,11	868,53	0,12%	-	0,00%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	1.873.540,24	0,00	0,00	1.872.953,41	-586,83	-0,03%	0,01%	-0,03%
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	160.954,69	0,00	0,00	160.605,20	-349,49	-0,22%	0,12%	-0,22%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1.076.336,67	0,00	0,00	1.067.012,12	-9.324,55	-0,87%	8,01%	-0,87%
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	956.741,60	0,00	0,00	942.169,75	-14.571,85	-1,52%	1,69%	-1,52%
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	1.018.040,25	0,00	0,00	995.566,10	-22.474,15	-2,21%	8,20%	-2,21%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	966.365,98	0,00	0,00	886.946,36	-79.419,62	-8,22%	10,38%	-8,22%
Total Renda Variável					57.935,35	0,34%	4,39%	

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 (%)
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.318.722,44	3.000.000,00	0,00	10.018.227,19	699.504,75	9,87%	9,88%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.978.923,56	0,00	50.021,01	7.611.480,37	682.577,82	9,78%	9,79%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.904.983,07	0,00	0,00	15.412.314,83	507.331,76	3,40%	3,40%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.206.871,25	0,00	0,00	3.667.123,62	460.252,37	14,35%	14,35%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.614.106,18	6.000.000,00	0,00	9.990.991,53	376.885,35	6,39%	6,44%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	11.170.622,32	0,00	11.534.141,60	0,00	363.519,28	3,25%	4,62%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.056.272,54	4.900.000,00	0,00	10.319.779,81	363.507,27	5,47%	5,50%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.642.405,75	0,00	53.357,67	7.852.451,97	263.403,89	3,45%	3,45%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	12.000.000,00	0,00	12.181.086,03	181.086,03	1,51%	4,60%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.240.360,27	0,00	0,00	8.406.706,49	166.346,22	2,02%	2,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	5.026.713,34	0,00	0,00	5.166.456,84	139.743,50	2,78%	2,78%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	1.012.966,63	0,00	0,00	1.136.518,08	123.551,45	12,20%	12,20%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.529.191,28	0,00	64.822,49	4.554.982,02	90.613,23	2,00%	2,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	4.826.463,52	7.625.444,87	6.186.982,00	6.353.992,96	89.066,57	1,15%	1,49%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.736.929,22	5.172.537,59	4.497.849,61	6.477.722,85	66.105,65	0,98%	1,50%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	10.147.099,85	8.335.000,00	17.179.500,00	1.364.952,42	62.352,57	0,53%	1,55%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.564.551,27	0,00	5.620.731,86	0,00	56.180,59	1,01%	2,09%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.223.663,21	0,00	0,00	1.257.523,69	33.860,48	2,77%	2,77%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	355.840,25	0,00	0,00	369.540,48	13.700,23	3,85%	3,85%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	7.200,30	0,00	0,00	5.697,60	-1.502,70	-20,87%	-20,87%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	2.875.558,56	0,00	0,00	2.779.845,05	-95.713,51	-3,33%	-3,33%
Total Renda Fixa					4.642.372,80	4,25%	

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 (%)
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.981.869,45	1.022.000,00	0,00	3.534.023,49	530.154,04	22,86%	21,85%
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.838.817,47	0,00	0,00	2.130.308,88	291.491,41	15,85%	15,85%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	940.082,98	0,00	0,00	1.067.012,12	126.929,14	13,50%	13,50%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	2.031.667,81	0,00	0,00	2.140.831,86	109.164,05	5,37%	5,37%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	915.495,05	0,00	1.021.677,29	0,00	106.182,24	11,60%	11,57%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	2.609.320,83	0,00	0,00	2.695.241,12	85.920,29	3,29%	3,29%
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	913.803,71	0,00	0,00	995.566,10	81.762,39	8,95%	8,95%
HAZ FII - ATCR11	748.214,22	0,00	530,01	749.092,11	1.407,90	0,19%	0,00%
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	161.371,61	0,00	0,00	160.605,20	-766,41	-0,47%	-0,47%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	1.873.737,55	0,00	0,00	1.872.953,41	-784,14	-0,04%	-
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	1.011.867,33	0,00	0,00	942.169,75	-69.697,58	-6,89%	-6,91%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	1.016.850,45	0,00	0,00	886.946,36	-129.904,09	-12,78%	-12,78%
Total Renda Variável					1.131.859,24	7,06%	

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 IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.083.847,67	4.764.197,52	1.600.000,00	15.412.314,83	1.164.269,64	9,11%	9,30%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.794.843,22	0,00	50.021,01	7.611.480,37	866.658,16	12,75%	12,76%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.153.378,39	3.000.000,00	0,00	10.018.227,19	864.848,80	12,82%	12,84%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	7.785.333,36	3.000.000,00	11.534.141,60	0,00	748.808,24	8,15%	9,65%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.163.152,37	1.125.819,93	53.357,67	7.852.451,97	616.837,34	9,18%	9,22%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.150.367,11	1.617.097,62	1.912.547,78	8.406.706,49	551.789,54	6,65%	6,81%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.474.677,36	6.000.000,00	0,00	9.990.991,53	516.314,17	10,65%	10,71%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.185.016,29	0,00	0,00	3.667.123,62	482.107,33	15,14%	15,14%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	53.129.233,28	52.192.500,00	1.364.952,42	428.219,14	2,66%	6,35%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	9.900.000,00	0,00	10.319.779,81	419.779,81	6,66%	9,90%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.204.932,15	0,00	8.620.731,86	0,00	415.799,71	5,66%	6,84%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.265.151,98	2.660.592,28	4.726.466,25	4.554.982,02	355.704,01	6,60%	6,76%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	4.949.714,81	21.188.804,63	20.126.761,21	6.353.992,96	342.234,73	5,23%	6,33%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.897.693,98	0,00	6.196.261,07	0,00	298.567,09	5,17%	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.391.368,70	10.092.595,70	8.199.064,80	6.477.722,85	192.823,25	4,75%	6,18%
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	6.712.210,06	0,00	6.893.421,62	0,00	181.211,56	3,27%	6,33%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	12.000.000,00	0,00	12.181.086,03	181.086,03	1,51%	9,65%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,00	5.000.000,00	0,00	5.166.456,84	166.456,84	3,33%	8,23%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	992.731,76	0,00	0,00	1.136.518,08	143.786,32	14,48%	14,48%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	11.063.467,87	1.802.000,00	13.005.733,28	0,00	140.265,41	1,14%	6,35%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.216.584,98	0,00	65.749,86	1.257.523,69	106.688,57	9,07%	3,37%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	606.419,57	0,00	282.532,70	369.540,48	45.653,61	9,94%	9,80%

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 (%)
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	840.829,72	0,00	883.511,11	0,00	42.681,39	5,19%	7,44%
SANTANDER TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.746.244,26	5.674.167,18	8.436.678,46	0,00	16.267,02	0,38%	6,07%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	15.998,21	0,00	0,00	5.697,60	-10.300,61	-64,39%	-64,40%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	2.862.032,45	0,00	0,00	2.779.845,05	-82.187,40	-2,87%	-2,87%
Total Renda Fixa					9.196.369,70	8,65%	

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 (%)
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	0,00	3.022.000,00	0,00	3.534.023,49	512.023,49	21,74%	26,02%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	0,00	2.500.000,00	0,00	2.695.241,12	195.241,12	7,81%	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,00	2.000.000,00	0,00	2.140.831,86	140.831,86	7,04%	-
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.130.308,88	130.308,88	6,52%	17,05%
HAZ FII - ATCR11	648.913,19	0,00	530,01	749.092,11	100.708,93	15,52%	0,00%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	954.311,05	0,00	1.041.397,92	0,00	87.086,87	9,13%	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	0,00	1.000.000,00	0,00	1.067.012,12	67.012,12	5,83%	13,64%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	0,00	1.000.000,00	1.021.677,29	0,00	21.677,29	1,48%	13,15%
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	995.566,10	-4.433,90	-1,44%	12,40%
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	167.998,29	0,00	0,00	160.605,20	-7.393,09	-4,40%	-4,40%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	1.881.874,89	0,00	0,00	1.872.953,41	-8.921,48	-0,47%	-
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	1.007.346,77	0,00	0,00	942.169,75	-65.177,02	-6,47%	-6,49%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	0,00	1.000.000,00	0,00	886.946,36	-113.053,64	-11,31%	-2,59%
Total Renda Variável					1.055.911,43	7,49%	