

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.655.505,58	5,51%	1.266	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.233.099,34	3,83%	643	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.053.896,69	1,25%	210	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	9.455.539,98	11,20%	508	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.343.963,29	2,78%	69	0,76%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	8.250.728,72	9,77%	1.477	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.334.501,22	2,76%	758	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.876.816,20	4,59%	732	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	8.101.060,78	9,59%	306	0,49%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.148.290,79	3,73%	86	0,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	799.760,38	0,95%	724	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	633.529,95	0,75%	200	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	6.670.769,51	7,90%	345	0,21%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	3.673.279,43	4,35%	44	2,42%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	6.947.026,04	8,23%	81	1,25%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	3.623.919,58	4,29%	803	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	5.355,21	0,01%	79	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	383.437,27	0,45%	425	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	870.062,12	1,03%	31	0,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	2.224.951,97	2,63%	13.646	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	266.098,62	0,32%	26	0,33%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	2.019.239,65	2,39%	98	2,14%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2018)

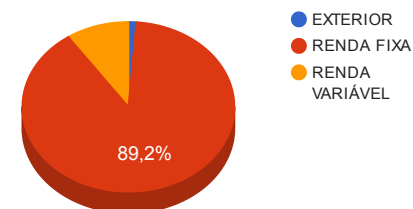
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	7.124,99	0,01%	28	1,10%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	D+90 ou D+150 a D+450	18 meses	759.378,66	0,90%	14	8,35%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	1.037.722,01	1,23%	158	0,24%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	D+4382	Não há	0,01	0,00%	5	-0,00%	Artigo 8º, Inciso III
BRADESCO PLUS I FI MULTIMERCADO	D+0	Não há	935.173,09	1,11%	19	3,06%	Artigo 8º, Inciso III
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	Não se aplica	Não se aplica	3.049.663,66	3,61%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se aplica	Não se aplica	3.083.767,94	3,65%		8,05%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIAÇÕES	D+4	Não há	1.013.064,88	1,20%	75	0,24%	Artigo 9º - A, Inciso III
		TOTAL -	84.456.727,56				

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

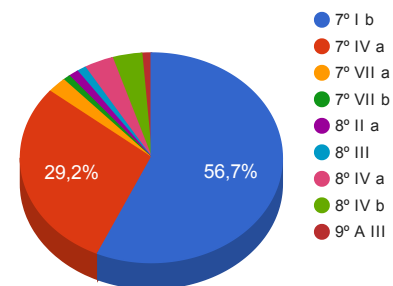
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	47.886.692,92	56,70%	15,00%	25,00%	70,00%	11.233.016,37
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	50.674.036,54
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	24.664.899,75	29,20%	5,00%	10,00%	30,00%	672.118,52
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	7,00%	15,00%	15,00%	12.668.509,13
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	2.026.364,64	2,40%	2,00%	5,00%	5,00%	2.196.471,74
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	759.378,66	0,90%	2,00%	5,00%	5,00%	3.463.457,72
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	10,00%	8.445.672,76
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	1.037.722,01	1,23%	2,00%	5,00%	10,00%	7.407.950,75
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	935.173,10	1,11%	7,00%	10,00%	10,00%	7.510.499,66
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	3.049.663,66	3,61%	2,00%	5,00%	5,00%	1.173.172,72
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	3.083.767,94	3,65%	2,00%	5,00%	5,00%	1.139.068,44
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	1.013.064,88	1,20%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.013.064,88
Total Carteira		84.456.727,56					

EXTERIOR	1.013.064,88	1,20%
RENDA FIXA	75.337.335,97	89,20%
RENDA VARIÁVEL	8.106.326,71	9,60%

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 "	47.886.692,92	56,70%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	24.664.899,75	29,20%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	2.026.364,64	2,40%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	759.378,66	0,90%	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%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	1.037.722,01	1,23%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	935.173,10	1,11%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	3.049.663,66	3,61%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	3.083.767,94	3,65%	2,00%	5,00%
Artigo 9º - A, Inciso III	1.013.064,88	1,20%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	84.456.727,56	100,00%	51,00	230,00

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	27.123.087,69	32,11%	0,01%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	26.575.307,91	31,47%	0,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	20.702.996,31	24,51%	0,00%
AQ3 ASSET MANAGEMENT	3.083.767,94	3,65%	19,51%
ROMA ASSET	3.049.663,66	3,61%	0,69%
FINAXIS CORRETORA	2.019.239,65	2,39%	-
Única Administradora	1.136.160,74	1,35%	0,07%
SECURITY ADMINISTRADORA DE RECURSOS	759.378,66	0,90%	8,35%
BRASIL PLURAL	7.125,00	0,01%	0,00%

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
IRF-M 1+	1,92%	12,27%	7,97%	9,99%	12,27%	30,98%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,85%	12,30%	8,28%	10,10%	12,30%	30,44%	0,20%	1,263%	4,70%
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%
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%
IMA-B	1,65%	13,06%	9,89%	11,77%	13,06%	27,52%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1,70%	12,86%	10,29%	11,90%	12,86%	27,50%	0,20%	1,273%	5,73%
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%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,62%	12,66%	9,79%	11,56%	12,66%	26,42%	0,20%	1,225%	5,48%
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%
IMA-B 5	1,36%	9,87%	4,65%	6,86%	9,87%	23,68%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,38%	9,67%	4,66%	6,81%	9,67%	23,25%	0,20%	0,598%	3,05%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1,36%	9,62%	4,73%	6,86%	9,62%	23,50%	0,20%	0,601%	3,18%
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FI IMA-B 5	0,55%	-17,91%	2,06%	-9,15%	-17,91%	-13,49%	0,70%	0,420%	14,65%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	-0,91%	-11,41%	-0,46%	1,17%	-11,41%	-2,94%	0,70%	2,832%	8,52%
IDKA IPCA 2 Anos	1,25%	9,75%	3,40%	6,58%	9,75%	24,69%	-	-	-

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 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%
CDI + 3,50% ao ano	0,77%	10,12%	2,40%	4,94%	10,12%	25,23%	-	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,10%	-69,83%	-14,39%	-26,25%	-69,83%	-93,95%	0,20%	-	-
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%
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%
Selic	0,49%	6,43%	1,54%	3,15%	6,43%	17,01%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,49%	6,33%	1,51%	3,10%	6,33%	17,34%	0,20%	0,002%	0,02%
CDI	0,49%	6,42%	1,54%	3,15%	6,42%	16,98%	-	-	-
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,48%	6,19%	1,50%	3,04%	6,19%	16,69%	0,25%	0,006%	0,03%
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%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,32%	-18,76%	-20,52%	-19,92%	-18,76%	-15,07%	1,00%	0,036%	21,24%
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,47%	7,98%	1,38%	3,16%	7,98%	15,66%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,15%	-6,86%	-0,72%	-1,70%	-6,86%	-11,39%	0,15%	0,028%	3,04%

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
IPCA	0,15%	3,75%	0,39%	1,11%	3,75%	6,80%	-	-	-
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%

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

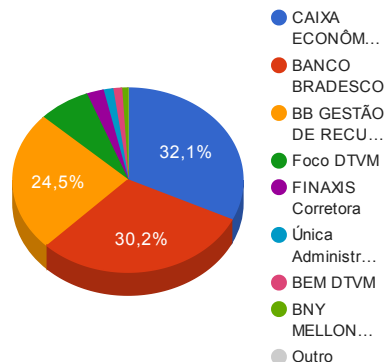
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	2,22%	5,62%	10,16%	10,65%	5,62%	26,12%	-	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,00%	-8,23%	-2,50%	-3,70%	-8,23%	-22,78%	1,50%	0,004%	38,15%
IPCA + 8,00% ao ano	0,76%	11,98%	2,31%	5,08%	11,98%	24,39%	-	-	-
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	4,56%	108,44%	14,95%	35,55%	108,44%	-100,61%	0,12%	0,118%	11,98%
CDI	0,49%	6,42%	1,54%	3,15%	6,42%	16,98%	-	-	-
BRADESCO PLUS I FI MULTIMERCADO	0,57%	6,50%	2,19%	3,69%	6,50%	17,77%	0,50%	0,131%	0,58%
Ibovespa	-1,81%	15,03%	10,77%	20,79%	15,03%	45,93%	-	-	-
BRADESCO SELECTION FIAÇÕES	0,30%	26,08%	13,12%	23,96%	26,08%	68,94%	1,50%	8,367%	21,56%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	-	-	-	-	-	-	0,30%	-	-

Retorno dos investimentos no Exterior e Benchmark's - base (dezembro / 2018)

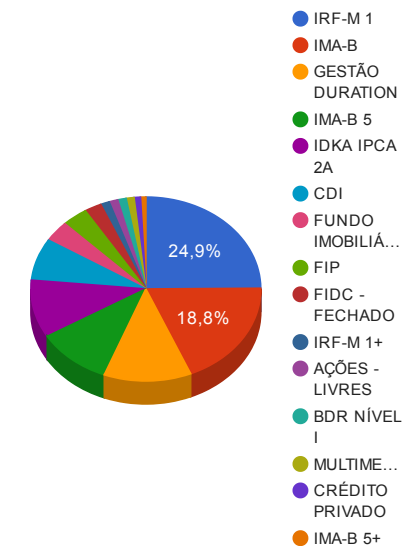
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Global BDRX	-7,73%	12,02%	-17,12%	-6,22%	12,02%	38,99%	-	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIAÇÕES	-7,81%	10,18%	-17,07%	-6,67%	10,18%	35,31%	0,70%	11,365%	18,40%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	27.123.087,69	32,11%
BANCO BRADESCO	25.537.585,90	30,24%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	20.702.996,31	24,51%
Foco DTVM	6.133.431,60	7,26%
FINAXIS Corretora	2.019.239,65	2,39%
Única Administradora	1.136.160,75	1,35%
BEM DTVM	1.037.722,01	1,23%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	759.378,66	0,90%
Geração Futuro	7.124,99	0,01%

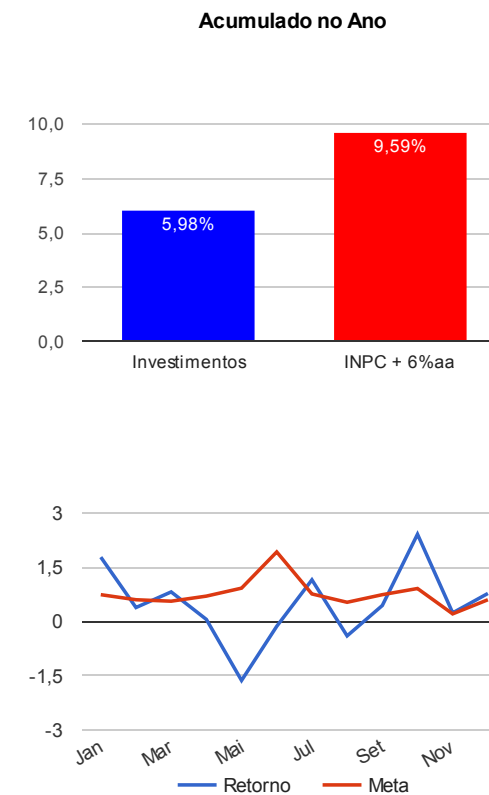


Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	21.007.295,08	24,87%
IMA-B	15.842.285,32	18,76%
GESTÃO DURATION	10.344.048,94	12,25%
IMA-B 5	8.882.947,16	10,52%
IDKA IPCA 2A	8.555.280,71	10,13%
CDI	6.232.308,82	7,38%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.083.767,94	3,65%
FIP	3.049.663,66	3,61%
FIDC - FECHADO	2.026.364,64	2,40%
IRF-M 1+	1.053.896,69	1,25%
AÇÕES - LIVRES	1.037.722,01	1,23%
BDR NÍVEL I	1.013.064,88	1,20%
MULTIMERCADO	935.173,10	1,11%
CRÉDITO PRIVADO	759.378,66	0,90%
IMA-B 5+	633.529,95	0,75%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	79.252.010,83	2.135.008,78	1.491.073,39	81.315.309,08	1.419.362,86	1,78%	0,74%	239,69%	1,06%
Fevereiro	81.315.309,08	577.688,15	782.665,89	81.423.749,70	313.418,36	0,39%	0,60%	64,47%	1,22%
Março	81.423.749,70	1.614.103,74	1.472.876,12	82.230.439,61	665.462,29	0,82%	0,56%	146,45%	2,59%
Abril	82.230.439,61	897.312,32	1.469.709,20	81.705.047,90	47.005,17	0,06%	0,70%	8,19%	0,93%
Mai	81.705.047,90	1.088.968,72	4.063.275,52	77.400.356,20	-1.330.384,90	-1,63%	0,92%	-177,21%	1,57%
Junho	77.400.356,20	247.792,32	2.061.462,70	75.483.726,33	-102.959,49	-0,13%	1,92%	-6,91%	3,97%
Julho	75.483.726,33	10.347.479,58	9.338.328,03	77.372.170,17	879.292,29	1,15%	0,76%	151,00%	1,14%
Agosto	77.372.170,17	1.118.251,31	1.501.455,44	76.681.323,07	-307.642,97	-0,40%	0,53%	-74,57%	2,40%
Setembro	76.681.323,07	13.143.573,35	13.152.279,16	77.010.587,03	337.969,77	0,44%	0,74%	59,43%	1,53%
Outubro	77.010.587,03	615.642,95	2.608.531,19	76.872.283,10	1.854.584,31	2,41%	0,91%	264,05%	1,38%
Novembro	76.872.283,10	3.347.737,64	3.530.059,92	76.872.779,60	182.818,78	0,24%	0,21%	111,99%	1,47%
Dezembro	76.872.779,60	3.631.581,99	2.280.537,05	78.828.877,72	605.053,18	0,77%	0,60%	128,02%	0,74%
Acumulado no ano					4.563.979,65	5,98%	9,59%	62,41%	



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(%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.034.732,40	0,00	0,00	1.053.896,69	19.164,29	1,85%	1,26%	1,85%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	622.083,85	0,00	0,00	633.529,95	11.446,10	1,84%	1,78%	1,84%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	5.265,51	0,00	0,00	5.355,21	89,70	1,70%	1,27%	1,70%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	2.305.783,37	0,00	0,00	2.343.963,29	38.179,92	1,66%	0,75%	1,66%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.305.223,63	0,00	0,00	9.455.539,98	150.316,35	1,62%	1,22%	1,62%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	788.886,55	0,00	0,00	799.760,38	10.873,83	1,38%	0,60%	1,38%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	6.853.529,26	0,00	0,00	6.947.026,04	93.496,78	1,36%	0,60%	1,36%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	6.583.474,19	0,00	0,00	6.670.769,51	87.295,32	1,33%	0,62%	1,33%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.628.512,94	0,00	0,00	3.673.279,43	44.766,49	1,23%	0,70%	1,23%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.306.303,25	0,00	0,00	2.334.501,22	28.197,97	1,22%	0,42%	1,22%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.922.445,70	0,00	90.388,77	3.876.816,20	44.759,27	1,14%	0,42%	1,16%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.403.025,48	1.711.231,54	0,00	3.148.290,79	34.033,77	1,09%	1,23%	1,62%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.278.148,72	1.920.350,45	0,00	3.233.099,34	34.600,17	1,08%	1,22%	1,63%
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FI IMA-B 5	865.318,07	0,00	0,00	870.062,12	4.744,05	0,55%	0,42%	0,55%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.630.684,38	0,00	0,00	4.655.505,58	24.821,20	0,54%	0,04%	0,54%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.919.483,91	0,00	864.696,44	8.101.060,78	46.273,31	0,52%	0,05%	0,54%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.708.475,51	0,00	1.506.229,38	8.250.728,72	48.482,59	0,50%	0,04%	0,54%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	381.584,83	0,00	0,00	383.437,27	1.852,44	0,49%	0,00%	0,49%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.214.351,07	0,00	0,00	2.224.951,97	10.600,90	0,48%	0,01%	0,48%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	3.607.035,55	0,00	0,00	3.623.919,58	16.884,03	0,47%	0,02%	0,47%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	756.967,23	0,00	0,00	759.378,66	2.411,43	0,32%	0,04%	0,32%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	7.118,05	0,00	0,00	7.124,99	6,94	0,10%	-	-

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(%)
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.022.355,78	0,00	0,00	2.019.239,65	-3.116,13	-0,15%	0,03%	-0,15%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	268.532,92	0,00	0,00	266.098,62	-2.434,30	-0,91%	2,83%	-0,91%
				Total Renda Fixa	747.746,42	1,00%	0,53%	

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(%)
BRADESCO PLUS I FI MULTIMERCADO	929.866,89	0,00	0,00	935.173,09	5.306,20	0,57%	0,13%	0,57%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	1.034.659,59	0,00	0,00	1.037.722,01	3.062,42	0,30%	8,37%	0,30%
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	0,12%	4,56%
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	3.050.541,93	0,00	0,00	3.049.663,66	-878,27	-0,03%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	3.089.278,63	0,00	0,00	3.083.767,94	-5.510,69	-0,18%	0,00%	0,00%
Total Renda Variável					1.979,66	0,02%	1,74%	

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

Ativos de Investimentos no Exterior	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIAÇÕES	1.098.902,58	0,00	0,00	1.013.064,88	-85.837,70	-7,81%	11,37%	-7,81%
				Total Exterior	-85.837,70	-7,81%	11,37%	

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 (%)
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.612.551,53	0,00	0,00	9.455.539,98	842.988,45	9,79%	9,79%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	8.565.680,13	0,00	2.000.000,00	6.947.026,04	381.345,91	4,77%	4,73%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	6.449.656,38	0,00	0,00	6.670.769,51	221.113,13	3,43%	3,43%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.322.673,57	0,00	2.271.259,34	8.250.728,72	199.314,49	1,97%	2,02%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.479.268,15	0,00	0,00	3.673.279,43	194.011,28	5,58%	5,58%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.240.121,63	0,00	2.326.419,90	8.101.060,78	187.359,05	1,94%	1,98%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.872.939,68	0,00	126.884,34	3.876.816,20	130.760,86	3,39%	3,40%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.153.105,25	0,00	1.267.178,43	0,00	114.073,18	9,89%	14,17%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	986.685,85	0,00	1.084.197,38	0,00	97.511,53	9,88%	14,25%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.564.040,35	0,00	0,00	4.655.505,58	91.465,23	2,00%	2,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	973.315,06	0,00	0,00	1.053.896,69	80.581,63	8,28%	8,28%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	554.017,04	0,00	0,00	633.529,95	79.512,91	14,35%	14,35%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.256.644,38	0,00	0,00	2.334.501,22	77.856,84	3,45%	3,45%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	284.159,90	2.000.000,00	0,00	2.343.963,29	59.803,39	5,52%	5,93%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	3.570.548,82	0,00	0,00	3.623.919,58	53.370,76	1,49%	1,49%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	3.181.618,45	0,00	3.233.099,34	51.480,89	287,35%	9,88%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,00	3.104.192,96	0,00	3.148.290,79	44.097,83	1,86%	9,79%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	764.156,80	0,00	0,00	799.760,38	35.603,58	4,66%	4,66%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.192.141,36	0,00	0,00	2.224.951,97	32.810,61	1,50%	1,50%
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FI IMA-B 5	852.475,59	0,00	0,00	870.062,12	17.586,53	2,06%	2,06%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	377.716,04	0,00	0,00	383.437,27	5.721,23	1,51%	1,51%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.855,40	0,00	0,00	5.355,21	499,81	10,29%	10,29%

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 (%)
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	8.322,24	0,00	0,00	7.124,99	-1.197,25	-14,39%	-14,39%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	267.315,27	0,00	0,00	266.098,62	-1.216,65	-0,46%	-0,46%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.033.823,10	0,00	0,00	2.019.239,65	-14.583,45	-0,72%	-0,72%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	955.380,30	0,00	0,00	759.378,66	-196.001,64	-20,52%	-20,52%
				Total Renda Fixa	2.785.870,13	5,42%	

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 (%)
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	917.350,41	0,00	0,00	1.037.722,01	120.371,60	13,12%	13,12%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.309.878,10	0,00	1.409.977,34	0,00	100.099,24	7,64%	22,59%
BRADESCO PLUS I FI MULTIMERCADO	915.092,08	0,00	0,00	935.173,09	20.081,01	2,19%	2,19%
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	14,95%
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	3.052.821,52	0,00	0,00	3.049.663,66	-3.157,86	-0,10%	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	3.099.465,22	0,00	0,00	3.083.767,94	-15.697,28	-0,51%	-2,50%
Total Renda Variável					221.696,71	1,78%	

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

Ativos de Investimentos no Exterior	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIAÇÕES	0,00	1.068.077,86	0,00	1.013.064,88	-55.012,98	-5,15%	-17,07%
				Total Exterior	-55.012,98	-5,15%	

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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.372.976,45	12.974,37	0,00	9.455.539,98	1.069.589,16	12,76%	12,76%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	7.455.279,89	756.271,97	2.000.000,00	6.947.026,04	735.474,18	9,66%	9,62%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	11.227.410,69	2.356.662,06	5.984.892,41	8.250.728,72	651.548,38	6,65%	6,81%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.384.684,97	0,00	887.509,20	3.876.816,20	379.640,43	9,26%	9,30%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	10.935.264,30	3.190.265,64	8.101.060,78	356.062,12	3,54%	6,72%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.360.870,33	0,00	0,00	4.655.505,58	294.635,25	6,76%	6,76%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00	6.396.547,21	0,00	6.670.769,51	274.222,30	4,29%	7,82%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	6.981.974,02	2.945.303,56	10.156.182,87	0,00	228.905,29	2,87%	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	9.191.436,63	4.697.987,04	10.966.559,13	3.148.290,79	225.426,25	3,90%	12,66%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	3.408.035,33	0,00	0,00	3.623.919,58	215.884,25	6,33%	6,33%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	3.458.422,40	0,00	3.673.279,43	214.857,03	6,21%	9,50%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.461.030,98	4.775.412,53	10.208.936,28	3.233.099,34	205.592,11	296,61%	12,84%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.137.383,75	0,00	0,00	2.334.501,22	197.117,47	9,22%	9,22%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.534.663,86	16.223,50	1.683.365,21	0,00	132.477,85	10,72%	14,98%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	1.251.973,18	0,00	1.364.389,49	0,00	112.416,31	10,62%	15,04%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	944.954,44	0,00	1.053.896,69	108.942,25	11,53%	12,30%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	651.999,54	1.479.519,93	0,00	2.224.951,97	93.432,50	5,85%	6,19%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	550.241,39	0,00	0,00	633.529,95	83.288,56	15,14%	15,14%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	270.469,40	2.000.000,00	0,00	2.343.963,29	73.493,89	10,86%	11,29%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	756.271,97	0,00	799.760,38	43.488,41	5,75%	9,67%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	360.606,98	0,00	0,00	383.437,27	22.830,29	6,33%	6,33%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.744,82	0,00	0,00	5.355,21	610,39	12,86%	12,86%

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 (%)
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	23.618,76	0,00	12.669,17	7.124,99	-3.824,60	-35,12%	-69,83%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	300.380,51	0,00	0,00	266.098,62	-34.281,89	-11,41%	-11,41%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.168.020,33	0,00	1.744,09	2.019.239,65	-147.036,59	-6,79%	-6,86%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	934.685,49	0,00	0,00	759.378,66	-175.306,83	-18,76%	-18,76%
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FI IMA-B 5	1.059.924,65	0,00	0,00	870.062,12	-189.862,53	-17,91%	-17,91%
				Total Renda Fixa	5.169.622,23	8,77%	

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 (%)
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	0,00	864.213,00	0,00	1.037.722,01	173.509,01	20,08%	26,08%
BRADESCO PLUS I FI MULTIMERCADO	0,00	911.846,80	0,00	935.173,09	23.326,29	2,56%	6,50%
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	108,44%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.450.002,25	0,00	1.438.899,33	0,00	-11.102,92	-0,93%	10,75%
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	3.062.815,22	0,00	0,00	3.049.663,66	-13.151,56	-0,43%	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	3.340.874,72	0,00	0,00	3.083.767,94	-257.106,78	-7,70%	-8,23%
Total Renda Variável					-84.525,96	-2,29%	

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

Ativos de Investimentos no Exterior	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIAÇÕES	0,00	1.068.077,86	0,00	1.013.064,88	-55.012,98	-5,15%	10,18%
				Total Exterior	-55.012,98	-5,15%	