

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
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	11.498.397,85	4,62%	210	0,67%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	47.160.556,73	18,95%	724	0,41%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.128.673,77	3,67%	643	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	269.227,24	0,11%	60	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.040.806,75	0,42%	75	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	22.964.947,86	9,23%	758	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	26.532.649,54	10,66%	1.477	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	41.100.447,42	16,51%	732	0,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	20.120.000,28	8,08%	658	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	3.689.798,85	1,48%	306	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.918.874,35	2,38%	1.266	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+0	Não há	15.317.603,34	6,15%	265	0,77%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	2.077.025,38	0,83%	196	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	15.997.114,29	6,43%	345	0,51%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	887.042,58	0,36%	803	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou D+1461	Não há	616.707,38	0,25%	16	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	9.275.224,76	3,73%	827	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	3.434,87	0,00%	47	0,42%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	1.965,49	0,00%	42	0,31%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.268.789,76	0,51%	23	2,56%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.196.161,17	0,48%	1.236	1,81%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	2.368.065,02	0,95%	158	0,54%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2018)

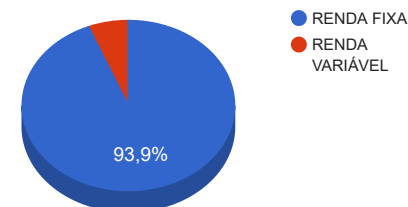
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	2.484.558,27	1,00%	2.186	1,18%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.190.069,63	0,48%	465	2,87%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	3.227.694,60	1,30%	729	1,20%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	1.315.769,48	0,53%	46	0,36%	Artigo 8º, Inciso III
ÁTICO FLORESTAL MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	1.233.706,66	0,50%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	1.009.360,00	0,41%		0,63%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
		TOTAL -	248.894.673,32				

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

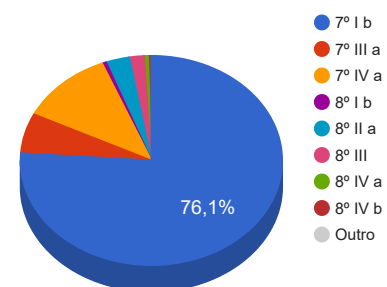
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	189.424.380,64	76,11%	40,00%	65,00%	100,00%	59.470.292,68
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	15.317.603,34	6,15%	5,00%	10,00%	20,00%	34.461.331,32
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	28.853.114,39	11,59%	10,00%	12,00%	40,00%	70.704.754,94
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5.400,36	0,00%	0,00%	0,00%	3,00%	7.461.439,84
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	12.444.733,67
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	15,00%	37.334.201,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	30,00%	1.268.789,76	0,51%	0,00%	0,00%	10,00%	23.620.677,57
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	7.238.854,09	2,91%	1,00%	2,00%	15,00%	30.095.346,91
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	12.444.733,67
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	4.543.464,08	1,83%	0,00%	5,00%	10,00%	20.346.003,25
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	1.233.706,66	0,50%	0,00%	1,00%	3,00%	6.233.133,54
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	1.009.360,00	0,41%	0,00%	1,00%	2,00%	3.968.533,47
Total Carteira		248.894.673,32					

RENDA FIXA	233.600.498,73	93,86%
RENDA VARIÁVEL	15.294.174,59	6,14%

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 " a "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	189.424.380,64	76,11%	40,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	15.317.603,34	6,15%	5,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	28.853.114,39	11,59%	10,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	2,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5.400,36	0,00%	0,00%	3,00%
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 "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	1.268.789,76	0,51%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	7.238.854,09	2,91%	1,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso III	4.543.464,08	1,83%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	1.233.706,66	0,50%	0,00%	3,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	1.009.360,00	0,41%	0,00%	2,00%
Total Renda Fixa	248.894.673,32	100,00%	56,00	305,00

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	186.387.301,13	74,89%	0,04%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	49.890.865,07	20,04%	0,00%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	6.057.863,87	2,43%	0,00%
ITAÚ UNIBANCO	3.387.059,37	1,36%	0,00%
WESTERN ASSET	1.315.769,48	0,53%	0,00%
ÁTICO ASSET MANAGEMENT	1.233.706,66	0,50%	3,76%
Elleven Gestora de Recursos	616.707,38	0,25%	0,09%
VILA RICA CAPITAL	3.434,87	0,00%	0,16%
BRASIL PLURAL	1.965,49	0,00%	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	1,65%	13,06%	9,89%	11,77%	13,06%	27,52%	-	-	-
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%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1,63%	12,94%	9,79%	11,66%	12,94%	26,90%	0,20%	1,208%	5,35%
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%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,51%	10,53%	6,18%	8,09%	10,53%	27,01%	0,20%	0,915%	3,38%
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%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	1,33%	9,41%	4,54%	6,64%	9,41%	22,69%	0,40%	0,584%	3,04%
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%
CDI + 3,50% ao ano	0,77%	10,12%	2,40%	4,94%	10,12%	25,23%	-	-	-
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-8,37%	-97,50%	-29,17%	-42,45%	-97,50%	-89,34%	0,20%	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-51,05%	-96,62%	-80,18%	-90,64%	-96,62%	-96,54%	0,39%	81,447%	178,17%

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

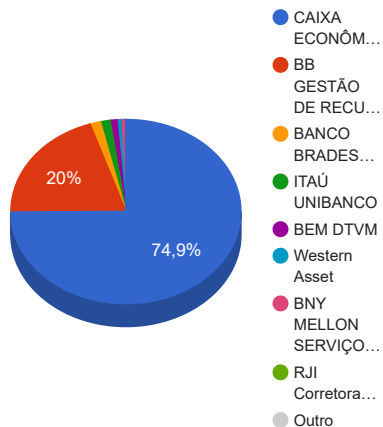
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	0,56%	6,97%	2,03%	3,78%	6,97%	18,87%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,54%	6,81%	2,02%	3,74%	6,81%	18,48%	0,20%	0,044%	0,55%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,54%	6,72%	1,96%	3,68%	6,72%	18,34%	0,20%	0,044%	0,54%
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%	-	-	-
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 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%

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

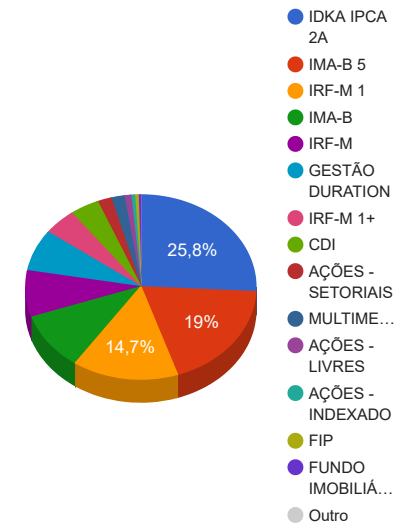
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	2,22%	5,62%	10,16%	10,65%	5,62%	26,12%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-0,65%	-5,67%	5,69%	10,19%	-5,67%	-1,04%	1,20%	7,989%	21,23%
SMLL	2,10%	8,13%	20,46%	18,83%	8,13%	61,50%	-	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	1,35%	5,01%	17,87%	16,93%	5,01%	56,54%	1,50%	7,156%	19,88%
IDIV	0,65%	15,95%	20,32%	24,50%	15,95%	45,28%	-	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1,61%	9,13%	20,29%	24,62%	9,13%	35,03%	1,50%	5,469%	16,93%
CDI	0,49%	6,42%	1,54%	3,15%	6,42%	16,98%	-	-	-
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	0,82%	8,35%	2,31%	2,78%	8,35%	17,73%	2,00%	0,718%	1,51%
Ibovespa	-1,81%	15,03%	10,77%	20,79%	15,03%	45,93%	-	-	-
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	0,90%	11,99%	25,26%	23,92%	11,99%	38,58%	2,00%	7,773%	22,30%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	0,83%	-	3,29%	4,98%	-	-	1,60%	0,295%	-
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	0,30%	26,08%	13,12%	23,96%	26,08%	68,94%	1,50%	8,367%	21,56%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	-1,78%	14,43%	10,54%	20,39%	14,43%	43,98%	0,50%	8,439%	21,76%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ÁTICO FLORESTAL MULTIELABORATÓRIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	186.387.301,13	74,89%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	49.890.865,07	20,04%
BANCO BRADESCO	3.689.798,85	1,48%
ITAÚ UNIBANCO	3.387.059,37	1,36%
BEM DTVM	2.368.065,02	0,95%
Western Asset	1.315.769,48	0,53%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	1.233.706,66	0,50%
RJI Corretora de Valores	616.707,38	0,25%
BRL Trust Investimentos	3.434,87	0,00%
Geração Futuro	1.965,49	0,00%



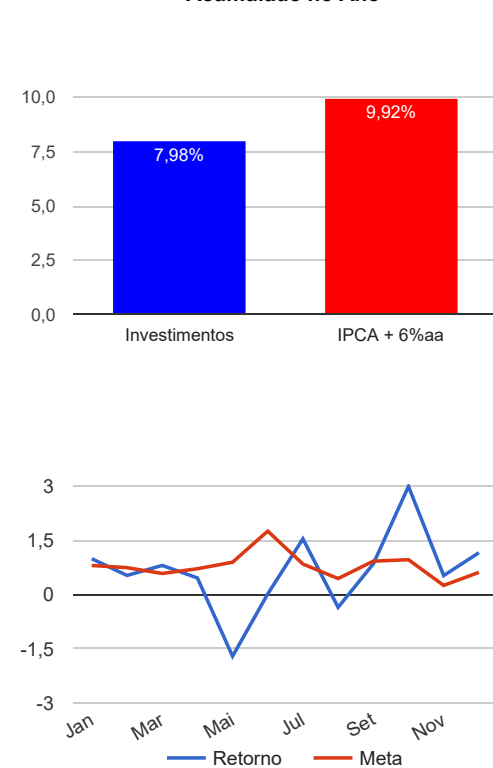
Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	64.065.395,28	25,74%
IMA-B 5	47.160.556,73	18,95%
IRF-M 1	36.410.549,98	14,63%
IMA-B	25.062.984,49	10,07%
IRF-M	20.120.000,28	8,08%
GESTÃO DURATION	18.074.139,67	7,26%
IRF-M 1+	11.498.397,85	4,62%
CDI	10.162.267,34	4,08%
AÇÕES - SETORIAIS	4.870.789,07	1,96%
MULTIMERCADO	4.543.464,08	1,83%
AÇÕES - LIVRES	2.368.065,02	0,95%
AÇÕES - INDEXADO	1.268.789,76	0,51%
FIP	1.233.706,66	0,50%
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.009.360,00	0,41%
FIDC - FECHADO	5.400,36	0,00%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	218.358.197,99	3.256.598,24	584.529,28	223.211.271,45	2.181.004,50	0,99%	0,80%	123,12%	0,58%
Fevereiro	223.211.271,45	32.046.177,92	29.063.833,93	227.380.909,32	1.187.293,88	0,52%	0,74%	71,09%	0,64%
Março	227.380.909,32	5.700.509,83	3.998.503,56	230.919.074,26	1.836.158,67	0,80%	0,58%	138,87%	0,60%
Abril	230.919.074,26	131.368.431,63	130.651.708,81	232.694.872,29	1.059.075,21	0,46%	0,71%	64,59%	0,84%
Mai	232.694.872,29	1.685.173,82	1.066.270,58	229.336.706,31	-3.977.069,22	-1,70%	0,89%	-191,81%	1,71%
Junho	229.336.706,31	1.804.315,46	1.051.639,34	230.123.823,29	34.440,86	0,01%	1,75%	0,85%	3,02%
Julho	230.123.823,29	9.361.449,78	8.674.997,13	234.356.082,82	3.545.806,88	1,54%	0,84%	182,52%	1,22%
Agosto	234.356.082,82	22.612.546,59	21.934.415,70	234.200.201,37	-834.012,34	-0,35%	0,44%	-80,15%	1,88%
Setembro	234.200.201,37	1.733.536,84	1.053.482,58	236.864.681,11	1.984.425,48	0,84%	0,92%	91,59%	1,28%
Outubro	236.864.681,11	1.204.155,03	920.997,05	244.224.419,79	7.076.580,70	2,98%	0,96%	310,10%	1,88%
Novembro	244.224.419,79	1.401.119,83	1.117.311,65	245.785.170,59	1.276.942,62	0,52%	0,25%	206,79%	1,17%
Dezembro	245.785.170,59	11.733.566,46	11.460.532,30	248.894.673,32	2.836.468,57	1,15%	0,61%	187,68%	0,86%
Acumulado no ano					18.207.115,81	7,98%	9,92%	80,40%	

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(%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.289.308,41	0,00	0,00	11.498.397,85	209.089,44	1,85%	1,26%	1,85%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.982.302,91	0,00	0,00	9.128.673,77	146.370,86	1,63%	1,22%	1,63%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	19.820.260,84	0,00	0,00	20.120.000,28	299.739,44	1,51%	0,92%	1,51%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	2.046.303,66	0,00	0,00	2.077.025,38	30.721,72	1,50%	0,94%	1,50%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	56.394.109,73	0,00	10.000.000,00	47.160.556,73	766.447,00	1,36%	0,60%	1,38%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	1.027.159,22	0,00	0,00	1.040.806,75	13.647,53	1,33%	0,58%	1,33%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	22.687.558,89	0,00	0,00	22.964.947,86	277.388,97	1,22%	0,42%	1,22%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	10.139.223,41	5.000.000,00	0,00	15.317.603,34	178.379,93	1,18%	1,21%	1,63%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	40.629.896,70	0,00	0,00	41.100.447,42	470.550,72	1,16%	0,42%	1,16%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	10.847.916,62	5.000.000,00	0,00	15.997.114,29	149.197,67	0,94%	0,62%	1,33%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	26.389.526,12	0,00	0,00	26.532.649,54	143.123,42	0,54%	0,04%	0,54%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	267.779,60	0,00	0,00	269.227,24	1.447,64	0,54%	0,04%	0,54%
BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.670.031,10	0,00	0,00	3.689.798,85	19.767,75	0,54%	0,05%	0,54%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.887.317,39	0,00	0,00	5.918.874,35	31.556,96	0,54%	0,04%	0,54%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	882.909,80	0,00	0,00	887.042,58	4.132,78	0,47%	0,02%	0,47%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	8.947.386,67	1.733.566,46	1.450.236,13	9.275.224,76	44.507,76	0,42%	0,01%	0,48%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	7.016,89	0,00	3.296,17	3.434,87	-285,85	-4,07%	81,45%	-51,05%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	650.071,83	0,00	0,00	616.707,38	-33.364,45	-5,13%	11,18%	-5,13%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	2.145,05	0,00	0,00	1.965,49	-179,56	-8,37%	-	-
Total Renda Fixa					2.752.239,73	1,19%	0,59%	

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(%)
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.177.201,12	0,00	0,00	1.196.161,17	18.960,05	1,61%	5,47%	1,61%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	2.451.417,33	0,00	0,00	2.484.558,27	33.140,94	1,35%	7,16%	1,35%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	1.179.511,97	0,00	0,00	1.190.069,63	10.557,66	0,90%	7,77%	0,90%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	3.201.161,56	0,00	0,00	3.227.694,60	26.533,04	0,83%	0,30%	0,83%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1.305.048,15	0,00	0,00	1.315.769,48	10.721,33	0,82%	0,72%	0,82%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	2.361.076,63	0,00	0,00	2.368.065,02	6.988,39	0,30%	8,37%	0,30%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.016.000,00	0,00	7.000,00	1.009.360,00	360,00	0,04%	7,99%	-0,65%
ÁTICO FLORESTAL MULTISTRATÉGIA FIP	1.233.706,66	0,00	0,00	1.233.706,66	0,00	0,00%	-	-
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	1.291.822,33	0,00	0,00	1.268.789,76	-23.032,57	-1,78%	8,44%	-1,78%
Total Renda Variável					84.228,84	0,55%	5,27%	

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 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	54.626.286,66	0,00	10.000.000,00	47.160.556,73	2.534.270,07	4,64%	4,66%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	39.747.531,71	0,00	0,00	41.100.447,42	1.352.915,71	3,40%	3,40%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	18.949.152,15	0,00	0,00	20.120.000,28	1.170.848,13	6,18%	6,18%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	9.385.413,11	5.000.000,00	0,00	15.317.603,34	932.190,23	9,30%	9,79%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.619.222,77	0,00	0,00	11.498.397,85	879.175,08	8,28%	8,28%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.307.531,79	0,00	0,00	9.128.673,77	821.141,98	9,88%	9,88%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	22.199.054,85	0,00	0,00	22.964.947,86	765.893,01	3,45%	3,45%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	26.007.639,41	0,00	0,00	26.532.649,54	525.010,13	2,02%	2,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	10.627.418,38	5.000.000,00	0,00	15.997.114,29	369.695,91	3,04%	3,43%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	8.269.011,73	4.338.841,32	3.467.960,38	9.275.224,76	135.332,09	1,36%	1,51%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.802.588,12	0,00	0,00	5.918.874,35	116.286,23	2,00%	2,00%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.618.289,92	0,00	0,00	3.689.798,85	71.508,93	1,98%	1,98%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	2.020.845,52	0,00	0,00	2.077.025,38	56.179,86	2,78%	2,78%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	995.596,92	0,00	0,00	1.040.806,75	45.209,83	4,54%	4,54%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	873.978,78	0,00	0,00	887.042,58	13.063,80	1,49%	1,49%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	264.045,54	0,00	0,00	269.227,24	5.181,70	1,96%	1,96%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	2.774,79	0,00	0,00	1.965,49	-809,30	-29,17%	-29,17%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	17.330,17	0,00	9.880,62	3.434,87	-4.014,68	-18,58%	-80,18%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	637.941,38	0,00	0,00	616.707,38	-21.234,00	-3,33%	-3,33%
Total Renda Fixa					9.767.844,71	4,37%	

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 (%)
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	2.107.832,88	0,00	0,00	2.484.558,27	376.725,39	17,87%	17,87%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	2.093.378,95	0,00	0,00	2.368.065,02	274.686,07	13,12%	13,12%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	950.085,13	0,00	0,00	1.190.069,63	239.984,50	25,26%	25,26%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	994.386,51	0,00	0,00	1.196.161,17	201.774,66	20,29%	20,29%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	1.147.795,64	0,00	0,00	1.268.789,76	120.994,12	10,54%	10,54%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	3.124.800,49	0,00	0,00	3.227.694,60	102.894,11	3,29%	3,29%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	955.000,00	0,00	21.000,00	1.009.360,00	75.360,00	7,92%	5,69%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1.286.041,15	0,00	0,00	1.315.769,48	29.728,33	2,31%	2,31%
ÁTICO FLORESTAL MULTIELSTRATÉGIA FIP	1.233.706,66	0,00	0,00	1.233.706,66	0,00	0,00%	-
Total Renda Variável					1.422.147,18	10,24%	

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 IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.435.143,78	43.000.000,00	10.000.000,00	47.160.556,73	3.725.412,95	9,71%	9,67%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.481.729,06	30.000.000,00	0,00	41.100.447,42	2.618.718,36	9,34%	9,30%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	72.362.912,09	25.000.000,00	73.000.000,00	26.532.649,54	2.169.737,45	6,14%	6,81%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.741.604,71	11.631.297,29	0,00	22.964.947,86	1.592.045,86	9,20%	9,22%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.733.838,32	15.000.000,00	0,00	20.120.000,28	1.386.161,96	10,59%	10,53%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	53.605.380,74	24.819.142,63	70.185.361,46	9.275.224,76	1.036.062,85	5,06%	6,23%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	4.292.292,52	10.000.000,00	0,00	15.317.603,34	1.025.310,82	12,33%	12,94%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.285.991,11	8.000.000,00	3.000.000,00	9.128.673,77	842.682,66	12,38%	12,84%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	29.268.346,41	872.943,39	25.000.000,00	5.918.874,35	777.584,55	6,30%	6,76%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	5.259.622,55	10.000.000,00	0,00	15.997.114,29	737.491,74	7,25%	7,82%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	35.000.000,00	24.000.000,00	11.498.397,85	498.397,85	8,04%	12,30%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	3.560.106,59	0,00	3.689.798,85	129.692,26	3,64%	6,72%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	3.457.716,70	0,00	3.560.106,59	0,00	102.389,89	2,96%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	951.287,05	0,00	0,00	1.040.806,75	89.519,70	9,41%	9,41%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,00	2.000.000,00	0,00	2.077.025,38	77.025,38	3,85%	8,23%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	810.337,29	24.091,53	0,00	887.042,58	52.613,76	6,32%	6,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	853.308,12	0,00	897.034,92	0,00	43.726,80	5,23%	7,44%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	101.650,07	0,00	140.299,92	3.434,87	42.084,72	-36,36%	-96,62%
PRASS II FIDC SÊNIOR	1.589.920,94	0,00	1.631.297,29	0,00	41.376,35	2,60%	8,68%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	252.269,15	0,00	0,00	269.227,24	16.958,09	6,72%	6,72%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	78.715,09	0,00	78.421,73	1.965,49	1.672,13	6,13%	-97,50%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	634.940,62	0,00	0,00	616.707,38	-18.233,24	-2,87%	-2,87%
Total Renda Fixa					16.988.432,89	7,90%	

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	2.000.000,00	0,00	2.368.065,02	368.065,02	18,40%	26,08%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	0,00	3.000.000,00	0,00	3.227.694,60	227.694,60	7,59%	-
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	1.108.808,94	0,00	0,00	1.268.789,76	159.980,82	14,43%	14,43%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	1.062.687,02	0,00	0,00	1.190.069,63	127.382,61	11,99%	11,99%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	2.366.036,80	0,00	0,00	2.484.558,27	118.521,47	5,01%	5,01%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1.214.402,60	0,00	0,00	1.315.769,48	101.366,88	8,35%	8,35%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.096.082,69	0,00	0,00	1.196.161,17	100.078,48	9,13%	9,13%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.070.000,00	0,00	85.700,00	1.009.360,00	25.060,00	2,52%	-5,67%
ÁTICO FLORESTAL MULTIELABRATÉGIA FIP	1.243.173,62	0,00	0,00	1.233.706,66	-9.466,96	-0,76%	-
Total Renda Variável					1.218.682,92	9,29%	