

Western Asset		WA FI Ações BDR Nível I - CNPJ: 19.831.126/0001-36	D+1	D+5	-	0,00%	0,00%	S&P500	1	0,0%	Renda variável	0,0%	0,0%	0,0%	15% do PL do Fundo	
Fundo de Índices ETF Referenciado - Art. 8º, Inciso I, Alínea "B"					-	0,00%										
Fundo de Ações Abertos - Art. 8º, Inciso II, Alínea "A"					145.034.680,67	12,28%										
34	ITAÚ	FIA Ações Dividendos -02.887.290/0001-62	D+1	D+4	10.941.609,50	0,93%	0,96%	do IBOV	240.330.785	4,55%	Renda variável	12,3%	20%	15%	Art. 8º, Inciso II, Alínea "A" 15% do PL do Fundo	
	ITAÚ	Instit Ações Phoenix FIA -23.731.629/0001-07	D+21	D+24	45.203.786,13	3,83%	3,67%	do IBOV	1.408.001.737	3,21%						
	ITAÚ FFINPREV	Instit Ações Phoenix FIA -23.731.629/0001-07	D+21	D+24	10.437.557,78	0,88%	3,67%	do IBOV	1.408.001.737	0,74%						
	ARX Investimentos ²⁾	ARX Income FI Ações-Divid - 03.168.062/0001-03	D+1	D+4	26.230.727,95	2,22%	-0,20%	do IBOV	306.671.004	8,55%						
	AZQUEST	FIC FIA Small Cap - 11.392.165/0001-72	D+27	D+28	23.897.971,97	2,02%	4,70%	do IBOV	767.259.119	3,11%						
	AZQUEST	FIC FIA Ações - 07.279.657/0001-89	D+1	D+4	3.026.244,51	0,26%	-0,03%	do IBOV	760.961.578	0,40%						
	AZQUEST FFINPREV	FIC FIA Small Cap - 11.392.165/0001-72	D+27	D+28	8.335.148,17	0,71%	4,70%	do SMLL	767.259.119	1,1%						
	AZQUEST FFINPREV	FIC FIA AÇÕES - 07.279.657/0001-89	D+1	D+4	4.374.792,91	0,37%	-0,03%	do IBOV	760.961.578	0,6%						
35	CEF/Vinci Partner's	FIC Valor Dividendos CNPJ 15.154.441/0001-15	D+30	D+33	7.559.044,47	0,64%	3,23%	do IDIV	449.315.909	1,68%						
36	XP Investimentos FFPREV	XP Dividendos FIA - 16.575.255/0001-12	D+1	D+4	5.027.797,28	0,43%	3,55%	do IDIV	295.047.276	1,70%						
Fundo de Índices ETF Abertosd - Art. 8º, Inciso II, Alínea "B"					0,00	Renda Variável 0,0% 20% 0%										
Fundos Multimercados - Art. 8º, Inciso III					26.769.027,10	2,27%										
	AZQUEST	AZQuest Equity Hedge FIM CNPJ 09.141.893/0001	D+4	D+5	5.064.416,54	0,43%	0,89%	CDI	198.954.543	2,55%						
	Mongeral Aegon	Mongeral Aegon FIM CNPJ 14.115.116/000180	D+1	D+1	4.877.387,02	58,52%	0,53%	CDI	143.226.244	3,41%						
39	Western Asset	WA US Index 500 CNPJ 17.453.850/0001-48	D+0	D+1	13.562.478,66	1,15%	-8,07%	CDI	897.727.916	1,5%	Renda Variável	1,4%	10%	5%	Artigo 8º, Inciso III 5% do PL do Fundo	
	Western Asset FFINPREV	WA US Index 500 CNPJ 17.453.850/0001-48	D+0	D+1	3.264.744,88	0,28%	-8,07%	CDI	897.727.916	0,4%						
Fundo de Participações - FIP - Art. 8º, Inciso IV, Alínea "A"					13.774.741,43	1,17%										
	Kinea	FIP CNPJ 16.437.148/0001-28	Fechado	Fechado	10.382.153,22	0,88%	-2,97%	IPCA	73.670.452	14,09%	FIP	1,2%	5%	3%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea "A" 5% do PL do Fundo	
	Kinea IV Feeder	FIP CNPJ 27.782.774/0001-78	Fechado	Fechado	624.976,47	0,05%	-4,15%	IPCA	24.920.937	2,51%						
	Kinea IV Feeder FFINPREV	FIP CNPJ 27.782.774/0001-78	Fechado	Fechado	937.464,71	0,08%	-4,15%	IPCA	24.920.937	3,76%						
	BRZ Brasil Portos	FIP CNPJ 14.737.553/0001-36	Fechado	Fechado	399.765,93	0,03%	-0,14%	IPCA	187.727.766	0,21%						
	BTG Pactual	FIP Infraestr II CNPJ 14.584.094/0001-06	Fechado	Fechado	1.430.381,10	0,12%	-0,16%	IPCA	357.684.688	0,40%						
Fundo Imobiliário FII - Art. 8º, Inciso IV, Alínea "B"					15.514.542,06	1,31%										
41	Reag Renda Imob DOMC11	REAG FII - 17.374.696/0001-19(10.000 quotas)	Fechado	Fechado	5.820.000,00	0,49%	4,86%	240.500	do CDI	142.229.160	4,09%	Imobiliário	1,3%	5%	3%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea "B" 5% do PL do Fundo
42	RB Capital RBRD11	FII Renda II - 09.006.914/0001-34 (107.933 quotas)	Fechado	Fechado	9.694.542,06	0,82%	3,56%	1.851.786	do CDI	166.327.419	5,83%					
Disponibilidade de Caixa					5.263,98	0,00%	17,48 100%									
46	Disponibilidade em Caixa FFIN1				4.812,49	0,00%	0,00%				Disponibilidade	0,00%				
	Disponibilidade em Caixa Honorário Sucumbência (BB)				-	0,00%	0,00%									
47	Disponibilidade em Caixa FFIN2(BB+Santander+Itaú+CEF)				451,49	0,96%	0,00%									
	Disponibilidade em Caixa FFPREV				-	0,00%	0,00%									
TOTAL DE ATIVOS					1.180.983.473,32	100,00%										

Meta Atuarial(INPC (+)0,14 + 0,486755)	0,60%	IBOVESPA	-1,81%	IFIX	2,22%	IRF-M	1,53%	Consolidado -Ano	12,40%
Rentabilidade no mês SBCPREV Consolidado	1,42%	IBrX	-1,29%	IMA-B	1,65%	IRFM 1	0,56%	Meta Atuarial - Ano	9,59%
INPC	0,14%	IBrX50	-2,11%	IMA-G	1,17%	IRFM 1+	1,92%	Consolidado - 12 me	12,40%
CDI	0,49%	SMLL	2,10%	IMA-B 5	1,36%	IMA-C	0,77%	Meta Atuarial - 12 Me	9,59%
IPCA	0,15%	IDIV	0,65%	IMA-B 5+	1,88%	IMA-S	0,49%		325.484.154,34

Total FFIN2 + FFINPrev **1.180.983.473,32**

dez/18 Ano 12 meses

Ranking SIRU = 17 01 2019 8º/363 2º/363 2º/363

Renda Fixa	rentabilidade no mês	1,44%	974.500.135,92	82,52%	Renda Fixa	974.500.135,92	82,52%
Renda Variável	rentabilidade no mês	1,33%	206.478.073,42	17,48%	Renda Variável	206.478.073,42	17,48%
Disponibilidade Caixa		1,42%	5.263,98	0,00%	Disponibilidade de Caixa	5.263,98	0,00%
			1.180.983.473,32	100,00%	Total Geral	1.180.983.473,32	100,00%

VaR 2,32%

ANO	META	SBCPREV	DIFER	Renda Fixa	974.500.135,92	82,52%
2011	12,49	11,18	-1,19	Renda variável	206.478.073,42	17,48%
2012	12,7	22,41	+9,71		5.263,98	0,00%
2013	12,03	-6,03	-18,06		1.180.983.473,32	100,00%
2014	12,75	10,45	-2,30	CONSOLIDADO EM Dezembro 2018		
2015	17,81	9,54	-8,27	RENTA FIXA	974.500.135,92	82,52% Lim Resol Pol Inv
2016	12,97	20,00	+7,03	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "A" (TP Federal)	230.686.576,40	19,53% 100,00% 0
2017	8,11	15,30	+7,19	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "B" (Fundos TP)	482.269.746,78	40,84% 100,00% 1
				Art. 7º, Inciso I, Alínea C (Índice ETF)	0,00	0,00% 100,00% 0
				Art. 7º, Inciso II (Op.Compromissadas)	0,00	0,00% 5,00% 0
				Artigo 7º, Inciso III "A" (Fundos Referenciados)	23.431.227,40	1,98% 60,00% 0
				Art. 7º, Inciso III, Alínea "B" (Índices ETF Referenciados)	0,00	0,00% 60,00% 0
				Artigo 7º, Inciso IV "A" (Fundos RF abertos)	230.650.813,05	19,53% 40,00% 0
				Art. 7º, Inciso IV, Alínea "B" (Índices ETF abertos)	0,00	0,00% 40,00% 0
				Art. 7º, Inciso V, Alínea "B" (Letras Imobiliárias Garantidas)	0,00	0,00% 20,00% 0
				Art. 7º, Inciso VI, Alínea "A" (CDB)	0,00	0,00% 15,00% 0

Art. 7º, Inciso VI, Alínea "B" (poupança)	0,00	0,00%	15,00%	0
Art. 7º, Inciso VII, Alínea "A" (FIDC cotas Sênior)	7.461.772,29	0,63%	5,00%	0
Art. 7º, Inciso VII, Alínea "B" (Fundos Crédito Privado)	0,00	0,00%	5,00%	0
Art. 7º, Inciso VII, Alínea "C" (Fundos Debêntures InfraEstrutura)	0,00	0,00%	5,00%	0
RENDA VARIÁVEL	206.478.073,42	17,48%		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea "A" (FIA abertos índices)	5.385.082,16	0,46%	30,00%	0
Art. 8º, Inciso I, Alínea "B" (Fundos ETF índices)	0,00	0,00%	30,00%	0
Art. 8º, Inciso II, Alínea "A" (FIA aberto carteira livre)	145.034.680,67	12,28%	20,00%	0
Artigo 8º, Inciso II, Alínea "B" (Fundos ETF carteira livre)	0,00	0,00%	20,00%	0
Artigo 8º, Inciso III (Fundos Multimercado)	26.769.027,10	2,27%	10,00%	0
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea "A" (FIP fechado)	13.774.741,43	1,17%	5,00%	0
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea "B" (FI Imobiliário)	15.514.542,06	1,31%	5,00%	0
Disponibilidade de Caixa	5.263,98	0,00%		

Títulos Públicos	230.686.576,40	19,53%
CEFederal	236.286.547,85	20,01%
Santander	158.344.773,21	13,41%
Banco do Brasil	143.420.057,64	12,14%
Itaú	116.442.403,63	9,86%
Bradesco	104.546.838,01	8,85%
AZQuest	61.509.920,60	5,21%
Western	21.925.836,34	1,86%
ARX Investimentos	26.230.727,95	2,22%
Safra	13.890.308,16	1,18%
Kinea/Itaú	11.944.594,40	1,01%
Icatu Vanguard	12.785.590,38	1,08%
RBCapital	9.694.542,06	0,82%
Vinci Partner's/CEF	7.559.044,47	0,64%
Ourinvest	7.405.748,43	0,63%
Mongeral Aegon	4.877.387,02	0,41%
Reag	5.820.000,00	0,49%
XP Investimentos	5.027.797,28	0,43%
BTG	1.430.381,10	0,12%
BRZ	399.765,93	0,03%
TrendBank	28.314,58	0,00%
BVA	27.709,28	0,00%
Saldo Caixa	5.263,98	0,00%

1.180.290.128,70	99,94%
-------------------------	---------------

Títulos Públicos	19,53%	230.686.576,40	23,69%	
IMA-B	12,47%	147.279.703,11	15,12%	
IMA-B5	29,09%	343.518.182,69	35,28%	
Alocação Dinâmica	3,14%	37.050.458,08	3,80%	
IRF-M	15,44%	182.288.081,31	18,72%	
DI + Outros R Fixa	2,16%	25.522.017,42	2,62%	
FIDC	0,63%	7.461.772,29	0,77%	
	81,83%	973.806.791,30	100,00%	0,83

