

26	BVA	Multisetorial Master II - 11.989.256/0001-90	Fechado	Fechado	19.037,46	0,00%	-30,67%		do CDI	444.208	4,29%	Renda Fixa	0,6%	5%	2%	5%	20%	Art. 1º, inciso VII, Alínea "A" 5% do PL cota sênior	
27	Trend Bank	Senior Multisetorial - 08.927.488/0001-09	Fechado	Fechado	14.749,98	0,00%	-13,50%		do CDI	296.479	4,98%	Renda Fixa	0,0%	5%	0%	5%	20%	Art. 7º, inciso VII, Alínea "B" 5% do PL do FI	
Fundos Renda Fixa Crédito Privado - Art. 7º, inciso VII, Alínea "B"												Renda Fixa	0,0%	5%	0%	5%	20%		
Fundos de Debêntures de Infraestrutura - Art. 7º, inciso VII, Alínea "C"					0,00		0,00%					Renda Fixa	0,0%	5%	0%	5%	20%	Art. 7º, inciso VII, Alínea "C" 5% do PL do FI	
INVESTIMENTOS EM RENDA VARIÁVEL E ESTRUTURADOS																			
Fundo de Ações Índices com no mínimo 50 ações - Art. 8º, inciso I, Alínea "A"					6.166.556,09	0,46%					81,63								
28	ITAÚ	Itaú RPI Ações Ibov FICFI - 08.817.414/0001-10	D+2	D+5	6.166.556,09	0,46%	4,68%		do IBOV	868.670.248	0,71%	Renda Variável	0,5%	30%	15%		20%	Artigo 8º, inciso II, Alínea "A" 15% do PL do Fundo	
Fundos ETF Índices com no mínimo 50 ações - Art. 8º, inciso I, Alínea "B"					-	0,00%	0,00%					Renda Variável		30%	0%	15%	20%	Artigo 8º, inciso I, Alínea "B" 15% do PL do Fundo	
Fundo de Ações em Geral - Art. 8º, inciso II, Alínea "A"					178.245.295,45	13,21%													
34	ITAÚ	FIA Ações Dividendos -02.887.290/0001-62	D+1	D+4	12.736.926,45	0,94%	4,38%		do IBOV	340.177.208	3,74%	Renda variável	13,2%	20%	10%	15%	20%	Art. 8º, inciso I, Alínea "A" 15% do PL do Fundo	
ITAÚ	Insttit Ações Phoenix FIA -23.731.629/0001-07	D+21	D+24	52.020.887,82	3,85%	4,88%		do IBOV	1.725.892.301	3,01%									
ITAÚ FFINPREV	Insttit Ações Phoenix FIA -23.731.629/0001-07	D+21	D+24	18.121.626,14	1,34%	4,88%		do IBOV	1.622.441.071	1,12%									
ARX Investimentos ²⁾	ARX Income FI Ações-Divid - 03.168.062/0001-03	D+1	D+4	29.292.002,54	2,17%	3,81%		do IBOV	451.039.103	6,49%									
AZQUEST	FIC FIA Small Cap - 11.392.165/0001-72	D+27	D+28	26.598.766,80	1,97%	5,50%		do IBOV	970.942.755	2,74%									
AZQUEST	FIC FIA Ações - 07.279.657/0001-89	D+1	D+4	3.328.083,24	0,25%	3,39%		do IBOV	846.353.915	0,39%									
AZQUEST FFINPREV	FIC FIA Small Cap - 11.392.165/0001-72	D+27	D+28	9.277.132,92	0,69%	5,50%		do SMLL	896.607.072	1,0%									
AZQUEST FFINPREV	FIC FIA açõES - 07.279.657/0001-89	D+1	D+4	4.811.136,33	0,36%	3,39%		do IBOV	846.353.915	0,6%									
35	CEF/Vinci Partner's	FIC Valor Dividendos CNPJ 15.154.441/0001-15	D+30	D+33	9.149.918,02	0,68%	5,82%		do IDIV	654.515.197	1,40%								
36	XP Investimentos FFPREV	XP Dividendos FIA - 16.575.255/0001-12	D+1	D+4	6.231.516,68	0,46%	4,61%		do IDIV	329.404.985	1,89%								
ICATU FFINPREV	icatu Vang Dividendos FIA 08.279.304/0001-41	D+1	D+5	6.677.298,51	0,49%	5,06%		do IDIV	719.117.715	0,93%									
Fundo ETF Índices em Geral - Art. 8º, inciso II, Alínea "B"											Renda Variável	0,0%	20%	0%	15%	20%	Artigo 8º, inciso II, Alínea "B" 15% do PL do Fundo		
Fundos Multimercados - Aberto (Investimentos Estruturados) Art. 8º, inciso III					30.223.371,05	2,24%													
39	AZQUEST	AZQuest Equity Hedge FIM CNPJ 09.141.893/0001-60	D+4	D+5	5.161.917,19	0,38%	1,05%		CDI	256.383.584	2,01%	Renda Variável	1,5%	10%	10%	5%	20%	Artigo 8º, inciso III do PL do Fundo	
	Mongeral Aegon	Mongeral Aegon FIM CNPJ 14.115.116/000180	D+1	D+1	5.051.137,99	54,45%	0,58%		CDI	156.296.185	3,23%								
	Western Asset	WA US Index 500 CNPJ 17.453.850/0001-48	D+0	D+1	16.128.001,23	1,20%	7,12%		CDI	790.728.906	2,0%								
	Western Asset FFINPREV	WA US Index 500 CNPJ 17.453.850/0001-48	D+0	D+1	3.882.314,64	0,29%	7,12%		CDI	763.457.082	0,5%								
Fundo de Participações - FIP - (Investimentos Estruturados) Art. 8º, inciso IV, Alínea "A"					16.988.838,16	1,26%													
	Kinea	FIP CNPJ 16.437.148/0001-28	Fechado	Fechado	8.206.965,34	0,61%	-0,05%		IPCA	58.235.593	14,09%	FIP	1,3%	5%	5%	5%	20%	Artigo 8º, inciso IV, Alínea "A" 5% do PL do Fundo	
	Kinea IV Feeder	FIP CNPJ 27.782.774/0001-78	Fechado	Fechado	2.716.284,87	0,20%	-0,50%		IPCA	108.311.859	2,51%								
	Kinea IV Feeder FFINPREV	FIP CNPJ 27.782.774/0001-78	Fechado	Fechado	4.074.427,31	0,30%	-0,50%		IPCA	108.311.859	3,76%								
	Vinci Cap Partners	FIP Multiesratégia II CNPJ 30.507.217/0001-53	Fechado	Fechado	0,00	0,00%	0,00%		IPCA	0	#DIV/0!								
	Vinci Cap Partners FFPREV	FIP Multiesratégia II CNPJ 30.507.217/0001-53	Fechado	Fechado	0,00	0,00%	0,00%		IPCA	0	#DIV/0!								
	BRZ Brasil Portos	FIP CNPJ 14.737.553/0001-36	Fechado	Fechado	380.744,41	0,03%	-0,14%		IPCA	173.179.941	0,22%								
	BTG Pactual	FIP Infraestr II CNPJ 14.584.094/0001-06	Fechado	Fechado	1.610.416,23	0,12%	-0,12%		IPCA	406.888.955	0,40%								
Fundo Imobiliário FI - Art. 8º, inciso IV, Alínea "B"					15.409.042,48	1,14%													
41	Reag Renda Imob DOMC11	REAG FI - 17.374.696/0001-19 (10.000 quotas)	Fechado	Fechado	4.555.300,00	0,34%	-0,29%	240.500	do CDI	111.322.421	4,09%	Imobiliário	1,1%	5%	3%	5%	20%	Artigo 8º, inciso IV, Alínea "B" 5% do PL do Fundo	
42	RB Capital RBRD11	FI Renda II - 09.006.914/0001-34 (107.933 quotas)	Fechado	Fechado	10.853.742,48	0,80%	2,14%	1.851.786	do CDI	182.308.332	5,95%								
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR																			
Fundo de Renda Fixa - Dívida Externa (Investimentos no Exterior) - Art. 9º-A, inciso I					-		0,00%					Exterior	0%	10%	0%	15%	20%	Art. 9º-A, inciso I	
Investimento no Exterior (Investimentos no Exterior) - Art. 9º-A, inciso II					-		0,00%					Exterior	0%	10%	0%	15%	20%	Art. 9º-A, inciso II	
Fundo de Ações - BDR-Nível 1 (Investimentos no Exterior) - Art. 9º-A, inciso III					-		0,00%					Exterior	0%	10%	0%	15%	20%	Art. 9º-A, inciso III	
Disponibilidade de Caixa																			
Disponibilidade de Caixa					838.968,35	0,06%					18,30	100%							
46	Disponibilidade em Caixa FFIN1				107.379,77	0,01%	0,00%					Disponibilidade	0,06%						
Disponibilidade em Caixa Honorário Sucumbência (BB)					1.811,12	0,00%	0,00%												
Disponibilidade - Saldo Consignados CEF					-	0,00%	0,00%												
47	Disponibilidade em Caixa FFIN2(BB+Santander+Itaú+CEF)				729.777,46	0,05%	0,00%												
Disponibilidade em Caixa FFPREV					-	0,00%	0,00%												
TOTAL DE ATIVOS					1.349.607.110,00	100,00%													
Meta Atuarial(INPC (+10,01 + 0,486755)					0,50%		IBOVESPA	4,06%		IFIX	2,88%	IRF-M	2,16%	Consolidado - Ano				10,79%	
Rentabilidade no mês SBCPREV Consolidado					3,02%		IBRX	4,10%		IMA-B	3,73%	IRFM 1	0,58%	Meta Atuarial - Ano				5,48%	
INPC					0,01%		IBRX50	4,12%		IMA-G	2,00%	IRFM 1+	4,22%	Consolidado - 12 meses				21,54%	
CDI					0,47%		SMLL	6,99%		IMA-B 5	1,72%	IMA-C	3,84%	Meta Atuarial - 12 Meses				9,50%	
IPCA					0,01%		IDIV	3,11%		IMA-B 5+	5,06%	IMA-S	0,47%					388.296.441,21	
																	961.310.668,79		
Total FFIN2 + FFINPREV					1.349.607.110,00													1.349.607.110,00	
dez/18 Ano					12 meses														
Ranking SIRU = 17 01 2019																			
Consolidado																			
Renda Fixa	rentabilidade no mês	2,78%	1.101.735.038,42	81,63%	Renda Fixa	1.101.735.038	81,63%												
Renda Variável	rentabilidade no mês	4,18%	247.033.103,23	18,30%	Renda Variável	247.033.103	18,30%												
Disponibilidade Caixa		3,02%	838.968,35	0,06%	Disponibilidade de Caixa	838.968	0,06%												
			1.349.607.110,00	100,00%	Total Geral	1.349.607.110	100,00%												

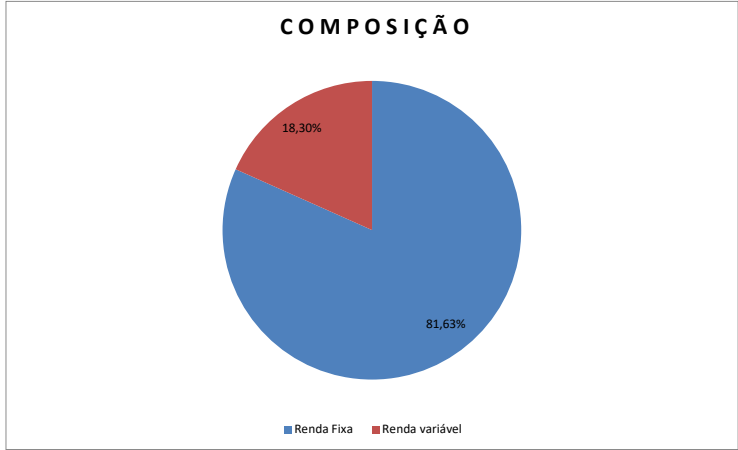
VaR 3,32%

ANO	META	SBCPREV	DIFER
2011	12,49	11,18	-1,19
2012	12,7	22,41	+9,71
2013	12,03	-6,03	-18,06
2014	12,75	10,45	-2,30
2015	17,81	9,54	-8,27
2016	12,97	20,00	+7,03
2017	8,11	15,30	+7,19
2018	9,58	12,39	+2,81

Renda Fixa	1.101.735.038,42	81,63%
Renda variável	247.033.103,23	18,30%
	838.968,35	0,06%
	1.349.607.110,00	100,00%

CONSOLIDADO Janeiro 2019

	1.349.607.110,00	100,00%	100,00%	100,00%
RENDA FIXA	1.101.735.038,42	81,63%	100,00%	Pol Inv
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "A" (TP Federal)	219.637.278,13	16,27%	100,00%	0
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "B" (Fundos TP)	572.585.076,62	42,43%	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)	27.284.088,14	2,02%	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)	274.519.678,69	20,34%	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)	7.708.916,84	0,57%	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 E ESTRUTURADOS	247.033.103,23	18,30%	50,00%	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea "A" (FIA abertos índices)	6.166.556,09	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)	178.245.295,45	13,21%	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)	30.223.371,05	2,24%	10,00%	0
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea "A" (FIP fechado)	16.988.838,16	1,26%	5,00%	0
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea "B" (FI Imobiliário)	15.409.042,48	1,14%	5,00%	0
Art. 8º, Inciso IV, Alínea "C" - FAções - Mercado de Acesso	-	0,00%	5,00%	0
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	0,00	0,00%	10,00%	
Fundo de Renda Fixa - Dívida Externa - Art. 9º-A, Inciso I		0,00%	10,00%	
Investimento no Exterior- Art. 9º-A, Inciso II		0,00%	10,00%	
Fundo deAções -BDR-Nível 1 - Art. 9º-A, Inciso III		0,00%	10,00%	
Disponibilidade de Caixa	838.968,35	0,06%	0,00%	



Títulos Públicos	219.637.278,13	16,27%
CEFederal	260.921.752,11	19,33%
Santander	207.435.678,53	15,37%
Banco do Brasil	150.814.816,22	11,17%
Itaú	145.498.219,88	10,78%
Bradesco	126.908.156,58	9,40%
AZQuest	58.606.336,10	4,34%
Western	25.588.659,57	1,90%
ARX Investimentos	29.292.002,54	2,17%
Safra	18.931.657,36	1,40%
Kinea/Itau	14.997.677,52	1,11%
Icatu Vanguard	30.937.549,02	2,29%
Sul América	13.656.665,44	1,01%
RBCapital	10.853.742,48	0,80%
Vinci Partner's/CEF	9.149.918,02	0,68%
Ourininvest	7.675.129,40	0,57%
Mongeral Aegon	5.051.137,99	0,37%
Reag	4.555.300,00	0,34%
XP Investimentos	6.231.516,68	0,46%
BTG	1.610.416,23	0,12%
BRZ	380.744,41	0,03%
TrendBank	14.749,98	0,00%
BVA	19.037,46	0,00%
Vinci Partner's/CEF	0,00	0,00%
Saldo Caixa	838.968,35	0,06%
	1.349.607.110,00	100,00%

	% do total		% da Rfixa
Títulos Públicos	16,27%	219.637.278,13	19,94%
IMA-B	15,71%	212.007.352,33	19,24%
IMA-BS	27,15%	366.422.893,28	33,26%
IMA-BS - ATIVO	0,41%	5.578.343,70	0,51%
Alocação Dinâmica	5,58%	75.366.537,23	6,84%
IRF-M	14,52%	196.020.616,63	17,79%

DI + Outros R Fixa	1,41%	18.993.100,28	1,72%	
FIDC	0,57%	7.708.916,84	0,70%	
	0,00%		0,00%	
	81,63%	1.101.735.038,42	100,00%	0,82