

Organizador: André Kamizono (Analista de Investimento)
Silvina Kelly (Analista de Investimento)

Colaborador: Camila Brito (Analista de Investimento)
Wilson Ribeiro (Analista de Investimento)

Revisão 0: Data de Elaboração: **21/01/2019**

Setor: Núcleo Gestor de Investimento

Período: Dezembro 2018

Base: **dezembro/2016 a dezembro/2018**

Para atendimento a Política de Investimento 2018, segue o relatório mensal, com o estudo Técnico da análise de risco e retorno dos fundos de investimentos enquadrados na resolução nº 3.922/10 (Com alteração res. 4.392/14).

Conforme definido na Política de Investimento 2018, Segue o ranking das Gestoras, conforme relatório ANBIMA (Novembro/2018).

Recebi neste Gabinete do IGEPREV	
Data:	22/01/19
Por:	Rita

1. Para Renda Fixa e Renda variável

ANBIMA » Fundos de Investimento Rankings		
Ranking de Gestão de Fundos de Investimento		
Ordem	Instituições Financeiras e Assets - R\$ milhões	Nov/18
Gestor		Total
1	BB DTVM S.A	933.421,58
2	ITAU UNIBANCO SA	662.334,35
3	BRADESCO	610.329,25
4	CAIXA	327.497,51
5	BANCO SANTANDER (BRASIL) SA	255.737,51
6	J SAFRA ASSET MANAGEMENT	95.950,63
7	BTG PACTUAL	92.997,34
8	CREDIT SUISSE	76.810,31
9	BRL DTVM	54.323,19
10	BW GESTAO DE INVESTIMENTO LTDA	47.517,81
11	KINEA INVESTIMENTO LTDA	46.673,03
12	OPPORTUNITY ASSET ADM	45.820,55
13	VOTORANTIM ASSET	44.044,97
14	BNP PARIBAS	43.540,28
15	WESTERN ASSET	37.569,83
16	SPX	37.057,71
17	SICREDI	31.419,31
18	VERDE ASSET MANAGEMENT S.A.	30.322,11
19	ADAMCAPITAL GESTAO DE RECURSOS	29.313,87
20	OLIVEIRA TRUST DTVM	27.834,81
21	SUL AMERICA INVESTIMENTOS DTVM	27.504,45
22	XP GESTAO DE RECURSOS	26.944,83
23	PATRIA INVESTIMENTOS	25.944,68
24	MORGAN STANLEY	22.822,24
25	VINCI PARTNERS	20.412,12
26	LIONS TRUST	20.132,99
27	JGP GESTAO DE RECURSOS LTDA	18.977,77
28	ICATU VANGUARDA	18.863,92
29	JP MORGAN	18.320,32
30	MODAL	17.867,44
31	BAHIA ASSET MANAGEMENT	17.299,32
32	GPS PLANEJAMENTO FINANCEIRO SA	14.612,10
33	AZ QUEST INVESTIMENTOS	14.536,92
34	PRAGMA	13.642,25
35	PORTO SEGURO INVESTIMENTOS	13.614,90
36	SCHRODER BRASIL	13.164,22
37	BANRISUL	10.954,42
38	BROOKFIELD GESTAO DE ATIVOS LTDA	10.914,84
39	KAPITALO	10.196,02
40	CITIBANK	10.037,61
41	REAG INVESTIMENTOS LTDA	9.938,79
42	RELIANCE ASSET	9.457,66
43	BNY MELLON ARX INVESTIMENTOS LTDA	9.346,67
44	CA INDOSUEZ WEALTH (BRAZIL) S.A. DTVM	9.048,29
45	TRUXT INVESTIMENTOS	8.873,92
46	GAVEA INVESTIMENTOS LTDA	8.698,80
47	MAPFRE DTVM SA	8.629,65
48	O3 GESTAO DE RECURSOS LTDA	8.447,61
49	RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	8.248,62
50	FRANKLIN TEMPLETON INVESTIMENTOS BRASIL	7.479,02

Gestoras aprovadas no credenciamento

Gestoras que não deram retorno ao credenciamento

Gestoras reprovadas no credenciamento

2. Para Fundos FIDC's, Imobiliários e de Participações.

2.1– FIDC's

ANBIMA » Fundos de Investimento Rankings		
Ranking de Gestão de Fundos de Investimento		
Ordem	Instituições Financeiras e Assets - R\$ milhões	Nov/18
Gestor		FIDC
1	BB DTVM S.A	26.313,41
2	OLIVEIRA TRUST DTVM	17.596,59
3	BRADESCO	6.471,51
4	TERCON ASSET MANAGEMENT	5.724,41
5	INTEGRAL INVESTIMENTOS	4.272,31
6	PETRA ASSET GESTAO DE INVESTIMENTOS LTDA	3.250,93
7	CAIXA	2.585,44
8	JUS CAPITAL GESTAO DE RECURSOS LTDA	2.453,47
9	XP GESTAO DE RECURSOS	2.404,12
10	OURO PRETO INVESTIMENTOS	2.376,14
11	MERRILL LYNCH	2.090,76
12	ANGA ASSET MANAGEMENT	2.068,93
13	PHRONESIS INVESTIMENTOS LTDA	1.743,46
14	REDASSET GESTAO DE RECURSOS LTDA	1.584,10
15	BTG PACTUAL	1.528,34
16	VOTORANTIM ASSET	1.492,02
17	JIVE ASSET GESTAO DE RECURSOS LTDA	1.478,44
18	CA INDOSUEZ WEALTH (BRAZIL) S.A. DTVM	1.477,07
19	INX ADMINISTRAÇÃO E GESTORA DE RECURSOS	1.204,49
20	NOVA S R M	1.177,17
21	PLANNER	1.155,46
22	CAPITALYS GESTÃO LTDA	1.144,98
23	VINCI PARTNERS	843,59
24	VISION BRAZIL	825,59
25	IDEAL INVEST S.A.	824,54
26	MODAL	795,42
27	CANVAS CAPITAL S.A	752,61
28	ARTESANAL INVESTIMENTOS	720,10
29	TG CORE ASSET	647,60
30	BRL DTVM	624,70

2.2-Imobiliários

ANBIMA » Fundos de Investimento | Rankings

Ranking de Gestão de Fundos de Investimento

Instituições Financeiras e Assets - R\$ milhões		Nov/18
Ordem	Gestor	FII
1	BTG PACTUAL	13.190,99
2	VOTORANTIM ASSET	7.822,04
3	KINEA INVESTIMENTO LTDA	7.364,53
4	RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	6.764,65
5	CREDIT SUISSE	4.473,47
6	CAIXA	4.228,58
7	MODAL	2.880,47
8	OLIVEIRA TRUST DTVM	2.470,45
9	OPPORTUNITY ASSET ADM	2.263,09
10	HEDGE INVESTMENTS	1.988,98
11	XP GESTAO DE RECURSOS	1.601,04
12	BRL DTVM	1.545,57
13	BRESCO GESTAO	1.417,37
14	COINVALORES	1.210,46
15	VINCI PARTNERS	1.038,54
16	BRPP GESTAO DE PRODUTOS ESTRUTURADOS	971,18
17	REAG INVESTIMENTOS LTDA	930,90
18	J SAFRA ASSET MANAGEMENT	881,97
19	PLANNER	815,18
20	RB CAPITAL ASSET MANAGEMENT	712,79
21	CADENCE GESTORA DE RECURSOS LTDA.	674,38
22	TAG INVESTIMENTOS	659,62
23	ROMA ASSET MANAGEMENT LTDA	613,36
24	MAUA CAPITAL S.A.	565,96
25	POLO CAPITAL GEST DE RECURSOS	487,01
26	G5 ADVISORS	459,68
27	GGR INVESTIMENTOS	456,70
28	BRKB DTVM S.A.	449,27
29	BANCO SANTANDER (BRASIL) SA	427,12
30	GF GESTAO DE RECURSOS S/A	409,78

2.3- Participações

ANBIMA » Fundos de Investimento | Rankings

Ranking de Gestão de Fundos de Investimento

Instituições Financeiras e Assets - R\$ milhões		Nov/18
Ordem	Gestor	FIP
1	BRL DTVM	47.793,10
2	PATRIA INVESTIMENTOS	22.945,61
3	LIONS TRUST	20.132,99
4	VOTORANTIM ASSET	12.462,72
5	BROOKFIELD GESTAO DE ATIVOS LTDA	10.914,84
6	BANCO SANTANDER (BRASIL) SA	10.093,40
7	MODAL	8.760,46
8	REAG INVESTIMENTOS LTDA	8.516,60
9	BTG PACTUAL	8.061,67
10	VINCI PARTNERS	6.760,11
11	OLIVEIRA TRUST DTVM	5.319,01
12	LORINVEST GESTAO DE RECURSOS LTDA	4.534,71
13	OPPORTUNITY ASSET ADM	4.178,94
14	PILARESO GESTORA DE RECURSOS LTDA	3.748,63
15	HSI HEMISFERIO SUL INVESTIMENTOS S.A.	3.569,26
16	O3 GESTAO DE RECURSOS LTDA	3.357,86
17	TARPON INVESTIMENTOS	2.770,08
18	PLANNER	2.735,35
19	GAVEA INVESTIMENTOS LTDA	2.005,23
20	BRZ INVESTIMENTOS LTDA	1.866,38
21	TCG	1.816,18
22	CULTINVEST ASSET MANAGEMENT LTDA	1.514,88
23	BRPP GESTAO DE PRODUTOS ESTRUTURADOS	1.499,39
24	CAIXA	1.470,30
25	THE AXXON GROUP PRIVATE EQUITY ASS LTDA	1.432,99
26	OMEGA GESTORA DE RECURSOS LTDA.	1.257,28
27	KINEA INVESTIMENTO LTDA	1.217,46
28	VL GESTORA DE RECURSOS LTDA	1.183,24
29	VALORA GESTAO DE INVESTIMENTOS LTDA	1.164,77
30	GF GESTAO DE RECURSOS S/A	1.016,99

ANÁLISE DE RISCO E RETORNO

Para a adequação à resolução nº 4.392/14 foram analisados grupos de fundos de investimentos enquadrados na resolução 4.392/14 classificados por benchmark.

1) FUNDOS DE INVESTIMENTO DE RENDA FIXA E RENDA VARIÁVEL, COM EXCEÇÃO DOS FIPS.

O NUGIN realizou a análise de risco e retorno considerando o período de 24 meses, ou seja, dezembro de 2016 a dezembro de 2018, os indicadores de risco x retorno utilizados nas análises dos fundos foram:

CRITÉRIOS PARA FUNDOS DE INVESTIMENTOS RENDA FIXA E VARIÁVEL (EXCETO FUNDOS ESTRUTURADOS)							
Indicadores	Excesso de retorno	Volatilidade	Sharp Generalizado	Alfa	Tracking Error	Treynor	Beta
CATEGORIA DE FUNDOS	CDI	CDI					
	Inflação + IMAG Ativo	Inflação + IMAG Ativo	Inflação + IMAG Ativo				Inflação + IMAG Ativo
	Inflação + IMAG Passivo	Inflação + IMAG Passivo	Inflação + IMAG Passivo		Inflação + IMAG Passivo		Inflação + IMAG Passivo
	Juros Pré	Juros Pré	Juros Pré		Juros Pré		Juros Pré
	CDI Multimercado	CDI Multimercado	CDI Multimercado	CDI Multimercado			
	Indices bovespa Ações Ativo	Indices bovespa Ações Ativo	Indices bovespa Ações Ativo	Indices bovespa Ações Ativo			
	Indices bovespa Ações Passivo		Indices bovespa Ações Passivo		Indices bovespa Ações Passivo	Indices bovespa Ações Passivo	Indices bovespa Ações Passivo

Os fundos foram analisados por categorias de fundos e classificados de acordo com o seu benchmark. Classificados de acordo com o quadro abaixo:

Segmento	Categoria de Fundos	Benchmarks
Renda Fixa	CDI	CDI
	Inflação + IMA G Ativo	Indices IMA e IMA G
	Inflação + IMA G Passivo	Indices IMA e IMA G
	Juros Pré	Indices IRFM
Renda Variável	CDI Multimercado	CDI
	Indices bovespa Ações Ativo	Indices BOVESPA
	Indices bovespa Ações Indexado	Indices BOVESPA

Os fundos foram analisados e classificados de acordo com o seu benchmark, levando em consideração as estratégias de benchmark da Política de Investimento.

Após análise os fundos apresentaram os seguintes resultados:

Observação:

	Fundos que fazem parte da carteira atual FUNPREV e FINANPREV
--	---

* ↑ : Em comparação ao mês anterior o Fundo subiu de posição no Ranking.
↓ : Em comparação ao mês anterior o Fundo caiu de posição no Ranking.
= : Em comparação ao mês anterior o Fundo manteve a posição no Ranking.

a) Segmento de Renda Fixa

1) Fundos Renda Fixa – Inflação + IMAG Ativo

1.1) IMAB – ATIVO

Nome	Ranking	Número de Cotistas	PI	Evolução*
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	1	15	R\$749.452.932,37	
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	2	8	R\$136.584.316,08	=
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	3	22	R\$287.256.744,58	=
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4	79	R\$1.220.981.481,89	
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	5	2.002	R\$129.604.988,20	=
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	6	265	R\$1.982.330.259,99	=

Fonte: Quantum Axis.

1.2) IMAB 5 – ATIVO

Nome	Ranking	Número de Cotistas	PI
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	1	21	R\$300.631.188,10
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	2	81	R\$556.904.316,48

Fonte: Quantum Axis.

1.3) IMAB 5+ – ATIVO

Nome	Ranking	Número de Cotistas	PI
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	1	31	R\$183.844.013,91

Fonte: Quantum Axis.

1.4) IMA GERAL

Nome	Ranking	Número de Cotistas	PI
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	1	49	R\$769.535.094,75
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2	171	R\$1.121.031.482,25
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3	101	R\$477.160.264,43

Fonte: Quantum Axis.

2) Fundos Renda Fixa – Inflação + IMA G Passivo

2.1) IMAB PASSIVO

Nome	Ranking	Número de Cotistas	PI	Evolução*
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1	189	R\$941.547.891,34	
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2	508	R\$3.870.963.791,60	
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3	643	R\$3.494.713.719,64	
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	4	86	R\$593.283.378,13	=

Fonte: Quantum Axis.

2.2) IMAB 5 PASSIVO

Nome	Ranking	Número de Cotistas	PI	Evolução*
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1	395	R\$3.128.030.529,16	=
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2	724	R\$11.498.930.142,73	=
ITÁU INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	3	75	R\$1.197.433.455,24	=

Fonte: Quantum Axis.

2.3) IMAB 5+ PASSIVO

Nome	Ranking	Número de Cotistas	PI	Evolução*
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1	197	R\$1.231.561.219,42	
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2	200	R\$946.928.584,30	=

Fonte: Quantum Axis.

2.4) IDKA 2 PASSIVO

Nome	Ranking	Número de Cotistas	PI	Evolução*
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1	69	R\$310.290.850,63	
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2	758	R\$6.854.500.353,12	↑
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3	732	R\$7.593.758.539,71	↓

Fonte: Quantum Axis.

2.5) IDKA 20 PASSIVO

Nome	Ranking	Número de Cotistas	PI
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1	13	R\$4.724.150,91

Fonte: Quantum Axis.

Fundos Renda Fixa – Juros Pré

3.1) IRFM

Nome	Ranking	Número de Cotistas	PI	Evolução*
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1	350	R\$2.378.694.859,16	=
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2	658	R\$5.181.846.911,71	=
ITÁU PRÉ FIXADO FIC RENDA FIXA LP	3	210	R\$182.474.141,22	

Fonte: Quantum Axis.

3.2) IRFM1

Nome	Ranking	Número de Cotistas	PI
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	1	15	R\$384.295.740,83
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2	306	R\$1.648.661.981,09
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3	1.477	R\$18.338.157.565,12
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4	1.266	R\$12.032.640.161,24

Fonte: Quantum Axis.

3.3) IRFM1+

Nome	Ranking	Número de Cotistas	PI	Evolução*
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1	210	R\$1.727.220.474,01	=

Fonte: Quantum Axis.

4) Fundos Renda Fixa – CDI

4.1) Fundos Referenciados – CDI

Nome	Ranking	Número de Cotistas	PI	Evolução*
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	1	1.238	R\$1.528.650.474,30	=
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2	425	R\$7.300.537.475,50	=
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	3	803	R\$4.810.359.689,92	=
BNP PARIBAS TARGUS FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	4	1.672	R\$836.570.998,60	
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	5	58	R\$187.598.156,96	
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	6	827	R\$6.777.682.965,68	
SAFRA INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7	4	R\$42.146.133,37	
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	8	336	R\$6.818.674.974,42	
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	9	840	R\$1.015.958.698,04	
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10	425	R\$2.386.354.167,00	=
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	11	12	R\$1.571.812.912,55	
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12	103	R\$280.537.079,37	
CAIXA RS TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	13	125	R\$315.001.616,00	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	14	171	R\$423.354.176,52	
WESTERN ASSET FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	15	7	R\$543.194.578,14	
BNP PARIBAS SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	16	247	R\$364.206.850,77	
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	17	307	R\$658.051.553,40	
AZ QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	18	343	R\$170.763.629,72	
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	19	93	R\$173.175.096,64	
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20	663	R\$1.157.483.382,72	

Fonte: Quantum Axis.

4.2) Fundos Crédito Privado – CDI

Nome	Ranking	Número de Cotistas	PI	Evolução*
BTG PACTUAL YIELD FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	1	29.353	R\$4.516.497.893,41	=
WESTERN ASSET CRÉDITO CORPORATIVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2	1	R\$67.501.999,47	
BNP PARIBAS MATCH FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	3	3.194	R\$3.538.697.044,43	

Fonte: Quantum Axis.

b) Segmento de Renda Variável

1) Fundos Renda Variável – Índices Bovespa Ações Ativo

1.1) IBOVESPA AÇÕES

Nome	Ranking	Número de Cotistas	PI	Evolução*
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1	151	R\$1.408.001.737,07	↑
BRADESCO H VALUATION IBOVESPA FI AÇÕES	2	794	R\$73.741.488,81	↓
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	3	3.901	R\$760.961.578,10	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4	4.475	R\$878.200.709,46	=
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	5	55	R\$783.807.802,01	=
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	6	46	R\$111.750.172,27	↑
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	7	759	R\$21.058.695,22	
BRADESCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES	8	7	R\$23.376.786,15	
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	9	465	R\$41.506.217,26	
BRADESCO IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	10	1.306	R\$44.757.809,27	
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	11	16	R\$135.477.497,93	
BB ACOES ALOCACAO FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	12	47	R\$120.351.489,10	
WESTERN ASSET IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	13	2	R\$17.379.065,55	
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	14	1.167	R\$275.727.897,86	↓
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	15	3.411	R\$47.419.718,53	
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	16	3.136	R\$32.055.138,71	
CAIXA IBOVESPA FI AÇÕES	17	3.817	R\$115.501.182,00	

Fonte: Quantum Axis.

1.2) IBRX AÇÕES

Nome	Ranking	Número de Cotistas	PI
WESTERN ASSET PREV ALPHA IBRX FIC AÇÕES	1	5	R\$79.032.679,49
BNP PARIBAS ACE IBRX FIC AÇÕES	2	7	R\$69.307.427,97

Fonte: Quantum Axis.

1.3) IBRX 50

Nome	Ranking	Número de Cotistas	PI	Evolução*
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	1	92	R\$210.937.763,28	=

Fonte: Quantum Axis.

1.4) S&P

Nome	Ranking	Número de Cotistas	PI	Evolução*
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1	75	R\$426.987.939,21	=
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2	1.885	R\$400.447.742,46	

Fonte: Quantum Axis.

2) Fundos Renda Variável – Índices Bovespa Ações Indexados

2.1) IBOVESPA INDEXADOS

Nome	Ranking	Número de Cotistas	PI	Evolução*
BB FI AÇÕES	1	19.030	R\$355.256.377,91	
BB VALE FI AÇÕES	2	41.359	R\$810.577.667,77	
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	3	4.983	R\$188.251.510,21	
BB PETROBRAS FI AÇÕES	4	50.432	R\$660.165.616,92	
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	5	29.479	R\$632.020.691,49	
BB SIDERURGIA FIC AÇÕES	6	6.558	R\$44.421.443,23	
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	7	2.901	R\$36.426.423,93	
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	8	23	R\$49.655.596,70	↓
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	9	4.018	R\$35.171.430,96	
BB ENERGIA FI AÇÕES	10	5.941	R\$90.594.382,87	
BB MULTI SETORIAL QUANTITATIVO FIC AÇÕES	11	2.938	R\$28.441.381,98	
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	12	56	R\$249.766.399,94	
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES	13	4.043	R\$34.963.196,37	
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	14	3.910	R\$54.077.689,12	
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	15	6.060	R\$104.756.552,67	
BB CONSUMO FIC AÇÕES	16	2.607	R\$113.803.254,34	
BRADESCO INDEXADO IBOVESPA FIC AÇÕES	17	943	R\$24.795.788,38	
BB CIELO FI AÇÕES	18	4.359	R\$34.164.024,75	
BRADESCO H IBOVESPA FI AÇÕES	19	1.626	R\$55.766.267,84	
BB INDEXADO IBOVESPA FIC AÇÕES	20	7.576	R\$139.792.660,59	

Fonte: Quantum Axis.

2.2) IBRX INDEXADOS

Nome	Ranking	Número de Cotistas	PI
BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES	1	4.983	R\$169.540.756,00

Fonte: Quantum Axis.

2.3) ISE INDEXADOS

Nome	Ranking	Número de Cotistas	PI	Evolução*
BB AÇÕES ÍNDICE DE SUSTENTABILIDADE EMPRESARIAL JOVEM FIC AÇÕES	1	2.953	R\$9.190.225,98	=

Fonte: Quantum Axis.

2.4) IGC INDEXADOS

Nome	Ranking	Número de Cotistas	PI	Evolução*
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1	128	R\$360.081.522,68	=

Fonte: Quantum Axis.

2.5) IDIV

Nome	Ranking	Número de Cotistas	PI	Evolução*
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	1	267	R\$240.330.785,32	=
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FI AÇÕES	2	43	R\$36.579.174,68	
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	3	25.141	R\$596.882.604,10	
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	4	1.236	R\$66.224.504,95	
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	5	113	R\$449.315.909,25	↑
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	6	656	R\$51.557.706,83	
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	7	711	R\$17.798.232,12	
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	8	536	R\$39.536.300,16	

Fonte: Quantum Axis.

2.6) SMALL

Nome	Ranking	Número de Cotistas	PI	Evolução*
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1	5.276	R\$767.259.119,02	
SAFRA SMALL CAP PB FIC AÇÕES	2	206	R\$67.119.721,61	
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	3	53	R\$115.325.480,66	
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	4	3.173	R\$101.870.855,73	=
BB PIPE FIC AÇÕES	5	14	R\$20.648.213,12	
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	6	5.007	R\$81.780.758,62	

Fonte: Quantum Axis.

3) Fundos Renda Variável – CDI MULTIMERCADO.

Nome	Ranking	Número de Cotistas	PI	Evolução*
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1	1.679	R\$272.809.180,06	
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	2	23	R\$179.263.372,47	↓
BRADESCO PLUS I FI MULTIMERCADO	3	19	R\$30.583.293,81	
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	4	3.772	R\$608.839.227,81	
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	5	221	R\$544.211.344,86	↓
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	6	46	R\$366.126.986,48	↓
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	7	1.835	R\$2.020.509.293,41	
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	8	36	R\$367.342.065,53	↓
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	9	9.226	R\$897.727.915,92	↓
SAFRA CARTEIRA INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	10	4.525	R\$1.287.060.958,91	
XP LONG SHORT 60 FIC MULTIMERCADO	11	4.693	R\$395.411.760,84	
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	12	2.165	R\$536.350.556,13	

Fonte: Quantum Axis.

OBS: Embora a gestora AZ Quest tenha sido aprovada no credenciamento 2018, a mesma trabalha diretamente com a distribuidora Privatiza A.A Investimentos, a qual foi reprovada no credenciamento mencionado. Sendo assim, existe a impossibilidade de realizar qualquer tipo de contrato com a AZ Quest Investimentos Ltda.

Silvana Kelly Gomes da Silva
Silvana Kelly Gomes da Silva
Coordenadora do Núcleo de Investimento
Mat. 54193919-1

André Rijo Kamizono
André Rijo Kamizono
Analista de Investimento
CEPREV