

# Relatório Analítico dos Investimentos em dezembro, 4º Trimestre e ano de 2018



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

## Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2018)

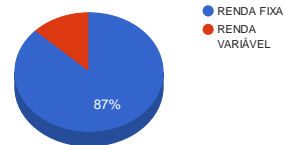
| Produto / Fundo   | Disponibilidade Resgate | Carência      | Saldo                 | Particip. S/ Total | Qtde. Cotistas | % S/ PL Fundo | RESOLUÇÃO<br>3.922 / 4.392 / 4.604  |
|---|-------------------------|---------------|-----------------------|--------------------|----------------|---------------|-------------------------------------|
| DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS                                |                         |               | 21.903,60             | 0,02%              |                |               | Artigo 20                           |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO      | D+1                     | Não há        | 1.163.508,60          | 0,86%              | 508            | 0,03%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO             | D+3                     | Não há        | 8.295.249,89          | 6,16%              | 351            | 0,21%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | D+0                     | Não há        | 24.539.186,12         | 18,23%             | 1.266          | 0,20%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | D+1                     | Não há        | 7.055.491,87          | 5,24%              | 758            | 0,10%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO    | D+0                     | 15/08/2020    | 725.819,78            | 0,54%              | 119            | 0,33%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | D+0                     | Não há        | 25.021.576,41         | 18,59%             | 1.477          | 0,14%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO         | D+0                     | 15/08/2022    | 3.705.001,51          | 2,75%              | 45             | 2,03%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO    | D+0                     | 15/08/2022    | 436.048,16            | 0,32%              | 115            | 0,09%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP      | D+0                     | Não há        | 5.046.540,40          | 3,75%              | 724            | 0,04%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0                     | Não há        | 9.872.337,98          | 7,34%              | 732            | 0,13%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP               | D+0                     | Não há        | 14.949.747,20         | 11,11%             | 827            | 0,22%         | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "  |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                      | D+0                     | Não há        | 1.509.233,92          | 1,12%              | 663            | 0,13%         | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "  |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP  | D+0                     | Não há        | 11.187.226,03         | 8,31%              | 803            | 0,23%         | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "  |
| ILLUMINATI FIDC   | D+1 ou D+1260           | 30 dias       | 3.593.283,66          | 2,67%              | 11             | 1,40%         | Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a " |
| SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO                    | D+91 ou D+1441          | Não há        | 3.725.599,42          | 2,77%              | 14             | 1,67%         | Artigo 8º, Inciso III               |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVSPA II FIC MULTIMERCADO  | D+2                     | 02/01/2020    | 2.157.064,00          | 1,60%              | 729            | 0,80%         | Artigo 8º, Inciso III               |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO   | D+2                     | 01/10/2020    | 4.021.937,22          | 2,99%              | 955            | 0,87%         | Artigo 8º, Inciso III               |
| ATICO FIC FIP FLORESTAL                                     | Não se aplica           | Não se aplica | 3.009.833,82          | 2,24%              |                |               | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "  |
| SÃO DOMINGOS FII - FISD11                                   | Não se aplica           | Não se aplica | 4.539.010,19          | 3,37%              |                | 12,15%        | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "  |
| <b>TOTAL -</b>  |                         |               | <b>134.575.599,78</b> |                    |                |               |                                     |

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

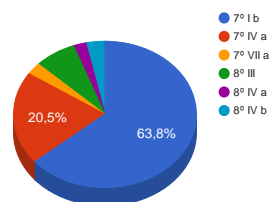
| Artigos - Renda Fixa                | Resolução % | Carteira \$           | Carteira % | Estratégia de Alocação |        |            | GAP Superior  |
|-------------------------------------|-------------|-----------------------|------------|------------------------|--------|------------|---------------|
|                                     |             |                       |            | Inferior %             | Alvo % | Superior % |               |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   | 100,00%     | 85.860.760,72         | 63,80%     | 15,00%                 | 20,00% | 70,00%     | 8.342.159,13  |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 60,00%      | 0,00                  | 0,00%      | 10,00%                 | 15,00% | 60,00%     | 80.745.359,87 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "  | 40,00%      | 27.646.207,15         | 20,54%     | 5,00%                  | 15,00% | 30,00%     | 12.726.472,78 |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "  | 15,00%      | 0,00                  | 0,00%      | 0,00%                  | 5,00%  | 10,00%     | 13.457.559,98 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a " | 5,00%       | 3.593.283,66          | 2,67%      | 2,00%                  | 5,00%  | 5,00%      | 3.135.496,33  |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b " | 5,00%       | 0,00                  | 0,00%      | 2,00%                  | 5,00%  | 5,00%      | 6.728.779,99  |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c " | 5,00%       | 0,00                  | 0,00%      | 2,00%                  | 5,00%  | 5,00%      | 6.728.779,99  |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "   | 30,00%      | 0,00                  | 0,00%      | 2,00%                  | 5,00%  | 10,00%     | 13.457.559,98 |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "  | 20,00%      | 0,00                  | 0,00%      | 2,00%                  | 5,00%  | 10,00%     | 13.457.559,98 |
| Artigo 8º, Inciso III               | 10,00%      | 9.904.600,64          | 7,36%      | 7,00%                  | 10,00% | 10,00%     | 3.552.959,34  |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "  | 5,00%       | 3.009.833,82          | 2,24%      | 2,00%                  | 5,00%  | 5,00%      | 3.718.946,17  |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "  | 5,00%       | 4.539.010,19          | 3,37%      | 2,00%                  | 5,00%  | 5,00%      | 2.189.769,80  |
| <b>Total Carteira</b>               |             | <b>134.553.696,18</b> |            |                        |        |            |               |

|                |                |        |
|----------------|----------------|--------|
| RENDA FIXA     | 117.122.155,13 | 87,04% |
| RENDA VARIÁVEL | 17.453.444,65  | 12,97% |

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 "   | 85.860.760,72         | 63,80%        | 0,00%               | 0,00%               |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "  | 27.646.207,15         | 20,54%        | 0,00%               | 0,00%               |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a " | 3.593.283,66          | 2,67%         | 0,00%               | 0,00%               |
| Artigo 8º, Inciso III               | 9.904.600,64          | 7,36%         | 0,00%               | 0,00%               |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "  | 3.009.833,82          | 2,24%         | 0,00%               | 0,00%               |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "  | 4.539.010,19          | 3,37%         | 0,00%               | 0,00%               |
| <b>Total Renda Fixa</b>             | <b>134.553.696,18</b> | <b>99,98%</b> | <b>0,00</b>         | <b>0,00</b>         |

## 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    | 61.069.203,21 | 45,38%        | 0,01%          |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 58.616.765,88 | 43,56%        | 0,00%          |
| ROMA ASSET                 | 4.539.010,19  | 3,37%         | 1,03%          |
| RJI Gestão & Investimentos | 3.725.599,42  | 2,77%         | -              |
| Queluz Gestão de Recursos  | 3.593.283,66  | 2,67%         | -              |
| ÁTICO ASSET MANAGEMENT     | 3.009.833,82  | 2,24%         | 9,17%          |

## 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 |
|---|-------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| IDKA IPCA 5 Anos  | 1,95% | 12,37% | 8,76%   | 10,44%  | 12,37%   | 28,24%   | -        | -         | -                       |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO         | 1,63% | 10,57% | 6,11%   | 8,37%   | 10,57%   | 25,77%   | 0,20%    | 0,882%    | 4,47%                   |
| IMA-B   | 1,65% | 13,06% | 9,89%   | 11,77%  | 13,06%   | 27,52%   | -        | -         | -                       |
| 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%                   |
| 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%                   |
| IMA Geral ex-C  | 1,18% | 9,80%  | 5,47%   | 7,33%   | 9,80%    | 23,95%   | -        | -         | -                       |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO             | 1,17% | 9,90%  | 5,50%   | 7,17%   | 9,90%    | 23,38%   | 0,30%    | 0,652%    | 2,77%                   |
| IPCA + 8,50% ao ano   | 0,80% | 12,49% | 2,42%   | 5,32%   | 12,49%   | 25,53%   | -        | -         | -                       |
| ILLUMINATI FIDC   | 1,52% | 5,48%  | 1,07%   | 2,46%   | 5,48%    | 14,81%   | 1,50%    | -         | -                       |
| IPCA + 6,00% ao ano   | 0,61% | 9,92%  | 1,84%   | 4,10%   | 9,92%    | 19,87%   | -        | -         | -                       |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO    | 7,80% | 24,94% | 12,15%  | 18,70%  | 24,94%   | 36,12%   | 0,20%    | 0,789%    | 4,54%                   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO    | 0,93% | 9,10%  | 2,77%   | 4,96%   | 9,10%    | 22,04%   | 0,15%    | 0,330%    | 1,46%                   |
| IRF-M 1   | 0,56% | 6,97%  | 2,03%   | 3,78%   | 6,97%    | 18,87%   | -        | -         | -                       |

## 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 |
|--|-------|-------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| 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%                   |
| 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%                   |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                     | 0,41% | 5,29% | 1,27%   | 2,60%   | 5,29%    | 14,62%   | 1,00%    | 0,004%    | 0,01%                   |
| Não definido   | -     | -     | -       | -       | -        | -        | -        | -         | -                       |

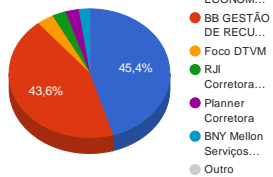
## Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (dezembro / 2018)

|   | Mês    | Ano    | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|---|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| IPCA + 6,00% ao ano   | 0,61%  | 9,92%  | 1,84%   | 4,10%   | 9,92%    | 19,87%   | -        | -         | -                       |
| SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO                    | -1,45% | -6,78% | -       | -       | -6,78%   | 2,33%    | 1,50%    | 2,202%    | -                       |
| Ibovespa  | -1,81% | 15,03% | 10,77%  | 20,79%  | 15,03%   | 45,93%   | -        | -         | -                       |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO   | 1,39%  | -      | 5,37%   | -       | -        | -        | 1,60%    | 0,663%    | -                       |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO | 0,83%  | -      | 3,29%   | 4,98%   | -        | -        | 1,60%    | 0,295%    | -                       |
| Não Informado   | -      | -      | -       | -       | -        | -        | -        | -         | -                       |
| SÃO DOMINGOS FII - FISD11                                   | 0,00%  | -      | 0,00%   | 0,00%   | -        | -        | 1,50%    | 0,000%    | 0,00%                   |
| ATICO FIC FIP FLORESTAL                                     | -      | -      | -       | -       | -        | -        | 0,10%    | -         | -                       |

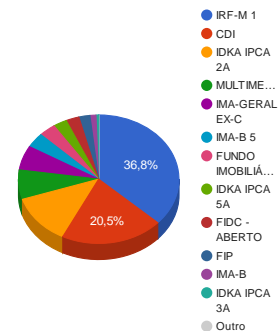


Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (dezembro / 2018)

| Administrador                   | Valor         | %      |
|---------------------------------|---------------|--------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL         | 61.069.203,21 | 45,38% |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM      | 58.616.765,88 | 43,56% |
| Foco DTVM                       | 4.539.010,19  | 3,37%  |
| RJI Corretora de Valores        | 3.725.599,42  | 2,77%  |
| Planner Corretora               | 3.593.283,66  | 2,67%  |
| BNY Mellon Serviços Financeiros | 3.009.833,82  | 2,24%  |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA      | 21.903,60     | 0,02%  |

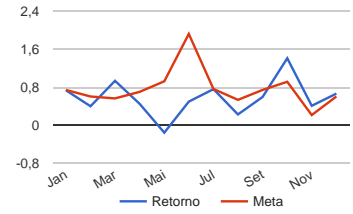
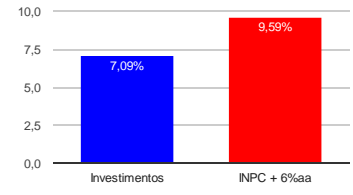


| Sub-segmento               | Valor         | %      |
|----------------------------|---------------|--------|
| IRF-M 1                    | 49.560.762,53 | 36,83% |
| CDI                        | 27.646.207,15 | 20,54% |
| IDKA IPCA 2A               | 16.927.829,85 | 12,58% |
| MULTIMERCADO               | 9.904.600,64  | 7,36%  |
| IMA-GERAL EX-C             | 8.295.249,89  | 6,16%  |
| IMA-B 5                    | 5.046.540,40  | 3,75%  |
| FUNDO IMOBILIÁRIO          | 4.539.010,19  | 3,37%  |
| IDKA IPCA 5A               | 3.705.001,51  | 2,75%  |
| FIDC - ABERTO              | 3.593.283,66  | 2,67%  |
| FIP                        | 3.009.833,82  | 2,24%  |
| IMA-B                      | 1.599.556,76  | 1,19%  |
| IDKA IPCA 3A               | 725.819,78    | 0,54%  |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA | 21.903,60     | 0,02%  |



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

**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(%) |
|---|---------------|------------|------------|-------------------------|-------------------|--------------|---------------|----------------|
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO         | 3.645.667,19  | 0,00       | 0,00       | 3.705.001,51            | 59.334,32         | 1,63%        | 0,88%         | 1,63%          |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO      | 1.145.012,10  | 0,00       | 0,00       | 1.163.508,60            | 18.496,50         | 1,62%        | 1,22%         | 1,62%          |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO    | 429.471,25    | 0,00       | 0,00       | 436.048,16              | 6.576,91          | 1,53%        | 0,79%         | 1,53%          |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP      | 4.977.925,79  | 0,00       | 0,00       | 5.046.540,40            | 68.614,61         | 1,38%        | 0,60%         | 1,38%          |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | 6.970.270,01  | 0,00       | 0,00       | 7.055.491,87            | 85.221,86         | 1,22%        | 0,42%         | 1,22%          |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO             | 8.199.368,02  | 0,00       | 0,00       | 8.295.249,89            | 95.881,87         | 1,17%        | 0,65%         | 1,17%          |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 9.759.311,58  | 0,00       | 0,00       | 9.872.337,98            | 113.026,40        | 1,16%        | 0,42%         | 1,16%          |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO    | 719.113,73    | 0,00       | 0,00       | 725.819,78              | 6.706,05          | 0,93%        | 0,33%         | 0,93%          |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | 24.886.604,08 | 0,00       | 0,00       | 25.021.576,41           | 134.972,33        | 0,54%        | 0,04%         | 0,54%          |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | 24.707.200,30 | 0,00       | 300.000,00 | 24.539.186,12           | 131.985,82        | 0,53%        | 0,04%         | 0,54%          |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP               | 14.878.184,81 | 0,00       | 0,00       | 14.949.747,20           | 71.562,39         | 0,48%        | 0,01%         | 0,48%          |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP  | 11.135.104,15 | 0,00       | 0,00       | 11.187.226,03           | 52.121,88         | 0,47%        | 0,02%         | 0,47%          |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                      | 1.080.104,43  | 528.955,17 | 104.834,72 | 1.509.233,92            | 5.009,04          | 0,31%        | 0,00%         | 0,41%          |
| ILLUMINATI FIDC   | 3.605.963,78  | 0,00       | 0,00       | 3.593.283,66            | -12.680,12        | -0,35%       | -             | -              |
|   |               |            |            | <b>Total Renda Fixa</b> | <b>836.829,86</b> | <b>0,72%</b> | <b>0,21%</b>  |                |

## 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 CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO   | 3.966.969,66  | 0,00       | 0,00     | 4.021.937,22 | 54.967,56     | 1,39%            | 0,66%         | 1,39%          |  |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO | 2.139.332,00  | 0,00       | 0,00     | 2.157.064,00 | 17.732,00     | 0,83%            | 0,30%         | 0,83%          |  |
| ATICO FIC FIP FLORESTAL                                     | 3.009.833,82  | 0,00       | 0,00     | 3.009.833,82 | 0,00          | 0,00%            | -             | -              |  |
| SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO                    | 3.725.599,42  | 0,00       | 0,00     | 3.725.599,42 | 0,00          | 0,00%            | 2,20%         | -1,45%         |  |
| SÃO DOMINGOS FII - FISD11                                   | 4.566.057,86  | 0,00       | 0,00     | 4.539.010,19 | -27.047,67    | -0,59%           | 0,00%         | 0,00%          |  |
| <b>Total Renda Variável</b>                                 |               |            |          |              |               | <b>45.651,89</b> | <b>0,26%</b>  | <b>0,80%</b>   |  |

## 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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | 24.467.975,46 | 58.672,88  | 0,00       | 25.021.576,41           | 494.928,07          | 2,02%        | 2,02%           |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | 24.351.618,46 | 0,00       | 300.000,00 | 24.539.186,12           | 487.567,66          | 2,00%        | 2,00%           |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO             | 7.862.799,52  | 0,00       | 0,00       | 8.295.249,89            | 432.450,37          | 5,50%        | 5,50%           |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 9.547.367,28  | 0,00       | 0,00       | 9.872.337,98            | 324.970,70          | 3,40%        | 3,40%           |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | 6.820.187,53  | 0,00       | 0,00       | 7.055.491,87            | 235.304,34          | 3,45%        | 3,45%           |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP      | 4.766.554,76  | 56.969,17  | 0,00       | 5.046.540,40            | 223.016,47          | 4,66%        | 4,66%           |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP               | 14.727.944,06 | 0,00       | 0,00       | 14.949.747,20           | 221.803,14          | 1,51%        | 1,51%           |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO         | 3.491.803,05  | 0,00       | 0,00       | 3.705.001,51            | 213.198,46          | 6,11%        | 6,11%           |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP  | 11.022.467,74 | 0,00       | 0,00       | 11.187.226,03           | 164.758,29          | 1,49%        | 1,49%           |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO      | 1.059.778,47  | 0,00       | 0,00       | 1.163.508,60            | 103.730,13          | 9,79%        | 9,79%           |
| ILLUMINATI FIDC   | 3.510.027,42  | 0,00       | 0,00       | 3.593.283,66            | 83.256,24           | 2,37%        | 1,07%           |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO    | 412.802,79    | 0,00       | 0,00       | 436.048,16              | 23.245,37           | 5,63%        | 12,15%          |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO    | 706.277,60    | 0,00       | 0,00       | 725.819,78              | 19.542,18           | 2,77%        | 2,77%           |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                      | 974.913,10    | 820.952,98 | 300.096,04 | 1.509.233,92            | 13.463,88           | 1,06%        | 1,27%           |
|   |               |            |            | <b>Total Renda Fixa</b> | <b>3.041.235,30</b> | <b>2,67%</b> |                 |

## 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 CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO   | 3.816.852,95  | 0,00       | 0,00     | 4.021.937,22 | 205.084,27        | 5,37%        | 5,37%           |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO | 2.088.300,00  | 0,00       | 0,00     | 2.157.064,00 | 68.764,00         | 3,29%        | 3,29%           |
| ATICO FIC FIP FLORESTAL                                     | 3.009.833,82  | 0,00       | 0,00     | 3.009.833,82 | 0,00              | 0,00%        | -               |
| SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO                    | 3.725.599,42  | 0,00       | 0,00     | 3.725.599,42 | 0,00              | 0,00%        | -               |
| SÃO DOMINGOS FII - FID11                                    | 4.588.974,35  | 0,00       | 0,00     | 4.539.010,19 | -49.964,16        | -1,09%       | 0,00%           |
| <b>Total Renda Variável</b>                                 |               |            |          |              | <b>223.884,11</b> | <b>1,30%</b> |                 |

## 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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | 21.928.293,44 | 1.558.555,52 | 0,00          | 25.021.576,41           | 1.534.727,45        | 6,79%        | 6,81%           |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | 19.879.084,67 | 3.518.476,65 | 300.000,00    | 24.539.186,12           | 1.441.624,80        | 6,72%        | 6,76%           |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP               | 14.072.931,60 | 0,00         | 0,00          | 14.949.747,20           | 876.815,60          | 6,23%        | 6,23%           |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 9.032.084,99  | 0,00         | 0,00          | 9.872.337,98            | 840.252,99          | 9,30%        | 9,30%           |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP  | 10.520.780,26 | 0,00         | 0,00          | 11.187.226,03           | 666.445,77          | 6,33%        | 6,33%           |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | 6.459.749,76  | 0,00         | 0,00          | 7.055.491,87            | 595.742,11          | 9,22%        | 9,22%           |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO             | 1.933.190,91  | 5.769.473,21 | 0,00          | 8.295.249,89            | 592.585,77          | 9,55%        | 9,90%           |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP      | 6.365.342,86  | 225.137,61   | 2.000.000,00  | 5.046.540,40            | 456.059,93          | 9,52%        | 9,67%           |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO         | 3.537.518,46  | 0,00         | 191.867,84    | 3.705.001,51            | 359.350,89          | 10,57%       | 10,57%          |
| ILLUMINATI FIDC   | 3.406.537,01  | 0,00         | 0,00          | 3.593.283,66            | 186.746,65          | 5,48%        | 5,48%           |
| CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | 3.670.500,83  | 0,00         | 3.856.317,65  | 0,00                    | 185.816,82          | 5,17%        | -               |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                      | 6.829.362,70  | 4.838.562,34 | 10.319.814,39 | 1.509.233,92            | 161.123,27          | 4,39%        | 5,29%           |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO      | 1.031.825,10  | 0,00         | 0,00          | 1.163.508,60            | 131.683,50          | 12,76%       | 12,76%          |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO    | 2.049.135,27  | 0,00         | 1.451.619,48  | 725.819,78              | 128.303,99          | 9,21%        | 9,10%           |
| CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA          | 1.319.062,00  | 0,00         | 1.411.926,42  | 0,00                    | 92.864,42           | 7,19%        | -               |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO    | 392.449,44    | 0,00         | 23.276,59     | 436.048,16              | 66.875,31           | 17,69%       | 24,94%          |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO         | 500.782,90    | 0,00         | 525.961,04    | 0,00                    | 25.178,14           | 5,14%        | 7,44%           |
|   |               |              |               | <b>Total Renda Fixa</b> | <b>8.342.197,41</b> | <b>7,55%</b> |                 |

## 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 (%) |
|---|---------------|--------------|----------|--------------|-------------------|--------------|-----------------|
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO   | 0,00          | 3.757.359,28 | 0,00     | 4.021.937,22 | 264.577,94        | 7,04%        | -               |
| SÃO DOMINGOS FII - FID11                                    | 4.346.645,25  | 0,00         | 0,00     | 4.539.010,19 | 192.364,94        | 4,43%        | -               |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO | 0,00          | 2.000.000,00 | 0,00     | 2.157.064,00 | 157.064,00        | 7,85%        | -               |
| ATICO FIC FIP FLORESTAL                                     | 3.037.079,07  | 0,00         | 0,00     | 3.009.833,82 | -27.245,25        | -0,90%       | -               |
| SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO                    | 3.786.306,32  | 0,00         | 0,00     | 3.725.599,42 | -60.706,90        | -1,60%       | -6,78%          |
| <b>Total Renda Variável</b>                                 |               |              |          |              | <b>526.054,73</b> | <b>3,52%</b> |                 |



