

Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2019



Carteira consolidada de investimentos - base (janeiro / 2019)

| 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 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 8.351.222,29 | 10,25% | 363 | 0,33% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | D+0 | Não há | 6.387.628,23 | 7,84% | 1.466 | 0,04% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | D+0 | 16/08/2020 | 1.153.885,71 | 1,42% | 107 | 0,12% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 6.441.960,01 | 7,90% | 758 | 0,08% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 7.209.201,05 | 8,84% | 738 | 0,08% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | 15/08/2022 | 779.913,55 | 0,96% | 95 | 0,16% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | Não há | 97.936,10 | 0,12% | 1.263 | 0,00% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | D+0 | 16/08/2030 | 1.370.871,00 | 1,68% | 34 | 0,65% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+1 | Não há | 74.900,24 | 0,09% | 780 | 0,00% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+1 | Não há | 698.657,82 | 0,86% | 525 | 0,02% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | 15/08/2022 | 1.479.788,56 | 1,82% | 115 | 0,30% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 222.067,51 | 0,27% | 702 | 0,00% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | D+0 | 15/08/2024 | 1.206.116,95 | 1,48% | 73 | 0,09% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1 | D+1 | Não há | 231.852,90 | 0,28% | 70 | 0,12% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP | D+0 | Não há | 1.043.760,28 | 1,28% | 272 | 0,05% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA | D+0 | Não possui | 13.359.609,74 | 16,39% | 362 | 0,37% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | D+0 | Não há | 1.007.006,21 | 1,24% | 823 | 0,01% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP | D+0 | Não há | 3.154.283,32 | 3,87% | 793 | 0,07% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA | D+0 | Não há | 2.149.669,85 | 2,64% | 58 | 0,85% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | D+0 | Não há | 1.158.484,25 | 1,42% | 419 | 0,02% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA | D+5 | Não há | 3.012.821,34 | 3,70% | 201 | 0,11% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO | D+30 ou D+30 a D+2880 | Não há | 1.094.278,05 | 1,34% | 74 | 0,20% | Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b " |

Carteira consolidada de investimentos - base (janeiro / 2019)

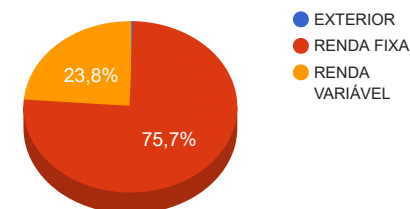
| Produto / Fundo | Disponibilidade Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Qtde. Cotistas | % S/ PL Fundo | RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604 |
|---|-------------------------|----------------|----------------------|--------------------|----------------|---------------|------------------------------------|
| ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES | D+4 | Não há | 1.705.045,88 | 2,09% | 6 | 2,59% | Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a " |
| CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES | D+4 | Não há | 1.391.382,80 | 1,71% | 56 | 0,50% | Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a " |
| CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES | D+4 | Não há | 3.340.307,88 | 4,10% | 640 | 5,82% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | D+24 | Não há | 1.375.899,23 | 1,69% | 151 | 0,09% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " |
| CAIXA CONSUMO FI AÇÕES | D+4 | Não há | 2.837.777,32 | 3,48% | 3.315 | 5,04% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " |
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO | D+33 | Não há | 710.978,28 | 0,87% | 35 | 1,45% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " |
| BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES | D+4 | Não há | 2.980.456,42 | 3,66% | 1.727 | 0,13% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " |
| CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES | D+45 | Não há | 1.024.189,99 | 1,26% | 56 | 0,70% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " |
| BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP | D+4 | Não há | 520.301,61 | 0,64% | 222 | 0,10% | Artigo 8º, Inciso III |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO | D+2 | 01/10/2020 | 1.080.574,01 | 1,33% | 955 | 0,23% | Artigo 8º, Inciso III |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO | D+2 | 02/01/2020 | 2.168.200,05 | 2,66% | 729 | 0,80% | Artigo 8º, Inciso III |
| BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11 | Não se aplica | Não se aplica | 266.556,26 | 0,33% | | 0,01% | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b " |
| CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES | D+4 | Não há | 424.015,38 | 0,52% | 71 | 0,10% | Artigo 9º - A, Inciso III |
| | | TOTAL - | 81.511.600,07 | | | | |

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (janeiro / 2019)

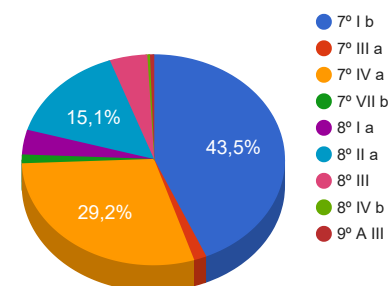
| Artigos - Renda Fixa | Resolução % | Carteira \$ | Carteira % | Estratégia de Alocação | | | GAP Superior |
|-------------------------------------|-------------|---------------|------------|------------------------|--------|------------|---------------|
| | | | | Inferior % | Alvo % | Superior % | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " | 100,00% | 35.474.149,02 | 43,52% | 15,00% | 27,00% | 90,00% | 37.886.291,04 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 60,00% | 1.275.613,18 | 1,56% | 0,00% | 10,00% | 60,00% | 47.631.346,86 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " | 40,00% | 23.841.874,71 | 29,25% | 10,00% | 30,00% | 40,00% | 8.762.765,32 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a " | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 1,00% | 5,00% | 4.075.580,00 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b " | 5,00% | 1.094.278,05 | 1,34% | 0,00% | 2,00% | 5,00% | 2.981.301,95 |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a " | 30,00% | 3.096.428,68 | 3,80% | 0,00% | 5,00% | 10,00% | 5.054.731,33 |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " | 20,00% | 12.269.609,12 | 15,05% | 0,00% | 10,00% | 20,00% | 4.032.710,89 |
| Artigo 8º, Inciso III | 10,00% | 3.769.075,67 | 4,62% | 0,00% | 10,00% | 10,00% | 4.382.084,34 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a " | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 2,50% | 5,00% | 4.075.580,00 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b " | 5,00% | 266.556,26 | 0,33% | 0,00% | 2,50% | 5,00% | 3.809.023,74 |
| Artigo 9º - A, Inciso III | 10,00% | 424.015,38 | 0,52% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | -424.015,38 |
| Total Carteira | | 81.511.600,07 | | | | | |

| | | |
|----------------|---------------|--------|
| EXTERIOR | 424.015,38 | 0,52% |
| RENDA FIXA | 61.685.914,96 | 75,68% |
| RENDA VARIÁVEL | 19.401.669,73 | 23,80% |

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

| Artigos - Renda Fixa | Base: janeiro / 2019 | | Limite Inferior (%) | Limite Superior (%) |
|-------------------------------------|----------------------|----------------|---------------------|---------------------|
| | Carteira (\$) | Carteira (%) | | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a " | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 10,00% |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " | 35.474.149,02 | 43,52% | 15,00% | 90,00% |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 1.275.613,18 | 1,56% | 0,00% | 60,00% |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " | 23.841.874,71 | 29,25% | 10,00% | 40,00% |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a " | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 15,00% |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a " | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b " | 1.094.278,05 | 1,34% | 0,00% | 5,00% |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c " | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a " | 3.096.428,68 | 3,80% | 0,00% | 10,00% |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " | 12.269.609,12 | 15,05% | 0,00% | 20,00% |
| Artigo 8º, Inciso III | 3.769.075,67 | 4,62% | 0,00% | 10,00% |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a " | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b " | 266.556,26 | 0,33% | 0,00% | 5,00% |
| Artigo 9º - A, Inciso III | 424.015,38 | 0,52% | 0,00% | 0,00% |
| Total Renda Fixa | 81.511.600,07 | 100,00% | 25,00 | 280,00 |

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (janeiro / 2019)

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 | 61.145.256,27 | 75,01% | 0,01% |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 8.611.037,53 | 10,56% | 0,00% |
| ITAÚ UNIBANCO | 6.093.766,45 | 7,48% | 0,00% |
| BRADESCO ASSET MANAGEMENT | 4.138.940,67 | 5,08% | 0,00% |
| VINCI PARTNERS | 1.024.189,99 | 1,26% | 0,00% |
| RIO BRAVO INVESTIMENTOS | 266.556,26 | 0,33% | 0,02% |
| SICREDI | 231.852,90 | 0,28% | 0,00% |

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (janeiro / 2019)

| | Mês | Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|---|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| IMA-B | 4,37% | 4,37% | 7,05% | 14,01% | 14,11% | 30,65% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 4,39% | 4,39% | 7,05% | 13,97% | 13,95% | 30,18% | 0,20% | 1,781% | 5,49% |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 4,36% | 4,36% | 7,01% | 13,86% | 13,82% | 30,01% | 0,20% | 1,735% | 5,46% |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP | 4,32% | 4,32% | 6,99% | 13,87% | 14,05% | 29,93% | 0,20% | 1,723% | 5,36% |
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 2,42% | 2,42% | 4,39% | 6,91% | 5,46% | 14,65% | 0,20% | 1,342% | 6,70% |
| CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1,05% | 1,05% | 2,10% | 2,39% | 3,40% | 10,83% | 0,20% | 0,429% | 4,36% |
| IMA-B 5 | 1,54% | 1,54% | 3,07% | 6,93% | 10,09% | 24,15% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,53% | 1,53% | 3,07% | 6,88% | 9,91% | 23,73% | 0,20% | 0,735% | 3,06% |
| IRF-M | 1,39% | 1,39% | 3,96% | 8,08% | 10,83% | 26,44% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,35% | 1,35% | 3,87% | 7,97% | 10,69% | 25,91% | 0,20% | 1,024% | 3,51% |
| IDKA IPCA 2 Anos | 1,26% | 1,26% | 2,71% | 6,23% | 10,29% | 24,91% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,27% | 1,27% | 2,57% | 5,93% | 9,64% | 23,04% | 0,20% | 0,592% | 2,36% |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,22% | 1,22% | 2,56% | 5,85% | 9,50% | 22,93% | 0,20% | 0,607% | 2,36% |
| IPCA + 6,00% ao ano | 0,83% | 0,83% | 1,71% | 4,09% | 9,95% | 19,79% | - | - | - |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,94% | 1,94% | 3,91% | 8,36% | 10,73% | 26,92% | 0,15% | 1,052% | 4,52% |
| CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,83% | 0,83% | 1,79% | 1,20% | 3,88% | 7,05% | 0,20% | 0,074% | 4,08% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | -4,11% | -4,11% | 3,64% | 7,90% | 18,55% | 29,35% | 0,20% | 0,956% | 4,57% |

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (janeiro / 2019)

| | Mês | Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|--|-------|-------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| IRF-M 1 | 0,58% | 0,58% | 1,69% | 3,70% | 6,96% | 18,04% | - | - | - |
| SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1 | 0,60% | 0,60% | 1,68% | 3,66% | 6,83% | 17,81% | 0,20% | 0,119% | 0,56% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,58% | 0,58% | 1,64% | 3,60% | 6,75% | 17,55% | 0,10% | 0,109% | 0,55% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,57% | 0,57% | 1,65% | 3,62% | 6,80% | 17,67% | 0,20% | 0,099% | 0,55% |
| Selic | 0,54% | 0,54% | 1,54% | 3,15% | 6,39% | 16,38% | - | - | - |
| BRABESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 0,53% | 0,53% | 1,51% | 3,10% | 6,29% | 16,69% | 0,20% | 0,001% | 0,02% |
| CDI | 0,54% | 0,54% | 1,54% | 3,15% | 6,38% | 16,36% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA | 0,54% | 0,54% | 1,52% | 3,10% | 6,22% | 16,25% | 0,20% | 0,008% | 0,03% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP | 0,53% | 0,53% | 1,49% | 3,10% | 6,29% | 16,40% | 0,20% | 0,003% | 0,04% |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,53% | 0,53% | 1,50% | 3,07% | 6,19% | 16,16% | 0,20% | 0,002% | 0,02% |
| IPCA | 0,32% | 0,32% | 0,26% | 1,10% | 3,78% | 6,74% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA | 2,88% | 2,88% | 4,64% | 7,26% | 9,82% | 21,96% | 0,002 | 1,382% | 2,03% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA | 2,37% | 2,37% | 4,69% | 6,05% | 9,18% | 22,45% | 0,40% | 1,127% | 1,50% |
| BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO | 1,46% | 1,46% | 2,92% | 6,44% | 11,08% | 27,60% | 0,20% | 0,699% | 3,02% |

Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (janeiro / 2019)

| | Mês | Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|---|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| IDIV | 12,48% | 12,48% | 21,45% | 30,55% | 18,70% | 50,50% | - | - | - |
| BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES | 8,34% | 8,34% | 11,71% | 24,13% | 17,93% | 55,60% | 1,50% | 7,614% | 20,07% |
| ICON | 12,31% | 12,31% | 16,71% | 16,51% | 0,19% | 30,90% | - | - | - |
| CAIXA CONSUMO FI AÇÕES | 12,55% | 12,55% | 15,82% | 14,54% | -3,11% | 26,72% | 1,60% | 7,367% | 20,49% |
| Ibovespa | 10,82% | 10,82% | 11,40% | 22,94% | 14,70% | 50,60% | - | - | - |
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO | 15,28% | 15,28% | 20,18% | 40,84% | 22,76% | - | 2,00% | 7,460% | 23,02% |
| CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES | 14,22% | 14,22% | 21,03% | 36,54% | 19,24% | 49,96% | 2,00% | 7,476% | 22,23% |
| CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES | 10,62% | 10,62% | 11,22% | 22,54% | 14,11% | 48,80% | 0,50% | 8,304% | 21,75% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | 8,29% | 8,29% | 15,51% | 25,43% | 26,66% | 65,09% | 2,50% | 7,342% | 19,20% |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO | 0,99% | 0,99% | 3,21% | - | - | - | 1,60% | 0,784% | - |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO | 0,56% | 0,56% | 2,00% | 4,38% | 8,24% | - | 1,60% | 0,296% | 2,45% |
| IGCT | 10,57% | 10,57% | 12,78% | 25,99% | 16,86% | 55,08% | - | - | - |
| ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES | 10,50% | 10,50% | 12,67% | 25,74% | 16,41% | 53,97% | 0,90% | 8,183% | 21,15% |
| SMLL | 9,41% | 9,41% | 17,06% | 23,72% | 13,39% | 58,58% | - | - | - |
| CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES | 13,32% | 13,32% | 26,19% | 32,83% | 23,83% | 65,94% | 1,72% | 10,524% | 19,32% |
| IFIX | 2,47% | 2,47% | 7,46% | 11,85% | 5,45% | 24,55% | - | - | - |
| BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,30% | - | - |

Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (janeiro / 2019)

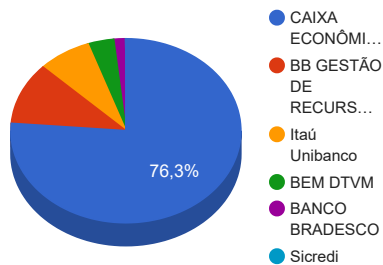
| | Mês | Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|--------------------------------------|-------|-------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| CDI | 0,54% | 0,54% | 1,54% | 3,15% | 6,38% | 16,36% | - | - | - |
| BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP | 0,82% | 0,82% | 1,88% | 3,28% | 7,35% | 20,99% | 0,60% | 0,364% | 2,59% |

Retorno dos investimentos no Exterior e Benchmark's - base (janeiro / 2019)

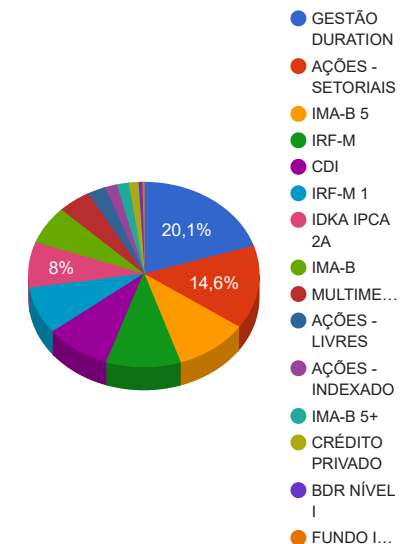
| | Mês | Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|--|-------|-------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| Global BDRX | 0,72% | 0,72% | -2,63% | -5,99% | 11,01% | 43,91% | - | - | - |
| CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES | 0,66% | 0,66% | -2,76% | -6,33% | 9,21% | 40,02% | 0,70% | 8,720% | 18,82% |

Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (janeiro / 2019)

| Administrador | Valor | % |
|----------------------------|---------------|--------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | 62.169.446,26 | 76,27% |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 8.877.593,79 | 10,89% |
| Itaú Unibanco | 6.093.766,45 | 7,48% |
| BEM DTVM | 2.980.456,42 | 3,66% |
| BANCO BRADESCO | 1.158.484,25 | 1,42% |
| Sicredi | 231.852,90 | 0,28% |



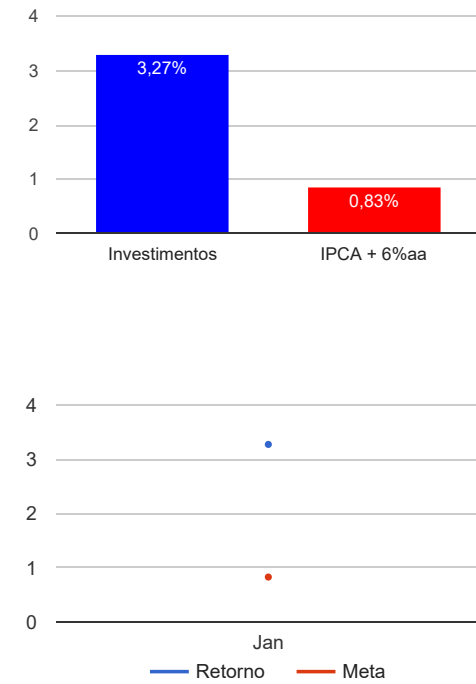
| Sub-segmento | Valor | % |
|-------------------|---------------|--------|
| GESTÃO DURATION | 16.372.431,08 | 20,09% |
| AÇÕES - SETORIAIS | 11.887.777,49 | 14,58% |
| IMA-B 5 | 8.363.086,76 | 10,26% |
| IRF-M | 8.351.222,29 | 10,25% |
| CDI | 7.469.443,63 | 9,16% |
| IRF-M 1 | 6.717.417,23 | 8,24% |
| IDKA IPCA 2A | 6.516.860,25 | 8,00% |
| IMA-B | 5.430.304,67 | 6,66% |
| MULTIMERCADO | 3.769.075,67 | 4,62% |
| AÇÕES - LIVRES | 2.086.877,51 | 2,56% |
| AÇÕES - INDEXADO | 1.391.382,80 | 1,71% |
| IMA-B 5+ | 1.370.871,00 | 1,68% |
| CRÉDITO PRIVADO | 1.094.278,05 | 1,34% |
| BDR NÍVEL I | 424.015,38 | 0,52% |
| FUNDO IMOBILIÁRIO | 266.556,26 | 0,33% |



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

| Mês | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (\$) | Retorno (%) | Meta (%) | Gap (%) | VaR (%) |
|------------------|----------------|--------------|--------------|---------------|--------------|-------------|----------|---------|---------|
| Janeiro | 80.445.558,00 | 1.132.453,93 | 2.697.847,21 | 81.511.600,07 | 2.631.435,35 | 3,27% | 0,83% | 393,34% | 2,15% |
| Acumulado no ano | | | | | 2.631.435,35 | 3,27% | 0,83% | 393,34% | |

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de janeiro / 2019

| Ativos de Renda Fixa | Sado Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | VaR - Mês (%) | Instituição(%) | |
|---|---------------|--------------|--------------|---------------|---------------|---------------------|---------------|----------------|--|
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 212.720,84 | 0,00 | 0,00 | 222.067,51 | 9.346,67 | 4,39% | 1,78% | 4,39% | |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 669.494,38 | 0,00 | 0,00 | 698.657,82 | 29.163,44 | 4,36% | 1,73% | 4,36% | |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP | 1.000.535,55 | 0,00 | 0,00 | 1.043.760,28 | 43.224,73 | 4,32% | 1,72% | 4,32% | |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA | 12.985.509,00 | 0,00 | 0,00 | 13.359.609,74 | 374.100,74 | 2,88% | 1,38% | 2,88% | |
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1.177.617,81 | 0,00 | 0,00 | 1.206.116,95 | 28.499,14 | 2,42% | 1,34% | 2,42% | |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA | 2.942.979,66 | 0,00 | 0,00 | 3.012.821,34 | 69.841,68 | 2,37% | 1,13% | 2,37% | |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 765.092,71 | 0,00 | 0,00 | 779.913,55 | 14.820,84 | 1,94% | 1,05% | 1,94% | |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1.453.493,86 | 0,00 | 0,00 | 1.479.788,56 | 26.294,70 | 1,81% | 0,96% | 1,81% | |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 7.100.358,95 | 0,00 | 0,00 | 7.209.201,05 | 108.842,10 | 1,53% | 0,74% | 1,53% | |
| BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO | 1.078.540,08 | 0,00 | 0,00 | 1.094.278,05 | 15.737,97 | 1,46% | 0,70% | 1,46% | |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 8.239.935,42 | 0,00 | 0,00 | 8.351.222,29 | 111.286,87 | 1,35% | 1,02% | 1,35% | |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 6.272.791,65 | 89.059,74 | 0,00 | 6.441.960,01 | 80.108,62 | 1,26% | 0,59% | 1,27% | |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 74.000,89 | 0,00 | 0,00 | 74.900,24 | 899,35 | 1,22% | 0,61% | 1,22% | |
| CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1.141.900,26 | 0,00 | 0,00 | 1.153.885,71 | 11.985,45 | 1,05% | 0,43% | 1,05% | |
| CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1.359.527,00 | 0,00 | 0,00 | 1.370.871,00 | 11.344,00 | 0,83% | 0,07% | 0,83% | |
| SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1 | 230.470,11 | 0,00 | 0,00 | 231.852,90 | 1.382,79 | 0,60% | 0,12% | 0,60% | |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 97.375,87 | 0,00 | 0,00 | 97.936,10 | 560,23 | 0,58% | 0,11% | 0,58% | |
| CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA | 2.138.084,55 | 0,00 | 0,00 | 2.149.669,85 | 11.585,30 | 0,54% | 0,01% | 0,54% | |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 1.152.335,93 | 0,00 | 0,00 | 1.158.484,25 | 6.148,32 | 0,53% | 0,00% | 0,53% | |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP | 3.132.284,38 | 5.384,84 | 0,00 | 3.154.283,32 | 16.614,10 | 0,53% | 0,00% | 0,53% | |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 1.001.707,69 | 0,00 | 0,00 | 1.007.006,21 | 5.298,52 | 0,53% | 0,00% | 0,53% | |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 8.001.592,27 | 1.038.009,35 | 2.695.747,21 | 6.387.628,23 | 43.773,82 | 0,48% | 0,10% | 0,57% | |
| Total Renda Fixa | | | | | | 1.020.859,38 | 1,64% | 0,79% | |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de janeiro / 2019

| Ativos de Renda Variável | Sado Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | VaR - Mês (%) | Instituição(%) |
|---|---------------|------------|----------|--------------|---------------------|--------------|---------------|----------------|
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO | 616.755,95 | 0,00 | 0,00 | 710.978,28 | 94.222,33 | 15,28% | 7,46% | 15,28% |
| CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES | 2.924.369,01 | 0,00 | 0,00 | 3.340.307,88 | 415.938,87 | 14,22% | 7,48% | 14,22% |
| CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES | 903.790,11 | 0,00 | 0,00 | 1.024.189,99 | 120.399,88 | 13,32% | 10,52% | 13,32% |
| CAIXA CONSUMO FI AÇÕES | 2.521.267,58 | 0,00 | 0,00 | 2.837.777,32 | 316.509,74 | 12,55% | 7,37% | 12,55% |
| CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES | 1.257.770,44 | 0,00 | 0,00 | 1.391.382,80 | 133.612,36 | 10,62% | 8,30% | 10,62% |
| ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES | 1.543.048,80 | 0,00 | 0,00 | 1.705.045,88 | 161.997,08 | 10,50% | 8,18% | 10,50% |
| BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES | 2.751.001,07 | 0,00 | 0,00 | 2.980.456,42 | 229.455,35 | 8,34% | 7,61% | 8,34% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | 1.270.594,85 | 0,00 | 0,00 | 1.375.899,23 | 105.304,38 | 8,29% | 7,34% | 8,29% |
| BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11 | 265.074,48 | 0,00 | 2.100,00 | 266.556,26 | 3.581,78 | 1,35% | - | 0,00% |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO | 1.070.023,47 | 0,00 | 0,00 | 1.080.574,01 | 10.550,54 | 0,99% | 0,78% | 0,99% |
| BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP | 516.087,59 | 0,00 | 0,00 | 520.301,61 | 4.214,02 | 0,82% | 0,36% | 0,82% |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO | 2.156.192,90 | 0,00 | 0,00 | 2.168.200,05 | 12.007,15 | 0,56% | 0,30% | 0,56% |
| Total Renda Variável | | | | | 1.607.793,48 | 9,03% | 6,37% | |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de janeiro / 2019

| Ativos de Investimentos no Exterior | Sado Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | VaR - Mês (%) | Instituição(%) |
|--|---------------|------------|----------|----------------|---------------|-------------|---------------|----------------|
| CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES | 421.232,89 | 0,00 | 0,00 | 424.015,38 | 2.782,49 | 0,66% | 8,72% | 0,66% |
| | | | | Total Exterior | 2.782,49 | 0,66% | 8,72% | |