

# Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2018

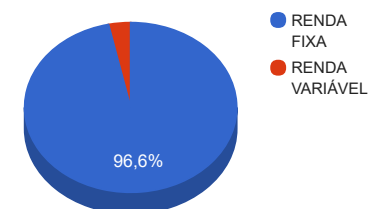
Carteira consolidada de investimentos - base (janeiro / 2018)

| Produto / Fundo   | Disponibilidade Resgate | Carência      | Saldo          | Particip.<br>S/ Total | Qtde.<br>Cotistas | % S/ PL<br>Fundo | RESOLUÇÃO<br>3.922 / 4.392 / 4.604  |
|---|-------------------------|---------------|----------------|-----------------------|-------------------|------------------|-------------------------------------|
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP     | D+0                     | Não há        | 8.180.004,20   | 2,42%                 | 203               | 0,56%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO         | D+0                     | 15/08/2018    | 5.205.780,82   | 1,54%                 | 193               | 1,43%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | D+0                     | Não há        | 34.899.671,04  | 10,34%                | 1.418             | 0,20%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO    | D+0                     | 15/08/2022    | 13.220.265,08  | 3,92%                 | 116               | 2,59%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP        | D+0                     | Não há        | 30.171.007,69  | 8,94%                 | 309               | 1,09%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | D+0                     | 15/08/2018    | 21.485.708,17  | 6,37%                 | 223               | 0,66%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP      | D+0                     | Não há        | 20.731.805,46  | 6,14%                 | 707               | 0,31%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0                     | Não há        | 57.474.011,65  | 17,03%                | 625               | 1,30%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | D+0                     | Não há        | 9.815.487,86   | 2,91%                 | 1.220             | 0,08%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO        | D+0                     | 15/08/2022    | 6.323.050,16   | 1,87%                 | 167               | 0,54%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP        | D+0                     | Não há        | 25.411.930,62  | 7,53%                 | 734               | 0,60%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP               | D+0                     | Não há        | 32.036.327,03  | 9,49%                 | 736               | 0,50%            | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "  |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA               | D+0                     | Não possui    | 52.549.207,27  | 15,57%                | 123               | 6,41%            | 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        | 8.718.324,02   | 2,58%                 | 60                | 2,00%            | Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b " |
| BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO                       | D+4                     | Não há        | 1.161.432,96   | 0,34%                 | 88                | 0,55%            | Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "   |
| BB CONSUMO FIC AÇÕES  | D+4                     | Não há        | 2.232.342,80   | 0,66%                 | 3.045             | 1,52%            | Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "  |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO | D+2                     | 43832         | 5.009.895,00   | 1,48%                 | 580               | 2,48%            | Artigo 8º, Inciso III               |
| BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11                     | Não se aplica           | Não se aplica | 2.915.318,25   | 0,86%                 |                   | 0,12%            | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "  |
|   |                         |               | <b>TOTAL -</b> | <b>337.541.570,08</b> |                   |                  |                                     |

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

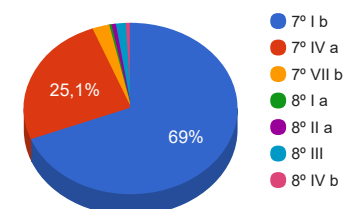
| Artigos - Renda Fixa                | Resolução %    | Carteira \$           | Carteira %    | Estratégia de Alocação |              |               | GAP Superior   |
|-------------------------------------|----------------|-----------------------|---------------|------------------------|--------------|---------------|----------------|
|                                     |                |                       |               | Inferior %             | Alvo %       | Superior %    |                |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   | 100,00%        | 232.918.722,75        | 69,00%        | 15,00%                 | 25,00%       | 70,00%        | 3.360.376,31   |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 60,00%         | 0,00                  | 0,00%         | 5,00%                  | 10,00%       | 60,00%        | 202.524.942,05 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "  | 40,00%         | 84.585.534,30         | 25,06%        | 5,00%                  | 10,00%       | 30,00%        | 16.676.936,72  |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "  | 15,00%         | 0,00                  | 0,00%         | 7,00%                  | 15,00%       | 15,00%        | 50.631.235,51  |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a " | 5,00%          | 0,00                  | 0,00%         | 2,00%                  | 5,00%        | 5,00%         | 16.877.078,50  |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b " | 5,00%          | 8.718.324,02          | 2,58%         | 2,00%                  | 5,00%        | 5,00%         | 8.158.754,48   |
| <b>Total Renda Fixa</b>             | <b>100,00%</b> | <b>326.222.581,07</b> | <b>96,65%</b> | <b>36,00</b>           | <b>70,00</b> | <b>190,00</b> | <b>-</b>       |

Distribuição por Segmento



| Artigos - Renda Variável           | Resolução %   | Carteira \$          | Carteira %   | Estratégia de Alocação |              |              | GAP Superior  |
|------------------------------------|---------------|----------------------|--------------|------------------------|--------------|--------------|---------------|
|                                    |               |                      |              | Inferior %             | Alvo %       | Superior %   |               |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "  | 30,00%        | 1.161.432,96         | 0,34%        | 2,00%                  | 5,00%        | 10,00%       | 32.592.724,05 |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " | 20,00%        | 2.232.342,80         | 0,66%        | 2,00%                  | 5,00%        | 10,00%       | 31.521.814,21 |
| Artigo 8º, Inciso III              | 10,00%        | 5.009.895,00         | 1,48%        | 7,00%                  | 10,00%       | 10,00%       | 28.744.262,01 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a " | 5,00%         | 0,00                 | 0,00%        | 2,00%                  | 5,00%        | 5,00%        | 16.877.078,50 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b " | 5,00%         | 2.915.318,25         | 0,86%        | 2,00%                  | 5,00%        | 5,00%        | 13.961.760,25 |
| <b>Total Renda Variável</b>        | <b>30,00%</b> | <b>11.318.989,01</b> | <b>3,35%</b> | <b>15,00</b>           | <b>30,00</b> | <b>40,00</b> | <b>-</b>      |

Distribuição por Artigo / Resolução



### Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

| Artigos - Renda Fixa                | Base: janeiro / 2018  |               | Limite Inferior (%) | Limite Superior (%) |
|-------------------------------------|-----------------------|---------------|---------------------|---------------------|
|                                     | Carteira (\$)         | Carteira (%)  |                     |                     |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   | 232.918.722,75        | 69,00%        | 15,00%              | 70,00%              |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 0,00                  | 0,00%         | 5,00%               | 60,00%              |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "  | 84.585.534,30         | 25,06%        | 5,00%               | 30,00%              |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "  | 0,00                  | 0,00%         | 7,00%               | 15,00%              |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a " | 0,00                  | 0,00%         | 2,00%               | 5,00%               |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b " | 8.718.324,02          | 2,58%         | 2,00%               | 5,00%               |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c " | 0,00                  | 0,00%         | 0,00%               | 5,00%               |
| <b>Total Renda Fixa</b>             | <b>326.222.581,07</b> | <b>96,65%</b> | <b>36,00</b>        | <b>190,00</b>       |

| Artigos - Renda Variável           | Base: janeiro / 2018 |              | Limite Inferior (%) | Limite Superior (%) |
|------------------------------------|----------------------|--------------|---------------------|---------------------|
|                                    | Carteira (\$)        | Carteira (%) |                     |                     |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "  | 1.161.432,96         | 0,34%        | 2,00%               | 10,00%              |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " | 2.232.342,80         | 0,66%        | 2,00%               | 10,00%              |
| Artigo 8º, Inciso III              | 5.009.895,00         | 1,48%        | 7,00%               | 10,00%              |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a " | 0,00                 | 0,00%        | 2,00%               | 5,00%               |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b " | 2.915.318,25         | 0,86%        | 2,00%               | 5,00%               |
| <b>Total Renda Variável</b>        | <b>11.318.989,01</b> | <b>3,35%</b> | <b>15,00</b>        | <b>40,00</b>        |

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (janeiro / 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    | 287.949.568,13 | 85,31%        | 0,08%          |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 46.676.683,70  | 13,83%        | 0,00%          |
| RIO BRAVO INVESTIMENTOS    | 2.915.318,25   | 0,86%         | 0,22%          |

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (janeiro / 2018)

|  | Mês   | Ano   | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|--|-------|-------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| IMA-B  | 3,40% | 3,40% | 3,46%   | 6,35%   | 14,49%   | 42,84%   | -        | -         | -                       |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 3,37% | 3,37% | 3,39%   | 6,21%   | 14,24%   | 42,39%   | 0,20%    | 1,795%    | 9,09%                   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,17% | 1,17% | 1,98%   | 4,59%   | 12,19%   | 27,57%   | 0,20%    | 0,448%    | 3,14%                   |
| CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA  | 1,05% | 1,05% | 1,61%   | 1,04%   | 4,30%    | 10,82%   | 0,20%    | 0,350%    | 4,31%                   |

|   |       |       |       |       |        |        |       |        |       |
|---|-------|-------|-------|-------|--------|--------|-------|--------|-------|
| IRF-M 1+  | 1,55% | 1,55% | 2,94% | 5,81% | 15,40% | 47,98% | -     | -      | -     |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,66% | 1,66% | 2,98% | 5,59% | 14,97% | 47,80% | 0,20% | 1,178% | 5,89% |

|  |       |       |       |       |        |        |       |        |       |
|--|-------|-------|-------|-------|--------|--------|-------|--------|-------|
| IMA-B 5  | 1,33% | 1,33% | 2,33% | 5,17% | 12,77% | 27,94% | -     | -      | -     |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,31% | 1,31% | 2,28% | 5,06% | 12,57% | 27,44% | 0,20% | 0,609% | 3,43% |

|  |       |       |       |       |        |        |       |        |       |
|--|-------|-------|-------|-------|--------|--------|-------|--------|-------|
| IRF-M  | 1,30% | 1,30% | 2,65% | 5,38% | 14,09% | 40,05% | -     | -      | -     |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,37% | 1,37% | 2,66% | 5,19% | 13,75% | 39,77% | 0,20% | 0,881% | 4,53% |

|  |       |       |       |       |       |        |       |        |       |
|--|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|--------|-------|
| IPCA + 6,00% ao ano                                      | 0,80% | 0,80% | 2,47% | 4,80% | 8,95% | 21,70% | -     | -      | -     |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,06% | 1,06% | 2,60% | 4,97% | 9,11% | 22,66% | 0,20% | 0,238% | 0,35% |

|   |       |       |       |       |        |        |       |        |       |
|---|-------|-------|-------|-------|--------|--------|-------|--------|-------|
| IDKA IPCA 2 Anos  | 0,77% | 0,77% | 2,20% | 4,96% | 13,25% | 27,12% | -     | -      | -     |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO         | 1,04% | 1,04% | 1,61% | 3,84% | 10,22% | 23,85% | 0,20% | 0,345% | 1,66% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,95% | 0,95% | 2,06% | 4,74% | 12,22% | 26,72% | 0,20% | 0,448% | 2,62% |

|   |       |       |       |       |        |        |       |        |       |
|---|-------|-------|-------|-------|--------|--------|-------|--------|-------|
| IRF-M 1   | 0,59% | 0,59% | 1,79% | 4,11% | 10,35% | 26,16% | -     | -      | -     |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,59% | 0,59% | 1,74% | 4,00% | 10,12% | 25,62% | 0,10% | 0,109% | 0,65% |

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (janeiro / 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      | 0,57% | 0,57% | 1,74%   | 4,02%   | 10,18%   | 25,79%   | 0,20%    | 0,097%    | 0,65%                   |
| CDI  | 0,58% | 0,58% | 1,70%   | 3,83%   | 9,38%    | 24,73%   | -        | -         | -                       |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP            | 0,57% | 0,57% | 1,66%   | 3,78%   | 9,39%    | 24,73%   | 0,20%    | 0,005%    | 0,13%                   |
| IPCA   | 0,29% | 0,29% | 1,01%   | 1,79%   | 2,86%    | 8,36%    | -        | -         | -                       |
| BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO | 1,36% | 1,36% | 2,55%   | 5,72%   | 14,87%   | 36,01%   | 0,20%    | 0,635%    | 4,08%                   |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA            | 1,01% | 1,01% | 2,09%   | 4,46%   | 11,06%   | -        | 0,002    | 0,419%    | 4,26%                   |

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

|   | Mês    | Ano    | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|---|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| Ibovespa  | 11,14% | 11,14% | 14,27%  | 28,81%  | 31,30%   | 110,15%  | -        | -         | -                       |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO | -      | -      | -       | -       | -        | -        | 1,60%    | -         | -                       |

|                                       |       |       |        |        |        |        |       |        |        |
|---------------------------------------|-------|-------|--------|--------|--------|--------|-------|--------|--------|
| IGC                                   | 8,21% | 8,21% | 10,90% | 23,41% | 31,37% | 91,81% | -     | -      | -      |
| BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO | 8,13% | 8,13% | 10,60% | 22,82% | 30,37% | 89,25% | 1,00% | 7,719% | 17,32% |

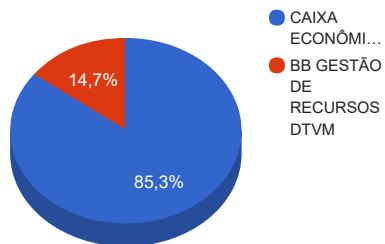
|   |       |       |       |        |        |        |       |   |   |
|---|-------|-------|-------|--------|--------|--------|-------|---|---|
| IFIX                                    | 2,64% | 2,64% | 2,65% | 10,60% | 18,12% | 72,74% | -     | - | - |
| BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00%  | 0,00%  | -      | 0,30% | - | - |

|                      |       |       |       |        |        |        |       |        |        |
|----------------------|-------|-------|-------|--------|--------|--------|-------|--------|--------|
| ICON                 | 1,36% | 1,36% | 4,45% | 18,98% | 30,65% | 60,40% | -     | -      | -      |
| BB CONSUMO FIC AÇÕES | 1,35% | 1,35% | 4,04% | 18,01% | 28,62% | 55,79% | 1,00% | 6,696% | 16,95% |

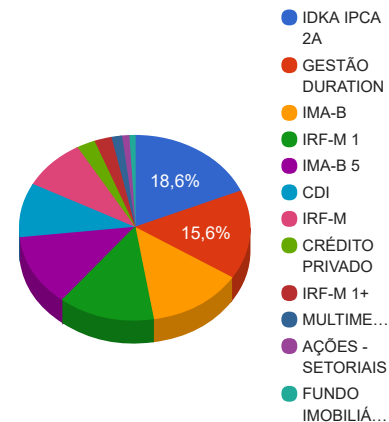


Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (janeiro / 2018)

| Administrador              | Valor          | %      |
|----------------------------|----------------|--------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL    | 287.949.568,13 | 85,31% |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 49.592.001,95  | 14,69% |



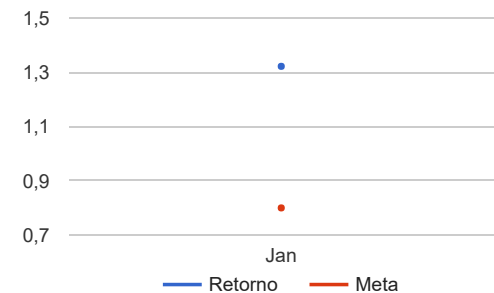
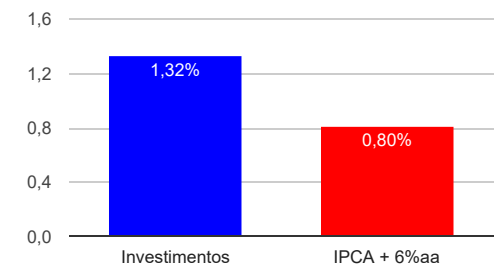
| Sub-segmento      | Valor         | %      |
|-------------------|---------------|--------|
| IDKA IPCA 2A      | 62.679.792,47 | 18,57% |
| GESTÃO DURATION   | 52.549.207,27 | 15,57% |
| IMA-B             | 44.955.245,86 | 13,32% |
| IRF-M 1           | 44.715.158,90 | 13,25% |
| IMA-B 5           | 42.217.513,63 | 12,51% |
| CDI               | 32.036.327,03 | 9,49%  |
| IRF-M             | 30.171.007,69 | 8,94%  |
| CRÉDITO PRIVADO   | 8.718.324,02  | 2,58%  |
| IRF-M 1+          | 8.180.004,20  | 2,42%  |
| MULTIMERCADO      | 5.009.895,00  | 1,48%  |
| AÇÕES - SETORIAIS | 3.393.775,76  | 1,01%  |
| FUNDO IMOBILIÁRIO | 2.915.318,25  | 0,86%  |



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

| Mês              | Saldo Anterior | Aplicações    | Resgates      | Saldo Atual    | Retorno (\$) | Retorno (%) | Meta (%) | Gap (%) | VaR (%) |
|------------------|----------------|---------------|---------------|----------------|--------------|-------------|----------|---------|---------|
| Janeiro          | 331.118.244,39 | 79.160.099,48 | 77.138.165,90 | 337.541.570,08 | 4.401.392,11 | 1,32%       | 0,80%    | 164,84% | 0,58%   |
| Acumulado no ano |                |               |               |                | 4.401.392,11 | 1,32%       | 0,80%    | 164,84% |         |

**Acumulado no Ano**



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de janeiro / 2018

| Ativos de Renda Fixa  | Sado Anterior | Aplicações    | Resgates      | Saldo Atual   | Retorno (R\$) | Retorno (%) | VaR - Mês (%) | Instituição(%) |
|---|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|-------------|---------------|----------------|
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP     | 6.055.192,91  | 0,00          | 6.239.294,12  | 0,00          | 184.101,21    | 3,04%       | 2,75%         | 4,91%          |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP        | 48.082.927,40 | 0,00          | 24.000.000,00 | 25.411.930,62 | 1.329.003,22  | 2,76%       | 1,80%         | 3,37%          |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP     | 12.999.783,16 | 0,00          | 5.000.000,00  | 8.180.004,20  | 180.221,04    | 1,39%       | 1,18%         | 1,66%          |
| BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO    | 8.601.503,94  | 0,00          | 0,00          | 8.718.324,02  | 116.820,08    | 1,36%       | 0,63%         | 1,36%          |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP      | 28.394.107,69 | 0,00          | 8.000.000,00  | 20.731.805,46 | 337.697,77    | 1,19%       | 0,61%         | 1,31%          |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO        | 6.249.811,41  | 0,00          | 0,00          | 6.323.050,16  | 73.238,75     | 1,17%       | 0,45%         | 1,17%          |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO    | 13.081.647,50 | 0,00          | 0,00          | 13.220.265,08 | 138.617,58    | 1,06%       | 0,24%         | 1,06%          |
| CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | 21.263.430,79 | 0,00          | 0,00          | 21.485.708,17 | 222.277,38    | 1,05%       | 0,35%         | 1,05%          |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO         | 5.152.329,53  | 0,00          | 0,00          | 5.205.780,82  | 53.451,29     | 1,04%       | 0,34%         | 1,04%          |
| CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP    | 11.465.523,17 | 0,00          | 11.582.271,78 | 0,00          | 116.748,61    | 1,02%       | 0,84%         | 1,68%          |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 56.931.115,06 | 0,00          | 0,00          | 57.474.011,65 | 542.896,59    | 0,95%       | 0,45%         | 0,95%          |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA               | 24.199.130,78 | 28.000.000,00 | 0,00          | 52.549.207,27 | 350.076,49    | 0,67%       | 0,42%         | 1,01%          |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP        | 0,00          | 30.000.000,00 | 0,00          | 30.171.007,69 | 171.007,69    | 0,57%       | 0,88%         | 1,37%          |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | 5.552.689,45  | 4.217.062,55  | 0,00          | 9.815.487,86  | 45.735,86     | 0,47%       | 0,11%         | 0,59%          |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | 56.834.091,27 | 121.471,03    | 22.316.600,00 | 34.899.671,04 | 260.708,74    | 0,46%       | 0,10%         | 0,57%          |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP               | 20.073.084,08 | 11.821.565,90 | 0,00          | 32.036.327,03 | 141.677,05    | 0,44%       | 0,00%         | 0,57%          |
| Total Renda Fixa  |               |               |               |               | 4.264.279,35  | 1,31%       | 0,51%         |                |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de janeiro / 2018

| Ativos de Renda Variável                                    | Sado Anterior | Aplicações   | Resgates | Saldo Atual  | Retorno (R\$) | Retorno (%) | VaR - Mês (%) | Instituição(%) |
|---|---------------|--------------|----------|--------------|---------------|-------------|---------------|----------------|
| BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO                       | 1.074.156,07  | 0,00         | 0,00     | 1.161.432,96 | 87.276,89     | 8,13%       | 7,72%         | 8,13%          |
| BB CONSUMO FIC AÇÕES  | 2.202.596,25  | 0,00         | 0,00     | 2.232.342,80 | 29.746,55     | 1,35%       | 6,70%         | 1,35%          |
| BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11                     | 2.905.123,93  | 0,00         | 0,00     | 2.915.318,25 | 10.194,32     | 0,35%       | -             | 0,00%          |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO | 0,00          | 5.000.000,00 | 0,00     | 5.009.895,00 | 9.895,00      | 0,20%       | -             | -              |
| Total Renda Variável  |               |              |          |              | 137.112,76    | 1,23%       | 7,05%         |                |