

# Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2017



Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2017)

| Produto / Fundo   | Disponibilidade Resgate | Carência   | Saldo         | Particip. S/ Total | Qtde. Cotistas | % S/ PL Fundo | RESOLUÇÃO<br>3.922 / 4.392 / 4.604  |
|---|-------------------------|------------|---------------|--------------------|----------------|---------------|-------------------------------------|
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | D+1                     | Não há     | 674.309,73    | 0,89%              | 707            | 0,01%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | D+0                     | Não há     | 666.301,36    | 0,88%              | 1.211          | 0,01%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP     | D+0                     | Não há     | 4.658.796,20  | 6,13%              | 276            | 0,33%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | D+0                     | 15/08/2018 | 2.083.709,80  | 2,74%              | 222            | 0,07%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP        | D+0                     | Não há     | 7.705.338,57  | 10,14%             | 754            | 0,14%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | D+2                     | Não há     | 2.167.769,38  | 2,85%              | 295            | 0,12%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | D+0                     | 16/08/2020 | 1.075.127,73  | 1,41%              | 107            | 0,12%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP        | D+0                     | Não há     | 7.502.953,34  | 9,87%              | 290            | 0,27%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO      | D+1                     | Não há     | 1.597.866,74  | 2,10%              | 610            | 0,03%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA                         | D+1                     | Não há     | 666.288,92    | 0,88%              | 1.816          | 0,65%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | D+0                     | Não há     | 1.327.950,22  | 1,75%              | 1.381          | 0,01%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0                     | Não há     | 2.220.219,93  | 2,92%              | 601            | 0,06%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP      | D+0                     | Não há     | 11.624.986,27 | 15,29%             | 711            | 0,18%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | D+0                     | 15/08/2024 | 1.098.051,53  | 1,44%              | 72             | 0,11%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP                   | D+0                     | Não há     | 7.411.255,99  | 9,75%              | 329            | 0,28%         | Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                     | D+0                     | Não há     | 4.107.978,55  | 5,40%              | 766            | 0,10%         | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "  |
| CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP                 | D+0                     | Não há     | 5.196.755,03  | 6,84%              | 6.655          | 0,05%         | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "  |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | D+0                     | 15/08/2022 | 714.456,67    | 0,94%              | 95             | 0,18%         | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "  |
| BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI              | D+0                     | Não há     | 1.083.824,31  | 1,43%              | 534            | 0,01%         | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "  |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO    | D+0                     | 15/08/2022 | 1.271.313,80  | 1,67%              | 116            | 0,26%         | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "  |
| CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA          | D+0                     | 16/08/2030 | 1.268.429,00  | 1,67%              | 34             | 0,65%         | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "  |
| CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES                              | D+4                     | Não há     | 552.246,28    | 0,73%              | 20             | 1,90%         | Artigo 8º, Inciso I                 |

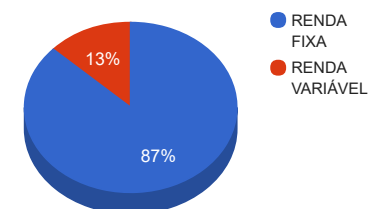
Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2017)

| 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 VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES    | D+43                    | 5 anos         | 814.842,58           | 1,07%                 | 53                | 0,82%            | Artigo 8º, Inciso III              |
| CAIXA CONSUMO FI AÇÕES                  | D+4                     | Não há         | 2.620.343,13         | 3,45%                 | 1.156             | 17,31%           | Artigo 8º, Inciso III              |
| ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES    | D+4                     | Não há         | 1.394.488,48         | 1,83%                 | 6                 | 2,20%            | Artigo 8º, Inciso III              |
| BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES             | D+4                     | Não há         | 2.091.814,42         | 2,75%                 | 534               | 0,36%            | Artigo 8º, Inciso III              |
| CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES           | D+4                     | Não há         | 2.091.400,34         | 2,75%                 | 350               | 5,01%            | Artigo 8º, Inciso III              |
| BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11 | Não se aplica           | Não se aplica  | 327.978,59           | 0,43%                 |                   | 0,01%            | Artigo 8º, Inciso VI               |
|   |                         | <b>TOTAL -</b> | <b>76.016.796,89</b> |                       |                   |                  |                                    |

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (agosto / 2017)

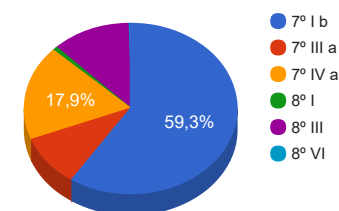
| Artigos - Renda Fixa                | Resolução %    | Carteira \$          | Carteira %    | Estratégia de Alocação |              |               | GAP Superior  |
|-------------------------------------|----------------|----------------------|---------------|------------------------|--------------|---------------|---------------|
|                                     |                |                      |               | Inferior %             | Alvo %       | Superior %    |               |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   | 100,00%        | 45.069.669,72        | 59,29%        | 30,00%                 | 35,00%       | 85,00%        | 19.544.607,64 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 80,00%         | 7.411.255,99         | 9,75%         | 15,00%                 | 20,00%       | 60,00%        | 38.198.822,14 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "  | 30,00%         | 13.642.757,36        | 17,95%        | 5,00%                  | 5,00%        | 30,00%        | 9.162.281,71  |
| Artigo 7º, Inciso VI                | 15,00%         | 0,00                 | 0,00%         | 5,00%                  | 10,00%       | 15,00%        | 11.402.519,53 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a " | 5,00%          | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                  | 2,50%        | 5,00%         | 3.800.839,84  |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b " | 5,00%          | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                  | 2,50%        | 5,00%         | 3.800.839,84  |
| <b>Total Renda Fixa</b>             | <b>100,00%</b> | <b>66.123.683,07</b> | <b>86,99%</b> | <b>55,00</b>           | <b>75,00</b> | <b>200,00</b> | <b>-</b>      |

Distribuição por Segmento



| Artigos - Renda Variável    | Resolução %   | Carteira \$         | Carteira %    | Estratégia de Alocação |              |              | GAP Superior |
|-----------------------------|---------------|---------------------|---------------|------------------------|--------------|--------------|--------------|
|                             |               |                     |               | Inferior %             | Alvo %       | Superior %   |              |
| Artigo 8º, Inciso I         | 30,00%        | 552.246,28          | 0,73%         | 1,00%                  | 2,00%        | 5,00%        | 3.248.593,56 |
| Artigo 8º, Inciso III       | 15,00%        | 9.012.888,95        | 11,86%        | 5,00%                  | 10,00%       | 15,00%       | 2.389.630,58 |
| Artigo 8º, Inciso IV        | 5,00%         | 0,00                | 0,00%         | 2,00%                  | 5,00%        | 5,00%        | 3.800.839,84 |
| Artigo 8º, Inciso V         | 5,00%         | 0,00                | 0,00%         | 2,00%                  | 4,00%        | 5,00%        | 3.800.839,84 |
| Artigo 8º, Inciso VI        | 5,00%         | 327.978,59          | 0,43%         | 2,00%                  | 4,00%        | 5,00%        | 3.472.861,25 |
| <b>Total Renda Variável</b> | <b>30,00%</b> | <b>9.893.113,82</b> | <b>13,01%</b> | <b>12,00</b>           | <b>25,00</b> | <b>35,00</b> | <b>-</b>     |

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

| Artigos - Renda Fixa                | Base: agosto / 2017  |               | Limite Inferior (%) | Limite Superior (%) |
|-------------------------------------|----------------------|---------------|---------------------|---------------------|
|                                     | Carteira (\$)        | Carteira (%)  |                     |                     |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   | 45.069.669,72        | 59,29%        | 30,00%              | 85,00%              |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 7.411.255,99         | 9,75%         | 15,00%              | 60,00%              |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "  | 13.642.757,36        | 17,95%        | 5,00%               | 30,00%              |
| Artigo 7º, Inciso VI                | 0,00                 | 0,00%         | 5,00%               | 15,00%              |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a " | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%               | 5,00%               |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b " | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%               | 5,00%               |
| <b>Total Renda Fixa</b>             | <b>66.123.683,07</b> | <b>86,99%</b> | <b>55,00</b>        | <b>200,00</b>       |

| Artigos - Renda Variável    | Base: agosto / 2017 |               | Limite Inferior (%) | Limite Superior (%) |
|-----------------------------|---------------------|---------------|---------------------|---------------------|
|                             | Carteira (\$)       | Carteira (%)  |                     |                     |
| Artigo 8º, Inciso I         | 552.246,28          | 0,73%         | 1,00%               | 5,00%               |
| Artigo 8º, Inciso III       | 9.012.888,95        | 11,86%        | 5,00%               | 15,00%              |
| Artigo 8º, Inciso IV        | 0,00                | 0,00%         | 2,00%               | 5,00%               |
| Artigo 8º, Inciso V         | 0,00                | 0,00%         | 2,00%               | 5,00%               |
| Artigo 8º, Inciso VI        | 327.978,59          | 0,43%         | 2,00%               | 5,00%               |
| <b>Total Renda Variável</b> | <b>9.893.113,82</b> | <b>13,01%</b> | <b>12,00</b>        | <b>35,00</b>        |

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (agosto / 2017)

|   | Mês    | Ano    | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|---|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| IMA-B 5+  | 1,36%  | 11,93% | 6,04%   | 4,21%   | 16,45%   | 51,77%   | -        | -         | -                       |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,34%  | 11,49% | 6,00%   | 3,94%   | 15,86%   | 50,41%   | 0,20%    | 2,654%    | 12,85%                  |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP   | 1,33%  | 11,73% | 5,93%   | 4,17%   | 16,18%   | 50,38%   | 0,20%    | 2,644%    | 12,76%                  |
| IMA-B   | 1,34%  | 11,14% | 5,57%   | 5,06%   | 15,49%   | 44,95%   | -        | -         | -                       |
| CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP                 | 1,36%  | 10,73% | 5,30%   | 4,72%   | 15,18%   | 43,25%   | 0,20%    | 1,756%    | 9,40%                   |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP      | 1,33%  | 11,00% | 5,51%   | 4,97%   | 15,39%   | 43,43%   | 0,20%    | 1,813%    | 9,83%                   |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO    | 1,32%  | 10,97% | 5,49%   | 4,92%   | 15,22%   | 44,11%   | 0,20%    | 1,808%    | 9,85%                   |
| GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA                       | 1,25%  | 10,29% | 5,43%   | 4,25%   | 14,90%   | 43,55%   | 0,15%    | 1,905%    | 10,34%                  |
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA       | -0,93% | 6,23%  | 3,02%   | 3,92%   | 9,37%    | 28,41%   | 0,20%    | 4,252%    | 8,59%                   |
| CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA       | -1,62% | 4,53%  | 1,86%   | 4,29%   | 8,30%    | 22,66%   | 0,20%    | 4,126%    | 5,91%                   |
| CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA       | -2,05% | 2,14%  | 0,14%   | 2,99%   | 5,74%    | 17,74%   | 0,20%    | 4,288%    | 4,41%                   |
| IMA-B 5   | 1,25%  | 9,83%  | 4,68%   | 6,98%   | 13,91%   | 34,53%   | -        | -         | -                       |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP    | 1,24%  | 9,71%  | 4,63%   | 6,90%   | 13,72%   | 33,75%   | 0,20%    | 0,717%    | 3,64%                   |
| IRF-M   | 1,06%  | 11,91% | 4,79%   | 7,25%   | 18,00%   | 40,09%   | -        | -         | -                       |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP      | 1,01%  | 11,75% | 4,73%   | 7,05%   | 17,80%   | 39,40%   | 0,20%    | 0,989%    | 4,89%                   |
| IDKA IPCA 2 Anos  | 0,97%  | 10,12% | 4,34%   | 7,49%   | 14,33%   | 34,57%   | -        | -         | -                       |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | 0,98%  | 9,35%  | 4,08%   | 6,76%   | 13,28%   | 33,34%   | 0,20%    | 0,487%    | 2,90%                   |

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (agosto / 2017)

|   | Mês    | Ano    | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|---|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,96%  | 9,32%  | 4,05%   | 6,79%   | 13,26%   | 33,40%   | 0,20%    | 0,491%    | 2,83%                   |
| IRF-M 1   | 0,90%  | 8,33%  | 2,86%   | 5,88%   | 13,15%   | 29,98%   | -        | -         | -                       |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | 0,89%  | 8,21%  | 2,82%   | 5,81%   | 12,96%   | 29,61%   | 0,20%    | 0,081%    | 0,67%                   |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | 0,88%  | 8,17%  | 2,83%   | 5,78%   | 12,88%   | 29,36%   | 0,10%    | 0,081%    | 0,68%                   |
| Selic   | 0,80%  | 7,35%  | 2,43%   | 5,29%   | 12,06%   | 27,92%   | -        | -         | -                       |
| BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI               | 0,99%  | 7,74%  | 2,65%   | 5,65%   | 12,68%   | 28,66%   | 0,20%    | 0,074%    | 0,12%                   |
| CDI   | 0,80%  | 7,34%  | 2,43%   | 5,28%   | 12,05%   | 27,88%   | -        | -         | -                       |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                     | 0,79%  | 7,40%  | 2,43%   | 5,30%   | 12,17%   | 27,88%   | 0,20%    | 0,003%    | 0,11%                   |
| CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP                 | 0,78%  | 7,35%  | 2,41%   | 5,28%   | 12,08%   | 27,99%   | 0,25%    | 0,004%    | 0,11%                   |
| IPCA + 6,00% ao ano   | 0,72%  | 5,65%  | 1,72%   | 3,93%   | 8,58%    | 25,42%   | -        | -         | -                       |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | 1,60%  | 11,49% | 5,79%   | 7,51%   | 15,49%   | 41,47%   | 0,15%    | 1,186%    | 6,48%                   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO    | 0,95%  | 5,88%  | 1,82%   | 4,17%   | 8,92%    | 25,78%   | 0,20%    | 0,182%    | 0,30%                   |
| CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA          | -1,94% | -0,26% | -1,07%  | 1,24%   | 2,66%    | 12,07%   | 0,20%    | 4,501%    | 4,06%                   |

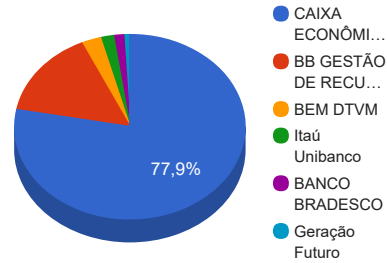
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (agosto / 2017)

|   | Mês   | Ano    | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|---|-------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| ICON                                    | 9,04% | 23,68% | 11,84%  | 18,64%  | 14,55%   | 31,50%   | -        | -         | -                       |
| CAIXA CONSUMO FI AÇÕES                  | 8,97% | 23,12% | 11,58%  | 18,07%  | 15,24%   | 23,35%   | 1,60%    | 5,193%    | 18,74%                  |
| SMLL                                    | 8,58% | 40,02% | 17,87%  | 18,86%  | 36,58%   | 75,74%   | -        | -         | -                       |
| CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES    | 8,52% | 23,23% | 14,19%  | 12,74%  | 8,88%    | 1,65%    | 1,72%    | 3,510%    | 17,52%                  |
| IGCT                                    | 8,03% | 23,01% | 14,26%  | 9,11%   | 27,24%   | 56,56%   | -        | -         | -                       |
| ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES    | 7,96% | 22,58% | 14,09%  | 8,90%   | 26,76%   | 55,83%   | 0,90%    | 5,786%    | 20,17%                  |
| Ibovespa                                | 7,46% | 17,61% | 12,95%  | 6,26%   | 22,34%   | 51,93%   | -        | -         | -                       |
| CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES          | 7,33% | 17,02% | 12,63%  | 5,92%   | 21,89%   | 49,07%   | 0,50%    | 5,737%    | 21,25%                  |
| CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES           | 5,30% | 17,97% | 10,95%  | 5,59%   | 13,01%   | 45,44%   | 2,00%    | 7,740%    | 22,28%                  |
| IDIV                                    | 6,96% | 20,19% | 10,75%  | 3,45%   | 33,46%   | 71,33%   | -        | -         | -                       |
| BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES             | 5,83% | 23,41% | 11,79%  | 4,86%   | 27,16%   | 52,82%   | 1,50%    | 5,271%    | 20,70%                  |
| IFIX                                    | 0,87% | 11,80% | 1,36%   | 2,76%   | 17,94%   | 42,94%   | -        | -         | -                       |
| BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11 | 0,00% | 0,00%  | 0,00%   | 0,00%   | -        | -        | 0,30%    | -         | -                       |

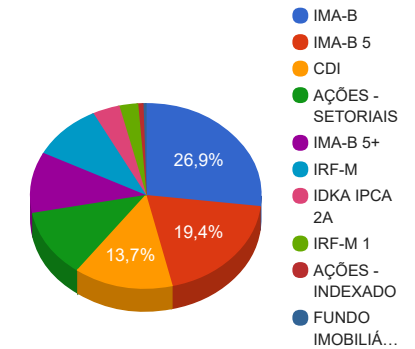


Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (agosto / 2017)

| Administrador              | Valor         | %      |
|----------------------------|---------------|--------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL    | 59.252.405,94 | 77,95% |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 11.527.974,82 | 15,17% |
| BEM DTVM                   | 2.091.814,42  | 2,75%  |
| Itaú Unibanco              | 1.394.488,48  | 1,83%  |
| BANCO BRADESCO             | 1.083.824,31  | 1,43%  |
| Geração Futuro             | 666.288,92    | 0,88%  |



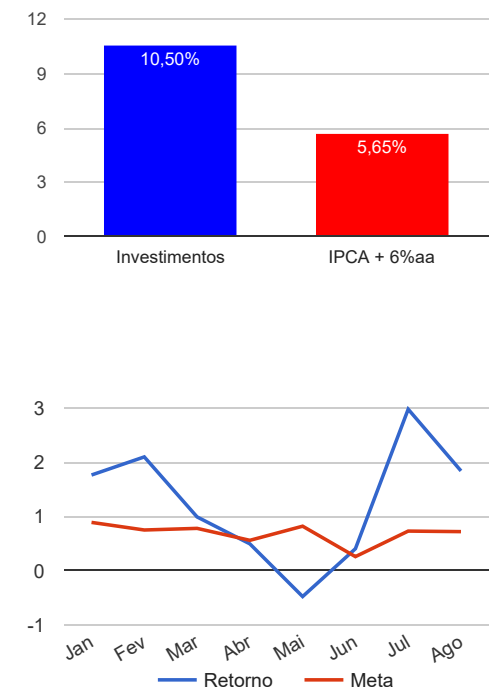
| Sub-segmento      | Valor         | %      |
|-------------------|---------------|--------|
| IMA-B             | 20.464.572,22 | 26,92% |
| IMA-B 5           | 14.783.823,80 | 19,45% |
| CDI               | 10.388.557,89 | 13,67% |
| AÇÕES - SETORIAIS | 9.012.888,95  | 11,86% |
| IMA-B 5+          | 8.094.994,58  | 10,65% |
| IRF-M             | 7.502.953,34  | 9,87%  |
| IDKA IPCA 2A      | 2.894.529,66  | 3,81%  |
| IRF-M 1           | 1.994.251,58  | 2,62%  |
| AÇÕES - INDEXADO  | 552.246,28    | 0,73%  |
| FUNDO IMOBILIÁRIO | 327.978,59    | 0,43%  |



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

| Mês              | Saldo Anterior | Aplicações   | Resgates     | Saldo Atual   | Retorno (\$) | Retorno (%) | Meta (%) | Gap (%) | VaR (%) |
|------------------|----------------|--------------|--------------|---------------|--------------|-------------|----------|---------|---------|
| Janeiro          | 67.163.512,71  | 7.014.108,42 | 7.291.540,11 | 68.069.728,53 | 1.183.647,51 | 1,76%       | 0,89%    | 197,59% | 1,95%   |
| Fevereiro        | 68.069.728,53  | 5.152.660,24 | 5.326.071,97 | 69.322.645,25 | 1.426.328,45 | 2,10%       | 0,75%    | 279,96% | 1,81%   |
| Março            | 69.322.645,25  | 6.627.494,43 | 7.527.639,13 | 69.109.336,77 | 686.836,22   | 0,99%       | 0,78%    | 126,28% | 1,87%   |
| Abril            | 69.109.336,77  | 5.025.461,99 | 875.866,66   | 73.621.661,68 | 362.729,58   | 0,50%       | 0,56%    | 88,79%  | 1,56%   |
| Mai              | 73.621.661,68  | 4.436.691,45 | 3.968.770,50 | 73.737.801,50 | -351.781,13  | -0,47%      | 0,82%    | -57,79% | 8,08%   |
| Junho            | 73.737.801,50  | 7.441.430,30 | 7.323.294,51 | 74.155.478,64 | 299.541,35   | 0,41%       | 0,26%    | 158,65% | 1,91%   |
| Julho            | 74.155.478,64  | 2.253.102,45 | 3.660.464,18 | 74.952.921,74 | 2.204.804,83 | 2,97%       | 0,73%    | 408,45% | 1,74%   |
| Agosto           | 74.952.921,74  | 2.067.729,33 | 2.381.517,20 | 76.016.796,89 | 1.377.663,02 | 1,84%       | 0,72%    | 253,79% | 1,93%   |
| Acumulado no ano |                |              |              |               | 7.189.769,83 | 10,50%      | 5,65%    | 185,92% |         |

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de agosto / 2017

| Ativos de Renda Fixa  | Sado Anterior | Aplicações   | Resgates     | Saldo Atual   | Retorno (R\$)     | Retorno (%)  | VaR - Mês (%) | Instituição(%) |
|---|---------------|--------------|--------------|---------------|-------------------|--------------|---------------|----------------|
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | 1.108.355,02  | 0,00         | 29.128,19    | 1.098.051,53  | 18.824,70         | 1,70%        | 4,25%         | -0,93%         |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | 722.289,85    | 0,00         | 19.184,57    | 714.456,67    | 11.351,39         | 1,57%        | 1,19%         | 1,60%          |
| CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP                   | 7.312.011,34  | 0,00         | 0,00         | 7.411.255,99  | 99.244,65         | 1,36%        | 1,76%         | 1,36%          |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | 2.139.147,85  | 0,00         | 0,00         | 2.167.769,38  | 28.621,53         | 1,34%        | 2,65%         | 1,34%          |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP     | 4.597.635,89  | 0,00         | 0,00         | 4.658.796,20  | 61.160,31         | 1,33%        | 2,64%         | 1,33%          |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP        | 7.604.436,27  | 0,00         | 0,00         | 7.705.338,57  | 100.902,30        | 1,33%        | 1,81%         | 1,33%          |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO      | 1.577.009,32  | 0,00         | 0,00         | 1.597.866,74  | 20.857,42         | 1,32%        | 1,81%         | 1,32%          |
| GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA                         | 658.069,84    | 0,00         | 0,00         | 666.288,92    | 8.219,08          | 1,25%        | 1,91%         | 1,25%          |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP      | 11.482.642,27 | 0,00         | 0,00         | 11.624.986,27 | 142.344,00        | 1,24%        | 0,72%         | 1,24%          |
| CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | 1.092.807,46  | 0,00         | 29.025,62    | 1.075.127,73  | 11.345,89         | 1,04%        | 4,13%         | -1,62%         |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP        | 7.428.153,01  | 0,00         | 0,00         | 7.502.953,34  | 74.800,33         | 1,01%        | 0,99%         | 1,01%          |
| BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI                | 1.073.221,41  | 0,00         | 0,00         | 1.083.824,31  | 10.602,90         | 0,99%        | 0,07%         | 0,99%          |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | 667.737,08    | 0,00         | 0,00         | 674.309,73    | 6.572,65          | 0,98%        | 0,49%         | 0,98%          |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 2.199.021,81  | 0,00         | 0,00         | 2.220.219,93  | 21.198,12         | 0,96%        | 0,49%         | 0,96%          |
| CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA          | 1.293.470,00  | 0,00         | 37.262,09    | 1.268.429,00  | 12.221,09         | 0,94%        | 4,50%         | -1,94%         |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO    | 1.295.652,01  | 0,00         | 36.440,65    | 1.271.313,80  | 12.102,44         | 0,93%        | 0,18%         | 0,95%          |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | 660.960,17    | 0,00         | 456,29       | 666.301,36    | 5.797,48          | 0,88%        | 0,08%         | 0,88%          |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                     | 4.018.174,67  | 57.725,22    | 0,00         | 4.107.978,55  | 32.078,66         | 0,79%        | 0,00%         | 0,79%          |
| CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | 2.127.229,07  | 0,00         | 57.835,85    | 2.083.709,80  | 14.316,58         | 0,67%        | 4,29%         | -2,05%         |
| CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP                 | 3.598.485,18  | 1.959.649,33 | 390.071,22   | 5.196.755,03  | 28.691,74         | 0,52%        | 0,00%         | 0,78%          |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | 3.044.172,89  | 50.354,78    | 1.780.012,72 | 1.327.950,22  | 13.435,27         | 0,43%        | 0,08%         | 0,89%          |
| <b>Total Renda Fixa</b>                                     |               |              |              |               | <b>734.688,53</b> | <b>1,12%</b> | <b>1,38%</b>  |                |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de agosto / 2017

| Ativos de Renda Variável                | Sado Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual  | Retorno (R\$) | Retorno (%) | VaR - Mês (%) | Instituição(%) |
|---|---------------|------------|----------|--------------|---------------|-------------|---------------|----------------|
| CAIXA CONSUMO FI AÇÕES                  | 2.404.703,03  | 0,00       | 0,00     | 2.620.343,13 | 215.640,10    | 8,97%       | 5,19%         | 8,97%          |
| CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES    | 750.853,26    | 0,00       | 0,00     | 814.842,58   | 63.989,32     | 8,52%       | 3,51%         | 8,52%          |
| ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES    | 1.291.618,96  | 0,00       | 0,00     | 1.394.488,48 | 102.869,52    | 7,96%       | 5,79%         | 7,96%          |
| CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES          | 514.541,94    | 0,00       | 0,00     | 552.246,28   | 37.704,34     | 7,33%       | 5,74%         | 7,33%          |
| BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES             | 1.976.513,40  | 0,00       | 0,00     | 2.091.814,42 | 115.301,02    | 5,83%       | 5,27%         | 5,83%          |
| CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES           | 1.986.201,57  | 0,00       | 0,00     | 2.091.400,34 | 105.198,77    | 5,30%       | 7,74%         | 5,30%          |
| BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11 | 327.807,17    | 0,00       | 2.100,00 | 327.978,59   | 2.271,42      | 0,69%       | -             | 0,00%          |
| Total Renda Variável                    |               |            |          |              | 642.974,49    | 6,95%       | 5,74%         |                |