

# Relatório Analítico dos Investimentos em outubro de 2019



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 (outubro / 2019)

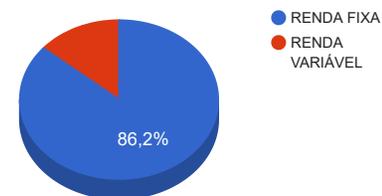
| Produto / Fundo   | Disponibilidade Resgate | Carência      | Saldo                 | Particip. S/ Total | Qtde. Cotistas | % S/ PL Fundo | RESOLUÇÃO<br>3.922 / 4.392 / 4.604  |
|---|-------------------------|---------------|-----------------------|--------------------|----------------|---------------|-------------------------------------|
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0                     | Não há        | 86.204.076,89         | 18,49%             | 943            | 0,99%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO    | D+0                     | 15/08/2022    | 15.505.409,55         | 3,33%              | 115            | 2,97%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA               | D+0                     | Não possui    | 93.208.004,02         | 20,00%             | 668            | 1,08%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP      | D+0                     | Não há        | 74.260.585,67         | 15,93%             | 924            | 0,73%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | D+0                     | Não há        | 1.462.927,39          | 0,31%              | 1.208          | 0,02%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP        | D+0                     | Não há        | 44.325.394,46         | 9,51%              | 966            | 0,61%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP     | D+0                     | Não há        | 54.108.218,10         | 11,61%             | 369            | 1,63%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO        | D+0                     | 15/08/2022    | 3.930.473,60          | 0,84%              | 165            | 0,58%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | D+0                     | Não há        | 5.445.966,45          | 1,17%              | 1.372          | 0,05%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP               | D+0                     | Não há        | 8.288.258,72          | 1,78%              | 738            | 0,17%         | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "  |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO         | D+0                     | 3 anos        | 4.544.466,03          | 0,97%              | 76             | 2,56%         | Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b " |
| BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO    | D+30 ou D+30 a D+2880   | Não há        | 10.613.964,69         | 2,28%              | 74             | 1,83%         | Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES                              | D+4                     | Não há        | 24.464.403,90         | 5,25%              | 97             | 5,33%         | Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "   |
| CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES                                | D+4                     | Não há        | 18.229.380,50         | 3,91%              | 89             | 2,31%         | Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "   |
| BB GOVERNANÇA FI AÇÕES                                      | D+4                     | Não há        | 1.504.784,03          | 0,32%              | 191            | 0,24%         | Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "   |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO | D+2                     | 02/01/2020    | 5.779.635,00          | 1,24%              | 729            | 2,01%         | Artigo 8º, Inciso III               |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP                    | D+4                     | Não há        | 5.157.937,43          | 1,11%              | 16.354         | 0,14%         | Artigo 8º, Inciso III               |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO   | D+2                     | 01/10/2020    | 3.426.398,36          | 0,74%              | 955            | 0,69%         | Artigo 8º, Inciso III               |
| CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP                              | D+4                     | Não há        | 3.184.836,78          | 0,68%              | 7.105          | 0,35%         | Artigo 8º, Inciso III               |
| BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11                     | Não se aplica           | Não se aplica | 2.480.407,07          | 0,53%              |                | 0,10%         | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "  |
| <b>Total</b>  |                         |               | <b>466.125.528,64</b> |                    |                |               |                                     |

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

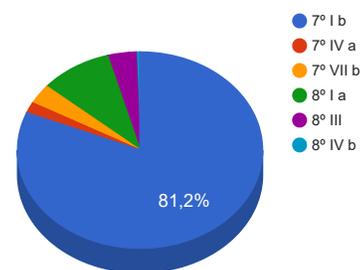
| Artigos                             | Resolução % | Carteira \$           | Carteira % | Estratégia de Alocação |        |            | GAP Superior   |
|-------------------------------------|-------------|-----------------------|------------|------------------------|--------|------------|----------------|
|                                     |             |                       |            | Inferior %             | Alvo % | Superior % |                |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   | 100,00%     | 378.451.056,13        | 81,19%     | 15,00%                 | 50,00% | 90,00%     | 41.061.919,65  |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 60,00%      | 0,00                  | 0,00%      | 0,00%                  | 1,00%  | 30,00%     | 139.837.658,59 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "  | 40,00%      | 8.288.258,72          | 1,78%      | 5,00%                  | 28,00% | 35,00%     | 154.855.676,30 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b " | 5,00%       | 15.158.430,72         | 3,25%      | 1,00%                  | 3,00%  | 5,00%      | 8.147.845,71   |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "   | 30,00%      | 44.198.568,43         | 9,48%      | 2,00%                  | 11,00% | 15,00%     | 25.720.260,87  |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "  | 20,00%      | 0,00                  | 0,00%      | 0,00%                  | 1,00%  | 5,00%      | 23.306.276,43  |
| Artigo 8º, Inciso III               | 10,00%      | 17.548.807,57         | 3,76%      | 1,00%                  | 4,00%  | 10,00%     | 29.063.745,29  |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "  | 5,00%       | 2.480.407,07          | 0,53%      | 0,00%                  | 1,00%  | 5,00%      | 20.825.869,36  |
| Artigo 9º - A, Inciso III           | 10,00%      | 0,00                  | 0,00%      | 0,00%                  | 1,00%  | 5,00%      | 23.306.276,43  |
| <b>Total Carteira</b>               |             | <b>466.125.528,64</b> |            |                        |        |            |                |

|                |                |        |
|----------------|----------------|--------|
| RENDA FIXA     | 401.897.745,57 | 86,22% |
| RENDA VARIÁVEL | 64.227.783,07  | 13,78% |

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

| Artigos                             | Base: outubro / 2019  |                | Limite Inferior (%) | Limite Superior (%) |
|-------------------------------------|-----------------------|----------------|---------------------|---------------------|
|                                     | Carteira (\$)         | Carteira (%)   |                     |                     |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   | 378.451.056,13        | 81,19%         | 15,00%              | 90,00%              |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 0,00                  | 0,00%          | 0,00%               | 30,00%              |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "  | 8.288.258,72          | 1,78%          | 5,00%               | 35,00%              |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "  | 0,00                  | 0,00%          | 0,00%               | 5,00%               |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a " | 0,00                  | 0,00%          | 0,00%               | 5,00%               |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b " | 15.158.430,72         | 3,25%          | 1,00%               | 5,00%               |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "   | 44.198.568,43         | 9,48%          | 2,00%               | 15,00%              |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "  | 0,00                  | 0,00%          | 0,00%               | 5,00%               |
| Artigo 8º, Inciso III               | 17.548.807,57         | 3,76%          | 1,00%               | 10,00%              |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "  | 0,00                  | 0,00%          | 0,00%               | 5,00%               |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "  | 2.480.407,07          | 0,53%          | 0,00%               | 5,00%               |
| Artigo 9º - A, Inciso III           | 0,00                  | 0,00%          | 0,00%               | 5,00%               |
| <b>Total</b>                        | <b>466.125.528,64</b> | <b>100,00%</b> | <b>24,00</b>        | <b>215,00</b>       |

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (outubro / 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    | 430.627.562,31 | 92,38%        | 0,08%          |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 33.017.559,26  | 7,08%         | 0,00%          |
| RIO BRAVO INVESTIMENTOS    | 2.480.407,07   | 0,53%         | 0,12%          |

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

|   | Mês   | Ano    | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|---|-------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| IMA-B 5+  | 4,67% | 32,45% | 7,73%   | 20,86%  | 37,00%   | 51,90%   | -        | -         | -                       |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP     | 4,65% | 31,99% | 7,65%   | 20,61%  | 36,37%   | 50,74%   | 0,20%    | 2,793%    | 7,89%                   |
| IMA-B   | 3,36% | 23,57% | 5,89%   | 15,34%  | 26,74%   | 39,79%   | -        | -         | -                       |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP        | 3,33% | 23,33% | 5,82%   | 15,17%  | 26,47%   | 39,19%   | 0,20%    | 1,925%    | 5,33%                   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO        | 1,05% | 8,98%  | 2,32%   | 5,19%   | 10,43%   | 20,61%   | 0,20%    | 0,581%    | 1,31%                   |
| IMA-B 5   | 1,65% | 12,09% | 3,47%   | 7,74%   | 13,78%   | 24,36%   | -        | -         | -                       |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP      | 1,64% | 11,89% | 3,42%   | 7,63%   | 13,58%   | 23,88%   | 0,20%    | 0,974%    | 2,06%                   |
| IDKA IPCA 2 Anos  | 1,23% | 10,48% | 2,93%   | 6,70%   | 12,06%   | 22,98%   | -        | -         | -                       |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,28% | 9,97%  | 2,82%   | 6,15%   | 11,39%   | 21,52%   | 0,20%    | 0,763%    | 1,54%                   |
| IPCA + 6,00% ao ano   | 0,63% | 7,75%  | 1,71%   | 3,57%   | 8,69%    | 20,40%   | -        | -         | -                       |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO         | 2,29% | 16,09% | 4,59%   | 11,19%  | 17,59%   | 26,01%   | 0,20%    | 1,442%    | 3,28%                   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO    | 1,52% | 12,32% | 3,29%   | 7,65%   | 14,34%   | 34,18%   | 0,20%    | 0,948%    | 2,07%                   |
| IRF-M 1   | 0,62% | 5,96%  | 1,83%   | 3,85%   | 7,13%    | 14,70%   | -        | -         | -                       |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | 0,61% | 5,79%  | 1,77%   | 3,74%   | 6,93%    | 14,31%   | 0,20%    | 0,148%    | 0,27%                   |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | 0,60% | 5,75%  | 1,75%   | 3,71%   | 6,87%    | 14,19%   | 0,10%    | 0,149%    | 0,27%                   |
| CDI   | 0,48% | 5,16%  | 1,45%   | 3,06%   | 6,20%    | 13,16%   | -        | -         | -                       |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP               | 0,45% | 5,02%  | 1,39%   | 2,96%   | 6,04%    | 12,77%   | 0,20%    | 0,008%    | 0,12%                   |

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

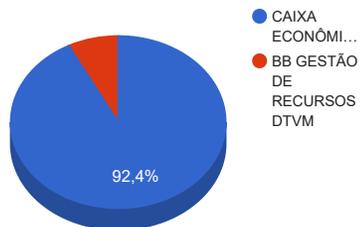
|  | Mês   | Ano    | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|--|-------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| IPCA   | 0,10% | 2,60%  | 0,17%   | 0,50%   | 2,54%    | 7,21%    | -        | -         | -                       |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA            | 1,71% | 16,33% | 3,73%   | 10,67%  | 18,32%   | 26,77%   | 0,002    | 1,122%    | 3,53%                   |
| BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO | 1,51% | 11,19% | 3,32%   | 6,84%   | 12,79%   | 24,85%   | 0,20%    | 0,881%    | 1,66%                   |

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

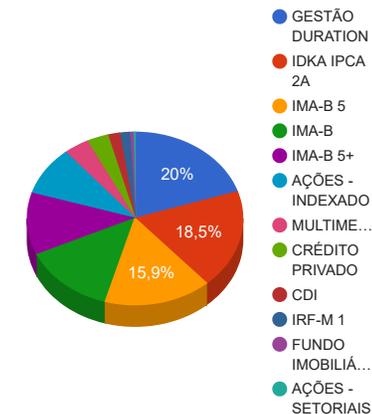
|   | Mês   | Ano    | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|---|-------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| IFIX  | 4,01% | 18,73% | 4,98%   | 11,30%  | 24,51%   | 25,41%   | -        | -         | -                       |
| BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11                     | 0,00% | 0,00%  | 0,00%   | 0,00%   | 0,00%    | 0,00%    | 0,30%    | -         | -                       |
| IGC   | 2,54% | 26,29% | 6,80%   | 15,22%  | 28,11%   | 44,60%   | -        | -         | -                       |
| BB GOVERNANÇA FI AÇÕES                                      | 2,80% | 23,27% | 6,44%   | 13,12%  | 25,46%   | 43,30%   | 1,00%    | 8,183%    | 11,04%                  |
| Ibovespa  | 2,36% | 22,00% | 5,31%   | 11,28%  | 22,64%   | 44,29%   | -        | -         | -                       |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO | 3,09% | 7,18%  | 3,90%   | 5,52%   | 8,72%    | -        | 1,60%    | 1,241%    | 2,66%                   |
| CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES                              | 2,29% | 21,43% | 5,16%   | 10,99%  | 22,09%   | 42,76%   | 0,50%    | 8,331%    | 11,67%                  |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO   | 0,35% | 6,72%  | 1,56%   | 4,57%   | 9,07%    | -        | 1,60%    | 2,455%    | 1,29%                   |
| IBX-50  | 2,18% | 20,18% | 4,87%   | 10,15%  | 20,18%   | 41,48%   | -        | -         | -                       |
| CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES                                | 2,19% | 19,63% | 4,87%   | 10,53%  | 19,06%   | 37,79%   | 0,70%    | 8,566%    | 12,01%                  |
| CDI   | 0,48% | 5,16%  | 1,45%   | 3,06%   | 6,20%    | 13,16%   | -        | -         | -                       |
| CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP                              | 1,19% | 10,02% | 2,83%   | 5,74%   | 10,92%   | 20,66%   | 1,00%    | 2,458%    | 3,40%                   |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP                    | 0,87% | 14,79% | 3,01%   | 8,89%   | 16,83%   | 27,11%   | 0,50%    | 1,480%    | 3,40%                   |

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

| Administrador              | Valor          | %      |
|----------------------------|----------------|--------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL    | 430.627.562,31 | 92,38% |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 35.497.966,33  | 7,62%  |

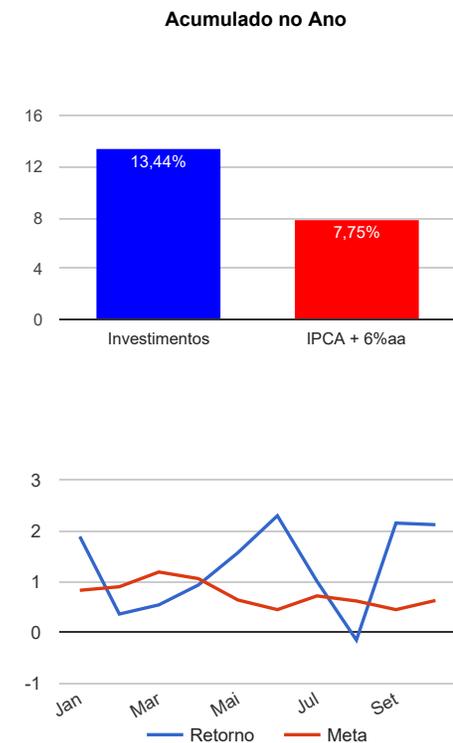


| Sub-segmento      | Valor         | %      |
|-------------------|---------------|--------|
| GESTÃO DURATION   | 93.208.004,02 | 20,00% |
| IDKA IPCA 2A      | 86.204.076,89 | 18,49% |
| IMA-B 5           | 74.260.585,67 | 15,93% |
| IMA-B             | 63.761.277,61 | 13,68% |
| IMA-B 5+          | 54.108.218,10 | 11,61% |
| AÇÕES - INDEXADO  | 42.693.784,40 | 9,16%  |
| MULTIMERCADO      | 17.548.807,57 | 3,76%  |
| CRÉDITO PRIVADO   | 15.158.430,72 | 3,25%  |
| CDI               | 8.288.258,72  | 1,78%  |
| IRF-M 1           | 6.908.893,84  | 1,48%  |
| FUNDO IMOBILIÁRIO | 2.480.407,07  | 0,53%  |
| AÇÕES - SETORIAIS | 1.504.784,03  | 0,32%  |



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

| Mês              | Saldo Anterior | Aplicações    | Resgates      | Saldo Atual    | Retorno (\$)  | Retorno (%) | Meta (%) | Gap (%) | VaR (%) |
|------------------|----------------|---------------|---------------|----------------|---------------|-------------|----------|---------|---------|
| Janeiro          | 389.532.929,62 | 58.367.638,88 | 53.792.246,74 | 401.544.963,80 | 7.436.642,04  | 1,89%       | 0,83%    | 226,90% | 1,19%   |
| Fevereiro        | 401.544.963,80 | 23.042.199,51 | 21.631.720,60 | 404.420.435,99 | 1.464.993,28  | 0,36%       | 0,90%    | 40,60%  | 1,66%   |
| Março            | 404.420.435,99 | 4.412.933,34  | 3.043.627,51  | 407.996.984,75 | 2.207.242,93  | 0,54%       | 1,19%    | 45,57%  | 2,53%   |
| Abril            | 407.996.984,75 | 8.549.454,06  | 5.129.100,00  | 415.261.525,93 | 3.844.187,12  | 0,93%       | 1,06%    | 88,19%  | 1,39%   |
| Mai              | 415.261.525,93 | 20.321.082,78 | 18.142.980,00 | 423.988.964,20 | 6.549.335,49  | 1,57%       | 0,64%    | 244,89% | 1,76%   |
| Junho            | 423.988.964,20 | 45.064.216,91 | 43.206.000,00 | 435.624.895,69 | 9.777.714,58  | 2,30%       | 0,45%    | 509,85% | 2,09%   |
| Julho            | 435.624.895,69 | 13.861.849,71 | 11.823.695,15 | 442.078.386,06 | 4.415.335,81  | 1,01%       | 0,72%    | 139,30% | 1,46%   |
| Agosto           | 442.078.386,06 | 5.563.459,70  | 4.123.183,97  | 442.864.075,25 | -654.586,54   | -0,15%      | 0,62%    | -23,78% | 2,53%   |
| Setembro         | 442.864.075,25 | 4.490.117,74  | 3.279.400,00  | 453.627.311,89 | 9.552.518,90  | 2,15%       | 0,45%    | 481,71% | 1,69%   |
| Outubro          | 453.627.311,89 | 6.114.499,75  | 3.293.400,00  | 466.125.528,64 | 9.677.117,00  | 2,12%       | 0,63%    | 334,52% | 1,98%   |
| Acumulado no ano |                |               |               |                | 54.270.500,61 | 13,44%      | 7,75%    | 173,44% |         |



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

| 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     | 51.706.411,63 | 0,00         | 0,00         | 54.108.218,10 | 2.401.806,47        | 4,65%        | 2,79%         | 4,65%          |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP        | 42.898.858,88 | 0,00         | 0,00         | 44.325.394,46 | 1.426.535,58        | 3,33%        | 1,92%         | 3,33%          |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO         | 4.442.741,55  | 0,00         | 0,00         | 4.544.466,03  | 101.724,48          | 2,29%        | 1,44%         | 2,29%          |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA               | 91.640.625,99 | 0,00         | 0,00         | 93.208.004,02 | 1.567.378,03        | 1,71%        | 1,12%         | 1,71%          |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP      | 73.062.933,48 | 0,00         | 0,00         | 74.260.585,67 | 1.197.652,19        | 1,64%        | 0,97%         | 1,64%          |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO    | 15.273.913,50 | 0,00         | 0,00         | 15.505.409,55 | 231.496,05          | 1,52%        | 0,95%         | 1,52%          |
| BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO    | 10.455.964,88 | 0,00         | 0,00         | 10.613.964,69 | 157.999,81          | 1,51%        | 0,88%         | 1,51%          |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 85.117.503,74 | 0,00         | 0,00         | 86.204.076,89 | 1.086.573,15        | 1,28%        | 0,76%         | 1,28%          |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO        | 3.889.752,88  | 0,00         | 0,00         | 3.930.473,60  | 40.720,72           | 1,05%        | 0,58%         | 1,05%          |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | 1.403.886,02  | 50.503,83    | 0,00         | 1.462.927,39  | 8.537,54            | 0,59%        | 0,15%         | 0,60%          |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | 8.619.995,15  | 49.501,32    | 3.273.000,00 | 5.445.966,45  | 49.469,98           | 0,57%        | 0,15%         | 0,61%          |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP               | 2.244.540,47  | 6.014.494,60 | 0,00         | 8.288.258,72  | 29.223,65           | 0,35%        | 0,01%         | 0,45%          |
| <b>Total Renda Fixa</b>                                     |               |              |              |               | <b>8.299.117,65</b> | <b>2,11%</b> | <b>1,28%</b>  |                |

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

| Ativos de Renda Variável                                    | Sado Anterior | Aplicações | Resgates  | Saldo Atual   | Retorno (R\$) | Retorno (%) | VaR - Mês (%) | Instituição(%) |
|---|---------------|------------|-----------|---------------|---------------|-------------|---------------|----------------|
| BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11                     | 2.370.388,36  | 0,00       | 20.400,00 | 2.480.407,07  | 130.418,71    | 5,50%       | -             | 0,00%          |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO | 5.606.235,00  | 0,00       | 0,00      | 5.779.635,00  | 173.400,00    | 3,09%       | 1,24%         | 3,09%          |
| BB GOVERNANÇA FI AÇÕES                                      | 1.463.864,97  | 0,00       | 0,00      | 1.504.784,03  | 40.919,06     | 2,80%       | 8,18%         | 2,80%          |
| CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES                              | 23.915.773,27 | 0,00       | 0,00      | 24.464.403,90 | 548.630,63    | 2,29%       | 8,33%         | 2,29%          |
| CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES                                | 17.838.503,86 | 0,00       | 0,00      | 18.229.380,50 | 390.876,64    | 2,19%       | 8,57%         | 2,19%          |
| CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP                              | 3.147.350,78  | 0,00       | 0,00      | 3.184.836,78  | 37.486,00     | 1,19%       | 2,46%         | 1,19%          |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP                    | 5.113.526,29  | 0,00       | 0,00      | 5.157.937,43  | 44.411,14     | 0,87%       | 1,48%         | 0,87%          |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO   | 3.414.541,19  | 0,00       | 0,00      | 3.426.398,36  | 11.857,17     | 0,35%       | 2,46%         | 0,35%          |
| Total Renda Variável  |               |            |           |               | 1.377.999,35  | 2,19%       | 6,53%         |                |