

Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2019



Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2019)

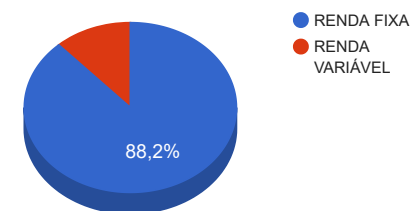
| Produto / Fundo | Disponibilidade Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Qtde. Cotistas | % S/ PL Fundo | RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604 |
|---|-------------------------|----------------|----------------------|--------------------|----------------|---------------|------------------------------------|
| TÍTULOS PÚBLICOS | | | 5.157.395,32 | 12,25% | | | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a " |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 3.877.134,06 | 9,21% | 799 | 0,05% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | Não há | 2.873.106,67 | 6,83% | 1.249 | 0,03% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | D+0 | Não há | 440.788,73 | 1,05% | 301 | 0,03% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | 15/08/2018 | 142.750,80 | 0,34% | 95 | 0,12% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 5.402.222,01 | 12,83% | 762 | 0,06% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA | D+1 | Não há | 1.998.599,52 | 4,75% | 25 | 1,29% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | D+0 | Não há | 4.893.893,87 | 11,63% | 1.463 | 0,03% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | D+0 | Não há | 3.041.396,43 | 7,23% | 405 | 0,04% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP | D+3 | Não há | 3.061.156,62 | 7,27% | 400 | 1,22% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | D+0 | Não há | 513.162,87 | 1,22% | 826 | 0,01% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA | D+0 | Não possui | 5.273.357,05 | 12,53% | 387 | 0,13% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA | D+0 | Não há | 455.267,83 | 1,08% | 313 | 0,07% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| SANTANDER PETROBRÁS PLUS FIC AÇÕES | D+4 | Não há | 1.022.585,74 | 2,43% | 1.571 | 1,79% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " |
| BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP | D+4 | Não há | 3.941.593,35 | 9,36% | 224 | 0,73% | Artigo 8º, Inciso III |
| | | TOTAL - | 42.094.410,87 | | | | |

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

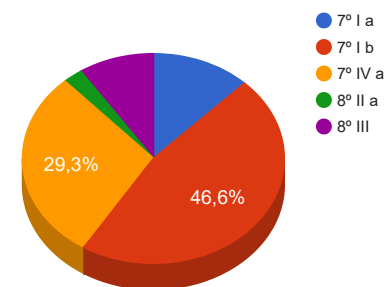
| Artigos - Renda Fixa | Resolução % | Carteira \$ | Carteira % | Estratégia de Alocação | | | GAP Superior |
|-------------------------------------|-------------|----------------------|------------|------------------------|--------|------------|---------------|
| | | | | Inferior % | Alvo % | Superior % | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a " | 100,00% | 5.157.395,32 | 12,25% | 0,00% | 0,00% | 20,00% | 3.261.486,85 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " | 100,00% | 19.628.495,66 | 46,63% | 15,00% | 35,00% | 70,00% | 9.837.591,95 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 60,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 10,00% | 55,00% | 23.151.925,98 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " | 40,00% | 12.344.340,80 | 29,33% | 10,00% | 25,00% | 40,00% | 4.493.423,55 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a " | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 5,00% | 2.104.720,54 |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " | 20,00% | 1.022.585,74 | 2,43% | 0,00% | 5,00% | 20,00% | 7.396.296,43 |
| Artigo 8º, Inciso III | 10,00% | 3.941.593,35 | 9,36% | 7,00% | 10,00% | 10,00% | 267.847,74 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a " | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 5,00% | 2.104.720,54 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b " | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 5,00% | 2.104.720,54 |
| Total Carteira | | 42.094.410,87 | | | | | |

| | | |
|----------------|---------------|--------|
| RENDA FIXA | 37.130.231,78 | 88,21% |
| RENDA VARIÁVEL | 4.964.179,09 | 11,79% |

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

| Artigos - Renda Fixa | Base: fevereiro / 2019 | | Limite Inferior (%) | Limite Superior (%) |
|-------------------------------------|------------------------|----------------|---------------------|---------------------|
| | Carteira (\$) | Carteira (%) | | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a " | 5.157.395,32 | 12,25% | 0,00% | 20,00% |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " | 19.628.495,66 | 46,63% | 15,00% | 70,00% |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 55,00% |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " | 12.344.340,80 | 29,33% | 10,00% | 40,00% |
| 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 " | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c " | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " | 1.022.585,74 | 2,43% | 0,00% | 20,00% |
| Artigo 8º, Inciso III | 3.941.593,35 | 9,36% | 7,00% | 10,00% |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a " | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b " | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% |
| Total Renda Fixa | 42.094.410,87 | 100,00% | 32,00 | 245,00 |

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (fevereiro / 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)

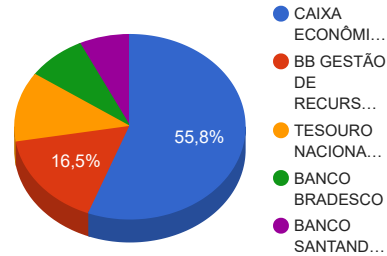
| Gestão | Valor | % s/ Carteira | % s/ PL Gestão |
|-------------------------------------|---------------|---------------|----------------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | 23.476.194,31 | 55,77% | 0,01% |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 6.957.450,82 | 16,53% | 0,00% |
| TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS) | 5.157.395,32 | 12,25% | - |
| BRANCO ASSET MANAGEMENT | 3.482.185,16 | 8,27% | 0,00% |
| SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT | 3.021.185,26 | 7,18% | 0,00% |

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

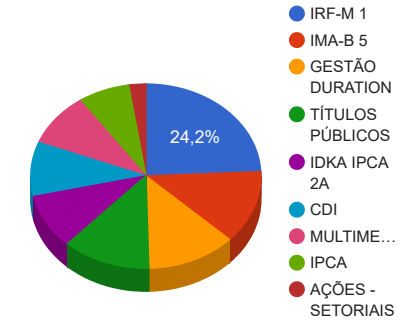
Dados atualizados dos Benchmark's dos Fundos, referente à base (fevereiro / 2019) ainda não disponíveis.

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

| Administrador | Valor | % |
|-------------------------------------|---------------|--------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | 23.476.194,31 | 55,77% |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 6.957.450,82 | 16,53% |
| TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS) | 5.157.395,32 | 12,25% |
| BANCO BRADESCO | 3.482.185,16 | 8,27% |
| BANCO SANTANDER | 3.021.185,26 | 7,18% |



| Sub-segmento | Valor | % |
|-------------------|---------------|--------|
| IRF-M 1 | 10.206.388,79 | 24,25% |
| IMA-B 5 | 5.402.222,01 | 12,83% |
| GESTÃO DURATION | 5.273.357,05 | 12,53% |
| TÍTULOS PÚBLICOS | 5.157.395,32 | 12,25% |
| IDKA IPCA 2A | 4.019.884,86 | 9,55% |
| CDI | 4.009.827,13 | 9,53% |
| MULTIMERCADO | 3.941.593,35 | 9,36% |
| IPCA | 3.061.156,62 | 7,27% |
| AÇÕES - SETORIAIS | 1.022.585,74 | 2,43% |



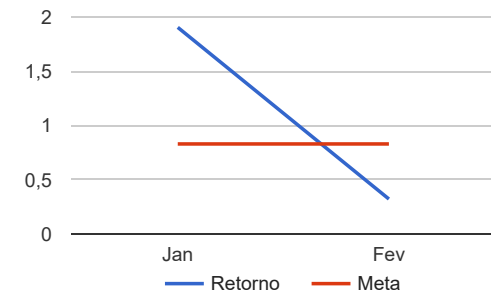
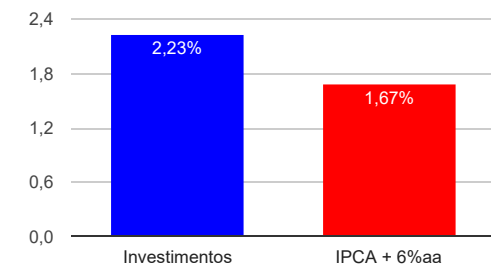
Carteira de Títulos Públicos - base (fevereiro / 2019)

| Títulos Públicos | Vencimento | Compra | Qtde. | P.U. Compra | P.U. Atual | \$ Pago | \$ Atual | GAP (Atual - Pago) |
|--|------------|------------|-------|--------------|--------------|------------|--------------|--------------------|
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2024 | 11/08/2004 | 500 | 1.487,344824 | 3.469,827471 | 743.672,41 | 1.734.913,74 | 991.241,32 |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2024 | 02/12/2004 | 270 | 1.494,58526 | 3.469,827471 | 403.538,02 | 936.853,42 | 533.315,40 |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2045 | 02/03/2009 | 630 | 1.104,73659 | 3.945,441532 | 695.984,05 | 2.485.628,17 | 1.789.644,11 |

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

| Mês | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (\$) | Retorno (%) | Meta (%) | Gap (%) | VaR (%) |
|------------------|----------------|--------------|--------------|---------------|--------------|-------------|----------|---------|---------|
| Janeiro | 39.753.444,62 | 1.968.013,87 | 338.080,69 | 42.170.818,62 | 787.440,82 | 1,90% | 0,83% | 228,80% | 0,81% |
| Fevereiro | 42.170.818,62 | 3.793.921,55 | 4.006.614,18 | 42.094.410,87 | 136.284,88 | 0,32% | 0,83% | 38,86% | 0,96% |
| Acumulado no ano | | | | | 923.725,70 | 2,23% | 1,67% | 133,65% | |

Acumulado no Ano



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

| Ativos de Renda Fixa | Sado Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | VaR - Mês (%) | Instituição(%) |
|---|---------------|--------------|--------------|--------------|-------------------|--------------|---------------|----------------|
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 3.855.645,90 | 0,00 | 0,00 | 3.877.134,06 | 21.488,16 | 0,56% | 0,63% | 0,56% |
| CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP | 3.044.228,70 | 0,00 | 0,00 | 3.061.156,62 | 16.927,92 | 0,56% | 0,26% | 0,56% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 5.374.068,44 | 0,00 | 0,00 | 5.402.222,01 | 28.153,57 | 0,52% | 0,79% | 0,52% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA | 5.247.052,79 | 0,00 | 0,00 | 5.273.357,05 | 26.304,26 | 0,50% | 2,41% | 0,50% |
| BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 3.026.743,10 | 0,00 | 0,00 | 3.041.396,43 | 14.653,33 | 0,48% | 0,01% | 0,48% |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 510.695,80 | 0,00 | 0,00 | 513.162,87 | 2.467,07 | 0,48% | 0,00% | 0,48% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 142.079,68 | 0,00 | 0,00 | 142.750,80 | 671,12 | 0,47% | 0,00% | 0,47% |
| BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 438.833,31 | 0,00 | 0,00 | 440.788,73 | 1.955,42 | 0,45% | 0,09% | 0,45% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2.860.554,05 | 0,00 | 0,00 | 2.873.106,67 | 12.552,62 | 0,44% | 0,08% | 0,44% |
| SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA | 1.990.129,98 | 0,00 | 0,00 | 1.998.599,52 | 8.469,54 | 0,43% | 0,08% | 0,43% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 5.069.616,92 | 1.074.872,17 | 1.270.000,00 | 4.893.893,87 | 19.404,78 | 0,32% | 0,08% | 0,45% |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA | 471.344,06 | 2.719.049,38 | 2.736.614,18 | 455.267,83 | 1.488,57 | 0,05% | 0,00% | 0,43% |
| TÍTULOS PÚBLICOS | 5.207.097,55 | 0,00 | 0,00 | 5.157.395,32 | -49.702,23 | -0,95% | - | - |
| Total Renda Fixa | | | | | 104.834,13 | 0,28% | 0,66% | |

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

| Ativos de Renda Variável | Sado Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | VaR - Mês (%) | Instituição(%) |
|--------------------------------------|---------------|------------|----------|--------------|---------------|-------------|---------------|----------------|
| SANTANDER PETROBRÁS PLUS FIC AÇÕES | 1.014.436,12 | 0,00 | 0,00 | 1.022.585,74 | 8.149,62 | 0,80% | 12,74% | 0,80% |
| BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP | 3.918.292,22 | 0,00 | 0,00 | 3.941.593,35 | 23.301,13 | 0,59% | 0,30% | 0,59% |
| Total Renda Variável | | | | | 31.450,75 | 0,64% | 2,86% | |