

Relatório Analítico dos Investimentos

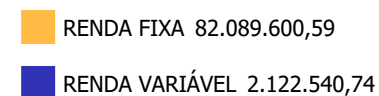
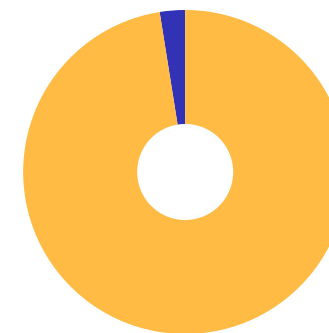
em fevereiro de 2019

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2019)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	10.217.756,11	12,13%	800	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	19.867.398,21	23,59%	1.249	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	18.996.170,22	22,56%	413	0,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	D+1	Não há	6.739.176,36	8,00%	60	4,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	5.407.718,01	6,42%	762	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	3.954.751,18	4,70%	538	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	5.841.176,52	6,94%	3.419	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	9.757.824,84	11,59%	387	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.307.629,14	1,55%	702	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	2.122.540,74	2,52%	224	0,39%	Artigo 8º, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			84.212.141,33				

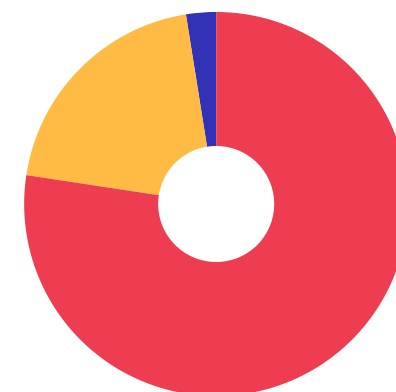
Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENTA FIXA) - base (Fevereiro / 2019)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	65.182.970,09	77,40%	50,00%	60,00%	100,00%	19.029.171,24
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	16.906.630,50	20,08%	0,00%	25,00%	40,00%	16.778.226,03
Total Renda Fixa	100,00%	82.089.600,59	97,48%	50,00%	85,00%	140,00%	



Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (REDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Fevereiro / 2019)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	16.842.428,27
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.122.540,74	2,52%	0,00%	10,00%	10,00%	6.298.673,39
Total Renda Variável	30,00%	2.122.540,74	2,52%	0,00%	15,00%	30,00%	



7º I b 7º IV a 8º III

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	56.466.245,60	67,05	0,00
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	15.165.542,85	18,01	0,00
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL	12.580.352,88	14,94	0,12

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)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	65.182.970,09	77,40	50,00	100,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	16.906.630,50	20,08	0,00	40,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	2.122.540,74	2,52	0,00	10,00

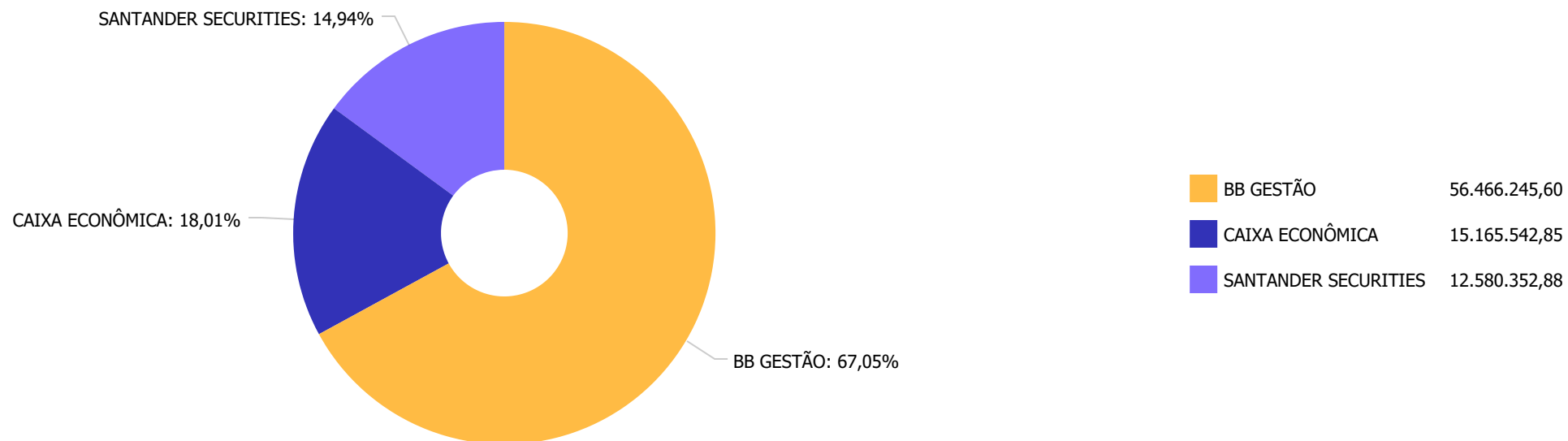
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2019 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,44%	2,36%	3,57%	8,62%	9,74%	21,94%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,39%	2,41%	3,60%	8,69%	9,81%	21,35%	0,01%	0,03%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,53%	1,80%	3,07%	6,69%	10,19%	23,90%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,61%	1,83%	3,07%	6,58%	9,55%	22,05%	0,01%	0,02%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,47%	1,05%	1,61%	3,73%	6,88%	17,40%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,44%	1,02%	1,56%	3,65%	6,66%	16,91%	0,00%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,55%	2,09%	3,49%	7,79%	10,10%	23,00%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,52%	2,07%	3,47%	7,74%	9,90%	22,57%	0,01%	0,03%
IMA-B (Benchmark)	0,55%	4,94%	6,67%	15,14%	14,11%	26,50%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,50%	4,87%	6,57%	14,95%	13,78%	25,82%	0,02%	0,06%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	0,54%	4,22%	5,77%	12,78%	12,18%	23,95%	0,02%	0,05%
CDI (Benchmark)	0,49%	1,04%	1,54%	3,07%	6,41%	15,93%	-	-
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	0,46%	1,02%	1,48%	2,91%	5,98%	15,17%	0,00%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,41%	0,86%	1,27%	2,53%	5,27%	13,53%	0,00%	0,00%

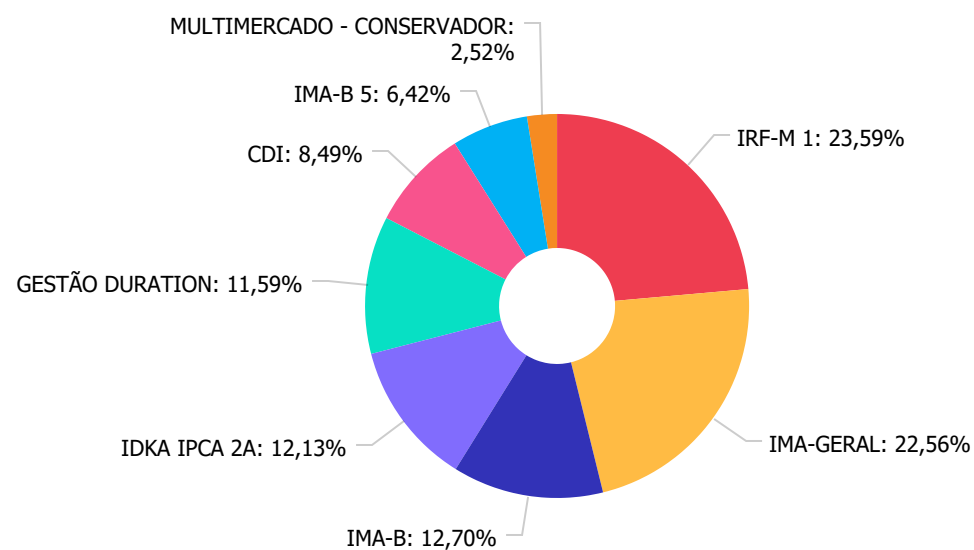
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2019 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,49%	1,04%	1,54%	3,07%	6,41%	15,93%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,60%	1,42%	1,85%	4,43%	7,48%	21,77%	0,00%	0,03%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Fevereiro / 2019)



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Fevereiro / 2019)

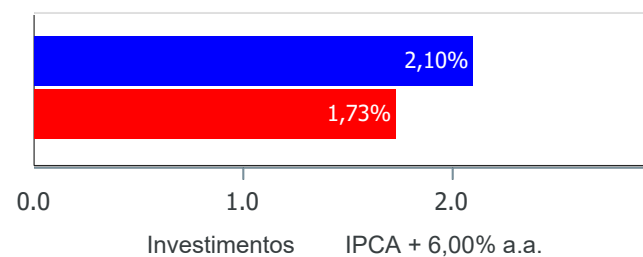


IRF-M 1	19.867.398,21
IMA-GERAL	18.996.170,22
IMA-B	10.693.927,54
IDKA IPCA 2A	10.217.756,11
GESTÃO DURATION	9.757.824,84
CDI	7.148.805,66
IMA-B 5	5.407.718,01
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	2.122.540,74

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019)

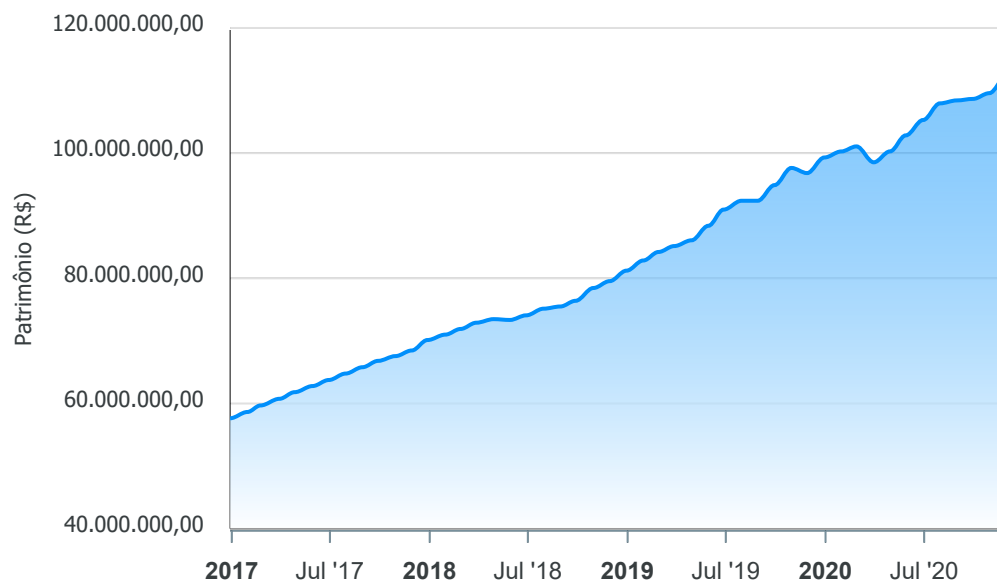
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	81.228.243,99	4.660.827,36	4.357.703,38	82.851.161,93	1.319.793,96	1.319.793,96	1,62%	1,62%	0,83%	0,83%	194,65%	0,71%
Fevereiro	82.851.161,93	3.662.305,57	2.697.530,49	84.212.141,33	396.204,32	1.715.998,28	0,47%	2,10%	0,90%	1,73%	121,02%	0,99%

Investimentos x Meta Atuarial



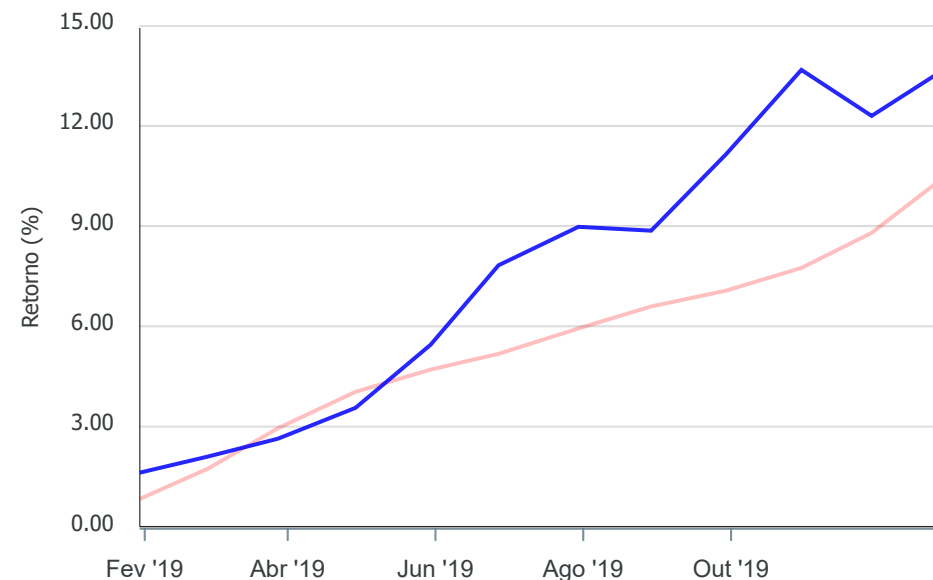
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



Investimentos Meta Atuarial ☐ CDI ☐ IMA-B ☐ IMA-B 5

☐ IMA-B 5+ ☐ IMA Geral ☐ IRF-M ☐ IRF-M 1 ☐ IRF-M 1+

☐ Ibovespa ☐ IBX ☐ SMLL ☐ IDIV

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	10.156.136,54	0,00	0,00	10.217.756,11	61.619,57	0,61%	0,61%	0,64%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	6.702.864,59	0,00	0,00	6.739.176,36	36.311,77	0,54%	0,54%	2,05%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.379.535,79	0,00	0,00	5.407.718,01	28.182,22	0,52%	0,52%	0,79%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	9.709.151,42	0,00	0,00	9.757.824,84	48.673,42	0,50%	0,50%	2,41%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	3.935.215,58	0,00	0,00	3.954.751,18	19.535,60	0,50%	0,50%	2,43%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	5.814.360,08	0,00	0,00	5.841.176,52	26.816,44	0,46%	0,46%	0,18%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	20.118.161,08	873.227,41	1.212.105,95	19.867.398,21	88.115,67	0,42%	0,44%	0,08%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	18.318.230,62	605.729,15	0,00	18.996.170,22	72.210,45	0,38%	0,39%	1,18%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	607.513,10	2.183.349,01	1.485.424,54	1.307.629,14	2.191,57	0,08%	0,41%	0,00%
Total Renda Fixa	80.741.168,80	3.662.305,57	2.697.530,49	82.089.600,59	383.656,71	0,47%		1,01%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	2.109.993,13	0,00	0,00	2.122.540,74	12.547,61	0,59%	0,59%	0,30%
Total Renda Variável	2.109.993,13	0,00	0,00	2.122.540,74	12.547,61	0,59%		0,30%