

Carteira consolidada de investimentos - base (janeiro / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			3.994,76	0,00%			Artigo 20
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	10.516.182,60	4,00%	26	4,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	5.303.236,00	2,02%	17	2,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	11.228.831,79	4,27%	223	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	6.181.125,65	2,35%	72	0,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2018	3.999.315,00	1,52%	163	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	17.196.886,00	6,54%	107	1,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	6.535.037,08	2,49%	6	13,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	13.547.244,86	5,15%	52	4,66%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	13.157.608,17	5,00%	167	1,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	D+0 ou D+1	Não há	1.907.086,05	0,73%	12	1,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	10.392.964,77	3,95%	94	2,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	17.431.423,27	6,63%	158	0,80%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.819.182,56	1,83%	1.083	8,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	5.664.937,25	2,15%	46	3,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	6.241.892,15	2,37%	122	0,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL INFLATION FIC RENDA FIXA	D+0 ou D+1 (de acordo com o	Não há	12.117.472,36	4,61%	98	8,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	montante resgatado) D+5	Não há	1.922.087,30	0,73%	90	0,21%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	187.593,01	0,07%	648	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.627.747,70	1,38%	63	0,25%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	11.893,23	0,00%	234	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	22.263.858,33	8,47%	123	2,72%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (janeiro / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	8,08	0,00%	736	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 7	Não se aplica	Não se aplica	46.323,81	0,02%	86	2,66%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	1.939.618,27	0,74%	98	1,90%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CARTÃO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	D+45 a D+75	Não há	4.725.394,04	1,80%	187	1,16%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	28.863,17	0,01%	47	0,09%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	2.464,40	0,00%		0,14%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	6.937.327,64	2,64%	60	1,59%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+31	Não há	5.678.993,39	2,16%	8.701	0,43%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	8.616.602,39	3,28%	3.921	1,75%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BRASIL PLURAL FIC AÇÕES	D+4 ou D+18 (isento de taxa de	Não há	5.343.261,00	2,03%	486	2,96%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB PIPE FIC AÇÕES	resgate) D+4	03/06/2018	520.690,57	0,20%	43	0,43%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	D+4	Não há	2.487.366,00	0,95%	15	1,81%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
XP DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.052.219,79	0,40%	1.005	2,36%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+33	Não há	3.579.070,84	1,36%	771	4,28%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	4.475.358,76	1,70%	261	0,70%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	6.021.073,32	2,29%	2.694	1,28%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	3.862.400,01	1,47%	6.316	0,99%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	469.953,90	0,18%	113	0,13%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	1.756.406,69	0,67%	15	0,49%	Artigo 8º, Inciso III
BRABESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.003.486,82	0,38%	6	1,01%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	820.518,90	0,31%	1.508	1,11%	Artigo 8º, Inciso III
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	310.669,66	0,12%	15	0,40%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "

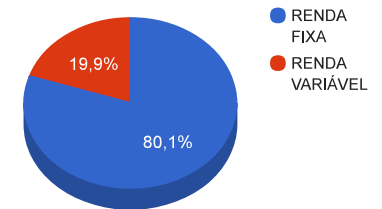
Carteira consolidada de investimentos - base (janeiro / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
NOVA RAPOSO MULTIESTRATÉGIA FIP - NVRP11	Não se aplica	Não se aplica	2.263.488,92	0,86%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	901.355,93	0,34%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BB VOTORANTIM INFRAESTRUTURA ENERGIA SUST II FIP - ESUD11	Não se aplica	Não se aplica	758.722,23	0,29%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	261.173,40	0,10%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
OURO PRETO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - ORPD11	Não se aplica	Não se aplica	2.202.719,55	0,84%		6,82%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11	Não se aplica	Não se aplica	1.060.155,80	0,40%		0,52%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	S/Info	Não se aplica	341.381,82	0,13%		0,02%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	15.374.929,29	5,85%	7	10,77%	Desenquadrado - RF
VOTORANTIM ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+361	Não há	5.832.350,12	2,22%	16	3,43%	Desenquadrado - RV
		TOTAL -	262.931.948,40				

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

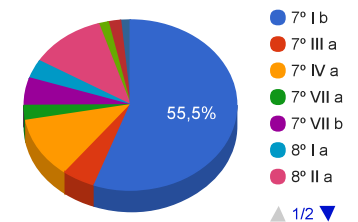
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	20,00%	52.586.389,68
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	134.122.953,20	51,01%	35,00%	40,00%	80,00%	76.222.605,52
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	12.117.472,36	4,61%	0,00%	5,00%	20,00%	40.468.917,32
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	28.013.187,65	10,65%	5,00%	15,00%	30,00%	50.866.396,87
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	6.742.663,69	2,56%	0,00%	2,00%	5,00%	6.403.933,73
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	12.616.321,03	4,80%	0,00%	5,00%	5,00%	530.276,39
Total Renda Fixa	100,00%	193.612.597,93	73,64%	40,00	70,00	160,00	-

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%	8.616.602,39	3,28%	0,00%	2,00%	2,00%	-3.357.963,42
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	27.811.394,19	10,58%	5,00%	15,00%	20,00%	24.774.995,49
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	3.580.412,41	1,36%	2,00%	5,00%	10,00%	22.712.782,43
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	4.495.410,14	1,71%	1,00%	3,00%	5,00%	8.651.187,28
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	3.604.257,17	1,37%	2,00%	5,00%	5,00%	9.542.340,25
Total Renda Variável	30,00%	48.108.076,30	18,30%	10,00	30,00	42,00	-

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 " a "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	134.122.953,20	51,01%	35,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	12.117.472,36	4,61%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	28.013.187,65	10,65%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	6.742.663,69	2,56%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	12.616.321,03	4,80%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	193.612.597,93	73,64%	40,00	160,00

Artigos - Renda Variável	Base: janeiro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	8.616.602,39	3,28%	0,00%	2,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	27.811.394,19	10,58%	5,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	3.580.412,41	1,36%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	4.495.410,14	1,71%	1,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	3.604.257,17	1,37%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	48.108.076,30	18,30%	10,00	42,00

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	76.701.336,68	29,17%	0,02%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	74.081.681,69	28,18%	0,01%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	25.225.171,83	9,59%	0,04%
WESTERN ASSET	17.862.295,29	6,79%	0,03%
BTG Pactual WM Gestão de Recursos	12.117.472,36	4,61%	0,02%
VOTORANTIM ASSET MANAGEMENT	8.854.561,27	3,37%	0,00%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	8.616.602,39	3,28%	0,05%
GERAÇÃO FUTURO	5.639.701,46	2,14%	0,04%
ITAÚ UNIBANCO	5.549.835,00	2,11%	0,00%
BRASIL PLURAL	5.345.725,40	2,03%	0,03%
XP GESTÃO DE RECURSOS	4.914.619,80	1,87%	0,00%
OLIVEIRA TRUST	4.725.394,04	1,80%	0,06%
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	4.475.358,76	1,70%	0,01%
OURO PRETO INVESTIMENTOS	2.202.719,55	0,84%	0,10%
FINAXIS CORRETORA	1.939.618,27	0,74%	1,90%

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
SAFRA ASSET MANAGEMENT	1.756.406,69	0,67%	0,00%%
KINEA INVESTIMENTOS	1.060.155,80	0,40%	0,00%%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	1.003.486,82	0,38%	0,00%%
VINCI PARTNERS	469.953,90	0,18%	0,00%%
VALORA INVESTIMENTOS	310.669,66	0,12%	0,01%%
VILA RICA CAPITAL	28.863,17	0,01%	0,03%%