

Relatório Analítico dos Investimentos

em agosto de 2019

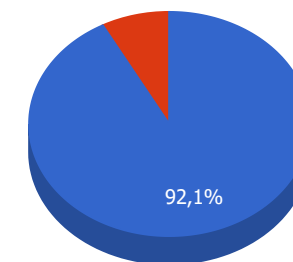
Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2019)

| 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 | 9.778.299,07 | 10,07% | 875 | 0,13% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN... | D+1 | Não há | 11.944.228,60 | 12,30% | 671 | 0,20% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI... | D+2 | Não há | 5.183.547,82 | 5,34% | 333 | 0,18% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA | D+0 | Não há | 6.177.675,08 | 6,36% | 93 | 1,14% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA | D+1 | Não há | 5.070.458,24 | 5,22% | 73 | 2,25% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+3 | Não há | 17.550.869,94 | 18,07% | 542 | 0,23% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0 | Não há | 17.323.207,10 | 17,84% | 1.390 | 0,15% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA | D+0 | Não possui | 11.264.812,40 | 11,60% | 630 | 0,15% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | Não há | 3.150.282,07 | 3,24% | 733 | 0,28% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | D+4 | Não há | 2.046.566,86 | 2,11% | 136 | 0,25% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP | D+4 | Não há | 4.554.297,06 | 4,69% | 219 | 0,83% | Artigo 8º, Inciso III |
| JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR1... | Não se ... | Não se aplica | 3.078.030,40 | 3,17% | | 1,65% | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b ' |
| Total para cálculo dos limites da Resolução | | | 97.122.274,64 | | | | |

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

| Artigos - Renda Fixa | Resolução % | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - 2019 | | | GAP Superior |
|-------------------------------------|----------------|----------------------|---------------|-------------------------------|---------------|----------------|---------------|
| | | | | Inf | Alvo | Sup | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a ' | 100,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 100,00% | 97.122.274,64 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' | 100,00% | 84.293.098,25 | 86,79% | 50,00% | 60,00% | 100,00% | 12.829.176,39 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c ' | 100,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 100,00% | 97.122.274,64 |
| Artigo 7º, Inciso II | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 4.856.113,73 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 60,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 60,00% | 58.273.364,78 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b ' | 60,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 60,00% | 58.273.364,78 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' | 40,00% | 5.196.848,93 | 5,35% | 0,00% | 25,00% | 40,00% | 33.652.060,93 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b ' | 40,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 40,00% | 38.848.909,86 |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b ' | 20,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 20,00% | 19.424.454,93 |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a ' | 15,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 15,00% | 14.568.341,20 |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b ' | 15,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 15,00% | 14.568.341,20 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a ' | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 4.856.113,73 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b ' | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 4.856.113,73 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c ' | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 4.856.113,73 |
| Total Renda Fixa | 100,00% | 89.489.947,18 | 92,14% | 50,00% | 85,00% | 570,00% | |

Distribuição por Segmento

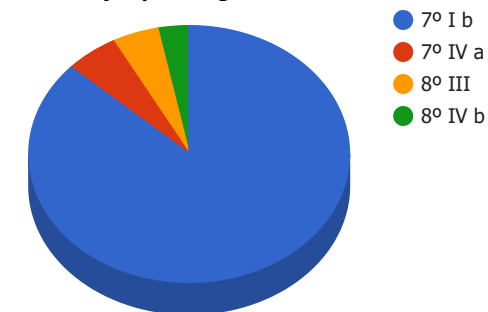


● RENDA FIXA ● RENDA VARIÁVEL

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

| Artigos - Renda Variável | Resolução | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - 2019 | | | GAP Superior |
|------------------------------------|---------------|---------------------|--------------|-------------------------------|---------------|----------------|---------------|
| | | | | Inf | Alvo | Sup | |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a ' | 30,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 30,00% | 29.136.682,39 |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b ' | 30,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 30,00% | 29.136.682,39 |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' | 20,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 20,00% | 19.424.454,93 |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b ' | 20,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 20,00% | 19.424.454,93 |
| Artigo 8º, Inciso III | 10,00% | 4.554.297,06 | 4,69% | 0,00% | 5,00% | 10,00% | 5.157.930,40 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a ' | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 4.856.113,73 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b ' | 5,00% | 3.078.030,40 | 3,17% | 0,00% | 5,00% | 5,00% | 1.778.083,33 |
| Total Renda Variável | 30,00% | 7.632.327,46 | 7,86% | 0,00% | 15,00% | 120,00% | |

Distribuição por Artigos



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

| Gestão | Valor | % S/ Carteira | % S/ PL Gestão |
|-----------------------------|---------------|---------------|----------------|
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 52.161.524,56 | 53,71 | 0,00 |
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | 28.588.019,50 | 29,44 | 0,01 |
| BRANCO ASSET MANAGEMENT | 8.224.241,94 | 8,47 | 0,00 |
| BANCO DO NORDESTE DO BRASIL | 5.070.458,24 | 5,22 | 0,05 |
| OURO PRETO INVESTIMENTOS | 3.078.030,40 | 3,17 | 0,07 |

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 ' a ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 100,00 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' | 84.293.098,25 | 86,79 | 0,00 | 100,00 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 100,00 |
| Artigo 7º, Inciso II | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 60,00 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 60,00 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' | 5.196.848,93 | 5,35 | 0,00 | 40,00 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 40,00 |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 20,00 |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 15,00 |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 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 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 30,00 |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 30,00 |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 20,00 |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 20,00 |
| Artigo 8º, Inciso III | 4.554.297,06 | 4,69 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b ' | 3.078.030,40 | 3,17 | 0,00 | 5,00 |

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

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|--------|--------|-------|--------|--------|--------|---------|------------------|
| IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark) | 0,23% | 8,15% | 3,25% | 6,43% | 15,94% | 25,15% | - | - |
| BRDESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA | 0,20% | 8,03% | 3,25% | 6,40% | 15,74% | 24,48% | 0,01% | 0,03% |
| IMA Geral ex-C (Benchmark) | 0,17% | 8,94% | 3,09% | 6,43% | 15,60% | 22,43% | - | - |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,08% | 9,42% | 3,30% | 6,85% | 16,13% | 22,79% | 0,01% | 0,03% |
| IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark) | 0,08% | 7,42% | 2,35% | 5,52% | 12,59% | 21,63% | - | - |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,05% | 6,86% | 2,15% | 4,94% | 11,84% | 19,96% | 0,01% | 0,02% |
| IMA-B 5+ (Benchmark) | -0,77% | 22,00% | 5,82% | 13,81% | 38,20% | 41,83% | - | - |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | -0,79% | 21,63% | 5,77% | 13,60% | 37,66% | 40,89% | 0,04% | 0,12% |
| IRF-M 1 (Benchmark) | 0,55% | 4,63% | 1,86% | 3,55% | 7,40% | 14,81% | - | - |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,52% | 4,50% | 1,81% | 3,45% | 7,24% | 14,42% | 0,00% | 0,00% |
| IMA-B (Benchmark) | -0,40% | 16,22% | 4,65% | 10,75% | 27,53% | 33,35% | - | - |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | -0,42% | 16,02% | 4,60% | 10,63% | 27,17% | 32,66% | 0,02% | 0,08% |
| BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA | -0,35% | 14,56% | 4,31% | 9,92% | 23,97% | 29,64% | 0,02% | 0,06% |
| CDI (Benchmark) | 0,50% | 4,18% | 1,55% | 3,11% | 6,28% | 13,54% | - | - |

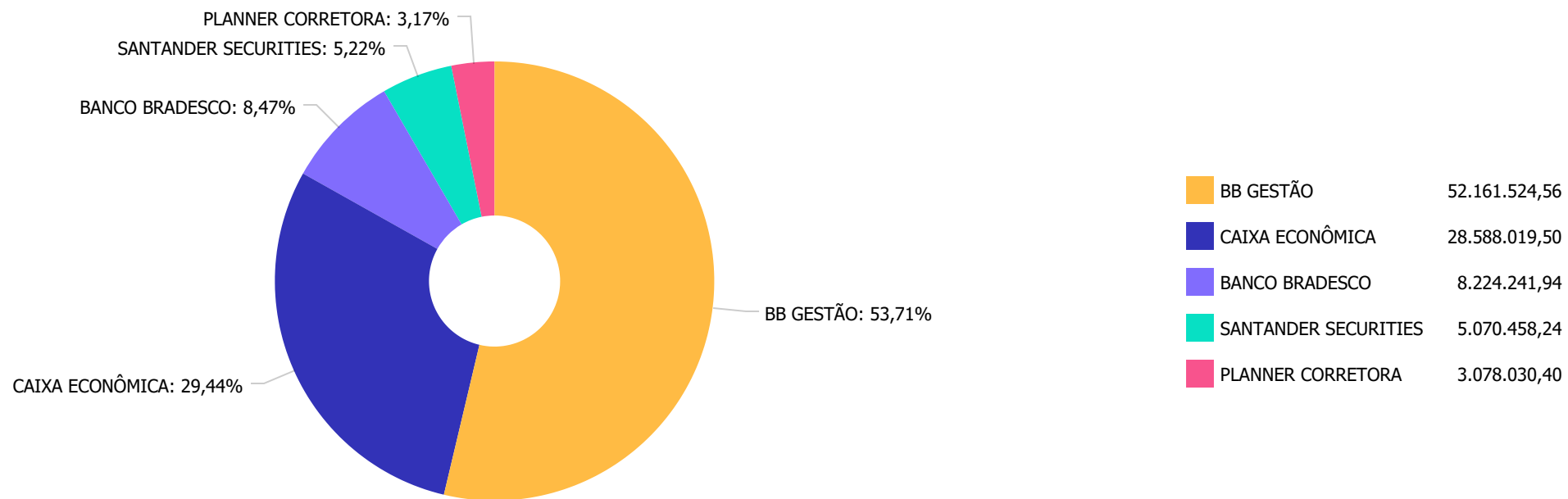
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2019 - RENDA FIXA

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|--------|--------|-------|-------|--------|--------|---------|------------------|
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,41% | 3,43% | 1,26% | 2,55% | 5,15% | 11,14% | 0,00% | 0,00% |
| IPCA (Benchmark) | 0,11% | 2,54% | 0,31% | 1,77% | 3,43% | 7,77% | - | - |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA | -0,13% | 12,00% | 3,74% | 8,33% | 16,60% | 23,55% | 0,02% | 0,04% |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 0,10% | 8,82% | 3,15% | 6,29% | 15,46% | - | 0,01% | 0,03% |

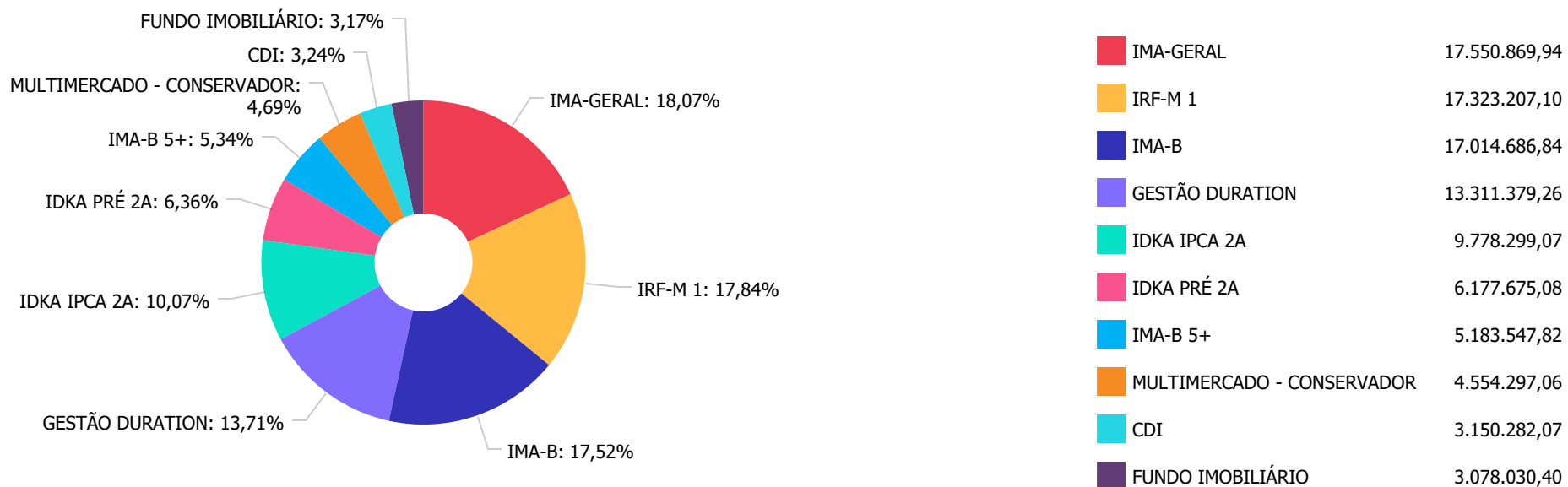
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2019 - RENDA VARIÁVEL

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|-------|-------|-------|-------|-------|--------|---------|------------------|
| CDI (Benchmark) | 0,50% | 4,18% | 1,55% | 3,11% | 6,28% | 13,54% | - | - |
| BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP | 0,53% | 5,14% | 1,63% | 3,68% | 8,27% | 15,85% | 0,02% | 0,01% |
| Não Informado (Benchmark) | - | - | - | - | - | - | - | - |
| JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | - | - | - |

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



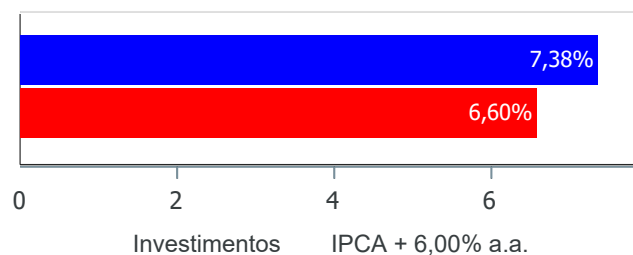
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Agosto / 2019)



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 | 82.723.511,14 | 1.235.745,91 | 100.488,20 | 85.094.381,52 | 1.235.612,67 | 1.235.612,67 | 1,47% | 1,47% | 0,83% | 0,83% | 177,18% | 0,58% |
| Fevereiro | 85.094.381,52 | 1.957.428,91 | 260.757,43 | 87.181.591,32 | 390.538,32 | 1.626.150,99 | 0,45% | 1,93% | 0,90% | 1,73% | 111,27% | 0,71% |
| Março | 87.181.591,32 | 1.359.103,14 | 50.372,07 | 88.925.759,09 | 435.436,70 | 2.061.587,69 | 0,49% | 2,43% | 1,19% | 2,95% | 82,46% | 1,16% |
| Abril | 88.925.759,09 | 663.872,09 | 299.945,92 | 89.964.800,47 | 675.115,21 | 2.736.702,90 | 0,76% | 3,21% | 1,06% | 4,04% | 79,37% | 0,51% |
| Mai | 89.964.800,47 | 2.449.365,23 | 278.408,16 | 93.397.519,63 | 1.261.762,09 | 3.998.464,99 | 1,37% | 4,62% | 0,64% | 4,71% | 98,16% | 0,65% |
| Junho | 93.397.519,63 | 34.439.826,86 | 34.093.999,40 | 95.282.926,75 | 1.539.579,66 | 5.538.044,65 | 1,64% | 6,34% | 0,45% | 5,18% | 122,40% | 1,22% |
| Julho | 95.282.926,75 | 925.196,54 | 327.578,29 | 96.770.452,97 | 889.907,97 | 6.427.952,62 | 0,93% | 7,32% | 0,72% | 5,94% | 123,32% | 0,75% |
| Agosto | 96.770.452,97 | 1.692.479,43 | 1.393.033,58 | 97.122.274,64 | 52.375,82 | 6.480.328,44 | 0,05% | 7,38% | 0,62% | 6,60% | 111,91% | 1,36% |

Investimentos x Meta Atuarial



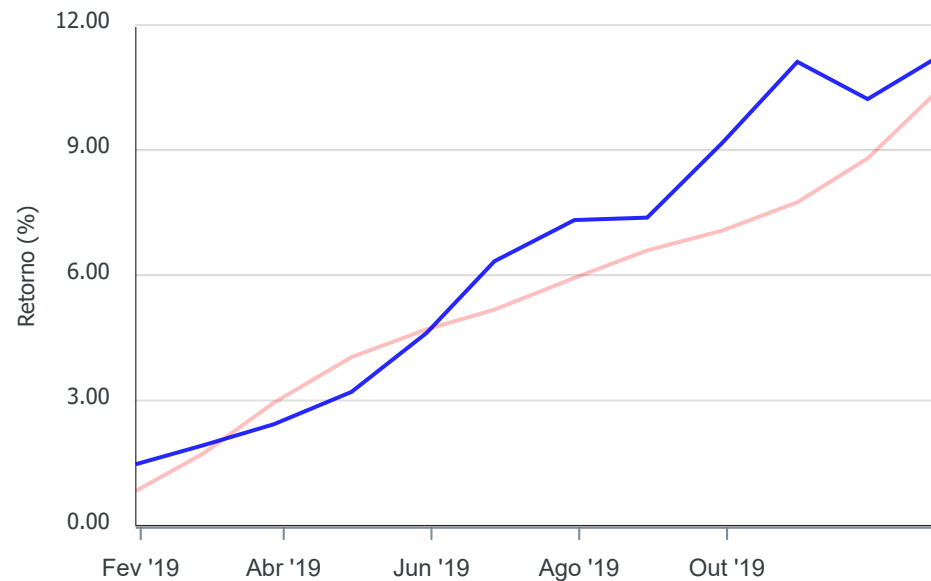
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Agosto/2019

FUNDOS DE RENDA FIXA

| Ativos Renda Fixa | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|---|----------------------|---------------------|---------------------|----------------------|------------------|--------------|------------|--------------|
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 17.232.741,15 | 0,00 | 0,00 | 17.323.207,10 | 90.465,95 | 0,52% | 0,52% | 0,18% |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2.838.638,04 | 1.692.479,43 | 1.393.033,58 | 3.150.282,07 | 12.198,18 | 0,27% | 0,41% | 0,00% |
| BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA | 6.165.541,78 | 0,00 | 0,00 | 6.177.675,08 | 12.133,30 | 0,20% | 0,20% | 1,11% |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 2.044.438,60 | 0,00 | 0,00 | 2.046.566,86 | 2.128,26 | 0,10% | 0,10% | 1,10% |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 17.536.010,27 | 0,00 | 0,00 | 17.550.869,94 | 14.859,67 | 0,08% | 0,08% | 1,18% |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC... | 9.773.189,03 | 0,00 | 0,00 | 9.778.299,07 | 5.110,04 | 0,05% | 0,05% | 0,71% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA | 11.279.419,73 | 0,00 | 0,00 | 11.264.812,40 | -14.607,33 | -0,13% | -0,13% | 1,74% |
| BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA | 5.088.455,67 | 0,00 | 0,00 | 5.070.458,24 | -17.997,43 | -0,35% | -0,35% | 2,34% |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI... | 11.994.044,84 | 0,00 | 0,00 | 11.944.228,60 | -49.816,24 | -0,42% | -0,42% | 2,46% |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE... | 5.224.784,33 | 0,00 | 0,00 | 5.183.547,82 | -41.236,51 | -0,79% | -0,79% | 3,60% |
| Total Renda Fixa | 89.177.263,44 | 1.692.479,43 | 1.393.033,58 | 89.489.947,18 | 13.237,89 | 0,01% | | 1,33% |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Agosto/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 | 4.530.433,81 | 0,00 | 0,00 | 4.554.297,06 | 23.863,25 | 0,53% | 0,53% | 1,87% |
| JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11 | 3.062.755,72 | 0,00 | 0,00 | 3.078.030,40 | 15.274,68 | 0,50% | 0,00% | - |
| Total Renda Variável | 7.593.189,53 | 0,00 | 0,00 | 7.632.327,46 | 39.137,93 | 0,52% | | 1,87% |