

# Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2018



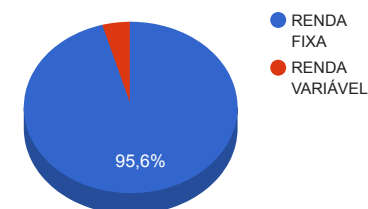
Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2018)

| Produto / Fundo   | Disponibilidade Resgate | Carência       | Saldo                | Particip. S/ Total | Qtde. Cotistas | % S/ PL Fundo | RESOLUÇÃO<br>3.922 / 4.392 / 4.604 |
|---|-------------------------|----------------|----------------------|--------------------|----------------|---------------|------------------------------------|
| DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS                                |                         |                | 32.505,06            | 0,17%              |                |               | Artigo 20                          |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO      | D+1                     | Não há         | 1.332.404,57         | 6,81%              | 698            | 0,03%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "  |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | D+0                     | Não há         | 3.548.854,13         | 18,13%             | 1.225          | 0,03%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "  |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP        | D+0                     | Não há         | 1.467.753,30         | 7,50%              | 745            | 0,03%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "  |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | D+0                     | Não há         | 5.434.204,36         | 27,76%             | 1.417          | 0,03%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "  |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO             | D+3                     | Não há         | 1.304.533,63         | 6,66%              | 180            | 0,05%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "  |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO      | D+1                     | Não há         | 1.391.677,96         | 7,11%              | 587            | 0,03%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "  |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP      | D+0                     | Não há         | 1.004.560,52         | 5,13%              | 716            | 0,01%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "  |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA               | D+0                     | Não possui     | 1.442.974,87         | 7,37%              | 144            | 0,14%         | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                     | D+0                     | Não há         | 558.745,75           | 2,85%              | 748            | 0,01%         | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP              | D+0                     | Não há         | 60.932,80            | 0,31%              | 427            | 0,00%         | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA                           | D+0                     | Não há         | 120.301,29           | 0,61%              | 37             | 0,15%         | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP               | D+0                     | Não há         | 1.016.966,63         | 5,19%              | 733            | 0,02%         | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO | D+2                     | 43832          | 861.734,25           | 4,40%              | 729            | 0,34%         | Artigo 8º, Inciso III              |
|   |                         | <b>TOTAL -</b> | <b>19.578.149,12</b> |                    |                |               |                                    |

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

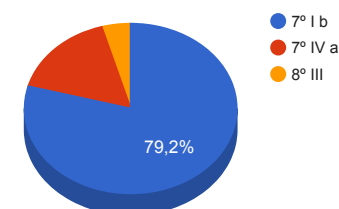
| Artigos - Renda Fixa               | Resolução %    | Carteira \$          | Carteira %    | Estratégia de Alocação |             |               | GAP Superior |
|------------------------------------|----------------|----------------------|---------------|------------------------|-------------|---------------|--------------|
|                                    |                |                      |               | Inferior %             | Alvo %      | Superior %    |              |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "  | 100,00%        | 15.483.988,47        | 79,09%        | 0,00%                  | 0,00%       | 100,00%       | 4.094.160,65 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " | 40,00%         | 3.199.921,34         | 16,34%        | 0,00%                  | 0,00%       | 30,00%        | 2.673.523,40 |
| <b>Total Renda Fixa</b>            | <b>100,00%</b> | <b>18.683.909,81</b> | <b>95,43%</b> | <b>0,00</b>            | <b>0,00</b> | <b>385,00</b> | <b>-</b>     |

Distribuição por Segmento



| Artigos - Renda Variável    | Resolução %   | Carteira \$       | Carteira %   | Estratégia de Alocação |             |              | GAP Superior |
|-----------------------------|---------------|-------------------|--------------|------------------------|-------------|--------------|--------------|
|                             |               |                   |              | Inferior %             | Alvo %      | Superior %   |              |
| Artigo 8º, Inciso III       | 10,00%        | 861.734,25        | 4,40%        | 0,00%                  | 0,00%       | 5,00%        | 117.173,21   |
| <b>Total Renda Variável</b> | <b>30,00%</b> | <b>861.734,25</b> | <b>4,40%</b> | <b>0,00</b>            | <b>0,00</b> | <b>38,00</b> | <b>-</b>     |

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

| Artigos - Renda Fixa               | Base: fevereiro / 2018 |               | Limite Inferior (%) | Limite Superior (%) |
|------------------------------------|------------------------|---------------|---------------------|---------------------|
|                                    | Carteira (\$)          | Carteira (%)  |                     |                     |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "  | 15.483.988,47          | 79,09%        | 0,00%               | 0,00%               |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " | 3.199.921,34           | 16,34%        | 0,00%               | 0,00%               |
| <b>Total Renda Fixa</b>            | <b>18.683.909,81</b>   | <b>95,43%</b> | <b>0,00</b>         | <b>0,00</b>         |

| Artigos - Renda Variável    | Base: fevereiro / 2018 |              | Limite Inferior (%) | Limite Superior (%) |
|-----------------------------|------------------------|--------------|---------------------|---------------------|
|                             | Carteira (\$)          | Carteira (%) |                     |                     |
| Artigo 8º, Inciso III       | 861.734,25             | 4,40%        | 0,00%               | 0,00%               |
| <b>Total Renda Variável</b> | <b>861.734,25</b>      | <b>4,40%</b> | <b>0,00</b>         | <b>0,00</b>         |

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (fevereiro / 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    | 11.409.428,02 | 58,28%        | -              |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 8.136.216,04  | 41,56%        | -              |

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (fevereiro / 2018)

|   | Mês   | Ano   | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|---|-------|-------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| IRF-M   | 1,10% | 2,42% | 3,69%   | 5,42%   | 13,07%   | 39,45%   | -        | -         | -                       |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO    | 1,10% | 2,40% | 3,66%   | 5,32%   | 12,77%   | 38,94%   | 0,20%    | 0,815%    | 4,49%                   |
| IMA Geral ex-C  | 0,72% | 2,41% | 3,33%   | 4,83%   | 11,12%   | 35,03%   | -        | -         | -                       |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO           | 0,76% | 2,49% | 3,42%   | 4,65%   | 10,51%   | -        | 0,30%    | 0,871%    | 4,83%                   |
| IMA-B   | 0,55% | 3,97% | 4,83%   | 5,51%   | 10,85%   | 40,45%   | -        | -         | -                       |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP      | 0,54% | 3,93% | 4,77%   | 5,39%   | 10,63%   | 39,99%   | 0,20%    | 1,843%    | 9,06%                   |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO    | 0,53% | 3,93% | 4,77%   | 5,39%   | 10,57%   | 39,87%   | 0,20%    | 1,841%    | 9,07%                   |
| IRF-M 1   | 0,54% | 1,14% | 1,71%   | 3,74%   | 9,85%    | 25,47%   | -        | -         | -                       |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA       | 0,53% | 1,11% | 1,68%   | 3,65%   | 9,68%    | 25,09%   | 0,20%    | 0,075%    | 0,64%                   |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,52% | 1,11% | 1,68%   | 3,63%   | 9,62%    | 24,91%   | 0,10%    | 0,074%    | 0,65%                   |
| IMA-B 5   | 0,54% | 1,88% | 2,78%   | 4,42%   | 11,72%   | 26,68%   | -        | -         | -                       |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP    | 0,53% | 1,85% | 2,73%   | 4,32%   | 11,52%   | 26,20%   | 0,20%    | 0,783%    | 3,43%                   |
| CDI   | 0,46% | 1,05% | 1,59%   | 3,48%   | 8,95%    | 24,07%   | -        | -         | -                       |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                   | 0,47% | 1,04% | 1,63%   | 3,56%   | 9,05%    | 24,14%   | 0,20%    | 0,010%    | 0,12%                   |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP            | 0,45% | 1,02% | 1,57%   | 3,46%   | 8,84%    | 23,93%   | 0,20%    | 0,005%    | 0,16%                   |
| CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA                         | 0,45% | 1,02% | 1,56%   | 3,45%   | 8,93%    | 24,02%   | 0,20%    | 0,010%    | 0,12%                   |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP             | 0,44% | 1,01% | 1,54%   | 3,42%   | 8,91%    | 24,05%   | 0,20%    | 0,021%    | 0,12%                   |

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (fevereiro / 2018)

|   | Mês   | Ano   | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|---|-------|-------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| IPCA  | 0,32% | 0,61% | 1,05%   | 1,92%   | 2,84%    | 7,74%    | -        | -         | -                       |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA | 0,64% | 1,66% | 2,47%   | 4,01%   | 10,06%   | -        | 0,002    | 0,447%    | 4,23%                   |
| Não definido                                  | -     | -     | -       | -       | -        | -        | -        | -         | -                       |

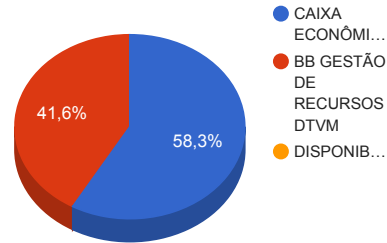
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (fevereiro / 2018)

|   | Mês   | Ano    | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|---|-------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| Ibovespa  | 0,52% | 11,72% | 18,59%  | 20,50%  | 28,04%   | 99,46%   | -        | -         | -                       |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO | 1,18% | -      | -       | -       | -        | -        | 1,60%    | 0,532%    | -                       |

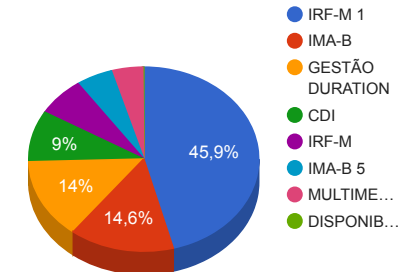


Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (fevereiro / 2018)

| Administrador              | Valor         | %      |
|----------------------------|---------------|--------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL    | 11.409.428,02 | 58,28% |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 8.136.216,04  | 41,56% |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA | 32.505,06     | 0,17%  |



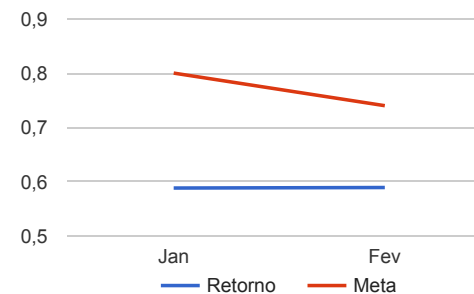
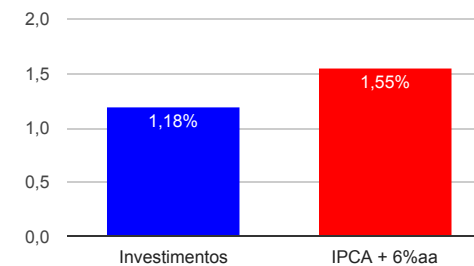
| Sub-segmento               | Valor        | %      |
|----------------------------|--------------|--------|
| IRF-M 1                    | 8.983.058,49 | 45,88% |
| IMA-B                      | 2.859.431,26 | 14,61% |
| GESTÃO DURATION            | 2.747.508,50 | 14,03% |
| CDI                        | 1.756.946,47 | 8,97%  |
| IRF-M                      | 1.332.404,57 | 6,81%  |
| IMA-B 5                    | 1.004.560,52 | 5,13%  |
| MULTIMERCADO               | 861.734,25   | 4,40%  |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA | 32.505,06    | 0,17%  |



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

| Mês              | Saldo Anterior | Aplicações   | Resgates     | Saldo Atual   | Retorno (\$) | Retorno (%) | Meta (%) | Gap (%) | VaR (%) |
|------------------|----------------|--------------|--------------|---------------|--------------|-------------|----------|---------|---------|
| Janeiro          | 17.114.796,24  | 3.180.488,84 | 1.411.492,78 | 18.994.909,23 | 111.116,93   | 0,59%       | 0,80%    | 73,42%  | 0,17%   |
| Fevereiro        | 18.994.909,23  | 6.671.522,96 | 6.235.311,54 | 19.545.644,06 | 114.523,41   | 0,59%       | 0,74%    | 79,82%  | 0,52%   |
| Acumulado no ano |                |              |              |               | 225.640,34   | 1,18%       | 1,55%    | 76,42%  |         |

**Acumulado no Ano**



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de fevereiro / 2018

| Ativos de Renda Fixa                                      | Sado Anterior | Aplicações   | Resgates     | Saldo Atual  | Retorno (R\$) | Retorno (%) | VaR - Mês (%) | Instituição(%) |
|---|---------------|--------------|--------------|--------------|---------------|-------------|---------------|----------------|
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO    | 318.637,84    | 1.000.000,00 | 0,00         | 1.332.404,57 | 13.766,73     | 1,04%       | 0,81%         | 1,10%          |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO           | 0,00          | 1.295.410,85 | 0,00         | 1.304.533,63 | 9.122,78      | 0,70%       | 0,87%         | 0,76%          |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA             | 364.304,65    | 1.070.451,16 | 0,00         | 1.442.974,87 | 8.219,06      | 0,57%       | 0,45%         | 0,64%          |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP    | 0,00          | 1.000.000,00 | 0,00         | 1.004.560,52 | 4.560,52      | 0,46%       | 0,78%         | 0,53%          |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP            | 60.661,67     | 0,00         | 0,00         | 60.932,80    | 271,13        | 0,45%       | 0,01%         | 0,45%          |
| CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA                         | 119.766,59    | 0,00         | 0,00         | 120.301,29   | 534,70        | 0,45%       | 0,01%         | 0,45%          |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP      | 461.319,13    | 1.000.000,00 | 0,00         | 1.467.753,30 | 6.434,17      | 0,44%       | 1,84%         | 0,54%          |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP             | 945.476,52    | 98.352,69    | 31.230,20    | 1.016.966,63 | 4.367,62      | 0,42%       | 0,02%         | 0,44%          |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO    | 182.225,89    | 1.203.781,34 | 0,00         | 1.391.677,96 | 5.670,73      | 0,41%       | 1,84%         | 0,53%          |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA       | 8.404.595,23  | 0,00         | 3.000.000,00 | 5.434.204,36 | 29.609,13     | 0,35%       | 0,07%         | 0,53%          |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 5.529.843,90  | 0,00         | 2.000.000,00 | 3.548.854,13 | 19.010,23     | 0,34%       | 0,07%         | 0,52%          |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                   | 1.756.395,66  | 3.526,92     | 1.204.081,34 | 558.745,75   | 2.904,51      | 0,17%       | 0,01%         | 0,47%          |
| Total Renda Fixa  |               |              |              |              | 104.471,31    | 0,56%       | 0,51%         |                |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de fevereiro / 2018

| Ativos de Renda Variável                                    | Sado Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | VaR - Mês (%) | Instituição(%) |
|---|---------------|------------|----------|-------------|---------------|-------------|---------------|----------------|
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO | 851.682,15    | 0,00       | 0,00     | 861.734,25  | 10.052,10     | 1,18%       | 0,53%         | 1,18%          |
| Total Renda Variável  |               |            |          |             | 10.052,10     | 1,18%       | 0,53%         |                |