

Composição dos Recursos Garantidores da PRECE  
 Resolução CMN Nº 3.792 de 24/09/2009 alterada pela Resolução CMN nº 4.275 de 31/10/2013.

Posição em 31 de Agosto de 2017

|   | AGO2017          | JUL2017          | %<br>Composição | %<br>Variação | Limites de Alocação<br>Geral |     | Limites de Alocação<br>Emissor |  | Limites de Alocação<br>Concentração |      |
|---|------------------|------------------|-----------------|---------------|------------------------------|-----|--------------------------------|--|-------------------------------------|------|
| <b>Disponibilidades e Outros Realizáveis</b>  | 1.880.476,76     | 1.810.756,79     | 0,15            | 3,85          |                              |     |                                |  |                                     |      |
| <b>Investimentos</b>  | 1.208.608.740,42 | 1.192.668.715,30 | 99,85           | 1,34          |                              |     |                                |  |                                     |      |
| <b>Renda Fixa</b>   | 637.878.490,83   | 629.446.362,68   | 52,70           | 1,34          |                              |     |                                |  |                                     |      |
| <b>Títulos Públicos</b>   | 7.699.324,98     | 7.364.981,48     | 0,64            | 4,54          |                              |     |                                |  |                                     |      |
| Notas do Tesouro Nacional - NTN-A/NTN-B/NTN-C                                       | 7.430.419,17     | 7.364.981,48     | 0,62            | 0,89          | 100%                         |     | 100%                           |  |                                     | 100% |
| Letras do Tesouro Nacional  | 268.905,81       | 0,00             | 0,02            | **            |                              |     |                                |  |                                     |      |
| <b>Créditos Privados e Depósitos</b>  | 1.929.741,75     | 3.208.174,78     | 0,16            | -39,85        | 80%                          | 80% |                                |  |                                     |      |
| <b>Contas a (Pagar) e a Receber - CRI - FOCUS</b>                                   | 1.929.741,75     | 3.208.174,78     | 0,16            | -39,85        |                              |     |                                |  |                                     |      |
| <b>Fundos de Investimentos</b>  | 628.249.424,10   | 618.873.206,42   | 51,90           | 1,52          |                              |     |                                |  |                                     |      |
| Renda Fixa - Planos   | 3.136.035,13     | 2.002.345,80     | 0,26            | 56,62         | 80%                          | 80% | 20%                            |  |                                     | 10%  |
| Multimercado - Planos   | 617.551.942,86   | 610.351.216,78   | 51,02           | 1,18          |                              |     |                                |  |                                     |      |
| Estruturado - Planos  | 7.561.446,11     | 6.519.643,84     | 0,62            | 15,98         |                              |     |                                |  |                                     |      |
| <b>Renda Variável</b>   | 277.843.219,28   | 270.863.929,10   | 22,95           | 2,58          | 80%                          | 80% | 20%                            |  |                                     | 10%  |
| <b>Fundos de Investimentos</b>  | 277.843.219,28   | 270.863.929,10   | 22,95           | 2,58          |                              |     |                                |  |                                     |      |
| Multimercado - Planos   | 277.843.219,28   | 270.863.929,10   | 22,95           | 2,58          |                              |     |                                |  |                                     |      |
| <b>Investimentos Estruturados</b>   | 0,00             | 0,00             | 0,00            | 0,00          |                              |     | 20%                            |  |                                     | 10%  |
| <b>Investimentos no Exterior</b>  | 0,00             | 0,00             | 0,00            | 0,00          |                              |     | 10%                            |  |                                     | 5%   |
| <b>Investimentos Imobiliários</b>   | 198.774.670,02   | 198.826.894,89   | 16,42           | -0,23         |                              |     |                                |  |                                     |      |
| Carteira Imobiliária  | 193.594.160,73   | 193.677.903,75   | 15,99           | -0,04         |                              |     | 8%                             |  |                                     |      |
| Contas a (Pagar) e a Receber  | 5.180.509,29     | 5.148.991,14     | 0,43            | 0,61          |                              |     |                                |  |                                     |      |
| <b>Empréstimos e Financiamentos</b>   | 94.112.360,29    | 93.531.528,63    | 7,78            | 0,62          |                              |     |                                |  |                                     |      |
| Carteira de Empréstimos ao Participantes  | 94.388.104,89    | 93.885.579,26    | 7,80            | 0,54          |                              |     | 15%                            |  |                                     |      |
| Contas a (Pagar) e a Receber  | -275.744,60      | -354.050,63      | -0,02           | -22,12        |                              |     |                                |  |                                     |      |
| <b>Recursos Garantidores das Reservas Técnicas dos Planos Previdenciários</b>       | 1.210.489.217,18 | 1.194.479.472,09 | 100,00          | 1,34          |                              |     |                                |  |                                     |      |
| <b>Fundos de Investimentos</b>  | 7.305.254,70     | 7.725.927,50     | 0,60            | -5,44         | 80%                          | 80% | 20%                            |  |                                     | 10%  |
| Renda Fixa - Gestão Administrativa  | 7.305.254,70     | 7.725.927,50     | 0,60            | -5,44         |                              |     |                                |  |                                     |      |
| <b>Recursos Garantidores das Reservas Técnicas dos Planos Previdenciários e PGA</b> | 1.217.794.471,88 | 1.202.205.399,59 | 100,00          | 1,30          |                              |     |                                |  |                                     |      |

