

Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2017



Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.700,94	0,00%			Artigo 20
FIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	4.899.252,00	2,37%	17	2,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	14.493.004,05	7,02%	156	1,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	6.015.306,20	2,91%	6	13,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	12.252.830,23	5,94%	167	1,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	9.578.436,16	4,64%	94	2,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	5.710.247,59	2,77%	72	0,66%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA ALOCAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.412.643,96	2,14%	1.598	5,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	10.569.263,50	5,12%	223	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	7.851.809,25	3,80%	282	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	5.209.403,61	2,52%	46	3,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	5.820.643,47	2,82%	122	0,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	D+2	Não há	10.243.425,52	4,96%	476	10,99%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	9.843.225,70	4,77%	27	4,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	6.370.824,13	3,09%	69	0,59%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	15.887.284,00	7,70%	107	1,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA STERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	8.391.653,03	4,07%	5	7,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
FIXA PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	463.909,10	0,22%	776	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	12.828.040,39	6,22%	52	4,66%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
FIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	96.245,67	0,05%	196	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
FIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	38.256,35	0,02%	764	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
FIXA FUNDOS INSTITUCIONAIS ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.316.553,92	1,61%	62	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2018	3.795.858,00	1,84%	163	0,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	542.648,57	0,26%	599	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	D+0 ou D+1	Não há	1.860.299,25	0,90%	12	1,27%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
RTÃO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	D+45 a D+75	Não há	4.303.871,13	2,09%	197	1,17%	Artigo 7º, Inciso VI
STER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	3.173,44	0,00%	42	0,14%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
IMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 7	Não se aplica	Não se aplica	109.997,26	0,05%	35	2,66%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
EMIU FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	2.001.758,32	0,97%	98	1,90%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
LIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	20.395,97	0,01%	1	0,09%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	3.632.371,21	1,76%	51	1,05%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
RPPS IPCA II FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	Término do Fundo	Não há	568.156,05	0,28%	25	0,60%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+33	Não há	705.685,66	0,34%	175	0,73%	Artigo 8º, Inciso III
XA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	398.781,58	0,19%	116	0,11%	Artigo 8º, Inciso III
P PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	4.058.394,63	1,97%	190	0,97%	Artigo 8º, Inciso III
CTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	1.830.472,12	0,89%	357	0,68%	Artigo 8º, Inciso III
QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	3.850.244,58	1,87%	590	2,18%	Artigo 8º, Inciso III
RAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	5.036.730,03	2,44%	131	3,31%	Artigo 8º, Inciso III
LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	1.147.556,22	0,56%	80	1,89%	Artigo 8º, Inciso III
INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	985.868,07	0,48%	6.493	0,23%	Artigo 8º, Inciso III
PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	407.132,72	0,20%	43	0,43%	Artigo 8º, Inciso III
STERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	D+4	Não há	2.042.269,41	0,99%	11	1,98%	Artigo 8º, Inciso III
ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	397.428,21	0,19%	27	0,96%	Artigo 8º, Inciso III
RAÇÃO FUTURO FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	751.854,50	0,36%	2.246	0,57%	Artigo 8º, Inciso IV

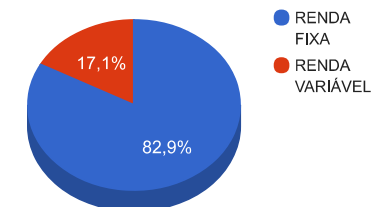
Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+31	Não há	3.442.376,37	1,67%	440	0,70%	Artigo 8º, Inciso IV
CG TORANTIM ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+361	Não há	4.783.938,66	2,32%	16	2,93%	Artigo 8º, Inciso IV
CG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	256.436,41	0,12%	40	0,13%	Artigo 8º, Inciso V
CG VOTORANTIM INFRAESTRUTURA ENERGIA SUST II FIP - ESUD11	Não se aplica	Não se aplica	702.765,80	0,34%			Artigo 8º, Inciso V
CG BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	320.877,00	0,16%	15	0,40%	Artigo 8º, Inciso V
CG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	705.481,47	0,34%			Artigo 8º, Inciso V
CG AREA II REAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11	Não se aplica	Não se aplica	1.108.344,70	0,54%		0,52%	Artigo 8º, Inciso VI
CG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRCR11	S/Info	Não se aplica	346.153,44	0,17%		0,02%	Artigo 8º, Inciso VI
CG RO PRETO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII	Não se aplica	Não se aplica	1.981.476,84	0,96%		6,90%	Artigo 8º, Inciso VI
		TOTAL -	206.392.756,39				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (fevereiro / 2017)

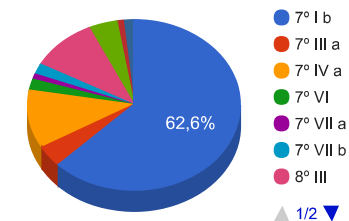
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	41.278.551,28
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	129.157.599,37	62,58%	40,00%	54,00%	80,00%	35.956.605,74
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	8.391.653,03	4,07%	0,00%	5,00%	20,00%	32.886.898,25
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	22.941.811,25	11,12%	5,00%	10,00%	30,00%	38.976.015,67
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	4.303.871,13	2,09%	0,00%	2,00%	10,00%	16.335.404,51
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	2.135.324,99	1,03%	0,00%	1,00%	5,00%	8.184.312,83
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	4.200.527,26	2,04%	0,00%	3,00%	5,00%	6.119.110,56
Total Renda Fixa	100,00%	171.130.787,03	82,92%	45,00	80,00	170,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	20.860.563,23	10,11%	5,00%	8,00%	13,00%	5.970.495,10
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	8.978.169,53	4,35%	2,00%	5,00%	5,00%	1.341.468,29
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	1.985.560,68	0,96%	1,00%	2,00%	5,00%	8.334.077,14
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	3.435.974,98	1,66%	2,00%	5,00%	5,00%	6.883.662,84
Total Renda Variável	30,00%	35.260.268,42	17,08%	10,00	20,00	30,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: fevereiro / 2017		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 "	129.157.599,37	62,58%	40,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	8.391.653,03	4,07%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	22.941.811,25	11,12%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	4.303.871,13	2,09%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	2.135.324,99	1,03%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	4.200.527,26	2,04%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	171.130.787,03	82,92%	45,00	170,00

Artigos - Renda Variável	Base: fevereiro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	0,00	0,00%	0,00%	2,00%
Artigo 8º, Inciso III	20.860.563,23	10,11%	5,00%	13,00%
Artigo 8º, Inciso IV	8.978.169,53	4,35%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	1.985.560,68	0,96%	1,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	3.435.974,98	1,66%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	35.260.268,42	17,08%	10,00	30,00