

Relatório Analítico dos Investimentos em março e 1º Trimestre de 2017



Carteira consolidada de investimentos - base (março / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
OPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.701,19	0,00%			Artigo 20
FIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	4.957.224,00	2,35%	17	2,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	6.100.536,21	2,89%	6	13,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	14.713.326,00	6,98%	171	1,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	9.723.071,10	4,61%	94	2,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	10.709.576,11	5,08%	223	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	12.438.350,84	5,90%	167	1,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ALOCAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.461.222,77	2,12%	1.895	5,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	9.917.754,00	4,71%	27	4,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	5.296.542,39	2,51%	46	3,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	5.777.876,80	2,74%	72	0,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	5.907.039,66	2,80%	122	0,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	D+2	Não há	10.328.261,95	4,90%	607	8,69%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	8.521.360,89	4,04%	303	0,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	6.447.589,85	3,06%	80	0,51%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	16.148.496,00	7,66%	107	1,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	8.788.438,07	4,17%	6	6,76%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
FIXA PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	D+0 ou D+1	Não há	1.875.818,25	0,89%	12	1,27%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	13.036.725,43	6,19%	52	4,66%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
FIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2018	3.827.646,00	1,82%	163	0,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
FUNDO INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.360.215,04	1,59%	62	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
FIXA FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.411.429,69	1,14%	604	0,20%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (março / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	74.057,03	0,04%	193	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	38.665,05	0,02%	754	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
PORTFÓLIO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	D+45 a D+75	Não há	4.355.899,99	2,07%	197	1,16%	Artigo 7º, Inciso VI
PRIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 7	Não se aplica	Não se aplica	109.227,52	0,05%	35	2,66%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PRIMUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	1.992.677,42	0,95%	98	1,90%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PRIMUM III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	3.080,01	0,00%	42	0,14%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PRIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	19.816,82	0,01%	1	0,09%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PRIMUM III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	3.695.647,82	1,75%	52	1,04%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
PRIMUM RPPS ICA II FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	Término do Fundo	Não há	572.358,08	0,27%	25	0,60%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
PRIMUM PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	411.839,18	0,20%	43	0,43%	Artigo 8º, Inciso III
PRIMUM LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	1.126.203,15	0,53%	81	1,87%	Artigo 8º, Inciso III
PRIMUM G PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+33	Não há	713.687,60	0,34%	198	0,72%	Artigo 8º, Inciso III
PRIMUM G PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	1.843.043,02	0,87%	366	0,67%	Artigo 8º, Inciso III
PRIMUM ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	389.925,84	0,18%	29	0,98%	Artigo 8º, Inciso III
PRIMUM CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	394.659,40	0,19%	116	0,11%	Artigo 8º, Inciso III
PRIMUM P PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	3.997.326,32	1,90%	200	0,92%	Artigo 8º, Inciso III
PRIMUM ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	4.929.941,87	2,34%	132	3,18%	Artigo 8º, Inciso III
PRIMUM QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	3.759.921,93	1,78%	729	2,04%	Artigo 8º, Inciso III
PRIMUM INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	952.564,88	0,45%	6.862	0,19%	Artigo 8º, Inciso III
PRIMUM STERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	D+4	Não há	1.992.873,45	0,95%	12	1,98%	Artigo 8º, Inciso III
PRIMUM G PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+31	Não há	3.485.373,84	1,65%	586	0,63%	Artigo 8º, Inciso IV
PRIMUM TORANTIM ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+361	Não há	4.859.807,21	2,31%	16	2,93%	Artigo 8º, Inciso IV

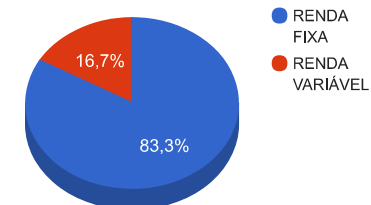
Carteira consolidada de investimentos - base (março / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
RAÇÃO FUTURO FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	756.453,00	0,36%	2.181	0,58%	Artigo 8º, Inciso IV
VOTORANTIM INFRAESTRUTURA ENERGIA SUST II FIP - ESUD11	Não se aplica	Não se aplica	709.534,35	0,34%			Artigo 8º, Inciso V
ASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	320.342,14	0,15%	15	0,40%	Artigo 8º, Inciso V
G PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	254.753,83	0,12%	40	0,13%	Artigo 8º, Inciso V
G PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	782.995,50	0,37%			Artigo 8º, Inciso V
G PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRGR11	S/Info	Não se aplica	341.316,90	0,16%		0,02%	Artigo 8º, Inciso VI
REA II REAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11	Não se aplica	Não se aplica	1.050.518,02	0,50%		0,52%	Artigo 8º, Inciso VI
RO PRETO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII	Não se aplica	Não se aplica	2.087.109,44	0,99%		6,90%	Artigo 8º, Inciso VI
		TOTAL -	210.771.822,85				

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

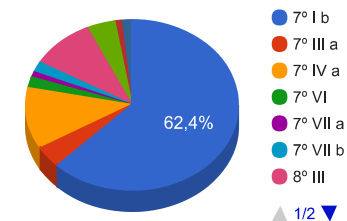
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	42.154.364,57
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	131.448.228,57	62,37%	40,00%	54,00%	80,00%	37.169.229,71
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	8.788.438,07	4,17%	0,00%	5,00%	20,00%	33.365.926,50
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	24.624.556,49	11,68%	5,00%	10,00%	30,00%	38.606.990,37
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	4.355.899,99	2,07%	0,00%	2,00%	10,00%	16.721.282,30
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	2.124.801,77	1,01%	0,00%	1,00%	5,00%	8.413.789,37
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	4.268.005,90	2,02%	0,00%	3,00%	5,00%	6.270.585,24
Total Renda Fixa	100,00%	175.609.930,79	83,32%	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%	20.511.986,64	9,73%	5,00%	8,00%	13,00%	6.888.350,33
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	9.101.634,05	4,32%	2,00%	5,00%	5,00%	1.436.957,09
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	2.067.625,82	0,98%	1,00%	2,00%	5,00%	8.470.965,32
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	3.478.944,36	1,65%	2,00%	5,00%	5,00%	7.059.646,78
Total Renda Variável	30,00%	35.160.190,87	16,68%	10,00	20,00	30,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: março / 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 "	131.448.228,57	62,37%	40,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	8.788.438,07	4,17%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	24.624.556,49	11,68%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	4.355.899,99	2,07%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	2.124.801,77	1,01%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	4.268.005,90	2,02%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	175.609.930,79	83,32%	45,00	170,00

Artigos - Renda Variável	Base: março / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	0,00	0,00%	0,00%	2,00%
Artigo 8º, Inciso III	20.511.986,64	9,73%	5,00%	13,00%
Artigo 8º, Inciso IV	9.101.634,05	4,32%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	2.067.625,82	0,98%	1,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	3.478.944,36	1,65%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	35.160.190,87	16,68%	10,00	30,00