

# Relatório Analítico dos Investimentos em abril de 2017



Carteira consolidada de investimentos - base (abril / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			2.817,95	0,00%			Artigo 20
FUNDOS PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	6.124.019,84	2,86%	6	13,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	9.755.539,30	4,56%	94	2,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	9.795.424,10	4,58%	27	4,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	5.782.767,17	2,70%	72	0,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ALOCUÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.449.762,84	2,08%	1.981	4,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	12.520.491,31	5,86%	167	1,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	5.950.845,97	2,78%	122	0,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	5.312.982,78	2,49%	46	3,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FUNDOS PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	D+2	Não há	10.241.362,27	4,79%	628	7,68%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	8.450.359,78	3,95%	314	0,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ALOCUÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	6.469.502,45	3,03%	84	0,49%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	16.258.928,00	7,60%	107	1,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	15.262.023,70	7,14%	179	1,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	4.961.364,00	2,32%	17	2,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	10.794.179,87	5,05%	223	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	9.250.464,14	4,33%	5	7,32%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	13.057.783,64	6,11%	52	4,66%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
FIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2018	3.851.298,00	1,80%	163	0,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
FUNDO INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.367.215,75	1,57%	62	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
FIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	66.927,62	0,03%	194	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
FUNDO FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.066.698,61	0,50%	608	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (abril / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
GG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	D+0 ou D+1	Não há	1.887.339,90	0,88%	12	1,27%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
RENDA FIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	23.971,66	0,01%	748	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
PORTFÓLIO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	D+45 a D+75	Não há	4.395.439,17	2,06%	211	1,12%	Artigo 7º, Inciso VI
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	1.980.029,41	0,93%	98	1,90%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 7	Não se aplica	Não se aplica	107.278,48	0,05%			Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ALIANÇA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	19.118,87	0,01%	46	0,09%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	3.072,72	0,00%	42	0,14%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ALIANÇA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	3.717.425,02	1,74%	52	1,04%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
RENDA FIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	401.790,17	0,19%	116	0,11%	Artigo 8º, Inciso III
GG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+33	Não há	726.981,25	0,34%	209	0,87%	Artigo 8º, Inciso III
GG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	2.399.829,56	1,12%	384	0,81%	Artigo 8º, Inciso III
PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	4.010.790,44	1,88%	208	0,88%	Artigo 8º, Inciso III
QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	4.343.311,02	2,03%	789	1,91%	Artigo 8º, Inciso III
ALIANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	4.867.532,59	2,28%	132	3,06%	Artigo 8º, Inciso III
ALIANÇA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	1.131.709,25	0,53%	81	1,76%	Artigo 8º, Inciso III
PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	421.076,72	0,20%	43	0,43%	Artigo 8º, Inciso III
INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	941.414,03	0,44%	6.629	0,20%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	D+4	Não há	1.996.956,86	0,93%	12	2,03%	Artigo 8º, Inciso III
ALOCÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	387.950,24	0,18%	29	0,95%	Artigo 8º, Inciso III
GG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+31	Não há	4.018.768,65	1,88%	720	0,65%	Artigo 8º, Inciso IV
PORTFÓLIO ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+361	Não há	4.891.451,78	2,29%	16	2,93%	Artigo 8º, Inciso IV
ALIANÇA FUTURO FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	762.088,09	0,36%	2.129	0,60%	Artigo 8º, Inciso IV

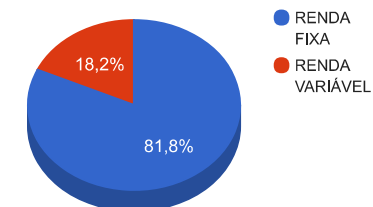
Carteira consolidada de investimentos - base (abril / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
VA RAPOSO MULTIESTRATÉGIA FIP - NVRP11	Não se aplica	Não se aplica	2.010.448,90	0,94%			Artigo 8º, Inciso V
VOTORANTIM INFRAESTRUTURA ENERGIA SUST II FIP - ESUD11	Não se aplica	Não se aplica	714.531,28	0,33%			Artigo 8º, Inciso V
ASIL ÓLEO & GÁS MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	320.054,58	0,15%			Artigo 8º, Inciso V
CG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	253.465,92	0,12%	40	0,13%	Artigo 8º, Inciso V
CG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	779.185,26	0,36%			Artigo 8º, Inciso V
AREA II REAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11	Não se aplica	Não se aplica	1.069.793,58	0,50%		0,52%	Artigo 8º, Inciso VI
CG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRCR11	S/Info	Não se aplica	328.203,06	0,15%		0,02%	Artigo 8º, Inciso VI
RO PRETO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII	Não se aplica	Não se aplica	2.095.899,70	0,98%		6,90%	Artigo 8º, Inciso VI
		<b>TOTAL -</b>	<b>213.799.667,25</b>				

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

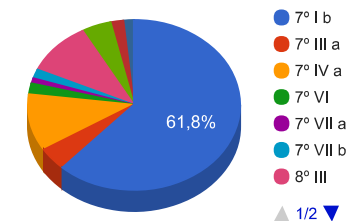
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	42.759.933,45
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	132.129.553,38	61,80%	40,00%	54,00%	80,00%	38.910.180,42
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	9.250.464,14	4,33%	0,00%	5,00%	20,00%	33.509.469,31
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	23.321.235,18	10,91%	5,00%	10,00%	30,00%	40.818.665,00
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	4.395.439,17	2,06%	0,00%	2,00%	10,00%	16.984.527,56
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	2.109.499,48	0,99%	0,00%	1,00%	5,00%	8.580.483,88
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	3.717.425,02	1,74%	0,00%	3,00%	5,00%	6.972.558,34
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>174.923.616,37</b>	<b>81,82%</b>	<b>45,00</b>	<b>80,00</b>	<b>170,00</b>	<b>-</b>

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	21.629.342,13	10,12%	5,00%	8,00%	13,00%	6.164.614,61
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	9.672.308,52	4,52%	2,00%	5,00%	5,00%	1.017.674,84
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	4.077.685,94	1,91%	1,00%	2,00%	5,00%	6.612.297,42
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	3.493.896,34	1,63%	2,00%	5,00%	5,00%	7.196.087,02
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>38.873.232,93</b>	<b>18,18%</b>	<b>10,00</b>	<b>20,00</b>	<b>30,00</b>	<b>-</b>

Distribuição por Artigo / Resolução



estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: abril / 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 "	132.129.553,38	61,80%	40,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	9.250.464,14	4,33%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	23.321.235,18	10,91%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	4.395.439,17	2,06%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	2.109.499,48	0,99%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	3.717.425,02	1,74%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>174.923.616,37</b>	<b>81,82%</b>	<b>45,00</b>	<b>170,00</b>

Artigos - Renda Variável	Base: abril / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	0,00	0,00%	0,00%	2,00%
Artigo 8º, Inciso III	21.629.342,13	10,12%	5,00%	13,00%
Artigo 8º, Inciso IV	9.672.308,52	4,52%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	4.077.685,94	1,91%	1,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	3.493.896,34	1,63%	2,00%	5,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>38.873.232,93</b>	<b>18,18%</b>	<b>10,00</b>	<b>30,00</b>