

# Relatório Analítico dos Investimentos em maio de 2017



Carteira consolidada de investimentos - base (maio / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			4.151,78	0,00%			Artigo 20
FUNDOS PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	6.093.743,71	2,83%	6	13,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	9.730.028,61	4,53%	94	2,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FI RENDA FIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	9.665.117,00	4,49%	27	4,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FI RENDA FIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	5.760.395,93	2,68%	72	0,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FUNDOS ALOCAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.363.500,94	2,03%	1.996	4,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	12.552.777,93	5,84%	167	1,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	5.973.957,26	2,78%	122	0,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	5.295.176,16	2,46%	46	3,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FUNDOS PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	D+2	Não há	11.053.241,41	5,14%	644	11,71%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FUNDOS IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	8.443.541,69	3,93%	314	0,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FUNDOS ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	6.446.247,41	3,00%	87	0,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FI RENDA FIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	16.265.592,00	7,56%	107	1,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FI RENDA FIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	16.308.382,60	7,58%	181	1,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FI RENDA FIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	4.942.108,00	2,30%	17	2,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FI RENDA FIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	10.870.734,86	5,06%	223	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FUNDOS WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	9.738.140,84	4,53%	5	8,11%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	12.658.291,81	5,89%	52	4,66%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
FI RENDA FIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2018	3.883.764,00	1,81%	163	0,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
FUNDOS INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.329.715,93	1,55%	62	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
FI RENDA FIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	46.695,32	0,02%	199	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
FUNDOS FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	339.203,19	0,16%	611	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (maio / 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	1.852.741,50	0,86%	12	1,27%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
RENDA FIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	20.973,41	0,01%	745	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
PORTFÓLIO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	D+45 a D+75	Não há	4.442.254,63	2,07%	214	1,11%	Artigo 7º, Inciso VI
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	1.969.312,94	0,92%	98	1,90%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 7	Não se aplica	Não se aplica	107.146,20	0,05%	84	2,66%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PRIMA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	18.564,85	0,01%	46	0,09%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	2.981,79	0,00%	42	0,14%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
OPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	3.716.500,34	1,73%	52	1,05%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
RENDA FIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	388.476,94	0,18%	116	0,11%	Artigo 8º, Inciso III
GG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+33	Não há	704.761,24	0,33%	228	1,04%	Artigo 8º, Inciso III
GG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	2.347.722,26	1,09%	423	0,73%	Artigo 8º, Inciso III
OP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	4.031.837,22	1,88%	210	0,84%	Artigo 8º, Inciso III
QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	4.640.795,89	2,16%	988	2,02%	Artigo 8º, Inciso III
OPERAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	4.570.406,60	2,13%	131	3,21%	Artigo 8º, Inciso III
LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	1.096.027,78	0,51%	80	1,75%	Artigo 8º, Inciso III
PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	416.245,59	0,19%	43	0,43%	Artigo 8º, Inciso III
INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	933.746,17	0,43%	6.151	0,21%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	D+4	Não há	1.967.472,59	0,92%	12	1,98%	Artigo 8º, Inciso III
ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	369.156,93	0,17%	28	0,93%	Artigo 8º, Inciso III
GG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+31	Não há	4.562.718,66	2,12%	914	0,69%	Artigo 8º, Inciso IV
PORTANTIM ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+361	Não há	4.912.720,91	2,28%	16	2,93%	Artigo 8º, Inciso IV
OPERAÇÃO FUTURO FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	761.001,82	0,35%	2.074	0,62%	Artigo 8º, Inciso IV

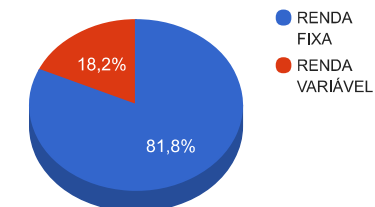
Carteira consolidada de investimentos - base (maio / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAVA RAPOSO MULTIESTRATÉGIA FIP - NVRP11	Não se aplica	Não se aplica	2.039.076,29	0,95%			Artigo 8º, Inciso V
CAVOTORANTIM INFRAESTRUTURA ENERGIA SUST II FIP - ESUD11	Não se aplica	Não se aplica	673.504,43	0,31%			Artigo 8º, Inciso V
CAVASIL ÓLEO & GÁS MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	319.701,60	0,15%	15	0,40%	Artigo 8º, Inciso V
CAVAPACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	251.826,67	0,12%	40	0,13%	Artigo 8º, Inciso V
CAVAPACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	774.139,41	0,36%			Artigo 8º, Inciso V
CAVAREAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11	Não se aplica	Não se aplica	915.589,10	0,43%		0,51%	Artigo 8º, Inciso VI
CAVAPACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	S/Info	Não se aplica	332.844,84	0,15%		0,02%	Artigo 8º, Inciso VI
CAVAPRETO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII	Não se aplica	Não se aplica	2.115.828,52	0,98%		6,90%	Artigo 8º, Inciso VI
		<b>TOTAL -</b>	<b>215.020.585,50</b>				

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

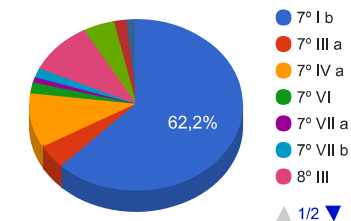
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	43.004.117,10
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	133.764.545,51	62,21%	40,00%	54,00%	80,00%	38.251.922,89
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	9.738.140,84	4,53%	0,00%	5,00%	20,00%	33.265.976,26
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	22.131.385,16	10,29%	5,00%	10,00%	30,00%	42.374.790,49
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	4.442.254,63	2,07%	0,00%	2,00%	10,00%	17.059.803,92
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	2.098.005,78	0,98%	0,00%	1,00%	5,00%	8.653.023,50
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	3.716.500,34	1,73%	0,00%	3,00%	5,00%	7.034.528,94
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>175.890.832,26</b>	<b>81,80%</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%	21.466.649,21	9,98%	5,00%	8,00%	13,00%	6.486.026,91
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	10.236.441,39	4,76%	2,00%	5,00%	5,00%	514.587,89
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	4.058.248,40	1,89%	1,00%	2,00%	5,00%	6.692.780,88
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	3.364.262,46	1,56%	2,00%	5,00%	5,00%	7.386.766,82
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>39.125.601,46</b>	<b>18,20%</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: maio / 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 "	133.764.545,51	62,21%	40,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	9.738.140,84	4,53%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	22.131.385,16	10,29%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	4.442.254,63	2,07%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	2.098.005,78	0,98%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	3.716.500,34	1,73%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>175.890.832,26</b>	<b>81,80%</b>	<b>45,00</b>	<b>170,00</b>

Artigos - Renda Variável	Base: maio / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	0,00	0,00%	0,00%	2,00%
Artigo 8º, Inciso III	21.466.649,21	9,98%	5,00%	13,00%
Artigo 8º, Inciso IV	10.236.441,39	4,76%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	4.058.248,40	1,89%	1,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	3.364.262,46	1,56%	2,00%	5,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>39.125.601,46</b>	<b>18,20%</b>	<b>10,00</b>	<b>30,00</b>