

Relatório Analítico dos Investimentos em junho, 2º Trimestre e 1º semestre de 2017



Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			12.201,81	0,01%			Artigo 20
FUNDOS PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	6.125.092,90	2,80%	6	13,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	9.763.316,55	4,46%	94	2,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	5.769.442,88	2,64%	72	0,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	9.693.814,90	4,43%	27	4,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ALOCUÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.368.456,48	2,00%	1.898	4,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	12.618.933,32	5,77%	167	1,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	6.008.121,79	2,75%	122	0,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	5.313.536,60	2,43%	46	3,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FUNDOS PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	D+2	Não há	11.043.649,16	5,05%	579	12,60%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	8.436.268,81	3,86%	307	0,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ALOCUÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	6.497.713,77	2,97%	92	0,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	16.551.178,82	7,57%	178	1,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	16.358.706,00	7,48%	107	1,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	10.932.154,85	5,00%	223	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	4.949.804,00	2,26%	17	2,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	9.766.395,65	4,47%	5	9,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	12.679.236,95	5,80%	52	4,66%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
FIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2018	3.902.289,00	1,78%	163	0,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
FUNDO INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.362.059,90	1,54%	62	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
FIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	21.146,32	0,01%	757	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
FIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	19.992,57	0,01%	204	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	314.837,89	0,14%	615	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
FUNDOS PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	D+0 ou D+1	Não há	1.861.529,55	0,85%	12	1,27%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
FUNDOS DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	D+45 a D+75	Não há	4.483.743,94	2,05%	214	1,11%	Artigo 7º, Inciso VI
FUNDOS PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	1.956.855,92	0,89%	98	1,90%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
FUNDOS MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 7	Não se aplica	Não se aplica	47.376,37	0,02%	84	2,66%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
FUNDOS ALIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	22.686,21	0,01%	46	0,09%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
FUNDOS MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	2.986,00	0,00%	42	0,14%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
FUNDOS FIDC III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	5.715.949,21	2,61%	62	1,47%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
FUNDOS PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+33	Não há	716.724,21	0,33%	216	1,05%	Artigo 8º, Inciso III
FUNDOS RENDA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	387.992,93	0,18%	116	0,11%	Artigo 8º, Inciso III
FUNDOS PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	3.050.926,72	1,40%	413	0,93%	Artigo 8º, Inciso III
FUNDOS INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	951.998,72	0,44%	5.923	0,21%	Artigo 8º, Inciso III
FUNDOS P PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	4.061.347,06	1,86%	208	0,81%	Artigo 8º, Inciso III
FUNDOS QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	4.609.423,84	2,11%	1.010	2,00%	Artigo 8º, Inciso III
FUNDOS ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	4.574.678,28	2,09%	129	4,10%	Artigo 8º, Inciso III
FUNDOS LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	1.103.465,86	0,50%	79	1,61%	Artigo 8º, Inciso III
FUNDOS PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	423.217,74	0,19%	43	0,43%	Artigo 8º, Inciso III
FUNDOS WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	D+4	Não há	2.000.616,40	0,91%	11	2,25%	Artigo 8º, Inciso III
FUNDOS ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	364.757,93	0,17%	30	0,89%	Artigo 8º, Inciso III
FUNDOS PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+31	Não há	4.610.116,21	2,11%	1.182	0,66%	Artigo 8º, Inciso IV
FUNDOS TORANTIM ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+361	Não há	4.954.972,95	2,27%	16	2,93%	Artigo 8º, Inciso IV
FUNDOS ALOCAÇÃO FUTURO FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	767.843,74	0,35%	2.010	0,64%	Artigo 8º, Inciso IV

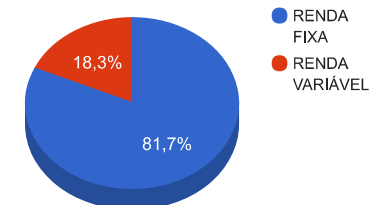
Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2017)

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	2.066.517,34	0,94%			Artigo 8º, Inciso V
VOTORANTIM INFRAESTRUTURA ENERGIA SUST II FIP - ESUD11	Não se aplica	Não se aplica	678.676,67	0,31%			Artigo 8º, Inciso V
ASIL ÓLEO & GÁS MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	319.177,65	0,15%	15	0,40%	Artigo 8º, Inciso V
CG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	250.138,60	0,11%	40	0,13%	Artigo 8º, Inciso V
CG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	769.364,01	0,35%			Artigo 8º, Inciso V
AREA II REAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11	Não se aplica	Não se aplica	983.053,56	0,45%		0,52%	Artigo 8º, Inciso VI
CG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRGR11	S/Info	Não se aplica	325.314,12	0,15%		0,02%	Artigo 8º, Inciso VI
RO PRETO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII	Não se aplica	Não se aplica	2.129.796,17	0,97%		6,90%	Artigo 8º, Inciso VI
		TOTAL -	218.699.598,83				

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

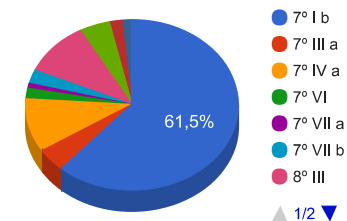
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	43.739.919,77
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	134.430.190,83	61,47%	40,00%	54,00%	80,00%	40.529.488,23
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	9.766.395,65	4,47%	0,00%	5,00%	20,00%	33.973.524,12
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	22.161.092,18	10,13%	5,00%	10,00%	30,00%	43.448.787,47
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	4.483.743,94	2,05%	0,00%	2,00%	10,00%	17.386.215,94
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	2.029.904,50	0,93%	0,00%	1,00%	5,00%	8.905.075,44
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5.715.949,21	2,61%	0,00%	3,00%	5,00%	5.219.030,73
Total Renda Fixa	100,00%	178.587.276,31	81,66%	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%	22.245.149,69	10,17%	5,00%	8,00%	13,00%	6.185.798,16
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	10.332.932,90	4,72%	2,00%	5,00%	5,00%	602.047,04
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	4.083.874,27	1,87%	1,00%	2,00%	5,00%	6.851.105,67
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	3.438.163,85	1,57%	2,00%	5,00%	5,00%	7.496.816,09
Total Renda Variável	30,00%	40.100.120,71	18,34%	10,00	20,00	30,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: junho / 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 "	134.430.190,83	61,47%	40,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	9.766.395,65	4,47%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	22.161.092,18	10,13%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	4.483.743,94	2,05%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	2.029.904,50	0,93%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5.715.949,21	2,61%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	178.587.276,31	81,66%	45,00	170,00

Artigos - Renda Variável	Base: junho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	0,00	0,00%	0,00%	2,00%
Artigo 8º, Inciso III	22.245.149,69	10,17%	5,00%	13,00%
Artigo 8º, Inciso IV	10.332.932,90	4,72%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	4.083.874,27	1,87%	1,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	3.438.163,85	1,57%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	40.100.120,71	18,34%	10,00	30,00