

# Relatório Analítico dos Investimentos em julho de 2017



Carteira consolidada de investimentos - base (julho / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			4.121,94	0,00%			Artigo 20
TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	10.110.296,44	4,43%	94	2,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FI RENDA FIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	11.113.142,18	4,87%	222	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FI RENDA FIXA BRASIL 2018 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	4.543.479,72	1,99%	1.839	4,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FI RENDA FIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	10.074.472,10	4,42%	27	4,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FI RENDA FIXA BRASIL 2030 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	12.937.688,12	5,67%	167	1,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FI RENDA FIXA BRASIL 2030 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	5.508.919,50	2,42%	46	3,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FI RENDA FIXA BRASIL 2030 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	6.145.270,95	2,70%	122	0,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FI RENDA FIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	5.990.006,46	2,63%	72	0,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FI RENDA FIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+2	Não há	11.557.052,23	5,07%	553	14,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FI RENDA FIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+2	Não há	8.832.357,88	3,87%	304	0,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FI RENDA FIXA BRASIL 2024 VII TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+3	Não há	6.655.363,77	2,92%	96	0,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FI RENDA FIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	16.840.740,00	7,39%	107	1,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FI RENDA FIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	5.138.976,00	2,25%	17	2,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FI RENDA FIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	18.015.534,11	7,90%	185	1,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FI RENDA FIXA BRASIL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	6.342.171,49	2,78%	6	13,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FI RENDA FIXA BRASIL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	10.190.916,84	4,47%	6	7,15%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
FI RENDA FIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2018	3.917.757,00	1,72%	163	0,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
FI RENDA FIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	3.447.083,73	1,51%	62	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
FI RENDA FIXA BRASIL 2018 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	12.608,37	0,01%	213	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
FI RENDA FIXA BRASIL 2018 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	276.852,05	0,12%	620	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
FI RENDA FIXA BRASIL 2018 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0 ou D+1	Não há	1.868.856,15	0,82%	12	1,27%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (julho / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
AXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	21.312,41	0,01%	766	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BT TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	13.161.038,65	5,77%	52	4,66%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
PORTFÓLIO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	D+45 a D+75	Não há	4.525.059,28	1,98%		1,14%	Artigo 7º, Inciso VI
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	1.946.943,59	0,85%	98	1,90%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PRÍXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 7	Não se aplica	Não se aplica	47.331,86	0,02%	84	2,66%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PRIMA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	17.797,85	0,01%	46	0,09%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PRISMA III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	2.615,18	0,00%	42	0,14%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PRISMA PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+31	Não há	5.153.947,32	2,26%	1.501	0,67%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
PRISMA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	6.561.765,01	2,88%	61	1,56%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
PRISMA PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+33	Não há	735.041,93	0,32%	212	1,14%	Artigo 8º, Inciso III
PRISMA PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	3.691.078,05	1,62%	463	1,08%	Artigo 8º, Inciso III
PRISMA PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	4.140.213,85	1,82%	213	0,70%	Artigo 8º, Inciso III
PRISMA QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	5.099.662,97	2,24%	1.089	1,95%	Artigo 8º, Inciso III
PRISMA RAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	4.697.088,67	2,06%	126	4,09%	Artigo 8º, Inciso III
PRISMA REGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	1.146.867,97	0,50%	77	1,51%	Artigo 8º, Inciso III
PRISMA PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	440.046,30	0,19%	43	0,43%	Artigo 8º, Inciso III
PRISMA STERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	D+4	Não há	2.054.319,87	0,90%	12	2,22%	Artigo 8º, Inciso III
PRISMA INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	1.002.925,39	0,44%	5.722	0,22%	Artigo 8º, Inciso III
PRISMA ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	381.732,88	0,17%	29	0,90%	Artigo 8º, Inciso III
PRISMA RENDA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	394.707,04	0,17%	116	0,11%	Artigo 8º, Inciso III
PRISMA TORANTIM ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+361	Não há	5.058.124,51	2,22%	16	2,93%	Artigo 8º, Inciso IV
PRISMA RAÇÃO FUTURO FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	777.570,68	0,34%	1.934	0,66%	Artigo 8º, Inciso IV

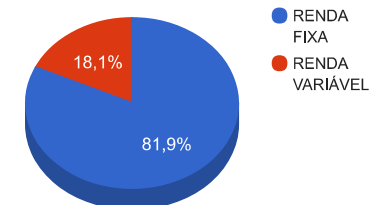
Carteira consolidada de investimentos - base (julho / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
VOTORANTIM INFRAESTRUTURA ENERGIA SUST II FIP - ESUD11	Não se aplica	Não se aplica	682.218,39	0,30%			Artigo 8º, Inciso V
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	308.064,88	0,14%	15	0,40%	Artigo 8º, Inciso V
BRG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	248.487,60	0,11%	40	0,13%	Artigo 8º, Inciso V
BRG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	764.747,19	0,34%			Artigo 8º, Inciso V
BRVA RAPOSO MULTISTRATÉGIA FIP - NVRP11	Não se aplica	Não se aplica	2.088.825,45	0,92%			Artigo 8º, Inciso V
BRSEA II REAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11	Não se aplica	Não se aplica	925.226,88	0,41%		0,52%	Artigo 8º, Inciso VI
BRG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRCR11	S/Info	Não se aplica	294.996,48	0,13%		0,02%	Artigo 8º, Inciso VI
BRPRO PRETO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII	Não se aplica	Não se aplica	2.128.448,59	0,93%		6,90%	Artigo 8º, Inciso VI
		<b>TOTAL -</b>	<b>228.021.873,75</b>				

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

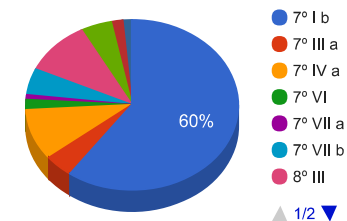
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	45.604.374,75
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	139.805.470,95	61,31%	40,00%	54,00%	80,00%	42.612.028,05
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	10.190.916,84	4,47%	0,00%	5,00%	20,00%	35.413.457,91
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	22.705.508,36	9,96%	5,00%	10,00%	30,00%	45.701.053,77
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	4.525.059,28	1,98%	0,00%	2,00%	10,00%	18.277.128,10
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	2.014.688,48	0,88%	0,00%	1,00%	5,00%	9.386.405,21
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	11.715.712,33	5,14%	0,00%	3,00%	5,00%	-314.618,64
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>190.957.356,24</b>	<b>83,75%</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%	23.783.684,92	10,43%	5,00%	8,00%	13,00%	5.859.158,67
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	10.989.642,51	4,82%	2,00%	5,00%	5,00%	411.451,18
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	4.092.343,51	1,79%	1,00%	2,00%	5,00%	7.308.750,18
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	3.348.671,95	1,47%	2,00%	5,00%	5,00%	8.052.421,74
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>42.214.342,89</b>	<b>18,51%</b>	<b>10,00</b>	<b>20,00</b>	<b>30,00</b>	<b>-</b>

Distribuição por Artigo / Resolução



atratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: julho / 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 "	139.805.470,95	61,31%	40,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	10.190.916,84	4,47%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	22.705.508,36	9,96%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	4.525.059,28	1,98%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	2.014.688,48	0,88%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	11.715.712,33	5,14%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>190.957.356,24</b>	<b>83,75%</b>	<b>45,00</b>	<b>170,00</b>

Artigos - Renda Variável	Base: julho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	0,00	0,00%	0,00%	2,00%
Artigo 8º, Inciso III	23.783.684,92	10,43%	5,00%	13,00%
Artigo 8º, Inciso IV	10.989.642,51	4,82%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	4.092.343,51	1,79%	1,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	3.348.671,95	1,47%	2,00%	5,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>42.214.342,89</b>	<b>18,51%</b>	<b>10,00</b>	<b>30,00</b>