

Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2017



Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.291,21	0,00%			Artigo 20
TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	9.992.589,46	4,26%	94	2,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	9.960.442,80	4,25%	26	4,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ALOC. FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.600.226,18	1,96%	1.816	4,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	5.934.322,19	2,53%	72	0,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	12.705.430,27	5,42%	167	1,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	5.447.162,81	2,32%	46	3,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	6.031.874,40	2,57%	122	0,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	D+2	Não há	11.709.966,62	5,00%	583	16,92%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ALOC. ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	6.727.262,27	2,87%	102	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	16.568.286,00	7,07%	107	1,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ALOC. IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	9.701.868,89	4,14%	295	0,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	19.617.713,12	8,37%	195	1,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	5.091.796,00	2,17%	17	2,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	10.885.787,34	4,64%	222	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	6.270.197,82	2,68%	6	13,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
FIXA PACTUAL STERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	11.326.959,67	4,83%	6	7,66%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
FIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	7.838,24	0,00%	221	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
FUNDO INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.487.776,49	1,49%	62	0,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
FUNDO FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.400.685,80	0,60%	628	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
FIXA PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	D+0 ou D+1	Não há	1.886.605,05	0,80%	12	1,27%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
FIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	17.479,75	0,01%	771	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	13.380.898,99	5,71%	52	4,66%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
RENTA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2018	3.845.004,00	1,64%	163	0,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
PORTFÓLIO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	D+45 a D+75	Não há	4.566.789,31	1,95%	202	1,14%	Artigo 7º, Inciso VI
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	1.912.700,67	0,82%	98	1,90%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PREMIUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 7	Não se aplica	Não se aplica	46.758,04	0,02%	86	2,66%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PREMIUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	17.222,75	0,01%	46	0,09%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PREMIUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	17.517,36	0,01%	42	0,14%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PREMIUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	6.651.922,93	2,84%	61	1,56%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
PREMIUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+31	Não há	5.200.032,67	2,22%	1.926	0,72%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
PREMIUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+33	Não há	777.488,61	0,33%	271	1,13%	Artigo 8º, Inciso III
PREMIUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+4 ou D+33	Não há	3.920.415,52	1,67%	648	0,99%	Artigo 8º, Inciso III
PREMIUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+30	Não há	4.274.329,40	1,82%	220	0,69%	Artigo 8º, Inciso III
PREMIUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+4	Não há	4.765.106,16	2,03%	119	2,95%	Artigo 8º, Inciso III
PREMIUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+4	Não há	3.563.386,76	1,52%	7.425	1,02%	Artigo 8º, Inciso III
PREMIUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+30	Não há	5.531.830,96	2,36%	1.417	1,87%	Artigo 8º, Inciso III
PREMIUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+4	Não há	2.224.711,38	0,95%	12	2,24%	Artigo 8º, Inciso III
PREMIUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+4	03/06/2018	470.540,78	0,20%	43	0,43%	Artigo 8º, Inciso III
PREMIUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+33	23/08/2017	420.392,73	0,18%	116	0,11%	Artigo 8º, Inciso III
PREMIUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+361	Não há	5.116.273,61	2,18%	16	2,93%	Artigo 8º, Inciso IV
PREMIUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1	Não há	785.301,65	0,34%	1.849	0,69%	Artigo 8º, Inciso IV
PREMIUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	682.300,78	0,29%			Artigo 8º, Inciso V
PREMIUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	307.692,26	0,13%	15	0,40%	Artigo 8º, Inciso V

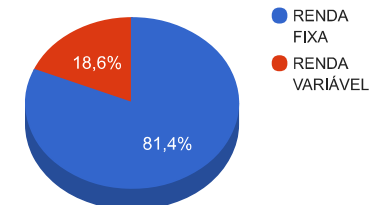
Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
GG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	246.632,93	0,11%	40	0,13%	Artigo 8º, Inciso V
GG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	836.385,16	0,36%			Artigo 8º, Inciso V
VA RAPOSO MULTIESTRATÉGIA FIP - NVRP11	Não se aplica	Não se aplica	2.115.342,17	0,90%	267	0,67%	Artigo 8º, Inciso V
EA II REAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11	Não se aplica	Não se aplica	915.589,10	0,39%		0,53%	Artigo 8º, Inciso VI
RO PRETO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII	Não se aplica	Não se aplica	2.123.821,16	0,91%		6,90%	Artigo 8º, Inciso VI
GG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	S/Info	Não se aplica	297.203,76	0,13%		0,02%	Artigo 8º, Inciso VI
		TOTAL -	234.387.153,98				

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

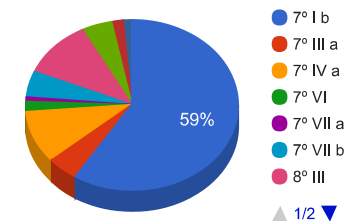
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	46.877.430,80
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	141.244.926,17	60,26%	40,00%	54,00%	80,00%	46.264.797,01
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	11.326.959,67	4,83%	0,00%	5,00%	20,00%	35.550.471,13
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	24.026.288,32	10,25%	5,00%	10,00%	30,00%	46.289.857,87
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	4.566.789,31	1,95%	0,00%	2,00%	10,00%	18.871.926,09
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	1.994.198,82	0,85%	0,00%	1,00%	5,00%	9.725.158,88
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	11.851.955,60	5,06%	0,00%	3,00%	5,00%	-132.597,90
Total Renda Fixa	100,00%	195.011.117,89	83,20%	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%	25.948.202,30	11,07%	5,00%	8,00%	13,00%	4.522.127,72
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	11.101.607,93	4,74%	2,00%	5,00%	5,00%	617.749,77
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	4.188.353,30	1,79%	1,00%	2,00%	5,00%	7.531.004,40
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	3.336.614,02	1,42%	2,00%	5,00%	5,00%	8.382.743,68
Total Renda Variável	30,00%	44.574.777,55	19,02%	10,00	20,00	30,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: agosto / 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 "	141.244.926,17	60,26%	40,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	11.326.959,67	4,83%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	24.026.288,32	10,25%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	4.566.789,31	1,95%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	1.994.198,82	0,85%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	11.851.955,60	5,06%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	195.011.117,89	83,20%	45,00	170,00

Artigos - Renda Variável	Base: agosto / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	0,00	0,00%	0,00%	2,00%
Artigo 8º, Inciso III	25.948.202,30	11,07%	5,00%	13,00%
Artigo 8º, Inciso IV	11.101.607,93	4,74%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	4.188.353,30	1,79%	1,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	3.336.614,02	1,42%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	44.574.777,55	19,02%	10,00	30,00