

Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º Trimestre de 2017



Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			4.523,65	0,00%			Artigo 20
IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	9.927.425,28	4,12%	283	0,62%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
RAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.682.096,48	1,94%	1.788	5,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	5.513.752,93	2,29%	46	3,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
IXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	10.940.148,62	4,54%	222	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
IXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	21.856.156,52	9,06%	196	1,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
IXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	10.155.106,50	4,21%	26	4,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	D+2	Não há	11.988.396,46	4,97%	650	17,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
IXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	6.020.853,41	2,50%	72	0,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	6.815.895,26	2,83%	113	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	12.816.670,80	5,32%	167	1,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
IXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	16.754.430,00	6,95%	107	1,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
IXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	5.165.980,00	2,14%	17	2,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	6.080.545,53	2,52%	122	0,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	6.364.261,90	2,64%	6	13,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	10.120.428,49	4,20%	94	2,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
STERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	13.453.776,36	5,58%	7	8,50%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
IXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	16.284,13	0,01%	776	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
Ú INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.540.374,32	1,47%	62	0,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	13.554.515,08	5,62%	52	4,66%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
IXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2018	3.864.120,00	1,60%	163	0,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
IXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	13.551,63	0,01%	229	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 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	354.111,10	0,15%	642	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
GG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	D+0 ou D+1	Não há	1.895.935,05	0,79%	12	1,27%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
PORTFÓLIO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	D+45 a D+75	Não há	4.600.489,50	1,91%	202	1,14%	Artigo 7º, Inciso VI
ALFA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	16.681,08	0,01%			Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PRÊMIO FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	1.902.933,39	0,79%	98	1,90%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 7	Não se aplica	Não se aplica	47.346,15	0,02%	86	2,66%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	2.752,95	0,00%	42	0,14%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
GG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+31	Não há	5.237.218,82	2,17%	2.368	0,67%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
ALFA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	6.735.382,60	2,79%	61	1,56%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	5.853.993,14	2,43%	2.112	1,74%	Artigo 8º, Inciso III
DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	3.665.103,51	1,52%	7.264	0,99%	Artigo 8º, Inciso III
PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	503.417,10	0,21%	43	0,43%	Artigo 8º, Inciso III
PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	4.393.426,04	1,82%	230	0,65%	Artigo 8º, Inciso III
ALFAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	4.955.689,71	2,06%	113	3,14%	Artigo 8º, Inciso III
ALFA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	439.085,99	0,18%	119	0,10%	Artigo 8º, Inciso III
GG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+33	Não há	816.323,52	0,34%	383	1,12%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	D+4	Não há	2.343.172,19	0,97%	13	2,24%	Artigo 8º, Inciso III
GG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	4.125.436,78	1,71%	1.061	1,03%	Artigo 8º, Inciso III
PORTFÓLIO ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+361	Não há	5.170.334,24	2,14%	16	2,93%	Artigo 8º, Inciso IV
ALFAÇÃO FUTURO FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	795.718,35	0,33%	1.787	0,78%	Artigo 8º, Inciso IV
ALFA ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	307.369,93	0,13%	15	0,40%	Artigo 8º, Inciso V
GG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	845.791,95	0,35%			Artigo 8º, Inciso V

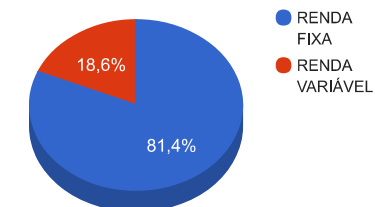
Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2017)

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	2.141.677,71	0,89%	266	0,67%	Artigo 8º, Inciso V
G PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	245.127,88	0,10%	39	0,13%	Artigo 8º, Inciso V
VOTORANTIM INFRAESTRUTURA ENERGIA SUST II FIP - ESUD11	Não se aplica	Não se aplica	687.386,11	0,29%			Artigo 8º, Inciso V
EA II REAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11	Não se aplica	Não se aplica	934.864,66	0,39%		0,52%	Artigo 8º, Inciso VI
RO PRETO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - ORPD11	Não se aplica	Não se aplica	2.157.413,95	0,89%		6,90%	Artigo 8º, Inciso VI
G PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRCR11	S/Info	Não se aplica	309.278,88	0,13%		0,02%	Artigo 8º, Inciso VI
		TOTAL -	241.132.755,63				

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

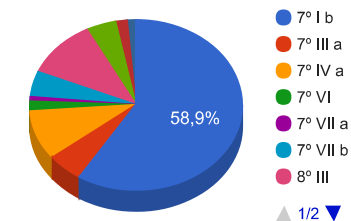
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	48.226.551,13
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	145.202.148,18	60,22%	40,00%	54,00%	80,00%	47.704.056,32
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	13.453.776,36	5,58%	0,00%	5,00%	20,00%	34.772.774,77
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	23.238.891,31	9,64%	5,00%	10,00%	30,00%	49.100.935,38
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	4.600.489,50	1,91%	0,00%	2,00%	10,00%	19.512.786,06
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	1.969.713,57	0,82%	0,00%	1,00%	5,00%	10.086.924,21
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	11.972.601,42	4,97%	0,00%	3,00%	5,00%	84.036,36
Total Renda Fixa	100,00%	200.437.620,34	83,12%	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%	27.095.647,98	11,24%	5,00%	8,00%	13,00%	4.251.610,25
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	11.203.271,41	4,65%	2,00%	5,00%	5,00%	853.366,37
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	4.227.353,58	1,75%	1,00%	2,00%	5,00%	7.829.284,20
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	3.401.557,49	1,41%	2,00%	5,00%	5,00%	8.655.080,29
Total Renda Variável	30,00%	45.927.830,46	19,05%	10,00	20,00	30,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: setembro / 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 "	145.202.148,18	60,22%	40,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	13.453.776,36	5,58%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	23.238.891,31	9,64%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	4.600.489,50	1,91%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	1.969.713,57	0,82%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	11.972.601,42	4,97%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	200.437.620,34	83,12%	45,00	170,00

Artigos - Renda Variável	Base: setembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	0,00	0,00%	0,00%	2,00%
Artigo 8º, Inciso III	27.095.647,98	11,24%	5,00%	13,00%
Artigo 8º, Inciso IV	11.203.271,41	4,65%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	4.227.353,58	1,75%	1,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	3.401.557,49	1,41%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	45.927.830,46	19,05%	10,00	30,00