

Relatório Analítico dos Investimentos em março e 1º Trimestre de 2018



Carteira consolidada de investimentos - base (março / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.902.675,52	0,52%	1.417	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	38.773.605,14	6,96%	167	3,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	42.846.183,00	7,69%	753	0,95%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	15.703.404,07	2,82%	72	1,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	13.738.056,65	2,46%	171	1,79%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	12.295.801,25	2,21%	20	3,97%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.554.966,04	1,36%	732	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	19.903.260,61	3,57%	223	0,62%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	11.707.056,90	2,10%	6	24,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	19.727.082,37	3,54%	31	4,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	30.585.836,33	5,49%	639	0,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRDESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	D+1	16/05/2019	18.200.089,65	3,27%	11	22,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	52.524.106,64	9,42%	110	6,80%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	14.335.135,42	2,57%	346	1,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.014.456,03	0,54%	1.005	5,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2018	8.359.904,00	1,50%	54	2,96%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	18/08/2018	44.723.258,03	8,02%	99	4,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	52.634.467,96	9,44%	481	0,59%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	3.846.049,76	0,69%	722	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	32.243.936,53	5,78%	239	2,90%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	22.532.934,44	4,04%	16	5,63%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	11.182.405,27	2,01%	63	0,73%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "

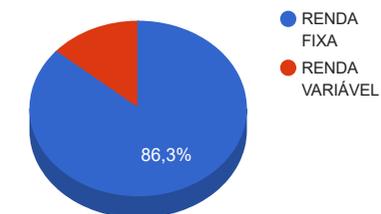
Carteira consolidada de investimentos - base (março / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	1.509.620,35	0,27%	98	1,53%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	11.481.572,65	2,06%	51	1,50%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	8.541.218,26	1,53%	110	3,35%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BRDESCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES	D+5	Não há	7.515.223,38	1,35%	11	8,34%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	9.178.991,03	1,65%	4.931	1,56%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	6.134.657,81	1,10%	253	1,14%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	6.217.564,73	1,12%	4.799	1,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	9.576.353,48	1,72%	35	4,03%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	14.925.898,73	2,68%	2.042	0,63%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	3.001.823,09	0,54%	19	3,21%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
TOTAL -			557.417.595,12				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (março / 2018)

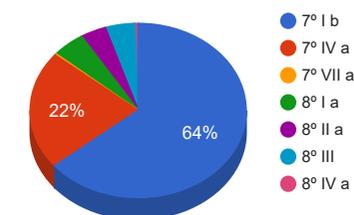
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	356.894.877,65	64,03%	45,00%	56,50%	65,00%	5.426.559,18
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	83.612.639,27
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	122.439.793,96	21,97%	10,00%	20,00%	35,00%	72.656.364,33
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	1.509.620,35	0,27%	0,00%	0,50%	0,50%	1.277.467,63
Total Renda Fixa	100,00%	480.844.291,96	86,26%	60,00	87,00	115,50	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	27.538.014,29	4,94%	2,00%	3,00%	5,00%	332.865,47
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	21.531.213,57	3,86%	4,00%	5,00%	7,00%	17.488.018,09
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	24.502.252,21	4,40%	4,00%	4,50%	8,00%	20.091.155,40
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	3.001.823,09	0,54%	0,00%	0,50%	1,00%	2.572.352,86
Total Renda Variável	30,00%	76.573.303,16	13,74%	10,00	13,00	21,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: março / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	356.894.877,65	64,03%	45,00%	65,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	122.439.793,96	21,97%	10,00%	35,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	1.509.620,35	0,27%	0,00%	0,50%
Total Renda Fixa	480.844.291,96	86,26%	60,00	115,50

Artigos - Renda Variável	Base: março / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	27.538.014,29	4,94%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	21.531.213,57	3,86%	4,00%	7,00%
Artigo 8º, Inciso III	24.502.252,21	4,40%	4,00%	8,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	3.001.823,09	0,54%	0,00%	1,00%
Total Renda Variável	76.573.303,16	13,74%	10,00	21,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (março / 2018)

Artigo 14º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	131.836.984,00	23,65%	0,01%
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	130.873.887,63	23,48%	0,01%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	127.149.136,38	22,81%	0,03%
SAFRA ASSET MANAGEMENT	49.754.634,42	8,93%	0,03%
ITAÚ UNIBANCO	30.909.487,64	5,55%	0,00%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	28.073.192,07	5,04%	0,01%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	17.924.621,63	3,22%	0,03%
ITAÚ DTVM	11.481.572,65	2,06%	0,00%
WESTERN ASSET	9.576.353,48	1,72%	0,02%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	9.178.991,03	1,65%	0,05%
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	6.134.657,81	1,10%	0,01%
GERAÇÃO FUTURO	3.014.456,03	0,54%	0,02%
FINAXIS CORRETORA	1.509.620,35	0,27%	1,53%

Microsoft OLE DB Provider for ODBC Drivers error '80040e14'

[MySQL][ODBC 5.3(a) Driver][mysqld-5.6.35-81.0-log]Duplicate entry '939' for key 'PRIMARY'

/plataforma/relatorios/uRentabilidade_rf.asp, line 62