

# Relatório Analítico dos Investimentos em junho, 2º Trimestre e 1º semestre de 2018



Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2018)

| Produto / Fundo  | Disponibilidade Resgate | Carência   | Saldo         | Particip. S/ Total | Qtde. Cotistas | % S/ PL Fundo | RESOLUÇÃO<br>3.922 / 4.392 / 4.604 |
|--|-------------------------|------------|---------------|--------------------|----------------|---------------|------------------------------------|
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA              | D+0                     | Não há     | 2.146.175,58  | 0,40%              | 1.438          | 0,01%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "  |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO             | D+0                     | 18/08/2018 | 45.777.050,94 | 8,49%              | 99             | 4,06%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "  |
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA              | D+0                     | 15/08/2024 | 15.137.484,10 | 2,81%              | 72             | 1,48%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "  |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP             | D+0                     | Não há     | 21.217.349,55 | 3,94%              | 661            | 0,60%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "  |
| SAFRA IMA FIC RENDA FIXA   | D+4                     | Não há     | 1.687.531,12  | 0,31%              | 21             | 0,63%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "  |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO             | D+0                     | 15/08/2022 | 39.023.643,27 | 7,24%              | 166            | 3,43%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "  |
| CAIXA BRASIL 2018 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA              | D+0                     | 16/08/2018 | 8.556.947,00  | 1,59%              | 54             | 2,96%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "  |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP      | D+0                     | Não há     | 39.271.676,59 | 7,29%              | 638            | 0,80%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "  |
| BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA      | D+1                     | Não há     | 7.364.837,21  | 1,37%              | 101            | 1,21%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "  |
| CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA              | D+0                     | 15/08/2018 | 20.373.088,59 | 3,78%              | 223            | 0,62%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "  |
| SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP | D+1                     | Não há     | 13.231.439,95 | 2,46%              | 173            | 2,19%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "  |
| SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA                | D+1                     | Não há     | 1.111.550,77  | 0,21%              | 310            | 0,10%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "  |
| BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                  | D+0                     | 15/08/2024 | 11.490.169,50 | 2,13%              | 6              | 24,52%        | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "  |
| BRDESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA               | D+1                     | 16/05/2019 | 17.936.189,96 | 3,33%              | 11             | 22,61%        | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "  |
| ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA                       | D+1                     | Não há     | 4.852.585,15  | 0,90%              | 34             | 1,33%         | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "  |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                          | D+0                     | Não há     | 10.024.245,58 | 1,86%              | 761            | 0,22%         | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI                    | D+0                     | Não há     | 63.114.832,28 | 11,71%             | 470            | 0,70%         | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA           | D+5                     | Não há     | 39.140.326,66 | 7,26%              | 133            | 2,34%         | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA              | D+1                     | Não há     | 11.245.408,04 | 2,09%              | 60             | 0,75%         | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA                                  | D+1                     | Não há     | 32.761.052,07 | 6,08%              | 17             | 7,17%         | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP                    | D+0                     | Não há     | 48.660.192,53 | 9,03%              | 765            | 0,62%         | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                            | D+1                     | Não há     | 12.339.535,27 | 2,29%              | 211            | 1,38%         | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |

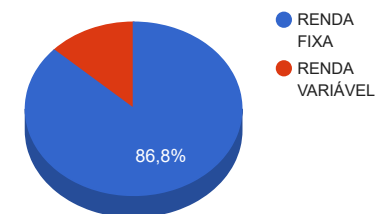
Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2018)

| Produto / Fundo                                     | Disponibilidade Resgate | Carência      | Saldo                 | Particip.<br>S/ Total | Qtde.<br>Cotistas | % S/ PL<br>Fundo | RESOLUÇÃO<br>3.922 / 4.392 / 4.604  |
|---|-------------------------|---------------|-----------------------|-----------------------|-------------------|------------------|-------------------------------------|
| PREMIUM FIDC SÊNIOR                                 | Não se aplica           | Não se aplica | 1.471.880,21          | 0,27%                 | 98                | 1,53%            | Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a " |
| BRDESCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES | D+5                     | Não há        | 1.468.850,40          | 0,27%                 | 9                 | 5,67%            | Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "   |
| ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES               | D+5                     | Não há        | 9.982.640,69          | 1,85%                 | 55                | 1,48%            | Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "   |
| BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO               | D+4                     | Não há        | 7.418.025,55          | 1,38%                 | 115               | 3,08%            | Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "   |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES        | D+4 ou D+33             | Não há        | 5.493.626,24          | 1,02%                 | 4.949             | 0,96%            | Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "  |
| BRDESCO SELECTION FI AÇÕES                          | D+4                     | Não há        | 5.130.892,31          | 0,95%                 | 119               | 5,45%            | Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "  |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES                   | D+30                    | Não há        | 8.330.157,43          | 1,55%                 | 5.627             | 1,39%            | Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "  |
| BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES                        | D+30                    | Não há        | 5.481.830,55          | 1,02%                 | 207               | 1,50%            | Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "  |
| SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO              | D+1                     | Não há        | 14.895.778,27         | 2,76%                 | 1.956             | 0,68%            | Artigo 8º, Inciso III               |
| WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO          | D+5                     | Não há        | 9.786.058,13          | 1,82%                 | 41                | 3,16%            | Artigo 8º, Inciso III               |
| CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP   | Não se aplica           | Não se aplica | 2.989.455,77          | 0,55%                 | 19                | 3,21%            | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "  |
| <b>TOTAL -</b>                                      |                         |               | <b>538.912.507,26</b> |                       |                   |                  |                                     |

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

| Artigos - Renda Fixa                | Resolução %    | Carteira \$           | Carteira %    | Estratégia de Alocação |              |               | GAP Superior   |
|-------------------------------------|----------------|-----------------------|---------------|------------------------|--------------|---------------|----------------|
|                                     |                |                       |               | Inferior %             | Alvo %       | Superior %    |                |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   | 100,00%        | 249.177.719,28        | 46,24%        | 45,00%                 | 56,50%       | 65,00%        | 101.115.410,44 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 60,00%         | 0,00                  | 0,00%         | 5,00%                  | 10,00%       | 15,00%        | 80.836.876,09  |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "  | 40,00%         | 217.285.592,43        | 40,32%        | 10,00%                 | 20,00%       | 35,00%        | -28.666.214,89 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a " | 5,00%          | 1.471.880,21          | 0,27%         | 0,00%                  | 0,50%        | 0,50%         | 1.222.682,33   |
| <b>Total Renda Fixa</b>             | <b>100,00%</b> | <b>467.935.191,92</b> | <b>86,83%</b> | <b>60,00</b>           | <b>87,00</b> | <b>115,50</b> | <b>-</b>       |

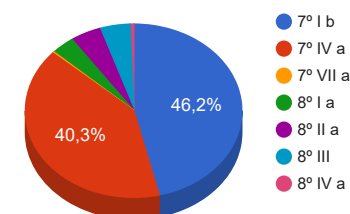
Distribuição por Segmento



 O Somatório dos incisos "a" e "b" do Artigo 7º IV não podem ultrapassar 40% (quarenta por cento).

| Artigos - Renda Variável           | Resolução %   | Carteira \$          | Carteira %    | Estratégia de Alocação |              |              | GAP Superior  |
|------------------------------------|---------------|----------------------|---------------|------------------------|--------------|--------------|---------------|
|                                    |               |                      |               | Inferior %             | Alvo %       | Superior %   |               |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "  | 30,00%        | 18.869.516,64        | 3,50%         | 2,00%                  | 3,00%        | 5,00%        | 8.076.108,72  |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " | 20,00%        | 24.436.506,53        | 4,53%         | 4,00%                  | 5,00%        | 7,00%        | 13.287.368,98 |
| Artigo 8º, Inciso III              | 10,00%        | 24.681.836,40        | 4,58%         | 4,00%                  | 4,50%        | 8,00%        | 18.431.164,18 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a " | 5,00%         | 2.989.455,77         | 0,55%         | 0,00%                  | 0,50%        | 1,00%        | 2.399.669,30  |
| <b>Total Renda Variável</b>        | <b>30,00%</b> | <b>70.977.315,34</b> | <b>13,17%</b> | <b>10,00</b>           | <b>13,00</b> | <b>21,00</b> | <b>-</b>      |

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

| Artigos - Renda Fixa                | Base: junho / 2018    |               | Limite Inferior (%) | Limite Superior (%) |
|-------------------------------------|-----------------------|---------------|---------------------|---------------------|
|                                     | Carteira (\$)         | Carteira (%)  |                     |                     |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   | 249.177.719,28        | 46,24%        | 45,00%              | 65,00%              |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 0,00                  | 0,00%         | 5,00%               | 15,00%              |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "  | 217.285.592,43        | 40,32%        | 10,00%              | 35,00%              |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a " | 1.471.880,21          | 0,27%         | 0,00%               | 0,50%               |
| <b>Total Renda Fixa</b>             | <b>467.935.191,92</b> | <b>86,83%</b> | <b>60,00</b>        | <b>115,50</b>       |

| Artigos - Renda Variável           | Base: junho / 2018   |               | Limite Inferior (%) | Limite Superior (%) |
|------------------------------------|----------------------|---------------|---------------------|---------------------|
|                                    | Carteira (\$)        | Carteira (%)  |                     |                     |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "  | 18.869.516,64        | 3,50%         | 2,00%               | 5,00%               |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " | 24.436.506,53        | 4,53%         | 4,00%               | 7,00%               |
| Artigo 8º, Inciso III              | 24.681.836,40        | 4,58%         | 4,00%               | 8,00%               |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a " | 2.989.455,77         | 0,55%         | 0,00%               | 1,00%               |
| <b>Total Renda Variável</b>        | <b>70.977.315,34</b> | <b>13,17%</b> | <b>10,00</b>        | <b>21,00</b>        |

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (junho / 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 |
|-----------------------------------|----------------|---------------|----------------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL           | 158.352.369,71 | 29,38%        | 0,04%          |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM        | 114.582.500,61 | 21,26%        | 0,01%          |
| BRADESCO ASSET MANAGEMENT         | 95.015.602,16  | 17,63%        | 0,01%          |
| ITAÚ UNIBANCO                     | 55.238.319,85  | 10,25%        | 0,00%          |
| SAFRA ASSET MANAGEMENT            | 49.344.361,46  | 9,16%         | 0,03%          |
| BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS   | 16.983.795,74  | 3,15%         | 0,03%          |
| SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT | 14.342.990,72  | 2,66%         | 0,00%          |
| ITAÚ DTVM                         | 9.982.640,69   | 1,85%         | 0,00%          |
| WESTERN ASSET                     | 9.786.058,13   | 1,82%         | 0,02%          |
| AZ QUEST INVESTIMENTOS            | 8.330.157,43   | 1,55%         | 0,04%          |
| BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT      | 5.481.830,55   | 1,02%         | 0,01%          |
| FINAXIS CORRETORA                 | 1.471.880,21   | 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 '900001' for key 'PRIMARY'

/plataforma/relatorios/uRentabilidade\_rf.asp, line 55