

Relatório Analítico dos Investimentos em outubro de 2017



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

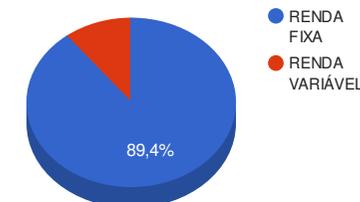
Carteira consolidada de investimentos - base (outubro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.792.754,99	2,04%			Artigo 20
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	24.537.240,59	27,87%	780	0,46%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRANCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	7.221.701,24	8,20%	193	1,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.951.291,50	5,62%	756	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	4.528.449,53	5,14%	347	0,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	735.700,16	0,84%	1.377	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.031.527,16	6,85%	715	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	14.059.093,91	15,97%	700	0,27%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.465.355,83	8,48%	437	0,39%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRANCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	4.371.582,23	4,97%	79	1,36%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	3.006.285,66	3,41%	38	0,89%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	973.195,61	1,11%	73	1,01%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.598.001,22	1,82%	1.847	2,36%	Artigo 8º, Inciso III
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	2.931.689,81	3,33%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	Não se aplica	Não se aplica	3.832.256,34	4,35%		4,23%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
		TOTAL -	88.036.125,78				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 20	100,00%	1.792.754,99	2,04%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.792.754,99
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	0,00	0,00%	30,00%	35,00%	70,00%	61.625.288,05
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	15,00%	20,00%	60,00%	52.821.675,47
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	73.901.942,15	83,95%	5,00%	5,00%	30,00%	-47.491.104,42
Artigo 7º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	13.205.418,87
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	3.006.285,66	3,41%	0,00%	2,50%	5,00%	1.395.520,63
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	4.401.806,29
Total Renda Fixa	100,00%	78.700.982,80	89,40%	55,00	75,00	185,00	-

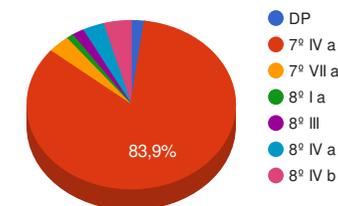
Distribuição por Segmento



⚠ 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%	973.195,61	1,11%	0,00%	0,00%	0,00%	-973.195,61
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.598.001,22	1,82%	5,00%	10,00%	15,00%	11.607.417,65
Artigo 8º, Inciso IV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.401.806,29
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	2.931.689,81	3,33%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.931.689,81
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	3.832.256,34	4,35%	0,00%	0,00%	0,00%	-3.832.256,34
Artigo 8º, Inciso V	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.401.806,29
Artigo 8º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.401.806,29
Total Renda Variável	30,00%	9.335.142,98	10,60%	11,00	25,00	30,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: outubro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 20	1.792.754,99	2,04%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	73.901.942,15	83,95%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	3.006.285,66	3,41%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	78.700.982,80	89,40%	55,00	185,00

Artigos - Renda Variável	Base: outubro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	973.195,61	1,11%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso III	1.598.001,22	1,82%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	2.931.689,81	3,33%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	3.832.256,34	4,35%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	9.335.142,98	10,60%	11,00	30,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (outubro / 2017)

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	40.367.824,96	45,85%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	23.538.834,94	26,74%	0,00%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	11.593.283,47	13,17%	0,00%
H11 CAPITAL	3.832.256,34	4,35%	46,92%
GGR INVESTIMENTOS	3.006.285,66	3,41%	0,57%

Microsoft VBScript runtime error '800a000b'

Division by zero

/plataforma/relatorios/uGestores.asp, line 21