

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



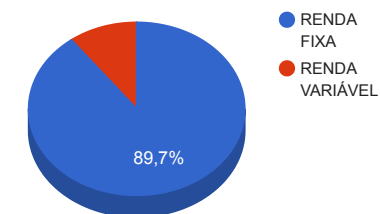
Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2017)

| Produto / Fundo | Disponibilidade Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Qtde. Cotistas | % S/ PL Fundo | RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604 |
|---|-------------------------|----------------|----------------------|-----------------------|-------------------|------------------|-------------------------------------|
| DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS | | | 8.538,74 | 0,02% | | | Artigo 20 |
| BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+1 | Não há | 4.676.551,79 | 9,73% | 109 | 0,98% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | Não há | 8.990.791,90 | 18,70% | 1.221 | 0,08% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+1 | Não há | 2.871.283,20 | 5,97% | 701 | 0,06% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+1 | Não há | 6.831.723,85 | 14,21% | 262 | 0,52% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | 15/08/2022 | 5.114.281,16 | 10,64% | 116 | 1,04% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | Não há | 2.907,45 | 0,01% | 642 | 0,00% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP | D+0 | Não há | 8.441.312,92 | 17,56% | 763 | 0,20% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| RDF FIDC SÊNIOR | D+30 | Não há | 509.222,40 | 1,06% | 69 | 1,45% | Artigo 7º, Inciso VI |
| INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP | Não se aplica | Não há | 5.666.585,28 | 11,79% | 15 | 10,20% | Artigo 7º, Inciso VI |
| BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP | D+4 | Não há | 1.848.653,88 | 3,84% | 88 | 1,44% | Artigo 8º, Inciso IV |
| SULAMÉRICA EVOLUTION FI MULTIMERCADO | D+5 | Não há | 507.573,11 | 1,06% | 111 | 0,24% | Artigo 8º, Inciso IV |
| JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11 | Não se aplica | Não se aplica | 2.103.788,12 | 4,38% | | 9,32% | Artigo 8º, Inciso VI |
| SULAMÉRICA CRÉDITO ATIVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP | D+30 | Não há | 506.727,50 | 1,05% | 277 | 0,11% | Desenquadrado - RV |
| | | TOTAL - | 48.079.941,30 | | | | |

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

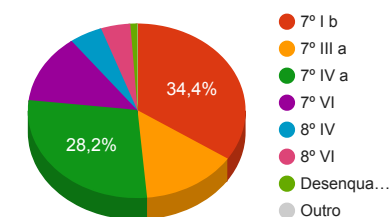
| Artigos - Renda Fixa | Resolução % | Carteira \$ | Carteira % | Estratégia de Alocação | | | GAP Superior |
|-------------------------------------|----------------|----------------------|---------------|------------------------|--------------|---------------|---------------|
| | | | | Inferior % | Alvo % | Superior % | |
| Artigo 20 | 100,00% | 8.538,74 | 0,02% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | -8.538,74 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " | 100,00% | 16.538.626,89 | 34,40% | 50,00% | 50,00% | 80,00% | 21.925.326,15 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 80,00% | 6.831.723,85 | 14,21% | 0,00% | 0,00% | 60,00% | 22.016.240,93 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " | 30,00% | 13.558.501,53 | 28,20% | 5,00% | 10,00% | 30,00% | 865.480,86 |
| Artigo 7º, Inciso VI | 15,00% | 6.175.807,68 | 12,84% | 5,00% | 10,00% | 15,00% | 1.036.183,52 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a " | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 2,50% | 5,00% | 2.403.997,07 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b " | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 2,50% | 5,00% | 2.403.997,07 |
| Total Renda Fixa | 100,00% | 43.113.198,69 | 89,67% | 60,00 | 75,00 | 215,00 | - |

Distribuição por Segmento



| Artigos - Renda Variável | Resolução % | Carteira \$ | Carteira % | Estratégia de Alocação | | | GAP Superior |
|-----------------------------|---------------|---------------------|---------------|------------------------|--------------|--------------|--------------|
| | | | | Inferior % | Alvo % | Superior % | |
| Artigo 8º, Inciso I | 30,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 15,00% | 7.211.991,20 |
| Artigo 8º, Inciso III | 15,00% | 0,00 | 0,00% | 3,00% | 5,00% | 15,00% | 7.211.991,20 |
| Artigo 8º, Inciso IV | 5,00% | 2.356.226,99 | 4,90% | 2,00% | 5,00% | 5,00% | 47.770,08 |
| Artigo 8º, Inciso V | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 5,00% | 2.403.997,07 |
| Artigo 8º, Inciso VI | 5,00% | 2.103.788,12 | 4,38% | 0,00% | 5,00% | 5,00% | 300.208,95 |
| Desenquadrado - RV | 0,00% | 506.727,50 | 1,05% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | -506.727,50 |
| Total Renda Variável | 30,00% | 4.966.742,61 | 10,33% | 5,00 | 25,00 | 45,00 | - |

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 20 | 8.538,74 | 0,02% | 0,00% | 0,00% |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " | 16.538.626,89 | 34,40% | 50,00% | 80,00% |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 6.831.723,85 | 14,21% | 0,00% | 60,00% |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " | 13.558.501,53 | 28,20% | 5,00% | 30,00% |
| Artigo 7º, Inciso VI | 6.175.807,68 | 12,84% | 5,00% | 15,00% |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a " | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b " | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% |
| Total Renda Fixa | 43.113.198,69 | 89,67% | 60,00 | 195,00 |

| Artigos - Renda Variável | Base: setembro / 2017 | | Limite Inferior (%) | Limite Superior (%) |
|-----------------------------|-----------------------|---------------|---------------------|---------------------|
| | Carteira (\$) | Carteira (%) | | |
| Artigo 8º, Inciso I | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 15,00% |
| Artigo 8º, Inciso II | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 10,00% |
| Artigo 8º, Inciso III | 0,00 | 0,00% | 5,00% | 15,00% |
| Artigo 8º, Inciso IV | 2.356.226,99 | 4,90% | 2,00% | 5,00% |
| Artigo 8º, Inciso V | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% |
| Artigo 8º, Inciso VI | 2.103.788,12 | 4,38% | 0,00% | 5,00% |
| Desenquadrado - RV | 506.727,50 | 1,05% | 0,00% | 0,00% |
| Total Renda Variável | 4.966.742,61 | 10,33% | 7,00 | 55,00 |

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

[MySQL][ODBC 5.3(a) Driver][mysqld-5.6.35-81.0-log]Duplicate entry '929' for key 'PRIMARY'

/plataforma/relatorios/uRentabilidade_rf.asp, line 62