

RELATÓRIO DE ACOMPANHAMENTO DE PERFORMANCE E ENQUADRAMENTO PERANTE A RESOLUÇÃO 3.922/10 E ALTERAÇÕES, OUTUBRO - 2019

Instituições	Fundos	PL	CATEGORIA	%	L.Bacem	ENQUADRAMENTO		
1	BRABESCO	INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC	R\$ 21.355.551,48	Renda Fixa	7,08%	40%	Artigo 7º, IV, a a) Fundos Renda fixa em geral.	
2	ITAÚ	INSTITUCIONAL ALOC DINAMIC II	R\$ 20.954.856,08	Renda Fixa				
3	SANTANDER	INSTITUCIONAL RF DI	R\$ 19.052.816,01	Renda Fixa				
4	RJI	TMJ IMA B FI RF	R\$ 30.696.033,29	Renda Fixa				
							Total	R\$ 92.059.256,86
5	PLANNER	FIRF PYXIS INSTITUCIONAL IMAB	R\$ 13.181.786,13	Renda Fixa	7,15%	60%	Artigo 7º, III, a a) cotas de fundos de investimento classificados como renda fixa	
6	RJI	TOWER RF FI IMAB-5 II	R\$ 18.833.596,10	Renda Fixa				
7	RJI	TOWER RF FI IMAB-5	R\$ 60.961.351,72	Renda Fixa				
							Total	R\$ 92.976.733,95
8	CAIXA	CAIXA FI BRASIL IMA-B5 TP RF LP	R\$ 242.932.618,44	Renda Fixa	33,29%	100%	Artigo 7º, I, b b) Fundos referenciados 100% Títulos Públicos	
9	SAFRA	SAFRA IMA FIC RF	R\$ 8.662.050,42	Renda Fixa				
10	BANCO BRASIL	ALOCÇÃO AT RF PREVIDENCIARIO	R\$ 72.215.406,53	Renda Fixa				
11	BANCO BRASIL	BB PREVIDENCIARIO RF IMA-B 5	R\$ 63.695.634,28	Renda Fixa				
12	ITAU	INSTITUCIONAL RF INFLAÇÃO 5	R\$ 45.326.604,37	Renda Fixa				
							Total	R\$ 432.832.314,04
13	BANCO BRASIL	CARTEIRA LONGO PRAZO (NTN-B)	R\$ 208.703.816,05	Renda Fixa	16,05%	100%	Art 7, I, a - Títulos Públicos de emissão do TN	
							Total	R\$ 208.703.816,05
14	INTRADER	PIATÁ RF LP PREV CRÉD. PRIV	R\$ 17.594.255,91	Crédito Privado	1,35%	5%	Artigo 7º, VII, b - Fundos Renda fixa/Crédito Privado	
							Total	R\$ 17.594.255,91
15	RJI	INCENTIVO II MULTISSETORIAL II	R\$ 14.368.398,00	Renda Fixa - FIDC	5,15%	5%	Artigo 7º, VII, a a) Cota de classe sênior de fundos de investimento em direito creditório (FIDC)	
16	CM CAPITAL	GGR PRIME I FIDC	R\$ 14.604.419,20	Renda Fixa - FIDC				
17	QUELUZ	ILLUMINATI FIDC	R\$ 31.729.531,92	Renda Fixa - FIDC				
18	ORLA	LME FIDC SENIOR	R\$ 6.093.679,98	Renda Fixa - FIDC				
19	SANTANDER	BBIF MASTER FIDC LP	R\$ 120.034,49	Renda Fixa - FIDC				
20	RJI	INCENTIVO MULTISSETORIAL I A/B	R\$ 214,35	Renda Fixa - FIDC				
							Total	R\$ 66.916.277,94
21	RJI	FI MULTIMERCADO SCULPTOR CP	R\$ 40.608.710,59	Multimercado	3,12%	10%	Artigo 8º, Inciso III	
							Total	R\$ 40.608.710,59
22	RJI	HAZZ	R\$ 12.117.594,76	Imobiliário	2,06%	5%	Artigo 8º, IV, b b) FII presença 60% pregões 12 meses anteriores.	
23	ELITE CCVM	BR HOTEIS FII	R\$ 13.250.140,15	Imobiliário				
24	PLANNER	INFRA REAL ESTATE FII	R\$ 1.447.049,84	Imobiliário				
							Total	R\$ 26.814.784,75
25	RJI	INFRA SETORIAL	R\$ 13.185.390,00	FIP	4,61%	5%	Artigo 8º, IV, a a) FIPs (que atendam requisitos governança).	
26	PLANNER	W7 FIP /INFRATEC	R\$ 2.104.562,59	FIP				
27	RJI	FIP/ATICO GESTÃO EMPRESARIAL	R\$ 642.249,90	FIP				
28	BNY MELLON	ATICO FLORESTAL FIP	R\$ 3.269.190,51	FIP				
29	LAD CAPITAL	FIM FP1/FP2 LONGO PRAZO	R\$ 25.038.744,35	FIP				
30	BNY MELLON	ATICO GERAÇÃO ENERGIA	R\$ 15.729.208,38	FIP				
							Total	R\$ 59.969.345,73
31	BRABESCO	GERAÇÃO FIA	R\$ 39.307.208,82	Ações	20,13%	20%	Artigo 8º, II, a a) Fundo de Ações	
32	BRABESCO	BAHIA BBM VALUATION II FIC FIA	R\$ 35.631.246,44	Ações				
33	BRABESCO	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 54.923.907,73	Ações				
34	ITAÚ	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 66.832.619,82	Ações				
35	BRABESCO	BRABESCO FI AÇÕES SELECTION	R\$ 65.048.839,84	Ações				
							Total	R\$ 261.743.822,65
TOTAL SEGMENTO RENDA FIXA		R\$ 911.082.654,75			70,07%	Resolução CMN Nº 4695/2018		
TOTAL SEGMENTO RENDA VARIÁVEL		R\$ 389.136.663,72			29,93%			
TOTAL GERAL		R\$ 1.300.219.318,47			100,00%			

Marcos André Breda
Diretor Presidente

Douglas Henrique Muncelli
Diretor Administrativo e Financeiro

Desenquadramento

* O Desenquadramento do 7º, VII, é provenientes de aplicações realizadas em gestões anteriores. O Instituto buscará, respeitando os prazos contratuais bem como a liquidez destes fundos, uma realocação dos respectivos valores de forma a cumprir os limites da Resolução 3.922/2010 e 4.604/2017.

* O Desenquadramento do 8º, II, é oriundo de rendimentos da carteira muito acima do esperado.