

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

Instituições	Fundos	PL	CATEGORIA	%	L.Bacem	ENQUADRAMENTO	
BRASESCO	INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC	R\$ 21.272.680,18	Renda Fixa	6,96%	40%	Artigo 7º, IV, a a) Fundos Renda fixa em geral.	
ITAÚ	INSTITUCIONAL ALOC DINAMIC II	R\$ 21.027.928,98	Renda Fixa				
SANTANDER	INSTITUCIONAL RF DI	R\$ 18.117.850,02	Renda Fixa				
RJI	TMJ IMA B FI RF	R\$ 30.278.955,15	Renda Fixa				
						Total	R\$ 90.697.414,33
PLANNER	FIRF PYXIS INSTITUCIONAL IMAB	R\$ 12.718.067,39	Renda Fixa	7,06%	60%	Artigo 7º, III, a a) cotas de fundos de investimento classificados como renda fixa	
RJI	TOWER RF FI IMAB-5 II	R\$ 18.663.057,57	Renda Fixa				
RJI	TOWER RF FI IMAB-5	R\$ 60.568.578,54	Renda Fixa				
						Total	R\$ 91.949.703,50
CAIXA	CAIXA FI BRASIL IMA-B5 TP RF LP	R\$ 245.106.478,47	Renda Fixa	33,30%	100%	Artigo 7º, I, b b) Fundos referenciados 100% Títulos Públicos	
SAFRA	SAFRA IMA FIC RF	R\$ 8.443.429,71	Renda Fixa				
BANCO BRASIL	ALOCÇÃO AT RF PREVIDENCIARIO	R\$ 71.538.013,63	Renda Fixa				
BANCO BRASIL	BB PREVIDENCIARIO RF IMA-B 5	R\$ 63.449.728,45	Renda Fixa				
ITAU	INSTITUCIONAL RF INFLAÇÃO 5	R\$ 45.192.757,56	Renda Fixa				
						Total	R\$ 433.730.407,82
BANCO BRASIL	CARTEIRA LONGO PRAZO (NTN-B)	R\$ 206.150.760,04	Renda Fixa	15,83%	100%	Art 7, I, a - Títulos Públicos de emissão do TN	
						Total	R\$ 206.150.760,04
INTRADER	PIATÁ RF LP PREV CRÉD. PRIV	R\$ 23.443.214,49	Crédito Privado	1,80%	5%	Artigo 7º, VII, b - Fundos Renda fixa/Crédito Privado	
						Total	R\$ 23.443.214,49
RJI	INCENTIVO II MULTISSETORIAL II	R\$ 14.342.398,19	Renda Fixa - FIDC	5,13%	5%	Artigo 7º, VII, a a) Cota de classe sênior de fundos de investimento em direito creditorio (FIDIC)	
CM CAPITAL	GGR PRIME I FIDC	R\$ 14.555.918,73	Renda Fixa - FIDC				
QUELUZ	ILLUMINATI FIDC	R\$ 31.681.040,67	Renda Fixa - FIDC				
ORLA	LME FIDC SENIOR	R\$ 6.082.743,86	Renda Fixa - FIDC				
SANTANDER	BBIF MASTER FIDC LP	R\$ 119.439,78	Renda Fixa - FIDC				
RJI	INCENTIVO MULTISSETORIAL I A/B	R\$ 0,00	Renda Fixa - FIDC				
						Total	R\$ 66.781.541,23
RJI	FI MULTIMERCADO SCULPTOR CP	R\$ 40.534.150,01	Multimercado	3,11%	10%	Artigo 8º, Inciso III	
						Total	R\$ 40.534.150,01
RJI	HAZZ	R\$ 12.116.833,88	Imobiliário	2,06%	5%	Artigo 8º, IV, b b) FII presença 60% pregões 12 meses anteriores.	
ELITE CCVM	BR HOTEIS FII	R\$ 13.235.684,50	Imobiliário				
PLANNER	INFRA REAL ESTATE FII	R\$ 1.448.083,39	Imobiliário				
						Total	R\$ 26.800.601,77
RJI	INFRA SETORIAL	R\$ 13.164.225,53	FIP	4,63%	5%	Artigo 8º, IV, a a) FIPs (que atendam requisitos governança).	
PLANNER	W7 FIP /INFRA TEC	R\$ 2.101.257,32	FIP				
RJI	FIP/ATICO GESTÃO EMPRESARIAL	R\$ 640.680,00	FIP				
BNY MELLON	ATICO FLORESTAL FIP	R\$ 3.652.238,22	FIP				
LAD CAPITAL	FIM FP1/FP2 LONGO PRAZO	R\$ 25.036.951,58	FIP				
BNY MELLON	ATICO GERAÇÃO ENERGIA	R\$ 15.725.028,83	FIP				
						Total	R\$ 60.320.381,48
BRASESCO	GERAÇÃO FIA	R\$ 38.964.448,41	Ações	20,13%	20%	Artigo 8º, II, a a) Fundo de Ações	
BRASESCO	BAHIA BBM VALUATION II FIC FIA	R\$ 35.900.765,35	Ações				
BRASESCO	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 55.175.564,47	Ações				
ITAU	ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 68.102.572,23	Ações				
BRASESCO	BRASESCO FI AÇÕES SELECTION	R\$ 64.107.556,87	Ações				
						Total	R\$ 262.250.907,33
TOTAL SEGMENTO RENDA FIXA		R\$ 912.753.041,41		70,07%	Resolução CMN N° 4695/2018		
TOTAL SEGMENTO RENDA VARIÁVEL		R\$ 389.906.040,59		29,93%			
TOTAL GERAL		R\$ 1.302.659.082,00		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.