

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL
PLANO I

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 29.06.2018

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.225.906.378,75		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			944.279.616,09	77,03	
<u>TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOURO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOURO NACIONAL</u>					
<u>Nota do Tesouro Nacional</u>		178.689	624.694.294,40	50,96	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			206.619.524,99	16,85	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		3.502,00	6.304.542,94	0,51	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	1	24.254.454,66	1,98	1,98
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	1	2.049.020,58	0,17	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	1	3.383.584,48	0,28	0,44
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	3.500	6.304.542,94	0,51	0,51
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-1	-24.254.454,66	-1,98	-1,98
- BANCO MORADA		-1	-5.432.605,06	-0,44	-0,44
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		161	65.025.306,56	5,30	
. PARANÁ BANCO		50	12.234.119,03	1,00	1,00
. ABC		1	9.634.928,10	0,79	0,79
. BRADESCO		105	30.605.438,17	2,50	2,50
. BANCO BTG PACTUAL		1	9.595.119,03	0,78	0,78
. SAFRA		4	2.955.702,23	0,24	0,24
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		41.982.453,73	135.289.675,49	11,04	
. SANT FIC FI ISN RF D		516,24	86.598,25	0,01	0,01
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		29.218.735,08	47.499.258,45	3,87	3,87
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		184.674,14	19.659.055,60	1,60	1,60
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FIM II		9.999.636,36	6.563.724,61	0,54	0,54
. BNP PARIBAS MATCH DI FI RENDA FIXA		78,65	26.182,08	0,00	0,00
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		45.250,01	6.538.599,20	0,53	0,53
. CA INDOSUEZ VITESSE FI RENDA FIXA CP		2.516.871,95	52.691.768,74	4,30	4,30
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		4.713,99	146.658,28	0,01	0,01
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		7.000,00	44.784,54	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		4.958,18	21.330,41	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		9,76	1.327.459,63	0,11	0,11
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR		9,37	684.255,70	0,06	0,06
<u>Debêntures</u>		29.717	60.058.625,49	4,90	
. LOJAS AMERICANAS		432	4.612.947,41	0,38	0,38
. ECOPISTAS		7.000	8.228.383,95	0,67	0,67
. LOCALIZA		289	3.018.271,97	0,25	0,25
. CEMIG		20.000	28.093.949,92	2,29	2,29
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		849	2.202.052,93	0,18	0,18
. SABESP		887	11.200.361,71	0,91	0,91
. ESPIRÍTO SANTO CENTRAIS ELÉTRICAS		140	1.457.031,60	0,12	0,12
. BR TOWERS SPEI S.A.		120	1.245.626,00	0,10	0,10
. VALORES A RECEBER			4.599.655,00	0,38	0,38
. COMANCHE PART.			4.599.655,00	0,38	0,38
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		0,00	-4.599.655,00	-0,38	-0,38
. COMANCHE PART.			-4.599.655,00	-0,38	-0,38
<u>Outros Títulos</u>		43	52.907.171,21	4,32	
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		36	5.606.368,44	0,46	0,46
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	15.338.449,73	1,25	1,25
. VALORES A RECEBER		1	107.378.617,97	8,76	8,76
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		-1,00	-75.416.264,93	-6,15	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO - ALOÉS		-1	-7.567.128,03	-0,62	-0,62
. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCARIO - BANIF			-67.849.136,90	-5,53	-5,53

B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			19.483.291,73	1,59	
B1. Mercado de Ações			18.063.092,95	1,47	
Companhias Abertas		839.317	14.224.044,96	1,16	
. AMBEV	ON	35.468	637.714,64	0,05	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	27.224	490.032,00	0,04	
. COSAN	ON	19.800	696.564,00	0,06	
. ECORODOVIAS	ON	48.700	360.380,00	0,03	
. EVEN	ON	0	0,00	0,00	
. GERDAU - GGBR	PN	62.364	867.483,24	0,07	
. IGUATEMI EMP SHOP S.A	ON	23.800	733.992,00	0,06	
. ITAUSA	ON	94	930,60	0,00	
. ITAUSA	PN	159.709	1.466.128,62	0,12	
. MARCOPOLO	PN	94.800	317.580,00	0,03	
. MRVE	ON	32.300	388.892,00	0,03	
. PETROBRÁS	PN	91.917	1.580.053,23	0,13	
. RANDON PART	PN	65.241	402.536,97	0,03	
. RENT	ON	61.692	1.463.951,16	0,12	
. RUMO	ON	16.919	238.557,90	0,02	
. SUZANO PAPEL	PNA	24.300	1.092.771,00	0,09	
. TOTVS	ON	13.400	364.480,00	0,03	
. VALE R. DOCE	PNA	61.589	3.054.198,51	0,25	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			67.799,09	0,01	
Instituições Financeiras		114.733	3.839.047,99	0,31	
. BRADESCO	PN	59.593	1.612.735,70	0,13	
. ITAU	PN	55.140	2.224.347,60	0,18	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			1.964,69	0,00	
B2. Fundos		1.154,00	1.420.198,78	0,12	
. FATOR SINERGIA V		1.154,00	1.420.198,78	0,12	
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		9.630.869	93.720.308,22	7,64	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.414,82	3.761.139,96	0,31	
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.281,00	19.232.151,79	1,57	
. FIP BVEP PLAZA		3.000,00	3.163.042,11	0,26	
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		6.100,75	4.373.328,52	0,36	
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		998.454,93	889.251,04	0,07	
. HAMILTON LANE FIC FIP		11.154,39	14.519.419,28	1,18	
. MULTINER FIP		9,44	624.362,48	0,05	
.STRATUS SCP BR FIP		3.266.587,00	4.560.220,78	0,37	
. P2BR INFR III FIQFIP		5.363,21	8.401.019,58	0,69	
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		79.208,00	7.026.541,68	0,57	
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		470,67	6.740.297,05	0,55	
. GGR COVEPI RENDA FII		57.000,00	6.931.200,00	0,57	
. MAUÁ MACRO II FIC DE FIM		6.494,98	4.618.286,03	0,38	
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		2.301.824,16	4.313.950,63	0,35	
. KINEA CHRONOS FIM		2.885.505,73	4.538.374,49	0,37	
. VALORES A RECEBER			27.722,80	0,00	
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		15.390.294	42.694.315,11	3,48	
. BB MM SCH INV EXTE FI		4.519.272,85	10.869.842,15	0,89	
. MSQUARE GL EQ FICFIM		3.305.204,08	8.604.044,52	0,70	
. VOT ALLIANZGI FIM		3.814.282,63	8.021.583,42	0,65	
. WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI		3.465,71	4.847.156,46	0,40	
. GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE		46.431,13	5.217.079,56	0,43	
. PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR		3.701.637,15	5.134.609,00	0,42	
E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			88.464.212,53	7,22	
E1 - Investimentos em Shopping Center			80.068.212,53	6,53	
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			27.332.318,47	2,23	
. SHOPPING PLAZA SUL			52.523.898,71	4,28	
. VALORES A RECEBER			211.995,35	0,02	
E2 - Investimento Imobiliário			8.396.000,00	0,68	
. PANAMBY			8.396.000,00	0,68	
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00	
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		1.680	37.441.115,21	3,05	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		1.680	36.143.567,32	2,95	
. VALORES A PAGAR (-)			-33.346,88	0,00	
. VALORES A RECEBER			1.330.894,77	0,11	
G - OUTROS			-176.480,14	-0,01	
. DISPONIVEL			176.355,66	0,01	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			333.512,07	0,03	
. OUTROS REALIZAVEIS			333.512,07	0,03	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-686.347,87	-0,06	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-333.512,07	-0,03	

GESTÃO TERCEIRIZADA	DISTRIBUIÇÃO	(%) EM RELAÇÃO A GESTÃO TERCEIRIZADA	(%) EM RELAÇÃO AO RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS			
- SANT FIC FI ISN RF D	86.598,25	0,03%	0,01%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO	47.499.258,45	17,39%	3,87%
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP	19.659.055,60	7,20%	1,60%
- BNP PARIBAS MATCH DI FI RENDA FIXA	26.182,08	0,01%	0,00%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP	6.538.599,20	2,39%	0,53%
- CA INDOSUEZ VITESSE FI RENDA FIXA CP	52.691.768,74	19,29%	4,30%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER	146.658,28	0,05%	0,01%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER II	44.784,54	0,02%	0,00%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER III	21.330,41	0,01%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.	1.327.459,63	0,49%	0,11%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR	684.255,70	0,25%	0,06%
- BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FIM II	6.563.724,61	2,40%	0,54%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP	3.761.139,96	1,38%	0,31%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	19.232.151,79	7,04%	1,57%
- FIP BVEP PLAZA	3.163.042,11	1,16%	0,26%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES	4.373.328,52	1,60%	0,36%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE	889.251,04	0,33%	0,07%
- HAMILTON LANE FIC FIP	14.519.419,28	5,32%	1,18%
- MULTINER FIP	624.362,48	0,23%	0,05%
- STRATUS SCP BR FIP	4.560.220,78	1,67%	0,37%
- P2BR INFR III FIQFIP	8.401.019,58	3,08%	0,69%
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO	7.054.264,48	2,58%	0,58%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	6.740.297,05	2,47%	0,55%
- GGR COVEPI RENDA FII	6.931.200,00	2,54%	0,57%
- MAUÁ MACRO II FIC DE FIM	4.618.286,03	1,69%	0,38%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS	4.313.950,63	1,58%	0,35%
- KINEA CHRONOS FIM	4.538.374,49	1,66%	0,37%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			
- BB MM SCH INV EXTE FI	10.869.842,15	3,98%	0,89%
- MSQUARE GL EQ FICFIM	8.604.044,52	3,15%	0,70%
- VOT ALLIANZGI FIM	8.021.583,42	2,94%	0,65%
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI	4.847.156,46	1,77%	0,40%
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE	5.217.079,56	1,91%	0,43%
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR	5.134.609,00	1,88%	0,42%
TOTAL	273.124.497,60	100,00%	22,28%

GESTÃO PRÓPRIA	DISTRIBUIÇÃO	(%) EM RELAÇÃO A GESTÃO TERCEIRIZADA	(%) EM RELAÇÃO AO RECURSOS GARANTIDORES
RENDA FIXA	808.989.940,60	84,91%	65,99%
RENDA VARIÁVEL	18.063.092,95	1,90%	1,47%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	88.464.212,53	9,28%	7,22%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	37.441.115,21	3,93%	3,05%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	-176.480,14	-0,02%	-0,01%
TOTAL	952.781.881,15	100,00%	77,72%