

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL
PLANO II

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 29.06.2018

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO	DIVERSIFICAÇÃO
	TIPO			PATRIMÔNIO (%)	(%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.049.468.968,12		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			664.698.184,71	63,34	
TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOURO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOURO NACIONAL					
Nota do Tesouro Nacional		146.083	464.103.203,69	44,22	
APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS			142.932.904,05	13,62	
Certificado de Depósito Bancário		1.500,00	2.701.946,97	0,26	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	1	13.141.991,09	1,25	1,25
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	1	3.403.988,49	0,32	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	1	2.047.692,08	0,20	0,52
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	1.500	2.701.946,97	0,26	0,26
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-1	-13.141.991,09	-1,25	-1,25
- BANCO MORADA		-2	-5.451.680,57	-0,52	-0,52
Letra Financeira Subordinada		131	32.017.877,31	3,05	
. BRADESCO		71	18.730.971,82	1,78	
. PARANÁ BANCO		35,00	7.637.174,84	0,73	
. ABC		25,00	5.649.730,65	0,54	
Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.		43.682.955,95	108.213.079,77	10,31	
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FIM II		4.999.818,18	3.281.862,30	0,31	0,31
. BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP		3.024.304,06	328.697,39	0,03	0,03
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		33.643.563,41	54.692.453,64	5,21	5,21
. BNP PARIBAS MATCH DI FI RENDA FIXA		82,69	22.419,15	0,00	0,00
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		30.166,67	4.359.066,13	0,42	0,42
. CA INDOSUEZ VITESSE FI RENDA FIXA CP		1.977.531,69	41.400.454,53	3,94	3,94
. FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER		2.474,99	77.000,26	0,01	0,01
. FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER II		3.000,00	19.193,37	0,00	0,00
. FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER III		1.976,00	8.500,88	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		19,52	2.654.596,04	0,25	0,25
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR		18,74	1.368.836,08	0,13	0,13
Debêntures		13.736	43.205.393,42	4,12	
. LOJAS AMERICANAS		288	3.075.298,27	0,29	0,29
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		700	1.815.591,35	0,17	0,17
. CEMIG		10.000	14.046.974,93	1,34	1,34
. LOCALIZA		386	4.031.325,19	0,38	0,38
. ROTA DAS BANDEIRAS		500	7.590.838,78	0,72	0,72
. SABESP		1.477	8.643.415,39	0,82	0,82
. ESPÍRITO SANTO CENTRAIS ELÉTRICAS		205	2.133.510,51	0,20	0,20
. BR TOWERS SPEI S.A.		180	1.868.439,00	0,18	0,18
. VALORES A RECEBER			3.127.765,40	0,30	
. COMANCHE PART.			3.127.765,40	0,30	0,30
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		0,00	-3.127.765,40	-0,30	
. COMANCHE PART.			-3.127.765,40	-0,30	-0,30
Outros Títulos		25	14.456.683,55	1,38	
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		25	3.882.432,47	0,37	0,37
. VALORES A RECEBER			30.362.882,26	2,89	2,89
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		0	-19.788.631,18	-1,89	
. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCARIO - BANIF			-19.788.631,18	-1,89	-1,89

B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			155.661.700,01	14,83	
B1. Mercado de Ações			80.019.201,83	7,62	
Companhias Abertas		2.373.824	71.328.508,07	6,80	
. AMBEV	ON	87.539	1.573.951,22	0,15	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	64.254	1.156.572,00	0,11	
. COSAN	ON	48.600	1.709.748,00	0,16	
. ECORODOVIAS	ON	109.500	810.300,00	0,08	
. GERDAU - GGBR	PN	96.424	1.341.257,84	0,13	
. IGUATEMI EMP SHOP S.A	ON	59.100	1.822.644,00	0,17	
. ISHARES BOVA	CI	572.000	40.240.200,00	3,83	
. ITAUSA	ON	216,00	2.138,40	0,00	
. ITAUSA	PN	360.800	3.312.144,00	0,32	
. MARCOPOLO	PN	187.800	629.130,00	0,06	
. MRVE	ON	78.400	943.936,00	0,09	
. PETROBRÁS	PN	183.377	3.152.250,63	0,30	
. RANDON PART	PN	135.675	837.114,75	0,08	
. RENT	ON	129.969	3.084.164,37	0,29	
. RUMO	ON	34.374	484.673,40	0,05	
. SUZANO PAPEL	PNA	62.200	2.797.134,00	0,27	
. TOTVS	ON	34.100	927.520,00	0,09	
. VALE R. DOCE	PNA	129.496	6.421.706,64	0,61	
. VALORES A RECEBER				0,00	
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			81.922,82	0,01	
Instituições Financeiras		260.934	8.690.693,76	0,83	
. BRADESCO	PN	136.893	3.682.421,70	0,35	
. ITAU	PN	124.041	5.003.813,94	0,48	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			4.458,12	0,00	
B2. Fundos		26.328.426,61	75.642.498,18	7,21	
. FATOR SINERGIA V		2.968,00	3.652.642,97	0,35	
. M. SQUARE INST. FIC FIA		11.563.945,16	23.073.764,24	2,20	
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		11.398.044,90	18.152.215,59	1,73	
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.300.735,63	17.286.622,89	1,65	
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	13.477.252,49	1,28	
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		19.465.725	93.357.806,11	8,90	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II- FIP		10.778,33	27.931,52	0,00	
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		395,93	5.944.281,79	0,57	
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		8.187,00	13.969.969,19	1,33	
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		2.000,00	2.108.694,74	0,20	
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		2.614,47	1.874.181,24	0,18	
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		665.636,79	592.834,18	0,06	
. HAMILTON LANE FIC FIP		5.746,20	7.479.700,87	0,71	
.STRATUS SCP BR FIP		3.266.587,00	4.560.220,78	0,43	
. P2 BR INFRAESTRUTURA III FIC DE FIP		2.683,79	4.203.934,23	0,40	
. COPA FLORESTAL III		7.598.242,00	7.432.903,42	0,71	
. MEMORIAL OFFICE FI IMOBILIARIO		10.000,00	919.999,93	0,09	
. ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO		39.000,00	12.480.390,00	1,19	
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		19.802,00	1.756.635,42	0,17	
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		313,78	4.493.531,41	0,43	
. GGR COVEPI RENDA FII		43.000,00	5.228.800,00	0,50	
. MAUÁ MACRO II FIC DE FIM		9.742,48	6.927.429,05	0,66	
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		3.452.736,24	6.470.925,95	0,62	
. KINEA CHRONOS FIM		4.328.258,59	6.807.561,73	0,65	
. VALORES A RECEBER			77.880,70	0,01	
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		16.013.873	44.208.730,53	4,21	
. BB MM SCH INV EXTE FI		5.128.757,86	12.335.787,24	1,18	
. MSQUARE GL EQ FICFIM		3.342.850,69	8.702.045,48	0,83	
. VOT ALLIANZGI FIM		3.790.730,70	7.972.052,79	0,76	
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI		3.465,71	4.847.156,46	0,46	
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE		46.431,13	5.217.079,56	0,50	
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR		3.701.637,15	5.134.609,00	0,49	

E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			19.761.976,96	1,88	
E1 - Investimentos em Shopping Center			19.761.976,96	1,88	
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			19.748.902,26	1,88	
. VALORES A RECEBER			13.074,70	0,00	
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		3.035	72.136.320,48	6,87	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		3.035	69.266.194,65	6,60	
. VALORES A PAGAR (-)			56.528,65	0,01	
. VALORES A RECEBER			2.813.597,18	0,27	
G - OUTROS			-355.750,68	-0,03	
. DISPONIVEL			110.239,57	0,01	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			54.561,85	0,01	
. OUTROS REALIZAVEIS			58.100,03	0,01	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-524.090,28	-0,05	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-54.561,85	-0,01	
GESTÃO TERCEIRIZADA			DISTRIBUIÇÃO	(%) EM RELAÇÃO A GESTÃO TERCEIRIZADA	(%) EM RELAÇÃO AO RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS					
- FUNDO FATOR SINERGIA V			3.652.642,97	1,14%	0,35%
- BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP			328.697,39	0,10%	0,03%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO			54.692.453,64	17,02%	5,21%
- M. SQUARE INST. FIC FIA			23.073.764,24	7,18%	2,20%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA			18.152.215,59	5,65%	1,73%
- BBM SMID CAPS FICFIA			17.286.622,89	5,38%	1,65%
- BNP PARIBAS MATCH DI FI RENDA FIXA			22.419,15	0,01%	0,00%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP			4.359.066,13	1,36%	0,42%
- CA INDOSUEZ VITESSE FI RENDA FIXA CP			41.400.454,53	12,88%	3,94%
- IBIUNA EQ. FIC FIA			13.477.252,49	4,19%	1,28%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER			77.000,26	0,02%	0,01%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II			19.193,37	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III			8.500,88	0,00%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.			2.654.596,04	0,83%	0,25%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR			1.368.836,08	0,43%	0,13%
- BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FIM II			3.281.862,30	1,02%	0,31%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP			27.931,52	0,01%	0,00%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			5.944.281,79	1,85%	0,57%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP			13.969.969,19	4,35%	1,33%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA			2.108.694,74	0,66%	0,20%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES			1.874.181,24	0,58%	0,18%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			592.834,18	0,18%	0,06%
- HAMILTON LANE FIC FIP			7.479.700,87	2,33%	0,71%
- STRATUS SCP BR FIP			4.560.220,78	1,42%	0,43%
- P2BR INFR III FIQFIP			4.203.934,23	1,31%	0,40%
- COPA FLORESTAL III			7.432.903,42	2,31%	0,71%
- MEMORIAL OFFICE FI MOBILIARIO			924.599,93	0,29%	0,09%
- ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO			12.556.440,00	3,91%	1,20%
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO			1.766.338,40	0,55%	0,17%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			4.493.531,41	1,40%	0,43%
- GGR COVEPI RENDA FII			5.228.800,00	1,63%	0,50%
- MAUÁ MACRO II FIC DE FIM			6.927.429,05	2,16%	0,66%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			6.470.925,95	2,01%	0,62%
- KINEA CHRONOS FIM			6.807.561,73	2,12%	0,65%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- BB MM SCH INV EXTE FI			12.335.787,24	3,84%	1,18%
- MSQUARE GL EQ FICFIM			8.702.045,48	2,71%	0,83%
- VOT ALLIANZGI FIM			7.972.052,79	2,48%	0,76%
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI			4.847.156,46	1,51%	0,46%
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE			5.217.079,56	1,62%	0,50%
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR			5.134.609,00	1,60%	0,49%
TOTAL			321.434.586,91	100,00%	29,18%

GESTÃO PRÓPRIA	DISTRIBUIÇÃO	(%) EM RELAÇÃO A GESTÃO TERCEIRIZADA	(%) EM RELAÇÃO AO RECURSOS GARANTIDORES
RENTA FIXA	556.485.104,94	76,44%	53,03%
RENTA VARIÁVEL	80.019.201,83	10,99%	7,62%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	19.761.976,96	2,71%	1,88%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	72.136.320,48	9,91%	6,87%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	-355.750,68	-0,05%	-0,03%
TOTAL	728.046.853,53	100,00%	69,37%