

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL

PLANO I

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 30.06.2015

DISCRIMINAÇÃO	Espécie Tipo	Quantidade	Valor em R\$	Alocação do patrimônio (%)	Diversificação (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.006.948.383,81		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			690.439.601,86	68,24	
<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>		133.071	417.568.814,82	41,47	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			106.398.492,40	10,57	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		40.832.966,73	41.518.963,36	4,12	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	24.254.455	24.254.454,66	2,41	2,41
. CDB 1826 DIAS - FIBRA	PÓS	8.000	15.654.168,43	1,55	1,55
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	2.049.532	2.049.020,58	0,20	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	3.383.073	3.383.584,48	0,34	0,54
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	3.500	4.525.074,69	0,45	0,45
. CDB 2995 DIAS - VOTORANTIM	PÓS	5.000	13.647.276,68	1,36	1,36
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		16.562.011	-16.562.011,10	-1,64	-1,64
- BANCO MORADA		-5.432.605	-5.432.605,06	-0,54	-0,54
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		53	38.929.036,99	3,87	
. PINE		16	6.815.123,35	0,68	0,68
. ABC		17	16.928.955,10	1,68	1,68
. BRADESCO		20	6.491.650,87	0,64	0,64
. BANCO BTG PACTUAL		1	6.680.406,03	0,66	0,66
. SAFRA		4	2.012.901,64	0,20	0,20
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		11.178.482,05	25.950.492,05	2,58	
. ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM		516,24	62.392,49	0,01	0,01
. SAFRA INSTITUCIONAL		7.371,00	1.820.545,71	0,18	0,18
. BRADESCO FI REF DI PREMIUM		1.150.800,15	9.124.367,66	0,91	0,91
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FIM II		9.999.636,36	11.911.543,82	1,18	1,18
. FIDC - CEEE - CIA. EST. DIST. ENERGIA ELETRICA		3.467,00	66.675,60	0,01	0,01
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		4.713,99	169.767,02	0,02	0,02
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		7.000,00	284.621,98	0,03	0,03
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		4.958,18	108.741,97	0,01	0,01
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		9,76	1.034.829,60	0,10	0,10
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR		9,37	1.367.006,20	0,14	0,14
<u>Debêntures</u>		29.605	44.816.916,63	4,13	
. ECOPISTAS		7.000	8.954.871,94	0,89	0,89
. COMANCHE PART.		2.500.000	3.101.054,00	0,31	0,31
. CEMIG		20.000	24.057.902,42	2,39	2,39
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		30	3.092.332,28	0,31	0,31
. RODOVIAS DO TIETÊ		2.000	2.325.912,16	0,23	0,23
. SABESP		275	3.108.718,39	0,31	0,31
. TRIANGULO DO SOL AUTO - ESTRADAS S/A		180	1.966.236,25	0,20	0,20
. BR TOWERS SPEI S.A.		120	1.310.943,19	0,13	0,13
. VALORES A RECEBER			1.967.579,54	0,20	0,20
. COMANCHE PART.			1.967.579,54	0,20	0,20
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		-2.500.000,00	-5.068.633,54	-0,50	-0,50
. COMANCHE PART.		-2.500.000	-5.068.633,54	-0,50	-0,50
<u>Outros Títulos</u>		19.044	121.655.378,01	12,08	
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		36	8.283.451,56	0,82	0,82
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	14.821.669,31	1,47	1,47

. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCARIO	1	69.677.208,51	6,92	6,92
. DEPOSITO A PRAZO COM GARANTIA ESPECIAL	19.000	33.439.644,00	3,32	3,32
. VALORES A RECEBER	2	31.917.518,76	3,17	3,17
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS	<u>-2.00</u>	<u>-36.484.114,13</u>	<u>-3,62</u>	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO - ALOÉS	-1	-6.909.976,65	-0,69	-0,69
. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCARIO - BANIF	-1	-29.574.137,48	-2,94	-2,94

B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			135.278.669,02	13,43
B1. Mercado de Ações			59.522.807,20	5,91
Companhias Abertas		5.480.334	51.695.632,71	5,13
. AMBEV	ON	104.768	2.001.068,80	0,20
. BRF - BRASIL FOODS	ON	61.124	4.014.624,32	0,40
. COSAN	ON	68.600	1.725.290,00	0,17
. ECORODOVIAS	ON	153.400	1.188.850,00	0,12
. EVEN	ON	277.800	916.740,00	0,09
. GERDAU - GGBR	PN	361.564	2.708.114,36	0,27
. IGTA	ON	66.100	1.625.399,00	0,16
. ISHARES BOVA	CI	273.700	14.084.602,00	1,40
. ITAUSA	PN	304.539	2.713.442,49	0,27
. MARCOPOLO	PN	196.800	456.576,00	0,05
. MILLS	ON	148.900	1.005.075,00	0,10
. MRVE	ON	164.900	1.287.869,00	0,13
. PÃO DE AÇUCAR	PN	339	24.848,70	0,00
. PETROBRÁS	PN	266.317	3.384.889,07	0,34
. RANDON PART	PN	162.100	521.962,00	0,05
. RENT	ON	59.385	1.822.525,65	0,18
. RUMO	ON	457.190	580.631,30	0,06
. TAIPE	ON	1.950.000	5.811.000,00	0,58
. TOTVS	ON	33.200	1.294.800,00	0,13
. V-AGRO	ON	90.081	78.370,47	0,01
. VALE R. DOCE	PNA	279.527	4.355.030,66	0,43
. VALORES A RECEBER				0,00
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			93.923,89	0,01
Instituições Financeiras		249.571	7.827.174,49	0,78
. BRADESCO	PN	129.727	3.697.219,50	0,37
. ITAU	PN	119.844	4.101.061,68	0,41
. VALORES A PAGAR				0,00
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			28.893,31	0,00
B2. Fundos		37.577.675,09	75.755.861,82	7,52
. FATOR SINERGIA IV		6.744,90	5.324.506,10	0,53
. FATOR SINERGIA V		1.154,00	790.604,34	0,08
. RB FUNDAMENTAL INST. FIA		98.255,80	10.364.528,41	1,03
. M. SQUARE INST. FIC FIA		8.834.914,97	13.693.857,84	1,36
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		11.672.108,61	12.716.010,88	1,26
. GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA		9.121.176,41	9.578.868,74	0,95
. BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIQ FIA		4.528.657,36	11.725.314,32	1,16
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.314.663,05	11.562.171,19	1,15

C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		2.953.949,12	66.839.954,38	6,64
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.307,62	3.353.681,92	0,33
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.281,00	16.149.328,66	1,60
. FIP BVEP PLAZA		3.000,00	3.327.903,61	0,33
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		4.498,05	4.847.105,23	0,48
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		491.181,54	335.286,46	0,03
. HAMILTON LANE FIC FIP		7.012,50	7.303.629,77	0,73
. MULTINER FIP		9,40	14.256.576,69	1,42
.STRATUS SCP BR FIP		2.357.940,00	2.375.386,40	0,24
. P2BR INFR III FIQFIP		1.040,33	932.217,31	0,09
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		79.208,00	8.467.335,20	0,84
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		470,67	5.411.503,05	0,54
. VALORES A RECEBER			80.000,08	0,01
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		3.769.975,66	5.897.296,27	0,59
. BB MM SCH INV EXTE FI		2.333.433,18	3.634.901,13	0,36
. MSQUARE GL EQ FICFIM		1.436.542,47	2.262.395,14	0,22
E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			68.779.093,61	6,83
E1 - Investimentos em Shopping Center			57.347.300,86	5,70
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			25.404.954,16	2,52
. SHOPPING PLAZA SUL			31.319.295,24	3,11
. VALORES A RECEBER			623.051,46	0,06
E2 - Investimento Imobiliário			11.431.792,75	1,14
. PANAMBY			12.144.487,33	1,21
. VALORES A PAGAR (-)			-712.694,58	-0,07
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		2.002	38.933.260,93	3,87
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		2.002	38.839.131,08	3,86
. VALORES A PAGAR (-)			-47.295,95	0,00
. VALORES A RECEBER			141.425,80	0,01
G - OUTROS			780.507,74	0,08
. DISPONIVEL			1.663.032,56	0,17
. DEPOSITOS JUDICIAIS			333.512,07	0,03
. OUTROS REALIZAVEIS			334.159,94	0,03
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-1.216.684,76	-0,12
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-333.512,07	-0,03

GESTÃO TERCEIRIZADA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Terceirizada	(%) em relação ao Recursos Garantidores
FUNDOS			
- ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM	62.392,49	0,04%	0,01%
- FUNDO FATOR SINERGIA IV	5.324.506,10	3,05%	0,53%
- FUNDO FATOR SINERGIA V	790.604,34	0,45%	0,08%
- RB.FUNDAMENTAL INST. FIA	10.364.528,41	5,94%	1,03%
- SAFRA INSTITUCIONAL	1.820.545,71	1,04%	0,18%
- BRADESCO FI REF DI PREMIUM	9.124.367,66	5,23%	0,91%
- M. SQUARE INST. FIC FIA	13.693.857,84	7,85%	1,36%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	12.716.010,88	7,29%	1,26%
- GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA	9.578.868,74	5,49%	0,95%
- BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIQ FIA	11.725.314,32	6,72%	1,16%
- BBM SMID CAPS FICFIA	11.562.171,19	6,63%	1,15%
- FIDC - CEEE - CIA. EST. DIST. ENERGIA ELETRICA	66.675,60	0,04%	0,01%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	169.767,02	0,10%	0,02%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	284.621,98	0,16%	0,03%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	108.741,97	0,06%	0,01%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.	1.034.829,60	0,59%	0,10%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR	1.367.006,20	0,78%	0,14%
- BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FIM II	11.911.543,82	6,83%	1,18%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP	3.353.681,92	1,92%	0,33%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	16.149.328,66	9,26%	1,60%
- FIP BVEP PLAZA	3.327.903,61	1,91%	0,33%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES	4.847.105,23	2,78%	0,48%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE	335.286,46	0,19%	0,03%
- HAMILTON LANE FIC FIP	7.303.629,77	4,19%	0,73%
- MULTINER FIP	14.256.576,69	8,17%	1,42%
- STRATUS SCP BR FIP	2.375.386,40	1,36%	0,24%
- P2BR INFR III FIQFIP	932.217,31	0,53%	0,09%
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO	8.547.335,28	4,90%	0,85%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	5.411.503,05	3,10%	0,54%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			
- BB MM SCH INV EXTE FI	3.634.901,13	2,08%	0,36%
- MSQUARE GL EQ FICFIM	2.262.395,14	1,30%	0,22%
TOTAL	174.443.604,52	100,00%	17,32%

GESTÃO PRÓPRIA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Própria	(%) em relação ao Recursos Garantidores
REND A FIXA	664.489.109,81	79,82%	65,99%
REND A VARIÁVEL	59.522.807,20	7,15%	5,91%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	68.779.093,61	8,26%	6,83%
EMP R ÉSTIMO PESSOAL	38.933.260,93	4,68%	3,87%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	780.507,74	0,09%	0,08%
TOTAL	832.504.779,29	100,00%	82,68%