

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL

PLANO II

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 30.06.2015

DISCRIMINAÇÃO	Espécie Tipo	Quantidade	Valor em R\$	Alocação do patrimônio (%)	Diversificação (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			666.857.235,07		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			383.833.493,43	57,58	
<u>TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO</u> <u>TESOURO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS</u> <u>SECURITIZADOS DO TESOURO NACIONAL</u>					
<u>Nota do Tesouro Nacional</u>		83.513	259.140.748,56	38,86	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			69.210.317,20	10,38	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		7,00	29.697.541,17	4,45	
.CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	1	13.141.991,09	1,97	1,97
.CDB 1826 DIAS - FIBRA	PÓS	1	9.783.855,26	1,47	1,47
.CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	1	3.403.988,49	0,51	
.CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	1	2.047.692,08	0,31	0,82
.CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	1	1.939.317,72	0,29	0,29
.CDB 1826 DIAS - SCHAHN	PÓS	2	5.376.925,87	0,81	0,81
.CDB 1827 DIAS - SOFISA	PÓS	2	5.699.927,94	0,85	0,85
.CDB 2995 DIAS - VOTORANTIM	PÓS	1	2.729.455,34	0,41	0,41
.PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-1	-8.973.932,05	-1,35	-1,35
- BANCO MORADA		-2	-5.451.680,57	-0,82	-0,82
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		3	7.068.235,14	1,06	
.BRADESCO		3	7.068.235,14	1,06	
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		9.607.278,56	32.444.540,89	4,87	
.BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FM II		4.999.818,18	5.955.771,93	0,89	0,89
.BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMÁRIAS II FIRF CP		3.024.304,06	3.669.557,78	0,55	0,55
.SAFRA INSTITUCIONAL		22.037,75	5.443.054,44	0,82	0,82
.BRADESCO FI REF DI PREMIUM		1.553.629,32	12.318.285,84	1,85	1,85
.FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		2.474,99	89.133,09	0,01	0,01
.FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		3.000,00	121.980,85	0,02	0,02
.FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		1.976,00	43.337,29	0,01	0,01
.FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		19,52	2.069.407,22	0,31	0,31
.FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR		18,74	2.734.012,45	0,41	0,41
<u>Debênturas</u>		1.711.660	29.416.187,84	4,41	
.COMANCHE PART.		1.700.000	2.108.716,72	0,32	0,32
.CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		22	2.287.708,91	0,34	0,34
.CEMIG		10.000	12.028.951,19	1,80	1,80
.RODOVIAS DO TIETÊ		1.000	1.162.956,09	0,17	0,17
.ROTA DAS BANDEIRAS		500	7.480.791,17	1,12	1,12
.SABESP		138	1.560.011,41	0,23	0,23
.TRIANGULO DO SOL AUTO - ESTRADAS S/A		270	2.949.354,37	0,44	0,44
.BR TOWERS SPEI S.A.		180	1.966.414,78	0,29	0,29
.VALORES A RECEBER			1.337.954,10	0,20	
.COMANCHE PART.			1.337.954,10	0,20	0,20
.PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS		-1.700.000,00	-3.446.670,90	-0,52	
.COMANCHE PART.		-1.700.000	-3.446.670,90	-0,52	-0,52
<u>Outros Títulos</u>		26	26.066.239,83	3,91	
.CERTIFICADO DE RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS		25	5.743.580,18	0,86	0,86
.CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCÁRIO		1	20.322.659,65	3,05	3,05
.VALORES A RECEBER		1	8.630.920,46	1,29	1,29
.PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS		-1	-8.630.920,46	-1,29	
.CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCÁRIO - BANIF		-1	-8.630.920,46	-1,29	-1,29
B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			128.821.842,56	19,32	
B1 Mercado de Ações			54.217.417,34	8,13	
<u>Companhias Abertas</u>		3.318.235	46.391.229,93	6,98	
.AMBEV	ON	100.439	1.918.384,90	0,29	
.BRF - BRASIL FOODS	ON	57.854	3.799.850,72	0,57	
.BR MALLS PARTICIPAÇÕES	ON	25.800	375.648,00	0,06	
.CEMIG	PN	21.685	257.184,10	0,04	
.CSAN	ON	46.000	1.156.900,00	0,17	
.ECORODOVIAS	ON	129.000	999.750,00	0,15	
.EVEN	ON	308.000	1.016.400,00	0,15	
.GERDAU - GGBR	PN	344.424	2.579.735,76	0,39	
.IGTA	ON	36.600	899.994,00	0,13	
.ISHARES BOVA	CJ	303.600	15.623.256,00	2,34	
.ITAUSA	PN	375.846	3.348.787,86	0,50	
.MARCOPOLO	PN	166.800	386.976,00	0,06	
.MILLS	ON	118.400	799.200,00	0,12	
.MRVE	ON	154.000	1.202.740,00	0,18	
.PÃO DE AÇÚCAR	PN	11.874	870.364,20	0,13	
.PETROBRÁS	PN	225.277	2.863.270,67	0,43	
.RANDON PART	PN	160.375	516.407,50	0,08	
.RENT	ON	49.160	1.508.720,40	0,23	
.RUMO	ON	225.244	286.059,88	0,04	
.TOTVS	ON	32.900	1.283.100,00	0,19	
.TRACTEBEL	ON	6.600	225.654,00	0,03	
.V-AGRO	ON	143.340	124.705,80	0,02	
.VALE R. DOCE	PNA	275.017	4.284.764,86	0,64	
.VALORES A RECEBER			0,00	0,00	
.VALORES A PAGAR			63.375,28	0,01	
.DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER					
<u>Instituições Financeiras</u>		250,475	7.826.187,41	1,17	
.BRADESCO	PN	135.506	3.861.921,00	0,58	
.ITAU	PN	114.969	3.934.239,18	0,59	
.VALORES A PAGAR			0,00	0,00	
.DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			30.027,23	0,00	
B2 Fundos		36.415.720,34	74.604.425,22	11,10	
.FATOR SINERGIA IV		5.784,10	4.566.043,46	0,68	
.FATOR SINERGIA V		2.968,00	2.033.374,07	0,30	
.RB FUNDAMENTAL INST. FIA		99.418,02	10.487.125,32	1,57	
.M. SQUARE INST. FIC FIA		8.547.123,45	13.247.789,46	1,99	
.CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		11.398.044,90	12.417.436,11	1,86	
.GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA		8.758.734,98	9.198.240,33	1,38	
.BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIQ FIA		4.302.911,26	11.140.826,75	1,67	
.BBM SMID CAPS FICFIA		3.300.735,63	11.513.589,72	1,73	

C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		2.780.954,74	47.918.076,69	7,19
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II- FIP		10.778,33	501.438,47	0,08
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		395,93	4.991.441,46	0,75
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		7.039,00	11.242.263,84	1,69
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		2.000,00	2.218.602,41	0,33
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		2.098,17	2.077.330,81	0,31
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		327.454,37	223.524,31	0,03
. HAMILTON LANE FIC FIP		3.612,50	3.762.475,94	0,56
. STRATUS SCP BR FIP		2.357.940,00	2.375.386,40	0,36
. MEMORIAL OFFICE FI IMOBILIARIO		10.000,00	1.179.999,91	0,18
. ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO		39.000,00	13.018.200,00	1,95
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		19.802,00	2.116.833,80	0,32
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		313,78	3.607.668,70	0,54
. P2 BR INFRAESTRUTURA III FIC DE FIP		519,67	465.660,62	0,07
. VALORES A RECEBER			137.250,02	0,02
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			13.283.932,12	1,99
. BB MM SCH INV EXTE FI		5.128.757,86	7.989.312,87	1,20
. MSQUARE GL EQ FICFIM		3.342.850,69	5.264.619,25	0,79
E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			23.569.085,26	3,53
E1 - Investimentos em Shopping Center			23.569.085,26	3,53
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			23.539.844,16	3,53
. VALORES A RECEBER			29.241,10	0,00
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		3.167	67.556.366,29	10,13
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		3.167	67.406.243,45	10,11
. VALORES A PAGAR (-)			-69.658,01	-0,01
. VALORES A RECEBER			219.780,85	0,03
G - OUTROS			1.904.438,72	0,29
. DISPONIVEL			2.121.082,57	0,32
. DEPOSITOS JUDICIAIS			54.561,85	0,01
. OUTROS REALIZAVEIS			56.207,58	0,01
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-272.851,43	-0,04
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-54.561,85	-0,01

GESTÃO TERCEIRIZADA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Terceirizada	(%) em relação ao Recursos Garantidores
FUNDOS			
. FUNDO FATOR SINERGIA IV	4.566.043,46	2,71%	0,68%
. FUNDO FATOR SINERGIA V	2.033.374,07	1,21%	0,30%
. RB.FUNDAMENTAL INST. FIA	10.487.125,32	6,23%	1,57%
. BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP	3.669.557,78	2,18%	0,55%
. SAFRA INSTITUCIONAL	5.443.054,44	3,24%	0,82%
. BRADESCO FI REF DI PREMIUM	12.318.285,84	7,32%	1,85%
. M. SQUARE INST. FIC FIA	13.247.789,46	7,88%	1,99%
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	12.417.436,11	7,38%	1,86%
. GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA	9.198.240,33	5,47%	1,38%
. BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIQ FIA	11.140.826,75	6,62%	1,67%
. BBM SMID CAPS FICFIA	11.513.589,72	6,84%	1,73%
. FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER	89.133,09	0,05%	0,01%
. FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER II	121.980,85	0,07%	0,02%
. FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER III	43.337,29	0,03%	0,01%
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.	2.069.407,22	1,23%	0,31%
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR	2.734.012,45	1,63%	0,41%
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FIM II	5.955.771,93	3,54%	0,89%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP	501.438,47	0,30%	0,08%
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	4.991.441,46	2,97%	0,75%
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP	11.242.263,84	6,68%	1,69%
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA	2.218.602,41	1,32%	0,33%
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES	2.077.330,81	1,23%	0,31%
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE	223.524,31	0,13%	0,03%
. HAMILTON LANE FIC FIP	3.762.475,94	2,24%	0,56%
. STRATUS SCP BR FIP	2.375.386,40	1,41%	0,36%
. MEMORIAL OFFICE FI IMOBILIARIO	1.189.999,91	0,71%	0,18%
. ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO	13.125.450,00	7,80%	1,97%
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO	2.136.833,82	1,27%	0,32%
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	3.607.668,70	2,14%	0,54%
. P2 BR INFRAESTRUTURA III FIC DE FIP	465.660,62	0,28%	0,07%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			
. BB MM SCH INV EXTE FI	7.989.312,87	4,75%	1,20%
. MSQUARE GL EQ FICFIM	5.264.619,25	3,13%	0,79%
TOTAL	168.220.974,92	100,00%	25,23%

GESTÃO PRÓPRIA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Própria	(%) em relação ao Recursos Garantidores
RENTA FIXA	351.388.952,54	70,47%	52,69%
RENTA VARIÁVEL	54.217.417,34	10,87%	8,13%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	23.569.085,26	4,73%	3,53%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	67.556.366,29	13,55%	10,13%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	1.904.438,72	0,38%	0,29%
TOTAL	498.636.260,15	100,00%	74,77%