

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL

PLANO I

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.12.2015

DISCRIMINAÇÃO	Espécie Tipo	Quantidade	Valor em R\$	Alocação do patrimônio (%)	Diversificação (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			<u>1.020.601.673,07</u>		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			<u>709.315.622,78</u>	<u>69,21</u>	
<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>		<u>147.371</u>	<u>454.569.528,61</u>	<u>44,54</u>	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			<u>109.878.928,33</u>	<u>10,77</u>	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		<u>40.824.966,73</u>	<u>19.649.815,30</u>	<u>1,93</u>	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	24.254.455	24.254.454,66	2,38	2,38
. 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	0,33	0,53
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	3.500	4.857.682,17	0,48	0,48
. CDB 2995 DIAS - VOTORANTIM	PÓS	5.000	14.792.133,13	1,45	1,45
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		16.562.011	-24.254.454,66	-2,38	-2,38
- BANCO MORADA		-5.432.605	-5.432.605,06	-0,53	-0,53
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		<u>53</u>	<u>41.842.524,42</u>	<u>4,10</u>	
. PINE		16	7.088.456,23	0,69	0,69
. ABC		17	18.362.785,72	1,80	1,80
. BRADESCO		20	6.996.543,23	0,69	0,69
. BANCO BTG PACTUAL		1	7.213.596,18	0,71	0,71
. SAFRA		4	2.181.143,06	0,21	0,21
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		<u>13.844.876,90</u>	<u>48.386.588,61</u>	<u>4,74</u>	
. ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM		516,24	66.769,43	0,01	0,01
. BRADESCO FI REF DI PREMIUM		3.828.033,00	32.454.547,59	3,18	3,18
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FIM II		9.999.636,36	12.832.178,25	1,26	1,26
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		4.713,99	133.668,58	0,01	0,01
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		7.000,00	253.960,46	0,02	0,02
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		4.958,18	85.768,05	0,01	0,01
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		9,76	1.086.701,45	0,11	0,11
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR		9,37	1.472.994,80	0,14	0,14
<u>Debêntures</u>		<u>29.805</u>	<u>46.216.935,85</u>	<u>4,24</u>	
. ECOPISTAS		7.000	9.097.970,02	0,89	0,89
. CEMIG		20.000	25.710.766,28	2,52	2,52
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		230	2.661.276,88	0,26	0,26
. RODOVIAS DO TIETÊ		2.000	2.423.741,58	0,24	0,24
. SABESP		275	3.338.796,75	0,33	0,33
. TRIANGULO DO SOL AUTO - ESTRADAS S/A		180	1.692.627,99	0,17	0,17
. BR TOWERS SPEI S.A.		120	1.291.756,35	0,13	0,13
. VALORES A RECEBER			<u>5.068.633,54</u>	0,50	0,50
. COMANCHE PART.			5.068.633,54	0,50	0,50
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		<u>0,00</u>	<u>-5.068.633,54</u>	<u>-0,50</u>	-0,50
. COMANCHE PART.			-5.068.633,54	-0,50	-0,50
<u>Outros Títulos</u>		<u>19.044</u>	<u>98.650.229,99</u>	<u>9,67</u>	
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		36	19.981.465,58	1,96	1,96
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	10.883.504,22	1,07	1,07
. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCARIO		1	67.967.388,51	6,66	6,66
. DEPOSITO A PRAZO COM GARANTIA ESPECIAL		19.000	36.127.848,74	3,54	3,54
. VALORES A RECEBER		2	37.987.620,50	3,72	3,72
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		<u>-2,00</u>	<u>-74.297.597,56</u>	<u>-7,28</u>	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO - ALOÉS		-1	-7.392.428,12	-0,72	-0,72
. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCARIO - BANIF		-1	-66.905.169,44	-6,56	-6,56

B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			92.620.474,84	9,07
B1. Mercado de Ações			33.869.565,29	3,32
Companhias Abertas		4.738.298	29.247.911,36	2,87
. AMBEV	ON	84.768	1.513.108,80	0,15
. BRF - BRASIL FOODS	ON	59.424	3.292.089,60	0,32
. COSAN	ON	63.100	1.590.120,00	0,16
. ECORODOVIAS	ON	153.400	780.806,00	0,08
. EVEN	ON	215.800	889.096,00	0,09
. GERDAU - GGBR	PN	400.364	1.861.692,60	0,18
. IGUATEMI EMP SHOP S.A	ON	76.100	1.439.051,00	0,14
. ITAUSA	PN	246.539	1.696.188,32	0,17
. MARCOPOLO	PN	226.800	419.580,00	0,04
. MILLS	ON	188.900	502.474,00	0,05
. MRVE	ON	164.900	1.431.332,00	0,14
. PÃO DE AÇUCAR	PN	339	14.190,54	0,00
. PETROBRÁS	PN	241.317	1.616.823,90	0,16
. RANDON PART	PN	182.100	446.145,00	0,04
. RENT	ON	56.185	1.394.511,70	0,14
. RUMO	ON	60.719	378.886,56	0,04
. RUMO LOG DIR	DIR	21.816	3.272,40	0,00
. TAIFE	ON	1.950.000	5.811.000,00	0,57
. TOTVS	ON	26.200	812.986,00	0,08
. VALE R. DOCE	PNA	319.527	3.275.151,75	0,32
. VALORES A RECEBER				0,00
. VALORES A PAGAR			-6.750,00	0,00
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			86.155,19	0,01
Instituições Financeiras		201.461	4.621.653,93	0,45
. BRADESCO	PN	100.927	1.945.872,56	0,19
. BRADESCO DIR	DIR	3.306	6.843,42	
. ITAU	PN	97.228	2.560.013,24	0,25
. VALORES A PAGAR				0,00
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			108.924,71	0,01
B2. Fundos		39.155.431,35	58.750.909,55	5,76
. FATOR SINERGIA IV		6.744,90	3.888.448,90	0,38
. FATOR SINERGIA V		1.154,00	701.845,35	0,07
. M. SQUARE INST. FIC FIA		10.510.927,03	15.354.206,02	1,50
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		11.672.108,61	11.496.308,80	1,13
. GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA		9.121.176,41	6.610.563,39	0,65
. BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIQ FIA		4.528.657,36	10.378.515,63	1,02
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.314.663,05	10.321.021,46	1,01
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		3.038.655,38	69.044.935,17	6,77
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.385,34	3.394.435,97	0,33
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.281,00	17.683.755,90	1,73
. FIP BVEP PLAZA		3.000,00	3.177.343,83	0,31
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		5.357,25	5.316.301,31	0,52
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		574.273,55	395.784,45	0,04
. HAMILTON LANE FIC FIP		7.672,50	8.475.794,36	0,83
. MULTINER FIP		9,40	14.257.449,30	1,40
.STRATUS SCP BR FIP		2.357.940,00	1.953.322,21	0,19
. P2BR INFR III FIQFIP		1.057,67	902.782,68	0,09
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		79.208,00	7.401.987,60	0,73
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		470,67	6.005.977,48	0,59
. VALORES A RECEBER			80.000,08	0,01
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		11.638.759,56	21.964.490,62	2,15
. BB MM SCH INV EXTE FI		4.519.272,85	8.806.793,77	0,86
. MSQUARE GL EQ FICFIM		3.305.204,08	6.576.408,68	0,64
. VOT ALLIANZGI FIM		3.814.282,63	6.581.288,17	0,64
E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			86.916.851,49	8,52
E1 - Investimentos em Shopping Center			75.114.186,89	7,36
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			27.509.493,50	2,70
. SHOPPING PLAZA SUL			46.995.175,47	4,60
. VALORES A RECEBER			609.517,92	0,06
E2 - Investimento Imobiliário			11.802.664,60	1,16
. PANAMBY			11.802.664,60	1,16
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00

F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		1.995	40.281.999,18	3,95	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		1.995	40.208.053,76	3,94	
. VALORES A PAGAR (-)			-54.524,57	-0,01	
. VALORES A RECEBER			128.469,99	0,01	
G - OUTROS			457.298,99	0,04	
. DISPONIVEL			1.544.412,34	0,15	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			333.512,07	0,03	
. OUTROS REALIZAVEIS			334.159,94	0,03	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-1.421.273,29	-0,14	
. 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	66.769,43	0,03%	0,01%
- FUNDO FATOR SINERGIA IV	3.888.448,90	2,03%	0,38%
- FUNDO FATOR SINERGIA V	701.845,35	0,37%	0,07%
- BRADESCO FI REF DI PREMIUM	32.454.547,59	16,94%	3,18%
- M. SQUARE INST. FIC FIA	15.354.206,02	8,02%	1,50%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	11.496.308,80	6,00%	1,13%
- GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA	6.610.563,39	3,45%	0,65%
- BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIQ FIA	10.378.515,63	5,42%	1,02%
- BBM SMID CAPS FICFIA	10.321.021,46	5,39%	1,01%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	133.668,58	0,07%	0,01%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	253.960,46	0,13%	0,02%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	85.768,05	0,04%	0,01%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.	1.086.701,45	0,57%	0,11%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR	1.472.994,80	0,77%	0,14%
- BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FIM II	12.832.178,25	6,70%	1,26%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP	3.394.435,97	1,77%	0,33%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	17.683.755,90	9,23%	1,73%
- FIP BVEP PLAZA	3.177.343,83	1,66%	0,31%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES	5.316.301,31	2,78%	0,52%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE	395.784,45	0,21%	0,04%
- HAMILTON LANE FIC FIP	8.475.794,36	4,42%	0,83%
- MULTINER FIP	14.257.449,30	7,44%	1,40%
- STRATUS SCP BR FIP	1.953.322,21	1,02%	0,19%
- P2BR INFR III FIQFIP	902.782,68	0,47%	0,09%
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO	7.481.987,68	3,91%	0,73%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	6.005.977,48	3,14%	0,59%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			
- BB MM SCH INV EXTE FI	8.806.793,77	4,60%	0,86%
- MSQUARE GL EQ FICFIM	6.576.408,68	3,43%	0,64%
- VOT ALLIANZGI FIM	6.581.288,17	3,44%	0,64%
TOTAL	191.565.635,78	100,00%	18,77%

GESTÃO PRÓPRIA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Própria	(%) em relação ao Recursos Garantidores
RENTA FIXA	660.929.034,17	80,36%	64,76%
RENTA VARIÁVEL	33.869.565,29	4,12%	3,32%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	86.916.851,49	10,57%	8,52%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	40.281.999,18	4,90%	3,95%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	457.298,99	0,06%	0,04%
TOTAL	822.454.749,12	100,00%	80,59%