

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL

PLANO II

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.12.2015

DISCRIMINAÇÃO	Espécie Tipo	Quantidade	Valor em R\$	Alocação do patrimônio (%)	Diversificação (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			681.876.059,24		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			400.690.939,73	58,76	
<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>		108.242	297.926.138,47	43,69	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			50.855.465,40	7,46	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		4,00	11.229.532,92	1,65	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	1	13.141.991,09	1,93	1,93
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	1	3.403.988,49	0,50	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	1	2.047.692,08	0,30	0,80
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	1	2.081.863,79	0,31	0,31
. CDB 1827 DIAS - SOFISA	PÓS	2	6.189.242,50	0,91	0,91
. CDB 2995 DIAS - VOTORANTIM	PÓS	1	2.958.426,63	0,43	0,43
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-1	-13.141.991,09	-1,93	-1,93
- BANCO MORADA		-2	-5.451.680,57	-0,80	-0,80
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		3	7.696.436,85	1,13	
. BRADESCO		3	7.696.436,85	1,13	
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		10.046.964,04	31.929.495,63	4,68	
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FIM II		4.999.818,18	6.416.089,14	0,94	0,94
. BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP		3.024.304,06	3.094.662,99	0,45	0,45
. BRADESCO FI REF DI PREMIUM		2.015.352,56	17.086.413,70	2,51	2,51
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		2.474,99	70.180,26	0,01	0,01
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		3.000,00	108.840,20	0,02	0,02
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		1.976,00	34.181,41	0,01	0,01
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		19,52	2.173.138,33	0,32	0,32
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR		18,74	2.945.989,60	0,43	0,43
<u>Debêntures</u>		12.360	35.027.637,00	5,14	
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		722	7.110.003,28	1,04	1,04
. CEMIG		10.000	12.855.383,12	1,89	1,89
. RODOVIAS DO TIETÊ		1.000	1.211.870,80	0,18	0,18
. ROTA DAS BANDEIRAS		500	7.698.334,34	1,13	1,13
. SABESP		138	1.675.468,91	0,25	0,25
. TRIANGULO DO SOL AUTO - ESTRADAS S/A		270	2.538.942,01	0,37	0,37
. BR TOWERS SPEI S.A.		180	1.937.634,54	0,28	0,28
. VALORES A RECEBER			3.446.670,90	0,51	
. COMANCHE PART.			3.446.670,90	0,51	0,51
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		0,00	-3.446.670,90	-0,51	
. COMANCHE PART.			-3.446.670,90	-0,51	-0,51
<u>Outros Títulos</u>		26	16.881.698,86	2,48	
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		25	6.307.447,78	0,93	0,93
. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCARIO		1	19.823.594,65	2,91	2,91
. VALORES A RECEBER		1	10.265.279,43	1,51	1,51
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		-1	-19.514.623,00	-2,86	
. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCARIO - BANIF		-1	-19.514.623,00	-2,86	-2,86

B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			114.721.675,23	16,82
<u>B1. Mercado de Ações</u>			54.976.519,14	8,06
<u>Companhias Abertas</u>		3.408.403	50.058.257,32	7,34
. AMBEV	ON	100.439	1.792.836,15	0,26
. BRF - BRASIL FOODS	ON	57.854	3.205.111,60	0,47
. COSAN	ON	76.900	1.937.880,00	0,28
. ECORODOVIAS	ON	167.200	851.048,00	0,12
. EVEN	ON	308.000	1.268.960,00	0,19
. GERDAU - GGBR	PN	405.424	1.885.221,60	0,28
. IGUATEMI EMP SHOP S.A	ON	81.600	1.543.056,00	0,23
. ISHARES BOVA	CI	607.100	25.577.123,00	3,75
. ITAUSA	PN	295.846	2.035.420,48	0,30
. MARCOPOLO	PN	166.800	308.580,00	0,05
. MILLS	ON	171.100	455.126,00	0,07
. MRVE	ON	154.000	1.336.720,00	0,20
. PÃO DE AÇUCAR	PN	3.300	138.138,00	0,02
. PETROBRÁS	PN	250.277	1.676.855,90	0,25
. RANDON PART	PN	160.375	392.918,75	0,06
. RENT	ON	66.160	1.642.091,20	0,24
. RUMO	ON	24.874	155.213,76	0,02
. RUMO LOG DIR	DIR	8.937	1.340,55	0,00
. TOTVS	ON	32.900	1.020.887,00	0,15
. VALE R. DOCE	PNA	269.317	2.760.499,25	0,40
. VALORES A RECEBER				0,00
. VALORES A PAGAR			-7.250,00	0,00
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			80.480,08	0,01
<u>Instituições Financeiras</u>		253.924	4.918.261,82	0,72
. BRADESCO	PN	135.506	2.030.299,68	0,30
. BRADESCO	DIR	3.449	7.139,43	0,00
. ITAU	PN	114.969	2.766.361,45	0,41
. VALORES A PAGAR				0,00
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			114.461,26	0,02
<u>B2. Fundos</u>		39.333.124,03	59.745.156,09	8,76
. FATOR SINERGIA IV		5.784,10	3.334.549,03	0,49
. FATOR SINERGIA V		2.968,00	1.805.092,71	0,26
. M. SQUARE INST. FIC FIA		11.563.945,16	16.892.439,26	2,48
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		11.398.044,90	11.226.372,00	1,65
. GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA		8.758.734,98	6.347.884,33	0,93
. BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIQ FIA		4.302.911,26	9.861.163,75	1,45
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.300.735,63	10.277.655,01	1,51
<u>C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS</u>		2.837.431,02	50.936.584,31	7,47
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II- FIP		10.778,33	470.515,85	0,07
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		395,93	5.465.702,91	0,80
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		7.574,99	14.493.608,08	2,13
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		2.000,00	2.118.229,23	0,31
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		2.295,97	2.278.414,85	0,33
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		382.849,20	263.856,42	0,04
. HAMILTON LANE FIC FIP		3.952,50	4.366.318,31	0,64
.STRATUS SCP BR FIP		2.357.940,00	1.953.322,21	0,29
. P2 BR INFRAESTRUTURA III FIC DE FIP		528,33	450.964,57	0,07
. MEMORIAL OFFICE FI IMOBILIARIO		10.000,00	999.999,92	0,15
. ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO		39.000,00	12.089.220,00	1,77
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		19.802,00	1.850.496,90	0,27
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		313,78	4.003.985,04	0,59
. VALORES A RECEBER			131.950,02	0,02
<u>D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</u>		12.262.339,25	23.186.474,46	3,40
. BB MM SCH INV EXTE FI		5.128.757,86	9.994.508,92	1,47
. MSQUARE GL EQ FICFIM		3.342.850,69	6.651.314,65	0,98
. VOT ALLIANZGI FIM		3.790.730,70	6.540.650,89	0,96

E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			17.896.632,01	2,62	
E1 - Investimentos em Shopping Center			17.896.632,01	2,62	
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			17.857.286,29	2,62	
. VALORES A RECEBER			39.345,72	0,01	
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		3.248	72.156.361,50	10,58	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		3.248	71.937.342,58	10,55	
. VALORES A PAGAR (-)			-45.526,95	-0,01	
. VALORES A RECEBER			264.545,87	0,04	
G - OUTROS			2.287.392,00	0,34	
. DISPONIVEL			2.659.966,08	0,39	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			54.561,85	0,01	
. OUTROS REALIZAVEIS			56.207,58	0,01	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-428.781,66	-0,06	
. 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	3.334.549,03	2,10%	0,49%
- FUNDO FATOR SINERGIA V	1.805.092,71	1,14%	0,26%
- BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP	3.094.662,99	1,95%	0,45%
- BRADESCO FI REF DI PREMIUM	17.086.413,70	10,76%	2,51%
- M. SQUARE INST. FIC FIA	16.892.439,26	10,64%	2,48%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	11.226.372,00	7,07%	1,65%
- GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA	6.347.884,33	4,00%	0,93%
- BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIQ FIA	9.861.163,75	6,21%	1,45%
- BBM SMID CAPS FICFIA	10.277.655,01	6,47%	1,51%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	70.180,26	0,04%	0,01%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	108.840,20	0,07%	0,02%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	34.181,41	0,02%	0,01%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.	2.173.138,33	1,37%	0,32%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR	2.945.989,60	1,86%	0,43%
- BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FIM II	6.416.089,14	4,04%	0,94%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP	470.515,85	0,30%	0,07%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	5.465.702,91	3,44%	0,80%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP	14.493.608,08	9,13%	2,13%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA	2.118.229,23	1,33%	0,31%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES	2.278.414,85	1,43%	0,33%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE	263.856,42	0,17%	0,04%
- HAMILTON LANE FIC FIP	4.366.318,31	2,75%	0,64%
- STRATUS SCP BR FIP	1.953.322,21	1,23%	0,29%
- MEMORIAL OFFICE FI MOBILIARIO	1.009.999,92	0,64%	0,15%
- ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO	12.196.470,00	7,68%	1,79%
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO	1.870.496,92	1,18%	0,27%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	4.003.985,04	2,52%	0,59%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			
- BB MM SCH INV EXTE FI	9.994.508,92	6,29%	1,47%
- MSQUARE GL EQ FICFIM	6.651.314,65	4,19%	0,98%
TOTAL	158.811.395,03	100,00%	23,29%

GESTÃO PRÓPRIA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Própria	(%) em relação ao Recursos Garantidores
RENTA FIXA	368.761.444,10	71,45%	54,08%
RENTA VARIÁVEL	54.976.519,14	10,65%	8,06%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	17.896.632,01	3,47%	2,62%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	72.156.361,50	13,98%	10,58%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	2.287.392,00	0,44%	0,34%
TOTAL	516.078.348,75	100,00%	75,69%