

**RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL
PLANO I**

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 29.12.2017

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.200.544.308,16		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			924.640.360,24	77,02	
<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>		178.689	624.694.294,40	52,03	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			183.443.288,55	15,28	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		9.502,00	12.343.687,49	1,03	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	1	24.254.454,66	2,02	2,02
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	1	2.049.020,58	0,17	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	1	3.383.584,48	0,28	0,45
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	3.500	6.007.483,74	0,50	0,50
. CDB 365 DIAS - BANCO SOFISA	PÓS	6.000	6.336.203,75	0,53	0,53
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS - BANCO CRUZEIRO DO SUL		-1	-24.254.454,66	-2,02	-2,02
- BANCO MORADA		-1	-5.432.605,06	-0,45	-0,45
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		151	56.345.027,23	4,69	
. PARANÁ BANCO		40	6.373.860,33	0,53	0,53
. ABC		1	9.100.150,93	0,76	0,76
. BRADESCO		105	29.020.948,47	2,42	2,42
. BANCO BTG PACTUAL		1	9.066.710,28	0,76	0,76
. SAFRA		4	2.783.357,22	0,23	0,23
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		35.679.081,52	114.754.573,83	9,56	
. SANT FIC FI ISN RF D		516,24	83.975,70	0,01	0,01
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		16.541.529,07	26.064.100,30	2,17	2,17
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		103.284,59	10.625.321,17	0,89	0,89
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FIM II		9.999.636,36	7.189.365,84	0,60	0,60
. BNP PARIBAS MATCH DI FI RENDA FIXA		97,34	25.603,29	0,00	0,00
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		45.250,01	7.098.110,02	0,59	0,59
. CA INDOSUEZ VITESSE FI RENDA FIXA CP		1.750.823,78	35.362.277,26	2,95	2,95
. ICATU VANGUARDA CP FI RENDA FIXA LONGO PRAZO		7.221.252,83	25.422.694,98	2,12	2,12
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		4.713,99	228.988,13	0,02	0,02
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		7.000,00	109.490,99	0,01	0,01
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		4.958,18	491.644,90	0,04	0,04
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		9,76	1.276.083,80	0,11	0,11
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR		9,37	776.917,45	0,06	0,06
<u>Debêntures</u>		29.717	62.478.923,56	5,20	
. LOJAS AMERICANAS		432	4.800.827,45	0,40	0,40
. ECOPISTAS		7.000	8.553.332,05	0,71	0,71
. LOCALIZA		289	3.039.335,76	0,25	0,25
. CEMIG		20.000	28.152.159,50	2,34	2,34
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		849	3.012.156,29	0,25	0,25
. SABESP		887	12.133.726,56	1,01	1,01
. ESPIRITO SANTO CENTRAIS ELÉTRICAS		140	1.466.651,99	0,12	0,12
. BR TOWERS SPEI S.A.		120	1.320.733,96	0,11	0,11
. VALORES A RECEBER			4.599.655,00	0,38	0,38
. COMANCHE PART.			4.599.655,00	0,38	0,38
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		0,00	-4.599.655,00	-0,38	-0,38
. COMANCHE PART.			-4.599.655,00	-0,38	-0,38
<u>Outros Títulos</u>		43	54.023.853,73	4,50	
. CERTIFICADO DE RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS		36	6.864.312,19	0,57	0,57
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	15.197.188,50	1,27	1,27
. VALORES A RECEBER		1	107.378.617,97	8,94	8,94
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		-1,00	-75.416.264,93	-6,28	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO - ALOÉS		-1	-7.567.128,03	-0,63	-0,63
. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCARIO - BANIF			-67.849.136,90	-5,65	-5,65

B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			20.541.464,77	1,71
<u>B1. Mercado de Ações</u>			19.054.340,08	1,59
<u>Companhias Abertas</u>		918.462	14.806.490,68	1,23
. AMBEV	ON	35.468	754.759,04	0,06
. BRF - BRASIL FOODS	ON	27.224	996.398,40	0,08
. COSAN	ON	19.800	821.700,00	0,07
. ECORODOVIAS	ON	48.700	599.010,00	0,05
. EVEN	ON	97.100	557.354,00	0,05
. GERDAU - GGBR	PN	62.364	772.066,32	0,06
. IGUATEMI EMP SHOP S.A	ON	23.800	937.482,00	0,08
. ITAUSA	ON	92	967,84	0,00
. ITAUSA	PN	141.756	1.533.799,92	0,13
. MARCOPOLO	PN	94.800	378.252,00	0,03
. MRVE	ON	32.300	485.792,00	0,04
. PETROBRÁS	PN	91.917	1.479.863,70	0,12
. RANDON PART	PN	65.241	467.777,97	0,04
. RENT	ON	61.692	1.360.925,52	0,11
. RUMO	ON	16.919	219.439,43	0,02
. SUZANO PAPEL	PNA	24.300	454.167,00	0,04
. TOTVS	ON	13.400	400.526,00	0,03
. VALE R. DOCE	PNA	61.589	2.479.573,14	0,21
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			106.636,40	0,01
<u>Instituições Financeiras</u>		109.643	4.247.849,40	0,35
. BRADESCO	PN	54.503	1.844.926,55	0,15
. ITAU	PN	55.140	2.347.861,20	0,20
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			55.061,65	0,00
<u>B2. Fundos</u>		1.154,00	1.487.124,69	0,12
. FATOR SINERGIA V		1.154,00	1.487.124,69	0,12
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		9.165.783	89.340.620,88	7,44
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.414,82	3.793.666,93	0,32
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.281,00	19.046.276,39	1,59
. FIP BVPE PLAZA		3.000,00	3.069.327,67	0,26
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		6.011,75	4.443.786,46	0,37
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		903.857,86	629.739,11	0,05
. HAMILTON LANE FIC FIP		10.948,44	12.285.745,21	1,02
. MULTINER FIP		9,44	627.073,61	0,05
. STRATUS SCP BR FIP		2.896.697,50	3.968.183,01	0,33
. P2BR INFR III FIQFIP		5.058,54	7.145.350,20	0,60
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		79.208,00	8.396.048,00	0,70
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		470,67	6.748.584,53	0,56
. GGR COVEPI RENDA FII		57.000,00	6.007.285,98	0,50
. MAUÁ MACRO II FIC DE FIM		6.494,98	4.503.981,32	0,38
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		2.301.824,16	4.320.020,31	0,36
. KINEA CHRONOS FIM		2.885.505,73	4.316.740,23	0,36
. VALORES A RECEBER			38.811,92	0,00
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		15.390.294	38.726.353,78	3,23
. BB MM SCH INV EXTE FI		4.519.272,85	9.284.131,30	0,77
. MSQUARE GL EQ FICFIM		3.305.204,08	7.138.240,06	0,59
. VOT ALLIANZGI FIM		3.814.282,63	6.947.447,02	0,58
. WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI		3.465,71	5.089.265,52	0,42
. GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE		46.431,13	5.198.304,31	0,43
. PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR		3.701.637,15	5.068.965,57	0,42
E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			89.080.659,86	7,42
<u>E1 - Investimentos em Shopping Center</u>			80.684.659,86	6,72
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			27.795.578,10	2,32
. SHOPPING PLAZA SUL			52.523.898,70	4,38
. VALORES A RECEBER			365.183,06	0,03
<u>E2 - Investimento Imobiliário</u>			8.396.000,00	0,70
. PANAMBY			8.396.000,00	0,70
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		1.759	39.349.341,89	3,28
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		1.759	38.177.190,97	3,18
. VALORES A PAGAR (-)			-5.784,04	0,00
. VALORES A RECEBER			1.177.934,96	0,10

G - OUTROS			-1.134.493,26	-0,09	
. DISPONIVEL			264.173,50	0,02	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			333.512,07	0,03	
. OUTROS REALIZAVEIS			333.512,07	0,03	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-1.732.178,83	-0,14	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-333.512,07	-0,03	

GESTÃO TERCEIRIZADA	DISTRIBUIÇÃO	(%) EM RELAÇÃO A GESTÃO TERCEIRIZADA	(%) EM RELAÇÃO AO RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS			
- SANT FIC FI ISN RF D	83.975,70	0,03%	0,01%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO	26.064.100,30	10,67%	2,17%
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP	10.625.321,17	4,35%	0,89%
- BNP PARIBAS MATCH DI FI RENDA FIXA	25.603,29	0,01%	0,00%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP	7.098.110,02	2,91%	0,59%
- CA INDOSUEZ VITESSE FI RENDA FIXA CP	35.362.277,26	14,47%	2,95%
- ICATU VANGUARDA CP FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	25.422.694,98	10,41%	2,12%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	228.988,13	0,09%	0,02%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	109.490,99	0,04%	0,01%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	491.644,90	0,20%	0,04%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.	1.276.083,80	0,52%	0,11%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR	776.917,45	0,32%	0,06%
- BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FIM II	7.189.365,84	2,94%	0,60%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP	3.793.666,93	1,55%	0,32%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	19.046.276,39	7,80%	1,59%
- FIP BVEP PLAZA	3.069.327,67	1,26%	0,26%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES	4.443.786,46	1,82%	0,37%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE	629.739,11	0,26%	0,05%
- HAMILTON LANE FIC FIP	12.285.745,21	5,03%	1,02%
- MULTINER FIP	627.073,61	0,26%	0,05%
- STRATUS SCP BR FIP	3.968.183,01	1,62%	0,33%
- P2BR INFR III FIQFIP	7.145.350,20	2,92%	0,60%
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO	8.434.859,92	3,45%	0,70%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	6.748.584,53	2,76%	0,56%
- GGR COVEPI RENDA FII	6.007.285,98	2,46%	0,50%
- MAUÁ MACRO II FIC DE FIM	4.503.981,32	1,84%	0,38%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS	4.320.020,31	1,77%	0,36%
- KINEA CHRONOS FIM	4.316.740,23	1,77%	0,36%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			
- BB MM SCH INV EXTE FI	9.284.131,30	3,80%	0,77%
- MSQUARE GL EQ FICFIM	7.138.240,06	2,92%	0,59%
- VOT ALLIANZGI FIM	6.947.447,02	2,84%	0,58%
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI	5.089.265,52	2,08%	0,42%
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE	5.198.304,31	2,13%	0,43%
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR	5.068.965,57	2,07%	0,42%
TOTAL	244.308.673,18	100,00%	20,35%

GESTÃO PRÓPRIA	DISTRIBUIÇÃO	(%) EM RELAÇÃO A GESTÃO TERCEIRIZADA	(%) EM RELAÇÃO AO RECURSOS GARANTIDORES
RENDA FIXA	809.885.786,41	84,70%	67,46%
RENDA VARIÁVEL	19.054.340,08	1,99%	1,59%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	89.080.659,86	9,32%	7,42%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	39.349.341,89	4,12%	3,28%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	-1.134.493,26	-0,12%	-0,09%
TOTAL	956.235.634,98	100,00%	79,65%

Elaborado em 22/03/2018