

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL
PLANO I

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 30.12.2016

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO	DIVERSIFICAÇÃO
	TIPO			PATRIMÔNIO (%)	(%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.123.260.445,68		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			889.803.430,07	79,22	
TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOURO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOURO NACIONAL					
Nota do Tesouro Nacional		197.237	632.644.692,87	56,32	
APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS			141.470.892,11	12,59	
Certificado de Depósito Bancário		18.502,00	33.587.631,92	2,99	
. CDB 7307 DIAS - BANCO CRUZEIRO DO SUL	PÓS	1	24.254.454,66	2,16	2,16
. CDB 1826 DIAS -BANCO MORADA	PÓS	1	2.049.020,58	0,18	
. CDB 1827 DIAS - BANCO MORADA	PÓS	1	3.383.584,48	0,30	0,48
. CDB 2924 DIAS - BANCO PANAMERICANO	PÓS	3.500	5.510.002,31	0,49	0,49
. CDB 2995 DIAS - BANCO VOTORANTIM	PÓS	5.000	17.087.592,42	1,52	1,52
. CDB 365 DIAS - BANCO BMG	PÓS	2.500	2.692.758,82	0,24	0,24
. CDB 365 DIAS - BANCO SOFISA	PÓS	2.500	2.726.058,37	0,24	0,24
. CDB 362 DIAS - PARANÁ BANCO	PÓS	5.000	5.571.220,00	0,50	0,50
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-1	-24.254.454,66	-2,16	-2,16
- BANCO MORADA		-1	-5.432.605,06	-0,48	-0,48
Letra Financeira Subordinada		130	57.794.360,68	5,15	
. BANCO ABC		18	21.285.818,37	1,90	1,90
. BANCO ITAÚ		7	4.129.909,15	0,37	0,37
. BANCO BRADESCO		105	21.632.148,95	1,93	1,93
. BANCO BTG PACTUAL		1	8.236.496,24	0,73	0,73
. BANCO SAFRA		4	2.509.987,97	0,22	0,22
Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.		11.708.751,08	50.088.899,51	4,46	
. ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM		516,24	76.224,89	0,01	0,01
. BRADESCO FI REF DI PREMIUM		1.578.925,54	15.294.390,69	1,36	1,36
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FIM II		9.999.636,36	8.226.840,53	0,73	0,73
. BNP PARIBAS MATCH DI FI RENDA FIXA		67.731,63	16.196.101,16	1,44	1,44
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		45.250,01	6.621.224,54	0,59	0,59
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		4.713,99	260.091,29	0,02	0,02
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		7.000,00	546.065,01	0,05	0,05
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		4.958,18	115.107,91	0,01	0,01
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		9,76	1.153.816,12	0,10	0,10
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR		9,37	1.599.037,37	0,14	0,14
Debêntures		29.325	59.457.035,48	5,29	
. ECOPISTAS		7.000	9.130.292,58	0,81	0,81
. LOCALIZA RENT A CAR S/A		289	3.132.555,61	0,28	0,28
. CEMIG DISTRIBUIÇÃO S A		20.000	27.425.493,17	2,44	2,44
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		849	5.436.054,64	0,48	0,48
. CIA DE SAN. BÁSICO DO EST. DE S.PAULO - SABESP		887	11.531.371,11	1,03	1,03
. TRIANGULO DO SOL AUTO - ESTRADAS S/A		180	1.481.379,16	0,13	0,13
. BR TOWERS SPEI S.A.		120	1.319.889,21	0,12	0,12
. VALORES A RECEBER			4.599.655,00	0,41	0,41
. COMANCHE PART.			4.599.655,00	0,41	0,41
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		0,00	-4.599.655,00	-0,41	-0,41
. COMANCHE PART.			-4.599.655,00	-0,41	-0,41
Outros Títulos		43	56.230.809,61	5,01	
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		36	8.311.237,89	0,74	0,74
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	15.957.218,68	1,42	1,42
. VALORES A RECEBER		1	107.378.617,97	9,56	9,56
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		-1,00	-75.416.264,93	-6,71	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO - ALOÉS		-1	-7.567.128,03	-0,67	-0,67
. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCARIO - BANIF			-67.849.136,90	-6,04	-6,04

B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			21.370.380,04	1.90	
<u>B1. Mercado de Ações</u>			14.773.197,00	1,32	
<u>Companhias Abertas</u>		940.263	11.396.905,96	1,01	
. AMBEV	ON	35.468	581.675,20	0,05	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	27.224	1.313.558,00	0,12	
. COSAN	ON	19.800	755.370,00	0,07	
. ECORODOVIAS	ON	48.700	401.288,00	0,04	
. EVEN	ON	97.100	359.270,00	0,03	
. GERDAU - GGBR	PN	62.364	673.531,20	0,06	
. IGUATEMI EMP SHOP S.A	ON	23.800	634.746,00	0,06	
. ITAUSA	PN	139.362	1.153.917,36	0,10	
. MARCOPOLO	PN	94.800	259.752,00	0,02	
. MILLS	ON	62.056	242.638,96	0,02	
. MRVE	ON	32.300	353.362,00	0,03	
. PETROBRÁS	PN	91.917	1.366.805,79	0,12	
. RANDON PART	PN	65.241	225.081,45	0,02	
. RENT	ON	19.585	670.198,70	0,06	
. RUMO	ON	16.919	103.882,66	0,01	
. SUZANO PAPEL	PNA	24.300	345.060,00	0,03	
. TOTVS	ON	13.400	322.136,00	0,03	
. VALE R. DOCE	PNA	65.927	1.538.736,18	0,14	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			95.896,46	0,01	
<u>Instituições Financeiras</u>		104.689	3.376.291,04	0,30	
. BANCO BRADESCO	PN	49.549	1.436.921,00	0,13	
. BANCO ITAU	PN	55.140	1.866.489,00	0,17	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			72.881,04	0,01	
<u>B2. Fundos</u>		3.628.833,79	6.597.183,04	0,59	
. FATOR SINERGIA V		1.154,00	868.199,97	0,08	
. M. SQUARE INST. FIC FIA		2.550.565,52	4.386.739,74	0,39	
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		287.080,55	353.785,88	0,03	
. GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA		746.606,39	820.694,39	0,07	
. BB MM SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI		43.427,34	167.763,06	0,01	
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		3.193.956	63.780.625,23	5,68	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.385,34	3.413.062,31	0,30	
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.281,00	18.004.429,40	1,60	
. FIP BVEP PLAZA		3.000,00	3.069.664,34	0,27	
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		5.845,15	5.715.176,81	0,51	
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		725.969,38	508.655,52	0,05	
. HAMILTON LANE FIC FIP		9.652,50	9.967.975,36	0,89	
. MULTINER FIP		9,44	3.365.538,12	0,30	
.STRATUS SCP BR FIP		2.357.940,00	3.275.112,64	0,29	
. P2BR INFR III FIQFIP		2.194,67	2.418.742,63	0,22	
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		79.208,00	7.564.364,00	0,67	
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		470,67	6.419.290,18	0,57	
. VALORES A RECEBER			58.613,92	0,01	
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		11.638.760	18.143.416,95	1,62	
. BB MM SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI		4.519.272,85	7.269.738,42	0,65	
. MSQUARE GLOBAL EQUITY MANAGERS FICFIM - IE		3.305.204,08	5.704.103,12	0,51	
. VOT ALLIANZGI EUROPE FIM		3.814.282,63	5.169.575,41	0,46	
E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			86.650.941,74	7,71	
<u>E1 - Investimentos em Shopping Center</u>			78.450.941,74	6,98	
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			26.392.155,00	2,35	
. SHOPPING PLAZA SUL			51.507.000,00	4,59	
. VALORES A RECEBER			551.786,74	0,05	
<u>E2 - Investimento Imobiliário</u>			8.200.000,00	0,73	
. PANAMBY			8.200.000,00	0,73	
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00	
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		1.881	43.508.057,02	3,87	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		1.881	42.436.914,74	3,78	
. VALORES A PAGAR (-)			-82.008,87	-0,01	
. VALORES A RECEBER			1.153.151,15	0,10	

G - OUTROS			3.594,63	0,00	
. DISPONIVEL			282.809,28	0,03	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			333.512,07	0,03	
. OUTROS REALIZAVEIS			333.512,07	0,03	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-612.726,72	-0,05	
. 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	76.224,89	0,05%	0,01%
- FUNDO FATOR SINERGIA V	868.199,97	0,63%	0,08%
- BRADESCO FI REF DI PREMIUM	15.294.390,69	11,03%	1,36%
- M. SQUARE INST. FIC FIA	4.386.739,74	3,16%	0,39%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	353.785,88	0,26%	0,03%
- GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA	820.694,39	0,59%	0,07%
- BBM SMID CAPS FICFIA	167.763,06	0,12%	0,01%
- BNP PARIBAS MATCH DI FI RENDA FIXA	16.196.101,16	11,68%	1,44%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP	6.621.224,54	4,78%	0,59%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	260.091,29	0,19%	0,02%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	546.065,01	0,39%	0,05%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	115.107,91	0,08%	0,01%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.	1.153.816,12	0,83%	0,10%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR	1.599.037,37	1,15%	0,14%
- BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FIM II	8.226.840,53	5,94%	0,73%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP	3.413.062,31	2,46%	0,30%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	18.004.429,40	12,99%	1,60%
- FIP BVEP PLAZA	3.069.664,34	2,21%	0,27%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES	5.715.176,81	4,12%	0,51%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE	508.655,52	0,37%	0,05%
- HAMILTON LANE FIC FIP	9.967.975,36	7,19%	0,89%
- MULTINER FIP	3.365.538,12	2,43%	0,30%
- STRATUS SCP BR FIP	3.275.112,64	2,36%	0,29%
- P2BR INFR III FIQFIP	2.418.742,63	1,74%	0,22%
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO	7.622.977,92	5,50%	0,68%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	6.419.290,18	4,63%	0,57%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			
- BB MM SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	7.269.738,42	5,24%	0,65%
- MSQUARE GLOBAL EQUITY MANAGERS FICFIM - IE	5.704.103,12	4,12%	0,51%
- VOT ALLIANZGI EUROPE FIM	5.169.575,41	3,73%	0,46%
TOTAL	138.610.124,73	100,00%	12,34%

GESTÃO PRÓPRIA	DISTRIBUIÇÃO	(%) EM RELAÇÃO A GESTÃO TERCEIRIZADA	(%) EM RELAÇÃO AO RECURSOS GARANTIDORES
RENDA FIXA	839.714.530,56	85,28%	74,76%
RENDA VARIÁVEL	14.773.197,00	1,50%	1,32%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	86.650.941,74	8,80%	7,71%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	43.508.057,02	4,42%	3,87%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	3.594,63	0,00%	0,00%
TOTAL	984.650.320,95	100,00%	87,66%