

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL
PLANO II

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 30.06.2017

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO	DIVERSIFICAÇÃO
	TIPO			PATRIMÔNIO (%)	(%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			907.545.445,31		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			562.927.437,97	62,03	
TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOURO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOURO NACIONAL					
Nota do Tesouro Nacional		146.083	433.852.079,72	47,80	
APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS			69.747.469,22	7,69	
Certificado de Depósito Bancário		1.505,00	7.619.182,50	0,84	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	1	13.141.991,09	1,45	1,45
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	1	3.403.988,49	0,38	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	1	2.047.692,08	0,23	0,60
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	1.500	2.471.589,19	0,27	0,27
. CDB 365 DIAS - BANCO BTG PACTUAL	PÓS	5	5.147.593,31	0,57	0,57
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-1	-13.141.991,09	-1,45	-1,45
- BANCO MORADA		-2	-5.451.680,57	-0,60	-0,60
Letra Financeira Subordinada		128	31.584.834,33	3,48	
. BRADESCO		71	17.002.603,22	1,87	
. ITAÚ		7,00	4.333.573,69	0,48	
. PARANÁ BANCO		25,00	5.093.763,39	0,56	
. ABC		25,00	5.154.894,03	0,57	
Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.		8.850.239,91	30.543.452,39	3,37	
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FIM II		4.999.818,18	4.053.119,16	0,45	0,45
. BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP		3.024.304,06	1.767.314,07	0,19	0,19
. BRADESCO FI REF DI PREMIUM		757.646,28	7.766.712,06	0,86	0,86
. BNP PARIBAS MATCH DI FI RENDA FIXA		30.815,47	7.792.267,67	0,86	0,86
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		30.166,67	4.667.429,43	0,51	0,51
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		2.474,99	12.016,41	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		3.000,00	12.710,85	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		1.976,00	17.148,77	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		19,52	2.459.454,30	0,27	0,27
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR		18,74	1.995.279,67	0,22	0,22
Debêntures		12.884	44.135.788,64	4,86	
. LOJAS AMERICANAS		288	2.895.826,51	0,32	0,32
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		700	3.434.771,75	0,38	0,38
. CEMIG		10.000	13.560.814,56	1,49	1,49
. LOCALIZA		386	4.151.185,94	0,46	0,46
. ROTA DAS BANDEIRAS		500	7.795.413,22	0,86	0,86
. SABESP		625	8.148.483,15	0,90	0,90
. ESPÍRITO SANTO CENTRAIS ELÉTRICAS		205	2.169.634,46	0,24	0,24
. BR TOWERS SPEI S.A.		180	1.979.659,05	0,22	0,22
. VALORES A RECEBER			3.127.765,40	0,34	
. COMANCHE PART.			3.127.765,40	0,34	0,34
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		0,00	-3.127.765,40	-0,34	
. COMANCHE PART.			-3.127.765,40	-0,34	-0,34
Outros Títulos		25	15.192.100,39	1,67	
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		25	4.617.849,31	0,51	0,51
. VALORES A RECEBER			30.362.882,26	3,35	3,35
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		0	-19.788.631,18	-2,18	
. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCARIO - BANIF			-19.788.631,18	-2,18	-2,18

B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			143.952.412,96	15,86	
<u>B1. Mercado de Ações</u>			69.180.420,01	7,62	
<u>Companhias Abertas</u>		2.523.535	61.114.436,14	6,73	
. AMBEV	ON	87.539	1.602.839,09	0,18	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	64.254	2.518.756,80	0,28	
. COSAN	ON	48.600	1.680.588,00	0,19	
. ECORODOVIAS	ON	109.500	1.133.325,00	0,12	
. EVEN	ON	215.500	851.225,00	0,09	
. GERDAU - GGBR	PN	96.424	991.238,72	0,11	
. IGUATEMI EMP SHOP S.A	ON	59.100	1.945.572,00	0,21	
. ISHARES BOVA	CI	572.000	34.851.960,00	3,84	
. ITAUSA	ON	212,00	1.829,56	0,00	
. ITAUSA	PN	320.240	2.888.564,80	0,32	
. MARCOPOLO	PN	187.800	533.352,00	0,06	
. MILLS	ON	52.300	190.895,00	0,02	
. MRVE	ON	78.400	1.059.968,00	0,12	
. PETROBRÁS	PN	183.377	2.268.373,49	0,25	
. RANDON PART	PN	135.675	624.105,00	0,07	
. RENT	ON	43.323	1.956.033,45	0,22	
. RUMO	ON	34.374	297.335,10	0,03	
. SUZANO PAPEL	PNA	62.200	886.972,00	0,10	
. TOTVS	ON	34.100	1.028.456,00	0,11	
. VALE R. DOCE	PNA	138.617	3.730.183,47	0,41	
. VALORES A RECEBER				0,00	
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			72.863,66	0,01	
<u>Instituições Financeiras</u>		248.490	8.065.983,87	0,89	
. BRADESCO	PN	124.449	3.503.239,35	0,39	
. ITAU	PN	124.041	4.558.506,75	0,50	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			4.237,77	0,00	
<u>B2. Fundos</u>		35.087.161,59	74.771.992,95	8,24	
. FATOR SINERGIA V		2.968,00	2.736.823,89	0,30	
. M. SQUARE INST. FIC FIA		11.563.945,16	21.651.024,20	2,39	
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		11.398.044,90	16.006.059,60	1,76	
. GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA		8.758.734,98	9.230.328,04	1,02	
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.300.735,63	13.916.167,13	1,53	
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	11.231.590,09	1,24	
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		11.758.203	81.934.575,86	9,03	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II- FIP		10.778,33	497.651,33	0,05	
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		395,93	5.576.224,76	0,61	
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		8.038,00	15.535.715,95	1,71	
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		2.000,00	2.106.963,80	0,23	
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		2.538,67	2.465.154,44	0,27	
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		540.107,11	353.722,77	0,04	
. HAMILTON LANE FIC FIP		5.243,94	6.014.201,79	0,66	
.STRATUS SCP BR FIP		2.357.940,00	3.337.331,60	0,37	
. P2 BR INFRAESTRUTURA III FIC DE FIP		2.316,00	2.737.492,41	0,30	
. COPA FLORESTAL III		925.992,00	766.455,29	0,08	
. MEMORIAL OFFICE FI IMOBILIARIO		10.000,00	1.104.999,91	0,12	
. ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO		39.000,00	12.285.000,00	1,35	
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		19.802,00	1.998.021,80	0,22	
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		313,78	4.284.418,16	0,47	
. GGR COVEPI RENDA FII		43.000,00	4.551.357,64	0,50	
. MAUÁ MACRO II FIC DE FIM		9.742,48	6.061.880,08	0,67	
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		3.452.736,24	6.111.269,95	0,67	
. KINEA CHRONOS FIM		4.328.258,59	6.060.377,04	0,67	
. VALORES A RECEBER			86.337,14	0,01	
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		12.262.339	22.413.748,31	2,47	
. BB MM SCH INV EXTE FI		5.128.757,86	9.506.141,42	1,05	
. MSQUARE GL EQ FICFIM		3.342.850,69	6.664.018,85	0,73	
. VOT ALLIANZGI FIM		3.790.730,70	6.243.588,04	0,69	

E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			18.310.671,21	2,02	
E1 - Investimentos em Shopping Center			18.310.671,21	2,02	
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			18.296.378,77	2,02	
. VALORES A RECEBER			14.292,44	0,00	
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		3.186	78.299.075,72	8,63	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		3.186	75.659.503,21	8,34	
. VALORES A PAGAR (-)			-26.520,04	0,00	
. VALORES A RECEBER			2.666.092,55	0,29	
G - OUTROS			-292.476,72	-0,03	
. DISPONIVEL			131.232,06	0,01	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			54.561,85	0,01	
. OUTROS REALIZAVEIS			58.100,03	0,01	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-481.808,81	-0,05	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-54.561,85	-0,01	
GESTÃO TERCEIRIZADA			DISTRIBUIÇÃO	(%) EM RELAÇÃO A GESTÃO TERCEIRIZADA	(%) EM RELAÇÃO AO RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS					
- FUNDO FATOR SINERGIA V			2.736.823,89	1,31%	0,30%
- BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP			1.767.314,07	0,84%	0,19%
- BRADESCO FI REF DI PREMIUM			7.766.712,06	3,70%	0,86%
- M. SQUARE INST. FIC FIA			21.651.024,20	10,32%	2,39%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA			16.006.059,60	7,63%	1,76%
- GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA			9.230.328,04	4,40%	1,02%
- BBM SMID CAPS FICFIA			13.916.167,13	6,64%	1,53%
- BNP PARIBAS MATCH DI FI RENDA FIXA			7.792.267,67	3,72%	0,86%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP			4.667.429,43	2,23%	0,51%
- IBIUNA EQ. FIC FIA			11.231.590,09	5,36%	1,24%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER			12.016,41	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER II			12.710,85	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER III			17.148,77	0,01%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.			2.459.454,30	1,17%	0,27%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR			1.995.279,67	0,95%	0,22%
- BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FIM II			4.053.119,16	1,93%	0,45%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP			497.651,33	0,24%	0,05%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			5.576.224,76	2,66%	0,61%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP			15.535.715,95	7,41%	1,71%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA			2.106.963,80	1,00%	0,23%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES			2.465.154,44	1,18%	0,27%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			353.722,77	0,17%	0,04%
- HAMILTON LANE FIC FIP			6.014.201,79	2,87%	0,66%
- STRATUS SCP BR FIP			3.337.331,60	1,59%	0,37%
- P2BR INFR III FIQFIP			2.737.492,41	1,31%	0,30%
- COPA FLORESTAL III			766.455,29	0,37%	0,08%
- MEMORIAL OFFICE FI MOBILIARIO			1.120.699,91	0,53%	0,12%
- ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO			12.374.700,00	5,90%	1,36%
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO			2.014.853,50	0,96%	0,22%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			4.284.418,16	2,04%	0,47%
- GGR COVEPI RENDA FII			4.551.357,64	2,17%	0,50%
- MAUÁ MACRO II FIC DE FIM			6.061.880,08	2,89%	0,67%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			6.111.269,95	2,91%	0,67%
- KINEA CHRONOS FIM			6.060.377,04	2,89%	0,67%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- BB MM SCH INV EXTE FI			9.506.141,42	4,53%	1,05%
- MSQUARE GL EQ FICFIM			6.664.018,85	3,18%	0,73%
- VOT ALLIANZGI FIM			6.243.588,04	2,98%	0,69%
TOTAL			209.699.664,07	100,00%	23,11%

GESTÃO PRÓPRIA	DISTRIBUIÇÃO	(%) EM RELAÇÃO A GESTÃO TERCEIRIZADA	(%) EM RELAÇÃO AO RECURSOS GARANTIDORES
REDA FIXA	532.383.985,58	76,29%	58,66%
REDA VARIÁVEL	69.180.420,01	9,91%	7,62%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	18.310.671,21	2,62%	2,02%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	78.299.075,72	11,22%	8,63%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	-292.476,72	-0,04%	-0,03%
TOTAL	697.881.675,80	100,00%	76,90%

Elaborado em 17/08/2017