

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL

PLANO II

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 29.12.2017

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO	DIVERSIFICAÇÃO
	TIPO			PATRIMÔNIO (%)	(%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			993.630.407,46		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			606.444.566,20	61,03	
<u>TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO</u> <u>TESOURO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS</u> <u>SECURITIZADOS DO TESOIRO NACIONAL</u>					
<u>Nota do Tesouro Nacional</u>		146.083	439.907.185,21	44,27	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			107.027.900,17	10,77	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		1.505,00	7.936.635,16	0,80	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	1	13.141.991,09	1,32	1,32
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	1	3.403.988,49	0,34	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	1	2.047.692,08	0,21	0,55
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	1.500	2.574.635,88	0,26	0,26
. CDB 365 DIAS - BANCO BTG PACTUAL	PÓS	5	5.361.999,28	0,54	0,54
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-1	-13.141.991,09	-1,32	-1,32
- BANCO MORADA		-2	-5.451.680,57	-0,55	-0,55
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		121	28.330.955,84	2,85	
. BRADESCO		71	17.647.676,92	1,78	
. PARANÁ BANCO		25,00	5.309.719,61	0,53	
. ABC		25,00	5.373.559,31	0,54	
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		32.202.179,74	70.760.309,17	7,12	
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FIM II		4.999.818,18	3.594.682,92	0,36	0,36
. BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP		3.024.304,06	320.870,79	0,03	0,03
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		21.012.816,98	33.109.404,01	3,33	3,33
. BNP PARIBAS MATCH DI FI RENDA FIXA		122,79	32.296,35	0,00	0,00
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		30.166,67	4.732.073,35	0,48	0,48
. CA INDOSUEZ VITESSE FI RENDA FIXA CP		808.989,02	16.339.562,20	1,64	1,64
. ICATU VANGUARDA CP FI RENDA FIXA LONGO PRAZO		2.318.472,80	8.162.271,58	0,82	0,82
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		2.474,99	120.226,05	0,01	0,01
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		3.000,00	46.924,70	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		1.976,00	195.936,78	0,02	0,02
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		19,52	2.551.856,91	0,26	0,26
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR		18,74	1.554.203,53	0,16	0,16
<u>Debêntures</u>		12.884	44.180.595,99	4,45	
. LOJAS AMERICANAS		288	3.200.551,63	0,32	0,32
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		700	2.483.521,09	0,25	0,25
. CEMIG		10.000	14.076.079,72	1,42	1,42
. LOCALIZA		386	4.059.458,85	0,41	0,41
. ROTA DAS BANDEIRAS		500	7.657.361,10	0,77	0,77
. SABESP		625	8.574.925,06	0,86	0,86
. ESPÍRITO SANTO CENTRAIS ELÉTRICAS		205	2.147.597,60	0,22	0,22
. BR TOWERS SPEI S.A.		180	1.981.100,94	0,20	0,20
. VALORES A RECEBER			3.127.765,40	0,31	
. COMANCHE PART.			3.127.765,40	0,31	0,31
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		0,00	-3.127.765,40	-0,31	
. COMANCHE PART.			-3.127.765,40	-0,31	-0,31
<u>Outros Títulos</u>		25	15.328.884,83	1,54	
. CERTIFICADO DE RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS		25	4.754.633,75	0,48	0,48
. VALORES A RECEBER			30.362.882,26	3,06	3,06
. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCÁRIO - BANIF			-19.788.631,18	-1,99	-1,99

B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			162.950.271,43	16,40	
B1. Mercado de Ações			84.373.260,28	8,49	
<u>Companhias Abertas</u>		2.548.760	74.753.568,33	7,52	
. AMBEV	ON	87.539	1.862.829,92	0,19	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	64.254	2.351.696,40	0,24	
. COSAN	ON	48.600	2.016.900,00	0,20	
. ECORODOVIAS	ON	109.500	1.346.850,00	0,14	
. EVEN	ON	215.500	1.236.970,00	0,12	
. GERDAU - GGBR	PN	96.424	1.193.729,12	0,12	
. HYPERMARCAS	ON	0	0,00	0,00	
. IGUATEMI EMP SHOP S.A	ON	59.100	2.327.949,00	0,23	
. ISHARES BOVA	CI	572.000	42.225.040,00	4,25	
. ITAUSA	ON	212,00	2.230,24	0,00	
. ITAUSA	PN	320.240	3.464.996,80	0,35	
. MARCOPOLO	PN	187.800	749.322,00	0,08	
. MRVE	ON	78.400	1.179.136,00	0,12	
. PETROBRÁS	PN	183.377	2.952.369,70	0,30	
. RANDON PART	PN	135.675	972.789,75	0,10	
. RENT	ON	129.969	2.867.116,14	0,29	
. RUMO	ON	34.374	445.830,78	0,04	
. SUZANO PAPEL	PNA	62.200	1.162.518,00	0,12	
. TOTVS	ON	34.100	1.019.249,00	0,10	
. VALE R. DOCE	PNA	129.496	5.213.508,96	0,52	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			162.536,52	0,02	
<u>Instituições Financeiras</u>		248.490	9.619.691,95	0,97	
. BRADESCO	PN	124.449	4.212.598,65	0,42	
. ITAU	PN	124.041	5.281.665,78	0,53	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			125.427,52	0,01	
<u>B2. Fundos</u>		26.328.426,61	78.577.011,15	7,91	
. FATOR SINERGIA V		2.968,00	3.824.771,29	0,38	
. M. SQUARE INST. FIC FIA		11.563.945,16	25.113.215,73	2,53	
. GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA		0,00	0,00	0,00	
. BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIQ FIA		0,00	0,00	0,00	
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.300.735,63	17.284.963,61	1,74	
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	13.355.606,66	1,34	
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		12.656.511	84.554.175,47	8,51	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II- FIP		10.778,33	59.863,09	0,01	
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		395,93	5.886.831,34	0,59	
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		8.136,00	13.833.974,17	1,39	
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		2.000,00	2.046.218,45	0,21	
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		2.576,47	1.904.479,91	0,19	
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		602.572,08	419.826,19	0,04	
. HAMILTON LANE FIC FIP		5.640,10	6.329.020,28	0,64	
. STRATUS SCP BR FIP		2.896.697,50	3.968.183,01	0,40	
. P2 BR INFRAESTRUTURA III FIC DE FIP		2.531,46	3.575.763,12	0,36	
. COPA FLORESTAL III		1.222.330,00	1.141.269,61	0,11	
. MEMORIAL OFFICE FI IMOBILIARIO		10.000,00	1.099.899,91	0,11	
. ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO		39.000,00	13.357.500,00	1,34	
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		19.802,00	2.099.012,00	0,21	
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		313,78	4.499.056,38	0,45	
. GGR COVEPI RENDA FII		43.000,00	4.531.812,23	0,46	
. MAUÁ MACRO II FIC DE FIM		9.742,48	6.755.971,98	0,68	
. KINEA CHRONOS FIM		4.328.258,59	6.475.110,35	0,65	
. VALORES A RECEBER			90.352,98	0,01	
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		16.013.873	40.016.851,45	4,03	
. BB MM SCH INV EXTE FI		5.128.757,86	10.536.221,87	1,06	
. MSQUARE GL EQ FICFIM		3.342.850,69	7.219.545,35	0,73	
. VOT ALLIANZGI FIM		3.790.730,70	6.904.548,83	0,69	
. WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI		3.465,71	5.089.265,52	0,51	
. GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE		46.431,13	5.198.304,31	0,52	
. PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR		3.701.637,15	5.068.965,57	0,51	
E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			20.222.446,60	2,04	
<u>E1 - Investimentos em Shopping Center</u>			20.222.446,60	2,04	
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			20.136.135,65	2,03	
. VALORES A RECEBER			86.310,95	0,01	
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		3.135	76.047.423,72	7,65	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		3.135	73.440.668,68	7,39	
. VALORES A PAGAR (-)			55.436,50	0,01	
. VALORES A RECEBER			2.551.318,54	0,26	

G - OUTROS			3.394.672,59	0,34	
. DISPONIVEL			5.144.125,66	0,52	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			54.561,85	0,01	
. OUTROS REALIZAVEIS			58.100,03	0,01	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-1.807.553,10	-0,18	
. 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		3.824.771,29	1,40%	0,38%	
- BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP		320.870,79	0,12%	0,03%	
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		33.109.404,01	12,09%	3,33%	
- M. SQUARE INST. FIC FIA		25.113.215,73	9,17%	2,53%	
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		18.998.453,86	6,94%	1,91%	
- BBM SMID CAPS FICFIA		17.284.963,61	6,31%	1,74%	
- BNP PARIBAS MATCH DI FI RENDA FIXA		32.296,35	0,01%	0,00%	
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		4.732.073,35	1,73%	0,48%	
- CA INDOSUEZ VITESSE FI RENDA FIXA CP		16.339.562,20	5,97%	1,64%	
- ICATU VANGUARDA CP FI RENDA FIXA LONGO PRAZO		8.162.271,58	2,98%	0,82%	
- IBIUNA EQ. FIC FIA		13.355.606,66	4,88%	1,34%	
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		120.226,05	0,04%	0,01%	
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		46.924,70	0,02%	0,00%	
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		195.936,78	0,07%	0,02%	
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.		2.551.856,91	0,93%	0,26%	
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR		1.554.203,53	0,57%	0,16%	
- BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FIM II		3.594.682,92	1,31%	0,36%	
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP		59.863,09	0,02%	0,01%	
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		5.886.831,34	2,15%	0,59%	
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		13.833.974,17	5,05%	1,39%	
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		2.046.218,45	0,75%	0,21%	
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		1.904.479,91	0,70%	0,19%	
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		419.826,19	0,15%	0,04%	
- HAMILTON LANE FIC FIP		6.329.020,28	2,31%	0,64%	
- STRATUS SCP BR FIP		3.968.183,01	1,45%	0,40%	
- P2BR INFR III FIQFIP		3.575.763,12	1,31%	0,36%	
- COPA FLORESTAL III		1.141.269,61	0,42%	0,11%	
- MEMORIAL OFFICE FI MOBILIARIO		1.104.499,91	0,40%	0,11%	
- ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO		13.433.550,00	4,90%	1,35%	
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		2.108.714,98	0,77%	0,21%	
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		4.499.056,38	1,64%	0,45%	
- GGR COVEPI RENDA FII		4.531.812,23	1,65%	0,46%	
- MAUÁ MACRO II FIC DE FIM		6.755.971,98	2,47%	0,68%	
- FIC DE FIM GARDE DUMAS		6.480.030,47	2,37%	0,65%	
- KINEA CHRONOS FIM		6.475.110,35	2,36%	0,65%	
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- BB MM SCH INV EXTE FI		10.536.221,87	3,85%	1,06%	
- MSQUARE GL EQ FICFIM		7.219.545,35	2,64%	0,73%	
- VOT ALLIANZGI FIM		6.904.548,83	2,52%	0,69%	
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI		5.089.265,52	1,86%	0,51%	
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE		5.198.304,31	1,90%	0,52%	
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR		5.068.965,57	1,85%	0,51%	
TOTAL		273.908.347,24	100,00%	26,02%	
GESTÃO PRÓPRIA		DISTRIBUIÇÃO	(%) EM RELAÇÃO A TERCEIRIZADA	(%) EM RELAÇÃO AO GARANTIDORES	
RENDA FIXA		535.684.257,03	74,43%	53,91%	
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS		20.222.446,60	2,81%	2,04%	
EMPRÉSTIMO PESSOAL		76.047.423,72	10,57%	7,65%	
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)		3.394.672,59	0,47%	0,34%	
TOTAL		719.722.060,22	100,00%	72,43%	

Elaborado em 22/03/2018