

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL

PLANO II

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 30.06.2016

DISCRIMINAÇÃO	Espécie Tipo	Quantidade	Valor em R\$	Alocação do patrimônio (%)	Diversificação (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			761.357.604,77		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			475.935.988,67	62,51	
<u>TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO</u> <u>TESOURO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS</u> <u>SECURITIZADOS DO TESOURO NACIONAL</u>					
<u>Nota do Tesouro Nacional</u>		123.242	351.740.321,02	46,20	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			70.615.899,34	9,27	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		2.504,00	10.618.122,91	1,39	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	1	13.141.991,09	1,73	1,73
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	1	3.403.988,49	0,45	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	1	2.047.692,08	0,27	0,72
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	1	2.249.928,55	0,30	0,30
. CDB 365 DIAS - SOFISA	PÓS	2	2.590.288,21	0,34	0,34
. CDB 2995 DIAS - VOTORANTIM	PÓS	1	3.226.474,26	0,42	0,42
. CDB 365 DIAS - BANCO BMG	PÓS	2.500	2.551.431,89	0,34	0,34
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-1	-13.141.991,09	-1,73	-1,73
- BANCO MORADA		-2	-5.451.680,57	-0,72	-0,72
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		46	10.855.887,98	1,43	
. BRADESCO		46	10.855.887,98	1,43	
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		9.813.420,65	49.141.888,45	6,45	
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FIM II		4.999.818,18	5.461.631,35	0,72	0,72
. BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP		3.024.304,06	2.989.701,79	0,39	0,39
. BRADESCO FI REF DI PREMIUM		1.681.093,51	15.209.843,11	2,00	2,00
. BNP PARIBAS MATCH DI FI RENDA FIXA		70.548,99	15.774.252,56	2,07	2,07
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		30.166,67	4.133.765,94	0,54	0,54
. FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER		2.474,99	16.915,48	0,00	0,00
. FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER II		3.000,00	20.387,29	0,00	0,00
. FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER III		1.976,00	29.206,18	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		19,52	2.307.351,31	0,30	0,30
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR		18,74	3.198.833,44	0,42	0,42
<u>Debêntures</u>		12.601	37.445.352,56	4,92	
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		700	5.646.322,50	0,74	0,74
. CEMIG		10.000	13.134.483,30	1,73	1,73
. RODOVIAS DO TIETÊ		1.000	1.268.635,81	0,17	0,17
. ROTA DAS BANDEIRAS		500	7.876.538,11	1,03	1,03
. SABESP		401	4.801.193,69	0,63	0,63
. TRIANGULO DO SOL AUTO - ESTRADAS S/A		270	2.719.805,59	0,36	0,36
. BR TOWERS SPEI S.A.		180	1.998.373,56	0,26	0,26
. VALORES A RECEBER			3.127.765,40	0,41	
. COMANCHE PART.			3.127.765,40	0,41	0,41
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		0,00	-3.127.765,40	-0,41	
. COMANCHE PART.			-3.127.765,40	-0,41	-0,41
<u>Outros Títulos</u>		26	16.134.415,75	2,12	
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		25	5.560.164,67	0,73	0,73
. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCARIO		1	19.823.594,65	2,60	2,60
. VALORES A RECEBER		1	10.539.287,61	1,38	1,38
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		-1	-19.788.631,18	-2,60	
. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCARIO - BANIF		-1	-19.788.631,18	-2,60	-2,60
B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			121.314.837,17	15,93	
<u>B1. Mercado de Ações</u>			62.373.630,65	8,19	
<u>Companhias Abertas</u>		3.075.428	55.952.612,91	7,35	

. AMBEV	ON	86.239	1.642.852,95	0,22
. BRF - BRASIL FOODS	ON	70.254	3.170.563,02	0,42
. COSAN	ON	48.600	1.618.866,00	0,21
. ECORODOVIAS	ON	116.400	975.432,00	0,13
. EVEN	ON	220.700	847.488,00	0,11
. GERDAU - GGBR	PN	261.424	1.539.787,36	0,20
. IGUATEMI EMP SHOP S.A	ON	69.800	1.966.266,00	0,26
. ISHARES BOVA	CI	607.100	30.294.290,00	3,98
. ITAUSA	PN	337.430	2.561.093,70	0,34
. MARCOPOLO	PN	166.800	400.320,00	0,05
. MILLS	ON	136.078	583.774,62	0,08
. MRVE	ON	90.400	977.224,00	0,13
. PETROBRÁS	PN	252.877	2.382.101,34	0,31
. RANDON PART	PN	222.475	723.043,75	0,09
. RENT	ON	45.760	1.578.720,00	0,21
. RUMO	ON	52.174	255.652,60	0,03
. SUZANO PAPEL	PNA	21.700	245.861,00	0,03
. TOTVS	ON	35.100	1.071.954,00	0,14
. VALE R. DOCE	PNA	234.117	3.050.544,51	0,40
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			66.778,06	0,01
<u>Instituições Financeiras</u>		<u>230.601</u>	<u>6.421.017,74</u>	<u>0,84</u>
. BRADESCO	PN	115.636	2.911.714,48	0,38
. ITAU	PN	114.965	3.483.439,50	0,46
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			25.863,76	0,00
<u>B2. Fundos</u>		<u>35.024.428,67</u>	<u>58.941.206,52</u>	<u>7,74</u>
. FATOR SINERGIA V		2.968,00	2.088.989,34	0,27
. M. SQUARE INST. FIC FIA		11.563.945,16	19.851.629,81	2,61
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		11.398.044,90	13.531.333,19	1,78
. GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA		8.758.734,98	7.334.951,98	0,96
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.300.735,63	10.984.164,93	1,44
. IBIUNA EQ. FIC FIA		33.277,82	5.150.137,27	0,68
<u>C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS</u>		<u>3.381.231,44</u>	<u>49.960.157,68</u>	<u>6,56</u>
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II- FIP		10.778,33	450.263,94	0,06
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		395,93	5.655.279,42	0,74
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		7.734,00	13.188.194,02	1,73
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		2.000,00	2.043.659,37	0,27
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		2.472,07	2.435.116,54	0,32
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		425.813,50	292.142,41	0,04
. HAMILTON LANE FIC FIP		4.122,50	4.116.700,40	0,54
.STRATUS SCP BR FIP		2.357.940,00	2.510.427,98	0,33
. P2 BR INFRAESTRUTURA III FIC DE FIP		859,33	832.768,77	0,11
. COPA FLORESTAL III		500.000,00	401.152,92	0,05
. MEMORIAL OFFICE FI IMOBILIARIO		10.000,00	1.019.099,92	0,13
. ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO		39.000,00	11.115.000,00	1,46
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		19.802,00	1.755.447,30	0,23
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		313,78	4.022.672,99	0,53
. VALORES A RECEBER			122.231,70	0,02
<u>D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</u>		<u>12.262.339,25</u>	<u>17.908.968,05</u>	<u>2,35</u>
. BB MM SCH INV EXTE FI		5.128.757,86	7.682.308,19	1,01
. MSQUARE GL EQ FICFIM		3.342.850,69	5.175.482,44	0,68
. VOT ALLIANZGI FIM		3.790.730,70	5.051.177,42	0,66
<u>E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS</u>			<u>17.718.435,09</u>	<u>2,33</u>
<u>E1 - Investimentos em Shopping Center</u>			<u>17.718.435,09</u>	<u>2,33</u>
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			17.685.504,09	2,32
. VALORES A RECEBER			32.931,00	0,00
<u>F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES</u>		<u>3.216</u>	<u>76.097.970,05</u>	<u>10,00</u>
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		3.216	73.891.936,73	9,71
. VALORES A PAGAR (-)			-59.504,38	-0,01
. VALORES A RECEBER			2.265.537,70	0,30

G - OUTROS			2.421.248,06	0,32	
. DISPONIVEL			2.659.966,08	0,35	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			54.561,85	0,01	
. OUTROS REALIZAVEIS			54.561,85	0,01	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-293.279,87	-0,04	
. 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	2.088.989,34	1,19%	0,27%
- BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP	2.989.701,79	1,70%	0,39%
- BRADESCO FI REF DI PREMIUM	15.209.843,11	8,64%	2,00%
- M. SQUARE INST. FIC FIA	19.851.629,81	11,28%	2,61%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	13.531.333,19	7,69%	1,78%
- GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA	7.334.951,98	4,17%	0,96%
- BBM SMID CAPS FICFIA	10.984.164,93	6,24%	1,44%
- BNP PARIBAS MATCH DI FI RENDA FIXA	15.774.252,56	8,97%	2,07%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP	4.133.765,94	2,35%	0,54%
- IBIUNA EQ. FIC FIA	5.150.137,27	2,93%	0,68%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	16.915,48	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	20.387,29	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	29.206,18	0,02%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.	2.307.351,31	1,31%	0,30%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR	3.198.833,44	1,82%	0,42%
- BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FIM II	5.461.631,35	3,10%	0,72%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP	450.263,94	0,26%	0,06%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	5.655.279,42	3,21%	0,74%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP	13.188.194,02	7,50%	1,73%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA	2.043.659,37	1,16%	0,27%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES	2.435.116,54	1,38%	0,32%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE	292.142,41	0,17%	0,04%
- HAMILTON LANE FIC FIP	4.116.700,40	2,34%	0,54%
- STRATUS SCP BR FIP	2.510.427,98	1,43%	0,33%
- P2BR INFR III FIQFIP	832.768,77	0,47%	0,11%
- COPA FLORESTAL III	401.152,92	0,23%	0,05%
- MEMORIAL OFFICE FI MOBILIARIO	1.034.799,92	0,59%	0,14%
- ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO	11.204.700,00	6,37%	1,47%
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO	1.772.279,00	1,01%	0,23%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	4.022.672,99	2,29%	0,53%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			
- BB MM SCH INV EXTE FI	7.682.308,19	4,37%	1,01%
- MSQUARE GL EQ FICFIM	5.175.482,44	2,94%	0,68%
- VOT ALLIANZGI FIM	5.051.177,42	2,87%	0,66%
TOTAL	175.952.220,70	100,00%	23,11%

GESTÃO PRÓPRIA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Própria	(%) em relação ao Recursos Garantidores
RENDA FIXA	426.794.100,22	72,91%	56,06%
RENDA VARIÁVEL	62.373.630,65	10,65%	8,19%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	17.718.435,09	3,03%	2,33%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	76.097.970,05	13,00%	10,00%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	2.421.248,06	0,41%	0,32%
TOTAL	585.405.384,07	100,00%	76,89%