

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL
PLANO II

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 30.12.2016

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO	DIVERSIFICAÇÃO
	TIPO			PATRIMÔNIO (%)	(%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			833.291.582,99		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			524.584.956,47	62,95	
<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>		164.001	417.107.273,60	50,06	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			51.594.591,71	6,19	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		7.500,00	11.212.583,63	1,35	
. CDB 7307 DIAS - BANCO CRUZEIRO DO SUL	PÓS	1	13.141.991,09	1,58	1,58
. CDB 1826 DIAS - BANCO MORADA	PÓS	1	3.403.988,49	0,41	
. CDB 1827 DIAS -BANCO MORADA	PÓS	1	2.047.692,08	0,25	0,65
. CDB 2924 DIAS - BANCO PANAMERICANO	PÓS	1.500	2.361.429,56	0,28	0,28
. CDB 365 DIAS -BANCO SOFISA	PÓS	2.500	2.740.876,76	0,33	0,33
. CDB 2995 DIAS - BANCO VOTORANTIM	PÓS	1.000	3.417.518,49	0,41	0,41
. CDB 365 DIAS - BANCO BMG	PÓS	2.500	2.692.758,82	0,32	0,32
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-1	-13.141.991,09	-1,58	-1,58
- BANCO MORADA		-2	-5.451.680,57	-0,65	-0,65
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		53	14.985.797,13	1,80	
. BANCO BRADESCO		46	10.855.887,98	1,30	
. BANCO ITAÚ		7,00	4.129.909,15	0,50	
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		8.596.027,44	25.396.210,95	3,05	
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FIM II		4.999.818,18	4.113.420,26	0,49	0,49
. BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP		3.024.304,06	1.692.697,54	0,20	0,20
. BRADESCO FI REF DI PREMIUM		514.420,59	4.982.976,94	0,60	0,60
. BNP PARIBAS MATCH DI FI RENDA FIXA		19.828,69	4.741.470,67	0,57	0,57
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		30.166,67	4.414.149,69	0,53	0,53
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		2.474,99	136.556,20	0,02	0,02
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		3.000,00	234.027,86	0,03	0,03
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		1.976,00	45.874,33	0,01	0,01
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		19,52	2.335.363,48	0,28	0,28
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR		18,74	2.699.673,98	0,32	0,32
<u>Debêntures</u>		12.661	42.549.507,75	5,11	
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		700	4.482.023,84	0,54	0,54
. CEMIG DISTRIBUIÇÃO S A		10.000	13.712.746,55	1,65	1,65
. LOCALIZA RENT A CAR S/A		386	4.183.967,02	0,50	0,50
. CONCESSIONARIA ROTA DAS BANDEIRAS S.A.		500	7.830.752,56	0,94	0,94
. CIA DE SAN. BÁSICO DO EST. DE S.PAULO - SABESP		1.075	8.138.115,23	0,98	0,98
. TRIANGULO DO SOL AUTO - ESTRADAS S/A		270	2.222.068,73	0,27	0,27
. BR TOWERS SPEI S.A.		180	1.979.833,82	0,24	0,24
. VALORES A RECEBER			3.127.765,40	0,38	
. COMANCHE PART.			3.127.765,40	0,38	0,38
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		0,00	-3.127.765,40	-0,38	
. COMANCHE PART.			-3.127.765,40	-0,38	-0,38
<u>Outros Títulos</u>		25	13.333.583,41	1,60	
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		25	2.759.332,33	0,33	0,33
. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCARIO				0,00	0,00
. VALORES A RECEBER			30.362.882,26	3,64	3,64
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		0	-19.788.631,18	-2,37	
. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCARIO - BANIF			-19.788.631,18	-2,37	-2,37

B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			135.072.701,65	16,21	
<u>B1. Mercado de Ações</u>			66.076.319,44	7,93	
<u>Companhias Abertas</u>		2.599.628	58.431.082,37	7,01	
. AMBEV	ON	87.539	1.435.639,60	0,17	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	64.254	3.100.255,50	0,37	
. COSAN	ON	48.600	1.854.090,00	0,22	
. ECORODOVIAS	ON	109.500	902.280,00	0,11	
. EVEN	ON	215.500	797.350,00	0,10	
. GERDAU - GGBR	PN	96.424	1.041.379,20	0,12	
. IGUATEMI EMP SHOP S.A	ON	59.100	1.576.197,00	0,19	
. ISHARES BOVA	CI	572.000	33.313.280,00	4,00	
. ITAUSA	PN	314.830	2.606.792,40	0,31	
. MARCOPOLO	PN	187.800	514.572,00	0,06	
. MILLS	ON	136.078	532.064,98	0,06	
. MRVE	ON	78.400	857.696,00	0,10	
. PETROBRÁS	PN	183.377	2.726.815,99	0,33	
. RANDON PART	PN	135.675	468.078,75	0,06	
. RENT	ON	41.260	1.411.917,20	0,17	
. RUMO	ON	34.374	211.056,36	0,03	
. SUZANO PAPEL	PNA	62.200	883.240,00	0,11	
. TOTVS	ON	34.100	819.764,00	0,10	
. VALE R. DOCE	PNA	138.617	3.235.320,78	0,39	
. VALORES A RECEBER				0,00	
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			143.292,61	0,02	
<u>Instituições Financeiras</u>		230.601	7.645.237,07	0,92	
. BRADESCO	PN	115.636	3.280.944,00	0,39	
. ITAU	PN	114.965	4.198.787,85	0,50	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			165.505,22	0,02	
<u>B2. Fundos</u>		35.087.161,59	68.996.382,21	8,28	
. FATOR SINERGIA V		2.968,00	2.232.944,01	0,27	
. M. SQUARE INST. FIC FIA		11.563.945,16	19.888.929,55	2,39	
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		11.398.044,90	14.046.466,69	1,69	
. GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA		8.758.734,98	9.627.890,70	1,16	
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.300.735,63	12.750.988,64	1,53	
. IBIUNA EQUITIES FIC FIA		62.732,91	10.449.162,62	1,25	
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		3.440.697	54.549.584,27	6,55	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II- FIP		10.778,33	265.610,46	0,03	
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		395,93	5.564.816,82	0,67	
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		7.911,00	15.168.592,12	1,82	
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		2.000,00	2.046.442,90	0,25	
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		2.505,07	2.449.361,49	0,29	
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		483.979,76	339.103,80	0,04	
. HAMILTON LANE FIC FIP		4.972,50	5.135.017,61	0,62	
.STRATUS SCP BR FIP		2.357.940,00	3.275.112,64	0,39	
. P2 BR INFRAESTRUTURA III FIC DE FIP		1.098,33	1.210.473,41	0,15	
. COPA FLORESTAL III		500.000,00	371.511,81	0,04	
. MEMORIAL OFFICE FI IMOBILIARIO		10.000,00	1.038.999,92	0,12	
. ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO		39.000,00	11.428.170,00	1,37	
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		19.802,00	1.891.091,00	0,23	
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		313,78	4.279.526,81	0,51	
. VALORES A RECEBER			85.753,48	0,01	
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		12.262.339	19.156.889,31	2,30	
. BB MM SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI		5.128.757,86	8.250.160,88	0,99	
. MSQUARE GLOBAL EQUITY MANAGERS FICFIM - IE		3.342.850,69	5.769.073,44	0,69	
. VOT ALLIANZGI EUROPE FIM		3.790.730,70	5.137.654,99	0,62	
E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			18.576.408,76	2,23	
<u>E1 - Investimentos em Shopping Center</u>			18.576.408,76	2,23	
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			18.522.260,00	2,22	
. VALORES A RECEBER			54.148,76	0,01	

F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		3.235	80.987.193,93	9,72	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		3.235	79.189.318,38	9,50	
. VALORES A PAGAR (-)			-584.869,95	-0,07	
. VALORES A RECEBER			2.382.745,50	0,29	
G - OUTROS			363.848,60	0,04	
. DISPONIVEL			760.584,31	0,09	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			54.561,85	0,01	
. OUTROS REALIZAVEIS			54.561,85	0,01	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-451.297,56	-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			2.232.944,01	1,33%	0,27%
- BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP			1.692.697,54	1,01%	0,20%
- BRADESCO FI REF DI PREMIUM			4.982.976,94	2,96%	0,60%
- M. SQUARE INST. FIC FIA			19.888.929,55	11,83%	2,39%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA			14.046.466,69	8,35%	1,69%
- GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA			9.627.890,70	5,73%	1,16%
- BBM SMID CAPS FICFIA			12.750.988,64	7,58%	1,53%
- BNP PARIBAS MATCH DI FI RENDA FIXA			4.741.470,67	2,82%	0,57%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP			4.414.149,69	2,63%	0,53%
- IBIUNA EQ. FIC FIA			10.449.162,62	6,21%	1,25%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER			136.556,20	0,08%	0,02%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II			234.027,86	0,14%	0,03%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III			45.874,33	0,03%	0,01%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.			2.335.363,48	1,39%	0,28%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR			2.699.673,98	1,61%	0,32%
- BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FIM II			4.113.420,26	2,45%	0,49%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP			265.610,46	0,16%	0,03%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			5.564.816,82	3,31%	0,67%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP			15.168.592,12	9,02%	1,82%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA			2.046.442,90	1,22%	0,25%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES			2.449.361,49	1,46%	0,29%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			339.103,80	0,20%	0,04%
- HAMILTON LANE FIC FIP			5.135.017,61	3,05%	0,62%
- STRATUS SCP BR FIP			3.275.112,64	1,95%	0,39%
- P2BR INFR III FIQFIP			1.210.473,41	0,72%	0,15%
- COPA FLORESTAL III			371.511,81	0,22%	0,04%
- MEMORIAL OFFICE FI MOBILIARIO			1.054.699,92	0,63%	0,13%
- ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO			11.517.870,00	6,85%	1,38%
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO			1.907.922,70	1,13%	0,23%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			4.279.526,81	2,55%	0,51%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- BB MM SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI			8.250.160,88	4,91%	0,99%
- MSQUARE GLOBAL EQUITY MANAGERS FICFIM - IE			5.769.073,44	3,43%	0,69%
- VOT ALLIANZGI EUROPE FIM			5.137.654,99	3,06%	0,62%
TOTAL			168.135.544,96	100,00%	20,18%
GESTÃO PRÓPRIA			DISTRIBUIÇÃO	(%) EM RELAÇÃO A GESTÃO TERCEIRIZADA	(%) EM RELAÇÃO AO RECURSOS GARANTIDORES
RENDA FIXA			499.188.745,52	75,04%	59,91%
RENDA VARIÁVEL			66.076.319,44	9,93%	7,93%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			18.576.408,76	2,79%	2,23%
EMPRÉSTIMO PESSOAL			80.987.193,93	12,18%	9,72%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)			363.848,60	0,05%	0,04%
TOTAL			665.192.516,25	100,00%	79,83%

Elaborado em 20/03/2017