

**RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL
PLANO II**

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.12.2018

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.134.614.006,96		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			740.740.206,24	65,29	
<u>TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOURO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOURO NACIONAL</u>					
<u>Nota do Tesouro Nacional</u>		158.593	499.443.852,70	44,02	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			184.910.663,26	16,30	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		1.500,00	2.841.583,75	0,25	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	1	13.141.991,09	1,16	1,16
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	1	3.403.988,49	0,30	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	1	2.047.692,08	0,18	0,48
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	1.500	2.841.583,75	0,25	0,25
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-1	-13.141.991,09	-1,16	-1,16
- BANCO MORADA		-2	-5.451.680,57	-0,48	-0,48
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		191	49.041.760,75	4,32	
. BRADESCO		71	19.894.804,73	1,75	
. PARANÁ BANCO		85,00	18.010.783,26	1,59	
. ABC		35,00	11.136.172,76	0,98	
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		56.683.052,44	133.027.318,76	11,72	
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FIM II		4.999.818,18	280.739,64	0,02	0,02
. BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP		3.024.304,06	329.593,79	0,03	0,03
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		14.333.222,38	24.052.604,85	2,12	2,12
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		34.287.969,21	99.777.170,90	8,79	8,79
. BNP PARIBAS MATCH DI FI RENDA FIXA		82,69	23.101,01	0,00	0,00
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		30.166,67	4.327.792,30	0,38	0,38
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		2.474,99	75.967,91	0,01	0,01
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		3.000,00	14.155,60	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		1.976,00	4.892,48	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		19,52	2.723.565,21	0,24	0,24
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR		18,74	18,74	0,00	0,00
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		673,71	1.417.716,33	0,12	0,12
<u>Debêntures</u>		13.556	41.703.203,73	3,68	
. LOJAS AMERICANAS		288	3.393.452,36	0,30	0,30
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		700	1.258.772,06	0,11	0,11
. CEMIG		10.000	14.643.180,91	1,29	1,29
. LOCALIZA		386	4.016.342,10	0,35	0,35
. ROTA DAS BANDEIRAS		500	7.562.407,22	0,67	0,67
. SABESP		1.477	9.126.961,70	0,80	0,80
. ESPIRITO SANTO CENTRAIS ELÉTRICAS		205	1.702.087,38	0,15	0,15
. VALORES A RECEBER			3.127.765,40	0,28	
. COMANCHE PART.			3.127.765,40	0,28	0,28
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		0,00	-3.127.765,40	-0,28	
. COMANCHE PART.			-3.127.765,40	-0,28	-0,28
<u>Outros Títulos</u>		18	14.682.486,55	1,29	
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		18	4.108.235,47	0,36	0,36
. VALORES A RECEBER			30.362.882,26	2,68	2,68
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		0	-19.788.631,18	-1,74	
. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCARIO - BANIF			-19.788.631,18	-1,74	-1,74

B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			130.450.194,02	11,50
B1. Mercado de Ações			44.838.373,05	3,95
Companhias Abertas		1.449.631	32.834.972,79	2,89
. AMBEV	ON	87.539	1.346.349,82	0,12
. BRF - BRASIL FOODS	ON	64.254	1.409.090,22	0,12
. COSAN	ON	48.600	1.626.156,00	0,14
. ECORODOVIAS	ON	109.500	1.027.110,00	0,09
. GERDAU - GGBR	PN	96.424	1.429.003,68	0,13
. IGUATEMI EMP SHOP S.A	ON	59.100	2.458.560,00	0,22
. ITAUSA	ON	216,00	2.872,80	0,00
. ITAUSA	PN	360.800	4.358.464,00	0,38
. LOGG COMERCIAL	ON	5.656	101.921,12	0,01
. MRVE	ON	78.400	969.024,00	0,09
. PETROBRÁS	PN	183.377	4.158.990,36	0,37
. RENT	ON	129.969	3.866.577,75	0,34
. SUZANO PAPEL	PNA	62.200	2.368.576,00	0,21
. TOTVS	ON	34.100	925.815,00	0,08
. VALE R. DOCE	PNA	129.496	6.604.296,00	0,58
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			182.166,04	0,02
Instituições Financeiras		322.954	12.003.400,26	1,06
. BRADESCO	PN	136.893	5.290.914,45	0,47
. ITAU	PN	186.061	6.605.165,50	0,58
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			107.320,31	0,01
B2. Fundos		26.325.458,61	85.611.820,97	7,55
. M. SQUARE INST. FIC FIA		11.563.945,16	27.310.899,10	2,41
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		11.398.044,90	22.403.442,08	1,97
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.300.735,63	20.332.255,55	1,79
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	15.565.224,24	1,37
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		34.083.857,47	100.331.607,50	8,84
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II- FIP		10.778,33	-17.997,79	0,00
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		395,93	6.214.416,68	0,55
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		8.767,00	16.053.932,22	1,41
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		2.000,00	1.999.205,80	0,18
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		2.623,47	1.871.600,36	0,16
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		743.635,24	652.554,05	0,06
. HAMILTON LANE FIC FIP		6.253,11	7.764.954,73	0,68
.STRATUS SCP BR FIP		4.643.471,00	6.146.915,47	0,54
. P2 BR INFRAESTRUTURA III FIC DE FIP		2.827,79	5.355.255,79	0,47
. COPA FLORESTAL III		9.582.055,00	12.602.134,09	1,11
. MAUÁ MACRO II FIC DE FIM		9.742,48	6.977.827,93	0,61
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		3.452.736,24	6.591.737,19	0,58
. KINEA CHRONOS FIM		4.328.258,59	7.099.707,06	0,63
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		4.362.567,77	6.626.486,98	0,58
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		6.898.571,00	7.130.977,65	0,63
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		29.174,51	7.261.899,33	0,64
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		20.946.555	45.946.131,89	4,05
. BB MM SCH INV EXTE FI		5.128.757,86	11.195.383,57	0,99
. MSQUARE GL EQ FICFIM		3.342.850,69	7.834.161,24	0,69
. VOT ALLIANZGI FIM □		3.790.730,70	6.589.692,48	0,58
. WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI □		3.465,71	4.952.921,80	0,44
. GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE		46.431,13	5.159.674,58	0,45
. PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR		3.701.637,15	5.272.992,00	0,46
. ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR		4.932.681,62	4.941.306,22	0,44
E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			47.694.750,02	4,20
E1 - Investimentos em Shopping Center			21.817.366,12	1,92
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			21.766.200,00	1,92
. VALORES A RECEBER			51.166,12	0,00
E3 - Investimento Fundo Imobiliário		112.115,78	25.877.383,90	2,28
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		19.802,00	2.047.724,82	0,18
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		313,78	4.159.908,45	0,37
. GGR COVEPI RENDA FII		43.000,00	5.800.270,00	0,51
. MEMORIAL OFFICE FI IMOBILIARIO		10.000,00	874.999,93	0,08
. ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO		39.000,00	12.910.950,00	1,14
. VALORES A RECEBER			83.530,70	0,01

F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		2.931	69.557.977,13	6,13	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		2.931	67.075.265,01	5,91	
. VALORES A PAGAR (-)			-52.496,21	0,00	
. VALORES A RECEBER			2.535.208,33	0,22	
G - OUTROS			-106.859,84	-0,01	
. DISPONIVEL			229.684,18	0,02	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			54.561,85	0,00	
. OUTROS REALIZAVEIS			3.538,18	0,00	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-68.063,40	-0,01	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-326.580,65	-0,03	
GESTÃO TERCEIRIZADA			DISTRIBUIÇÃO	(%) EM RELAÇÃO A GESTÃO TERCEIRIZADA	(%) EM RELAÇÃO AO RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS					
- BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP			329.593,79	0,09%	0,03%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO			24.052.604,85	6,26%	2,12%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES			99.777.170,90	25,95%	8,79%
- M. SQUARE INST. FIC FIA			27.310.899,10	7,10%	2,41%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA			22.403.442,08	5,83%	1,97%
- BBM SMID CAPS FICFIA			20.332.255,55	5,29%	1,79%
- BNP PARIBAS MATCH DI FI RENDA FIXA			23.101,01	0,01%	0,00%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP			4.327.792,30	1,13%	0,38%
- IBIUNA EQ. FIC FIA			15.565.224,24	4,05%	1,37%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER			75.967,91	0,02%	0,01%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II			14.155,60	0,00%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III			4.892,48	0,00%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.			2.723.565,21	0,71%	0,24%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR			18,74	0,00%	0,00%
- BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FIM II			280.739,64	0,07%	0,02%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP			(17.997,79)	0,00%	0,00%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			6.214.416,68	1,62%	0,55%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP			16.053.932,22	4,18%	1,41%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA			1.999.205,80	0,52%	0,18%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES			1.871.600,36	0,49%	0,16%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			652.554,05	0,17%	0,06%
- HAMILTON LANE FIC FIP			7.764.954,73	2,02%	0,68%
- STRATUS SCP BR FIP			6.146.915,47	1,60%	0,54%
- P2BR INFR III FIQFIP			5.355.255,79	1,39%	0,47%
- COPA FLORESTAL III			12.602.134,09	3,28%	1,11%
- MAUÁ MACRO II FIC DE FIM			6.977.827,93	1,81%	0,61%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			6.591.737,19	1,71%	0,58%
- KINEA CHRONOS FIM			7.099.707,06	1,85%	0,63%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM			6.626.486,98	1,72%	0,58%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM			7.130.977,65	1,85%	0,63%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM			7.261.899,33	1,89%	0,64%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO			2.054.655,52	0,53%	0,18%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			4.159.908,45	1,08%	0,37%
- GGR COVEPI RENDA FII			5.800.270,00	1,51%	0,51%
- MEMORIAL OFFICE FI MOBILIARIO			885.299,93	0,23%	0,08%
- ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO			12.977.250,00	3,37%	1,14%
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO			83.530,70	0,02%	0,01%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- BB MM SCH INV EXTE FI			11.195.383,57	2,91%	0,99%
- MSQUARE GL EQ FICFIM			7.834.161,24	2,04%	0,69%
- VOT ALLIANZGI FIM			6.589.692,48	1,71%	0,58%
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI □			4.952.921,80	1,29%	0,44%
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE			5.159.674,58	1,34%	0,45%
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR			5.272.992,00	1,37%	0,46%
- ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR			4.941.306,22	1,29%	0,44%
TOTAL			384.518.771,21	100,00%	32,53%
GESTÃO PRÓPRIA			DISTRIBUIÇÃO	(%) EM RELAÇÃO A GESTÃO TERCEIRIZADA	(%) EM RELAÇÃO AO RECURSOS GARANTIDORES
RENDA FIXA			607.712.887,48	78,95%	53,56%
RENDA VARIÁVEL			44.838.373,05	5,82%	3,95%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			47.694.750,02	6,20%	4,20%
EMPRÉSTIMO PESSOAL			69.557.977,13	9,04%	6,13%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)			-106.859,84	-0,01%	-0,01%
TOTAL			769.697.127,84	100,00%	67,84%