

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO

CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 30.06.2013

DISCRIMINAÇÃO	Espécie Tipo	Quantidade	Valor em R\$	Alocação do patrimônio (%)	Diversificação (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.450.029.478,80		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			964.578.179,71	66,53	
<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>		162.980	448.857.888,38	30,96	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			209.074.577,03	14,42	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		20,00	126.638.161,45	8,73	
. CDB 1.826 DIAS - ABC	PÓS	5	48.516.953,72	3,35	3,35
. CDB 1827 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	931.141,89	0,06	0,06
. CDB 182 DIAS - CACIQUE	PÓS	2	50.350,70	0,00	0,00
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	4	61.591.335,20	4,25	4,25
. CDB 1826 DIAS - FIBRA	PÓS	2	18.663.687,46	1,29	1,29
. CDB 1653 DIAS - ITAÚ	PÓS	2	18.688.319,12	1,29	
. CDB 1856 DIAS - ITAÚ	PÓS	1	9.843.849,59	0,68	1,97
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.453.009,07	0,38	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.431.276,56	0,37	0,75
. CDB 1826 DIAS - SCHAHIN	PÓS	2	12.746.252,61	0,88	
. CDB 1827 DIAS - SCHAHIN	PÓS	1	871.690,46	0,06	0,94
. CDB 1827 DIAS - SOFISA	PÓS	2	4.191.782,23	0,29	0,29
. CDB 2995 DIAS - VOTORANTIM	PÓS	2	12.134.133,67	0,84	0,84
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-4	-61.591.335,20	-4,25	-4,25
- BANCO MORADA		-4	-10.884.285,63	-0,75	-0,75
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		35	14.669.499,46	1,01	
. ABC		17	7.463.968,46	0,51	0,51
. BONSUCESSO		1	633.932,56	0,04	0,04
. PINE		17	6.571.598,44	0,45	0,45
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		23.001.449,54	67.766.916,12	4,67	
. ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM		516,24	50.758,21	0,00	0,00
. BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM		714.609,35	4.604.305,44	0,32	0,32
. REAL FAQ EXTRA DI - ASSISTENCIAL		11,56	10.089,53	0,00	0,00
. METRUS SAUDE RF ANS		6.166.317,99	10.233.785,96	0,71	0,71
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS CREDITO PRIVADO FIC DE FI		4.730,15	3.593.334,01	0,25	0,25
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FI MULTIMERCADO II		450.000,00	459.084,45	0,03	0,03
. BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP		3.708.924,99	4.977.334,32	0,34	0,34
. SAFRA INSTITUCIONAL		110.354,18	22.210.501,33	1,53	1,53
. FIDC - CEEE - CIA. EST. DIST. ENERGIA ELETRICA		4.467,00	2.724.003,04	0,19	0,19
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		8.673,99	14.563,18	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		14.724,00	103.205,69	0,01	0,01
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		8.925,14	35.298,09	0,00	0,00
. FIDC - BCSUL VERAX CPP 360		11.809.150,31	13.631.729,47	0,94	0,94
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		39,04	4.501.228,83	0,31	0,31
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR		5,60	617.694,57	0,04	0,04
<u>Debêntures</u>		5.050.909	88.282.448,96	6,10	
. CEMIG		32.000	33.287.514,87	2,30	2,30
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		60	22.254.328,35	1,53	1,53
. CPFL ENERGIA		1.101	7.493.972,20	0,52	0,52
. COMANCHE PART.		5.000.000	7.048.754,00	0,49	0,49
. ELETROMETRÔ		10.248	3.163.046,50	0,22	0,22
. ECOPISTAS		7.000	8.328.636,71	0,57	0,57
. ROTA DAS BANDEIRAS		500	6.706.196,33	0,46	0,46

<u>Outros Títulos</u>		<u>25.529</u>	<u>218.363.265,34</u>	<u>15,06</u>	
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		61	16.886.842,48	1,16	1,16
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		16	27.831.788,27	1,92	1,92
. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCARIO		3	119.472.146,84	8,24	8,24
. DEPOSITO A PRAZO COM GARANTIA ESPECIAL		25.449	36.120.403,90	2,49	2,49
. VALORES A RECEBER			18.599.859,15	1,28	1,28
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS			-547.775,30	-0,04	-0,04
<u>B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL</u>			<u>251.110.710,78</u>	<u>17,32</u>	
<u>B1. Mercado de Ações</u>			<u>98.500.725,58</u>	<u>6,79</u>	
<u>Companhias Abertas</u>		<u>7.190.242</u>	<u>82.395.512,51</u>	<u>5,68</u>	
. ALL AMER LATINA	ON	313.078	2.961.717,88	0,20	
. AMBEV	PN	55.568	4.641.039,36	0,32	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	201.750	9.774.787,50	0,67	
. BR MALLS PARTICIPAÇÕES	ON	131.200	2.621.376,00	0,18	
. CEMIG	PN	91.887	1.829.470,17	0,13	
. CYRELA REALT	ON	74.100	1.136.694,00	0,08	
. ECORODOVIAS	ON	121.100	1.896.426,00	0,13	
. GAFISA	ON	346.800	998.784,00	0,07	
. GERDAU - GGBR	PN	362.078	4.565.803,58	0,31	
. HYPERMARCAS	ON	153.500	2.230.355,00	0,15	
. ISHARES BOVA	CI	26.000	1.209.000,00	0,08	
. ITAUSA	DIR	33.050	273.984,50	0,02	
. ITAUSA	PN	1.214.624	10.069.232,96	0,69	
. MARCOPOLO	PN	60.500	770.165,00	0,05	
. OGX PETRÓLEO	ON	231.300	182.727,00	0,01	
. PÃO DE AÇUCAR	PN	37.020	3.687.192,00	0,25	
. PDG REALT	ON	466.934	985.230,74	0,07	
. PETROBRÁS	PN	568.659	9.200.902,62	0,63	
. POSITIVO INF	ON	100.400	388.548,00	0,03	
. RANDON PART	PN	151.350	1.825.281,00	0,13	
. RENT	ON	70.390	2.224.324,00	0,15	
. TAIPE	ON	1.724.970	5.140.410,60	0,35	
. TOTVS	ON	37.900	1.326.121,00	0,09	
. TRACTEBEL	ON	36.900	1.279.323,00	0,09	
. V-AGRO	ON	253.216	947.027,84	0,07	
. VALE R. DOCE	PNA	286.860	7.759.563,00	0,54	
. VIVT - TELEF. BRASIL	PN	39.108	1.971.043,20	0,14	
. VALORES A RECEBER			963.121,73	0,07	
. VALORES A PAGAR			-919.547,80	-0,06	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			455.408,63	0,03	
<u>Instituições Financeiras</u>		<u>578.785</u>	<u>16.105.213,07</u>	<u>1,11</u>	
. BRADESCO	PN	274.103	7.894.166,40	0,54	
. BRASIL	ON	86.552	1.915.395,76	0,13	
. ITAU	PN	218.130	6.275.600,10	0,43	
. VALORES A PAGAR			-45.605,83	0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			65.656,64	0,00	
<u>B2. Fundos</u>		<u>35.113.180,36</u>	<u>152.609.985,20</u>	<u>10,52</u>	
. ITAU - UNIBANCO METRUS FIA		749.867,01	69.321.661,19	4,78	
. FATOR SINERGIA		15.106,00	25.252.497,63	1,74	
. RB FUNDAMENTAL INST. FIA		161.800,50	17.896.140,63	1,23	
. M. SQUARE PIPE FIA		7.000.000,00	9.236.330,39	0,64	
. M. SQUARE INST. FIC FIA		7.402.620,61	9.361.443,30	0,65	
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		10.608.288,12	10.698.645,49	0,74	
. GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA		9.175.498,12	10.843.266,57	0,75	
<u>C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS</u>		<u>426.213,51</u>	<u>66.182.279,36</u>	<u>4,56</u>	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP		10.745,39	3.789.745,82	0,26	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		7.510,64	2.701.244,59	0,19	
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.676,93	15.539.954,41	1,07	
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		2.863,00	3.265.927,48	0,23	

. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA	2.650,00	2.758.522,79	0,19
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES	970,00	868.239,76	0,06
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE	250.000,00	196.958,37	0,01
. HAMILTON LANE FIC FIP	1.250,00	1.228.514,29	0,08
. MEMORIAL OFFICE FI IMOBILIARIO	10.000,00	1.539.499,88	0,11
. ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO	39.000,00	14.820.000,00	1,02
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO	99.010,00	13.694.073,10	0,94
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	537,55	5.566.469,27	0,38
. VALORES A RECEBER		213.129,60	0,01
D-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS		79.656.409,95	5,49
D1 - Investimentos em Shopping Center		68.224.617,20	4,71
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ		20.356.085,44	1,40
. SHOPPING PLAZA SUL		26.873.475,91	1,85
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA		20.465.984,05	1,41
. VALORES A RECEBER		529.071,80	0,04
D2 - Investimento Imobiliário		11.431.792,75	0,79
. PANAMBY		12.144.487,33	0,84
. VALORES A PAGAR (-)		-712.694,58	-0,05
E - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES	4.546	86.610.031,66	5,97
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	4.546	86.700.551,91	5,98
. VALORES A PAGAR (-)		-257.667,57	-0,02
. VALORES A RECEBER		167.147,32	0,01
F - OUTROS		1.891.867,34	0,13
. DISPONIVEL		3.003.963,48	0,21
. DEPOSITOS JUDICIAIS		743.520,75	0,05
. OUTROS REALIZAVEIS		390.223,00	0,03
. OUTRAS EXIGIBILIDADES		-1.364.885,41	-0,09
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL		-880.954,48	-0,06

GESTÃO TERCEIRIZADA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Terceirizada	(%) em relação ao Recursos Garantidores
CARTEIRA			
- ITAU - UNIBANCO METRUS FIA	69.321.661,19	24,19%	4,78%
FUNDOS			
- ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM	50.758,21	0,02%	0,00%
- FUNDO FATOR SINERGIA	25.252.497,63	8,81%	1,74%
- RB.FUNDAMENTAL INST. FIA	17.896.140,63	6,25%	1,23%
- BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP	4.977.334,32	1,74%	0,34%
- SAFRA INSTITUCIONAL	22.210.501,33	7,75%	1,53%
- M. SQUARE PIPE FIA	9.236.330,39	3,22%	0,64%
- M. SQUARE INST. FIC FIA	9.361.443,30	3,27%	0,65%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	10.698.645,49	3,73%	0,74%
- GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA	10.843.266,57	3,78%	0,75%
- FIDC - CEEE - CIA. EST. DIST. ENERGIA ELETRICA	2.724.003,04	0,95%	0,19%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	14.563,18	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	103.205,69	0,04%	0,01%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	35.298,09	0,01%	0,00%
- FIDC - BCSUL VERAX CPP 360	13.631.729,47	4,76%	0,94%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.	4.501.228,83	1,57%	0,31%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR	617.694,57	0,22%	0,04%
- BRZ MULTIRECEBIVEIS CP FIC DE FI	3.593.334,01	1,25%	0,25%
- BRZ MULTIRECEBIVEIS FIC FI MULTIMERCADO II	459.084,45	0,16%	0,03%
- REAL FAQ EXTRA DI - ASSISTENCIAL	10.089,53	0,00%	0,00%
- BRADESCO DED. SAUDE ANS	10.233.785,96	3,57%	0,71%
- BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	4.604.305,44	1,61%	0,32%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP	3.789.745,82	1,32%	0,26%
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP	2.701.244,59	0,94%	0,19%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	15.539.954,41	5,42%	1,07%

- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP	3.265.927,48	1,14%	0,23%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA	2.758.522,79	0,96%	0,19%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES	868.239,76	0,30%	0,06%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE	196.958,37	0,07%	0,01%
- HAMILTON LANE FIC FIP	1.228.514,29	0,43%	0,08%
- MEMORIAL OFFICE FI MOBILIARIO	1.551.499,88	0,54%	0,11%
- ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO	14.926.080,00	5,21%	1,03%
- BTG PACTUAL CORPOTATE OFFICE FI IMOBILIARIO	13.789.122,70	4,81%	0,95%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	5.566.469,27	1,94%	0,38%
TOTAL	286.559.180,68	100,00%	19,76%
GESTÃO PRÓPRIA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Própria	(%) em relação ao Recursos Garantidores
RENDA FIXA	896.811.263,59	77,08%	61,86%
RENDA VARIÁVEL	98.500.725,58	8,47%	6,79%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	79.656.409,95	6,85%	5,49%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	86.610.031,66	7,44%	5,97%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	1.891.867,34	0,16%	0,13%
TOTAL	1.163.470.298,12	100,00%	80,24%