

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO

CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 30.06.2014					
DISCRIMINAÇÃO	Espécie Tipo	Quantidade	Valor em R\$	Alocação do patrimônio (%)	Diversificação (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.634.643.953,65		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			1.038.884.223,71	63,56	
<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>		204.762	548.922.094,40	33,58	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			231.450.820,46	14,16	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		14,00	94.110.573,97	5,76	
. CDB 1827 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	1.073.186,58	0,07	0,07
. CDB 182 DIAS - CACIQUE	PÓS	2	55.080,65	0,00	0,00
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	4	61.591.335,20	3,77	3,77
. CDB 1826 DIAS - FIBRA	PÓS	2	21.566.378,67	1,32	1,32
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.453.009,07	0,33	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.431.276,56	0,33	0,67
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	2	5.610.518,70	0,34	0,34
. CDB 1826 DIAS - SCHAHIN	PÓS	2	14.881.587,63	0,91	
. CDB 1827 DIAS - SCHAHIN	PÓS	1	1.012.080,41	0,06	0,97
. CDB 1827 DIAS - SOFISA	PÓS	2	4.837.957,67	0,30	0,30
. CDB 2995 DIAS - VOTORANTIM	PÓS	2	13.956.292,31	0,85	0,85
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-4	-30.473.843,85	-1,86	-1,86
- BANCO MORADA		-4	-10.884.285,63	-0,67	-0,67
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		46	39.107.036,05	2,39	
. ABC		18	20.013.598,76	1,22	1,22
. BONSUCESSO		1	731.603,21	0,04	0,04
. PINE		17	7.060.372,68	0,43	0,43
. BRADESCO		10	5.571.735,71	0,34	0,34
. BANCO BTG PACTUAL		1	5.729.725,69	0,35	0,35
. SAFRA		4	1.713.780,21	0,10	0,10
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		36.029.080,96	98.233.210,44	6,01	
. ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM		516,24	55.709,37	0,00	0,00
. BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM		1.429.207,52	10.113.752,46	0,62	0,62
. REAL FAQ EXTRA DI - ASSISTENCIAL		11,56	10.627,81	0,00	0,00
. METRUS SAUDE RF ANS		6.705.879,86	12.161.858,13	0,74	0,74
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS CREDITO PRIVADO FIC DE FI		4.730,16	2.160.984,71	0,13	0,13
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FI MULTIMERCADO II		12.206.454,54	15.917.762,40	0,97	0,97
. BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP		3.708.925,00	4.908.369,47	0,30	0,30
. SAFRA INSTITUCIONAL		127.353,02	28.120.130,70	1,72	1,72
. FIDC - CEEE - CIA. EST. DIST. ENERGIA ELETRICA		4.467,00	1.443.044,39	0,09	0,09
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		8.673,97	233.485,79	0,01	0,01
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		14.724,00	221.316,37	0,01	0,01
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		8.925,14	349.764,45	0,02	0,02
. FIDC - BCSUL VERAX CPP 360		11.809.150,31	15.484.359,71	0,95	0,95
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		39,04	4.084.282,90	0,25	0,25
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR		23,62	2.967.761,78	0,18	0,18
<u>Debêntures</u>		5.053.221	82.404.822,92	5,05	
. CEMIG		32.000	35.398.178,26	2,17	2,17
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		60	14.634.085,07	0,90	0,90
. COMANCHE PART.		5.000.000	8.618.072,90	0,53	0,53
. ELETROMETRÔ		10.248	666.453,35	0,04	0,04

. ECOPISTAS		7.000	8.563.315,78	0,52	0,52
. RODOVIAS DO TIETÊ		3.000	3.206.952,47	0,20	0,20
. ROTA DAS BANDEIRAS		500	7.051.358,66	0,43	0,43
. SABESP		413	4.254.130,43	0,26	0,26
. VALORES A RECEBER			12.276,00	0,00	0,00
<u>Outros Títulos</u>		<u>20.521</u>	<u>176.106.485,93</u>	<u>10,77</u>	
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		61	15.143.866,60	0,93	0,93
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	14.577.271,90	0,89	0,89
. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCARIO		3	120.094.718,16	7,35	7,35
. DEPOSITO A PRAZO COM GARANTIA ESPECIAL		20.450	30.771.787,75	1,88	1,88
. VALORES A RECEBER			32.728.894,11	2,00	2,00
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS			-37.210.052,59	-2,28	-2,28
B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			<u>256.907.792,12</u>	<u>15,72</u>	
<u>B1. Mercado de Ações</u>			<u>97.223.556,47</u>	<u>5,95</u>	
<u>Companhias Abertas</u>		<u>6.266.688</u>	<u>78.279.486,26</u>	<u>4,79</u>	
. ALL AMER LATINA	ON	4.478	37.301,74	0,00	
. AMBEV	ON	341.640	5.384.246,40	0,33	
. AMBEV	DIR	248	3.908,48	0,00	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	183.250	9.785.550,00	0,60	
. BR MALLS PARTICIPAÇÕES	ON	105.500	1.983.400,00	0,12	
. CEMIG	PN	87.506	1.412.346,84	0,09	
. CYRELA REALT	ON	1.100	15.202,00	0,00	
. ECORODOVIAS	ON	250.400	3.791.056,00	0,23	
. GAFISA	ON	7.200	24.264,00	0,00	
. GERDAU - GGBR	PN	465.478	6.023.285,32	0,37	
. HYPERMARCAS	ON	2.300	44.275,00	0,00	
. ISHARES BOVA	CI	56.000	2.894.640,00	0,18	
. ITAUSA	PN	1.269.394	11.050.595,05	0,68	
. MARCOPOLO	PN	232.700	998.283,00	0,06	
. PÃO DE AÇUCAR	PN	38.420	3.956.875,80	0,24	
. PDG REALT	ON	9.634	14.065,64	0,00	
. PETROBRÁS	PN	265.559	4.591.515,11	0,28	
. POSITIVO INF	ON	2.400	5.184,00	0,00	
. RANDON PART	PN	293.937	1.810.651,92	0,11	
. RENT	ON	83.790	3.053.307,60	0,19	
. TAIPE	ON	1.724.970	5.140.410,60	0,31	
. TOTVS	ON	62.000	2.356.000,00	0,14	
. TRACTEBEL	ON	27.900	920.700,00	0,06	
. V-AGRO	ON	301.816	860.175,60	0,05	
. VALE R. DOCE	PNA	448.460	11.816.921,00	0,72	
. VIVT - TELEF. BRASIL	PN	608	27.360,00	0,00	
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00	
. VALORES A PAGAR				0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			277.965,16	0,02	
<u>Instituições Financeiras</u>		<u>607.578</u>	<u>18.944.070,21</u>	<u>1,16</u>	
. BRADESCO	PN	300.203	9.621.506,15	0,59	
. BRASIL	ON	80.852	2.009.172,20	0,12	
. ITAU	PN	226.523	7.241.940,31	0,44	
. VALORES A PAGAR				0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			71.451,55	0,00	
<u>B2. Fundos</u>		<u>66.665.534,61</u>	<u>159.684.235,65</u>	<u>9,77</u>	
. ITAU - UNIBANCO METRUS FIA		4.245,56	423.786,62	0,03	
. FATOR SINERGIA IV FIA		15.106,00	21.776.557,82	1,33	
. FATOR SINERGIA V FIA		4.122,00	3.779.086,10	0,23	
. RB FUNDAMENTAL INST. FIA		208.932,52	24.114.188,17	1,48	
. M. SQUARE INST. FIC FIA		17.382.038,42	25.395.820,73	1,55	
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		21.212.891,85	23.078.724,79	1,41	
. GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA		13.424.087,67	20.287.966,76	1,24	
. BTG PACTUAL DIVIDENDOS FICFIA		8.831.568,62	21.427.448,52	1,31	
. BBM SMID CAPS FICFIA		5.582.541,99	19.400.656,14	1,19	

C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		10.953.647,78	125.055.488,18	7,65
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP		10.744,82	1.482.468,98	0,09
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.255,80	3.353.679,50	0,21
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.676,92	18.073.494,78	1,11
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		5.577,00	8.772.034,68	0,54
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		3.185,71	3.531.952,23	0,22
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		2.662,32	2.412.460,73	0,15
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		548.766,67	388.852,60	0,02
. HAMILTON LANE FIC FIP		6.849,77	6.254.647,74	0,38
. MULTINER FIP		9,36	14.232.461,42	0,87
.STRATUS SCP BR FIP		1.745.542,80	3.575.963,28	0,22
. MEMORIAL OFFICE FI IMOBILIARIO		10.000,00	1.199.999,91	0,07
. ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO		39.000,00	14.001.000,00	0,86
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		99.010,00	12.142.586,40	0,74
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		758,05	8.636.632,85	0,53
. VALORES A RECEBER			215.250,10	0,01
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			13.391.001,49	0,82
. BB MM SCH INV EXTE FI		5.128.757,86	8.227.392,62	0,50
. MSQUARE GL EQ FICFIM		3.342.850,69	5.163.608,87	0,32
D-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			93.749.421,43	5,74
D1 - Investimentos em Shopping Center			82.317.628,68	5,04
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			25.888.858,06	1,58
. SHOPPING PLAZA SUL			31.970.738,41	1,96
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			24.001.695,09	1,47
. VALORES A RECEBER			456.337,12	0,03
D2 - Investimento Imobiliário			11.431.792,75	0,70
. PANAMBY			12.144.487,33	0,74
. VALORES A PAGAR (-)			-712.694,58	-0,04
E - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		5,172	100.346.115,62	6,14
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		5,172	100.385.298,41	6,14
. VALORES A PAGAR (-)			-164.052,79	-0,01
. VALORES A RECEBER			124.870,00	0,01
F - OUTROS			6.309.911,10	0,39
. DISPONIVEL			7.712.353,05	0,47
. DEPOSITOS JUDICIAIS			744.486,45	0,05
. OUTROS REALIZAVEIS			390.367,52	0,02
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-1.656.341,44	-0,10
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-880.954,48	-0,05

GESTÃO TERCEIRIZADA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Terceirizada	(%) em relação ao Recursos Garantidores
CARTEIRA			
- ITAU - UNIBANCO METRUS FIA	423.786,62	0,13%	0,03%
FUNDOS			
- ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM	55.709,37	0,02%	0,00%
- FUNDO FATOR SINERGIA IV	21.776.557,82	6,69%	1,33%
- FUNDO FATOR SINERGIA V	3.779.086,10	1,16%	0,23%
- RB.FUNDAMENTAL INST. FIA	24.114.188,17	7,41%	1,48%
- BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP	4.908.369,47	1,51%	0,30%
- SAFRA INSTITUCIONAL	28.120.130,70	8,64%	1,72%
- M. SQUARE PIPE FIA	-	0,00%	0,00%
- M. SQUARE INST. FIC FIA	25.395.820,73	7,80%	1,55%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	23.078.724,79	7,09%	1,41%
- GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA	20.287.966,76	6,23%	1,24%

- BTG PACTUAL DIVIDENDOS FICFIA	21.427.448,52	6,59%	1,31%
- FIDC - CEEE - CIA. EST. DIST. ENERGIA ELETRICA	1.443.044,39	0,44%	0,09%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	233.485,79	0,07%	0,01%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	221.316,37	0,07%	0,01%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	349.764,45	0,11%	0,02%
- FIDC - BCSUL VERAX CPP 360	15.484.359,71	4,76%	0,95%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.	4.084.282,90	1,26%	0,25%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR	2.967.761,78	0,91%	0,18%
- BRZ MULTIRECEBIVEIS CP FIC DE FI	2.160.984,71	0,66%	0,13%
- BRZ MULTIRECEBIVEIS FIC FI MULTIMERCADO II	15.917.762,40	4,89%	0,97%
- REAL FAQ EXTRA DI - ASSISTENCIAL	10.627,81	0,00%	0,00%
- BRADESCO DED. SAUDE ANS	12.161.858,13	3,74%	0,74%
- BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	10.113.752,46	3,11%	0,62%
- BBM SMID CAPS FICFIA	2.841.688,21	0,87%	0,17%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP	1.482.468,98	0,46%	0,09%
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP	3.353.679,50	1,03%	0,21%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	18.073.494,78	5,55%	1,11%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP	8.772.034,68	2,70%	0,54%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA	3.531.952,23	1,09%	0,22%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES	2.412.460,73	0,74%	0,15%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE	388.852,60	0,12%	0,02%
- HAMILTON LANE FIC FIP	6.254.647,74	1,92%	0,38%
- STRATUS SCP BR FIP	3.575.963,28	1,10%	0,22%
- MEMORIAL OFFICE FI MOBILIARIO	1.206.999,91	0,37%	0,07%
- ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO	14.112.150,00	4,34%	0,86%
- BTG PACTUAL CORPOTATE OFFICE FI IMOBILIARIO	12.237.636,00	3,76%	0,75%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	8.636.632,85	2,65%	0,53%
TOTAL	325.397.451,44	100,00%	19,91%
GESTÃO PRÓPRIA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Própria	(%) em relação ao Recursos Garantidores
RENTA FIXA	940.651.013,27	75,96%	57,55%
RENTA VARIÁVEL	97.223.556,47	7,85%	5,95%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	93.749.421,43	7,57%	5,74%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	100.346.115,62	8,10%	6,14%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	6.309.911,10	0,51%	0,39%
TOTAL	1.238.280.017,89	100,00%	75,75%