

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL

PLANO I

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 30.06.2014

DISCRIMINAÇÃO	Espécie Tipo	Quantidade	Valor em R\$	Alocação do patrimônio (%)	Diversificação (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			939.068.607,87		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			640.938.458,34	68,25	
<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>		130.771	366.253.852,99	39,00	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			106.456.407,49	11,34	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		4,00	45.741.046,79	4,87	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	2	33.473.833,57	3,56	3,56
. CDB 1826 DIAS - FIBRA	PÓS	1	13.271.617,64	1,41	1,41
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	1	2.049.020,58	0,22	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	1	3.383.584,48	0,36	0,58
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	1	3.927.363,09	0,42	0,42
. CDB 2995 DIAS - VOTORANTIM	PÓS	1	11.630.243,59	1,24	1,24
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-2	-16.562.011,10	-1,76	-1,76
- BANCO MORADA		-2	-5.432.605,06	-0,58	-0,58
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		41	32.019.541,83	3,41	
. PINE		16	6.285.303,68	0,67	0,67
. ABC		18	14.390.517,25	1,53	1,53
. BRADESCO		7	3.900.215,00	0,42	0,42
. BANCO BTG PACTUAL		1	5.729.725,69	0,61	0,61
. SAFRA		4	1.713.780,21	0,18	0,18
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		14.978.226,78	28.695.818,87	3,06	
. ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM		516,24	55.709,37	0,01	0,01
. SAFRA INSTITUCIONAL		37.440,05	8.266.935,62	0,88	0,88
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FIM II		9.999.636,36	10.611.841,60	1,13	1,13
. FIDC - CEEE - CIA. EST. DIST. ENERGIA ELETRICA		3.467,00	1.119.998,85	0,12	0,12
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		4.713,99	126.890,93	0,01	0,01
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		7.000,00	105.216,95	0,01	0,01
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		4.958,18	194.304,59	0,02	0,02
. FIDC - BCSUL VERAX CPP 360		4.920.479,29	6.451.816,55	0,69	0,69
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		9,76	1.021.163,97	0,11	0,11
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR		5,90	741.940,44	0,08	0,08
<u>Debêntures</u>		2.536.479	47.756.559,31	5,09	
. ELETROMETRÔ		7.174	466.543,36	0,05	0,05
. ECOPISTAS		7.000	8.563.315,78	0,91	0,91
. COMANCHE PART.		2.500.000	4.309.036,45	0,46	0,46
. CEMIG		20.000	22.123.861,42	2,36	2,36
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		30	7.317.042,56	0,78	0,78
. RODOVIAS DO TIETÊ		2.000	2.137.968,30	0,23	0,23
. SABESP		275	2.832.653,44	0,30	0,30
. VALORES A RECEBER			6.138,00	0,00	0,00
<u>Outros Títulos</u>		19.046	120.471.638,55	12,83	
. CERTIFICADO DE RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS		36	8.942.033,10	0,95	0,95
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	14.577.271,90	1,55	1,55
. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCARIO		1	72.784.619,53	7,75	7,75
. DEPOSITO A PRAZO COM GARANTIA ESPECIAL		19.000	28.648.872,50	3,05	3,05
. VALORES A RECEBER		4	20.513.295,65	2,18	2,18
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		-2,00	-24.994.454,13	-2,66	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO - ALOÉS		-1	-6.239.632,79	-0,66	-0,66
. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCARIO - BANIF		-1	-18.754.821,34	-2,00	-2,00

B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			128.731.229,29	13,71
B1. Mercado de Ações			50.986.658,94	5,43
Companhias Abertas		3.997.132	41.620.379,99	4,43
. ALL AMER LATINA	ON	66	549,78	0,00
. AMBEV	ON	169.520	2.671.635,20	0,28
. AMBEV DIR	DIR	248	3.908,48	0,00
. BRF - BRASIL FOODS	ON	91.624	4.892.721,60	0,52
. BR MALLS PARTICIPAÇÕES	ON	51.900	975.720,00	0,10
. CEMIG	PN	42.452	685.175,28	0,07
. ECORODOVIAS	ON	132.000	1.998.480,00	0,21
. GERDAU - GGBR	PN	232.464	3.008.084,16	0,32
. ITAUSA	PN	625.578	5.436.272,82	0,58
. MARCOPOLO	PN	121.400	520.806,00	0,06
. MILLS	ON	51.600	1.337.988,00	0,14
. PÃO DE AÇUCAR	PN	20.539	2.115.311,61	0,23
. PDG REALT	ON	92	134,32	0,00
. PETROBRÁS	PN	129.017	2.230.703,93	0,24
. RANDON PART	PN	133.600	822.976,00	0,09
. RENT	ON	41.985	1.529.933,40	0,16
. TAIPE	ON	1.724.970	5.140.410,60	0,55
. TOTVS	ON	31.500	1.197.000,00	0,13
. TRACTEBEL	ON	14.200	468.600,00	0,05
. V-AGRO	ON	154.781	441.125,85	0,05
. VALE R. DOCE	PNA	227.527	5.995.336,45	0,64
. VIVT - TELEF. BRASIL	PN	69	3.105,00	0,00
. VALORES A RECEBER				0,00
. VALORES A PAGAR				0,00
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			144.401,51	0,02
Instituições Financeiras		300.314	9.366.278,95	1,00
. BRADESCO	PN	149.523	4.792.212,15	0,51
. BRASIL	ON	39.647	985.227,95	0,10
. ITAU	PN	111.144	3.553.273,68	0,38
. VALORES A PAGAR				0,00
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			35.565,17	0,00
B2. Fundos		36.076.878,29	77.744.570,35	8,28
. ITAU - UNIBANCO METRUS FIA		1.643,31	164.033,46	0,02
. FATOR SINERGIA IV		6.744,90	9.723.330,50	1,04
. FATOR SINERGIA V		1.154,00	1.057.997,42	0,11
. RB FUNDAMENTAL INST. FIA		98.255,80	11.340.306,46	1,21
. M. SQUARE INST. FIC FIA		8.834.914,97	12.908.147,56	1,37
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		10.743.477,78	11.688.447,23	1,24
. GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA		9.121.176,41	10.349.610,79	1,10
. BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIQ FIA		4.528.657,36	10.987.580,64	1,17
. BBM SMID CAPS FICFIA		2.740.853,78	9.525.116,29	1,01
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		2.170.563,88	56.325.696,63	6,00
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.255,80	3.353.679,50	0,36
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.280,99	13.806.252,27	1,47
. FIP BVEP PLAZA		1.911,43	2.119.171,34	0,23
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		1.863,62	1.688.722,51	0,18
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		329.260,00	233.311,56	0,02
. HAMILTON LANE FIC FIP		4.520,85	4.128.067,51	0,44
. MULTINER FIP		9,36	14.232.461,42	1,52
. STRATUS SCP BR FIP		1.743.799,00	1.787.981,64	0,19
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		79.208,00	9.714.069,12	1,03
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		454,83	5.181.979,68	0,55
. VALORES A RECEBER			80.000,08	0,01
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		3.769.975,66	4.124.738,54	0,44
. BB MM SCH INV EXTE FI		2.333.433,18	2.572.712,33	0,27
. MSQUARE GL EQ FICFIM		1.436.542,47	1.552.026,21	0,17

E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			69.744.669,47	7,43	
E1 - Investimentos em Shopping Center			58.312.876,72	6,21	
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			25.888.858,06	2,76	
. SHOPPING PLAZA SUL			31.970.738,41	3,40	
. VALORES A RECEBER			453.280,25	0,05	
E2 - Investimento Imobiliário			11.431.792,75	1,22	
. PANAMBY			12.144.487,33	1,29	
. VALORES A PAGAR (-)			-712.694,58	-0,08	
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		2,086	37.701.405,92	4,01	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		2,086	37.836.123,46	4,03	
. VALORES A PAGAR (-)			-134.758,09	-0,01	
. VALORES A RECEBER			40,55	0,00	
G - OUTROS			1.502.409,68	0,16	
. DISPONIVEL			2.251.134,23	0,24	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			333.512,07	0,04	
. OUTROS REALIZAVEIS			334.159,94	0,04	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-1.082.884,49	-0,12	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-333.512,07	-0,04	

GESTÃO TERCEIRIZADA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Terceirizada	(%) em relação ao Recursos Garantidores
CARTEIRA			
- ITAU - UNIBANCO METRUS FIA	164.033,46	0,10%	0,02%
FUNDOS			
- ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM	55.709,37	0,03%	0,01%
- FUNDO FATOR SINERGIA IV	9.723.330,50	5,83%	1,04%
- FUNDO FATOR SINERGIA V	1.057.997,42	0,63%	0,11%
- RB.FUNDAMENTAL INST. FIA	11.340.306,46	6,80%	1,21%
- SAFRA INSTITUCIONAL	8.266.935,62	4,95%	0,88%
- M. SQUARE INST. FIC FIA	12.908.147,56	7,73%	1,37%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	11.688.447,23	7,00%	1,24%
- GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA	10.349.610,79	6,20%	1,10%
- BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIQ FIA	10.987.580,64	6,58%	1,17%
- BBM SMID CAPS FICFIA	9.525.116,29	5,71%	1,01%
- FIDC - CEEE - CIA. EST. DIST. ENERGIA ELETRICA	1.119.998,85	0,67%	0,12%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	126.890,93	0,08%	0,01%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	105.216,95	0,06%	0,01%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	194.304,59	0,12%	0,02%
- FIDC - BCSUL VERAX CPP 360	6.451.816,55	3,87%	0,69%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.	1.021.163,97	0,61%	0,11%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR	741.940,44	0,44%	0,08%
- BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FIM II	10.611.841,60	6,36%	1,13%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP	3.353.679,50	2,01%	0,36%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	13.806.252,27	8,27%	1,47%
- FIP BVPE PLAZA	2.119.171,34	1,27%	0,23%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES	1.688.722,51	1,01%	0,18%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE	233.311,56	0,14%	0,02%
- HAMILTON LANE FIC FIP	4.128.067,51	2,47%	0,44%
- MULTINER FIP	14.232.461,42	8,53%	1,52%
- STRATUS SCP BR FIP	1.787.981,64	1,07%	0,19%
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO	9.794.069,20	5,87%	1,04%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	5.181.979,68	3,11%	0,55%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			
- BB MM SCH INV EXTE FI	2.572.712,33	1,54%	0,27%
- MSQUARE GL EQ FICFIM	1.552.026,21	0,93%	0,17%
TOTAL	166.890.824,39	100,00%	17,77%

GESTÃO PRÓPRIA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Própria	(%) em relação ao Recursos Garantidores
RENTA FIXA	612.242.639,47	79,29%	65,20%
RENTA VARIÁVEL	50.986.658,94	6,60%	5,43%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	69.744.669,47	9,03%	7,43%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	37.701.405,92	4,88%	4,01%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	1.502.409,68	0,19%	0,16%
TOTAL	772.177.783,48	100,00%	82,23%