

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL

PLANO II

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 30.06.2014

DISCRIMINAÇÃO	Espécie Tipo	Quantidade	Valor em R\$	Alocação do patrimônio (%)	Diversificação (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			565.674.949,35		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			302.888.194,75	53,54	
<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>		68.013	168.894.521,39	29,86	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			77.459.088,43	13,69	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		7,00	41.186.983,91	7,28	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	1	18.137.405,30	3,21	3,21
. CDB 1826 DIAS - FIBRA	PÓS	1	8.294.761,03	1,47	1,47
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	1	3.403.988,49	0,60	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	1	2.047.692,08	0,36	0,96
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	1	1.683.155,61	0,30	0,30
. CDB 1826 DIAS - SCHAHIN	PÓS	2	14.881.587,63	2,63	2,63
. CDB 1827 DIAS - SOFISA	PÓS	2	4.837.957,67	0,86	0,86
. CDB 2995 DIAS - VOTORANTIM	PÓS	1	2.326.048,72	0,41	0,41
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-1	-8.973.932,05	-1,59	-1,59
- BANCO MORADA		-2	-5.451.680,57	-0,96	-0,96
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		3	1.671.520,71	0,30	
. BRADESCO		3	1.671.520,71	0,30	
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		6.309.520,61	34.600.583,81	6,12	
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS CREDITO PRIVADO FIC DE FI		4.730,16	2.160.984,71	0,38	0,38
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FIM II		2.206.818,18	5.305.920,80	0,94	0,94
. BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP		3.024.304,06	4.002.346,15	0,71	0,71
. SAFRA INSTITUCIONAL		82.090,04	18.125.857,05	3,20	3,20
. FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER		2.474,99	66.621,78	0,01	0,01
. FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER II		3.000,00	45.092,98	0,01	0,01
. FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER III		1.976,00	77.436,86	0,01	0,01
. FIDC - BCSUL VERAX CPP 360		984.095,86	1.290.363,31	0,23	0,23
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		19,52	2.042.079,28	0,36	0,36
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR		11,81	1.483.880,89	0,26	0,26
<u>Debêntures</u>		1.714.734	29.103.810,29	5,14	
. ELETROMETRÔ		3.074	199.909,99	0,04	0,04
. COMANCHE PART.		1.700.000	2.930.144,79	0,52	0,52
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		22	5.365.831,15	0,95	0,95
. CEMIG		10.000	11.061.930,70	1,96	1,96
. RODOVIAS DO TIETÊ		1.000	1.068.984,17	0,19	0,19
. ROTA DAS BANDEIRAS		500	7.051.358,66	1,25	1,25
. SABESP		138	1.421.476,99	0,25	0,25
. VALORES A RECEBER			4.173,84	0,00	0,00
<u>Outros Títulos</u>		26	27.430.774,64	4,85	
. CERTIFICADO DE RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS		25	6.201.833,50	1,10	1,10
. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCARIO		1	21.228.941,14	3,75	3,75
. VALORES A RECEBER		1	5.482.727,39	0,97	0,97
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		-1	-5.482.727,39	-0,97	
. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCARIO - BANIF		-1	-5.482.727,39	-0,97	-0,97

B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			121.352.397,86	21,45
B1. Mercado de Ações			44.522.109,07	7,87
Companhias Abertas		2.226.504	35.227.994,07	6,23
. ALL AMER LATINA	ON	85	708,05	0,00
. AMBEV	ON	167.795	2.644.449,20	0,47
. AMBEV DIR	DIR	244	3.845,44	0,00
. BRF - BRASIL FOODS	ON	89.054	4.755.483,60	0,84
. BR MALLS PARTICIPAÇÕES	ON	51.600	970.080,00	0,17
. CEMIG	PN	43.385	700.233,90	0,12
. ECORODOVIAS	ON	116.700	1.766.838,00	0,31
. GERDAU - GGBR	PN	227.924	2.949.336,56	0,52
. ITAUSA	PN	624.681	5.428.477,89	0,96
. MARCOPOLO	PN	109.700	470.613,00	0,08
. MILLS	ON	48.400	1.255.012,00	0,22
. PÃO DE AÇUCAR	PN	17.374	1.789.348,26	0,32
. PDG REALT	ON	54	78,84	0,00
. PETROBRÁS	PN	127.677	2.207.535,33	0,39
. RANDON PART	PN	157.775	971.894,00	0,17
. RENT	ON	40.760	1.485.294,40	0,26
. TOTVS	ON	29.900	1.136.200,00	0,20
. TRACTEBEL	ON	13.200	435.600,00	0,08
. V-AGRO	ON	143.340	408.519,00	0,07
. VALE R. DOCE	PNA	216.817	5.713.127,95	1,01
. VIVT - TELEF. BRASIL	PN	39	1.755,00	0,00
. VALORES A RECEBER				0,00
. VALORES A PAGAR				0,00
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			133.563,65	0,02
Instituições Financeiras		298.150	9.294.115,00	1,64
. BRADESCO	PN	146.255	4.687.472,75	0,83
. BRASIL	ON	39.926	992.161,10	0,18
. ITAU	PN	111.969	3.579.648,93	0,63
. VALORES A PAGAR				0,00
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			34.832,22	0,01
B2. Fundos		35.029.692,82	76.830.288,79	13,58
. ITAU - UNIBANCO METRUS FIA		1.650,73	164.774,04	0,03
. FATOR SINERGIA IV		5.784,10	8.338.266,27	1,47
. FATOR SINERGIA V		2.968,00	2.721.088,68	0,48
. RB FUNDAMENTAL INST. FIA		99.418,02	11.474.445,37	2,03
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		10.469.414,07	11.390.277,56	2,01
. GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA		8.758.734,98	9.938.355,97	1,76
. BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIQ FIA		4.302.911,26	10.439.867,88	1,85
. BBM SMID CAPS FICFIA		2.841.688,21	9.875.539,85	1,75
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		311.475,34	41.947.788,57	7,42
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II- FIP		10.744,82	1.482.468,98	0,26
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		395,93	4.267.242,51	0,75
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		5.577,00	8.772.034,68	1,55
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		1.274,29	1.412.780,89	0,25
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		798,70	723.738,22	0,13
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		219.506,67	155.541,04	0,03
. HAMILTON LANE FIC FIP		2.328,92	2.126.580,23	0,38
.STRATUS SCP BR FIP		1.743,80	1.787.981,64	0,32
. MEMORIAL OFFICE FI IMOBILIARIO		10.000,00	1.199.999,91	0,21
. ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO		39.000,00	14.001.000,00	2,48
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		19.802,00	2.428.517,28	0,43
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		303,22	3.454.653,17	0,61
. VALORES A RECEBER			135.250,02	0,02
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			9.266.262,95	1,64
. BB MM SCH INV EXTE FI		5.128.757,86	5.654.680,29	1,00
. MSQUARE GL EQ FICFIM		3.342.850,69	3.611.582,66	0,64

E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			24.004.751,96	4,24	
E1 - Investimentos em Shopping Center			24.004.751,96	4,24	
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			24.001.695,09	4,24	
. VALORES A RECEBER			3.056,87	0,00	
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		3.086	62.644.709,70	11,07	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		3.086	62.549.174,95	11,06	
. VALORES A PAGAR (-)			-29.294,70	-0,01	
. VALORES A RECEBER			124.829,45	0,02	
G - OUTROS			3.570.843,56	0,63	
. DISPONIVEL			3.700.019,01	0,65	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			54.561,85	0,01	
. OUTROS REALIZAVEIS			56.207,58	0,01	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-185.383,03	-0,03	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-54.561,85	-0,01	

GESTÃO TERCEIRIZADA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Terceirizada	(%) em relação ao Recursos Garantidores
CARTEIRA			
- ITAU - UNIBANCO METRUS FIA	164.774,04	0,10%	0,03%
FUNDOS			
- FUNDO FATOR SINERGIA IV	8.338.266,27	5,13%	1,47%
- FUNDO FATOR SINERGIA V	2.721.088,68	1,67%	0,48%
- RB.FUNDAMENTAL INST. FIA	11.474.445,37	7,05%	2,03%
- BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP	4.002.346,15	2,46%	0,71%
- SAFRA INSTITUCIONAL	18.125.857,05	11,14%	3,20%
- M. SQUARE PIPE FIA	-	0,00%	0,00%
- M. SQUARE INST. FIC FIA	12.487.673,17	7,68%	2,21%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	11.390.277,56	7,00%	2,01%
- GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA	9.938.355,97	6,11%	1,76%
- BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIQ FIA	10.439.867,88	6,42%	1,85%
- BBM SMID CAPS FICFIA	9.875.539,85	6,07%	1,75%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	66.621,78	0,04%	0,01%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	45.092,98	0,03%	0,01%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	77.436,86	0,05%	0,01%
- FIDC - BCSUL VERAX CPP 360	1.290.363,31	0,79%	0,23%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.	2.042.079,28	1,26%	0,36%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR	1.483.880,89	0,91%	0,26%
- BRZ MULTIRECEBÍVEIS CREDITO PRIVADO FIC DE FI	2.160.984,71	1,33%	0,38%
- BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FIM II	5.305.920,80	3,26%	0,94%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP	1.482.468,98	0,91%	0,26%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	4.267.242,51	2,62%	0,75%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP	8.772.034,68	5,39%	1,55%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA	1.412.780,89	0,87%	0,25%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES	723.738,22	0,44%	0,13%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE	155.541,04	0,10%	0,03%
- HAMILTON LANE FIC FIP	2.126.580,23	1,31%	0,38%
- STRATUS SCP BR FIP	1.787.981,64	1,10%	0,32%
- MEMORIAL OFFICE FI MOBILIARIO	1.207.999,91	0,74%	0,21%
- ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO	14.108.250,00	8,67%	2,49%
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO	2.448.517,30	1,51%	0,43%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	3.454.653,17	2,12%	0,61%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			
- BB MM SCH INV EXTE FI	5.654.680,29	3,48%	1,00%
- MSQUARE GL EQ FICFIM	3.611.582,66	2,22%	0,64%
TOTAL	162.644.924,12	100,00%	28,75%

GESTÃO PRÓPRIA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Própria	(%) em relação ao Recursos Garantidores
RENDA FIXA	268.287.610,94	66,57%	47,43%
RENDA VARIÁVEL	44.522.109,07	11,05%	7,87%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	24.004.751,96	5,96%	4,24%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	62.644.709,70	15,54%	11,07%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	3.570.843,56	0,89%	0,63%
TOTAL	403.030.025,23	100,00%	71,25%