

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO

CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.12.2013

DISCRIMINAÇÃO	Espécie Tipo	Quantidade	Valor em R\$	Alocação do patrimônio (%)	Diversificação (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.516.307.966,53		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			981.179.804,78	64,72	
<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>		192.662	493.997.711,71	32,58	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			215.972.325,23	14,24	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		17,00	120.601.827,63	7,95	
. CDB 1.826 DIAS - ABC	PÓS	3	31.381.023,97	2,07	2,07
. CDB 1827 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	989.559,78	0,07	0,07
. CDB 182 DIAS - CACIQUE	PÓS	2	52.601,55	0,00	0,00
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	4	61.591.335,20	4,06	4,06
. CDB 1826 DIAS - FIBRA	PÓS	2	19.892.299,48	1,31	1,31
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.453.009,07	0,36	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.431.276,56	0,36	0,72
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	2	5.231.126,54	0,34	0,34
. CDB 1826 DIAS - SCHAHIN	PÓS	2	13.648.296,86	0,90	
. CDB 1827 DIAS - SCHAHIN	PÓS	1	929.899,11	0,06	0,96
. CDB 1827 DIAS - SOFISA	PÓS	2	4.464.707,96	0,29	0,29
. CDB 2995 DIAS - VOTORANTIM	PÓS	2	12.894.821,03	0,85	0,85
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-4	-30.473.843,85	-2,01	-2,01
- BANCO MORADA		-4	-10.884.285,63	-0,72	-0,72
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		45	20.586.170,67	1,36	
. ABC		17	7.959.237,17	0,52	0,52
. BONSUCESSO		1	674.505,38	0,04	0,04
. PINE		17	6.738.640,42	0,44	0,44
. BRADESCO		10	5.213.787,70	0,34	0,34
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		30.039.959,85	74.784.326,93	4,93	
. ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM		516,24	53.033,86	0,00	0,00
. BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM		1.072.589,72	7.224.583,59	0,48	0,48
. REAL FAQ EXTRA DI - ASSISTENCIAL		11,56	10.324,16	0,00	0,00
. METRUS SAUDE RF ANS		6.705.879,86	11.603.930,28	0,77	0,77
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS CREDITO PRIVADO FIC DE FI		4.730,16	3.117.885,61	0,21	0,21
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FI MULTIMERCADO II		6.620.181,54	6.687.115,97	0,44	0,44
. BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP		3.708.925,00	4.723.951,31	0,31	0,31
. SAFRA INSTITUCIONAL		81.122,71	17.059.785,34	1,13	1,13
. FIDC - CEEE - CIA. EST. DIST. ENERGIA ELETRICA		4.467,00	2.126.423,89	0,14	0,14
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		8.673,97	205.963,03	0,01	0,01
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		14.724,00	57.604,49	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		8.925,14	599,93	0,00	0,00
. FIDC - BCSUL VERAX CPP 360		11.809.150,31	14.403.860,15	0,95	0,95
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		39,04	4.755.394,00	0,31	0,31
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR		23,62	2.753.871,32	0,18	0,18
<u>Debêntures</u>		5.053.221	85.912.248,23	5,68	
. CEMIG		32.000	34.929.979,05	2,30	2,30
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		60	18.563.317,42	1,22	1,22
. COMANCHE PART.		5.000.000	8.033.653,99	0,53	0,53
. ELETROMETRÔ		10.248	1.912.898,51	0,13	0,13

. ECOPISTAS		7.000	8.387.226,18	0,55	0,55
. RODOVIAS DO TIETÊ		3.000	3.083.428,26	0,20	0,20
. ROTA DAS BANDEIRAS		500	6.821.682,98	0,45	0,45
. SABESP		413	4.180.061,84	0,28	0,28
Outros Títulos		25.521	185.297.519,61	12,22	
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		61	16.939.336,69	1,12	1,12
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	14.288.633,71	0,94	0,94
. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCARIO		3	120.512.992,82	7,95	7,95
. DEPOSITO A PRAZO COM GARANTIA ESPECIAL		25.450	38.358.391,46	2,53	2,53
. VALORES A RECEBER			23.703.941,30	1,56	1,56
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS			-28.505.776,37	-1,88	-1,88
B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			252.850.203,05	16,68	
B1. Mercado de Ações			152.373.874,69	10,05	
Companhias Abertas		10.432.333	126.983.916,61	8,37	
. ALL AMER LATINA	ON	494.178	3.241.807,68	0,21	
. AMBEV	ON	503.340	8.717.848,80	0,57	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	295.450	14.550.912,50	0,96	
. BR MALLS PARTICIPAÇÕES	ON	218.900	3.732.245,00	0,25	
. CEMIG	PN	187.106	2.621.355,06	0,17	
. CYRELA REALT	ON	109.000	1.569.600,00	0,10	
. ECORODOVIAS	ON	190.500	2.819.400,00	0,19	
. GAFISA	ON	610.000	2.153.300,00	0,14	
. GERDAU - GGBR	PN	475.278	8.716.598,52	0,57	
. HYPERMARCAS	ON	220.600	3.893.590,00	0,26	
. ISHARES BOVA	CI	56.000	2.813.440,00	0,19	
. ITAUSA	PN	1.930.474	17.181.218,60	1,13	
. MARCOPOLO	PN	203.100	1.035.810,00	0,07	
. PÃO DE AÇUCAR	PN	58.220	6.107.860,20	0,40	
. PDG REALT	ON	911.034	1.648.971,54	0,11	
. PETROBRÁS	PN	768.459	13.125.279,72	0,87	
. POSITIVO INF	ON	168.800	484.456,00	0,03	
. RANDON PART	PN	258.150	2.966.143,50	0,20	
. RENT	ON	107.290	3.570.611,20	0,24	
. TAIPE	ON	1.724.970	5.140.410,60	0,34	
. TOTVS	ON	76.400	2.823.744,00	0,19	
. TRACTEBEL	ON	51.800	1.861.692,00	0,12	
. V-AGRO	ON	394.816	1.354.218,88	0,09	
. VALE R. DOCE	PNA	361.760	11.840.404,80	0,78	
. VIVT - TELEF. BRASIL	PN	56.708	2.542.219,64	0,17	
. VALORES A RECEBER			4.659,34	0,00	
. VALORES A PAGAR				0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			466.119,03	0,03	
Instituições Financeiras		860.885	25.389.958,08	1,67	
. BRADESCO	PN	415.603	12.089.891,27	0,80	
. BRASIL	ON	127.352	3.107.388,80	0,20	
. ITAU	PN	317.930	9.967.105,50	0,66	
. VALORES A PAGAR				0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			225.572,51	0,01	
B2. Fundos		41.143.483,53	100.476.328,36	6,63	
. ITAU - UNIBANCO METRUS FIA		4.245,56	413.428,54	0,03	
. FATOR SINERGIA IV FIA		15.106,00	23.520.217,34	1,55	
. FATOR SINERGIA V FIA		2.725,00	2.693.424,73	0,18	
. RB FUNDAMENTAL INST. FIA		197.523,67	23.387.399,18	1,54	
. M. SQUARE PIPE FIA		7.000.000,00	3.704.063,58	0,24	
. M. SQUARE INST. FIC FIA		7.402.620,61	10.199.706,29	0,67	
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		15.052.900,86	15.725.786,30	1,04	
. GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA		9.421.939,78	16.211.736,78	1,07	
. BTG PACTUAL DIVIDENDOS FICFIA		2.046.422,06	4.620.565,62	0,30	

C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		431.198,14	89.594.382,52	5,91	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP		10.744,82	3.710.845,34	0,24	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		7.536,17	2.720.229,22	0,18	
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.676,92	17.765.703,47	1,17	
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		4.347,00	6.183.282,37	0,41	
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		3.185,71	3.489.809,08	0,23	
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		1.662,32	1.484.652,87	0,10	
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		250.000,00	132.610,08	0,01	
. HAMILTON LANE FIC FIP		3.372,88	3.136.263,59	0,21	
. MEMORIAL OFFICE FI IMOBILIARIO		10.000,00	1.599.999,87	0,11	
. ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO		39.000,00	14.430.000,00	0,95	
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		99.010,00	13.252.488,50	0,87	
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		652,99	7.252.011,52	0,48	
. MULTINER FIP		9,33	14.223.287,01	0,94	
. VALORES A RECEBER			213.199,60	0,01	
D-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			94.618.663,42	6,24	
D1 - Investimentos em Shopping Center			83.186.870,67	5,49	
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			26.130.810,00	1,72	
. SHOPPING PLAZA SUL			32.296.460,00	2,13	
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			24.226.010,00	1,60	
. VALORES A RECEBER			533.590,67	0,04	
D2 - Investimento Imobiliário			11.431.792,75	0,75	
. PANAMBY			12.144.487,33	0,80	
. VALORES A PAGAR (-)			-712.694,58	-0,05	
E - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		5.103	94.777.044,72	6,25	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		5.103	94.848.245,08	6,26	
. VALORES A PAGAR (-)			-179.196,98	-0,01	
. VALORES A RECEBER			107.996,62	0,01	
F - OUTROS			3.287.868,04	0,22	
. DISPONIVEL			4.414.135,05	0,29	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			743.520,75	0,05	
. OUTROS REALIZAVEIS			390.367,52	0,03	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-1.379.200,80	-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	413.428,54	0,16%	0,03%
FUNDOS			
- ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM	53.033,86	0,02%	0,00%
- FUNDO FATOR SINERGIA IV	23.520.217,34	9,38%	1,55%
- FUNDO FATOR SINERGIA V	2.693.424,73	1,07%	0,18%
- RB.FUNDAMENTAL INST. FIA	23.387.399,18	9,33%	1,54%
- BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP	4.723.951,31	1,88%	0,31%
- SAFRA INSTITUCIONAL	17.059.785,34	6,81%	1,13%
- M. SQUARE PIPE FIA	3.704.063,58	1,48%	0,24%
- M. SQUARE INST. FIC FIA	10.199.706,29	4,07%	0,67%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	15.725.786,30	6,27%	1,04%
- GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA	16.211.736,78	6,47%	1,07%
- BTG PACTUAL DIVIDENDOS FICFIA	4.620.565,62	1,84%	0,30%
- FIDC - CEEE - CIA. EST. DIST. ENERGIA ELETRICA	2.126.423,89	0,85%	0,14%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	205.963,03	0,08%	0,01%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	57.604,49	0,02%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	599,93	0,00%	0,00%
- FIDC - BCSUL VERAX CPP 360	14.403.860,15	5,75%	0,95%

- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.	4.755.394,00	1,90%	0,31%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR	2.753.871,32	1,10%	0,18%
- BRZ MULTIRECEBIVEIS CP FIC DE FI	3.117.885,61	1,24%	0,21%
- BRZ MULTIRECEBIVEIS FIC FI MULTIMERCADO II	6.687.115,97	2,67%	0,44%
- REAL FAQ EXTRA DI - ASSISTENCIAL	10.324,16	0,00%	0,00%
- BRADESCO DED. SAUDE ANS	11.603.930,28	4,63%	0,77%
- BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	7.224.583,59	2,88%	0,48%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP	3.710.845,34	1,48%	0,24%
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP	2.720.229,22	1,09%	0,18%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	17.765.703,47	7,09%	1,17%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP	6.183.282,37	2,47%	0,41%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA	3.489.809,08	1,39%	0,23%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES	1.484.652,87	0,59%	0,10%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE	132.610,08	0,05%	0,01%
- HAMILTON LANE FIC FIP	3.136.263,59	1,25%	0,21%
- MEMORIAL OFFICE FI MOBILIARIO	1.606.999,87	0,64%	0,11%
- ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO	14.541.150,00	5,80%	0,96%
- BTG PACTUAL CORPOTATE OFFICE FI IMOBILIARIO	13.347.538,10	5,33%	0,88%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	7.252.011,52	2,89%	0,48%
TOTAL	250.631.750,80	100,00%	16,53%
GESTÃO PRÓPRIA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Própria	(%) em relação ao Recursos Garantidores
RENTA FIXA	906.395.477,85	72,43%	59,79%
RENTA VARIÁVEL	152.373.874,69	12,18%	10,05%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	94.618.663,42	7,56%	6,24%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	94.777.044,72	7,57%	6,25%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	3.287.868,04	0,26%	0,22%
TOTAL	1.251.452.928,72	100,00%	82,53%