

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL

PLANO I

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.12.2013

DISCRIMINAÇÃO	Espécie Tipo	Quantidade	Valor em R\$	Alocação do patrimônio (%)	Diversificação (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			894.291.283,64		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			604.519.995,90	67,60	
<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>		129.771	346.536.009,33	38,75	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			89.235.371,05	9,98	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		5,00	54.021.563,06	6,04	
. CDB 1.826 DIAS - ABC	PÓS	1	10.460.852,75	1,17	1,17
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	2	33.473.833,57	3,74	3,74
. CDB 1826 DIAS - FIBRA	PÓS	1	12.241.415,07	1,37	1,37
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	1	2.049.020,58	0,23	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	1	3.383.584,48	0,38	0,61
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	1	3.661.788,58	0,41	0,41
. CDB 2995 DIAS - VOTORANTIM	PÓS	1	10.745.684,19	1,20	1,20
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-2	-16.562.011,10	-1,85	-1,85
- BANCO MORADA		-2	-5.432.605,06	-0,61	-0,61
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		40	17.638.455,47	1,97	
. PINE		16	6.029.566,91	0,67	0,67
. ABC		17	7.959.237,17	0,89	0,89
. BRADESCO		7	3.649.651,39	0,41	0,41
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		9.370.659,06	17.575.352,52	1,97	
. ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM		516,24	53.033,86	0,01	0,01
. SAFRA INSTITUCIONAL		16.145,33	3.395.269,74	0,38	0,38
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FIM II		4.413.363,36	4.458.077,31	0,50	0,50
. FIDC - CEEE - CIA. EST. DIST. ENERGIA ELETRICA		3.467,00	1.650.394,36	0,18	0,18
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		4.713,99	111.933,32	0,01	0,01
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		7.000,00	27.385,99	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		4.958,18	333,24	0,00	0,00
. FIDC - BCSUL VERAX CPP 360		4.920.479,29	6.001.608,39	0,67	0,67
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		9,76	1.188.848,50	0,13	0,13
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR		5,90	688.467,81	0,08	0,08
<u>Debêntures</u>		2.536.479	49.695.005,44	5,56	
. ELETROMETRÔ		7.174	1.339.103,62	0,15	0,15
. ECOPISTAS		7.000	8.387.226,18	0,94	0,94
. COMANCHE PART.		2.500.000	4.016.827,00	0,45	0,45
. CEMIG		20.000	21.831.236,91	2,44	2,44
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		30	9.281.658,73	1,04	1,04
. RODOVIAS DO TIETÊ		2.000	2.055.618,84	0,23	0,23
. SABESP		275	2.783.334,16	0,31	0,31
<u>Outros Títulos</u>		19.044	119.053.610,08	13,31	
. CERTIFICADO DE RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS		36	10.001.590,75	1,12	1,12
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	14.288.633,71	1,60	1,60
. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCARIO		1	73.038.213,17	8,17	8,17
. DEPOSITO A PRAZO COM GARANTIA ESPECIAL		19.000	26.527.007,52	2,97	2,97
. VALORES A RECEBER		2	14.773.759,35	1,65	1,65

. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		-2,00	-19.575.594,42	-2,19	
. Cedula de credito bancario - ALOÉS		-1	-5.879.982,21	-0,66	-0,66
. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCARIO - BANIF		-1	-13.695.612,21	-1,53	-1,53
B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			131.014.181,44	14,65	
<u>B1. Mercado de Ações</u>			83.742.335,51	9,36	
<u>Companhias Abertas</u>		6.380.221	69.527.509,86	7,77	
. ALL AMER LATINA	ON	244.866	1.606.320,96	0,18	
. AMBEV	ON	270.520	4.685.406,40	0,52	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	158.524	7.807.307,00	0,87	
. BR MALLS PARTICIPAÇÕES	ON	119.600	2.039.180,00	0,23	
. CEMIG	PN	95.152	1.333.079,52	0,15	
. CYRELA REALT	ON	60.300	868.320,00	0,10	
. ECORODOVIAS	ON	101.400	1.500.720,00	0,17	
. GAFISA	ON	343.200	1.211.496,00	0,14	
. GERDAU - GGBR	PN	261.064	4.787.913,76	0,54	
. HYPERMARCAS	ON	123.200	2.174.480,00	0,24	
. ITAUSA	PN	1.052.415	9.366.493,50	1,05	
. MARCOPOLO	PN	94.200	480.420,00	0,05	
. PÃO DE AÇUCAR	PN	32.139	3.371.702,49	0,38	
. PDG REALT	ON	499.192	903.537,52	0,10	
. PETROBRÁS	PN	424.217	7.245.626,36	0,81	
. POSITIVO INF	ON	73.100	209.797,00	0,02	
. RANDON PART	PN	144.000	1.654.560,00	0,19	
. RENT	ON	58.485	1.946.380,80	0,22	
. TAIPE	ON	1.724.970	5.140.410,60	0,57	
. TOTVS	ON	41.000	1.515.360,00	0,17	
. TRACTEBEL	ON	27.200	977.568,00	0,11	
. V-AGRO	ON	205.081	703.427,83	0,08	
. VALE R. DOCE	PNA	197.027	6.448.693,71	0,72	
. VIVT - TELEF. BRASIL	PN	29.369	1.316.612,27	0,15	
. VALORES A RECEBER				0,00	
. VALORES A PAGAR				0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			232.696,14	0,03	
<u>Instituições Financeiras</u>		482.810	14.214.825,65	1,59	
. BRADESCO	PN	227.323	6.612.826,07	0,74	
. BRASIL	ON	76.547	1.867.746,80	0,21	
. ITAU	PN	178.940	5.609.769,00	0,63	
. VALORES A PAGAR				0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			124.483,78	0,01	
<u>B2. Fundos</u>		22.320.285,70	47.271.845,93	5,29	
. ITAU - UNIBANCO METRUS FIA		1.643,31	160.024,20	0,02	
. FATOR SINERGIA IV		6.744,90	10.501.882,28	1,17	
. FATOR SINERGIA V		1.154,00	1.140.628,31	0,13	
. RB FUNDAMENTAL INST. FIA		98.255,80	11.633.783,03	1,30	
. M. SQUARE PIPE FIA		3.500.000,00	1.852.031,79	0,21	
. M. SQUARE INST. FIC FIA		2.775.982,73	3.824.889,86	0,43	
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		8.560.987,25	8.943.675,19	1,00	
. GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA		7.375.517,72	9.214.931,27	1,03	
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		243.727,43	50.826.528,19	5,68	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		7.536,17	2.720.229,22	0,30	
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.280,99	13.571.132,10	1,52	
. FIP BVEP PLAZA		1.911,43	2.093.885,45	0,23	
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		1.163,62	1.039.257,01	0,12	
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		150.000,00	79.566,05	0,01	
. HAMILTON LANE FIC FIP		2.226,10	2.069.933,97	0,23	
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		79.208,00	10.601.990,80	1,19	
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		391,79	4.351.206,90	0,49	
. MULTINER FIP		9,33	14.223.287,01	1,59	
. VALORES A RECEBER			76.039,68	0,01	

D- INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			70.375.316,18	7,87	
D1 - Investimentos em Shopping Center			58.943.523,43	6,59	
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			26.130.810,00	2,92	
. SHOPPING PLAZA SUL			32.296.460,00	3,61	
. VALORES A RECEBER			516.253,43	0,06	
D2 - Investimento Imobiliário			11.431.792,75	1,28	
. PANAMBY			12.144.487,33	1,36	
. VALORES A PAGAR (-)			-712.694,58	-0,08	
E - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		2.102	36.304.947,93	4,06	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		2.102	36.432.776,15	4,07	
. VALORES A PAGAR (-)			-129.362,64	-0,01	
. VALORES A RECEBER			1.534,42	0,00	
F - OUTROS			1.250.314,00	0,14	
. DISPONIVEL			1.448.568,63	0,16	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			333.512,07	0,04	
. OUTROS REALIZAVEIS			334.159,94	0,04	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-532.414,57	-0,06	
. 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	160.024,20	0,16%	0,02%
FUNDOS			
- ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM	53.033,86	0,05%	0,01%
- FUNDO FATOR SINERGIA IV	10.501.882,28	10,35%	1,17%
- FUNDO FATOR SINERGIA V	1.140.628,31	1,12%	0,13%
- RB.FUNDAMENTAL INST. FIA	11.633.783,03	11,47%	1,30%
- SAFRA INSTITUCIONAL	3.395.269,74	3,35%	0,38%
- M. SQUARE PIPE FIA	1.852.031,79	1,83%	0,21%
- M. SQUARE INST. FIC FIA	3.824.889,86	3,77%	0,43%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	8.943.675,19	8,82%	1,00%
- GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA	9.214.931,27	9,08%	1,03%
- FIDC - CEEE - CIA. EST. DIST. ENERGIA ELETRICA	1.650.394,36	1,63%	0,18%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER	111.933,32	0,11%	0,01%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER II	27.385,99	0,03%	0,00%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER III	333,24	0,00%	0,00%
- FIDC - BCSUL VERAX CPP 360	6.001.608,39	5,92%	0,67%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.	1.188.848,50	1,17%	0,13%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR	688.467,81	0,68%	0,08%
- BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FIM II	4.458.077,31	4,39%	0,50%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP	2.720.229,22	2,68%	0,30%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	13.571.132,10	13,38%	1,52%
- FIP BVEP PLAZA	2.093.885,45	2,06%	0,23%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES	1.039.257,01	1,02%	0,12%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE	79.566,05	0,08%	0,01%
- HAMILTON LANE FIC FIP	2.069.933,97	2,04%	0,23%
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO	10.678.030,48	10,53%	1,19%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	4.351.206,90	4,29%	0,49%
TOTAL	101.450.439,63	100,00%	11,34%

GESTÃO PRÓPRIA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Própria	(%) em relação ao Recursos Garantidores
RENTA FIXA	586.944.643,38	75,38%	65,63%
RENTA VARIÁVEL	83.742.335,51	10,76%	9,36%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	70.375.316,18	9,04%	7,87%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	36.304.947,93	4,66%	4,06%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	1.250.314,00	0,16%	0,14%
TOTAL	778.617.557,00	100,00%	87,07%