

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL

PLANO II

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.12.2013

DISCRIMINAÇÃO	Espécie Tipo	Quantidade	Valor em R\$	Alocação do patrimônio (%)	Diversificação (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			516.469.749,15		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			281.589.119,86	54,52	
<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>		59.113	139.664.545,14	27,04	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			77.493.068,15	15,00	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		8,00	49.106.690,03	9,51	
. CDB 1.826 DIAS - ABC	PÓS	1	10.460.852,75	2,03	2,03
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	1	18.137.405,30	3,51	3,51
. CDB 1826 DIAS - FIBRA	PÓS	1	7.650.884,41	1,48	1,48
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	1	3.403.988,49	0,66	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	1	2.047.692,08	0,40	1,06
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	1	1.569.337,96	0,30	0,30
. CDB 1826 DIAS - SCHAHIN	PÓS	2	13.648.296,86	2,64	2,64
. CDB 1827 DIAS - SOFISA	PÓS	2	4.464.707,96	0,86	0,86
. CDB 2995 DIAS - VOTORANTIM	PÓS	1	2.149.136,84	0,42	0,42
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-1	-8.973.932,05	-1,74	-1,74
- BANCO MORADA		-2	-5.451.680,57	-1,06	-1,06
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		3	1.564.136,31	0,30	
. BRADESCO		3	1.564.136,31	0,30	
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		6.287.335,95	26.822.241,81	5,19	
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS CREDITO PRIVADO FIC DE FI		4.730,16	3.117.885,61	0,60	0,60
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FIM II		2.206.818,18	2.229.038,66	0,43	0,43
. BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP		3.024.304,06	3.851.969,27	0,75	0,75
. SAFRA INSTITUCIONAL		59.905,38	12.597.755,66	2,44	2,44
. FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER		2.474,99	58.768,56	0,01	0,01
. FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER II		3.000,00	11.736,85	0,00	0,00
. FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER III		1.976,00	132,85	0,00	0,00
. FIDC - BCSUL VERAX CPP 360		984.095,86	1.200.321,69	0,23	0,23
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		19,52	2.377.696,99	0,46	0,46
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR		11,81	1.376.935,67	0,27	0,27
<u>Debêntures</u>		1.714.734	30.273.625,47	5,86	
. ELETROMETRÔ		3.074	573.794,89	0,11	0,11
. COMANCHE PART.		1.700.000	2.731.442,36	0,53	0,53
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		22	6.806.549,69	1,32	1,32
. CEMIG		10.000	10.915.618,45	2,11	2,11
. RODOVIAS DO TIETÊ		1.000	1.027.809,42	0,20	0,20
. ROTA DAS BANDEIRAS		500	6.821.682,98	1,32	1,32
. SABESP		138	1.396.727,68	0,27	0,27
<u>Outros Títulos</u>		3.026	34.157.881,10	6,61	
. CERTIFICADO DE RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS		25	6.937.745,94	1,34	1,34
. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCARIO		1	21.302.745,85	4,12	4,12
. DEPOSITO A PRAZO COM GARANTIA ESPECIAL		3.000	5.917.389,31	1,15	1,15
. VALORES A RECEBER		1	4.010.166,95	0,78	0,78
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		-1	-4.010.166,95	-0,78	
. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCARIO - BANIF		-1	-4.010.166,95	-0,78	-0,78

B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			111.627.953,72	21,61
B1. Mercado de Ações			64.390.765,21	12,47
Companhias Abertas		3.909.328	53.475.088,02	10,35
. ALL AMER LATINA	ON	244.985	1.607.101,60	0,31
. AMBEV	ON	228.495	3.957.533,40	0,77
. BRF - BRASIL FOODS	ON	134.354	6.616.934,50	1,28
. BR MALLS PARTICIPAÇÕES	ON	97.300	1.658.965,00	0,32
. CEMIG	PN	90.285	1.264.892,85	0,24
. CYRELA REALT	ON	47.600	685.440,00	0,13
. ECORODOVIAS	ON	87.400	1.293.520,00	0,25
. GAFISA	ON	259.600	916.388,00	0,18
. GERDAU - GGBR	PN	209.124	3.835.334,16	0,74
. HYPERMARCAS	ON	95.100	1.678.515,00	0,32
. ITAUSA	PN	858.924	7.644.423,60	1,48
. MARCOPOLO	PN	107.300	547.230,00	0,11
. PÃO DE AÇUCAR	PN	25.574	2.682.968,34	0,52
. PDG REALT	ON	402.354	728.260,74	0,14
. PETROBRÁS	PN	335.377	5.728.239,16	1,11
. POSITIVO INF	ON	93.300	267.771,00	0,05
. RANDON PART	PN	112.100	1.288.029,00	0,25
. RENT	ON	47.760	1.589.452,80	0,31
. TOTVS	ON	34.800	1.286.208,00	0,25
. TRACTEBEL	ON	24.100	866.154,00	0,17
. V-AGRO	ON	186.040	638.117,20	0,12
. VALE R. DOCE	PNA	160.617	5.256.994,41	1,02
. VIVT - TELEF. BRASIL	PN	26.839	1.203.192,37	0,23
. VALORES A RECEBER				0,00
. VALORES A PAGAR				0,00
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			233.422,89	0,05
Instituições Financeiras		369.271	10.915.677,19	2,11
. BRADESCO	PN	183.855	5.348.341,95	1,04
. BRASIL	ON	49.526	1.208.434,40	0,23
. ITAU	PN	135.890	4.260.151,50	0,82
. VALORES A PAGAR				0,00
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			98.749,34	0,02
B2. Fundos		21.362.145,68	47.237.188,51	9,15
. ITAU - UNIBANCO METRUS FIA		1.650,73	160.746,68	0,03
. FATOR SINERGIA IV		5.784,10	9.005.915,28	1,74
. FATOR SINERGIA V		1.571,00	1.552.796,42	0,30
. RB FUNDAMENTAL INST. FIA		88.009,17	10.420.551,61	2,02
. M. SQUARE PIPE FIA		2.500.000,00	1.322.879,85	0,26
. M. SQUARE INST. FIC FIA		4.626.637,88	6.374.816,43	1,23
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		6.491.913,62	6.782.111,11	1,31
. GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA		5.600.157,12	6.996.805,51	1,35
. BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIQ FIA		2.046.422,06	4.620.565,62	0,89
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		187.470,70	38.767.854,33	7,51
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II- FIP		10.744,82	3.710.845,34	0,72
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		395,93	4.194.571,37	0,81
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		4.347,00	6.183.282,37	1,20
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		1.274,29	1.395.923,63	0,27
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		498,70	445.395,86	0,09
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		100.000,00	53.044,03	0,01
. HAMILTON LANE FIC FIP		1.146,78	1.066.329,62	0,21
. MEMORIAL OFFICE FI IMOBILIARIO		10.000,00	1.599.999,87	0,31
. ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO		39.000,00	14.430.000,00	2,79
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		19.802,00	2.650.497,70	0,51
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		261,20	2.900.804,62	0,56
. VALORES A RECEBER			137.159,92	0,03

D-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			24.243.347,24	4,69	
D1 - Investimentos em Shopping Center			24.243.347,24	4,69	
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			24.226.010,00	4,69	
. VALORES A RECEBER			17.337,24	0,00	
E - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		3.001	58.472.096,79	11,32	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		3.001	58.415.468,93	11,31	
. VALORES A PAGAR (-)			-49.834,34	-0,01	
. VALORES A RECEBER			106.462,20	0,02	
F - OUTROS			1.769.377,21	0,34	
. DISPONIVEL			2.171.881,94	0,42	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			54.561,85	0,01	
. OUTROS REALIZAVEIS			56.207,58	0,01	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-458.712,31	-0,09	
. 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	160.746,68	0,14%	0,03%
FUNDOS			
- FUNDO FATOR SINERGIA IV	9.005.915,28	7,98%	1,74%
- FUNDO FATOR SINERGIA V	1.552.796,42	1,38%	0,30%
- RB.FUNDAMENTAL INST. FIA	10.420.551,61	9,24%	2,02%
- BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP	3.851.969,27	3,41%	0,75%
- SAFRA INSTITUCIONAL	12.597.755,66	11,17%	2,44%
- M. SQUARE PIPE FIA	1.322.879,85	1,17%	0,26%
- M. SQUARE INST. FIC FIA	6.374.816,43	5,65%	1,23%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	6.782.111,11	6,01%	1,31%
- GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA	6.996.805,51	6,20%	1,35%
- BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIQ FIA	4.620.565,62	4,10%	0,89%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	58.768,56	0,05%	0,01%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	11.736,85	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	132,85	0,00%	0,00%
- FIDC - BCSUL VERAX CPP 360	1.200.321,69	1,06%	0,23%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.	2.377.696,99	2,11%	0,46%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR	1.376.935,67	1,22%	0,27%
- BRZ MULTIRECEBÍVEIS CREDITO PRIVADO FIC DE FI	3.117.885,61	2,76%	0,60%
- BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FIM II	2.229.038,66	1,98%	0,43%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP	3.710.845,34	3,29%	0,72%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	4.194.571,37	3,72%	0,81%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP	6.183.282,37	5,48%	1,20%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA	1.395.923,63	1,24%	0,27%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES	445.395,86	0,39%	0,09%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE	53.044,03	0,05%	0,01%
- HAMILTON LANE FIC FIP	1.066.329,62	0,95%	0,21%
- MEMORIAL OFFICE FI MOBILIARIO	1.606.999,87	1,42%	0,31%
- ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO	14.541.150,00	12,89%	2,82%
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO	2.669.507,62	2,37%	0,52%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	2.900.804,62	2,57%	0,56%
TOTAL	112.827.284,65	100,00%	21,85%

GESTÃO PRÓPRIA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Própria	(%) em relação ao Recursos Garantidores
RENTA FIXA	254.766.878,05	63,12%	49,33%
RENTA VARIÁVEL	64.390.765,21	15,95%	12,47%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	24.243.347,24	6,01%	4,69%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	58.472.096,79	14,49%	11,32%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	1.769.377,21	0,44%	0,34%
TOTAL	403.642.464,50	100,00%	78,15%

--