

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO

CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.12.2014

DISCRIMINAÇÃO	Espécie Tipo	Quantidade	Valor em R\$	Alocação do patrimônio (%)	Diversificação (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.652.321.276,37		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			1.079.721.303,33	65,25	
<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>		222.562	606.091.333,31	36,68	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			227.038.548,29	13,63	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		14,00	87.230.963,51	5,28	
. CDB 1827 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	1.143.666,33	0,07	0,07
. CDB 182 DIAS - CACIQUE	PÓS	2	58.281,92	0,00	0,00
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	4	61.591.335,20	3,73	3,73
. CDB 1826 DIAS - FIBRA	PÓS	2	23.024.572,07	1,39	1,39
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.453.009,07	0,33	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.431.276,56	0,33	0,66
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	2	5.918.248,13	0,36	0,36
. CDB 1826 DIAS - SCHAHIN	PÓS	2	4.862.164,68	0,29	
. CDB 1827 DIAS - SCHAHIN	PÓS	1	1.082.677,63	0,07	0,36
. CDB 1827 DIAS - SOFISA	PÓS	2	5.164.016,61	0,31	0,31
. CDB 2995 DIAS - VOTORANTIM	PÓS	2	14.859.844,79	0,90	0,90
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-4	-30.473.843,85	-1,84	-1,84
- BANCO MORADA		-4	-10.884.285,63	-0,66	-0,66
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		47	43.128.723,91	2,50	
. ABC		19	21.323.771,05	1,29	1,29
. BONSUCESSO		1	780.077,10	0,05	0,05
. PINE		17	7.258.344,13	0,44	0,44
. BRADESCO		10	5.854.558,86	0,35	0,35
. BANCO BTG PACTUAL		1	6.085.067,98	0,37	0,37
. SAFRA		4	1.826.904,79	0,11	0,11
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		25.759.477,24	96.678.860,87	5,85	
. ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM		516,24	58.841,61	0,00	0,00
. BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM		1.963.432,73	14.685.450,35	0,89	0,89
. REAL FAQ EXTRA DI - ASSISTENCIAL		11,56	10.991,25	0,00	0,00
. METRUS SAUDE RF ANS		6.705.879,86	12.816.747,01	0,78	0,78
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS CREDITO PRIVADO FIC DE FI		0,00	0,00	0,00	0,00
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FI MULTIMERCADO II		12.206.454,54	16.913.532,54	1,02	1,02
. BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP		3.708.925,00	5.017.341,77	0,30	0,30
. SAFRA INSTITUCIONAL		153.308,69	35.950.050,67	2,18	2,18
. FIDC - CEEE - CIA. EST. DIST. ENERGIA ELETRICA		4.467,00	618.422,36	0,04	0,04
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		8.673,97	365.225,53	0,02	0,02
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		14.724,00	633.515,68	0,04	0,04
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		8.925,14	300.598,28	0,02	0,02
. FIDC - BCSUL VERAX CPP 360		984.095,86	0,00	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		39,04	4.321.611,83	0,26	0,26
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR		23,62	4.986.531,99	0,30	0,30
<u>Debêntures</u>		42.973	71.351.367,91	4,33	
. CEMIG		32.000	37.204.599,98	2,25	2,25
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		60	10.554.610,98	0,64	0,64
. COMANCHE PART.		5.000.000	6.202.107,98	0,38	0,38

. ELETROMETRÔ		0	0,00	0,00	0,00
. ECOPISTAS		7.000	8.631.057,19	0,52	0,52
. RODOVIAS DO TIETÊ		3.000	3.286.634,84	0,20	0,20
. ROTA DAS BANDEIRAS		500	7.180.514,36	0,43	0,43
. SABESP		413	4.493.950,56	0,27	0,27
. VALORES A RECEBER					
. COMANCHE PART.			2.860.589,97	0,17	0,17
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS					
. COMANCHE PART.		-5.000.000	-9.062.697,95	-0,55	-0,55
Outros Títulos		20.521	175.240.053,82	10,61	
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		61	15.630.599,11	0,95	0,95
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	14.421.699,87	0,87	0,87
. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCARIO		3	117.110.975,80	7,09	7,09
. DEPOSITO A PRAZO COM GARANTIA ESPECIAL		20.450	32.664.293,09	1,98	1,98
. VALORES A RECEBER			41.787.562,02	2,53	2,53
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS			-46.375.076,07	-2,81	-2,81
B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			244.435.859,86	14,79	
B1. Mercado de Ações			91.220.429,84	5,52	
Companhias Abertas		6.551.389	70.731.213,55	4,28	
. ALL AMER LATINA	ON	4.478	22.658,68	0,00	
. AMBEV	ON	342.138	5.593.956,30	0,34	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	183.250	11.625.380,00	0,70	
. BR MALLS PARTICIPAÇÕES	ON	105.500	1.733.365,00	0,10	
. CEMIG	PN	87.506	1.149.828,84	0,07	
. CYRELA REALT	ON	1.100	12.166,00	0,00	
. ECORODOVIAS	ON	250.400	2.669.264,00	0,16	
. GAFISA	ON	7.200	15.840,00	0,00	
. GERDAU - GGBR	PN	465.478	4.459.279,24	0,27	
. HYPERMARCAS	ON	2.300	38.295,00	0,00	
. ISHARES BOVA	CI	238.200	11.562.228,00	0,70	
. ITAUSA	PN	1.271.645	11.940.746,55	0,72	
. MARCOPOLO	PN	232.700	774.891,00	0,05	
. MILLS	ON	100.000	955.000	0,06	
. PÃO DE AÇUCAR	PN	38.420	3.789.364,60	0,23	
. PDG REALT	ON	9.634	8.285,24	0,00	
. PETROBRÁS	PN	265.559	2.660.901,18	0,16	
. POSITIVO INF	ON	2.400	5.136,00	0,00	
. RANDON PART	PN	293.937	1.402.079,49	0,08	
. RENT	ON	83.790	2.992.140,90	0,18	
. TAIPE	ON	1.724.970	5.140.410,60	0,31	
. TOTVS	ON	62.000	2.170.000,00	0,13	
. TRACTEBEL	ON	27.900	943.857,00	0,06	
. V-AGRO	ON	301.816	307.852,32	0,02	
. VALE R. DOCE	PNA	448.460	8.623.885,80	0,52	
. VIVT - TELEF. BRASIL	PN	608	28.484,80	0,00	
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00	
. VALORES A PAGAR			-10.122.933,38	-0,61	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			228.850,39	0,01	
Instituições Financeiras		607.578	20.489.216,29	1,24	
. BRADESCO	PN	300.203	10.525.117,18	0,64	
. BRASIL	ON	80.852	1.921.852,04	0,12	
. ITAU	PN	226.523	7.837.695,80	0,47	
. VALORES A PAGAR				0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			204.551,27	0,01	
B2. Fundos		66.661.289,06	153.215.430,02	9,27	
. FATOR SINERGIA IV FIA		15.106,00	19.300.723,85	1,17	
. FATOR SINERGIA V FIA		4.122,00	3.098.632,96	0,19	
. RB FUNDAMENTAL INST. FIA		208.932,52	22.778.098,37	1,38	
. M. SQUARE INST. FIC FIA		17.382.038,42	25.395.820,73	1,54	
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		21.212.891,85	22.176.444,61	1,34	

. GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA	13.424.087,67	20.321.096,10	1,23
. BTG PACTUAL DIVIDENDOS FICFIA	8.831.568,62	20.695.559,64	1,25
. BBM SMID CAPS FICFIA	5.582.541,99	19.449.053,76	1,18
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	14.037.954,97	107.372.103,15	8,48
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP	10.778,33	520.583,35	0,03
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP	8.307,62	3.384.434,97	0,20
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	1.676,93	20.828.864,59	1,26
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP	6.588,00	11.643.940,53	0,70
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA	3.846,43	4.312.503,29	0,26
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES	4.288,22	4.284.236,54	0,26
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE	699.217,79	485.794,64	0,03
. HAMILTON LANE FIC FIP	7.583,81	6.859.470,29	0,42
. MULTINER FIP	9,40	14.276.956,23	0,86
. STRATUS SCP BR FIP	4.663.370,00	5.152.688,08	0,31
. P2BR INFR III FIQFIP	988,33	803.174,88	0,08
. MEMORIAL OFFICE FI IMOBILIARIO	10.000,00	1.228.099,90	0,07
. ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO	39.000,00	12.476.100,00	0,76
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO	99.010,00	10.801.991,00	0,65
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	773,89	9.690.883,64	0,59
. P2 BR INFRAESTRUTURA III FIC DE FIP	493,67	401.181,12	0,02
. VALORES A RECEBER		221.200,10	0,01
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	8.482.022,56	16.057.844,01	0,97
. BB MM SCH INV EXTE FI	5.128.757,86	9.743.178,90	0,59
. MSQUARE GL EQ FICFIM	3.342.850,69	6.314.665,11	0,38
D-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS		93.441.985,06	5,66
D1 - Investimentos em Shopping Center		82.010.192,31	4,96
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ		25.646.906,11	1,55
. SHOPPING PLAZA SUL		31.645.016,83	1,92
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA		23.814.766,00	1,44
. VALORES A RECEBER		903.503,37	0,05
D2 - Investimento Imobiliário		11.431.792,75	0,69
. PANAMBY		12.144.487,33	0,73
. VALORES A PAGAR (-)		-712.694,58	-0,04
E - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES	5.207	106.945.113,76	6,47
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	5.207	104.267.866,40	6,31
. VALORES A PAGAR (-)		-134.668,41	-0,01
. VALORES A RECEBER		2.811.915,77	0,17
F - OUTROS		4.347.067,20	0,26
. DISPONIVEL		5.865.663,41	0,35
. DEPOSITOS JUDICIAIS		744.486,45	0,05
. OUTROS REALIZAVEIS		390.367,52	0,02
. OUTRAS EXIGIBILIDADES		-1.910.078,08	-0,12
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL		-743.372,10	-0,04

GESTÃO TERCEIRIZADA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Terceirizada	(%) em relação ao Recursos Garantidores
FUNDOS			
- ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM	58.841,61	0,02%	0,00%
- FUNDO FATOR SINERGIA IV	19.300.723,85	5,92%	1,17%
- FUNDO FATOR SINERGIA V	3.098.632,96	0,95%	0,19%
- RB.FUNDAMENTAL INST. FIA	22.778.098,37	6,99%	1,38%
- BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP	5.017.341,77	1,54%	0,30%
- SAFRA INSTITUCIONAL	35.950.050,67	11,03%	2,18%
- M. SQUARE INST. FIC FIA	25.395.820,73	7,79%	1,54%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	22.176.444,61	6,80%	1,34%

- GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA	20.321.096,10	6,23%	1,23%
- BTG PACTUAL DIVIDENDOS FICFIA	20.695.559,64	6,35%	1,25%
- FIDC - CEEE - CIA. EST. DIST. ENERGIA ELETRICA	618.422,36	0,19%	0,04%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	365.225,53	0,11%	0,02%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	633.515,68	0,19%	0,04%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	300.598,28	0,09%	0,02%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.	4.321.611,83	1,33%	0,26%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR	4.986.531,99	1,53%	0,30%
- BRZ MULTIRECEBIVEIS FIC FI MULTIMERCADO II	16.913.532,54	5,19%	1,02%
- REAL FAQ EXTRA DI - ASSISTENCIAL	10.991,25	0,00%	0,00%
- BRADESCO DED. SAUDE ANS	12.816.747,01	3,93%	0,78%
- BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	14.685.450,35	4,51%	0,89%
- BBM SMID CAPS FICFIA	2.841.688,21	0,87%	0,17%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP	520.583,35	0,16%	0,03%
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP	3.384.434,97	1,04%	0,20%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	20.828.864,59	6,39%	1,26%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP	11.643.940,53	3,57%	0,70%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA	4.312.503,29	1,32%	0,26%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES	4.284.236,54	1,31%	0,26%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE	485.794,64	0,15%	0,03%
- HAMILTON LANE FIC FIP	6.859.470,29	2,10%	0,42%
- STRATUS SCP BR FIP	5.152.688,08	1,58%	0,31%
- P2BR INFR III FIQFIP	803.174,88	0,25%	0,05%
- MEMORIAL OFFICE FI MOBILIARIO	1.235.099,90	0,38%	0,07%
- ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO	12.587.250,00	3,86%	0,76%
- BTG PACTUAL CORPOTATE OFFICE FI IMOBILIARIO	10.897.040,60	3,34%	0,66%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	9.690.883,64	2,97%	0,59%
TOTAL	325.972.890,64	100,00%	19,73%
GESTÃO PRÓPRIA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Própria	(%) em relação ao Recursos Garantidores
RENTA FIXA	983.042.442,46	76,86%	59,50%
RENTA VARIÁVEL	91.220.429,84	7,13%	5,52%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	93.441.985,06	7,31%	5,66%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	106.945.113,76	8,36%	6,47%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	4.347.067,20	0,34%	0,26%
TOTAL	1.278.997.038,32	100,00%	77,41%