

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL

PLANO I

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.12.2014

DISCRIMINAÇÃO	Espécie Tipo	Quantidade	Valor em R\$	Alocação do patrimônio (%)	Diversificação (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			<u>949.073.956,97</u>		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			<u>652.995.013,86</u>	<u>68,80</u>	
<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>		133.071	380.172.551,94	40,06	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			110.022.277,39	11,59	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		4,00	47.606.767,58	5,02	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	2	33.473.833,57	3,53	3,53
. CDB 1826 DIAS - FIBRA	PÓS	1	14.168.967,43	1,49	1,49
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	1	2.049.020,58	0,22	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	1	3.383.584,48	0,36	0,57
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	1	4.142.773,69	0,44	0,44
. CDB 2995 DIAS - VOTORANTIM	PÓS	1	12.383.203,99	1,30	1,30
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-2	-16.562.011,10	-1,75	-1,75
- BANCO MORADA		-2	-5.432.605,06	-0,57	-0,57
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		41	33.784.608,79	3,56	
. PINE		16	6.425.379,04	0,68	0,68
. ABC		18	15.349.065,78	1,62	1,62
. BRADESCO		7	4.098.191,20	0,43	0,43
. BANCO BTG PACTUAL		1	6.085.067,98	0,64	0,64
. SAFRA		4	1.826.904,79	0,19	0,19
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		10.079.603,10	28.630.901,02	3,02	
. ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM		516,24	58.841,61	0,01	0,01
. SAFRA INSTITUCIONAL		59.295,66	13.822.596,21	1,46	1,46
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FIM II		9.999.636,36	11.275.688,35	1,19	1,19
. FIDC - CEEE - CIA. EST. DIST. ENERGIA ELETRICA		3.467,00	479.979,92	0,05	0,05
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		4.713,99	198.486,63	0,02	0,02
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		7.000,00	301.182,39	0,03	0,03
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		4.958,18	166.991,31	0,02	0,02
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		9,76	1.080.501,61	0,11	0,11
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR		5,90	1.246.632,99	0,13	0,13
<u>Debêntures</u>		29.305	42.344.667,30	4,46	
. ECOPISTAS		7.000	8.631.057,19	0,91	0,91
. COMANCHE PART.		2.500.000	3.101.054,00	0,33	0,33
. CEMIG		20.000	23.252.875,00	2,45	2,45
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		30	5.277.305,26	0,56	0,56
. RODOVIAS DO TIETÊ		2.000	2.191.089,89	0,23	0,23
. SABESP		275	2.992.339,96	0,32	0,32
. VALORES A RECEBER			1.430.294,98	0,15	0,15
. COMANCHE PART.			1.430.294,98	0,15	0,15
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS		-2.500.000,00	-4.531.348,98	-0,48	-0,48
. COMANCHE PART.		-2.500.000	-4.531.348,98	-0,48	-0,48
<u>Outros Títulos</u>		19.044	120.455.517,23	12,69	
. CERTIFICADO DE RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS		36	9.230.805,76	0,97	0,97
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	14.421.699,87	1,52	1,52
. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCARIO		1	70.976.307,35	7,48	7,48
. DEPOSITO A PRAZO COM GARANTIA ESPECIAL		19.000	30.414.218,30	3,20	3,20
. VALORES A RECEBER		2	26.066.464,60	2,75	2,75

. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		-2,00	-30.653.978,65	-3,23	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO - ALOÉS		-1	-6.499.327,73	-0,68	-0,68
. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCARIO - BANIF		-1	-24.154.650,92	-2,55	-2,55
B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			121.631.040,01	12,82	
<u>B1. Mercado de Ações</u>			46.766.409,47	4,93	
<u>Companhias Abertas</u>		4.088.732	36.634.285,25	3,86	
. ALL AMER LATINA	ON	66	333,96	0,00	
. AMBEV	ON	169.768	2.775.706,80	0,29	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	91.624	5.812.626,56	0,61	
. BR MALLS PARTICIPAÇÕES	ON	51.900	852.717,00	0,09	
. CEMIG	PN	42.452	557.819,28	0,06	
. ECORODOVIAS	ON	132.000	1.407.120,00	0,15	
. GERDAU - GGBR	PN	232.464	2.227.005,12	0,23	
. ISHARES BOVA	CI	91.600	4.446.264,00	0,47	
. ITAUSA	PN	625.578	5.874.177,42	0,62	
. MARCOPOLO	PN	121.400	404.262,00	0,04	
. MILLS	ON	51.600	492.780,00	0,05	
. PÃO DE AÇUCAR	PN	20.539	2.025.761,57	0,21	
. PDG REALT	ON	92	79,12	0,00	
. PETROBRÁS	PN	129.017	1.292.750,34	0,14	
. RANDON PART	PN	133.600	637.272,00	0,07	
. RENT	ON	41.985	1.499.284,35	0,16	
. TAIFE	ON	1.724.970	5.140.410,60	0,54	
. TOTVS	ON	31.500	1.102.500,00	0,12	
. TRACTEBEL	ON	14.200	480.386,00	0,05	
. V-AGRO	ON	154.781	157.876,62	0,02	
. VALE R. DOCE	PNA	227.527	4.375.344,21	0,46	
. VIVT - TELEF. BRASIL	PN	69	3.232,65	0,00	
. VALORES A RECEBER				0,00	
. VALORES A PAGAR			-5.051.226,15	-0,53	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			119.801,80	0,01	
<u>Instituições Financeiras</u>		300.314	10.132.124,22	1,07	
. BRADESCO	PN	149.523	5.242.276,38	0,55	
. BRASIL	ON	39.647	942.409,19	0,10	
. ITAU	PN	111.144	3.845.582,40	0,41	
. VALORES A PAGAR				0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			101.856,25	0,01	
<u>B2. Fundos</u>		36.075.234,98	74.864.630,54	7,89	
. FATOR SINERGIA IV		6.744,90	8.617.859,56	0,91	
. FATOR SINERGIA V		1.154,00	867.496,95	0,09	
. RB FUNDAMENTAL INST. FIA		98.255,80	10.711.976,46	1,13	
. M. SQUARE INST. FIC FIA		8.834.914,97	12.908.147,56	1,36	
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		10.743.477,78	11.231.478,56	1,18	
. GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA		9.121.176,41	10.366.511,24	1,09	
. BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIQ FIA		4.528.657,36	10.612.282,20	1,12	
. BBM SMID CAPS FICFIA		2.740.853,78	9.548.878,01	1,01	
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		2.851.795,61	61.437.293,45	6,47	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.307,62	3.384.434,97	0,36	
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.281,00	15.911.065,57	1,68	
. FIP BVEP PLAZA		2.307,86	2.587.501,97	0,27	
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		3.001,75	2.998.965,58	0,32	
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		419.530,67	291.476,78	0,03	
. HAMILTON LANE FIC FIP		5.005,32	4.527.250,39	0,48	
. MULTINER FIP		9,40	14.276.956,23	1,50	
.STRATUS SCP BR FIP		2.331.685,00	2.576.344,04	0,27	
. P2BR INFR III FIQFIP		988,33	803.174,88	0,08	
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		79.208,00	8.641.592,80	0,91	
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		470,67	5.358.530,16	0,56	
. VALORES A RECEBER			80.000,08	0,01	

D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		3.769.975,66	4.944.699,18	0,52	
. BB MM SCH INV EXTE FI		2.333.433,18	3.046.699,93	0,32	
. MSQUARE GL EQ FICFIM		1.436.542,47	1.897.999,25	0,20	
E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			69.597.977,96	7,33	
E1 - Investimentos em Shopping Center			58.166.185,21	6,13	
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			25.646.906,11	2,70	
. SHOPPING PLAZA SUL			31.645.016,83	3,33	
. VALORES A RECEBER			874.262,27	0,09	
E2 - Investimento Imobiliário			11.431.792,75	1,20	
. PANAMBY			12.144.487,33	1,28	
. VALORES A PAGAR (-)			-712.694,58	-0,08	
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		2.046	38.869.725,96	4,10	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		2.046	38.057.136,88	4,01	
. VALORES A PAGAR (-)			-114.039,95	-0,01	
. VALORES A RECEBER			926.629,03	0,10	
G - OUTROS			-401.793,45	-0,04	
. DISPONIVEL			780.618,40	0,08	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			333.512,07	0,04	
. OUTROS REALIZAVEIS			334.159,94	0,04	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-1.516.571,79	-0,16	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-333.512,07	-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	0,03%	0,01%
- FUNDO FATOR SINERGIA IV	8.617.859,56	5,07%	0,91%
- FUNDO FATOR SINERGIA V	867.496,95	0,51%	0,09%
- RB.FUNDAMENTAL INST. FIA	10.711.976,46	6,31%	1,13%
- SAFRA INSTITUCIONAL	13.822.596,21	8,14%	1,46%
- M. SQUARE INST. FIC FIA	12.908.147,56	7,60%	1,36%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	11.231.478,56	6,61%	1,18%
- GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA	10.366.511,24	6,10%	1,09%
- BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIQ FIA	10.612.282,20	6,25%	1,12%
- BBM SMID CAPS FICFIA	9.548.878,01	5,62%	1,01%
- FIDC - CEEE - CIA. EST. DIST. ENERGIA ELETRICA	479.979,92	0,28%	0,05%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	198.486,63	0,12%	0,02%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	301.182,39	0,18%	0,03%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	166.991,31	0,10%	0,02%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.	1.080.501,61	0,64%	0,11%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR	1.246.632,99	0,73%	0,13%
- BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FIM II	11.275.688,35	6,64%	1,19%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP	3.384.434,97	1,99%	0,36%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	15.911.065,57	9,37%	1,68%
- FIP BVEP PLAZA	2.587.501,97	1,52%	0,27%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES	2.998.965,58	1,77%	0,32%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE	291.476,78	0,17%	0,03%
- HAMILTON LANE FIC FIP	4.527.250,39	2,67%	0,48%
- MULTINER FIP	14.276.956,23	8,40%	1,50%
- STRATUS SCP BR FIP	2.576.344,04	1,52%	0,27%
- P2BR INFR III FIQFIP	803.174,88	0,47%	0,08%
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO	8.721.592,88	5,13%	0,92%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	5.358.530,16	3,15%	0,56%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			
- BB MM SCH INV EXTE FI	3.046.699,93	1,79%	0,32%
- MSQUARE GL EQ FICFIM	1.897.999,25	1,12%	0,20%
TOTAL	169.877.524,19	100,00%	17,90%

GESTÃO PRÓPRIA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Própria	(%) em relação ao Recursos Garantidores
RENTA FIXA	624.364.112,84	80,13%	65,79%
RENTA VARIÁVEL	46.766.409,47	6,00%	4,93%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	69.597.977,96	8,93%	7,33%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	38.869.725,96	4,99%	4,10%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	-401.793,45	-0,05%	-0,04%
TOTAL	779.196.432,78	100,00%	82,10%