

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL

PLANO II

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.12.2014

DISCRIMINAÇÃO	Espécie Tipo	Quantidade	Valor em R\$	Alocação do patrimônio (%)	Diversificação (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			596.686.917,66		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			332.362.924,08	56,22	
<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>		83.513	211.902.819,39	35,51	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			68.084.686,77	11,41	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		7,00	32.297.374,42	5,41	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	1	18.137.405,30	3,04	3,04
. CDB 1826 DIAS - FIBRA	PÓS	1	8.855.604,64	1,48	1,48
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	1	3.403.988,49	0,57	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	1	2.047.692,08	0,34	0,91
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	1	1.775.474,44	0,30	0,30
. CDB 1826 DIAS - SCHAHIN	PÓS	2	4.862.164,68	0,81	0,81
. CDB 1827 DIAS - SOFISA	PÓS	2	5.164.016,61	0,87	0,87
. CDB 2995 DIAS - VOTORANTIM	PÓS	1	2.476.640,80	0,42	0,42
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-1	-8.973.932,05	-1,50	-1,50
- BANCO MORADA		-2	-5.451.680,57	-0,91	-0,91
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		3	1.756.367,66	0,29	
. BRADESCO		3	1.756.367,66	0,29	
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		6.304.790,45	34.030.944,69	5,70	
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FIM II		2.206.818,18	5.637.844,19	0,94	0,94
. BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMÁRIAS II FIRF CP		3.024.304,06	4.091.203,53	0,69	0,69
. SAFRA INSTITUCIONAL		82.090,04	19.348.049,26	3,24	3,24
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		2.474,99	104.211,80	0,02	0,02
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		3.000,00	129.078,17	0,02	0,02
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		1.976,00	66.551,60	0,01	0,01
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		19,52	2.160.740,14	0,36	0,36
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR		11,81	2.493.266,00	0,42	0,42
<u>Debêntures</u>		1.711.660	25.274.131,76	4,75	
. COMANCHE PART.		1.700.000	2.108.716,72	0,35	0,35
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		22	3.870.024,37	0,65	0,65
. CEMIG		10.000	11.626.437,48	1,95	1,95
. RODOVIAS DO TIETÊ		1.000	1.095.544,95	0,18	0,18
. ROTA DAS BANDEIRAS		500	7.180.514,36	1,20	1,20
. SABESP		138	1.501.610,60	0,25	0,25
. VALORES A RECEBER			972.600,59	0,16	
. COMANCHE PART.			972.600,59	0,16	0,16
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		-1.700.000,00	-3.081.317,31	-0,52	
. COMANCHE PART.		-1.700.000	-3.081.317,31	-0,52	-0,52
<u>Outros Títulos</u>		26	27.101.286,16	4,54	
. CERTIFICADO DE RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS		25	6.399.793,35	1,07	1,07
. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCÁRIO		1	20.701.492,81	3,47	3,47
. VALORES A RECEBER		1	7.053.287,64	1,18	1,18
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		-1	-7.053.287,64	-1,18	
. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCÁRIO - BANIF		-1	-7.053.287,64	-1,18	-1,18

B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			114.261.847,15	19,15
B1. Mercado de Ações			40.431.083,79	6,78
Companhias Abertas		2.317.104	30.380.536,20	5,09
. ALL AMER LATINA	ON	85	430,10	0,00
. AMBEV	ON	168.039	2.747.437,65	0,46
. BRF - BRASIL FOODS	ON	89.054	5.649.585,76	0,95
. BR MALLS PARTICIPAÇÕES	ON	51.600	847.788,00	0,14
. CEMIG	PN	43.385	570.078,90	0,10
. ECORODOVIAS	ON	116.700	1.244.022,00	0,21
. GERDAU - GGBR	PN	227.924	2.183.511,92	0,37
. ISHARES BOVA	CI	90.600	4.397.724,00	0,74
. ITAUSA	PN	624.681	5.865.754,59	0,98
. MARCOPOLO	PN	109.700	365.301,00	0,06
. MILLS	ON	48.400	462.220,00	0,08
. PÃO DE AÇUCAR	PN	17.374	1.713.597,62	0,29
. PDG REALT	ON	54	46,44	0,00
. PETROBRÁS	PN	127.677	1.279.323,54	0,21
. RANDON PART	PN	157.775	752.586,75	0,13
. RENT	ON	40.760	1.455.539,60	0,24
. TOTVS	ON	29.900	1.046.500,00	0,18
. TRACTEBEL	ON	13.200	446.556,00	0,07
. V-AGRO	ON	143.340	146.206,80	0,02
. VALE R. DOCE	PNA	216.817	4.169.390,91	0,70
. VIVT - TELEF. BRASIL	PN	39	1.827,15	0,00
. VALORES A RECEBER				0,00
. VALORES A PAGAR			-5.071.707,23	-0,85
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			106.814,70	0,02
Instituições Financeiras		298.150	10.050.547,59	1,68
. BRADESCO	PN	146.255	5.127.700,30	0,86
. BRASIL	ON	39.926	949.041,02	0,16
. ITAU	PN	111.969	3.874.127,40	0,65
. VALORES A PAGAR				0,00
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			99.678,87	0,02
B2. Fundos		35.028.042,09	73.830.763,36	12,37
. FATOR SINERGIA IV		5.784,10	7.390.266,91	1,24
. FATOR SINERGIA V		2.968,00	2.231.136,01	0,37
. RB FUNDAMENTAL INST. FIA		99.418,02	10.838.683,17	1,82
. M. SQUARE INST. FIC FIA		8.547.123,45	12.487.673,17	2,09
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		10.469.414,07	10.944.966,05	1,83
. GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA		8.758.734,98	9.954.584,86	1,67
. BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIQ FIA		4.302.911,26	10.083.277,44	1,69
. BBM SMID CAPS FICFIA		2.841.688,21	9.900.175,75	1,66
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		2.704.136,80	45.934.809,70	7,70
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II- FIP		10.778,33	520.583,35	0,09
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		395,93	4.917.799,02	0,82
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		6.588,00	11.643.940,53	1,95
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		1.538,57	1.725.001,32	0,29
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		1.286,47	1.285.270,96	0,22
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		279.687,12	194.317,86	0,03
. HAMILTON LANE FIC FIP		2.578,50	2.332.219,90	0,39
. STRATUS SCP BR FIP		2.331.685,00	2.576.344,04	0,43
. MEMORIAL OFFICE FI IMOBILIARIO		10.000,00	1.228.099,90	0,21
. ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO		39.000,00	12.476.100,00	2,09
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		19.802,00	2.160.398,20	0,36
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		303,22	4.332.353,48	0,73
. P2 BR INFRAESTRUTURA III FIC DE FIP		493,67	401.181,12	0,07
. VALORES A RECEBER			141.200,02	0,02
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			11.113.144,83	1,86
. BB MM SCH INV EXTE FI		5.128.757,86	6.696.478,97	1,12
. MSQUARE GL EQ FICFIM		3.342.850,69	4.416.665,86	0,74

E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			23.844.007,10	4,00	
E1 - Investimentos em Shopping Center			23.844.007,10	4,00	
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			23.814.766,00	3,99	
. VALORES A RECEBER			29.241,10	0,00	
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		3.161	68.075.387,80	11,41	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		3.161	66.210.729,52	11,10	
. VALORES A PAGAR (-)			-20.628,46	0,00	
. VALORES A RECEBER			1.885.286,74	0,32	
G - OUTROS			1.094.797,00	0,18	
. DISPONIVEL			1.044.021,79	0,17	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			54.561,85	0,01	
. OUTROS REALIZAVEIS			56.207,58	0,01	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-5.432,37	0,00	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-54.561,85	-0,01	

GESTÃO TERCEIRIZADA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Terceirizada	(%) em relação ao Recursos Garantidores
FUNDOS			
- FUNDO FATOR SINERGIA IV	7.390.266,91	4,48%	1,24%
- FUNDO FATOR SINERGIA V	2.231.136,01	1,35%	0,37%
- RB.FUNDAMENTAL INST. FIA	10.838.683,17	6,57%	1,82%
- BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP	4.091.203,53	2,48%	0,69%
- SAFRA INSTITUCIONAL	19.348.049,26	11,73%	3,24%
- M. SQUARE INST. FIC FIA	12.487.673,17	7,57%	2,09%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	10.944.966,05	6,64%	1,83%
- GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA	9.954.584,86	6,04%	1,67%
- BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIQ FIA	10.083.277,44	6,11%	1,69%
- BBM SMID CAPS FICFIA	9.900.175,75	6,00%	1,66%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER	104.211,80	0,06%	0,02%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER II	129.078,17	0,08%	0,02%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER III	66.551,60	0,04%	0,01%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.	2.160.740,14	1,31%	0,36%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR	2.493.266,00	1,51%	0,42%
- BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FIM II	5.637.844,19	3,42%	0,94%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP	520.583,35	0,32%	0,09%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	4.917.799,02	2,98%	0,82%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP	11.643.940,53	7,06%	1,95%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA	1.725.001,32	1,05%	0,29%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES	1.285.270,96	0,78%	0,22%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE	194.317,86	0,12%	0,03%
- HAMILTON LANE FIC FIP	2.332.219,90	1,41%	0,39%
- STRATUS SCP BR FIP	2.576.344,04	1,56%	0,43%
- MEMORIAL OFFICE FI MOBILIARIO	1.236.099,90	0,75%	0,21%
- ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO	12.583.350,00	7,63%	2,11%
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO	2.180.398,22	1,32%	0,37%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	4.332.353,48	2,63%	0,73%
- P2 BR INFRAESTRUTURA III FIC DE FIP	401.181,12	0,24%	0,07%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			
- BB MM SCH INV EXTE FI	6.696.478,97	4,06%	1,12%
- MSQUARE GL EQ FICFIM	4.416.665,86	2,68%	0,74%
TOTAL	164.903.712,58	100,00%	27,64%

GESTÃO PRÓPRIA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Própria	(%) em relação ao Recursos Garantidores
RENTA FIXA	298.331.979,39	69,09%	50,00%
RENTA VARIÁVEL	40.431.083,79	9,36%	6,78%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	23.844.007,10	5,52%	4,00%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	68.075.387,80	15,77%	11,41%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	1.094.797,00	0,25%	0,18%
TOTAL	431.777.255,08	100,00%	72,36%