

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO
CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 29.06.2018

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO	DIVERSIFICAÇÃO
	TIPO			PATRIMÔNIO (%)	(%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			2.386.221.786,15		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			1.714.796.247,66	71,86	
TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOURO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOURO NACIONAL					
Nota do Tesouro Nacional		342.658	1.147.181.462	48,08	
APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS			380.148.813,82	15,93	
Certificado de Depósito Bancário		5.002,00	9.006.489,91	0,38	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	4	44.627.825,93	1,87	1,87
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.453.009,07	0,23	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.431.276,56	0,23	0,46
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	5.000	9.006.489,91	0,38	0,38
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-3	-44.627.825,93	-1,87	-1,87
- BANCO MORADA		-3	-10.884.285,63	-0,46	-0,46
Letra Financeira Subordinada		298	98.744.826,61	4,14	
. ABC		27	15.284.659	0,64	0,64
. ITAÚ		0	-	0,00	0,00
. PARANÁ BANCO		95	21.572.936,61	0,90	0,90
. BRADESCO		176	49.336.409,99	2,07	2,07
. BANCO BTG PACTUAL		1	9.595.119,03	0,40	0,40
. SAFRA		4	2.955.702,23	0,12	0,12
Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.		159.745.069,39	272.397.497,30	11,42	
. SANT FIC FI ISN RF D		516,24	86.598,25	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		66.640.273,53	108.333.354,16	4,54	4,54
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		62.862.298,49	19.659.055,60	0,82	0,82
. SAN FC EXTRA RF REF		11,56	13.879,81	0,00	0,00
. METRUS SAUDE RF ANS		6.891.627,03	19.039.066,58	0,80	0,80
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FI MULTIMERCADO II		14.999.454,54	9.845.586,91	0,41	0,41
. BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP		3.708.925,00	403.105,63	0,02	0,02
. BNP PARIBAS MATCH DI FI RENDA FIXA		627,53	758.904,44	0,03	0,03
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		75.416,68	10.897.665,33	0,46	0,46
. CA INDOSUEZ VITESSE FI RENDA FIXA CP		4.533.519,16	94.911.123,10	3,98	3,98
. FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER		8.673,97	269.858,70	0,01	0,01
. FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER II		14.724,00	94.201,07	0,00	0,00
. FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER III		8.925,14	38.396,52	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		39,04	5.309.353,71	0,22	0,22
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR		37,48	2.737.347,49	0,11	0,11
Debêntures		45.853	107.110.894,69	4,50	
. CEMIG		32.000	44.950.319,84	1,88	1,88
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		1.949	5.055.125,06	0,21	0,21
. LOJAS AMERICANAS		720	7.688.245,68	0,32	0,32
. ECOPISTAS		7.000	8.228.383,95	0,34	0,34
. ROTA DAS BANDEIRAS		500	7.590.838,78	0,32	0,32
. SABESP		2.364	19.843.777,10	0,83	0,83
. TRIANGULO DO SOL AUTO - ESTRADAS S/A		345	3.590.542,11	0,15	0,15
. BR TOWERS SPEI S.A.		300	3.114.065	0,13	0,13
. VALORES A RECEBER					
. COMANCHE PART.			9.349.383,13	0,39	0,39
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS					
. COMANCHE PART.			-9.349.383,12	-0,39	-0,39
Outros Títulos		68	80.355.077,51	3,37	
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		61	9.488.800,91	0,40	0,40
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	15.338.449,73	0,64	0,64
. VALORES A RECEBER			174.210.710,44	7,30	7,30
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS			-118.682.883,57	-4,97	-4,97

B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			175.144.991,74	7,34	
B1. Mercado de Ações			98.082.294,78	4,11	
Companhias Abertas		3.213.141	85.552.553,03	3,59	
. AMBEV	ON	123.007	2.211.665,86	0,09	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	91.478	1.646.604,00	0,07	
. COSAN	ON	68.400	2.406.312,00	0,10	
. ECORODOVIAS	ON	158.200	1.170.680,00	0,05	
. EVEN	ON	0	-	0,00	
. GERDAU - GGBR	PN	158.788	2.208.741,08	0,09	
. ITAUSA	ON	310	3.069,00	0,00	
. IGUATEMI EMP SHOP S.A	ON	82.900	2.556.636,00	0,11	
. ITAUSA	PN	520.509	4.778.272,62	0,20	
. MARCOPOLO	PN	282.600	946.710,00	0,04	
. MRVE	ON	110.700	1.332.828,00	0,06	
. PETROBRÁS	PN	275.294	4.732.303,86	0,20	
. RANDON PART	PN	200.916	1.239.651,72	0,05	
. RENT	ON	191.661	4.548.115,53	0,19	
. RUMO LOG	ON	51.293	723.231,30	0,03	
. RUMO LOG DIR	DIR	86.500	3.889.905,00	0,16	
. TOTVS	ON	47.500	1.292.000,00	0,05	
. VALE R. DOCE	PNA	191.085	9.475.905,15	0,40	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			149.721,91	0,01	
Instituições Financeiras		375.667	12.529.741,75	0,53	
. BRADESCO	PN	196.486	5.295.157,40	0,22	
. ITAU	PN	179.181	7.228.161,54	0,30	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			6.422,81	0,00	
B2. Fundos		26.329.580,61	77.062.696,96	3,23	
. FATOR SINERGIA V FIA		4.122,00	5.072.841,75	0,21	
. M. SQUARE INST. FIC FIA		11.563.945,16	23.073.764,24	0,97	
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		11.398.044,90	18.152.215,59	0,76	
. GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA		0,00	0,00	0,00	
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.300.735,63	17.286.622,89	0,72	
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	13.477.252,49	0,56	
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		29.096.594	187.078.114,33	7,84	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP		10.778,33	27.931,52	0,00	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.414,82	3.761.139,96	0,16	
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.676,93	25.176.433,58	1,06	
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		8.187,00	13.969.969,19	0,59	
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		5.000,00	5.271.736,85	0,22	
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		8.715,22	6.247.509,76	0,26	
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.664.091,72	1.482.085,22	0,06	
. HAMILTON LANE FIC FIP		16.900,59	21.999.120,15	0,92	
. MULTINER FIP		9,44	624.362,48	0,03	
.STRATUS SCP BR FIP		6.533.174,00	9.120.441,56	0,38	
. P2BR INFR III FIQFIP		8.047,00	12.604.953,81	0,53	
. COPA FLORESTAL III		7.598.242,00	7.432.903,42	0,31	
. MEMORIAL OFFICE FI IMOBILIARIO		10.000,00	919.999,93	0,04	
. ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO		39.000,00	12.480.390,00	0,52	
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		99.010,00	8.783.177,10	0,37	
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		784,45	11.233.828,46	0,47	
. GGR COVEPI RENDA FII		100.000,00	12.160.000,00	0,51	
. MAUÁ MACRO II FIC DE FIM		16.237,46	11.545.715,08	0,48	
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		5.754.560,40	10.784.876,58	0,45	
. KINEA CHRONOS FIM		7.213.764,32	11.345.936,22	0,48	
. VALORES A RECEBER			105.603,50	0,00	
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		23.579.690	86.903.045,64	3,64	
. BB MM SCH INV EXTE FI		5.128.757,86	23.205.629,39	0,97	
. MSQUARE GL EQ FICFIM		3.342.850,69	17.306.090,00	0,73	
. VOT ALLIANZGI FIM		7.605.013,33	15.993.636,21	0,67	
. WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI		6.931,42	9.694.312,92	0,41	
. GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE		92.862,26	10.434.159,12	0,44	
. PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR		7.403.274,30	10.269.218,00	0,43	
D-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			108.226.189,49	4,54	
D1 - Investimentos em Shopping Center			99.830.189,49	4,18	
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			27.332.318,47	1,15	
. SHOPPING PLAZA SUL			52.523.898,71	2,20	
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			19.748.902,26	0,83	
. VALORES A RECEBER			225.070,05	0,01	
D2 - Investimento Imobiliário			8.396.000,00	0,35	
. PANAMBY			8.396.000,00	0,35	
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00	

E - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		4.715	109.577.435,69	4,59	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		4.715	105.409.761,97	4,42	
. VALORES A PAGAR (-)			23.181,77	0,00	
. VALORES A RECEBER			4.144.491,95	0,17	
F - OUTROS			4.495.761,60	0,19	
. DISPONIVEL			4.596.781,24	0,19	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			1.858.844,52	0,08	
. OUTROS REALIZAVEIS			391.612,10	0,02	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-1.541.784,16	-0,06	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-809.692,10	-0,03	
GESTÃO TERCEIRIZADA		DISTRIBUIÇÃO		(%) EM RELAÇÃO A GESTÃO TERCEIRIZADA	(%) EM RELAÇÃO AO RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS					
- SANT FIC FI ISN RF D		86.598,25		0,01%	0,00%
- FUNDO FATOR SINERGIA V		5.072.841,75		0,81%	0,21%
- BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP		403.105,63		0,06%	0,02%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		108.333.354,16		17,38%	4,54%
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		19.659.055,60		3,15%	0,82%
- M. SQUARE INST. FIC FIA		23.073.764,24		3,70%	0,97%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		18.152.215,59		2,91%	0,76%
- BNP PARIBAS MATCH DI FI RENDA FIXA		758.904,44		0,12%	0,03%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		10.897.665,33		1,75%	0,46%
- CA INDOSUEZ VITESSE FI RENDA FIXA CP		94.911.123,10		15,22%	3,98%
- IBIUNA EQ. FIC FIA		13.477.252,49		2,16%	0,56%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		269.858,70		0,04%	0,01%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		94.201,07		0,02%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		38.396,52		0,01%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		5.309.353,71		0,85%	0,22%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR		2.737.347,49		0,44%	0,11%
- BRZ MULTIRECEBIVEIS FIC FI MULTIMERCADO II		9.845.586,91		1,58%	0,41%
- REAL FAQ EXTRA DI - ASSISTENCIAL		13.879,81		0,00%	0,00%
- BRADESCO DED. SAUDE ANS		19.039.066,58		3,05%	0,80%
- BBM SMID CAPS FICFIA		17.286.622,89		2,77%	0,72%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP		27.931,52		0,00%	0,00%
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		3.761.139,96		0,60%	0,16%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		25.176.433,58		4,04%	1,06%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		13.969.969,19		2,24%	0,59%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		5.271.736,85		0,85%	0,22%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		6.247.509,76		1,00%	0,26%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.482.085,22		0,24%	0,06%
- HAMILTON LANE FIC FIP		21.999.120,15		3,53%	0,92%
. MULTINER FIP		624.362,48		0,10%	0,03%
- STRATUS SCP BR FIP		9.120.441,56		1,46%	0,38%
- P2BR INFR III FIQFIP		12.604.953,81		2,02%	0,53%
- COPA FLORESTAL III		7.432.903,42		1,19%	0,31%
- MEMORIAL OFFICE FI MOBILIARIO		922.699,93		0,15%	0,04%
- ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO		12.548.640,00		2,01%	0,53%
- BTG PACTUAL CORPOTATE OFFICE FI IMOBILIARIO		8.817.830,60		1,41%	0,37%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		11.233.828,46		1,80%	0,47%
- GGR COVEPI RENDA FII		12.160.000,00		1,95%	0,51%
- MAUÁ MACRO II FIC DE FIM		11.545.715,08		1,85%	0,48%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS		10.784.876,58		1,73%	0,45%
- KINEA CHRONOS FIM		11.345.936,22		1,82%	0,48%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- BB MM SCH INV EXTE FI		23.205.629,39		3,72%	0,97%
- MSQUARE GL EQ FICFIM		17.306.090,00		2,78%	0,73%
- VOT ALLIANZGI FIM		15.993.636,21		2,57%	0,67%
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI		9.694.312,92		1,55%	0,41%
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE		10.434.159,12		1,67%	0,44%
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR		10.269.218,00		1,65%	0,43%
TOTAL		623.441.354,27		100,00%	26,13%

GESTÃO PRÓPRIA	DISTRIBUIÇÃO	(%) EM RELAÇÃO A GESTÃO TERCEIRIZADA	(%) EM RELAÇÃO AO RECURSOS GARANTIDORES
RENTA FIXA	1.442.398.750,36	81,83%	60,46%
RENTA VARIÁVEL	98.082.294,78	5,56%	4,11%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	108.226.189,49	6,14%	4,54%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	109.577.435,69	6,22%	4,59%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	4.495.761,60	0,26%	0,19%
TOTAL	1.762.780.431,92	100,00%	73,92%