

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO					
CONSOLIDADO					
POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.12.2015					
DISCRIMINAÇÃO	Espécie Tipo	Quantidade	Valor em R\$	Alocação do patrimônio (%)	Diversificação (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.791.197.950,20		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			1.192.440.150,60	76,01	
<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>		266.491	780.637.886,71	43,58	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			192.857.803,58	20,19	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		16.576.896,06	33.620.323,72	1,88	
. CDB 1827 DIAS - BICBANCO	PÓS	685	1.365.970,53	0,08	0,08
. CDB 182 DIAS - CACIQUE	PÓS	64	72.410,69	0,00	0,00
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	4	44.627.825,93	2,49	2,49
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	2.049.533	5.453.009,07	0,30	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	3.383.074	5.431.276,56	0,30	0,61
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	3.501	6.939.545,96	0,39	0,39
. CDB 1827 DIAS - SCHAHIN	PÓS	631	1.302.594,28	0,07	0,07
. CDB 1827 DIAS - SOFISA	PÓS	5.001	6.189.242,50	0,35	0,35
. CDB 2995 DIAS - VOTORANTIM	PÓS	5.001	17.750.559,76	0,99	0,99
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		16.562.009	-44.627.825,93	-2,49	-2,49
- BANCO MORADA		-5.432.607	-10.884.285,63	-0,61	-0,61
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		59	58.575.589,28	3,15	
. ABC		18	25.452.106,07	1,42	1,42
. BONSUCESSO		1	934.226,33	0,05	0,05
. PINE		17	8.101.537,56	0,45	0,45
. BRADESCO		23	14.692.980,08	0,82	0,82
. BANCO BTG PACTUAL		1	7.213.596,18	0,40	0,40
. SAFRA		4	2.181.143,06	0,12	0,12
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		31.964.098,88	100.661.890,58	15,17	
. ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM		516,24	66.769,43	0,00	0,00
. BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM		6.331.165,58	51.503.162,29	2,88	2,88
. REAL FAQ EXTRA DI - ASSISTENCIAL		11,56	11.942,57	0,00	0,00
. METRUS SAUDE RF ANS		6.891.627,03	14.863.615,16	0,83	0,83
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FI MULTIMERCADO II		14.999.454,54	19.248.267,39	1,07	1,07
. BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP		3.708.925,00	3.795.211,29	0,21	0,21
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		8.673,97	245.956,99	0,01	0,01
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		14.724,00	534.187,70	0,03	0,03
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		8.925,14	154.389,60	0,01	0,01
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		39,04	4.346.408,95	0,24	0,24
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR		36,79	5.891.979,21	0,33	0,33
<u>Debêntures</u>		44.623	87.757.092,14	4,91	
. CEMIG		32.000	41.137.226,02	2,30	2,30
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		960	13.712.722,82	0,77	0,77
. ECOPISTAS		7.000	9.097.970,02	0,51	0,51
. RODOVIAS DO TIETÊ		3.000	3.635.612,38	0,20	0,20
. ROTA DAS BANDEIRAS		500	7.698.334,34	0,43	0,43
. SABESP		413	5.014.265,66	0,28	0,28
. TRIANGULO DO SOL AUTO - ESTRADAS S/A		450	4.231.570,00	0,24	0,24
. BR TOWERS SPEI S.A.		300	3.229.391	0,18	0,18
. VALORES A RECEBER					
. COMANCHE PART.			10.137.267,17	0,57	0,57
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS					
. COMANCHE PART.			-10.137.267,16	-0,57	-0,57
<u>Outros Títulos</u>		20.521	131.187.368,17	7,32	
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		61	26.288.913,36	1,47	1,47
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	10.883.504,22	0,61	0,61
. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCARIO		3	111.637.206,29	6,23	6,23
. DEPOSITO A PRAZO COM GARANTIA ESPECIAL		20.450	38.792.065,31	2,17	2,17
. VALORES A RECEBER			60.875.887,01	3,40	3,40
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS			-117.290.208,02	-6,55	-6,55

B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			213.149.060,74	11,90
<u>B1. Mercado de Ações</u>			92.140.476,68	5,14
<u>Companhias Abertas</u>		8.311.505	82.433.905,56	4,60
. AMBEV	ON	187.938	3.354.693,30	0,19
. BRF - BRASIL FOODS	ON	119.050	6.595.370,00	0,37
. COSAN	ON	142.000	3.578.400,00	0,20
. ECORODOVIAS	ON	325.900	1.658.831,00	0,09
. EVEN	ON	531.400	2.189.368,00	0,12
. GERDAU - GGBR	PN	820.378	3.814.757,70	0,21
. ISHARES BOVA	CI	663.100	27.936.403,00	1,56
. IGUATEMI EMP SHOP S.A	ON	160.300	3.031.273,00	0,17
. ITAUSA	PN	550.985	3.790.776,80	0,21
. MARCOPOLO	PN	402.400	744.440,00	0,04
. MILLS	ON	376.200	1.000.692,00	0,06
. MRVE	ON	322.200	2.796.696,00	0,16
. PÃO DE AÇUCAR	PN	3.639	152.328,54	0,01
. PETROBRÁS	PN	500.959	3.356.425,30	0,19
. RANDON PART	PN	350.237	858.080,65	0,05
. RENT	ON	124.490	3.089.841,80	0,17
. RUMO LOG	ON	88.038	549.357,12	0,03
. RUMO LOG DIR	DIR	31.631	4.744,65	0,00
. TAIFE	ON	1.950.000	5.811.000,00	0,32
. TOTVS	ON	60.000	1.861.800,00	0,10
. VALE R. DOCE	PNA	600.660	6.156.765,00	0,34
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00
. VALORES A PAGAR			-67.137,34	0,00
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			168.999,04	0,01
<u>Instituições Financeiras</u>		462.667	9.706.571,12	0,54
. BRADESCO	PN	240.143	4.047.701,04	0,23
. BRADESCO DIR	ON	6.876	14.233,32	0,00
. ITAU	PN	215.648	5.417.239,52	0,30
. VALORES A PAGAR				0,00
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			227.397,24	0,01
<u>B2. Fundos</u>		74.483.383,25	121.008.584,06	6,76
. FATOR SINERGIA IV FIA		15.106,00	8.708.644,87	0,49
. FATOR SINERGIA V FIA		4.122,00	2.506.938,06	0,14
. M. SQUARE INST. FIC FIA		22.074.872,20	32.246.645,28	1,80
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		23.070.153,51	22.722.680,80	1,27
. GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA		13.424.087,67	12.958.447,72	0,72
. BTG PACTUAL DIVIDENDOS FICFIA		9.279.643,20	21.266.550,86	1,19
. BBM SMID CAPS FICFIA		6.615.398,68	20.598.676,47	1,15
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		21.952.708,28	119.981.519,48	11,02
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP		10.778,33	470.515,85	0,03
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.385,34	3.394.435,97	0,19
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.676,93	23.149.458,81	1,29
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		7.574,99	14.493.608,08	0,81
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		5.000,00	5.295.573,06	0,30
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		7.653,22	7.594.716,16	0,42
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		957.122,75	659.640,87	0,04
. HAMILTON LANE FIC FIP		11.625,00	12.842.112,67	0,72
. MULTINER FIP		9,40	14.257.449,30	0,80
.STRATUS SCP BR FIP		4.715.880,00	3.906.644,42	0,22
. P2BR INFR III FIQFIP		1.586,00	1.353.747,25	0,09
. MEMORIAL OFFICE FI IMOBILIARIO		10.000,00	999.999,92	0,06
. ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO		39.000,00	12.089.220,00	0,67
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		99.010,00	9.252.484,50	0,52
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		784,45	10.009.962,52	0,56
. VALORES A RECEBER			211.950,10	0,01
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		16.076.621,89	45.150.965,08	2,52
. BB MM SCH INV EXTE FI		5.128.757,86	18.801.302,69	1,05
. MSQUARE GL EQ FICFIM		3.342.850,69	13.227.723,33	0,74
. VOT ALLIANZGI FIM		7.605.013,33	13.121.939,06	0,73

D-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			104.813.483,50	5,85	
D1 - Investimentos em Shopping Center			93.010.818,90	5,19	
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			27.509.493,50	1,54	
. SHOPPING PLAZA SUL			46.995.175,47	2,62	
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			17.857.286,29	1,00	
. VALORES A RECEBER			648.863,64	0,04	
D2 - Investimento Imobiliário			11.802.664,60	0,66	
. PANAMBY			11.802.664,60	0,66	
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00	
E - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		5.243	112.438.360,68	6,28	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		5.243	112.145.396,34	6,26	
. VALORES A PAGAR (-)			-100.051,52	-0,01	
. VALORES A RECEBER			393.015,86	0,02	
F - OUTROS			3.224.410,12	0,18	
. DISPONIVEL			5.087.424,64	0,28	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			768.668,93	0,04	
. OUTROS REALIZAVEIS			390.367,52	0,02	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-2.238.128,87	-0,12	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-783.922,10	-0,04	

GESTÃO TERCEIRIZADA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Terceirizada	(%) em relação ao Recursos Garantidores
FUNDOS - ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM - FUNDO FATOR SINERGIA IV - FUNDO FATOR SINERGIA V - BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP - BRADESCO FI REF DI PREMIUM - M. SQUARE INST. FIC FIA - CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA - GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA - BTG PACTUAL DIVIDENDOS FICFIA - FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER - FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER II - FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER III - FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF. - FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR - BRZ MULTIRECEBIVEIS FIC FI MULTIMERCADO II - REAL FAQ EXTRA DI - ASSISTENCIAL - BRADESCO DED. SAUDE ANS - BBM SMID CAPS FICFIA	66.769,43 8.708.644,87 2.506.938,06 3.795.211,29 51.503.162,29 32.246.645,28 22.722.680,80 12.958.447,72 21.266.550,86 245.956,99 534.187,70 154.389,60 4.346.408,95 5.891.979,21 19.248.267,39 11.942,57 14.863.615,16 20.598.676,47	0,02% 2,33% 0,67% 1,02% 13,78% 8,63% 6,08% 3,47% 5,69% 0,07% 0,14% 0,04% 1,16% 1,58% 5,15% 0,00% 3,98% 5,51%	0,00% 0,49% 0,14% 0,21% 2,88% 1,80% 1,27% 0,72% 1,19% 0,01% 0,03% 0,01% 0,24% 0,33% 1,07% 0,00% 0,83% 1,15%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS - INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP - INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP - FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES - P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP - FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA - RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES - FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE - HAMILTON LANE FIC FIP . MULTINER FIP - STRATUS SCP BR FIP - P2BR INFR III FIQFIP - MEMORIAL OFFICE FI MOBILIARIO - ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO - BTG PACTUAL CORPOTATE OFFICE FI IMOBILIARIO - CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	470.515,85 3.394.435,97 23.149.458,81 14.493.608,08 5.295.573,06 7.594.716,16 659.640,87 12.842.112,67 14.257.449,30 3.906.644,42 1.353.747,25 1.009.999,92 12.196.470,00 9.352.484,60 10.009.962,52	0,13% 0,91% 6,19% 3,88% 1,42% 2,03% 0,18% 3,44% 3,82% 1,05% 0,36% 0,27% 3,26% 2,50% 2,68%	0,03% 0,19% 1,29% 0,81% 0,30% 0,42% 0,04% 0,72% 0,80% 0,22% 0,08% 0,06% 0,68% 0,52% 0,56%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR - BB MM SCH INV EXTE FI - MSQUARE GL EQ FICFIM - VOT ALLIANZGI FIM	18.801.302,69 13.227.723,33 13.121.939,06	5,03% 3,54% 3,51%	1,05% 0,74% 0,73%
TOTAL	373.686.320,14	91,43%	19,07%
GESTÃO PRÓPRIA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Própria	(%) em relação ao Recursos Garantidores
RENTA FIXA	1.091.778.260,02	77,74%	60,96%
RENTA VARIÁVEL	92.140.476,68	6,56%	5,14%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	104.813.483,50	7,46%	5,85%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	112.438.360,68	8,01%	6,28%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	3.224.410,12	0,23%	0,18%
TOTAL	1.404.394.991,00	100,00%	78,41%