

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO
CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.12.2018

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			2.531.550.000,41		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			1.828.667.482,56	72,24	
TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOURO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOURO NACIONAL					
Nota do Tesouro Nacional		361.266	1.236.915.028	48,86	
APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS			405.723.713,91	16,03	
Certificado de Depósito Bancário		5.002,00	9.471.945,83	0,37	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	4	44.627.825,93	1,76	1,76
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.453.009,07	0,22	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.431.276,56	0,21	0,43
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	5.000	9.471.945,83	0,37	0,37
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-3	-44.627.825,93	-1,76	-1,76
- BANCO MORADA		-3	-10.884.285,63	-0,43	-0,43
Letra Financeira Subordinada		358	130.892.023,82	5,17	
. ABC		37	26.488.969	1,05	1,05
. PARANÁ BANCO		145	38.974.079,52	1,54	1,54
. BRADESCO		176	52.206.228,87	2,06	2,06
. BANCO BTG PACTUAL		1	10.099.373,60	0,40	0,40
. SAFRA		4	3.123.372,77	0,12	0,12
Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.		132.445.176,30	265.359.744,26	10,48	
. SANT FIC FI ISN RF D		516,24	89.308,26	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		29.415.461,41	49.250.385,08	1,95	1,95
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		50.615.372,07	147.289.523,03	5,82	5,82
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		26.704.017,19	29.059.400,13	1,15	1,15
. SAN FC EXTRA RF REF		11,56	14.014,88	0,00	0,00
. METRUS SAUDE RF ANS		6.891.627,03	19.598.094,70	0,77	0,77
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FI MULTIMERCADO II		14.999.454,54	842.218,92	0,03	0,03
. BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP		3.708.925,00	404.204,94	0,02	0,02
. BNP PARIBAS MATCH DI FI RENDA FIXA		627,53	61.390,82	0,00	0,00
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		75.416,68	10.819.480,75	0,43	0,43
. CA INDOSUEZ VITESSE FI RENDA FIXA CP		0,00	0,00	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		8.673,97	266.240,66	0,01	0,01
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		14.724,00	69.475,71	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		8.925,14	22.098,21	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		39,04	5.447.296,22	0,22	0,22
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR		37,48	37,46	0,00	0,00
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		1.347,42	2.126.574,49	0,08	0,08
Debêntures		45.553	105.021.291,10	4,16	
. CEMIG		32.000	46.858.178,99	1,85	1,85
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		1.949	3.504.781,06	0,14	0,14
. LOJAS AMERICANAS		720	8.483.630,89	0,34	0,34
. ECOISTAS		7.000	7.770.493,80	0,31	0,31
. ROTA DAS BANDEIRAS		500	7.562.407,22	0,30	0,30
. SABESP		2.364	20.953.914,46	0,83	0,83
. TRIANGULO DO SOL AUTO - ESTRADAS S/A		345	2.864.488,51	0,11	0,11
VALORES A RECEBER					
. COMANCHE PART.			9.349.383,13	0,37	0,37
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS					
. COMANCHE PART.			-9.349.383,12	-0,37	-0,37
Outros Títulos		51	81.007.450,01	3,20	
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		44	10.042.808,51	0,40	0,40
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	15.436.814,63	0,61	0,61
. VALORES A RECEBER			174.210.710,44	6,88	6,88
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS			-118.682.883,57	-4,69	-4,69

B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			150.769.781,61	5,96	
B1. Mercado de Ações			65.157.960,64	2,57	
Companhias Abertas		2.114.318	47.854.139,13	1,89	
. AMBEV	ON	123.007	1.891.847,66	0,07	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	91.478	2.006.112,54	0,08	
. COSAN	ON	68.400	2.288.664,00	0,09	
. ECORODOVIAS	ON	158.200	1.483.916,00	0,06	
. GERDAU - GGBR	PN	158.788	2.353.238,16	0,09	
. ITAUSA	ON	310	4.123,00	0,00	
. IGUATEMI EMP SHOP S.A	ON	82.900	3.448.640,00	0,14	
. ITAUSA	PN	520.509	6.287.748,72	0,25	
. LOGG COMERCIAL	ON	7.986	143.908	0,01	
. MRVE	ON	110.700	1.368.252,00	0,05	
. PETROBRÁS	PN	275.294	6.243.667,92	0,25	
. RENT	ON	191.661	5.701.914,75	0,23	
. SUZANO PAPEL	PNA	86.500	3.293.920,00	0,13	
. TOTVS	ON	47.500	1.289.625,00	0,05	
. VALE R. DOCE	PNA	191.085	9.745.335,00	0,38	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			303.226,66	0,01	
Instituições Financeiras		465.617	17.303.821,51	0,68	
. BRADESCO	PN	196.846	7.608.097,90	0,30	
. ITAU	PN	268.771	9.541.370,50	0,38	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			154.353,11	0,01	
B2. Fundos		26.325.458,61	85.611.820,97	3,38	
. M. SQUARE INST. FIC FIA		11.563.945,16	27.310.899,10	1,08	
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		11.398.044,90	22.403.442,08	0,88	
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.300.735,63	20.332.255,55	0,80	
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	15.565.224,24	0,61	
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		53.084.067	192.777.692,81	7,62	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP		10.778,33	-17.997,79	0,00	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.414,82	3.008.622,29	0,12	
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.676,93	26.320.563,95	1,04	
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		8.767,00	16.053.932,22	0,63	
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		5.000,00	4.998.014,49	0,20	
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		8.745,22	6.238.905,68	0,25	
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.859.087,84	1.631.384,90	0,06	
. HAMILTON LANE FIC FIP		18.391,51	22.838.102,09	0,90	
. MULTINER FIP		10,17	624.444,47	0,02	
.STRATUS SCP BR FIP		9.286.942,00	12.293.830,94	0,49	
. P2BR INFR III FIQFIP		8.479,00	16.057.487,08	0,63	
. COPA FLORESTAL III		9.582.055,00	12.602.134,09	0,50	
. MAUÁ MACRO II FIC DE FIM		16.237,46	11.629.713,21	0,46	
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		5.754.560,40	10.986.228,65	0,43	
. KINEA CHRONOS FIM		7.213.764,32	11.832.845,10	0,47	
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		7.474.075,30	11.352.686,14	0,45	
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		11.778.262,69	12.175.061,76	0,48	
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		48.819,31	12.151.733,58	0,48	
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		33.445.053	90.514.555,56	3,58	
. BB MM SCH INV EXTE FI		5.128.757,86	21.060.343,93	0,83	
. MSQUARE GL EQ FICFIM		3.342.850,69	15.580.095,49	0,62	
. VOT ALLIANZGI FIM □		7.605.013,33	13.220.326,94	0,52	
. WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI □		6.931,42	9.905.843,60	0,39	
. GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE		92.862,26	10.319.349,16	0,41	
. PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR		7.403.274,30	10.545.984,00	0,42	
. ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR		9.865.363,24	9.882.612,44	0,39	
E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			164.706.619,02	6,51	
E1 - Investimentos em Shopping Center			108.161.020,42	4,27	
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			30.867.450,00	1,22	
. SHOPPING PLAZA SUL			55.268.700,00	2,18	
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			21.766.200,00	0,86	
. VALORES A RECEBER			258.670,42	0,01	
E2 - Investimento Imobiliário			8.521.000,00	0,34	
. PANAMBY			8.521.000,00	0,34	
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00	
E3 - Investimento Fundo Imobiliário		248.794,45	48.024.598,60	1,90	
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		99.010,00	10.238.624,10	0,40	
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		784,45	10.399.771,07	0,41	
. GGR COVEPI RENDA FII		100.000,00	13.489.000,00	0,53	
. MEMORIAL OFFICE FI IMOBILIARIO		10.000,00	874.999,93	0,03	
. ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO		39.000,00	12.910.950,00	0,51	
. VALORES A RECEBER			111.253,50	0,00	

F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		<u>4.497</u>	<u>103.582.121,23</u>	<u>4,09</u>	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		4.497	100.084.922,45	3,95	
. VALORES A PAGAR (-)			-86.350,00	0,00	
. VALORES A RECEBER			3.583.548,78	0,14	
G - OUTROS			<u>531.747,62</u>	<u>0,02</u>	
. DISPONIVEL			1.161.914,79	0,05	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			2.234.265,14	0,09	
. OUTROS REALIZAVEIS			3.628,78	0,00	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-88.891,59	0,00	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-2.779.169,50	-0,11	

GESTÃO TERCEIRIZADA	DISTRIBUIÇÃO	(%) EM RELAÇÃO A GESTÃO TERCEIRIZADA	(%) EM RELAÇÃO AO RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS			
- SANT FIC FI ISN RF D	89.308,26	0,01%	0,00%
- BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP	404.204,94	0,06%	0,02%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO	49.250.385,08	7,32%	1,95%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES	147.289.523,03	21,90%	5,82%
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP	29.059.400,13	4,32%	1,15%
- M. SQUARE INST. FIC FIA	27.310.899,10	4,06%	1,08%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	22.403.442,08	3,33%	0,88%
- BNP PARIBAS MATCH DI FI RENDA FIXA	61.390,82	0,01%	0,00%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP	10.819.480,75	1,61%	0,43%
- IBIUNA EQ. FIC FIA	15.565.224,24	2,31%	0,61%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER	266.240,66	0,04%	0,01%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER II	69.475,71	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER III	22.098,21	0,00%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.	5.447.296,22	0,81%	0,22%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR	37,46	0,00%	0,00%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL	2.126.574,49	0,32%	0,08%
- BRZ MULTIRECEBIVEIS FIC FI MULTIMERCADO II	842.218,92	0,13%	0,03%
- REAL FAQ EXTRA DI - ASSISTENCIAL	14.014,88	0,00%	0,00%
- BRADESCO DED. SAUDE ANS	19.598.094,70	2,91%	0,77%
- BBM SMID CAPS FICFIA	20.332.255,55	3,02%	0,80%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP	(17.997,79)	0,00%	0,00%
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP	3.008.622,29	0,45%	0,12%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	26.320.563,95	3,91%	1,04%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP	16.053.932,22	2,39%	0,63%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA	4.998.014,49	0,74%	0,20%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES	6.238.905,68	0,93%	0,25%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE	1.631.384,90	0,24%	0,06%
- HAMILTON LANE FIC FIP	22.838.102,09	3,40%	0,90%
. MULTINER FIP	624.444,47	0,09%	0,02%
- STRATUS SCP BR FIP	12.293.830,94	1,83%	0,49%
- P2BR INFR III FIQFIP	16.057.487,08	2,39%	0,63%
- COPA FLORESTAL III	12.602.134,09	1,87%	0,50%
- MAUÁ MACRO II FIC DE FIM	11.629.713,21	1,73%	0,46%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS	10.986.228,65	1,63%	0,43%
- KINEA CHRONOS FIM	11.832.845,10	1,76%	0,47%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM	11.352.686,14	1,69%	0,45%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM	12.175.061,76	1,81%	0,48%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM	12.151.733,58	1,81%	0,48%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			
- MEMORIAL OFFICE FI MOBILIARIO	885.299,93	0,13%	0,03%
- ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO	12.977.250,00	1,93%	0,51%
- BTG PACTUAL CORPOTATE OFFICE FI IMOBILIARIO	10.273.277,60	1,53%	0,41%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	10.399.771,07	1,55%	0,41%
- GGR COVEPI RENDA FII	13.489.000,00	2,01%	0,53%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			
- BB MM SCH INV EXTE FI	21.060.343,93	3,13%	0,83%
- MSQUARE GL EQ FICFIM	15.580.095,49	2,32%	0,62%
- VOT ALLIANZGI FIM	13.220.326,94	1,97%	0,52%
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI □	9.905.843,60	1,47%	0,39%
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE	10.319.349,16	1,53%	0,41%
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR	10.545.984,00	1,57%	0,42%
- ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR	9.882.612,44	1,47%	0,39%
TOTAL	672.405.799,80	100,00%	26,56%
GESTÃO PRÓPRIA	DISTRIBUIÇÃO	(%) EM RELAÇÃO A GESTÃO TERCEIRIZADA	(%) EM RELAÇÃO AO RECURSOS GARANTIDORES
RENDA FIXA	1.563.307.738,30	82,40%	61,76%
RENDA VARIÁVEL	65.157.960,64	3,43%	2,57%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	164.706.619,02	8,68%	6,51%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	103.582.121,23	5,46%	4,09%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	531.747,62	0,03%	0,02%
TOTAL	1.897.286.186,81	100,00%	75,00%