

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO
CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 30.06.2017

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO	DIVERSIFICAÇÃO
	TIPO			PATRIMÔNIO (%)	(%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			2.146.558.954,43		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			1.545.482.180,14	72,00	
TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOURO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOURO NACIONAL					
Nota do Tesouro Nacional		417.807	1.130.819.104,90	52,68	
APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS			221.542.513,73	10,32	
Certificado de Depósito Bancário		11.085,00	19.554.053,99	0,91	
. CDB 186 DIAS - CACIQUE	PÓS	78	79.498,40	0,00	0,00
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	4	44.627.825,93	2,08	2,08
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.453.009,07	0,25	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.431.276,56	0,25	0,51
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	5.000	8.238.630,62	0,38	0,38
. CDB 365 DIAS - SOFISA	PÓS	6.000	6.088.331,66	0,28	0,28
. CDB 365 DIAS - BANCO BTG PACTUAL	PÓS	5	5.147.593,31	0,24	0,24
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-3	-44.627.825,93	-2,08	-2,08
- BANCO MORADA		-3	-10.884.285,63	-0,51	-0,51
Letra Financeira Subordinada		293	93.840.626,17	4,37	
. ABC		27	13.831.003	0,64	0,64
. ITAÚ		15	11.143.475,20	0,52	0,52
. PARANÁ BANCO		75	12.740.808,88	0,59	0,59
. BRADESCO		176	44.831.603,94	2,09	2,09
. BANCO BTG PACTUAL		1	8.648.225,33	0,40	0,40
. SAFRA		4	2.645.509,94	0,12	0,12
Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.		28.803.646,78	108.147.833,57	5,04	
. SANT FIC FI ISN RF D		516,24	80.660,72	0,00	0,00
. BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM		2.971.066,38	27.550.859,46	1,28	1,28
. SAN FC EXTRA RF REF		11,56	13.495,72	0,00	0,00
. METRUS SAUDE RF ANS		6.891.627,03	17.801.073,99	0,83	0,83
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FI MULTIMERCADO II		14.999.454,54	12.159.357,47	0,57	0,57
. BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP		3.708.925,00	2.167.386,35	0,10	0,10
. BNP PARIBAS MATCH DI FI RENDA FIXA		124.229,73	27.615.326,56	1,29	1,29
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		75.416,68	11.668.573,58	0,54	0,54
. FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER		8.673,97	42.113,28	0,00	0,00
. FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER II		14.724,00	62.384,86	0,00	0,00
. FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER III		8.925,14	77.457,12	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		39,04	4.919.058,35	0,23	0,23
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR		37,48	3.990.086,11	0,19	0,19
Debêntures		45.001	110.788.253,15	5,17	
. CEMIG		32.000	43.394.606,64	2,02	2,02
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		1.949	9.563.385,95	0,45	0,45
. LOJAS AMERICANAS		720	7.239.566,29	0,34	0,34
. ECOPISTAS		7.000	8.896.008,08	0,41	0,41
. ROTA DAS BANDEIRAS		500	7.795.413,22	0,36	0,36
. SABESP		1.512	19.689.190,49	0,92	0,92
. TRIANGULO DO SOL AUTO - ESTRADAS S/A		345	3.651.336,00	0,17	0,17
. BR TOWERS SPEI S.A.		300	3.299.548	0,15	0,15
VALORES A RECEBER					
. COMANCHE PART.			9.349.383,13	0,44	0,44
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS					
. COMANCHE PART.			-9.349.383,12	-0,44	-0,44
Outros Títulos		68	82.332.308,36	3,84	
. CERTIFICADO DE RECEBÍVEIS IMOBILIARIOS		61	11.282.329,70	0,53	0,53
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	15.522.151,79	0,72	0,72
. VALORES A RECEBER			174.210.710,44	8,12	8,12
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS			-118.682.883,57	-5,53	-5,53

B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			161.715.840,73	7,53
B1. Mercado de Ações			84.611.354,79	3,94
Companhias Abertas		3.424.207	72.982.831,53	3,40
. AMBEV	ON	123.007	2.252.258,17	0,10
. BRF - BRASIL FOODS	ON	91.478	3.585.937,60	0,17
. COSAN	ON	68.400	2.365.272,00	0,11
. ECORODOVIAS	ON	158.200	1.637.370,00	0,08
. EVEN	ON	312.600	1.234.770,00	0,06
. GERDAU - GGBR	PN	158.788	1.632.340,64	0,08
. ITAUSA	ON	304	2.623,52	0,00
. IGUATEMI EMP SHOP S.A	ON	82.900	2.729.068,00	0,13
. ITAUSA	PN	461.996	4.167.203,92	0,19
. MARCOPOLO	PN	282.600	802.584,00	0,04
. MILLS	ON	71.300	260.245,00	0,01
. MRVE	ON	110.700	1.496.664,00	0,07
. PETROBRÁS	PN	275.294	3.405.386,78	0,16
. RANDON PART	PN	200.916	924.213,60	0,04
. RENT	ON	63.887	2.884.498,05	0,13
. RUMO LOG	ON	51.293	443.684,45	0,02
. RUMO LOG DIR	DIR	86.500	1.233.490,00	0,06
. TOTVS	ON	47.500	1.432.600,00	0,07
. VALE R. DOCE	PNA	204.544	5.504.279,04	0,26
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			136.382,76	0,01
Instituições Financeiras		358.133	11.628.523,26	0,54
. BRADESCO	PN	178.952	5.037.498,80	0,23
. ITAU	PN	179.181	6.584.901,75	0,31
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			6.122,71	0,00
B2. Fundos		27.007.028,83	77.104.485,94	3,59
. FATOR SINERGIA V FIA		4.122,00	3.800.939,38	0,18
. M. SQUARE INST. FIC FIA		12.241.393,39	22.919.401,70	1,07
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		11.398.044,90	16.006.059,60	0,75
. GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA		0,00	9.230.328,04	0,43
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.300.735,63	13.916.167,13	0,65
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	11.231.590,09	0,52
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		20.290.243	169.432.708,84	7,89
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP		10.778,33	497.651,33	0,02
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.414,82	3.487.606,64	0,16
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.676,93	23.617.563,43	1,10
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		8.038,00	15.535.715,95	0,72
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		5.000,00	5.267.409,50	0,25
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		8.462,22	8.217.181,47	0,38
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.350.267,53	884.306,75	0,04
. HAMILTON LANE FIC FIP		15.423,36	17.688.828,76	0,82
. MULTINER FIP		9,44	3.391.180,22	0,16
.STRATUS SCP BR FIP		4.715.880,00	6.674.663,20	0,31
. P2BR INFR III FIQFIP		6.944,00	8.207.741,90	0,38
. COPA FLORESTAL III		925.992,00	766.455,29	0,04
. MEMORIAL OFFICE FI IMOBILIARIO		10.000,00	1.104.999,91	0,05
. ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO		39.000,00	12.285.000,00	0,57
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		99.010,00	9.990.109,00	0,47
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		784,45	10.711.045,35	0,50
. GGR COVEPI RENDA FII		100.000,00	10.584.552,65	0,49
. MAUÁ MACRO II FIC DE FIM		16.237,46	10.103.133,47	0,47
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		5.754.560,40	10.185.449,92	0,47
. KINEA CHRONOS FIM		7.213.764,32	10.100.628,40	0,47
. VALORES A RECEBER			131.485,70	0,01
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		16.076.622	43.661.560,07	2,03
. BB MM SCH INV EXTE FI		5.128.757,86	17.882.603,71	0,83
. MSQUARE GL EQ FICFIM		3.342.850,69	13.252.988,66	0,62
. VOT ALLIANZGI FIM		7.605.013,33	12.525.967,70	0,58
D-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			104.575.749,01	4,87
D1 - Investimentos em Shopping Center			96.375.749,01	4,49
. SHOPPING METRÕ BOULEVARD TATUAPÉ			26.070.299,45	1,21
. SHOPPING PLAZA SUL			51.506.433,83	2,40
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			18.296.378,77	0,85
. VALORES A RECEBER			502.636,96	0,02
D2 - Investimento Imobiliário			8.200.000,00	0,38
. PANAMBY			8.200.000,00	0,38
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00

E - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		5.002	119.727.789,35	5,58	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		5.002	115.789.744,26	5,39	
. VALORES A PAGAR (-)			-42.056,20	0,00	
. VALORES A RECEBER			3.980.101,29	0,19	
F - OUTROS			1.963.126,29	0,09	
. DISPONIVEL			3.034.987,45	0,14	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			755.030,05	0,04	
. OUTROS REALIZAVEIS			391.612,10	0,02	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-1.404.621,98	-0,07	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-813.881,33	-0,04	

GESTÃO TERCEIRIZADA	DISTRIBUIÇÃO	(%) EM RELAÇÃO A GESTÃO TERCEIRIZADA	(%) EM RELAÇÃO AO RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS			
- ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM	80.660,72	0,02%	0,00%
- FUNDO FATOR SINERGIA V	3.800.939,38	0,95%	0,18%
- BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP	2.167.386,35	0,54%	0,10%
- BRADESCO FI REF DI PREMIUM	27.550.859,46	6,91%	1,28%
- M. SQUARE INST. FIC FIA	22.919.401,70	5,75%	1,07%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	16.006.059,60	4,02%	0,75%
- GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA	9.230.328,04	2,32%	0,43%
- BNP PARIBAS MATCH DI FI RENDA FIXA	27.615.326,56	6,93%	1,29%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP	11.668.573,58	2,93%	0,54%
- IBIUNA EQ. FIC FIA	11.231.590,09	2,82%	0,52%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	42.113,28	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	62.384,86	0,02%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	77.457,12	0,02%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.	4.919.058,35	1,23%	0,23%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR	3.990.086,11	1,00%	0,19%
- BRZ MULTIRECEBIVEIS FIC FI MULTIMERCADO II	12.159.357,47	3,05%	0,57%
- REAL FAQ EXTRA DI - ASSISTENCIAL	13.495,72	0,00%	0,00%
- BRADESCO DED. SAUDE ANS	17.801.073,99	4,47%	0,83%
- BBM SMID CAPS FICFIA	13.916.167,13	3,49%	0,65%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP	497.651,33	0,12%	0,02%
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP	3.487.606,64	0,88%	0,16%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	23.617.563,43	5,93%	1,10%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP	15.535.715,95	3,90%	0,72%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA	5.267.409,50	1,32%	0,25%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES	8.217.181,47	2,06%	0,38%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE	884.306,75	0,22%	0,04%
- HAMILTON LANE FIC FIP	17.688.828,76	4,44%	0,82%
. MULTINER FIP	3.391.180,22	0,85%	0,16%
- STRATUS SCP BR FIP	6.674.663,20	1,68%	0,31%
- P2BR INFR III FIQFIP	8.207.741,90	2,06%	0,38%
- COPA FLORESTAL III	766.455,29	0,19%	0,04%
- MEMORIAL OFFICE FI MOBILIARIO	1.114.999,91	0,28%	0,05%
- ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO	12.392.250,00	3,11%	0,58%
- BTG PACTUAL CORPOTATE OFFICE FI IMOBILIARIO	10.090.109,10	2,53%	0,47%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	10.711.045,35	2,69%	0,50%
- GGR COVEPI RENDA FII	10.584.552,65	2,66%	0,49%
- MAUÁ MACRO II FIC DE FIM	10.103.133,47	2,54%	0,47%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS	10.185.449,92	2,56%	0,47%
- KINEA CHRONOS FIM	10.100.628,40	2,54%	0,47%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			
- BB MM SCH INV EXTE FI	17.882.603,71	4,49%	0,83%
- MSQUARE GL EQ FICFIM	13.252.988,66	3,33%	0,62%
- VOT ALLIANZGI FIM	12.525.967,70	3,14%	0,58%
TOTAL	398.432.352,82	100,00%	18,56%
GESTÃO PRÓPRIA	DISTRIBUIÇÃO	(%) EM RELAÇÃO A GESTÃO TERCEIRIZADA	(%) EM RELAÇÃO AO RECURSOS GARANTIDORES
RENDA FIXA	1.437.334.346,57	82,22%	66,97%
RENDA VARIÁVEL	84.611.354,79	4,84%	3,94%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	104.575.749,01	5,98%	4,87%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	119.727.789,35	6,85%	5,58%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	1.963.126,29	0,11%	0,09%
TOTAL	1.748.212.366,01	100,00%	81,44%