

**RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO
CONSOLIDADO**

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 28.06.2019

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCACÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			2.689.878.306,60		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			1.811.986.062,95	67,36	
<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>		355.371	1.200.780.617	44,64	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			504.894.079,63	18,77	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		5.002,00	9.981.579,16	0,37	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	4	44.627.825,93	1,66	1,66
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.453.009,07	0,20	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.431.276,56	0,20	0,40
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	5.000	9.981.579,16	0,37	0,37
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-3	-44.627.825,93	-1,66	-1,66
- BANCO MORADA		-3	-10.884.285,63	-0,40	-0,40
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		357	105.258.628,40	3,91	
. ABC		21	11.030.706	0,41	0,41
. PARANÁ BANCO		160	35.822.757,59	1,33	1,33
. BRADESCO		176	55.087.313,33	2,05	2,05
. SAFRA		4	3.317.851,74	0,12	0,12
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		183.086.625,84	389.653.872,07	14,49	
. SANT FIC FI ISN RF D		516,24	92.064,12	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		18.889.257,64	41.112.206,44	1,53	1,53
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		23.259.652,63	69.956.963,55	2,60	2,60
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		17.182.348,07	39.375.754,44	1,46	1,46
. SAN FC EXTRA RF REF		11,56	14.130,93	0,00	0,00
. BRADESCO DED. SAUDE ANS		6.891.627,03	20.159.248,90	0,75	0,75
. AF GERAES 30		36.490.623,73	40.307.539,32	1,50	1,50
. BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP		3.708.925,00	403.760,24	0,02	0,02
. CA AG VITESSE		1.998.134,60	44.882.874,55	1,67	1,67
. BNP PARIBAS MATCH DI FI RENDA FIXA		627,53	63.214,35	0,00	0,00
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		75.416,68	10.783.176,14	0,40	0,40
. AZ QUEST LUCE		46.312.727,30	65.466.157,84	2,43	2,43
. ARX VINSON FI RF CP		28.243.048,26	30.055.246,51	1,12	1,12
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		8.673,97	257.646,42	0,01	0,01
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		14.724,00	47.732,79	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		8.925,14	9.348,13	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		39,04	3.900.565,22	0,15	0,15
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		1.347,42	4.531.742,18	0,17	0,17
. VALORES A RECEBER			18.234.500,00	0,68	0,68
<u>Debêntures</u>		44.737	87.535.289,64	3,26	
. CEMIG		32.000	46.735.427,05	1,74	1,74
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		1.949	2.126.070,07	0,08	0,08
. LOJAS AMERICANAS		720	8.805.829,32	0,33	0,33
. ECOPISTAS		7.000	7.260.481,98	0,27	0,27
. ROTA DAS BANDEIRAS		500	7.595.454,17	0,28	0,28
. SABESP		2.223	12.868.322,75	0,48	0,48
. TRIANGULO DO SOL AUTO - ESTRADAS S/A		345	2.143.703,99	0,08	0,08
. VALORES A RECEBER					
. COMANCHE PART.			9.349.383,13	0,35	0,35
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS					
. COMANCHE PART.			-9.349.383,12	-0,35	-0,35
<u>Outros Títulos</u>		51	18.776.076,40	0,70	
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		44	7.761.952,26	0,29	0,29
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	15.306.346,22	0,57	0,57
. VALORES A RECEBER			3.274.905,95	0,12	0,12
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS			-7.567.128,03	-0,28	-0,28

B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			249.862.495,67	9,29
B1. Mercado de Ações			72.993.805,23	2,71
Companhias Abertas		2.210.918	54.324.938,74	2,02
. AMBEV	ON	128.007	2.290.045,23	0,09
. BRF - BRASIL FOODS	ON	91.478	2.700.430,56	0,10
. COSAN	ON	68.400	3.156.660,00	0,12
. ECORODOVIAS	ON	158.200	1.702.232,00	0,06
. FLEURY	ON	222.000	4.739.700	0,18
. GERDAU - GGBR	PN	158.788	2.413.577,60	0,09
. ITAUSA	ON	310	4.079,60	0,00
. ITAUSA	PN	520.509	6.709.361,01	0,25
. LOGG COMERCIAL	ON	7.986	159.161	0,01
. MRVE	ON	110.700	2.166.399,00	0,08
. PETROBRÁS	PN	275.294	7.545.808,54	0,28
. RENT	ON	191.661	7.854.267,78	0,29
. SUZANO PAPEL	PNA	86.500	2.841.525,00	0,11
. VALE R. DOCE	PNA	191.085	9.902.024,70	0,37
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			139.666,74	0,01
Instituições Financeiras		504.985	18.668.866,49	0,69
. BRADESCO	PN	236.214	8.914.716,36	0,33
. ITAU	PN	268.771	9.745.636,46	0,36
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			8.513,67	0,00
B2. Fundos		49.522.521,13	176.868.690,44	6,58
. M. SQUARE INST. FIC FIA		6.293.092,63	18.073.127,12	0,67
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		15.690.874,77	37.429.452,18	1,39
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.096.544,16	22.346.106,90	0,83
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	17.716.388,70	0,66
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		87.042,25	13.630.655,37	0,51
. MOAT CAPITAL FIA		10.351.340,47	32.572.971,95	1,21
. SPX APACHE FIA		13.940.893,93	35.099.988,22	1,30
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		83.511.038	272.006.249,74	10,11
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP		10.778,33	-43.339,31	0,00
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.414,82	2.209.592,42	0,08
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.676,93	25.637.126,46	0,95
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.090,00	17.222.547,21	0,64
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		5.000,00	5.051.868,05	0,19
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		8.918,22	6.067.575,71	0,23
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.861.401,17	1.619.283,13	0,06
. HAMILTON LANE FIC FIP		19.301,67	25.630.393,90	0,95
. MULTINER FIP		10,17	-29.455,65	0,00
. STRATUS SCP BR FIP		9.286.942,00	12.694.367,46	0,47
. P2BR INFR III FIQFIP		8.775,00	18.046.654,58	0,67
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	16.184.802,10	0,60
. MAUÁ MACRO II FIC DE FIM		25.439,73	18.417.164,47	0,68
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		9.097.590,07	18.255.133,25	0,68
. KINEA CHRONOS FIM		7.213.764,32	12.341.437,13	0,46
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		15.860.872,32	25.276.343,20	0,94
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		29.971.798,56	32.824.337,51	1,22
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		121.264,39	34.600.418,16	1,29
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		33.445.053	102.513.415,62	3,81
. BB MM SCH INV EXTE FI		5.128.757,86	24.141.273,12	0,90
. MSQUARE GL EQ FICFIM		3.342.850,69	18.480.734,13	0,69
. VOT ALLIANZGI FIM		7.605.013,33	15.722.339,29	0,58
. WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI		6.931,42	10.928.676,74	0,41
. GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE		92.862,26	11.452.186,02	0,43
. PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR		7.403.274,30	11.369.162,88	0,42
. ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR		9.865.363,24	10.419.043,44	0,39
E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			160.372.802,83	5,96
E1 - Investimentos em Shopping Center			107.411.235,76	3,99
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			30.481.606,86	1,13
. SHOPPING PLAZA SUL			55.268.700,00	2,05
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			21.487.146,16	0,80
. VALORES A RECEBER			173.782,74	0,01
E2 - Investimento Imobiliário			8.521.000,00	0,32
. PANAMBY			8.521.000,00	0,32
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00
E3 - Investimento Fundo Imobiliário		280.554,45	44.440.567,07	1,65
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		146.960,00	9.555.455,10	0,36
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		784,45	10.413.571,77	0,39
. GGR COVEPI RENDA FII		132.810,00	22.343.867,22	0,83
. VALORES A RECEBER			2.129.906,52	0,08
. VALORES A PAGAR			-2.233,54	0,00

F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		4.315	96.420.510,83	3,58	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		4.315	92.877.100,29	3,45	
. VALORES A PAGAR (-)			-45.874,75	0,00	
. VALORES A RECEBER			3.589.285,29	0,13	
G - OUTROS			-3.283.231,04	-0,12	
. DISPONIVEL			1.002.062,70	0,04	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			2.721.596,79	0,10	
. OUTROS REALIZAVEIS			266.371,22	0,01	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-5.116.602,98	-0,19	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-2.156.658,77	-0,08	

GESTÃO TERCEIRIZADA	DISTRIBUIÇÃO	(%) EM RELAÇÃO A GESTÃO TERCEIRIZADA	(%) EM RELAÇÃO AO RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS			
- SANT FIC FI ISN RF D	92.064,12	0,01%	0,00%
- BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP	403.760,24	0,04%	0,02%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO	41.112.206,44	4,26%	1,53%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES	69.956.963,55	7,25%	2,60%
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP	39.375.754,44	4,08%	1,46%
- M. SQUARE INST. FIC FIA	18.073.127,12	1,87%	0,67%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	37.429.452,18	3,88%	1,39%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA	13.630.655,37	1,41%	0,51%
- MOAT CAPITAL FIA	32.572.971,95	3,37%	1,21%
- BNP PARIBAS MATCH DI FI RENDA FIXA	63.214,35	0,01%	0,00%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP	10.783.176,14	1,12%	0,40%
- SPX APACHE FIA	35.099.988,22	3,64%	1,30%
- CA INDOSUEZ VITESSE FI RENDA FIXA CP	44.882.874,55	4,65%	1,67%
- IBIUNA EQ. FIC FIA	17.716.388,70	1,84%	0,66%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	257.646,42	0,03%	0,01%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	47.732,79	0,00%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	9.348,13	0,00%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.	3.900.565,22	0,40%	0,15%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL	4.531.742,18	0,47%	0,17%
- REAL FAQ EXTRA DI - ASSISTENCIAL	14.130,93	0,00%	0,00%
- BRADESCO DED. SAUDE ANS	20.159.248,90	2,09%	0,75%
- BBM SMID CAPS FICFIA	22.346.106,90	2,32%	0,83%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES 30	40.307.539,32	4,18%	1,50%
- AZ QUEST LUCE	65.466.157,84	6,78%	2,43%
- ARX VINSON FI RF CP	30.055.246,51	3,11%	1,12%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP	(43.339,31)	0,00%	0,00%
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP	2.209.592,42	0,23%	0,08%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	25.637.126,46	2,66%	0,95%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP	17.222.547,21	1,78%	0,64%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA	5.051.868,05	0,52%	0,19%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES	6.067.575,71	0,63%	0,23%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE	1.619.283,13	0,17%	0,06%
- HAMILTON LANE FIC FIP	25.630.393,90	2,66%	0,95%
. MULTINER FIP	-29.455,65	0,00%	0,00%
- STRATUS SCP BR FIP	12.694.367,46	1,32%	0,47%
- P2BR INFR III FIQFIP	18.046.654,58	1,87%	0,67%
- COPA FLORESTAL III	16.184.802,10	1,68%	0,60%
- MAUÁ MACRO II FIC DE FIM	18.417.164,47	1,91%	0,68%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS	18.255.133,25	1,89%	0,68%
- KINEA CHRONOS FIM	12.341.437,13	1,28%	0,46%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM	25.276.343,20	2,62%	0,94%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM	32.824.337,51	3,40%	1,22%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM	34.600.418,16	3,58%	1,29%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO	9.600.009,60	0,99%	0,36%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	10.413.571,77	1,08%	0,39%
- GGR COVEPI RENDA FII	22.343.867,22	2,32%	0,83%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			
- BB MM SCH INV EXTE FI	24.141.273,12	2,50%	0,90%
- MSQUARE GL EQ FICFIM	18.480.734,13	1,91%	0,69%
- VOT ALLIANZGI FIM	15.722.339,29	1,63%	0,58%
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI	10.928.676,74	1,13%	0,41%
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE	11.452.186,02	1,19%	0,43%
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR	11.369.162,88	1,18%	0,42%
- ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR	10.419.043,44	1,08%	0,39%
TOTAL	965.165.176,50	100,00%	36,64%

GESTÃO PRÓPRIA	DISTRIBUIÇÃO	(%) EM RELAÇÃO A GESTÃO PRÓPRIA	(%) EM RELAÇÃO AO RECURSOS GARANTIDORES
REDA FIXA	1.414.570.238,62	83,00%	52,59%
REDA VARIÁVEL	72.993.805,23	4,28%	2,71%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	123.694.188,02	7,26%	4,60%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	96.420.510,83	5,66%	3,58%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	-3.283.231,04	-0,19%	-0,12%
TOTAL	1.704.395.511,66	100,00%	63,36%