

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO
CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 30.12.2016

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			2.029.835.959,62		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			1.487.372.320,29	73,29	
<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>		366.539	1.066.687.352,99	52,55	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			230.819.102,49	11,37	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		29.075,00	47.051.897,20	2,32	
. CDB 186 DIAS - BANCO CACIQUE	PÓS	73	75.246,06	0,00	0,00
. CDB 7307 DIAS - BANCO CRUZEIRO DO SUL	PÓS	4	44.627.825,93	2,20	2,20
. CDB 1826 DIAS - BANCO MORADA	PÓS	2	5.453.009,07	0,27	
. CDB 1827 DIAS - BANCO MORADA	PÓS	2	5.431.276,56	0,27	0,54
. CDB 2924 DIAS - BANCO PANAMERICANO	PÓS	5.000	7.871.431,87	0,39	0,39
. CDB 365 DIAS - BANCO SOFISA	PÓS	7.000	6.542.665,63	0,32	0,32
. CDB 2995 DIAS - BANCO VOTORANTIM	PÓS	6.000	20.505.110,91	1,01	1,01
. CDB 365 DIAS - BANCO BMG	PÓS	5.000	5.385.517,64	0,27	0,27
. CDB 362 DIAS - PARANÁ BANCO	PÓS	6.000	6.671.925,09	0,33	0,33
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-3	-44.627.825,93	-2,20	-2,20
- BANCO MORADA		-3	-10.884.285,63	-0,54	-0,54
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		189	76.334.518,20	3,76	
. BANCO ABC		19	21.285.818,37	1,05	1,05
. BANCO ITAÚ		18	10.619.766,37	0,52	0,52
. BANCO PINE		1	1.194.412,32	0,06	0,06
. BANCO BRADESCO		151	32.488.036,93	1,60	1,60
. BANCO BTG PACTUAL		1	8.236.496,24	0,41	0,41
. BANCO SAFRA		4	2.509.987,97	0,12	0,12
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		28.513.099,26	107.432.687,09	5,29	
. ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM		516,24	76.224,89	0,00	0,00
. BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM		2.692.668,62	26.082.753,72	1,28	1,28
. SANTANDER FC EXTRA RF REF		11,56	13.041,82	0,00	0,00
. BRAD DED SAUD SU ANS		6.891.627,03	16.868.920,81	0,83	0,83
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FI MULTIMERCADO II		14.999.454,54	12.340.260,79	0,61	0,61
. BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP		3.708.925,00	2.075.878,65	0,10	0,10
. BNP PARIBAS MATCH DI FI RENDA FIXA		112.079,97	26.800.748,89	1,32	1,32
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		75.416,68	11.035.374,23	0,54	0,54
. FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER		8.673,97	478.581,21	0,02	0,02
. FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER II		14.724,00	1.148.608,75	0,06	0,06
. FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER III		8.925,14	207.203,80	0,01	0,01
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		39,04	4.656.861,34	0,23	0,23
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR		37,48	5.648.228,19	0,28	0,28
<u>Debêntures</u>		44.836	107.310.249,04	5,30	
. CEMIG DISTRIBUIÇÃO S A		32.000	43.880.789,03	2,16	2,16
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		1.949	12.479.234,97	0,61	0,61
. LOCALIZA RENT A CAR S/A		675	7.316.522,63	0,36	0,36
. ECOPISTAS		7.000	9.130.292,58	0,45	0,45
. CONCESSIONARIA ROTA DAS BANDEIRAS S.A.		500	7.830.752,56	0,39	0,39
. CIA DE SAN. BÁSICO DO EST. DE S.PAULO - SABESP		1.962	19.669.486,34	0,97	0,97
. TRIANGULO DO SOL AUTO - ESTRADAS S/A		450	3.703.447,89	0,18	0,18
. BR TOWERS SPEI S.A.		300	3.299.723	0,16	0,16
. VALORES A RECEBER					
. COMANCHE PART.			9.349.383,13	0,46	0,46
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS					
. COMANCHE PART.			-9.349.383,12	-0,46	-0,46
<u>Outros Títulos</u>		68	82.555.615,77	4,07	
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		61	11.070.570,22	0,55	0,55
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	15.957.218,68	0,79	0,79
. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCARIO		0	0,00	0,00	0,00
. DEPOSITO A PRAZO COM GARANTIA ESPECIAL		0	0,00	0,00	0,00
. VALORES A RECEBER			174.210.710,44	8,58	8,58
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS			-118.682.883,57	-5,85	-5,85

B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			156.443.081,69	7,71	
B1. Mercado de Ações			80.849.516,44	3,98	
Companhias Abertas		3.539.891	69.827.988,33	3,44	
. AMBEV	ON	123.007	2.017.314,80	0,10	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	91.478	4.413.813,50	0,22	
. COSAN	ON	68.400	2.609.460,00	0,13	
. ECORODOVIAS	ON	158.200	1.303.568,00	0,06	
. EVEN	ON	312.600	1.156.620,00	0,06	
. GERDAU - GGBR	PN	158.788	1.714.910,40	0,08	
. ISHARES BOVA	CI	572.000	33.313.280,00	1,64	
. IGUATEMI EMP SHOP S.A	ON	82.900	2.210.943,00	0,11	
. ITAUSA	PN	454.192	3.760.709,76	0,19	
. MARCOPOLO	PN	282.600	774.324,00	0,04	
. MILLS	ON	198.134	774.703,94	0,04	
. MRVE	ON	110.700	1.211.058,00	0,06	
. PETROBRÁS	PN	275.294	4.093.621,78	0,20	
. RANDON PART	PN	200.916	693.160,20	0,03	
. RENT	ON	60.845	2.082.115,90	0,10	
. RUMO LOG	ON	51.293	314.939,02	0,02	
. RUMO LOG DIR	DIR	86.500	1.228.300,00	0,06	
. TOTVS	ON	47.500	1.141.900,00	0,06	
. VALE R. DOCE	PNA	204.544	4.774.056,96	0,24	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			239.189,07	0,01	
Instituições Financeiras		335.290	11.021.528,11	0,54	
. BANCO BRADESCO	PN	165.185	4.717.865,00	0,23	
. BANCO ITAU	PN	170.105	6.065.276,85	0,30	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			238.386,26	0,01	
B2. Fundos		29.957.260,40	75.593.565,25	3,72	
. FATOR SINERGIA V FIA		4.122,00	3.101.143,98	0,15	
. M. SQUARE INST. FIC FIA		14.114.510,68	24.275.669,29	1,20	
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		11.685.125,45	14.400.252,57	0,71	
. GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA		746.606,39	10.448.585,09	0,51	
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.344.162,97	12.918.751,70	0,64	
. IBIUNA EQUITIES FIC FIA		62.732,91	10.449.162,62	0,51	
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		22.711.275	118.330.209,50	5,83	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP		10.778,33	265.610,46	0,01	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.385,34	3.413.062,31	0,17	
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.676,93	23.569.246,22	1,16	
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		7.911,00	15.168.592,12	0,75	
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		5.000,00	5.116.107,24	0,25	
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		8.350,22	8.164.538,30	0,40	
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.209.949,14	847.759,32	0,04	
. HAMILTON LANE FIC FIP		14.625,00	15.102.992,97	0,74	
. MULTINER FIP		9,44	3.365.538,12	0,17	
.STRATUS SCP BR FIP		4.715.880,00	6.550.225,28	0,32	
. P2BR INFR III FIQFIP		3.293,00	3.629.216,04	0,18	
. COPA FLORESTAL III		500.000,00	371.511,81	0,02	
. MEMORIAL OFFICE FI IMOBILIARIO		10.000,00	1.038.999,92	0,05	
. ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO		39.000,00	11.428.170,00	0,56	
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		99.010,00	9.455.455,00	0,47	
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		784,45	10.698.816,99	0,53	
. VALORES A RECEBER			144.367,40	0,01	
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		16.076.622	37.300.306,26	1,84	
. BB MM SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI		5.128.757,86	15.519.899,30	0,76	
. MSQUARE GLOBAL EQUITY MANAGERS FICFIM - IE		3.342.850,69	11.473.176,56	0,57	
. VOT ALLIANZGI EUROPE FIM		7.605.013,33	10.307.230,40	0,51	
D-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			105.227.350,50	5,18	
D1 - Investimentos em Shopping Center			97.027.350,50	4,78	
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			26.392.155,00	1,30	
. SHOPPING PLAZA SUL			51.507.000,00	2,54	
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			18.522.260,00	0,91	
. VALORES A RECEBER			605.935,50	0,03	
D2 - Investimento Imobiliário			8.200.000,00	0,40	
. PANAMBY			8.200.000,00	0,40	
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00	
E - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		5.116	124.495.250,95	6,13	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		5.116	121.626.233,12	5,99	
. VALORES A PAGAR (-)			-666.878,82	-0,03	
. VALORES A RECEBER			3.535.896,65	0,17	

F - OUTROS			667.440,43	0,03	
. DISPONIVEL			1.767.402,23	0,09	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			745.434,58	0,04	
. OUTROS REALIZAVEIS			388.073,92	0,02	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-1.452.098,20	-0,07	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-781.372,10	-0,04	

GESTÃO TERCEIRIZADA	DISTRIBUIÇÃO	(%) EM RELAÇÃO A GESTÃO TERCEIRIZADA	(%) EM RELAÇÃO AO RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS			
- ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM	76.224,89	0,02%	0,00%
- FUNDO FATOR SINERGIA V	3.101.143,98	0,92%	0,15%
- BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP	2.075.878,65	0,61%	0,10%
- BRADESCO FI REF DI PREMIUM	26.082.753,72	7,70%	1,28%
- M. SQUARE INST. FIC FIA	24.275.669,29	7,17%	1,20%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	14.400.252,57	4,25%	0,71%
- GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA	10.448.585,09	3,08%	0,51%
- BNP PARIBAS MATCH DI FI RENDA FIXA	26.800.748,89	7,91%	1,32%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP	11.035.374,23	3,26%	0,54%
- IBIUNA EQUITIES FIC FIA	10.449.162,62	3,08%	0,51%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER	478.581,21	0,14%	0,02%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER II	1.148.608,75	0,34%	0,06%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER III	207.203,80	0,06%	0,01%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.	4.656.861,34	1,37%	0,23%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR	5.648.228,19	1,67%	0,28%
- BRZ MULTIRECEBIVEIS FIC FI MULTIMERCADO II	12.340.260,79	3,64%	0,61%
- REAL FAQ EXTRA DI - ASSISTENCIAL	13.041,82	0,00%	0,00%
- BRADESCO DED. SAUDE ANS	16.868.920,81	4,98%	0,83%
- BBM SMID CAPS FICFIA	12.918.751,70	3,81%	0,64%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP	265.610,46	0,08%	0,01%
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP	3.413.062,31	1,01%	0,17%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	23.569.246,22	6,96%	1,16%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP	15.168.592,12	4,48%	0,75%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA	5.116.107,24	1,51%	0,25%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES	8.164.538,30	2,41%	0,40%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE	847.759,32	0,25%	0,04%
- HAMILTON LANE FIC FIP	15.102.992,97	4,46%	0,74%
- MULTINER FIP	3.365.538,12	0,99%	0,17%
- STRATUS SCP BR FIP	6.550.225,28	1,93%	0,32%
- P2BR INFR III FIQFIP	3.629.216,04	1,07%	0,18%
- COPA FLORESTAL III	371.511,81	0,11%	0,02%
- MEMORIAL OFFICE FI MOBILIARIO	1.048.999,92	0,31%	0,05%
- ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO	11.535.420,00	3,41%	0,57%
- BTG PACTUAL CORPOTATE OFFICE FI IMOBILIARIO	9.555.455,10	2,82%	0,47%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	10.698.816,99	3,16%	0,53%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			
- BB MM SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	15.519.899,30	4,58%	0,76%
- MSQUARE GLOBAL EQUITY MANAGERS FICFIM - IE	11.473.176,56	3,39%	0,57%
- VOT ALLIANZGI EUROPE FIM	10.307.230,40	3,04%	0,51%
TOTAL	338.729.650,80	100,00%	16,69%
GESTÃO PRÓPRIA	DISTRIBUIÇÃO	(%) EM RELAÇÃO A GESTÃO TERCEIRIZADA	(%) EM RELAÇÃO AO RECURSOS GARANTIDORES
RENDA FIXA	1.379.939.633,20	81,60%	67,99%
RENDA VARIÁVEL	80.849.516,44	4,78%	3,98%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	105.227.350,50	6,22%	5,18%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	124.495.250,95	7,36%	6,13%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	667.440,43	0,04%	0,03%
TOTAL	1.691.179.191,52	100,00%	83,32%