

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

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 29.12.2017

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			2.298.456.029,20		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			1.633.478.548,88	71,07	
<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>		331.791	1.088.776.358,90	47,37	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			351.464.338,25	15,29	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		11.007,00	20.280.322,65	0,88	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	4	44.627.825,93	1,94	1,94
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.453.009,07	0,24	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.431.276,56	0,24	0,47
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	5.000	8.582.119,62	0,37	0,37
. CDB 365 DIAS - SOFISA	PÓS	6.000	6.336.203,75	0,28	0,28
. CDB 365 DIAS - BANCO BTG PACTUAL	PÓS	5	5.361.999,28	0,23	0,23
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-3	-44.627.825,93	-1,94	-1,94
- BANCO MORADA		-3	-10.884.285,63	-0,47	-0,47
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		278	86.301.544,29	3,75	
. ABC		27	14.473.710	0,63	0,63
. ITAÚ		0	-	0,00	0,00
. PARANÁ BANCO		75	13.309.141,16	0,58	0,58
. BRADESCO		176	46.668.625,39	2,03	2,03
. BANCO BTG PACTUAL		1	9.066.710,28	0,39	0,39
. SAFRA		4	2.783.357,22	0,12	0,12
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		132.481.033,72	244.882.471,31	10,65	
. SANT FIC FI ISN RF D		516,24	83.975,70	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		56.908.740,33	89.669.770,47	3,90	3,90
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		37.554.346,06	10.625.321,17	0,46	0,46
. SAN FC EXTRA RF REF		11,56	13.754,55	0,00	0,00
. METRUS SAUDE RF ANS		6.891.627,03	18.491.646,07	0,80	0,80
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FI MULTIMERCADO II		14.999.454,54	10.784.048,76	0,47	0,47
. BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMÁRIAS II FIRF CP		3.708.925,00	1.543.947,91	0,07	0,07
. BNP PARIBAS MATCH DI FI RENDA FIXA		10.549,71	2.774.876,73	0,12	0,12
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		75.416,68	11.830.183,37	0,51	0,51
. CA INDOSUEZ VITESSE FI RENDA FIXA CP		2.759.321,33	55.731.414,54	2,42	2,42
. ICATU VANGUARDA CP FI RENDA FIXA LONGO PRAZO		9.539.725,62	33.584.966,56	1,46	1,46
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		8.673,97	421.349,81	0,02	0,02
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		14.724,00	230.306,47	0,01	0,01
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		8.925,14	885.001,59	0,04	0,04
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		39,04	5.103.869,18	0,22	0,22
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR		37,48	3.108.038,43	0,14	0,14
<u>Debêntures</u>		45.001	110.893.890,42	4,83	
. CEMIG		32.000	45.043.455,17	1,96	1,96
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		1.949	6.914.832,29	0,30	0,30
. LOJAS AMERICANAS		720	8.001.379,08	0,35	0,35
. ECOPISTAS		7.000	8.553.332,05	0,37	0,37
. ROTA DAS BANDEIRAS		500	7.657.361,10	0,33	0,33
. SABESP		1.512	20.708.651,62	0,90	0,90
. TRIANGULO DO SOL AUTO - ESTRADAS S/A		345	3.614.249,59	0,16	0,16
. BR TOWERS SPEI S.A.		300	3.301.835	0,14	0,14
. VALORES A RECEBER					
. COMANCHE PART.			9.349.383,13	0,41	0,41
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS					
. COMANCHE PART.			-9.349.383,12	-0,41	-0,41
<u>Outros Títulos</u>		68	82.343.961,31	3,58	
. CERTIFICADO DE RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS		61	11.618.945,94	0,51	0,51
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	15.197.188,50	0,66	0,66
. VALORES A RECEBER			174.210.710,44	7,58	7,58
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS			-118.682.883,57	-5,16	-5,16

B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			183.491.736,20	7,98
B1. Mercado de Ações			103.427.600,36	4,50
Companhias Abertas		3.467.222	89.560.059,01	3,90
. AMBEV	ON	123.007	2.617.588,96	0,11
. BRF - BRASIL FOODS	ON	91.478	3.348.094,80	0,15
. COSAN	ON	68.400	2.838.600,00	0,12
. ECORODOVIAS	ON	158.200	1.945.860,00	0,08
. EVEN	ON	312.600	1.794.324,00	0,08
. GERDAU - GGBR	PN	158.788	1.965.795,44	0,09
. ITAUSA	ON	304	3.198,08	0,00
. IGUATEMI EMP SHOP S.A	ON	82.900	3.265.431,00	0,14
. ITAUSA	PN	461.996	4.998.796,72	0,22
. MARCOPOLO	PN	282.600	1.127.574,00	0,05
. MRVE	ON	110.700	1.664.928,00	0,07
. PETROBRÁS	PN	275.294	4.432.233,40	0,19
. RANDON PART	PN	200.916	1.440.567,72	0,06
. RENT	ON	191.661	4.228.041,66	0,18
. RUMO LOG	ON	51.293	665.270,21	0,03
. RUMO LOG DIR	DIR	86.500	1.616.685,00	0,07
. TOTVS	ON	47.500	1.419.775,00	0,06
. VALE R. DOCE	PNA	191.085	7.693.082,10	0,33
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			269.172,92	0,01
Instituições Financeiras		358.133	13.867.541,35	0,60
. BRADESCO	PN	178.952	6.057.525,20	0,26
. ITAU	PN	179.181	7.629.526,98	0,33
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			180.489,17	0,01
B2. Fundos		26.329.580,61	80.064.135,84	3,48
. FATOR SINERGIA V FIA		4.122,00	5.311.895,98	0,23
. M. SQUARE INST. FIC FIA		11.563.945,16	25.113.215,73	1,09
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		11.398.044,90	18.998.453,86	0,83
. GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA		0,00	0,00	0,00
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.300.735,63	17.284.963,61	0,75
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	13.355.606,66	0,58
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		21.822.294	173.894.796,35	7,57
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP		10.778,33	59.863,09	0,00
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.414,82	3.793.666,93	0,17
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.676,93	24.933.107,73	1,08
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		8.136,00	13.833.974,17	0,60
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		5.000,00	5.115.546,12	0,22
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		8.588,22	6.348.266,37	0,28
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.506.429,94	1.049.565,30	0,05
. HAMILTON LANE FIC FIP		16.588,54	18.614.765,49	0,81
. MULTINER FIP		9,44	627.073,61	0,03
. STRATUS SCP BR FIP		5.793.395,00	7.936.366,02	0,35
. P2BR INFR III FIQFIP		7.590,00	10.721.113,32	0,47
. COPA FLORESTAL III		1.222.330,00	1.141.269,61	0,05
. MEMORIAL OFFICE FI IMOBILIARIO		10.000,00	1.099.899,91	0,05
. ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO		39.000,00	13.357.500,00	0,58
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		99.010,00	10.495.060,00	0,46
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		784,45	11.247.640,91	0,49
. GGR COVEPI RENDA FII		100.000,00	10.539.098,21	0,46
. MAUÁ MACRO II FIC DE FIM		16.237,46	11.259.953,30	0,49
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		5.754.560,40	10.800.050,78	0,47
. KINEA CHRONOS FIM		7.213.764,32	10.791.850,58	0,47
. VALORES A RECEBER			129.164,90	0,01
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		23.579.690	78.743.205,23	3,43
. BB MM SCH INV EXTE FI		5.128.757,86	19.820.353,17	0,86
. MSQUARE GL EQ FICFIM		3.342.850,69	14.357.785,41	0,62
. VOT ALLIANZGI FIM		7.605.013,33	13.851.995,85	0,60
. WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI		6.931,42	10.178.531,04	0,44
. GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE		92.862,26	10.396.608,62	0,45
. PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR		7.403.274,30	10.137.931,14	0,44
D-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			109.303.106,46	4,76
D1 - Investimentos em Shopping Center			100.907.106,46	4,39
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			27.795.578,10	1,21
. SHOPPING PLAZA SUL			52.523.898,70	2,29
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			20.136.135,65	0,88
. VALORES A RECEBER			451.494,01	0,02
D2 - Investimento Imobiliário			8.396.000,00	0,37
. PANAMBY			8.396.000,00	0,37
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00
E - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		4.894	115.396.765,61	5,02
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		4.894	111.617.859,65	4,86
. VALORES A PAGAR (-)			49.652,46	0,00
. VALORES A RECEBER			3.729.253,50	0,16

F - OUTROS			4.147.870,47	0,18	
. DISPONIVEL			7.741.507,59	0,34	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			755.030,05	0,03	
. OUTROS REALIZAVEIS			391.612,10	0,02	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-3.871.077,94	-0,17	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-869.201,33	-0,04	
GESTÃO TERCEIRIZADA			DISTRIBUIÇÃO	(%) EM RELAÇÃO A GESTÃO TERCEIRIZADA	(%) EM RELAÇÃO AO RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS					
- SANT FIC FI ISN RF D			83.975,70	0,01%	0,00%
- FUNDO FATOR SINERGIA V			5.311.895,98	0,92%	0,23%
- BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP			1.543.947,91	0,27%	0,07%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO			89.669.770,47	15,52%	3,90%
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP			10.625.321,17	1,84%	0,46%
- M. SQUARE INST. FIC FIA			25.113.215,73	4,35%	1,09%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA			18.998.453,86	3,29%	0,83%
- BNP PARIBAS MATCH DI FI RENDA FIXA			2.774.876,73	0,48%	0,12%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP			11.830.183,37	2,05%	0,51%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO			55.731.414,54	9,65%	2,42%
- CA INDOSUEZ VITESSE FI RENDA FIXA CP			33.584.966,56	5,81%	1,46%
- IBIUNA EQ. FIC FIA			13.355.606,66	2,31%	0,58%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER			421.349,81	0,07%	0,02%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II			230.306,47	0,04%	0,01%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III			885.001,59	0,15%	0,04%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.			5.103.869,18	0,88%	0,22%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR			3.108.038,43	0,54%	0,14%
- BRZ MULTIRECEBIVEIS FIC FI MULTIMERCADO II			10.784.048,76	1,87%	0,47%
- REAL FAQ EXTRA DI - ASSISTENCIAL			13.754,55	0,00%	0,00%
- BRADESCO DED. SAUDE ANS			18.491.646,07	3,20%	0,80%
- BBM SMID CAPS FICFIA			17.284.963,61	2,99%	0,75%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP			59.863,09	0,01%	0,00%
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP			3.793.666,93	0,66%	0,17%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			24.933.107,73	4,32%	1,08%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP			13.833.974,17	2,40%	0,60%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA			5.115.546,12	0,89%	0,22%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES			6.348.266,37	1,10%	0,28%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			1.049.565,30	0,18%	0,05%
- HAMILTON LANE FIC FIP			18.614.765,49	3,22%	0,81%
. MULTINER FIP			627.073,61	0,11%	0,03%
- STRATUS SCP BR FIP			7.936.366,02	1,37%	0,35%
- P2BR INFR III FIQFIP			10.721.113,32	1,86%	0,47%
- COPA FLORESTAL III			1.141.269,61	0,20%	0,05%
- MEMORIAL OFFICE FI MOBILIARIO			1.104.499,91	0,19%	0,05%
- ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO			13.433.550,00	2,33%	0,58%
- BTG PACTUAL CORPOTATE OFFICE FI IMOBILIARIO			10.543.574,90	1,83%	0,46%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			11.247.640,91	1,95%	0,49%
- GGR COVEPI RENDA FII			10.539.098,21	1,82%	0,46%
- MAUÁ MACRO II FIC DE FIM			11.259.953,30	1,95%	0,49%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			10.800.050,78	1,87%	0,47%
- KINEA CHRONOS FIM			10.791.850,58	1,87%	0,47%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- BB MM SCH INV EXTE FI			19.820.353,17	3,43%	0,86%
- MSQUARE GL EQ FICFIM			14.357.785,41	2,49%	0,62%
- VOT ALLIANZGI FIM			13.851.995,85	2,40%	0,60%
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI			10.178.531,04	1,76%	0,44%
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE			10.396.608,62	1,80%	0,45%
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR			10.137.931,14	1,76%	0,44%
TOTAL			577.584.608,73	100,00%	25,13%
GESTÃO PRÓPRIA			DISTRIBUIÇÃO	(%) EM RELAÇÃO A GESTÃO TERCEIRIZADA	(%) EM RELAÇÃO AO RECURSOS GARANTIDORES
RENDA FIXA			1.388.596.077,57	80,69%	60,42%
RENDA VARIÁVEL			103.427.600,36	6,01%	4,50%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			109.303.106,46	6,35%	4,76%
EMPRÉSTIMO PESSOAL			115.396.765,61	6,71%	5,02%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)			4.147.870,47	0,24%	0,18%
TOTAL			1.720.871.420,47	100,00%	74,92%

Elaborado em 22/03/2018