

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

CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.08.2020

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			3.083.733.869,85		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			1.967.471.201,81	63,80	
TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOUREIRO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOUREIRO NACIONAL					
<u>Nota do Tesouro Nacional</u>		371.409	1.315.998.676	42,68	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			564.086.328,76	18,29	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		5.072,00	11.051.405,54	0,36	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	4	44.627.825,93	1,45	1,45
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.453.009,07	0,18	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.431.276,56	0,18	0,35
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	5.000	10.981.217,40	0,36	0,36
. CDB 362 DIAS - PARANÁ BANCO	PÓS	70	70.188,14	0,00	0,00
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-3	-44.627.825,93	-1,45	-1,45
- BANCO MORADA		-3	-10.884.285,63	-0,35	-0,35
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		557	163.199.748,02	5,29	
. ABC		21	12.293.525	0,40	0,40
. PARANÁ BANCO		360	49.584.592,02	1,61	1,61
. BRADESCO		176	61.832.420,40	2,01	2,01
. BANCO BTG PACTUAL		0	0,00	0,00	0,00
. SAFRA		94	39.489.210,28	1,28	1,28
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		69.810.314,81	389.835.175,20	12,64	
. SANT FIC FI ISN RF D		337,13	62.588,73	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		7.062.107,57	12.551.901,80	0,41	0,41
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		5.750.608,27	17.455.981,81	0,57	0,57
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		4.341.890,47	56.992.564,09	1,85	1,85
. SAN FC EXTRA RF REF		11,56	14.241,77	0,00	0,00
. BRADESCO DED. SAUDE ANS		6.891.627,03	21.057.709,60	0,68	0,68
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		39.838.368,72	52.670.329,19	1,71	1,71
. BNP PARIBAS TARGUS FIC FI DE FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO		28.418,61	13.065.446,41	0,42	0,42
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		75.416,68	8.323.842,35	0,27	0,27
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		114.603,99	11.786.642,92	0,38	0,38
. AZ QUEST LUCE		5.663.269,09	8.085.427,01	0,26	0,26
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		8.673,97	111.468,43	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		14.724,00	82.835,18	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		8.925,14	57.596,03	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		39,04	1.412.059,67	0,05	0,05
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		11.293,53	14.811.315,77	0,48	0,48
. VINCI VALOREM FIM		64.274,34	14.435.433,05	0,47	0,47
. BRAD RF DI FED EXTRA		12.972.887,91	156.857.791,39	5,09	5,09
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00	0,00
<u>Debêntures</u>		48.248	76.364.212,19	2,49	
. CEMIG		30.000	45.359.318,88	1,47	1,47
. LOJAS AMERICANAS		720	9.043.265,47	0,29	0,29
. ECOPISTAS		7.000	5.153.824,13	0,17	0,17
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	9.649.184,29	0,31	0,31
. SABESP		1.736	7.158.619,42	0,23	0,23
. VALORES A RECEBER					
. COMANCHE PART.			9.349.383,12	0,30	0,30
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS					
. COMANCHE PART.			-9.349.383,12	-0,30	-0,30

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

CONSOLIDADO

Outros Títulos		<u>7</u>	<u>11.021.984,94</u>	<u>0,36</u>	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	15.314.207,02	0,50	0,50
. VALORES A RECEBER			3.274.905,95	0,11	0,11
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS			-7.567.128,03	-0,25	-0,25
B - INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			267.560.054,07	8,68	
B1. Mercado de Ações			<u>64.974.558,51</u>	<u>2,11</u>	
Companhias Abertas		<u>1.946.641</u>	<u>53.897.390,03</u>	<u>1,75</u>	
. AMBEV	ON	120.607	1.484.672,17	0,05	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	86.578	1.696.063,02	0,06	
. COSAN	ON	64.800	5.394.600,00	0,17	
. ECORODOVIAS	ON	149.200	1.927.664,00	0,06	
. GERDAU - GGBR	PN	147.388	2.813.636,92	0,09	
. ITAUSA	ON	216	2.328,48	0,00	
. ITAUSA	PN	491.509	4.634.929,87	0,15	
. LOGG COMERCIAL	ON	7.386	228.818	0,01	
. MRVE	ON	104.800	1.883.256,00	0,06	
. PÃO DE AÇUCAR	PN	64.000	4.064.640,00	0,13	
. PETROBRÁS	PN	258.894	5.667.189,66	0,18	
. RENT	ON	189.378	9.133.700,94	0,30	
. SUZANO PAPEL	PNA	82.100	4.121.420,00	0,13	
. VALE R. DOCE	PNA	179.785	10.729.568,80	0,35	
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			114.901,89	0,00	
Instituições Financeiras		<u>499.306</u>	<u>11.077.168,48</u>	<u>0,36</u>	
. BRADESCO	PN	245.535	5.092.395,90	0,17	
. ITAU	PN	253.771	5.976.307,05	0,19	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			8.465,53	0,00	
B2. Fundos		<u>49.522.521,13</u>	<u>202.585.495,56</u>	<u>6,57</u>	
. M. SQUARE INST. FIC FIA		6.293.092,63	22.838.172,65	0,74	
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		15.690.874,77	49.527.744,88	1,61	
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.096.544,16	24.619.432,32	0,80	
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	18.934.617,06	0,61	
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		87.042,25	14.515.640,66	0,47	
. MOAT CAPITAL FIA		10.351.340,47	38.592.905,80	1,25	
. SPX APACHE FIA		13.940.893,93	33.556.982,19	1,09	
C - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		<u>96.489.097</u>	<u>270.545.219,22</u>	<u>8,77</u>	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP		10.858,75	-177.874,67	-0,01	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.517,01	2.382.437,09	0,08	
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.676,93	27.360.878,11	0,89	
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.269,00	18.752.399,32	0,61	
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		5.000,00	4.991.664,69	0,16	
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		9.098,22	6.626.825,35	0,21	
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.876.004,07	2.036.970,52	0,07	
. HAMILTON LANE FIC FIP		20.549,88	34.925.635,02	1,13	
. MULTINER FIP		10,17	-8.114,86	0,00	
. STRATUS SCP BR FIP		10.000.000,00	13.303.740,00	0,43	
. P2BR INFR III FIQFIP		10.250,00	15.859.985,02	0,51	
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	7.179.146,30	0,23	
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		9.097.590,07	19.859.474,15	0,64	
. KINEA CHRONOS FIM		19.486.337,47	34.894.328,70	1,13	
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		15.860.872,32	27.262.280,27	0,88	
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		29.971.798,56	32.894.075,89	1,07	
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		121.264,39	22.401.368,36	0,73	
D - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		<u>26.287.920</u>	<u>81.691.132,55</u>	<u>2,65</u>	
. BB MM SCH INV EXTE FI		5.128.757,86	21.968.851,31	0,71	
. VOT ALLIANZGI FIM		3.790.730,70	13.419.163,88	0,44	
. WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI		6.931,42	11.910.648,30	0,39	
. GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE		92.862,26	11.612.365,80	0,38	
. PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR		7.403.274,30	12.055.202,48	0,39	
. ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR		9.865.363,24	10.724.900,78	0,35	

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

CONSOLIDADO

E - INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			94.164.774,48	3,05	
E1 - Investimentos em Shopping Center			60.102.337,09	1,95	
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			36.324.545,12	1,18	
. SHOPPING PLAZA SUL			0,00	0,00	
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			23.767.311,94	0,77	
. VALORES A RECEBER			10.480,03	0,00	
E2 - Investimento Imobiliário			9.992.474,25	0,32	
. PANAMBY			9.992.474,25	0,32	
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00	
E3 - Investimento Fundo Imobiliário					
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO	99.794,45		17.882.265,45	0,58	
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	99.010,00		8.621.790,80	0,28	
. VALORES A RECEBER	784,45		9.214.776,10	0,30	
. VALORES A PAGAR			45.698,55	0,00	
			0,00	0,00	
E3 - Outros Investimentos Imobiliário					
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS	44		6.187.697,69	0,20	
	44		6.187.697,69	0,20	
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		3.813	82.474.292,04	2,67	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		3.813	79.578.339,92	2,58	
. VALORES A PAGAR (-)			-10.607,57	0,00	
. VALORES A RECEBER			2.906.559,69	0,09	
G - OUTROS			319.827.195,68	10,37	
. DISPONIVEL			1.507.423,25	0,05	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			1.782.987,97	0,06	
. OUTROS REALIZAVEIS			160.281.882,61	5,20	
. OUTROS DIREITOS A RECEBER			161.866.252,38	5,25	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-5.113.633,62	-0,17	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-497.716,91	-0,02	

GESTÃO TERCEIRIZADA	DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO TERCEIRIZADA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS			
- SANT FIC FI ISN RF D	62.588,73	0,01%	0,00%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO	12.551.901,80	1,30%	0,41%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES	17.455.981,81	1,81%	0,57%
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP	56.992.564,09	5,92%	1,85%
- M. SQUARE INST. FIC FIA	22.838.172,65	2,37%	0,74%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	49.527.744,88	5,15%	1,61%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA	14.515.640,66	1,51%	0,47%
- MOAT CAPITAL FIA	38.592.905,80	4,01%	1,25%
- BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	13.065.446,41	1,36%	0,42%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP	8.323.842,35	0,86%	0,27%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II	11.786.642,92	1,22%	0,38%
- SPX APACHE FIA	33.556.982,19	3,49%	1,09%
- IBIUNA EQ. FIC FIA	18.934.617,06	1,97%	0,61%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	111.468,43	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	82.835,18	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	57.596,03	0,01%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.	1.412.059,67	0,15%	0,05%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL	14.811.315,77	1,54%	0,48%
- SAN FC EXTRA RF REF	14.241,77	0,00%	0,00%
- BRADESCO DED. SAUDE ANS	21.057.709,60	2,19%	0,68%
- BBM SMID CAPS FICFIA	24.619.432,32	2,56%	0,80%
- AZ QUEST LUCE	8.085.427,01	0,84%	0,26%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM	52.670.329,19	5,47%	1,71%
- VINCI VALOREM FIM	14.435.433,05	1,50%	0,47%
- BRAD RF DI FED EXTRA	156.857.791,39	16,30%	5,09%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP	(177.874,67)	-0,02%	-0,01%
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP	2.382.437,09	0,25%	0,08%

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

CONSOLIDADO

- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			27.360.878,11	2,84%	0,89%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP			18.752.399,32	1,95%	0,61%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA			4.991.664,69	0,52%	0,16%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES			6.626.825,35	0,69%	0,21%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			2.036.970,52	0,21%	0,07%
- HAMILTON LANE FIC FIP			34.925.635,02	3,63%	1,13%
- MULTINER FIP			-8.114,86	0,00%	0,00%
- STRATUS SCP BR FIP			13.303.740,00	1,38%	0,43%
- P2BR INFR III FIQFIP			15.859.985,02	1,65%	0,51%
- COPA FLORESTAL III			7.179.146,30	0,75%	0,23%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			19.859.474,15	2,06%	0,64%
- KINEA CHRONOS FIM			34.894.328,70	3,63%	1,13%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM			27.262.280,27	2,83%	0,88%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM			32.894.075,89	3,42%	1,07%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM			22.401.368,36	2,33%	0,73%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO			8.667.489,35	0,90%	0,28%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			9.214.776,10	0,96%	0,30%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- BB MM SCH INV EXTE FI			21.968.851,31	2,28%	0,71%
- VOT ALLIANZGI FIM			13.419.163,88	1,39%	0,44%
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI			11.910.648,30	1,24%	0,39%
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE			11.612.365,80	1,21%	0,38%
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR			12.055.202,48	1,25%	0,39%
- ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR			10.724.900,78	1,11%	0,35%
TOTAL			962.539.288,02	100,00%	31,21%

GESTÃO PRÓPRIA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENTA FIXA			1.577.636.026,61	74,37%	51,16%
RENTA VARIÁVEL			64.974.558,51	3,06%	2,11%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			76.282.509,03	3,60%	2,47%
EMPRÉSTIMO PESSOAL			82.474.292,04	3,89%	2,67%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)			319.827.195,68	15,08%	10,37%
TOTAL			2.121.194.581,87	100,00%	68,79%