

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

CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 28.02.2020

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			3.016.742.443,92		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			1.836.733.679,61	60,88	
TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOUREIRO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOUREIRO NACIONAL					
<u>Nota do Tesouro Nacional</u>		358.485	1.253.459.122	41,55	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			491.792.995,57	16,30	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		5.002,00	10.627.977,50	0,35	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	4	44.627.825,93	1,48	1,48
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.453.009,07	0,18	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.431.276,56	0,18	0,36
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	5.000	10.627.977,50	0,35	0,35
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-3	-44.627.825,93	-1,48	-1,48
- BANCO MORADA		-3	-10.884.285,63	-0,36	-0,36
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		357	122.515.218,63	4,06	
. ABC		21	11.831.391	0,39	0,39
. PARANÁ BANCO		160	48.109.334,43	1,59	1,59
. BRADESCO		176	58.998.434,86	1,96	1,96
. BANCO BTG PACTUAL		0	0,00	0,00	0,00
. SAFRA		4	3.576.058,20	0,12	0,12
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		163.054.126,98	358.649.799,44	11,89	
. SANT FIC FI ISN RF D		337,13	62.117,51	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		13.411.937,85	23.916.663,79	0,79	0,79
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		19.661.189,37	61.151.729,34	2,03	2,03
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		7.477.568,64	51.263.122,94	1,70	1,70
. AF GERAES 30		10.071.484,93	11.510.013,25	0,38	0,38
. SAN FC EXTRA RF REF		11,56	14.295,00	0,00	0,00
. BRADESCO DED. SAUDE ANS		6.891.627,03	20.803.870,27	0,69	0,69
. BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP		3.708.925,00	313,40	0,00	0,00
. CA AG VITESSE		491.451,18	11.313.776,31	0,38	0,38
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		49.054.436,62	63.348.450,60	2,10	2,10
. BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO		27.462,10	12.576.987,40	0,42	0,42
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		75.416,68	8.288.900,76	0,27	0,27
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		78.649,64	8.034.592,78	0,27	0,27
. AZ QUEST LUCE		41.630.340,87	60.598.011,74	2,01	2,01
. ARX VINSON FI RF CP		10.431.101,69	11.480.231,98	0,38	0,38
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		8.673,97	238.379,89	0,01	0,01
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		14.724,00	70.438,44	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		8.925,14	37.854,18	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		39,04	1.356.153,07	0,04	0,04
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		9.824,52	12.583.896,79	0,42	0,42
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00	0,00
<u>Debêntures</u>		52.071	80.662.719,62	2,68	
. CEMIG		32.000	47.202.431,34	1,56	1,56
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		1.949	529.748,86	0,02	0,02
. LOJAS AMERICANAS		720	9.565.742,80	0,32	0,32
. ECOPISTAS		7.000	6.146.467,25	0,20	0,20
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	9.597.183,80	0,32	0,32
. SABESP		1.265	6.927.335,58	0,23	0,23
. ESPÍRITO SANTO CENTRAIS ELÉTRICAS		345	693.809,99	0,02	0,02
. VALORES A RECEBER					
. COMANCHE PART.			9.349.383,12	0,31	0,31
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS					
. COMANCHE PART.			-9.349.383,12	-0,31	-0,31

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

CONSOLIDADO

Outros Títulos		<u>7</u>	<u>10.818.842,80</u>	<u>0,36</u>	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	15.111.064,88	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			272.810.645,92	9,04	
B1. Mercado de Ações			<u>69.257.844,35</u>	<u>2,30</u>	
Companhias Abertas		<u>1.946.641</u>	<u>54.049.404,05</u>	<u>1,79</u>	
. AMBEV	ON	120.607	1.753.625,78	0,06	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	86.578	2.341.069,12	0,08	
. COSAN	ON	64.800	4.741.416,00	0,16	
. ECORODOVIAS	ON	149.200	2.354.376,00	0,08	
. GERDAU - GGBR	PN	147.388	2.495.278,84	0,08	
. ITAUSA	ON	216	2.751,84	0,00	
. ITAUSA	PN	491.509	5.903.023,09	0,20	
. LOGG COMERCIAL	ON	7.386	203.706	0,01	
. MRVE	ON	104.800	2.042.552,00	0,07	
. PÃO DE AÇUCAR	PN	64.000	4.615.040,00	0,15	
. PETROBRÁS	PN	258.894	6.560.373,96	0,22	
. RENT	ON	189.378	9.381.786,12	0,31	
. SUZANO PAPEL	PNA	82.100	3.131.294,00	0,10	
. VALE R. DOCE	PNA	179.785	7.966.273,35	0,26	
. VIVT - TELEF. BRASIL	PN	0	-	0,00	
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			556.838,07	0,02	
Instituições Financeiras		<u>476.985</u>	<u>15.208.440,30</u>	<u>0,50</u>	
. BRADESCO	PN	223.214	6.814.723,42	0,23	
. ITAU	PN	253.771	8.120.672,00	0,27	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			273.044,88	0,01	
B2. Fundos		<u>49.522.521,13</u>	<u>203.552.801,57</u>	<u>6,75</u>	
. M. SQUARE INST. FIC FIA		6.293.092,63	22.745.798,17	0,75	
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		15.690.874,77	45.734.122,24	1,52	
. BBM SMID CAPS FIC FIA		3.096.544,16	25.488.149,51	0,84	
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	20.633.059,69	0,68	
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		87.042,25	15.747.351,61	0,52	
. MOAT CAPITAL FIA		10.351.340,47	36.422.946,01	1,21	
. SPX APACHE FIA		13.940.893,93	36.781.374,34	1,22	
C - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		<u>96.487.754</u>	<u>277.266.413,11</u>	<u>9,19</u>	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP		10.858,75	-100.216,13	0,00	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.506,93	2.248.652,71	0,07	
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.676,93	27.374.834,76	0,91	
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.220,00	17.323.867,33	0,57	
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		5.000,00	5.036.444,25	0,17	
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		9.066,22	6.639.273,41	0,22	
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.876.004,07	1.625.963,55	0,05	
. HAMILTON LANE FIC FIP		19.700,40	29.303.400,74	0,97	
. MULTINER FIP		10,17	-11.626,55	0,00	
. STRATUS SCP BR FIP		10.000.000,00	14.505.920,00	0,48	
. P2BR INFR III FIQFIP		9.848,00	22.380.112,16	0,74	
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	6.652.905,40	0,22	
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		9.097.590,07	19.025.346,15	0,63	
. KINEA CHRONOS FIM		19.486.337,47	34.699.151,60	1,15	
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		15.860.872,32	26.226.890,42	0,87	
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		29.971.798,56	33.772.213,62	1,12	
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		121.264,39	30.563.279,73	1,01	
D - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		<u>41.269.530</u>	<u>113.149.906,87</u>	<u>3,75</u>	
. BB MM SCH INV EXTE FI		9.648.030,71	27.651.032,48	0,92	
. MSQUARE GL EQ FICFIM		6.648.054,77	21.443.492,53	0,71	
. VOT ALLIANZGI FIM		7.605.013,33	18.313.634,80	0,61	
. WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI		6.931,42	11.423.998,20	0,38	
. GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE		92.862,26	11.730.761,86	0,39	
. PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR		7.403.274,30	11.781.473,88	0,39	
. ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR		9.865.363,24	10.805.513,12	0,36	

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

CONSOLIDADO

E - INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			115.346.563,78	3,82
E1 - Investimentos em Shopping Center			61.315.441,25	2,03
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			36.993.095,03	1,23
. SHOPPING PLAZA SUL			0,00	0,00
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			24.293.525,49	0,81
. VALORES A RECEBER			28.820,73	0,00
E2 - Investimento Imobiliário			9.100.989,70	0,30
. PANAMBY			9.100.989,70	0,30
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00
E3 - Investimento Fundo Imobiliário				
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO	242.483,45		39.480.954,07	1,31
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	99.010,00		10.792.090,00	0,36
. GGR COVEPI RENDA FII	784,45		9.205.745,93	0,31
. VALORES A RECEBER	142.689,00		19.424.253,57	0,64
. VALORES A PAGAR			58.864,57	0,00
			0,00	0,00
E3 - Outros Investimentos Imobiliário	44		5.449.178,76	0,18
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS	44		5.449.178,76	0,18
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES	4.031		86.315.650,13	2,86
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	4.031		82.971.583,86	2,75
. VALORES A PAGAR (-)			-43.826,39	0,00
. VALORES A RECEBER			3.387.892,66	0,11
G - OUTROS			315.119.584,50	10,45
. DISPONIVEL			1.509.285,41	0,05
. DEPOSITOS JUDICIAIS			1.757.839,09	0,06
. OUTROS REALIZAVEIS			160.281.882,61	5,31
. OUTROS DIREITOS A RECEBER			156.962.550,70	5,20
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-5.018.299,07	-0,17
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-373.674,24	-0,01

GESTÃO TERCEIRIZADA	DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO TERCEIRIZADA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS			
- SANT FIC FI ISN RF D	62.117,51	0,01%	0,00%
- BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP	313,40	0,00%	0,00%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO	23.916.663,79	2,41%	0,79%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES	61.151.729,34	6,16%	2,03%
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP	51.263.122,94	5,17%	1,70%
- M. SQUARE INST. FIC FIA	22.745.798,17	2,29%	0,75%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	45.734.122,24	4,61%	1,52%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA	15.747.351,61	1,59%	0,52%
- MOAT CAPITAL FIA	36.422.946,01	3,67%	1,21%
- BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	12.576.987,40	1,27%	0,42%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP	8.288.900,76	0,84%	0,27%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II	8.034.592,78	0,81%	0,27%
- SPX APACHE FIA	36.781.374,34	3,71%	1,22%
- CA INDOSUEZ VITESSE FI RENDA FIXA CP	11.313.776,31	1,14%	0,38%
- IBIUNA EQ. FIC FIA	20.633.059,69	2,08%	0,68%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	238.379,89	0,02%	0,01%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	70.438,44	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	37.854,18	0,00%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.	1.356.153,07	0,14%	0,04%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL	12.583.896,79	1,27%	0,42%
- SAN FC EXTRA RF REF	14.295,00	0,00%	0,00%
- BRADESCO DED. SAUDE ANS	20.803.870,27	2,10%	0,69%
- BBM SMID CAPS FICFIA	25.488.149,51	2,57%	0,84%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES 30	11.510.013,25	1,16%	0,38%
- AZ QUEST LUCE	60.598.011,74	6,11%	2,01%
- ARX VINSON FI RF CP	11.480.231,98	1,16%	0,38%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM	63.348.450,60	6,39%	2,10%
- VINCI VALOREM FIM	-	0,00%	0,00%
- BRAD RF DI FED EXTRA	-	0,00%	0,00%

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

CONSOLIDADO

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP			(100.216,13)	-0,01%	0,00%
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP			2.248.652,71	0,23%	0,07%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			27.374.834,76	2,76%	0,91%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP			17.323.867,33	1,75%	0,57%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA			5.036.444,25	0,51%	0,17%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES			6.639.273,41	0,67%	0,22%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			1.625.963,55	0,16%	0,05%
- HAMILTON LANE FIC FIP			29.303.400,74	2,95%	0,97%
. MULTINER FIP			-11.626,55	0,00%	0,00%
- STRATUS SCP BR FIP			14.505.920,00	1,46%	0,48%
- P2BR INFR III FIQFIP			22.380.112,16	2,26%	0,74%
- COPA FLORESTAL III			6.652.905,40	0,67%	0,22%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			19.025.346,15	1,92%	0,63%
- KINEA CHRONOS FIM			34.699.151,60	3,50%	1,15%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM			26.226.890,42	2,64%	0,87%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM			33.772.213,62	3,40%	1,12%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM			30.563.279,73	3,08%	1,01%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO			10.850.954,57	1,09%	0,36%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			9.205.745,93	0,93%	0,31%
- GGR COVEPI RENDA FII			19.424.253,57	1,96%	0,64%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- BB MM SCH INV EXTE FI			27.651.032,48	2,79%	0,92%
- MSQUARE GL EQ FICFIM			21.443.492,53	2,16%	0,71%
- VOT ALLIANZGI FIM			18.313.634,80	1,85%	0,61%
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI			11.423.998,20	1,15%	0,38%
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE			11.730.761,86	1,18%	0,39%
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR			11.781.473,88	1,19%	0,39%
- ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR			10.805.513,12	1,09%	0,36%
TOTAL			992.099.875,10	100,00%	32,89%

GESTÃO PRÓPRIA	DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENDA FIXA	1.478.083.880,17	73,00%	49,00%
RENDA VARIÁVEL	69.257.844,35	3,42%	2,30%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	75.865.609,71	3,75%	2,51%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	86.315.650,13	4,26%	2,86%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	315.119.584,50	15,56%	10,45%
TOTAL	2.024.642.568,86	100,00%	67,11%