

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

CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.07.2020

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			3.075.202.150,00		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			1.932.604.785,82	62,84	
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	1.329.147.328	43,22	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			515.862.623,22	16,77	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		5.072,00	10.961.771,57	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	10.891.738,95	0,35	0,35
. CDB 362 DIAS - PARANÁ BANCO	PÓS	70	70.032,62	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	161.687.754,54	5,26	
. ABC		21	12.183.904	0,40	0,40
. PARANÁ BANCO		360	49.226.813,99	1,60	1,60
. BRADESCO		176	61.093.309,96	1,99	1,99
. BANCO BTG PACTUAL		0	0,00	0,00	0,00
. SAFRA		94	39.183.726,83	1,27	1,27
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		76.082.679,50	343.213.097,11	11,16	
. SANT FIC FI ISN RF D		337,13	62.435,21	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		7.062.107,57	12.476.335,89	0,41	0,41
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		10.219.087,49	30.922.003,28	1,01	1,01
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		4.341.890,47	57.054.078,88	1,86	1,86
. SAN FC EXTRA RF REF		11,56	14.227,98	0,00	0,00
. BRADESCO DED. SAUDE ANS		6.891.627,03	21.031.160,31	0,68	0,68
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		39.827.865,51	52.364.626,12	1,70	1,70
. BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO		28.418,61	13.025.282,12	0,42	0,42
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		75.416,68	8.286.525,95	0,27	0,27
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		114.603,99	11.936.098,40	0,39	0,39
. AZ QUEST LUCE		7.477.657,78	10.597.674,68	0,34	0,34
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		8.673,97	112.192,37	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		14.724,00	72.580,48	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		8.925,14	27.154,40	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		39,04	1.398.344,89	0,05	0,05
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		11.293,53	15.029.317,80	0,49	0,49
. VINCI VALOREM FIM		64.274,34	14.322.923,90	0,47	0,47
. BRAD RF DI FED EXTRA		11.647.118,68	94.480.134,45	3,07	3,07
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00	0,00
<u>Debêntures</u>		48.593	76.732.257,62	2,51	
. CEMIG		30.000	45.049.185,69	1,46	1,46
. LOJAS AMERICANAS		720	8.959.738,06	0,29	0,29
. ECOPISTAS		7.000	5.105.928,12	0,17	0,17
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	9.808.964,92	0,32	0,32
. SABESP		1.736	7.103.994,98	0,23	0,23
. ESPÍRITO SANTO CENTRAIS ELÉTRICAS		345	704.445,85	0,02	0,02
. 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		7	10.862.576,76	0,35	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	15.154.798,84	0,49	0,49
. 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			274.815.295,68	8,94	
B1. Mercado de Ações			68.598.407,13	2,23	
Companhias Abertas		1.946.641	56.256.234,01	1,83	
. AMBEV	ON	120.607	1.676.437,30	0,05	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	86.578	1.792.164,60	0,06	
. BRCR12/DIR	DIR	0	-	0,00	
. COSAN	ON	64.800	5.857.920,00	0,19	
. ECORODOVIAS	ON	149.200	2.166.384,00	0,07	
. GERDAU - GGBR	PN	147.388	2.571.920,60	0,08	
. ITAUSA	ON	216	2.624,40	0,00	
. ITAUSA	PN	491.509	5.244.401,03	0,17	
. LOGG COMERCIAL	ON	7.386	271.805	0,01	
. MRVE	ON	104.800	2.005.872,00	0,07	
. PÃO DE AÇUCAR	PN	64.000	4.544.000,00	0,15	
. PETROBRÁS	PN	258.894	5.747.446,80	0,19	
. RENT	ON	189.378	9.643.127,76	0,31	
. SUZANO PAPEL	PNA	82.100	3.448.200,00	0,11	
. VALE R. DOCE	PNA	179.785	10.914.747,35	0,35	
. VIVT - TELEF. BRASIL	PN	0	-	0,00	
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			369.183,37	0,01	
Instituições Financeiras		499.306	12.342.173,12	0,40	
. BRADESCO	PN	245.535	5.509.805,40	0,18	
. ITAU	PN	253.771	6.823.902,19	0,22	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			8.465,53	0,00	
B2. Fundos		49.522.521,13	206.216.888,55	6,71	
. M. SQUARE INST. FIC FIA		6.293.092,63	23.134.309,10	0,75	
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		15.690.874,77	49.127.240,48	1,60	
. BBM SMID CAPS FIC FIA		3.096.544,16	25.050.989,01	0,81	
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	19.400.665,31	0,63	
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		87.042,25	14.870.001,43	0,48	
. MOAT CAPITAL FIA		10.351.340,47	40.069.223,29	1,30	
. SPX APACHE FIA		13.940.893,93	34.564.459,93	1,12	
C - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		96.488.614	267.441.193,34	8,70	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP		10.858,75	-167.390,02	-0,01	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.517,01	2.385.845,29	0,08	
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.676,93	27.355.121,44	0,89	
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.220,00	18.661.823,46	0,61	
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		5.000,00	5.026.363,24	0,16	
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		9.066,22	6.601.529,32	0,21	
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.876.004,07	1.454.638,55	0,05	
. HAMILTON LANE FIC FIP		20.549,88	32.785.306,41	1,07	
. MULTINER FIP		10,17	-19.469,54	0,00	
. STRATUS SCP BR FIP		10.000.000,00	13.189.580,00	0,43	
. P2BR INFR III FIQFIP		9.848,00	15.255.693,20	0,50	
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	7.186.709,70	0,23	
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		9.097.590,07	19.976.904,94	0,65	
. KINEA CHRONOS FIM		19.486.337,47	34.856.153,03	1,13	
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		15.860.872,32	26.881.625,08	0,87	
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		29.971.798,56	32.750.136,33	1,06	
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		121.264,39	23.260.622,95	0,76	
D - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		32.935.975	105.201.600,85	3,42	
. BB MM SCH INV EXTE FI		5.128.757,86	19.628.848,05	0,64	
. MSQUARE GL EQ FICFIM		6.648.054,77	27.647.358,78	0,90	
. VOT ALLIANZGI FIM		3.790.730,70	12.153.424,88	0,40	
. WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI		6.931,42	11.861.761,70	0,39	
. GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE		92.862,26	11.474.299,50	0,37	
. PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR		7.403.274,30	11.899.747,34	0,39	
. ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR		9.865.363,24	10.536.160,60	0,34	

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

CONSOLIDADO

E - INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			94.373.118,35	3,07	
E1 - Investimentos em Shopping Center			60.279.627,80	1,96	
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			36.435.970,10	1,18	
. SHOPPING PLAZA SUL			0,00	0,00	
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			23.855.014,19	0,78	
. VALORES A RECEBER			-11.356,49	0,00	
E2 - Investimento Imobiliário			9.830.979,40	0,32	
. PANAMBY			9.830.979,40	0,32	
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00	
E3 - Investimento Fundo Imobiliário		99.794,45	18.271.336,49	0,59	
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		99.010,00	9.009.910,00	0,29	
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		784,45	9.218.852,19	0,30	
. VALORES A RECEBER			42.574,30	0,00	
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00	
E3 - Outros Investimentos Imobiliário		44	5.991.174,66	0,19	
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		44	5.991.174,66	0,19	
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		3.856	82.857.485,19	2,69	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		3.856	80.068.199,13	2,60	
. VALORES A PAGAR (-)			-11.031,46	0,00	
. VALORES A RECEBER			2.800.317,52	0,09	
G - OUTROS			317.908.670,77	10,34	
. DISPONIVEL			928.416,02	0,03	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			1.782.987,97	0,06	
. OUTROS REALIZAVEIS			160.281.882,61	5,21	
. OUTROS DIREITOS A RECEBER			160.495.457,61	5,22	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-5.095.950,32	-0,17	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-484.123,12	-0,02	

GESTÃO TERCEIRIZADA	DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO TERCEIRIZADA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS			
- SANT FIC FI ISN RF D	62.435,21	0,01%	0,00%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO	12.476.335,89	1,33%	0,41%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES	30.922.003,28	3,29%	1,01%
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP	57.054.078,88	6,07%	1,86%
- M. SQUARE INST. FIC FIA	23.134.309,10	2,46%	0,75%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	49.127.240,48	5,22%	1,60%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA	14.870.001,43	1,58%	0,48%
- MOAT CAPITAL FIA	40.069.223,29	4,26%	1,30%
- BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	13.025.282,12	1,39%	0,42%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP	8.286.525,95	0,88%	0,27%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II	11.936.098,40	1,27%	0,39%
- SPX APACHE FIA	34.564.459,93	3,68%	1,12%
- IBIUNA EQ. FIC FIA	19.400.665,31	2,06%	0,63%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	112.192,37	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	72.580,48	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	27.154,40	0,00%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.	1.398.344,89	0,15%	0,05%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL	15.029.317,80	1,60%	0,49%
- SAN FC EXTRA RF REF	14.227,98	0,00%	0,00%
- BRADESCO DED. SAUDE ANS	21.031.160,31	2,24%	0,68%
- BBM SMID CAPS FICFIA	25.050.989,01	2,66%	0,81%
- AZ QUEST LUCE	10.597.674,68	1,13%	0,34%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM	52.364.626,12	5,57%	1,70%
- VINCI VALOREM FIM	14.322.923,90	1,52%	0,47%
- BRAD RF DI FED EXTRA	94.480.134,45	10,05%	3,07%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP	(167.390,02)	-0,02%	-0,01%

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

CONSOLIDADO

- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP			2.385.845,29	0,25%	0,08%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			27.355.121,44	2,91%	0,89%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP			18.661.823,46	1,98%	0,61%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA			5.026.363,24	0,53%	0,16%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES			6.601.529,32	0,70%	0,21%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			1.454.638,55	0,15%	0,05%
- HAMILTON LANE FIC FIP			32.785.306,41	3,49%	1,07%
. MULTINER FIP			-19.469,54	0,00%	0,00%
- STRATUS SCP BR FIP			13.189.580,00	1,40%	0,43%
- P2BR INFR III FIQFIP			15.255.693,20	1,62%	0,50%
- COPA FLORESTAL III			7.186.709,70	0,76%	0,23%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			19.976.904,94	2,12%	0,65%
- KINEA CHRONOS FIM			34.856.153,03	3,71%	1,13%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM			26.881.625,08	2,86%	0,87%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM			32.750.136,33	3,48%	1,06%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM			23.260.622,95	2,47%	0,76%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO			9.052.484,30	0,96%	0,29%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			9.218.852,19	0,98%	0,30%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- BB MM SCH INV EXTE FI			19.628.848,05	2,09%	0,64%
- MSQUARE GL EQ FICFIM			27.647.358,78	2,94%	0,90%
- VOT ALLIANZGI FIM			12.153.424,88	1,29%	0,40%
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI			11.861.761,70	1,26%	0,39%
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE			11.474.299,50	1,22%	0,37%
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR			11.899.747,34	1,27%	0,39%
- ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR			10.536.160,60	1,12%	0,34%
TOTAL			940.344.116,38	100,00%	30,58%

GESTÃO PRÓPRIA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENTA FIXA			1.589.391.688,71	74,45%	51,68%
RENTA VARIÁVEL			68.598.407,13	3,21%	2,23%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			76.101.781,86	3,56%	2,47%
EMPRÉSTIMO PESSOAL			82.857.485,19	3,88%	2,69%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)			317.908.670,77	14,89%	10,34%
TOTAL			2.134.858.033,66	100,00%	69,42%