

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

CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 30.06.2020

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			3.026.945.829,78		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			1.915.683.024,74	63,29	
<u>TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOIRO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOIRO NACIONAL</u>					
<u>Nota do Tesouro Nacional</u>		367.356	1.317.581.562	43,53	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			511.264.224,84	16,89	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		5.002,00	10.799.998,90	0,36	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	4	44.627.825,93	1,47	1,47
. 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	10.799.998,90	0,36	0,36
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-3	-44.627.825,93	-1,47	-1,47
- BANCO MORADA		-3	-10.884.285,63	-0,36	-0,36
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		357	160.178.571,64	5,29	
. ABC		21	12.069.649	0,40	0,40
. PARANÁ BANCO		160	48.866.928,43	1,61	1,61
. BRADESCO		176	60.375.891,69	1,99	1,99
. BANCO BTG PACTUAL		0	0,00	0,00	0,00
. SAFRA		94	38.866.102,06	1,28	1,28
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		87.346.073,94	340.285.654,30	11,24	
. SANT FIC FI ISN RF D		337,13	62.269,96	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		7.710.290,95	13.486.034,33	0,45	0,45
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		12.896.110,94	38.803.194,65	1,28	1,28
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		4.789.154,02	55.463.375,22	1,83	1,83
. SAN FC EXTRA RF REF		11,56	14.211,90	0,00	0,00
. BRADESCO DED. SAUDE ANS		6.891.627,03	20.998.455,40	0,69	0,69
. BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP		3.708.925,00	4.428,46	0,00	0,00
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		39.817.212,68	52.042.869,62	1,72	1,72
. BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO		28.735,23	13.098.881,23	0,43	0,43
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		75.416,68	8.314.573,99	0,27	0,27
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		103.368,31	10.454.459,41	0,35	0,35
. AZ QUEST LUCE		11.281.228,75	15.740.813,88	0,52	0,52
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		8.673,97	111.822,45	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		14.724,00	55.597,35	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		8.925,14	31.438,19	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		39,04	1.384.431,19	0,05	0,05
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		11.293,53	14.528.759,61	0,48	0,48
. VINCI VALOREM FIM		64.274,34	14.198.453,28	0,47	0,47
. BRAD RF DI FED EXTRA		6.761.615,32	81.491.584,18	2,69	2,69
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00	0,00
<u>Debêntures</u>		48.959	76.080.817,78	2,52	
. CEMIG		30.000	44.702.956,19	1,48	1,48
. LOJAS AMERICANAS		720	8.805.503,00	0,29	0,29
. ECOPISTAS		7.000	5.665.859,38	0,19	0,19
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	9.162.504,89	0,30	0,30
. SABESP		2.102	7.043.229,57	0,23	0,23
. ESPÍRITO SANTO CENTRAIS ELÉTRICAS		345	700.764,75	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>10.756.419,94</u>	<u>0,36</u>	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	15.048.642,02	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			<u>250.889.427,26</u>	<u>8,29</u>	
B1. Mercado de Ações			<u>62.138.329,29</u>	<u>2,05</u>	
Companhias Abertas		<u>1.960.032</u>	<u>50.588.817,31</u>	<u>1,67</u>	
. AMBEV	ON	120.607	1.705.382,98	0,06	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	86.578	1.840.648,28	0,06	
. BRCR12/DIR	DIR	13.391	74.148,97	0,00	
. COSAN	ON	64.800	4.595.616,00	0,15	
. ECORODOVIAS	ON	149.200	1.935.124,00	0,06	
. GERDAU - GGBR	PN	147.388	2.359.681,88	0,08	
. ITAUSA	ON	216	2.367,36	0,00	
. ITAUSA	PN	491.509	4.713.571,31	0,16	
. LOGG COMERCIAL	ON	7.386	243.368,70	0,01	
. MRVE	ON	104.800	1.886.400,00	0,06	
. PÃO DE AÇUCAR	PN	64.000	4.542.720,00	0,15	
. PETROBRÁS	PN	258.894	5.579.165,70	0,18	
. RENT	ON	189.378	7.747.453,98	0,26	
. SUZANO PAPEL	PNA	82.100	3.020.459,00	0,10	
. VALE R. DOCE	PNA	179.785	10.053.577,20	0,33	
. VALORES A PAGAR			-89.767,63	0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			378.899,58	0,01	
Instituições Financeiras		<u>499.306</u>	<u>11.549.511,98</u>	<u>0,38</u>	
. BRADESCO	PN	245.535	5.082.574,50	0,17	
. ITAU	PN	253.771	6.458.471,95	0,21	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			8.465,53	0,00	
B2. Fundos		<u>49.522.521,13</u>	<u>188.751.097,97</u>	<u>6,24</u>	
. M. SQUARE INST. FIC FIA		6.293.092,63	21.406.551,97	0,71	
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		15.690.874,77	45.645.300,58	1,51	
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.096.544,16	22.279.124,93	0,74	
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	18.012.388,96	0,60	
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		87.042,25	13.806.598,18	0,46	
. MOAT CAPITAL FIA		10.351.340,47	35.593.713,58	1,18	
. SPX APACHE FIA		13.940.893,93	32.007.419,77	1,06	
C - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		<u>96.125.384</u>	<u>261.595.610,73</u>	<u>8,64</u>	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP		10.858,75	-135.780,47	0,00	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.506,93	2.385.110,14	0,08	
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.676,93	27.345.494,77	0,90	
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.220,00	18.657.296,31	0,62	
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		5.000,00	5.028.409,13	0,17	
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		9.066,22	6.609.968,29	0,22	
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.870.162,91	1.457.731,01	0,05	
. HAMILTON LANE FIC FIP		19.700,40	29.965.640,68	0,99	
. MULTINER FIP		10,17	-16.286,51	0,00	
. STRATUS SCP BR FIP		9.643.471,00	13.206.180,00	0,44	
. P2BR INFR III FIQFIP		9.848,00	15.229.589,51	0,50	
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	7.023.138,00	0,23	
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		9.097.590,07	19.462.463,52	0,64	
. KINEA CHRONOS FIM		19.486.337,47	34.448.586,54	1,14	
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		15.860.872,32	26.644.393,04	0,88	
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		29.971.798,56	32.188.234,04	1,06	
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		121.264,39	22.095.442,77	0,73	
D - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		<u>29.630.770</u>	<u>102.185.206,55</u>	<u>3,38</u>	
. BB MM SCH INV EXTE FI		5.128.757,86	18.897.369,83	0,62	
. MSQUARE GL EQ FICFIM		3.342.850,69	26.949.108,06	0,89	
. VOT ALLIANZGI FIM		3.790.730,70	11.800.205,08	0,39	
. WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI		6.931,42	11.377.333,92	0,38	
. GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE		92.862,26	11.097.370,16	0,37	
. PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR		7.403.274,30	11.666.647,68	0,39	
. ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR		9.865.363,24	10.397.171,82	0,34	

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

CONSOLIDADO

E - INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			94.445.119,00	3,12	
E1 - Investimentos em Shopping Center			60.471.872,92	2,00	
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			36.547.395,08	1,21	
. SHOPPING PLAZA SUL			0,00	0,00	
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			23.942.716,45	0,79	
. VALORES A RECEBER			-18.238,61	0,00	
E2 - Investimento Imobiliário			9.750.231,86	0,32	
. PANAMBY			9.750.231,86	0,32	
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00	
E3 - Investimento Fundo Imobiliário					
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO	147.744,45		18.407.988,03	0,61	
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	146.960,00		9.149.514,10	0,30	
. VALORES A RECEBER	784,45		9.215.899,63	0,30	
. VALORES A PAGAR			42.574,30	0,00	
			0,00	0,00	
E3 - Outros Investimentos Imobiliário					
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS	44		5.815.026,19	0,19	
	44		5.815.026,19	0,19	
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		3.888	83.563.196,17	2,76	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		3.888	80.815.483,18	2,67	
. VALORES A PAGAR (-)			-12.641,24	0,00	
. VALORES A RECEBER			2.760.354,23	0,09	
G - OUTROS			318.584.245,33	10,52	
. DISPONIVEL			2.704.928,20	0,09	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			1.782.987,97	0,06	
. OUTROS REALIZAVEIS			160.281.882,61	5,30	
. OUTROS DIREITOS A RECEBER			159.358.399,14	5,26	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-5.091.481,99	-0,17	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-452.470,60	-0,01	

GESTÃO TERCEIRIZADA	DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO TERCEIRIZADA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS			
- SANT FIC FI ISN RF D	62.269,96	0,01%	0,00%
- BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP	4.428,46	0,00%	0,00%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO	13.486.034,33	1,48%	0,45%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES	38.803.194,65	4,26%	1,28%
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP	55.463.375,22	6,09%	1,83%
- M. SQUARE INST. FIC FIA	21.406.551,97	2,35%	0,71%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	45.645.300,58	5,01%	1,51%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA	13.806.598,18	1,52%	0,46%
- MOAT CAPITAL FIA	35.593.713,58	3,91%	1,18%
- BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	13.098.881,23	1,44%	0,43%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP	8.314.573,99	0,91%	0,27%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II	10.454.459,41	1,15%	0,35%
- SPX APACHE FIA	32.007.419,77	3,51%	1,06%
- IBIUNA EQ. FIC FIA	18.012.388,96	1,98%	0,60%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	111.822,45	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	55.597,35	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	31.438,19	0,00%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.	1.384.431,19	0,15%	0,05%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL	14.528.759,61	1,59%	0,48%
- SAN FC EXTRA RF REF	14.211,90	0,00%	0,00%
- BRADESCO DED. SAUDE ANS	20.998.455,40	2,30%	0,69%
- BBM SMID CAPS FICFIA	22.279.124,93	2,44%	0,74%
- AZ QUEST LUCE	15.740.813,88	1,73%	0,52%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM	52.042.869,62	5,71%	1,72%
- VINCI VALOREM FIM	14.198.453,28	1,56%	0,47%
- BRAD RF DI FED EXTRA	81.491.584,18	8,94%	2,69%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP	(135.780,47)	-0,01%	0,00%
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP	2.385.110,14	0,26%	0,08%

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

CONSOLIDADO

- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			27.345.494,77	3,00%	0,90%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP			18.657.296,31	2,05%	0,62%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVPE PLAZA			5.028.409,13	0,55%	0,17%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES			6.609.968,29	0,73%	0,22%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			1.457.731,01	0,16%	0,05%
- HAMILTON LANE FIC FIP			29.965.640,68	3,29%	0,99%
- MULTINER FIP			-16.286,51	0,00%	0,00%
- STRATUS SCP BR FIP			13.206.180,00	1,45%	0,44%
- P2BR INFR III FIQFIP			15.229.589,51	1,67%	0,50%
- COPA FLORESTAL III			7.023.138,00	0,77%	0,23%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			19.462.463,52	2,14%	0,64%
- KINEA CHRONOS FIM			34.448.586,54	3,78%	1,14%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM			26.644.393,04	2,92%	0,88%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM			32.188.234,04	3,53%	1,06%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM			22.095.442,77	2,42%	0,73%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO			9.192.088,40	1,01%	0,30%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			9.215.899,63	1,01%	0,30%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- BB MM SCH INV EXTE FI			18.897.369,83	2,07%	0,62%
- MSQUARE GL EQ FICFIM			26.949.108,06	2,96%	0,89%
- VOT ALLIANZGI FIM			11.800.205,08	1,29%	0,39%
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI			11.377.333,92	1,25%	0,38%
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE			11.097.370,16	1,22%	0,37%
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR			11.666.647,68	1,28%	0,39%
- ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR			10.397.171,82	1,14%	0,34%
TOTAL			911.225.557,62	100,00%	30,10%

GESTÃO PRÓPRIA	DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENTA FIXA	1.575.397.370,44	74,46%	52,05%
RENTA VARIÁVEL	62.138.329,29	2,94%	2,05%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	76.037.130,97	3,59%	2,51%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	83.563.196,17	3,95%	2,76%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	318.584.245,33	15,06%	10,52%
TOTAL	2.115.720.272,20	100,00%	69,90%