

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

CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 29.05.2020

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			2.986.680.552,89		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			1.890.294.967,15	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>		370.470	1.298.648.147	43,48	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			505.532.440,50	16,93	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		5.002,00	10.778.009,21	0,36	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	4	44.627.825,93	1,49	1,49
. 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	10.778.009,21	0,36	0,36
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-3	-44.627.825,93	-1,49	-1,49
- BANCO MORADA		-3	-10.884.285,63	-0,36	-0,36
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		557	159.640.689,83	5,35	
. ABC		21	12.026.525	0,40	0,40
. PARANÁ BANCO		360	48.735.169,10	1,63	1,63
. BRADESCO		176	60.105.964,21	2,01	2,01
. SAFRA		94	38.773.031,68	1,30	1,30
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		97.669.868,45	335.113.741,46	11,22	
. SANT FIC FI ISN RF D		337,13	62.245,64	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		7.740.962,56	13.452.562,81	0,45	0,45
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		3.514.056,36	38.690.999,79	1,30	1,30
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		4.791.218,50	55.163.768,36	1,85	1,85
. SAN FC EXTRA RF REF		11,56	14.216,45	0,00	0,00
. BRADESCO DED. SAUDE ANS		6.891.627,03	20.960.785,74	0,70	0,70
. BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP		3.708.925,00	210,67	0,00	0,00
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		39.805.697,20	51.499.196,73	1,72	1,72
. BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO		28.735,23	13.058.522,20	0,44	0,44
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		75.416,68	8.256.704,98	0,28	0,28
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		89.951,57	8.945.431,44	0,30	0,30
. AZ QUEST LUCE		30.979.273,95	42.807.831,81	1,43	1,43
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		8.673,97	113.247,93	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		14.724,00	53.535,01	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		8.925,14	33.238,47	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		39,04	1.380.419,68	0,05	0,05
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		11.293,53	14.282.063,61	0,48	0,48
. VINCI VALOREM FIM		64.274,34	14.024.006,32	0,47	0,47
. BRAD RF DI FED EXTRA		4.349.389,16	52.314.753,82	1,75	1,75
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00	0,00
<u>Debêntures</u>		50.071	75.316.119,93	2,53	
. CEMIG		30.000	44.527.119,95	1,49	1,49
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		1.949	71.116,61	0,00	0,00
. LOJAS AMERICANAS		720	8.522.492,37	0,29	0,29
. ECOPISTAS		7.000	5.629.618,03	0,19	0,19
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	8.858.238,64	0,30	0,30
. SABESP		1.265	7.009.921,53	0,23	0,23
. ESPÍRITO SANTO CENTRAIS ELÉTRICAS		345	697.612,79	0,02	0,02
. VALORES A RECEBER					
. COMANCHE PART.			9.349.383,13	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>10.798.259,69</u>	<u>0,36</u>	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	15.090.481,77	0,51	0,51
. 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>228.809.667,78</u>	<u>7,66</u>	
B1. Mercado de Ações			<u>57.954.901,30</u>	<u>1,94</u>	
Companhias Abertas		<u>1.946.641</u>	<u>47.446.663,68</u>	<u>1,59</u>	
. AMBEV	ON	120.607	1.505.175,36	0,05	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	86.578	2.002.549,14	0,07	
. COSAN	ON	64.800	4.267.080,00	0,14	
. ECORODOVIAS	ON	149.200	1.961.980,00	0,07	
. GERDAU - GGBR	PN	147.388	1.979.420,84	0,07	
. ITAUSA	ON	216	2.252,88	0,00	
. ITAUSA	PN	491.509	4.354.769,74	0,15	
. LOGG COMERCIAL	ON	7.386	172.832	0,01	
. MRVE	ON	104.800	1.589.816,00	0,05	
. PÃO DE AÇUCAR	PN	64.000	4.030.720,00	0,13	
. PETROBRÁS	PN	258.894	5.265.903,96	0,18	
. RENT	ON	189.378	7.287.265,44	0,24	
. SUZANO PAPEL	PNA	82.100	3.108.306,00	0,10	
. VALE R. DOCE	PNA	179.785	9.528.605,00	0,32	
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			389.986,92	0,01	
Instituições Financeiras		<u>499.306</u>	<u>10.508.237,62</u>	<u>0,35</u>	
. BRADESCO	PN	245.535	4.652.888,25	0,16	
. ITAU	PN	253.771	5.846.883,84	0,20	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			8.465,53	0,00	
B2. Fundos		<u>49.522.521,13</u>	<u>170.854.766,48</u>	<u>5,72</u>	
. M. SQUARE INST. FIC FIA		6.293.092,63	19.614.501,03	0,66	
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		15.690.874,77	39.971.442,14	1,34	
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.096.544,16	20.693.074,70	0,69	
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	16.426.356,03	0,55	
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		87.042,25	12.601.843,28	0,42	
. MOAT CAPITAL FIA		10.351.340,47	31.576.417,35	1,06	
. SPX APACHE FIA		13.940.893,93	29.971.131,95	1,00	
C - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		<u>96.487.754</u>	<u>260.973.129,45</u>	<u>8,74</u>	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP		10.858,75	-129.003,45	0,00	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.506,93	2.393.368,42	0,08	
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.676,93	27.334.028,75	0,92	
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.220,00	19.601.870,21	0,66	
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		5.000,00	5.030.295,37	0,17	
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		9.066,22	6.616.471,87	0,22	
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.876.004,07	1.461.758,23	0,05	
. HAMILTON LANE FIC FIP		19.700,40	29.333.897,38	0,98	
. MULTINER FIP		10,17	-11.106,06	0,00	
. STRATUS SCP BR FIP		10.000.000,00	14.259.700,00	0,48	
. P2BR INFR III FIQFIP		9.848,00	15.720.891,29	0,53	
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	7.202.469,00	0,24	
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		9.097.590,07	18.989.641,74	0,64	
. KINEA CHRONOS FIM		19.486.337,47	34.171.728,56	1,14	
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		15.860.872,32	26.342.731,79	0,88	
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		29.971.798,56	31.848.377,83	1,07	
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		121.264,39	20.806.008,56	0,70	
D - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		<u>32.935.975</u>	<u>98.971.963,87</u>	<u>3,31</u>	
. BB MM SCH INV EXTE FI		5.128.757,86	18.325.599,70	0,61	
. MSQUARE GL EQ FICFIM		6.648.054,77	25.551.985,65	0,86	
. VOT ALLIANZGI FIM		3.790.730,70	11.310.766,98	0,38	
. WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI		6.931,42	11.207.165,48	0,38	
. GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE		92.862,26	10.971.230,60	0,37	
. PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR		7.403.274,30	11.449.710,20	0,38	
. ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR		9.865.363,24	10.155.505,26	0,34	
E - INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			<u>106.724.321,57</u>	<u>3,57</u>	

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

CONSOLIDADO

E1 - Investimentos em Shopping Center			<u>60.684.074,42</u>	<u>2,03</u>	
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			36.658.820,07	1,23	
. SHOPPING PLAZA SUL			0,00	0,00	
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			24.030.418,71	0,80	
. VALORES A RECEBER			-5.164,36	0,00	
E2 - Investimento Imobiliário			<u>9.669.484,32</u>	<u>0,32</u>	
. PANAMBY			9.669.484,32	0,32	
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00	
E3 - Investimento Fundo Imobiliário		<u>202.564,45</u>	<u>30.661.662,35</u>	<u>1,03</u>	
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		99.010,00	8.970.306,00	0,30	
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		784,45	9.214.639,75	0,31	
. GGR COVEPI RENDA FII		102.770,00	12.434.142,30	0,42	
. VALORES A RECEBER			42.574,30	0,00	
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00	
E3 - Outros Investimentos Imobiliário		<u>44</u>	<u>5.709.100,48</u>	<u>0,19</u>	
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		44	5.709.100,48	0,19	
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		<u>5.232</u>	<u>84.453.943,85</u>	<u>2,83</u>	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		5.232	81.731.730,02	2,74	
. VALORES A PAGAR (-)			-23.525,16	0,00	
. VALORES A RECEBER			2.745.738,99	0,09	
G - OUTROS			<u>316.452.559,22</u>	<u>10,60</u>	
. DISPONIVEL			829.031,74	0,03	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			1.782.987,97	0,06	
. OUTROS REALIZAVEIS			160.281.882,61	5,37	
. OUTROS DIREITOS A RECEBER			159.101.842,19	5,33	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-5.065.610,58	-0,17	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-477.574,71	-0,02	
GESTÃO TERCEIRIZADA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO TERCEIRIZADA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS					
- SANT FIC FI ISN RF D			62.245,64	0,01%	0,00%
- BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP			210,67	0,00%	0,00%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO			13.452.562,81	1,50%	0,45%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES			38.690.999,79	4,32%	1,30%
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP			55.163.768,36	6,15%	1,85%
- M. SQUARE INST. FIC FIA			19.614.501,03	2,19%	0,66%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA			39.971.442,14	4,46%	1,34%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA			12.601.843,28	1,41%	0,42%
- MOAT CAPITAL FIA			31.576.417,35	3,52%	1,06%
- BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO			13.058.522,20	1,46%	0,44%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP			8.256.704,98	0,92%	0,28%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II			8.945.431,44	1,00%	0,30%
- SPX APACHE FIA			29.971.131,95	3,34%	1,00%
- IBIUNA EQ. FIC FIA			16.426.356,03	1,83%	0,55%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER			113.247,93	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II			53.535,01	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III			33.238,47	0,00%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.			1.380.419,68	0,15%	0,05%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL			14.282.063,61	1,59%	0,48%
- SAN FC EXTRA RF REF			14.216,45	0,00%	0,00%
- BRADESCO DED. SAUDE ANS			20.960.785,74	2,34%	0,70%
- BBM SMID CAPS FICFIA			20.693.074,70	2,31%	0,69%
- AZ QUEST LUCE			42.807.831,81	4,77%	1,43%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM			51.499.196,73	5,74%	1,72%
- VINCI VALOREM FIM			14.024.006,32	1,56%	0,47%
- BRAD RF DI FED EXTRA			52.314.753,82	5,83%	1,75%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP			(129.003,45)	-0,01%	0,00%
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP			2.393.368,42	0,27%	0,08%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			27.334.028,75	3,05%	0,92%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP			19.601.870,21	2,19%	0,66%

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

CONSOLIDADO

- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVFP PLAZA			5.030.295,37	0,56%	0,17%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES			6.616.471,87	0,74%	0,22%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			1.461.758,23	0,16%	0,05%
- HAMILTON LANE FIC FIP			29.333.897,38	3,27%	0,98%
- MULTINER FIP			-11.106,06	0,00%	0,00%
- STRATUS SCP BR FIP			14.259.700,00	1,59%	0,48%
- P2BR INFR III FIQFIP			15.720.891,29	1,75%	0,53%
- COPA FLORESTAL III			7.202.469,00	0,80%	0,24%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			18.989.641,74	2,12%	0,64%
- KINEA CHRONOS FIM			34.171.728,56	3,81%	1,14%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM			26.342.731,79	2,94%	0,88%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM			31.848.377,83	3,55%	1,07%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM			20.806.008,56	2,32%	0,70%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO			9.012.880,30	1,01%	0,30%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			9.214.639,75	1,03%	0,31%
- GGR COVEPI RENDA FII			12.434.142,30	1,39%	0,42%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- BB MM SCH INV EXTE FI			18.325.599,70	2,04%	0,61%
- MSQUARE GL EQ FICFIM			25.551.985,65	2,85%	0,86%
- VOT ALLIANZGI FIM			11.310.766,98	1,26%	0,38%
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI			11.207.165,48	1,25%	0,38%
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE			10.971.230,60	1,22%	0,37%
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR			11.449.710,20	1,28%	0,38%
- ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR			10.155.505,26	1,13%	0,34%
TOTAL			896.575.263,65	100,00%	30,02%

GESTÃO PRÓPRIA	DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENTA FIXA	1.555.181.225,69	74,41%	52,07%
RENTA VARIÁVEL	57.954.901,30	2,77%	1,94%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	76.062.659,22	3,64%	2,55%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	84.453.943,85	4,04%	2,83%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	316.452.559,22	15,14%	10,60%
TOTAL	2.090.105.289,28	100,00%	69,98%