

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

CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.03.2020

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			2.912.132.430,30		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			1.845.946.498,40	63,40	
TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOIRO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOIRO NACIONAL					
<u>Nota do Tesouro Nacional</u>		370.470	1.303.894.874	44,78	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			454.912.534,11	15,62	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		5.002,00	10.710.444,35	0,37	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	4	44.627.825,93	1,53	1,53
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.453.009,07	0,19	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.431.276,56	0,19	0,37
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	5.000	10.710.444,35	0,37	0,37
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-3	-44.627.825,93	-1,53	-1,53
- BANCO MORADA		-3	-10.884.285,63	-0,37	-0,37
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		557	138.488.878,75	4,76	
. ABC		21	11.935.917	0,41	0,41
. PARANÁ BANCO		360	48.457.032,23	1,66	1,66
. BRADESCO		176	59.442.531,10	2,04	2,04
. SAFRA		54	18.653.398,00	0,64	0,64
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		147.995.407,32	305.713.211,01	10,50	
. SANT FIC FI ISN RF D		337,13	62.072,37	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		12.764.232,28	20.821.550,72	0,72	0,72
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		12.892.052,05	39.356.761,13	1,35	1,35
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		7.380.371,64	55.502.517,51	1,91	1,91
. AF GERAES 30		10.071.484,93	11.170.955,72	0,38	0,38
. SAN FC EXTRA RF REF		11,56	14.233,07	0,00	0,00
. BRADESCO DED. SAUDE ANS		6.891.627,03	20.866.458,00	0,72	0,72
. BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP		3.708.925,00	287,82	0,00	0,00
. CA AG VITESSE		491.451,18	10.893.269,05	0,37	0,37
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		49.061.396,60	42.568.363,94	1,46	1,46
. BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO		37.429,83	16.912.314,03	0,58	0,58
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		75.416,68	8.090.843,34	0,28	0,28
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		78.649,64	7.635.298,14	0,26	0,26
. AZ QUEST LUCE		34.068.733,41	46.816.029,75	1,61	1,61
. ARX VINSON FI RF CP		10.431.101,69	11.270.566,20	0,39	0,39
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		8.673,97	232.127,62	0,01	0,01
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		14.724,00	56.245,89	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		8.925,14	35.409,33	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		39,04	1.369.823,48	0,05	0,05
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		9.824,52	12.038.083,90	0,41	0,41
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00	0,00
<u>Debêntures</u>		50.071	76.373.184,39	2,63	
. CEMIG		30.000	44.408.854,90	1,53	1,53
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		1.949	320.071,37	0,01	0,01
. LOJAS AMERICANAS		720	8.908.007,25	0,31	0,31
. ECOPISTAS		7.000	6.204.680,78	0,21	0,21
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	8.858.303,81	0,30	0,30
. SABESP		1.265	6.980.669,60	0,24	0,24
. ESPÍRITO SANTO CENTRAIS ELÉTRICAS		345	692.596,68	0,02	0,02
. VALORES A RECEBER					
. COMANCHE PART.			9.349.383,12	0,32	0,32
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS					
. COMANCHE PART.			-9.349.383,12	-0,32	-0,32

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

CONSOLIDADO

Outros Títulos		<u>7</u>	<u>10.765.905,55</u>	<u>0,37</u>	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	15.058.127,63	0,52	0,52
. VALORES A RECEBER			3.274.905,95	0,11	0,11
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS			-7.567.128,03	-0,26	-0,26
B - INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			187.607.206,76	6,44	
B1. Mercado de Ações			<u>49.299.459,61</u>	<u>1,69</u>	
Companhias Abertas		<u>1.946.641</u>	<u>38.795.690,44</u>	<u>1,33</u>	
. AMBEV	ON	120.607	1.437.635,44	0,05	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	86.578	1.306.462,02	0,04	
. COSAN	ON	64.800	3.483.648,00	0,12	
. ECORODOVIAS	ON	149.200	1.409.940,00	0,05	
. GERDAU - GGBR	PN	147.388	1.481.249,40	0,05	
. ITAUSA	ON	216	2.149,20	0,00	
. ITAUSA	PN	491.509	4.310.533,93	0,15	
. LOGG COMERCIAL	ON	7.386	161.753	0,01	
. MRVE	ON	104.800	1.282.752,00	0,04	
. PÃO DE AÇUCAR	PN	64.000	4.245.760,00	0,15	
. PETROBRÁS	PN	258.894	3.621.927,06	0,12	
. RENT	ON	189.378	4.980.641,40	0,17	
. SUZANO PAPEL	PNA	82.100	2.938.359,00	0,10	
. VALE R. DOCE	PNA	179.785	7.770.307,70	0,27	
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			362.571,89	0,01	
Instituições Financeiras		<u>476.985</u>	<u>10.503.769,17</u>	<u>0,36</u>	
. BRADESCO	PN	223.214	4.636.154,78	0,16	
. ITAU	PN	253.771	5.859.572,39	0,20	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			8.042,00	0,00	
B2. Fundos		<u>49.522.521,13</u>	<u>138.307.747,15</u>	<u>4,75</u>	
. M. SQUARE INST. FIC FIA		6.293.092,63	16.432.955,43	0,56	
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		15.690.874,77	31.494.921,69	1,08	
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.096.544,16	17.154.524,57	0,59	
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	13.452.554,27	0,46	
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		87.042,25	10.324.327,14	0,35	
. MOAT CAPITAL FIA		10.351.340,47	23.129.401,59	0,79	
. SPX APACHE FIA		13.940.893,93	26.319.062,46	0,90	
C - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		96.487.754	257.042.848,29	8,83	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP		10.858,75	-120.519,26	0,00	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.506,93	2.232.781,46	0,08	
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.676,93	27.380.506,33	0,94	
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.220,00	19.616.912,57	0,67	
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		5.000,00	5.034.534,32	0,17	
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		9.066,22	6.631.894,41	0,23	
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.876.004,07	1.620.520,95	0,06	
. HAMILTON LANE FIC FIP		19.700,40	28.978.246,06	1,00	
. MULTINER FIP		10,17	-14.324,92	0,00	
. STRATUS SCP BR FIP		10.000.000,00	14.290.790,00	0,49	
. P2BR INFR III FIQFIP		9.848,00	15.803.511,99	0,54	
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	6.652.268,60	0,23	
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		9.097.590,07	18.438.744,45	0,63	
. KINEA CHRONOS FIM		19.486.337,47	33.561.511,94	1,15	
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		15.860.872,32	26.278.256,66	0,90	
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		29.971.798,56	31.564.868,60	1,08	
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		121.264,39	19.092.344,13	0,66	
D - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		41.269.530	109.573.060,11	3,76	
. BB MM SCH INV EXTE FI		9.648.030,71	28.745.456,75	0,99	
. MSQUARE GL EQ FICFIM		6.648.054,77	21.200.120,26	0,73	
. VOT ALLIANZGI FIM		7.605.013,33	18.822.027,06	0,65	
. WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI		6.931,42	10.218.451,06	0,35	
. GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE		92.862,26	10.230.046,54	0,35	
. PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR		7.403.274,30	10.783.332,82	0,37	
. ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR		9.865.363,24	9.573.625,62	0,33	
E - INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			110.962.010,41	3,81	
E1 - Investimentos em Shopping Center			<u>61.087.493,28</u>	<u>2,10</u>	

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

CONSOLIDADO

. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			36.881.670,04	1,27
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			24.205.823,24	0,83
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00
E2 - Investimento Imobiliário			9.262.484,55	0,32
. PANAMBY			9.262.484,55	0,32
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00
E3 - Investimento Fundo Imobiliário	242.484,45	35.073.386,10	1,20	
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO	99.010,00	8.842.583,10	0,30	
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	784,45	9.206.781,52	0,32	
. GGR COVEPI RENDA FII	142.690,00	16.968.575,88	0,58	
. VALORES A RECEBER		55.445,60	0,00	
. VALORES A PAGAR		0,00	0,00	
E3 - Outros Investimentos Imobiliário	44	5.538.646,48	0,19	
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS	44	5.538.646,48	0,19	
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES	3.999	85.107.030,43	2,92	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	3.999	81.794.238,20	2,81	
. VALORES A PAGAR (-)		-38.411,04	0,00	
. VALORES A RECEBER		3.351.203,27	0,12	
G - OUTROS		315.893.775,90	10,83	
. DISPONIVEL		1.572.928,93	0,05	
. DEPOSITOS JUDICIAIS		1.757.839,09	0,06	
. OUTROS REALIZAVEIS		160.282.076,61	5,50	
. OUTROS DIREITOS A RECEBER		157.877.609,57	5,41	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES		-5.212.173,61	-0,18	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL		-384.504,69	-0,01	

GESTÃO TERCEIRIZADA	DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO TERCEIRIZADA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS			
- SANT FIC FI ISN RF D	62.072,37	0,01%	0,00%
- BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP	287,82	0,00%	0,00%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO	20.821.550,72	2,46%	0,72%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES	39.356.761,13	4,65%	1,35%
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP	55.502.517,51	6,56%	1,91%
- M. SQUARE INST. FIC FIA	16.432.955,43	1,94%	0,56%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	31.494.921,69	3,72%	1,08%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA	10.324.327,14	1,22%	0,35%
- MOAT CAPITAL FIA	23.129.401,59	2,73%	0,79%
- BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	16.912.314,03	2,00%	0,58%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP	8.090.843,34	0,96%	0,28%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II	7.635.298,14	0,90%	0,26%
- SPX APACHE FIA	26.319.062,46	3,11%	0,90%
- CA INDOSUEZ VITESSE FI RENDA FIXA CP	10.893.269,05	1,29%	0,37%
- IBIUNA EQ. FIC FIA	13.452.554,27	1,59%	0,46%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	232.127,62	0,03%	0,01%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	56.245,89	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	35.409,33	0,00%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.	1.369.823,48	0,16%	0,05%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL	12.038.083,90	1,42%	0,41%
- SAN FC EXTRA RF REF	14.233,07	0,00%	0,00%
- BRADESCO DED. SAUDE ANS	20.866.458,00	2,47%	0,72%
- BBM SMID CAPS FICFIA	17.154.524,57	2,03%	0,59%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES 30	11.170.955,72	1,32%	0,38%
- AZ QUEST LUCE	46.816.029,75	5,54%	1,61%
- ARX VINSON FI RF CP	11.270.566,20	1,33%	0,39%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM	42.568.363,94	5,03%	1,46%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP	(120.519,26)	-0,01%	0,00%
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP	2.232.781,46	0,26%	0,08%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	27.380.506,33	3,24%	0,94%

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

CONSOLIDADO

- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP			19.616.912,57	2,32%	0,67%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA			5.034.534,32	0,60%	0,17%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES			6.631.894,41	0,78%	0,23%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			1.620.520,95	0,19%	0,06%
- HAMILTON LANE FIC FIP			28.978.246,06	3,43%	1,00%
- MULTINER FIP			-14.324,92	0,00%	0,00%
- STRATUS SCP BR FIP			14.290.790,00	1,69%	0,49%
- P2BR INFR III FIQFIP			15.803.511,99	1,87%	0,54%
- COPA FLORESTAL III			6.652.268,60	0,79%	0,23%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			18.438.744,45	2,18%	0,63%
- KINEA CHRONOS FIM			33.561.511,94	3,97%	1,15%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM			26.278.256,66	3,11%	0,90%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM			31.564.868,60	3,73%	1,08%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM			19.092.344,13	2,26%	0,66%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO			8.898.028,70	1,05%	0,31%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			9.206.781,52	1,09%	0,32%
- GGR COVEPI RENDA FII			16.968.575,88	2,01%	0,58%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- BB MM SCH INV EXTE FI			28.745.456,75	3,40%	0,99%
- MSQUARE GL EQ FICFIM			21.200.120,26	2,51%	0,73%
- VOT ALLIANZGI FIM			18.822.027,06	2,23%	0,65%
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI			10.218.451,06	1,21%	0,35%
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE			10.230.046,54	1,21%	0,35%
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR			10.783.332,82	1,28%	0,37%
- ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR			9.573.625,62	1,13%	0,33%
TOTAL			845.710.252,66	100,00%	29,05%

GESTÃO PRÓPRIA	DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENTA FIXA	1.540.233.287,39	74,55%	52,90%
RENTA VARIÁVEL	49.299.459,61	2,39%	1,69%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	75.888.624,31	3,67%	2,61%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	85.107.030,43	4,12%	2,92%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	315.409.072,29	15,27%	10,83%
TOTAL	2.065.937.474,03	100,00%	70,95%