

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

CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 30.09.2020

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			3.106.193.153,93		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			2.008.009.593,89	64,65	
TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOIRO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOIRO NACIONAL					
<u>Nota do Tesouro Nacional</u>		371.409	1.329.420.263	42,80	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			590.691.523,70	19,02	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		5.072,00	11.135.323,72	0,36	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	4	44.627.825,93	1,44	1,44
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.453.009,07	0,18	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.431.276,56	0,17	0,35
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	5.000	11.064.983,50	0,36	0,36
. CDB 362 DIAS - PARANÁ BANCO	PÓS	70	70.340,22	0,00	0,00
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-3	-44.627.825,93	-1,44	-1,44
- BANCO MORADA		-3	-10.884.285,63	-0,35	-0,35
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		557	164.874.344,09	5,31	
. ABC		21	12.403.842	0,40	0,40
. PARANÁ BANCO		360	49.954.265,24	1,61	1,61
. BRADESCO		176	62.718.170,51	2,02	2,02
. BANCO BTG PACTUAL		0	0,00	0,00	0,00
. SAFRA		94	39.798.066,24	1,28	1,28
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		63.061.721,14	414.681.855,89	13,35	
. SANT FIC FI ISN RF D		337,13	62.616,59	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		5.934.545,17	10.581.756,32	0,34	0,34
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		1.733.031,76	5.270.588,21	0,17	0,17
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		4.336.612,70	56.962.206,53	1,83	1,83
. SAN FC EXTRA RF REF		11,56	14.245,06	0,00	0,00
. BRADESCO DED. SAUDE ANS		6.891.627,03	21.061.768,77	0,68	0,68
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		39.848.910,49	52.757.895,69	1,70	1,70
. BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO		28.418,61	13.081.230,59	0,42	0,42
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		75.416,68	8.363.536,28	0,27	0,27
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		114.603,99	11.706.056,08	0,38	0,38
. AZ QUEST LUCE		4.054.550,34	5.813.957,35	0,19	0,19
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		8.673,97	109.545,09	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		14.724,00	60.357,06	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		8.925,14	79.546,41	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		39,04	1.424.896,74	0,05	0,05
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		11.293,53	14.633.606,07	0,47	0,47
. VINCI VALOREM FIM		64.274,34	14.422.409,35	0,46	0,46
. BRAD RF DI FED EXTRA		16.328.183,40	198.275.637,70	6,38	6,38
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00	0,00
<u>Debêntures</u>		48.248	76.654.736,00	2,48	
. CEMIG		30.000	45.726.108,92	1,47	1,47
. LOJAS AMERICANAS		720	9.021.277,23	0,29	0,29
. ECOPISTAS		7.000	5.208.379,65	0,17	0,17
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	9.476.694,77	0,31	0,31
. SABESP		1.736	7.222.275,43	0,23	0,23
. 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		<u>7</u>	<u>11.243.071,47</u>	<u>0,36</u>	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	15.535.293,55	0,50	0,50
. VALORES A RECEBER			3.274.905,95	0,11	0,11
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS			-7.567.128,03	-0,24	-0,24
B - INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			256.536.156,67	8,26	
B1. Mercado de Ações			<u>63.847.138,64</u>	<u>2,06</u>	
Companhias Abertas		<u>1.946.641</u>	<u>53.362.991,26</u>	<u>1,72</u>	
. AMBEV	ON	120.607	1.512.411,78	0,05	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	86.578	1.591.303,64	0,05	
. COSAN	ON	64.800	4.427.784,00	0,14	
. ECORODOVIAS	ON	149.200	1.766.528,00	0,06	
. GERDAU - GGBR	PN	147.388	3.065.670,40	0,10	
. ITAUSA	ON	216	2.194,56	0,00	
. ITAUSA	PN	491.509	4.325.279,20	0,14	
. LOGG COMERCIAL	ON	7.386	222.097	0,01	
. MRVE	ON	104.800	1.686.232,00	0,05	
. PÃO DE AÇUCAR	PN	64.000	4.463.360,00	0,14	
. PETROBRÁS	PN	258.894	5.076.911,34	0,16	
. RENT	ON	189.378	10.732.051,26	0,35	
. SUZANO PAPEL	PNA	82.100	3.739.655,00	0,12	
. VALE R. DOCE	PNA	179.785	10.627.091,35	0,34	
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			124.421,71	0,00	
Instituições Financeiras		<u>499.306</u>	<u>10.484.147,38</u>	<u>0,34</u>	
. BRADESCO	PN	245.535	4.765.834,35	0,15	
. ITAU	PN	253.771	5.709.847,50	0,18	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			8.465,53	0,00	
B2. Fundos		<u>49.522.521,13</u>	<u>192.689.018,03</u>	<u>6,20</u>	
. M. SQUARE INST. FIC FIA		6.293.092,63	21.660.858,11	0,70	
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		15.690.874,77	47.695.810,77	1,54	
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.096.544,16	23.465.659,96	0,76	
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	18.230.256,75	0,59	
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		87.042,25	13.966.732,58	0,45	
. MOAT CAPITAL FIA		10.351.340,47	35.628.987,84	1,15	
. SPX APACHE FIA		13.940.893,93	32.040.712,02	1,03	
C - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		<u>96.489.444</u>	<u>264.908.415,23</u>	<u>8,53</u>	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP		10.858,75	-186.885,75	-0,01	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.517,01	2.376.204,31	0,08	
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.676,93	27.381.514,56	0,88	
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.269,00	14.930.713,32	0,48	
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		5.000,00	4.989.771,29	0,16	
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		9.098,22	6.620.190,18	0,21	
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.876.004,07	2.030.703,16	0,07	
. HAMILTON LANE FIC FIP		20.896,61	35.549.170,73	1,14	
. MULTINER FIP		10,17	-9.015,97	0,00	
. STRATUS SCP BR FIP		10.000.000,00	13.303.740,00	0,43	
. P2BR INFR III FIQFIP		10.250,00	16.275.511,28	0,52	
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	6.990.986,40	0,23	
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		9.097.590,07	19.233.201,51	0,62	
. KINEA CHRONOS FIM		19.486.337,47	34.599.369,87	1,11	
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		15.860.872,32	27.228.396,75	0,88	
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		29.971.798,56	32.634.034,57	1,05	
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		121.264,39	20.960.809,06	0,67	
D - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		<u>26.287.920</u>	<u>81.353.079,62</u>	<u>#REF!</u>	
. BB MM SCH INV EXTE FI		5.128.757,86	21.822.303,98	0,70	
. VOT ALLIANZGI FIM		3.790.730,70	13.581.089,34	0,44	
. WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI		6.931,42	11.749.038,58	0,38	
. GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE		92.862,26	11.498.523,74	0,37	
. PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR		7.403.274,30	12.024.726,90	0,39	
. ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR		9.865.363,24	10.677.397,08	0,34	

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

CONSOLIDADO

E - INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			93.882.447,29	3,02	
E1 - Investimentos em Shopping Center			59.916.634,32	1,93	
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			36.213.120,13	1,17	
. SHOPPING PLAZA SUL			0,00	0,00	
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			23.679.609,69	0,76	
. VALORES A RECEBER			23.904,50	0,00	
E2 - Investimento Imobiliário			10.153.969,10	0,33	
. PANAMBY			10.153.969,10	0,33	
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00	
E3 - Investimento Fundo Imobiliário			17.339.297,00	0,56	
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO	99.794,45		8.078.980,00	0,26	
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	99.010,00		9.214.518,18	0,30	
. VALORES A RECEBER	784,45		45.798,82	0,00	
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00	
E3 - Outros Investimentos Imobiliário			6.472.546,87	0,21	
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS	44		6.472.546,87	0,21	
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		3.777	81.258.679,50	2,62	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		3.777	78.196.602,98	2,52	
. VALORES A PAGAR (-)			-10.555,43	0,00	
. VALORES A RECEBER			3.072.631,95	0,10	
G - OUTROS			320.244.781,73	10,31	
. DISPONIVEL			777.407,16	0,03	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			1.927.434,58	0,06	
. OUTROS REALIZAVEIS			160.281.882,61	5,16	
. OUTROS DIREITOS A RECEBER			163.108.121,42	5,25	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-5.123.992,33	-0,16	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-726.071,71	-0,02	

GESTÃO TERCEIRIZADA	DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO TERCEIRIZADA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS			
- SANT FIC FI ISN RF D	62.616,59	0,01%	0,00%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO	10.581.756,32	1,09%	0,34%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES	5.270.588,21	0,54%	0,17%
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP	56.962.206,53	5,87%	1,83%
- M. SQUARE INST. FIC FIA	21.660.858,11	2,23%	0,70%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	47.695.810,77	4,91%	1,54%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA	13.966.732,58	1,44%	0,45%
- MOAT CAPITAL FIA	35.628.987,84	3,67%	1,15%
- BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	13.081.230,59	1,35%	0,42%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP	8.363.536,28	0,86%	0,27%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II	11.706.056,08	1,21%	0,38%
- SPX APACHE FIA	32.040.712,02	3,30%	1,03%
- IBIUNA EQ. FIC FIA	18.230.256,75	1,88%	0,59%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	109.545,09	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	60.357,06	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	79.546,41	0,01%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.	1.424.896,74	0,15%	0,05%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL	14.633.606,07	1,51%	0,47%
- SAN FC EXTRA RF REF	14.245,06	0,00%	0,00%
- BRADESCO DED. SAUDE ANS	21.061.768,77	2,17%	0,68%
- BBM SMID CAPS FICFIA	23.465.659,96	2,42%	0,76%
- AZ QUEST LUCE	5.813.957,35	0,60%	0,19%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM	52.757.895,69	5,43%	1,70%
- VINCI VALOREM FIM	14.422.409,35	1,49%	0,46%
- BRAD RF DI FED EXTRA	198.275.637,70	20,42%	6,38%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP	(186.885,75)	-0,02%	-0,01%
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP	2.376.204,31	0,24%	0,08%

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

CONSOLIDADO

- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			27.381.514,56	2,82%	0,88%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP			14.930.713,32	1,54%	0,48%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA			4.989.771,29	0,51%	0,16%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES			6.620.190,18	0,68%	0,21%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			2.030.703,16	0,21%	0,07%
- HAMILTON LANE FIC FIP			35.549.170,73	3,66%	1,14%
- MULTINER FIP			-9.015,97	0,00%	0,00%
- STRATUS SCP BR FIP			13.303.740,00	1,37%	0,43%
- P2BR INFR III FIQFIP			16.275.511,28	1,68%	0,52%
- COPA FLORESTAL III			6.990.986,40	0,72%	0,23%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			19.233.201,51	1,98%	0,62%
- KINEA CHRONOS FIM			34.599.369,87	3,56%	1,11%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM			27.228.396,75	2,80%	0,88%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM			32.634.034,57	3,36%	1,05%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM			20.960.809,06	2,16%	0,67%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO			8.124.778,82	0,84%	0,26%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			9.214.518,18	0,95%	0,30%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- BB MM SCH INV EXTE FI			21.822.303,98	2,25%	0,70%
- VOT ALLIANZGI FIM			13.581.089,34	1,40%	0,44%
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI			11.749.038,58	1,21%	0,38%
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE			11.498.523,74	1,18%	0,37%
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR			12.024.726,90	1,24%	0,39%
- ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR			10.677.397,08	1,10%	0,34%
TOTAL			970.971.665,81	100,00%	31,26%

GESTÃO PRÓPRIA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENTA FIXA			1.593.327.738,00	74,62%	51,30%
RENTA VARIÁVEL			63.847.138,64	2,99%	2,06%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			76.543.150,29	3,58%	2,46%
EMPRÉSTIMO PESSOAL			81.258.679,50	3,81%	2,62%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)			320.244.781,73	15,00%	10,31%
TOTAL			2.135.221.488,16	100,00%	68,74%