

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

CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 30.04.2020

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			2.961.493.415,79		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			1.855.790.426,41	62,66	
<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	1.309.534.548	44,22	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			460.591.599,04	15,55	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		5.002,00	10.763.659,85	0,36	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	4	44.627.825,93	1,51	1,51
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.453.009,07	0,18	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.431.276,56	0,18	0,37
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	5.000	10.763.659,85	0,36	0,36
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-3	-44.627.825,93	-1,51	-1,51
- BANCO MORADA		-3	-10.884.285,63	-0,37	-0,37
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		557	159.295.452,84	5,38	
. ABC		21	12.001.467	0,41	0,41
. PARANÁ BANCO		360	48.671.952,13	1,64	1,64
. BRADESCO		176	59.884.347,22	2,02	2,02
. BANCO BTG PACTUAL		0	0,00	0,00	0,00
. SAFRA		94	38.737.686,01	1,31	1,31
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		93.237.079,94	290.532.486,35	9,81	
. SANT FIC FI ISN RF D		337,13	62.110,81	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		8.668.067,03	18.013.041,72	0,61	0,61
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		3.512.028,69	38.718.323,59	1,31	1,31
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		6.928.200,27	54.548.847,85	1,84	1,84
. SAN FC EXTRA RF REF		11,56	14.216,93	0,00	0,00
. BRADESCO DED. SAUDE ANS		6.891.627,03	20.917.773,06	0,71	0,71
. BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP		3.708.925,00	254,42	0,00	0,00
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		49.066.359,69	36.886.257,02	1,25	1,25
. BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO		50.191,48	22.708.623,17	0,77	0,77
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		75.416,68	8.076.877,31	0,27	0,27
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		78.649,64	7.734.283,38	0,26	0,26
. AZ QUEST LUCE		14.213.610,07	46.762.885,90	1,58	1,58
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		8.673,97	113.707,29	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		14.724,00	60.444,45	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		8.925,14	34.650,11	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		39,04	1.377.661,91	0,05	0,05
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		11.293,53	13.995.657,02	0,47	0,47
. BRAD RF DI FED EXTRA		7.503.249,22	20.506.870,41	0,69	0,69
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00	0,00
<u>Debêntures</u>		50.071	74.863.503,86	2,54	
. CEMIG		30.000	44.543.197,33	1,50	1,50
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		1.949	182.270,48	0,01	0,01
. LOJAS AMERICANAS		720	8.379.263,93	0,28	0,28
. ECOPISTAS		7.000	5.618.387,50	0,19	0,19
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	8.438.777,95	0,28	0,28
. SABESP		1.265	7.007.117,77	0,24	0,24
. TRIANGULO DO SOL AUTO - ESTRADAS S/A		345	694.488,90	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		Z	10.800.775,14	0,36	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	15.092.997,22	0,51	0,51
. VALORES A RECEBER			3.274.905,95	0,11	0,11
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS			-7.567.128,03	-0,26	-0,26
B - INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			211.717.618,82	7,15	
B1. Mercado de Ações			53.962.303,77	1,82	
Companhias Abertas		1.946.641	43.473.900,85	1,47	
. AMBEV	ON	120.607	1.367.683,38	0,05	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	86.578	1.678.747,42	0,06	
. COSAN	ON	64.800	3.910.032,00	0,13	
. ECORODOVIAS	ON	149.200	1.565.108,00	0,05	
. GERDAU - GGBR	PN	147.388	1.730.335,12	0,06	
. ITAUSA	ON	216	2.298,24	0,00	
. ITAUSA	PN	491.509	4.423.581,00	0,15	
. LOGG COMERCIAL	ON	7.386	168.992	0,01	
. MRVE	ON	104.800	1.587.720,00	0,05	
. PÃO DE AÇUCAR	PN	64.000	4.238.080,00	0,14	
. PETROBRÁS	PN	258.894	4.673.036,70	0,16	
. RENT	ON	189.378	6.474.833,82	0,22	
. SUZANO PAPEL	PNA	82.100	3.235.561,00	0,11	
. VALE R. DOCE	PNA	179.785	8.065.155,10	0,27	
. VIVT - TELEF. BRASIL	PN	0	-	0,00	
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			352.737,39	0,01	
Instituições Financeiras		499.306	10.488.402,92	0,35	
. BRADESCO	PN	245.535	4.701.995,25	0,16	
. ITAU	PN	253.771	5.778.365,67	0,20	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			8.042,00	0,00	
B2. Fundos		49.522.521,13	157.755.315,05	5,33	
. M. SQUARE INST. FIC FIA		6.293.092,63	18.446.433,50	0,62	
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		15.690.874,77	35.984.112,82	1,22	
. BBM SMID CAPS FIC FIA		3.096.544,16	19.153.608,89	0,65	
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	15.633.870,44	0,53	
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		87.042,25	11.993.747,93	0,40	
. MOAT CAPITAL FIA		10.351.340,47	28.106.880,93	0,95	
. SPX APACHE FIA		13.940.893,93	28.436.660,54	0,96	
C - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		96.487.754	259.748.828,60	8,77	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP		10.858,75	-126.927,03	0,00	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.506,93	2.226.963,26	0,08	
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.676,93	27.364.131,57	0,92	
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.220,00	19.614.516,39	0,66	
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		5.000,00	5.032.080,97	0,17	
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		9.066,22	6.622.698,50	0,22	
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.876.004,07	1.464.472,40	0,05	
. HAMILTON LANE FIC FIP		19.700,40	29.804.273,52	1,01	
. MULTINER FIP		10,17	-8.402,50	0,00	
. STRATUS SCP BR FIP		10.000.000,00	14.275.210,00	0,48	
. P2BR INFR III FIQFIP		9.848,00	15.727.887,49	0,53	
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	7.036.750,80	0,24	
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		9.097.590,07	18.784.777,66	0,63	
. KINEA CHRONOS FIM		19.486.337,47	33.943.598,10	1,15	
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		15.860.872,32	26.587.447,40	0,90	
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		29.971.798,56	31.575.256,82	1,07	
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		121.264,39	19.824.093,29	0,67	

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO

CONSOLIDADO

D - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		41.269.530	121.448.963,88	4,10	
. BB MM SCH INV EXTE FI		9.648.030,71	33.441.130,53	1,13	
. MSQUARE GL EQ FICFIM		6.648.054,77	24.606.861,76	0,83	
. VOT ALLIANZGI FIM		7.605.013,33	20.856.254,95	0,70	
. WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI		6.931,42	10.733.290,68	0,36	
. GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE		92.862,26	10.728.273,90	0,36	
. PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR		7.403.274,30	11.143.258,86	0,38	
. ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR		9.865.363,24	9.939.893,20	0,34	
E - INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			110.568.410,13	3,73	
E1 - Investimentos em Shopping Center			60.863.274,04	2,06	
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			36.770.245,06	1,24	
. SHOPPING PLAZA SUL			0,00	0,00	
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			24.118.120,96	0,81	
. VALORES A RECEBER			-25.091,98	0,00	
E2 - Investimento Imobiliário			9.588.736,78	0,32	
. PANAMBY			9.588.736,78	0,32	
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00	
E3 - Investimento Fundo Imobiliário		229.580,45	34.478.872,05	1,16	
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		99.010,00	9.144.563,60	0,31	
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		784,45	9.209.411,73	0,31	
. GGR COVEPI RENDA FII		129.786,00	15.833.892,00	0,53	
. VALORES A RECEBER			291.004,72	0,01	
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00	
E3 - Outros Investimentos Imobiliário		44	5.637.527,26	0,19	
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		44	5.637.527,26	0,19	
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		3.978	84.942.283,36	2,87	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		3.978	82.160.667,62	2,77	
. VALORES A PAGAR (-)			-30.588,75	0,00	
. VALORES A RECEBER			2.812.204,49	0,09	
G - OUTROS			317.276.884,59	10,71	
. DISPONIVEL			2.003.892,53	0,07	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			1.757.839,09	0,06	
. OUTROS REALIZAVEIS			160.282.076,61	5,41	
. OUTROS DIREITOS A RECEBER			158.813.858,94	5,36	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-5.072.451,61	-0,17	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-508.330,97	-0,02	

GESTÃO TERCEIRIZADA	DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO A GESTÃO TERCEIRIZADA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS			
- SANT FIC FI ISN RF D	62.110,81	0,01%	0,00%
- BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP	254,42	0,00%	0,00%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO	18.013.041,72	2,08%	0,61%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES	38.718.323,59	4,48%	1,31%
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP	54.548.847,85	6,31%	1,84%
- M. SQUARE INST. FIC FIA	18.446.433,50	2,14%	0,62%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	35.984.112,82	4,16%	1,22%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA	11.993.747,93	1,39%	0,40%
- MOAT CAPITAL FIA	28.106.880,93	3,25%	0,95%
- BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	22.708.623,17	2,63%	0,77%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP	8.076.877,31	0,93%	0,27%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II	7.734.283,38	0,90%	0,26%
- SPX APACHE FIA	28.436.660,54	3,29%	0,96%
- IBIUNA EQ. FIC FIA	15.633.870,44	1,81%	0,53%

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO

CONSOLIDADO

- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER			113.707,29	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II			60.444,45	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III			34.650,11	0,00%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.			1.377.661,91	0,16%	0,05%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL			13.995.657,02	1,62%	0,47%
- SAN FC EXTRA RF REF			14.216,93	0,00%	0,00%
- BRADESCO DED. SAUDE ANS			20.917.773,06	2,42%	0,71%
- BBM SMID CAPS FICFIA			19.153.608,89	2,22%	0,65%
- AZ QUEST LUCE			46.762.885,90	5,41%	1,58%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM			36.886.257,02	4,27%	1,25%
- VINCI VALOREM FIM			-	0,00%	0,00%
- BRAD RF DI FED EXTRA			20.506.870,41	2,37%	0,69%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP			(126.927,03)	-0,01%	0,00%
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP			2.226.963,26	0,26%	0,08%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			27.364.131,57	3,17%	0,92%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP			19.614.516,39	2,27%	0,66%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVPE PLAZA			5.032.080,97	0,58%	0,17%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES			6.622.698,50	0,77%	0,22%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			1.464.472,40	0,17%	0,05%
- HAMILTON LANE FIC FIP			29.804.273,52	3,45%	1,01%
- . MULTINER FIP			-8.402,50	0,00%	0,00%
- STRATUS SCP BR FIP			14.275.210,00	1,65%	0,48%
- P2BR INFR III FIQFIP			15.727.887,49	1,82%	0,53%
- COPA FLORESTAL III			7.036.750,80	0,81%	0,24%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			18.784.777,66	2,17%	0,63%
- KINEA CHRONOS FIM			33.943.598,10	3,93%	1,15%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM			26.587.447,40	3,08%	0,90%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM			31.575.256,82	3,65%	1,07%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM			19.824.093,29	2,29%	0,67%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO			9.435.568,32	1,09%	0,32%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			9.209.411,73	1,07%	0,31%
- GGR COVEPI RENDA FII			15.833.892,00	1,83%	0,53%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- BB MM SCH INV EXTE FI			33.441.130,53	3,87%	1,13%
- MSQUARE GL EQ FICFIM			24.606.861,76	2,85%	0,83%
- VOT ALLIANZGI FIM			20.856.254,95	2,41%	0,70%
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI			10.733.290,68	1,24%	0,36%
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE			10.728.273,90	1,24%	0,36%
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR			11.143.258,86	1,29%	0,38%
- ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR			9.939.893,20	1,15%	0,34%
TOTAL			863.964.465,97	100,00%	29,17%

GESTÃO PRÓPRIA	DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENDA FIXA	1.565.257.940,06	74,62%	52,85%
RENDA VARIÁVEL	53.962.303,77	2,57%	1,82%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	76.089.538,08	3,63%	2,57%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	84.942.283,36	4,05%	2,87%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	317.276.884,59	15,13%	10,71%
TOTAL	2.097.528.949,86	100,00%	70,83%