

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO

CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 30.06.2016

DISCRIMINAÇÃO	Espécie Tipo	Quantidade	Valor em R\$	Alocação do patrimônio (%)	Diversificação (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.946.909.312,04		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			1.380.322.651,17	70,91	
TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOURO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOURO NACIONAL					
Nota do Tesouro Nacional		296.124	915.572.742,93	47,03	
APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS			257.849.169,96	13,24	
Certificado de Depósito Bancário		-16.536.437,94	44.416.820,15	2,28	
. CDB 182 DIAS - CACIQUE	PÓS	68	70.456,89	0,00	0,00
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	4	44.627.825,93	2,29	2,29
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	2.049.533	5.453.009,07	0,28	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	3.383.074	5.431.276,56	0,28	0,56
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	3.501	7.499.761,84	0,39	0,39
. CDB 365 DIAS - SOFISA	PÓS	6.001	6.187.805,76	0,32	0,32
. CDB 2995 DIAS - VOTORANTIM	PÓS	5.001	19.358.845,57	0,99	0,99
. CDB 365 DIAS - BANCO BMG	PÓS	5.000	5.102.863,78	0,26	0,26
. CDB 362 DIAS - PARANÁ BANCO	PÓS	6.000	6.197.086,31	0,32	0,32
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-16.562.013	-44.627.825,93	-2,29	-2,29
- BANCO MORADA		-5.432.607	-10.884.285,63	-0,56	-0,56
Letra Financeira Subordinada		95	77.880.483,65	4,00	
. ABC		19	27.726.390,20	1,42	1,42
. PINE		17	8.565.934,19	0,44	0,44
. BRADESCO		59	31.405.123,03	1,61	1,61
. BANCO BTG PACTUAL		1	7.811.647,49	0,40	0,40
. SAFRA		4	2.371.388,74	0,12	0,12
Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.		29.760.586,64	135.551.866,16	6,96	
. ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM		516,24	71.278,27	0,00	0,00
. BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM		3.871.087,70	35.024.010,48	1,80	1,80
. REAL FAQ EXTRA DI - ASSISTENCIAL		11,56	12.472,90	0,00	0,00
. METRUS SAUDE RF ANS		6.891.627,03	15.833.269,13	0,81	0,81
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FI MULTIMERCADO II		14.999.454,54	19.203.204,57	0,99	0,99
. BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP		3.708.925,00	3.666.489,70	0,19	0,19
. BNP PARIBAS MATCH DI FI RENDA FIXA		181.148,27	40.105.677,31	2,06	2,06
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		75.416,68	10.334.414,85	0,53	0,53
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		8.673,97	59.282,79	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		14.724,00	100.060,82	0,01	0,01
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		8.925,14	129.954,05	0,01	0,01
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		39,04	4.614.843,10	0,24	0,24
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR		37,48	6.396.908,19	0,33	0,33
Debêntures		45.576	93.687.452,84	4,82	
. CEMIG		32.000	42.030.346,60	2,16	2,16
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		1.300	10.486.027,51	0,54	0,54
. ECOPISTAS		7.000	9.251.921,70	0,48	0,48
. RODOVIAS DO TIETÉ		3.000	3.805.907,44	0,20	0,20
. ROTA DAS BANDEIRAS		500	7.876.538,11	0,40	0,40
. SABESP		1.026	12.328.636,64	0,63	0,63
. TRIANGULO DO SOL AUTO - ESTRADAS S/A		450	4.533.009,32	0,23	0,23
. BR TOWERS SPEI S.A.		300	3.375.066	0,17	0,17
. VALORES A RECEBER					
. COMANCHE PART.			9.349.383,13	0,48	0,48
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS					
. COMANCHE PART.			-9.349.383,12	-0,48	-0,48
Outros Títulos		9.071	113.213.285,44	5,82	
. CERTIFICADO DE RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS		61	24.993.682,65	1,28	1,28
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	15.703.241,50	0,81	0,81
. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCARIO		3	111.637.206,29	5,73	5,73
. DEPOSITO A PRAZO COM GARANTIA ESPECIAL		9.000	16.988.534,42	0,87	0,87

. VALORES A RECEBER			62.573.504,15	3,21	3,21
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS			-118.682.883,57	-6,10	-6,10
B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			183.846.599,19	9,44	
B1. Mercado de Ações			78.626.440,61	4,04	
Companhias Abertas		4.361.191	68.846.168,01	3,54	
. AMBEV	ON	128.907	2.455.678,35	0,13	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	104.778	4.728.631,14	0,24	
. COSAN	ON	73.000	2.431.630,00	0,12	
. ECORODOVIAS	ON	173.400	1.453.092,00	0,07	
. EVEN	ON	331.900	1.274.496,00	0,07	
. GERDAU - GGBR	PN	385.988	2.273.469,32	0,12	
. ISHARES BOVA	CI	607.100	30.294.290,00	1,56	
. IGUATEMI EMP SHOP S.A	ON	99.200	2.794.464,00	0,14	
. ITAUSA	PN	508.492	3.859.454,28	0,20	
. MARCOPOLO	PN	284.900	683.760,00	0,04	
. MILLS	ON	207.134	888.604,86	0,05	
. MRVE	ON	134.100	1.449.621,00	0,07	
. PÃO DE AÇUCAR	PN	0	-	0,00	
. PETROBRÁS	PN	384.394	3.620.991,48	0,19	
. RANDON PART	PN	350.416	1.138.852,00	0,06	
. RENT	ON	68.945	2.378.602,50	0,12	
. RUMO LOG	ON	75.693	370.895,70	0,02	
. RUMO LOG DIR	DIR	21.700	245.861,00	0,01	
. TOTVS	ON	50.300	1.536.162,00	0,08	
. VALE R. DOCE	PNA	370.844	4.832.097,32	0,25	
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00	
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			135.515,06	0,01	
Instituições Financeiras		351.278	9.780.272,60	0,50	
. BRADESCO	PN	176.485	4.443.892,30	0,23	
. BRADESCO DIR	ON	0	0,00	0,00	
. ITAU	PN	174.793	5.296.227,90	0,27	
. VALORES A PAGAR				0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			40.152,40	0,00	
B2. Fundos		57.139.422,93	105.220.158,58	5,40	
. FATOR SINERGIA IV FIA		0,00	0,00	0,00	
. FATOR SINERGIA V FIA		4.122,00	2.901.217,68	0,15	
. M. SQUARE INST. FIC FIA		22.074.872,20	37.895.561,14	1,95	
. CONSTELLATION INSTITUCIONAIS FIC FIA		21.280.821,63	25.263.796,60	1,30	
. GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA		7.657.740,41	13.747.882,43	0,71	
. BTG PACTUAL DIVIDENDOS FICFIA		0,00	0,00	0,00	
. BBM SMID CAPS FICFIA		6.088.588,88	20.261.563,46	1,04	
. IBIUNA EQ. FIC FIA		33.277,82	5.150.137,27	0,26	
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		22.562.357,09	120.384.514,08	6,18	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP		10.778,33	450.263,94	0,02	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.385,34	3.384.445,28	0,17	
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.676,93	23.952.391,85	1,23	
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		7.734,00	13.188.194,02	0,68	
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVPE PLAZA		5.000,00	5.109.148,42	0,26	
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		8.240,22	8.117.055,14	0,42	
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.064.533,51	730.355,85	0,04	
. HAMILTON LANE FIC FIP		12.125,00	12.107.942,35	0,62	
. MULTINER FIP		9,44	14.266.824,71	0,73	
. STRATUS SCP BR FIP		4.715.880,00	5.020.855,96	0,26	
. P2BR INFR III FIQFIP		2.578,00	2.498.306,31	0,13	
. COPA FLORESTAL III		500.000,00	401.152,92	0,02	
. MEMORIAL OFFICE FI IMOBILIARIO		10.000,00	1.019.099,92	0,05	
. ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO		39.000,00	11.115.000,00	0,57	
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		99.010,00	8.777.236,50	0,45	
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		784,45	10.056.682,41	0,52	
. VALORES A RECEBER			189.558,50	0,01	
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		16.076.621,89	34.878.093,16	1,79	
. BB MM SCH INV EXTE FI		5.128.757,86	14.451.675,70	0,74	
. MSQUARE GL EQ FICFIM		3.342.850,69	10.292.679,48	0,53	
. VOT ALLIANZGI FIM		7.605.013,33	10.133.737,98	0,52	
D-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			104.078.704,80	5,35	
D1 - Investimentos em Shopping Center			92.276.040,20	4,74	
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			27.244.554,57	1,40	

. SHOPPING PLAZA SUL			46.650.437,32	2,40
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			17.685.504,09	0,91
. VALORES A RECEBER			695.544,22	0,04
D2 - Investimento Imobiliário			11.802.664,60	0,61
. PANAMBY			11.802.664,60	0,61
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00
E - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		5.169	118.354.899,61	6,08
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	5.169		115.128.458,45	5,91
. VALORES A PAGAR (-)			-97.425,65	-0,01
. VALORES A RECEBER			3.323.866,81	0,17
F - OUTROS			5.043.850,03	0,26
. DISPONÍVEL			5.791.241,70	0,30
. DEPOSITOS JUDICIAIS			752.486,45	0,04
. OUTROS REALIZÁVEIS			388.073,92	0,02
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-1.104.029,94	-0,06
. EXIGÍVEL CONTINGENCIAL			-783.922,10	-0,04

GESTÃO TERCEIRIZADA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Terceirizada	(%) em relação ao Recursos Garantidores
FUNDOS			
- ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM	71.278,27	0,02%	0,00%
- FUNDO FATOR SINERGIA V	2.901.217,68	0,73%	0,15%
- BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP	3.666.489,70	0,93%	0,19%
- BRADESCO FI REF DI PREMIUM	35.024.010,48	8,84%	1,80%
- M. SQUARE INST. FIC FIA	37.895.561,14	9,57%	1,95%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	25.263.796,60	6,38%	1,30%
- GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA	13.747.882,43	3,47%	0,71%
- BNP PARIBAS MATCH DI FI RENDA FIXA	40.105.677,31	10,13%	2,06%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP	10.334.414,85	2,61%	0,53%
- IBIUNA EQ. FIC FIA	5.150.137,27	1,30%	0,26%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	59.282,79	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	100.060,82	0,03%	0,01%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	129.954,05	0,03%	0,01%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.	4.614.843,10	1,17%	0,24%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR	6.396.908,19	1,62%	0,33%
- BRZ MULTIRECEBÍVEIS FIC FI MULTIMERCADO II	19.203.204,57	4,85%	0,99%
- REAL FAQ EXTRA DI - ASSISTENCIAL	12.472,90	0,00%	0,00%
- BRADESCO DED. SAUDE ANS	15.833.269,13	4,00%	0,81%
- BBM SMID CAPS FICFIA	20.261.563,46	5,12%	1,04%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP	450.263,94	0,11%	0,02%
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP	3.384.445,28	0,85%	0,17%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	23.952.391,85	6,05%	1,23%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP	13.188.194,02	3,33%	0,68%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA	5.109.148,42	1,29%	0,26%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES	8.117.055,14	2,05%	0,42%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE	730.355,85	0,18%	0,04%
- HAMILTON LANE FIC FIP	12.107.942,35	3,06%	0,62%
. MULTINER FIP	14.266.824,71	3,60%	0,73%
- STRATUS SCP BR FIP	5.020.855,96	1,27%	0,26%
- P2BR INFR III FIQFIP	2.498.306,31	0,63%	0,13%
- COPA FLORESTAL III	401.152,92	0,10%	0,02%
- MEMORIAL OFFICE FI MOBILIARIO	1.029.099,92	0,26%	0,05%
- ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO	11.222.250,00	2,83%	0,58%
- BTG PACTUAL CORPOTATE OFFICE FI IMOBILIARIO	8.877.236,60	2,24%	0,46%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	10.056.682,41	2,54%	0,52%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			
- BB MM SCH INV EXTE FI	14.451.675,70	3,65%	0,74%
- MSQUARE GL EQ FICFIM	10.292.679,48	2,60%	0,53%
- VOT ALLIANZGI FIM	10.133.737,98	2,56%	0,52%
TOTAL	396.062.323,58	100,00%	20,34%
GESTÃO PRÓPRIA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Própria	(%) em relação ao Recursos Garantidores
RENDA FIXA	1.244.770.785,01	80,26%	63,95%
RENDA VARIÁVEL	78.626.440,61	5,07%	4,04%

INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	104.078.704,80	6,71%	5,35%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	118.354.899,61	7,63%	6,08%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	5.043.850,03	0,33%	0,26%
TOTAL	1.550.874.680,06	100,00%	79,66%