

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

CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 29.01.2021

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			3.088.982.936,71		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			2.062.407.933,48	66,77	
<u>TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOUREIRO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOUREIRO NACIONAL</u>					
<u>Nota do Tesouro Nacional</u>		371.543	1.400.674.187	45,34	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			581.390.565,72	18,82	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		5.072,00	11.782.424,22	0,38	
. 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	0,18	0,35
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	5.000	11.711.479,67	0,38	0,38
. CDB 362 DIAS - PARANÁ BANCO	PÓS	70	70.944,55	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>		1.157	204.137.951,93	6,61	
. ABC		621	45.892.156	1,49	1,49
. PARANÁ BANCO		360	52.544.473,35	1,70	1,70
. BRADESCO		176	67.645.451,18	2,19	2,19
. BANCO BTG PACTUAL		0	0,00	0,00	0,00
. SAFRA		90	38.055.872	1,23	1,23
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		39.785.374,36	365.470.189,57	11,83	
. SANT FIC FI ISN RF D		337,13	63.122,67	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		589,26	1.069,49	0,00	0,00
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		28.363,88	86.606,16	0,00	0,00
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		441.190,25	59.824.957,33	1,94	1,94
. SAN FC EXTRA RF REF		11,56	14.296,62	0,00	0,00
. BRADESCO DED. SAUDE ANS		6.891.627,03	21.172.012,75	0,69	0,69
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		32.188.264,13	44.440.127,21	1,44	1,44
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		75.416,68	7.474.280,23	0,24	0,24
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		114.603,99	12.448.050,98	0,40	0,40
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		8.673,97	105.272,47	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		14.724,00	65.667,04	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		8.925,14	79.547,32	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		39,04	1.403.538,60	0,05	0,05
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		12.608,30	17.571.893,79	0,57	0,57
. VINCI VALOREM FIM		183.841,95	42.209.094,31	1,37	1,37
. BRAD RF DI FED EXTRA		10.263.548,04	124.787.540,45	4,04	4,04
. BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO		7.819.958,17	33.723.112,15	1,09	1,09
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00	0,00
<u>Debêntures</u>		47.057	68.161.763,97	2,22	
. CEMIG		30.000	48.189.055,79	1,56	1,56
. ECOPISTAS		7.000	4.240.204,56	0,14	0,14
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	10.511.547,87	0,34	0,34
. SABESP		1.265	5.220.955,75	0,17	0,17
. VALORES A RECEBER					
. COMANCHE PART.			9.349.383,12	0,30	0,30
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
. COMANCHE PART.			-9.349.383,12	-0,30	-0,30
<u>Outros Títulos</u>		7	12.181.416,92	0,39	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	16.473.639,00	0,53	0,53

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

CONSOLIDADO

. 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			301.423.975,76	9,76	
B1. Mercado de Ações			79.447.305,51	2,57	
Companhias Abertas		1.946.641	65.960.526,59	2,14	
. AMBEV	ON	120.607	1.822.371,77	0,06	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	86.578	1.837.185,16	0,06	
. COSAN	ON	64.800	4.863.888,00	0,16	
. ECORODOVIAS	ON	149.200	1.809.796,00	0,06	
. GERDAU - GGBR	PN	147.388	3.426.771,00	0,11	
. ITAUSA	ON	216	2.510	0,00	
. ITAUSA	PN	491.509	5.214.910,49	0,17	
. LOGG COMERCIAL	ON	7.386	247.431	0,01	
. MRVE	ON	104.800	1.991.200,00	0,06	
. PÃO DE AÇUCAR	PN	64.000	4.830.720,00	0,16	
. PETROBRÁS	PN	258.894	6.909.880,86	0,22	
. RENT	ON	189.378	12.097.466,64	0,39	
. SUZANO PAPEL	PNA	82.100	5.094.305,00	0,16	
. VALE R. DOCE	PNA	179.785	15.812.090,75	0,51	
Instituições Financeiras		499.306	13.266.406,04	0,43	
. BRADESCO	PN	245.535	6.074.535,90	0,20	
. ITAU	PN	253.771	7.191.870,14	0,23	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER (inst. Fin. + Companhia Aberta)			220.372,88	0,01	
B2. Fundos		49.522.521,13	221.976.670,25	7,19	
. VELT INST FICFIA		6.293.092,63	25.819.078,47	0,84	
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		15.690.874,77	54.811.107,51	1,77	
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.096.544,16	28.210.505,11	0,91	
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	19.749.996,16	0,64	
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		87.042,25	15.130.021,55	0,49	
. MOAT CAPITAL FIA		10.351.340,47	40.722.941,50	1,32	
. SPX APACHE FIA		13.940.893,93	37.533.019,95	1,22	
C - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		105.710.472	267.493.120,57	8,66	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP		10.858,75	-96.074,28	0,00	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.533,97	2.370.267,39	0,08	
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.676,93	26.614.543,45	0,86	
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.269,00	10.473.217,56	0,34	
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVPE PLAZA		5.000,00	4.982.264,20	0,16	
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		9.229.551,01	6.718.333,42	0,22	
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.876.004,07	2.014.302,28	0,07	
. HAMILTON LANE FIC FIP		21.069,97	31.037.813,07	1,00	
. MULTINER FIP		10,17	-9.742,38	0,00	
. STRATUS SCP BR FIP		10.000.000,00	16.226.830,00	0,53	
. P2BR INFR III FIQFIP		10.635,00	18.169.951,20	0,59	
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	7.669.711,90	0,25	
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		9.097.590,07	19.913.798,58	0,64	
. KINEA CHRONOS FIM		19.486.337,47	35.379.489,80	1,15	
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		15.860.872,32	27.635.762,37	0,89	
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		29.971.798,56	34.215.103,90	1,11	
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		121.264,39	24.177.548,15	0,78	
D - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		182.000.000	128.258.207,56	4,15	
. SCHRODER PLAN II FIM		70.000.000,00	71.398.461,40	2,31	
. SCHRODER METRUS FIM		112.000.000,00	56.859.746,16	1,84	
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00	
E - INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			85.387.676,56	2,76	
E1 - Investimentos em Shopping Center			52.303.376,47	1,69	
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			31.170.061,42	1,01	

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO

CONSOLIDADO

. SHOPPING PLAZA SUL			0,00	0,00
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			21.077.864,83	0,68
. VALORES A RECEBER			55.450,22	0,00
E2 - Investimento Imobiliário			11.889.746,06	0,38
. PANAMBY			11.889.746,06	0,38
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00
E3 - Investimento Fundo Imobiliário	82.465,45	17.665.668,42	0,57	
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO	81.681,00	7.343.121,90	0,24	
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	784,45	9.921.080,71	0,32	
. VALORES A RECEBER		401.760,11	0,01	
. VALORES A PAGAR		-294,30	0,00	
E3 - Outros Investimentos Imobiliário	44	3.528.885,61	0,11	
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS	44	3.528.885,61	0,11	
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES	3.597	70.974.612,64	2,30	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	3.597	72.441.687,26	2,35	
. VALORES A PAGAR (-)		-26.133,22	0,00	
. VALORES A RECEBER		-1.440.941,40	-0,05	
G - OUTROS		173.037.410,14	5,60	
. DISPONIVEL		1.142.689,21	0,04	
. DEPOSITOS JUDICIAIS		1.927.667,86	0,06	
. OUTROS REALIZAVEIS		160.281.882,61	5,19	
. OUTROS DIREITOS A RECEBER		172.847.349,82	5,60	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES		-5.282.571,94	-0,17	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL		-157.879.607,42	-5,11	

GESTÃO TERCEIRIZADA	DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO TERCEIRIZADA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS			
- SANT FIC FI ISN RF D	63.122,67	0,01%	0,00%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO	1.069,49	0,00%	0,00%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES	86.606,16	0,01%	0,00%
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP	59.824.957,33	5,98%	1,94%
- VELT INST FICFIA	25.819.078,47	2,58%	0,84%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	54.811.107,51	5,48%	1,77%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA	15.130.021,55	1,51%	0,49%
- MOAT CAPITAL FIA	40.722.941,50	4,07%	1,32%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP	7.474.280,23	0,75%	0,24%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II	12.448.050,98	1,24%	0,40%
- SPX APACHE FIA	37.533.019,95	3,75%	1,22%
- IBIUNA EQ. FIC FIA	19.749.996,16	1,97%	0,64%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	105.272,47	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	65.667,04	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	79.547,32	0,01%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.	1.403.538,60	0,14%	0,05%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL	17.571.893,79	1,76%	0,57%
- SAN FC EXTRA RF REF	14.296,62	0,00%	0,00%
- BRADESCO DED. SAUDE ANS	21.172.012,75	2,12%	0,69%
- BBM SMID CAPS FICFIA	28.210.505,11	2,82%	0,91%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM	44.440.127,21	4,44%	1,44%
- VINCI VALOREM FIM	42.209.094,31	4,22%	1,37%
- BRAD RF DI FED EXTRA	124.787.540,45	12,47%	4,04%
- BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO	33.723.112,15	3,37%	1,09%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP	(96.074,28)	-0,01%	0,00%
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP	2.370.267,39	0,24%	0,08%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	26.614.543,45	2,66%	0,86%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP	10.473.217,56	1,05%	0,34%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA	4.982.264,20	0,50%	0,16%
- INDUSTRIAL PARKS BRASIL FIP MULTIESTRATÉGIA	6.718.333,42	0,67%	0,22%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE	2.014.302,28	0,20%	0,07%

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

CONSOLIDADO

- HAMILTON LANE FIC FIP			31.037.813,07	3,10%	1,00%
- MULTINER FIP			-9.742,38	0,00%	0,00%
- STRATUS SCP BR FIP			16.226.830,00	1,62%	0,53%
- P2BR INFR III FIQFIP			18.169.951,20	1,82%	0,59%
- COPA FLORESTAL III			7.669.711,90	0,77%	0,25%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			19.913.798,58	1,99%	0,64%
- KINEA CHRONOS FIM			35.379.489,80	3,53%	1,15%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM			27.635.762,37	2,76%	0,89%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM			34.215.103,90	3,42%	1,11%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM			24.177.548,15	2,42%	0,78%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO			7.744.587,71	0,77%	0,25%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			9.921.080,71	0,99%	0,32%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- SCHRODER PLAN II FIM			71.398.461,40	7,13%	2,31%
- SCHRODER METRUS FIM			56.859.746,16	5,68%	1,84%
TOTAL			1.000.863.856,41	100,00%	32,40%

GESTÃO PRÓPRIA	DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENTA FIXA	1.696.937.743,91	81,27%	54,94%
RENTA VARIÁVEL	79.226.932,63	3,79%	2,56%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	67.722.008,14	3,24%	2,19%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	70.974.612,64	3,40%	2,30%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	173.037.410,14	8,29%	5,60%
TOTAL	2.087.898.707,46	100,00%	67,59%