

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

CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.08.2021

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			3.185.568.043,01		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			2.170.418.297,41	68,13	
<u>TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOIRO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOIRO NACIONAL</u>					
Nota do Tesouro Nacional		353.433	1.381.475.300	43,37	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			707.068.844,72	22,20	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		72,00	72.818,94	0,00	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	4	44.627.825,93	1,40	1,40
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.453.009,07	0,17	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.431.276,56	0,17	0,34
. CDB 362 DIAS - PARANÁ BANCO	PÓS	70	72.818,94	0,00	0,00
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-3	-44.627.825,93	-1,40	-1,40
- BANCO MORADA		-3	-10.884.285,63	-0,34	-0,34
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		1.857	242.779.172,18	7,62	
. ABC		621	45.489.585	1,43	1,43
. PARANÁ BANCO		340	51.943.591	1,63	1,63
. BRADESCO		896	74.322.205,61	2,33	2,33
. DAYCOVAL		600	29.840.422	0,94	0,94
. SAFRA		90	41.183.368,89	1,29	1,29
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		39.984.202,76	464.216.853,60	14,57	
. SANT FIC FI ISN RF D		337,13	64.507,17	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		25.422,00	47.703,75	0,00	0,00
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		28.363,88	88.863,12	0,00	0,00
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		504.189,50	70.463.396,25	2,21	2,21
. SAN FC EXTRA RF REF		11,56	14.459,10	0,00	0,00
. BRADESCO DED. SAUDE ANS		6.891.627,03	21.536.947,83	0,68	0,68
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		32.254.317,79	44.908.800,41	1,41	1,41
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		75.416,68	6.999.751,58	0,22	0,22
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		159.546,74	17.105.367,52	0,54	0,54
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		8.673,97	75.023,52	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		14.724,00	33.598,75	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		8.925,14	73.915,50	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		39,04	1.532.670,26	0,05	0,05
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		12.608,30	17.708.983,14	0,56	0,56
. VINCI VALOREM FIM		183.841,95	42.939.369,37	1,35	1,35
. BRAD RF DI FED EXTRA		16.667.716,60	206.305.728,92	6,48	6,48
. BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO		7.819.958,17	34.317.767,41	1,08	1,08
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00	0,00
<u>Debêntures</u>		47.057	68.703.396,27	2,17	
. CEMIG		30.000	49.577.454,49	1,56	1,56
. ECOPISTAS		7.000	3.033.112,90	0,10	0,10
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	10.480.697,19	0,33	0,33
. SABESP		1.265	5.612.131,69	0,18	0,18
. VALORES A RECEBER					
. COMANCHE PART.			9.349.383,12	0,29	0,29
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS					
. COMANCHE PART.			-9.349.383,12	-0,29	-0,29

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO

CONSOLIDADO

Outros Títulos		<u>7</u>	<u>13.170.755,95</u>	<u>0,41</u>	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	17.462.978,03	0,55	0,55
. VALORES A RECEBER			3.274.905,95	0,10	0,10
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS			-7.567.128,03	-0,24	-0,24
B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			<u>309.506.030,30</u>	<u>9,72</u>	
B1. Mercado de Ações			<u>84.454.799,47</u>	<u>2,65</u>	
Companhias Abertas		<u>2.461.041,00</u>	<u>70.260.079,28</u>	<u>2,21</u>	
. AMBEV	ON	120.607	2.062.379,70	0,06	
. ASSAI ATACADISTA	ON	320.000	5.379.200	0,17	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	86.578	2.027.656,76	0,06	
. COSAN	ON	259.200	5.715.360,00	0,18	
. ECORODOVIAS	ON	149.200	1.469.620,00	0,05	
. GERDAU - GGBR	PN	147.388	4.174.028,16	0,13	
. ITAUSA	ON	216	2.505,60	0,00	
. ITAUSA	PN	491.509	5.681.844	0,18	
. LOGG COMERCIAL	ON	7.386	208.137,48	0,01	
. MRVE	ON	104.800	1.434.712	0,05	
. PÃO DE AÇUCAR	PN	64.000	1.813.120,00	0,06	
. PETROBRÁS	PN	258.894	7.039.327,86	0,22	
. RENT	ON	189.378	10.502.903,88	0,33	
. SUZANO PAPEL	PNA	82.100	5.008.100,00	0,16	
. VALE R. DOCE	PNA	179.785	17.741.183,80	0,56	
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00	
Instituições Financeiras		<u>523.858</u>	<u>14.104.188,79</u>	<u>0,44</u>	
. BRADESCO	PN	270.087	6.252.514,05	0,20	
. ITAU	PN	253.771	7.851.674,74	0,25	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER (inst. Fin. + Companhia Aberta)			90.531,40	0,00	
B2. Fundos		<u>49.522.521,13</u>	<u>225.051.230,83</u>	<u>7,06</u>	
. VELT INST FICFIA		6.293.092,63	25.052.513,02	0,79	
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		15.690.874,77	54.225.067,61	1,70	
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.096.544,16	27.691.011,52	0,87	
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	22.075.021,85	0,69	
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		87.042,25	16.887.655,69	0,53	
. MOAT CAPITAL FIA		10.351.340,47	38.375.767,80	1,20	
. SPX APACHE FIA		13.940.893,93	40.744.193,34	1,28	
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		<u>105.742.753</u>	<u>253.426.675,75</u>	<u>7,96</u>	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP		10.858,75	-147.564,00	0,00	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.587,21	2.277.991,06	0,07	
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.676,93	26.211.568,39	0,82	
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.354,00	8.965.345,45	0,28	
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVPE PLAZA		5.000,00	4.503.060,55	0,14	
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		9.229.551,01	2.455.108,01	0,08	
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.907.807,84	2.847.931,76	0,09	
. HAMILTON LANE FIC FIP		21.069,97	21.926.502,15	0,69	
. MULTINER FIP		10,17	-8.179,00	0,00	
.STRATUS SCP BR FIP		10.000.000,00	18.078.430,00	0,57	
. P2BR INFR III FIQFIP		10.974,00	20.126.214,51	0,63	
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	1.031.004,40	0,03	
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		9.097.590,07	20.596.747,39	0,65	
. KINEA CHRONOS FIM		19.486.337,47	36.205.741,69	1,14	
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		15.860.872,32	29.002.373,80	0,91	
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		29.971.798,56	34.355.449,84	1,08	
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		121.264,39	24.998.949,79	0,78	
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		<u>182.000.000</u>	<u>129.468.651,34</u>	<u>4,06</u>	
. SCHRODER PLAN II FIM		70.000.000	74.199.625,50	2,33	

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

CONSOLIDADO

. SCHRODER METRUS FIM		112.000.000,00	55.269.025,84	1,73	
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00	
E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			77.930.956,10	2,45	
E1 - Investimentos em Shopping Center			51.099.327,49	1,60	
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			30.490.340,45	0,96	
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			20.523.184,20	0,64	
. VALORES A RECEBER			85.802,84	0,00	
E2 - Investimento Imobiliário			15.211.413,00	0,48	
. PANAMBY			15.211.413,00	0,48	
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00	
E3 - Investimento Fundo Imobiliário		784,45	11.620.215,61	0,36	
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		784,45	11.620.215,61	0,36	
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00	
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00	
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		3.310	62.866.848,50	1,97	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		3.310	64.746.297,90	2,03	
. VALORES A PAGAR (-)			-14.023,57	0,00	
. VALORES A RECEBER			-1.865.425,83	-0,06	
G - OUTROS			181.950.583,61	5,71	
. DISPONIVEL			1.406.965,08	0,04	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			1.942.281,14	0,06	
. OUTROS REALIZAVEIS			160.285.778,05	5,03	
. OUTROS DIREITOS A RECEBER			181.608.142,64	5,70	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-5.281.287,33	-0,17	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-158.011.295,97	-4,96	
GESTÃO TERCEIRIZADA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO TERCEIRIZADA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS					
- SANT FIC FI ISN RF D			64.507,17	0,01%	0,00%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO			47.703,75	0,00%	0,00%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES			88.863,12	0,01%	0,00%
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP			70.463.396,25	6,50%	2,21%
- VELT INST FICFIA			25.052.513,02	2,31%	0,79%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA			54.225.067,61	5,00%	1,70%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA			16.887.655,69	1,56%	0,53%
- MOAT CAPITAL FIA			38.375.767,80	3,54%	1,20%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP			6.999.751,58	0,65%	0,22%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II			17.105.367,52	1,58%	0,54%
- SPX APACHE FIA			40.744.193,34	3,76%	1,28%
- IBIUNA EQ. FIC FIA			22.075.021,85	2,04%	0,69%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER			75.023,52	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER II			33.598,75	0,00%	0,00%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER III			73.915,50	0,01%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.			1.532.670,26	0,14%	0,05%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL			17.708.983,14	1,63%	0,56%
- SAN FC EXTRA RF REF			14.459,10	0,00%	0,00%
- BRADESCO DED. SAUDE ANS			21.536.947,83	1,99%	0,68%
- BBM SMID CAPS FICFIA			27.691.011,52	2,56%	0,87%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM			44.908.800,41	4,14%	1,41%
- VINCI VALOREM FIM			42.939.369,37	3,96%	1,35%
- BRAD RF DI FED EXTRA			206.305.728,92	19,04%	6,48%
- BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO			34.317.767,41	3,17%	1,08%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP			(147.564,00)	-0,01%	0,00%
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP			2.277.991,06	0,21%	0,07%

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

CONSOLIDADO

- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			26.211.568,39	2,42%	0,82%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP			8.965.345,45	0,83%	0,28%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA			4.503.060,55	0,42%	0,14%
- INDUSTRIAL PARKS BRASIL FIP MULTISTRATÉGIA			2.455.108,01	0,23%	0,08%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			2.847.931,76	0,26%	0,09%
- HAMILTON LANE FIC FIP			21.926.502,15	2,02%	0,69%
- MULTINER FIP			-8.179,00	0,00%	0,00%
- STRATUS SCP BR FIP			18.078.430,00	1,67%	0,57%
- P2BR INFR III FIQFIP			20.126.214,51	1,86%	0,63%
- COPA FLORESTAL III			1.031.004,40	0,10%	0,03%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			20.596.747,39	1,90%	0,65%
- KINEA CHRONOS FIM			36.205.741,69	3,34%	1,14%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM			29.002.373,80	2,68%	0,91%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM			34.355.449,84	3,17%	1,08%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM			24.998.949,79	2,31%	0,78%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			11.620.215,61	1,07%	0,36%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- SCHRODER PLAN II FIM			74.199.625,50	6,85%	2,33%
- SCHRODER METRUS FIM			55.269.025,84	5,10%	1,73%
TOTAL			1.083.783.627,13	100,00%	34,02%

GESTÃO PRÓPRIA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENTA FIXA			1.706.201.443,81	81,18%	53,56%
RENTA VARIÁVEL			84.454.799,47	4,02%	2,65%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			66.310.740,49	3,15%	2,08%
EMPRÉSTIMO PESSOAL			62.866.848,50	2,99%	1,97%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)			181.950.583,61	8,66%	5,71%
TOTAL			2.101.784.415,88	100,00%	65,98%