

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

CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.12.2020

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			3.089.929.568,59		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			2.089.496.606,71	67,62	
TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOURE NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOURE NACIONAL					
<u>Nota do Tesouro Nacional</u>		371.543	1.383.060.438	44,76	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			623.764.458,42	20,19	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		5.072,00	11.587.504,06	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	11.516.712,90	0,37	0,37
. CDB 362 DIAS - PARANÁ BANCO	PÓS	70	70.791,16	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>		857	206.400.952,74	6,68	
. ABC		321	46.523.074	1,51	1,51
. PARANÁ BANCO		360	51.824.608,07	1,68	1,68
. BRADESCO		176	66.634.084,63	2,16	2,16
. BANCO BTG PACTUAL		0	0,00	0,00	0,00
. SAFRA		94	41.419.185,55	1,34	1,34
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		50.241.700,07	405.776.001,62	13,13	
. SANT FIC FI ISN RF D		337,13	63.006,77	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		809,65	1.465,35	0,00	0,00
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		28.363,88	86.735,17	0,00	0,00
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		441.190,25	59.686.791,86	1,93	1,93
. SAN FC EXTRA RF REF		11,56	14.292,11	0,00	0,00
. BRADESCO DED. SAUDE ANS		6.891.627,03	21.143.504,83	0,68	0,68
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		42.644.369,45	58.660.605,72	1,90	1,90
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		75.416,68	7.596.867,04	0,25	0,25
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		114.603,99	12.458.718,18	0,40	0,40
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		8.673,97	107.502,12	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		14.724,00	64.956,25	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		8.925,14	72.431,06	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		39,04	1.377.339,19	0,04	0,04
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		12.608,30	17.623.782,10	0,57	0,57
. VINCI VALOREM FIM		246.452,47	56.468.834,60	1,83	1,83
. BRAD RF DI FED EXTRA		10.487.903,47	136.679.511,45	4,42	4,42
. BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO		7.819.958,17	33.669.657,82	1,09	1,09
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00	0,00
<u>Debêntures</u>		47.528	70.543.095,80	2,29	
. CEMIG		30.000	47.591.210,42	1,54	1,54
. ECOPISTAS		7.000	4.813.113,94	0,16	0,16
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	10.603.867,77	0,34	0,34
. SABESP		1.736	7.534.903,67	0,24	0,24
. 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	12.128.614,96	0,39	
. CÉDULA DE CRÉDITO BANCÁRIO		7	16.420.837,04	0,53	0,53
. VALORES A RECEBER			3.274.905,95	0,11	0,11
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS			-7.567.128,03	-0,24	-0,24

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO

CONSOLIDADO

B - INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			310.018.381,55	10,03
B1. Mercado de Ações			83.034.136,78	2,69
Companhias Abertas		1.946.641	68.216.879,30	2,21
. AMBEV	ON	120.607	1.887.499,55	0,06
. BRF - BRASIL FOODS	ON	86.578	1.908.179,12	0,06
. COSAN	ON	64.800	4.907.304,00	0,16
. ECORODOVIAS	ON	149.200	1.994.804,00	0,06
. GERDAU - GGBR	PN	147.388	3.603.636,60	0,12
. ITAUSA	ON	216	2.665,44	0,00
. ITAUSA	PN	491.509	5.765.400,57	0,19
. LOGG COMERCIAL	ON	7.386	252.675	0,01
. MRVE	ON	104.800	1.985.960,00	0,06
. PÃO DE AÇUCAR	PN	64.000	4.803.200,00	0,16
. PETROBRÁS	PN	258.894	7.337.055,96	0,24
. RENT	ON	189.378	13.057.613,10	0,42
. SUZANO PAPEL	PNA	82.100	4.806.134,00	0,16
. VALE R. DOCE	PNA	179.785	15.722.198,25	0,51
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			182.553,65	0,01
Instituições Financeiras		499.306	14.817.257,48	0,48
. BRADESCO	PN	245.535	6.663.819,90	0,22
. ITAU	PN	253.771	8.026.776,73	0,26
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			126.660,85	0,00
B2. Fundos		49.522.521,13	226.984.244,77	7,35
. M. SQUARE INST. FIC FIA		6.293.092,63	25.375.463,84	0,82
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		15.690.874,77	54.666.963,44	1,77
. BBM SMID CAPS FIC FIA		3.096.544,16	28.733.028,05	0,93
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	20.662.254,50	0,67
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		87.042,25	15.826.898,21	0,51
. MOAT CAPITAL FIA		10.351.340,47	43.442.315,24	1,41
. SPX APACHE FIA		13.940.893,93	38.277.321,49	1,24
C - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		105.709.959	268.989.124,59	8,71
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP		10.858,75	-89.612,98	0,00
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.533,97	2.373.032,36	0,08
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.676,93	26.615.704,42	0,86
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.269,00	10.604.787,73	0,34
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		5.000,00	4.984.084,52	0,16
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		9.229.551,01	6.725.950,66	0,22
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.876.004,07	2.018.198,56	0,07
. HAMILTON LANE FIC FIP		20.896,61	31.286.882,47	1,01
. MULTINER FIP		10,17	-6.739,68	0,00
. STRATUS SCP BR FIP		10.000.000,00	16.241.320,00	0,53
. P2BR INFR III FIQFIP		10.296,00	17.604.409,28	0,57
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	7.672.973,70	0,25
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		9.097.590,07	20.119.446,89	0,65
. KINEA CHRONOS FIM		19.486.337,47	35.736.128,75	1,16
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		15.860.872,32	27.821.590,17	0,90
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		29.971.798,56	34.344.393,24	1,11
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		121.264,39	24.936.574,54	0,81
D - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		21.355.238	85.645.033,88	2,77
. BB MM SCH INV EXTE FI		5.128.757,86	22.705.119,18	0,73
. VOT ALLIANZGI FIM		3.790.730,70	14.124.205,34	0,46
. WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI		6.931,42	12.421.188,60	0,40
. GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE		92.862,26	12.366.806,44	0,40
. PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR		7.403.274,30	12.664.833,32	0,41
. ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR		4.932.681,62	5.681.440,50	0,18
. VALORES A RECEBER			5.681.440,50	0,18
E - INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			88.861.202,93	2,88
E1 - Investimentos em Shopping Center			52.490.062,90	1,70
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			31.267.164,41	1,01

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO

CONSOLIDADO

. SHOPPING PLAZA SUL			0,00	0,00
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			21.157.104,94	0,68
. VALORES A RECEBER			65.793,55	0,00
E2 - Investimento Imobiliário			11.563.493,88	0,37
. PANAMBY			11.563.493,88	0,37
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00
E3 - Investimento Fundo Imobiliário	86.465,45		17.566.685,25	0,57
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO	85.681,00		7.603.331,94	0,25
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	784,45		9.920.590,87	0,32
. VALORES A RECEBER			42.762,44	0,00
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00
E3 - Outros Investimentos Imobiliário	44		7.240.960,90	0,23
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS	44		7.240.960,90	0,23
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES	3.652		76.873.157,53	2,49
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	3.652		73.951.478,37	2,39
. VALORES A PAGAR (-)			-3.589,04	0,00
. VALORES A RECEBER			2.925.268,20	0,09
G - OUTROS			170.046.061,40	5,50
. DISPONIVEL			1.222.082,47	0,04
. DEPOSITOS JUDICIAIS			1.927.667,86	0,06
. OUTROS REALIZAVEIS			160.281.882,61	5,19
. OUTROS DIREITOS A RECEBER			169.660.586,19	5,49
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-5.155.866,14	-0,17
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-157.890.291,59	-5,11
GESTÃO TERCEIRIZADA		DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO TERCEIRIZADA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS				
- SANT FIC FI ISN RF D		63.006,77	0,01%	0,00%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		1.465,35	0,00%	0,00%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		86.735,17	0,01%	0,00%
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		59.686.791,86	5,97%	1,93%
- M. SQUARE INST. FIC FIA		25.375.463,84	2,54%	0,82%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		54.666.963,44	5,47%	1,77%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		15.826.898,21	1,58%	0,51%
- MOAT CAPITAL FIA		43.442.315,24	4,35%	1,41%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		7.596.867,04	0,76%	0,25%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		12.458.718,18	1,25%	0,40%
- SPX APACHE FIA		38.277.321,49	3,83%	1,24%
- IBIUNA EQ. FIC FIA		20.662.254,50	2,07%	0,67%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		107.502,12	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		64.956,25	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		72.431,06	0,01%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		1.377.339,19	0,14%	0,04%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		17.623.782,10	1,76%	0,57%
- SAN FC EXTRA RF REF		14.292,11	0,00%	0,00%
- BRADESCO DED. SAUDE ANS		21.143.504,83	2,12%	0,68%
- BBM SMID CAPS FICFIA		28.733.028,05	2,88%	0,93%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		58.660.605,72	5,87%	1,90%
- VINCI VALOREM FIM		56.468.834,60	5,65%	1,83%
- BRAD RF DI FED EXTRA		136.679.511,45	13,68%	4,42%
- BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO		33.669.657,82	3,37%	1,09%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS				
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP		(89.612,98)	-0,01%	0,00%
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		2.373.032,36	0,24%	0,08%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		26.615.704,42	2,66%	0,86%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		10.604.787,73	1,06%	0,34%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		4.984.084,52	0,50%	0,16%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		6.725.950,66	0,67%	0,22%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		2.018.198,56	0,20%	0,07%
- HAMILTON LANE FIC FIP		31.286.882,47	3,13%	1,01%

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

CONSOLIDADO

. MULTINER FIP			-6.739,68	0,00%	0,00%
- STRATUS SCP BR FIP			16.241.320,00	1,63%	0,53%
- P2BR INFR III FIQFIP			17.604.409,28	1,76%	0,57%
- COPA FLORESTAL III			7.672.973,70	0,77%	0,25%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			20.119.446,89	2,01%	0,65%
- KINEA CHRONOS FIM			35.736.128,75	3,58%	1,16%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM			27.821.590,17	2,78%	0,90%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM			34.344.393,24	3,44%	1,11%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM			24.936.574,54	2,50%	0,81%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO			7.641.679,72	0,76%	0,25%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			9.920.590,87	0,99%	0,32%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- BB MM SCH INV EXTE FI			22.705.119,18	2,27%	0,73%
- VOT ALLIANZGI FIM			14.124.205,34	1,41%	0,46%
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI			12.421.188,60	1,24%	0,40%
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE			12.366.806,44	1,24%	0,40%
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR			12.664.833,32	1,27%	0,41%
- ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR			5.681.440,50	0,57%	0,35%
TOTAL			999.275.234,99	100,00%	32,51%
GESTÃO PRÓPRIA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENTA FIXA			1.683.720.605,09	80,76%	54,49%
RENTA VARIÁVEL			83.034.136,78	3,98%	2,69%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			71.294.517,68	3,42%	2,31%
EMPRÉSTIMO PESSOAL			76.873.157,53	3,69%	2,49%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)			170.046.061,40	8,16%	5,50%
TOTAL			2.084.968.478,48	100,00%	67,48%