

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

CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.01.2022

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			3.361.945.177,91		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			2.356.893.203,93	70,11	
<u>TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOURE NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOURE NACIONAL</u>					
Nota do Tesouro Nacional		368.974	1.544.541.046	45,94	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			730.185.236,02	21,72	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		71,00	75.888,17	0,00	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	4	44.627.825,93	1,33	1,33
. CDB 362 DIAS - PARANÁ BANCO	PÓS	70	75.888,17	0,00	0,00
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS - BANCO CRUZEIRO DO SUL		-3	-44.627.825,93	-1,33	-1,33
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		2.497	234.988.398,69	6,99	
. ABC		621	46.542.744	1,38	1,38
. PARANÁ BANCO		340	55.877.324	1,66	1,66
. BRADESCO		846	58.715.354,54	1,75	1,75
. DAYCOVAL		600	29.614.400	0,88	0,88
. SAFRA		90	44.238.576,04	1,32	1,32
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		87.804.668,88	495.120.949,16	14,73	
. SANT FIC FI ISN RF D		337,13	66.686,71	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		363.722,69	706.694,22	0,02	0,02
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		30.704,13	99.873,62	0,00	0,00
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		504.189,50	72.904.590,97	2,17	2,17
. SAN FC EXTRA RF REF		11,56	14.823,84	0,00	0,00
. BRADESCO DED. SAUDE ANS		1.219.990,97	22.176.500,47	0,66	0,66
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		32.254.317,79	46.517.387,76	1,38	1,38
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		75.416,68	6.616.137,65	0,20	0,20
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		226.809,03	24.361.416,99	0,72	0,72
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		8.673,97	0,00	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		14.724,00	20.593,25	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		8.925,14	38.263,72	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		39,04	1.247.545,14	0,04	0,04
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		12.608,30	18.118.199,74	0,54	0,54
. VINCI VALOREM FIM		183.841,95	44.008.033,77	1,31	1,31
. BRAD RF DI FED EXTRA		15.080.398,83	192.318.706,55	5,72	5,72
. BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO		7.819.958,17	35.367.080,86	1,05	1,05
. ARX METRUS 2		30.000.000,00	30.538.413,90	0,91	0,91
<u>Debêntures</u>		47.057	69.453.491,63	2,07	
. CEMIG		30.000	53.131.762,64	1,58	1,58
. ECOPISTAS		7.000	1.592.251,71	0,05	0,05
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	10.474.513,36	0,31	0,31
. SABESP		1.265	4.254.963,92	0,13	0,13
<u>Outros Títulos</u>		7	12.713.430,04	0,38	
. Cedula de Credito Bancario		7	17.005.652,12	0,51	0,51
. VALORES A RECEBER			3.274.905,95	0,10	0,10
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS			-7.567.128,03	-0,23	-0,23

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO

CONSOLIDADO

B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			275.571.929,28	8,20
B1. Mercado de Ações			80.349.830,41	2,39
Companhias Abertas		2.491.484,00	67.424.532,94	2,01
. AMBEV	ON	120.607	1.805.486,79	0,05
. ASSAI ATACADISTA	ON	320.000	4.009.600	0,12
. BRF - BRASIL FOODS	ON	86.578	1.933.286,74	0,06
. COSAN	ON	259.200	6.161.184,00	0,18
. ECORODOVIAS	ON	149.200	1.181.664,00	0,04
. GERDAU - GGBR	PN	147.388	4.103.281,92	0,12
. ITAUSA	ON	226	2.327,80	0,00
. ITAUSA	PN	516.084	5.258.896	0,16
. LOGG COMERCIAL	ON	7.386	208.876,08	0,01
. MRVE	ON	104.800	1.405.368	0,04
. PÃO DE AÇÚCAR	PN	64.000	1.448.320,00	0,04
. PETROBRÁS	PN	258.894	8.375.220,90	0,25
. RENT	ON	189.378	11.097.550,80	0,33
. SUZANO PAPEL	PNA	82.100	4.860.320,00	0,14
. VALE R. DOCE	PNA	179.785	14.539.212,95	0,43
. XP	DIR	5.858	1.033.937	0,03
Instituições Financeiras		523.858	12.586.003,03	0,37
. BRADESCO	PN	270.087	6.157.983,60	0,18
. ITAU	PN	253.771	6.428.019,43	0,19
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER (inst. Fin. + Companhia Aberta)			339.294,44	0,01
B2. Fundos		49.522.521,13	195.222.098,87	5,81
. VELT INST FICFIA		6.293.092,63	19.781.061,38	0,59
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		15.690.874,77	40.032.741,69	1,19
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.096.544,16	22.629.543,19	0,67
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	21.130.057,57	0,63
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		87.042,25	16.228.688,79	0,48
. MOAT CAPITAL FIA		10.351.340,47	37.453.064,83	1,11
. SPX APACHE FIA		13.940.893,93	37.966.941,42	1,13
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		76.170.459	252.133.585,95	7,50
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP		10.858,75	-189.590,25	-0,01
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.660,33	2.321.362,43	0,07
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.676,93	23.707.272,99	0,71
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.354,00	7.342.949,96	0,22
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVPE PLAZA		5.000,00	4.495.491,20	0,13
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		9.229.551,01	2.426.468,61	0,07
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.907.807,84	2.852.665,15	0,08
. HAMILTON LANE FIC FIP		21.069,97	21.176.268,77	0,63
. MULTINER FIP		10,17	-6.768,36	0,00
. STRATUS SCP BR FIP		10.000.000,00	13.845.560,00	0,41
. P2BR INFR III FIQFIP		11.257,50	22.455.844,00	0,67
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	1.015.872,50	0,03
. CLARITAS LONG SHORT		983.361,11	11.374.846,15	0,34
. GIANT ZARATHUSTRA II		20.278.690,71	35.508.084,38	1,06
. IBIUNA LONG SHORT		147.742,28	36.276.648,04	1,08
. NEO PROPECTUS I		23.377.642,04	33.598.597,29	1,00
. SAFRA KEPLER		177.776,81	33.932.013,12	1,01
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		126.000.000	127.263.577,84	3,79
. SCHRODER PLAN II FIM		70.000.000	71.655.155,60	2,13
. SCHRODER METRUS FIM		56.000.000,00	55.608.422,24	1,65
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO

CONSOLIDADO

E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			98.599.493,21	2,93	
E1 - Investimentos em Shopping Center			68.089.822,42	2,03	
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			47.558.090,33	1,41	
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			20.455.466,67	0,61	
. VALORES A RECEBER			76.265,42	0,00	
E2 - Investimento Imobiliário			29.529.627,60	0,88	
. PANAMBY			29.529.627,60	0,88	
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00	
E3 - Investimento Fundo Imobiliário	784,45	980.043,19	0,03		
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	784,45	980.043,19	0,03		
. VALORES A RECEBER		0,00	0,00		
. VALORES A PAGAR		0,00	0,00		
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES	3.147	57.419.348,84	1,71		
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	3.147	60.086.916,51	1,79		
. VALORES A PAGAR (-)		-57.876,18	0,00		
. VALORES A RECEBER		-2.609.691,49	-0,08		
G - OUTROS		194.064.038,86	5,77		
. DISPONIVEL		994.205,05	0,03		
. DEPOSITOS JUDICIAIS		1.970.572,92	0,06		
. OUTROS REALIZAVEIS		160.285.778,05	4,77		
. OUTROS DIREITOS A RECEBER		194.249.566,88	5,78		
. OUTRAS EXIGIBILIDADES		-5.270.310,19	-0,16		
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL		-158.165.773,85	-4,70		
GESTÃO TERCEIRIZADA		DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO TERCEIRIZADA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES	
FUNDOS					
- SANT FIC FI ISN RF D		66.686,71	0,01%	0,00%	
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		706.694,22	0,07%	0,02%	
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		99.873,62	0,01%	0,00%	
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		72.904.590,97	6,81%	2,17%	
- VELT INST FICFIA		19.781.061,38	1,85%	0,59%	
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		40.032.741,69	3,74%	1,19%	
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		16.228.688,79	1,52%	0,48%	
- MOAT CAPITAL FIA		37.453.064,83	3,50%	1,11%	
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		6.616.137,65	0,62%	0,20%	
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		24.361.416,99	2,28%	0,72%	
- SPX APACHE FIA		37.966.941,42	3,55%	1,13%	
- IBIUNA EQ. FIC FIA		21.130.057,57	1,97%	0,63%	
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		-	0,00%	0,00%	
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		20.593,25	0,00%	0,00%	
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		38.263,72	0,00%	0,00%	
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		1.247.545,14	0,12%	0,04%	
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		18.118.199,74	1,69%	0,54%	
- SAN FC EXTRA RF REF		14.823,84	0,00%	0,00%	
- BRADESCO DED. SAUDE ANS		22.176.500,47	2,07%	0,66%	
- BBM SMID CAPS FICFIA		22.629.543,19	2,11%	0,67%	
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		46.517.387,76	4,34%	1,38%	
- VINCI VALOREM FIM		44.008.033,77	4,11%	1,31%	
- BRAD RF DI FED EXTRA		192.318.706,55	17,96%	5,72%	
- BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO		35.367.080,86	3,30%	1,05%	
- ARX METRUS 2		30.538.413,90	2,85%	0,91%	
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP		(189.590,25)	-0,02%	-0,01%	
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		2.321.362,43	0,22%	0,07%	
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		23.707.272,99	2,21%	0,71%	
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		7.342.949,96	0,69%	0,22%	
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		4.495.491,20	0,42%	0,13%	

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

CONSOLIDADO

- INDUSTRIAL PARKS BRASIL FIP MULTIESTRATÉGIA			2.426.468,61	0,23%	0,07%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			2.852.665,15	0,27%	0,08%
- HAMILTON LANE FIC FIP			21.176.268,77	1,98%	0,63%
- MULTINER FIP			-6.768,36	0,00%	0,00%
- STRATUS SCP BR FIP			13.845.560,00	1,29%	0,41%
- P2BR INFR III FIQFIP			22.455.844,00	2,10%	0,67%
- COPA FLORESTAL III			1.015.872,50	0,09%	0,03%
- CLARITAS LONG SHORT			11.374.846,15	1,06%	0,34%
- GIANT ZARATHUSTRA II			35.508.084,38	3,32%	1,06%
- IBIUNA LONG SHORT			36.276.648,04	3,39%	1,08%
- NEO PROVECTUS I			33.598.597,29	3,14%	1,00%
- SAFRA KEPLER			33.932.013,12	3,17%	1,01%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			980.043,19	0,09%	0,03%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- SCHRODER PLAN II FIM			71.655.155,60	6,69%	2,13%
- SCHRODER METRUS FIM			55.608.422,24	5,19%	1,65%
TOTAL			1.070.720.255,00	100,00%	31,85%

GESTÃO PRÓPRIA	DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENTA FIXA	1.861.772.254,77	81,26%	55,38%
RENTA VARIÁVEL	80.349.830,41	3,51%	2,39%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	97.619.450,02	4,26%	2,90%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	57.419.348,84	2,51%	1,71%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	194.064.038,86	8,47%	5,77%
TOTAL	2.291.224.922,90	100,00%	68,15%