

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

CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 30.07.2021

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			3.182.877.752,64		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			2.151.741.533,09	67,60	
<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	1.388.801.344	43,63	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			681.688.191,80	21,42	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		72,00	72.394,88	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	72.394,88	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	242.287.070,07	7,61	
. ABC		621	45.667.628	1,43	1,43
. PARANÁ BANCO		340	51.233.087	1,61	1,61
. BRADESCO		896	74.481.030,33	2,34	2,34
. DAYCOVAL		600	30.284.902	0,95	0,95
. SAFRA		90	40.620.423,23	1,28	1,28
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		39.961.405,12	439.328.726,85	13,80	
. SANT FIC FI ISN RF D		337,13	64.199,41	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		12.007,39	22.405,43	0,00	0,00
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		28.363,88	88.341,25	0,00	0,00
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		494.806,47	68.833.198,12	2,16	2,16
. SAN FC EXTRA RF REF		11,56	14.409,77	0,00	0,00
. BRADESCO DED. SAUDE ANS		6.891.627,03	21.448.081,68	0,67	0,67
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		32.254.317,79	44.778.840,99	1,41	1,41
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		75.416,68	7.044.262,78	0,22	0,22
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		159.546,74	17.176.716,42	0,54	0,54
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		8.673,97	81.092,99	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		14.724,00	38.127,06	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		8.925,14	67.983,18	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		39,04	1.507.320,25	0,05	0,05
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		12.608,30	17.764.676,08	0,56	0,56
. VINCI VALOREM FIM		183.841,95	42.863.225,14	1,35	1,35
. BRAD RF DI FED EXTRA		15.141.434,32	183.362.447,27	5,76	5,76
. BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO		7.819.958,17	34.173.399,03	1,07	1,07
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00	0,00
<u>Debêntures</u>		47.057	68.048.885,92	2,15	
. CEMIG		30.000	48.951.114,26	1,54	1,54
. ECOPISTAS		7.000	2.987.036,21	0,09	0,09
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	10.574.110,84	0,33	0,33
. SABESP		1.265	5.536.624,61	0,17	0,17
. 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		7	13.203.111,74	0,41	
. Cedula de Credito Bancario		7	17.495.333,82	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			320.716.189,37	10,08	
B1. Mercado de Ações			88.908.780,17	2,79	
Companhias Abertas		2.205.041,00	74.485.099,23	2,34	
. AMBEV	ON	120.607	2.006.900,48	0,06	
. ASSAI ATACADISTA	ON	64.000	5.547.520	0,17	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	86.578	2.218.128,36	0,07	
. COSAN	ON	259.200	6.622.560,00	0,21	
. Ecorodovias	ON	149.200	1.627.772,00	0,05	
. GERDAU - GGBR	PN	147.388	4.539.550,40	0,14	
. ITAUSA	ON	216	2.464,56	0,00	
. ITAUSA	PN	491.509	5.490.156	0,17	
. LOGG COMERCIAL	ON	7.386	212.052,06	0,01	
. MRVE	ON	104.800	1.502.832	0,05	
. PÃO DE AÇUCAR	PN	64.000	1.985.920,00	0,06	
. PETROBRÁS	PN	258.894	6.966.837,54	0,22	
. RENT	ON	189.378	11.769.842,70	0,37	
. SUZANO PAPEL	PNA	82.100	4.439.147,00	0,14	
. VALE R. DOCE	PNA	179.785	19.553.416,60	0,61	
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00	
Instituições Financeiras		523.858	14.238.871,05	0,45	
. BRADESCO	PN	270.087	6.549.609,75	0,21	
. ITAU	PN	253.771	7.689.261,30	0,24	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER (inst. Fin. + Companhia Aberta)			184.809,89	0,01	
B2. Fundos		49.522.521,13	231.807.409,20	7,28	
. VELT INST FICFIA		6.293.092,63	25.854.366,61	0,81	
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		15.690.874,77	54.535.662,36	1,71	
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.096.544,16	29.479.566,76	0,93	
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	22.495.406,04	0,71	
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		87.042,25	17.223.384,21	0,54	
. MOAT CAPITAL FIA		10.351.340,47	40.137.974,83	1,26	
. SPX APACHE FIA		13.940.893,93	42.081.048,39	1,32	
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		105.742.753	259.116.127,16	8,14	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP		10.858,75	-143.208,82	0,00	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.587,21	2.285.358,56	0,07	
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.676,93	26.239.698,65	0,82	
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.354,00	9.695.254,86	0,30	
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		5.000,00	4.502.838,14	0,14	
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		9.229.551,01	2.459.402,33	0,08	
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.907.807,84	2.851.077,87	0,09	
. HAMILTON LANE FIC FIP		21.069,97	26.493.660,32	0,83	
. MULTINER FIP		10,17	-8.185,64	0,00	
.STRATUS SCP BR FIP		10.000.000,00	18.092.250,00	0,57	
. P2BR INFR III FIQFIP		10.974,00	20.049.296,60	0,63	
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	1.023.567,30	0,03	
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		9.097.590,07	20.471.865,69	0,64	
. KINEA CHRONOS FIM		19.486.337,47	36.095.495,78	1,13	
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		15.860.872,32	28.917.215,93	0,91	
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		29.971.798,56	34.202.257,98	1,07	
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		121.264,39	25.888.281,65	0,81	
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		182.000.000	128.496.461,24	4,04	
. SCHRODER PLAN II FIM		70.000.000	72.889.534,20	2,29	
. SCHRODER METRUS FIM		112.000.000,00	55.606.927,04	1,75	
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00	

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO

CONSOLIDADO

E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			77.461.995,09	2,43	
E1 - Investimentos em Shopping Center			51.254.138,14	1,61	
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			30.587.443,44	0,96	
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			20.602.424,28	0,65	
. VALORES A RECEBER			64.270,42	0,00	
E2 - Investimento Imobiliário			14.625.685,40	0,46	
. PANAMBY			14.625.685,40	0,46	
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00	
E3 - Investimento Fundo Imobiliário		784,45	11.582.171,55	0,36	
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		784,45	11.582.171,55	0,36	
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00	
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00	
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		3.356	64.045.197,44	2,01	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		3.356	65.746.215,69	2,07	
. VALORES A PAGAR (-)			-15.168,66	0,00	
. VALORES A RECEBER			-1.685.849,59	-0,05	
G - OUTROS			181.300.249,25	5,70	
. DISPONIVEL			3.280.326,12	0,10	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			1.942.281,14	0,06	
. OUTROS REALIZAVEIS			160.285.778,05	5,04	
. OUTROS DIREITOS A RECEBER			179.077.171,00	5,63	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-5.361.240,19	-0,17	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-157.924.066,87	-4,96	
GESTÃO TERCEIRIZADA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO TERCEIRIZADA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS					
- SANT FIC FI ISN RF D			64.199,41	0,01%	0,00%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO			22.405,43	0,00%	0,00%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES			88.341,25	0,01%	0,00%
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP			68.833.198,12	6,43%	2,16%
- VELT INST FICFIA			25.854.366,61	2,42%	0,81%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA			54.535.662,36	5,10%	1,71%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA			17.223.384,21	1,61%	0,54%
- MOAT CAPITAL FIA			40.137.974,83	3,75%	1,26%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP			7.044.262,78	0,66%	0,22%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II			17.176.716,42	1,60%	0,54%
- SPX APACHE FIA			42.081.048,39	3,93%	1,32%
- IBIUNA EQ. FIC FIA			22.495.406,04	2,10%	0,71%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER			81.092,99	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II			38.127,06	0,00%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III			67.983,18	0,01%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.			1.507.320,25	0,14%	0,05%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL			17.764.676,08	1,66%	0,56%
- SAN FC EXTRA RF REF			14.409,77	0,00%	0,00%
- BRADESCO DED. SAUDE ANS			21.448.081,68	2,00%	0,67%
- BBM SMID CAPS FICFIA			29.479.566,76	2,75%	0,93%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM			44.778.840,99	4,18%	1,41%
- VINCI VALOREM FIM			42.863.225,14	4,00%	1,35%
- BRAD RF DI FED EXTRA			183.362.447,27	17,13%	5,76%
- BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO			34.173.399,03	3,19%	1,07%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP			(143.208,82)	-0,01%	0,00%
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP			2.285.358,56	0,21%	0,07%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			26.239.698,65	2,45%	0,82%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP			9.695.254,86	0,91%	0,30%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA			4.502.838,14	0,42%	0,14%
- INDUSTRIAL PARKS BRASIL FIP MULTIESTRATÉGIA			2.459.402,33	0,23%	0,08%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			2.851.077,87	0,27%	0,09%
- HAMILTON LANE FIC FIP			26.493.660,32	2,48%	0,83%

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO

CONSOLIDADO

- MULTINER FIP			-8.185,64	0,00%	0,00%
- STRATUS SCP BR FIP			18.092.250,00	1,69%	0,57%
- P2BR INFR III FIQFIP			20.049.296,60	1,87%	0,63%
- COPA FLORESTAL III			1.023.567,30	0,10%	0,03%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			20.471.865,69	1,91%	0,64%
- KINEA CHRONOS FIM			36.095.495,78	3,37%	1,13%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM			28.917.215,93	2,70%	0,91%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM			34.202.257,98	3,20%	1,07%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM			25.888.281,65	2,42%	0,81%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			11.582.171,55	1,08%	0,36%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- SCHRODER PLAN II FIM			72.889.534,20	6,81%	2,29%
- SCHRODER METRUS FIM			55.606.927,04	5,20%	1,75%
TOTAL			1.070.330.896,00	100,00%	33,63%

GESTÃO PRÓPRIA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENDA FIXA			1.712.412.806,24	81,06%	53,80%
RENDA VARIÁVEL			88.908.780,17	4,21%	2,79%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			65.879.823,54	3,12%	2,07%
EMPRÉSTIMO PESSOAL			64.045.197,44	3,03%	2,01%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)			181.300.249,25	8,58%	5,70%
TOTAL			2.112.546.856,64	100,00%	66,37%