

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

CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.05.2021

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			3.181.095.121,52		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			2.131.100.895,48	66,99	
<u>TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOIRO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOIRO NACIONAL</u>					
Nota do Tesouro Nacional		353.933	1.360.650.149	42,77	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			690.067.803,46	21,69	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		5.072,00	12.302.318,98	0,39	
. 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 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	5.000	12.230.579,88	0,38	0,38
. CDB 362 DIAS - PARANÁ BANCO	PÓS	70	71.739,10	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>		1.067	210.842.921,34	6,63	
. ABC		621	45.383.750	1,43	1,43
. PARANÁ BANCO		340	50.024.919	1,57	1,57
. BRADESCO		106	45.391.466,19	1,43	1,43
. DAYCOVAL		600	30.363.486	0,95	0,95
. SAFRA		90	39.679.299,72	1,25	1,25
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		39.922.047,72	466.922.563,14	14,68	
. SANT FIC FI ISN RF D		337,13	63.742,35	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		713,77	1.317,81	0,00	0,00
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		28.363,88	87.579,06	0,00	0,00
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		479.713,73	66.182.373,08	2,08	2,08
. SAN FC EXTRA RF REF		11,56	14.346,49	0,00	0,00
. BRADESCO DED. SAUDE ANS		6.891.627,03	21.314.352,43	0,67	0,67
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		32.241.346,75	44.870.844,23	1,41	1,41
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		75.416,68	7.143.579,04	0,22	0,22
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		159.546,74	17.063.889,70	0,54	0,54
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		8.673,97	87.730,10	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		14.724,00	44.743,60	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		8.925,14	99.812,56	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		39,04	1.466.614,50	0,05	0,05
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		12.608,30	17.557.586,24	0,55	0,55
. VINCI VALOREM FIM		183.841,95	42.750.949,79	1,34	1,34
. BRAD RF DI FED EXTRA		17.499.605,07	214.228.429,24	6,73	6,73
. BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO		7.819.958,17	33.944.672,92	1,07	1,07
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00	0,00
<u>Debêntures</u>		47.057	67.451.486,16	2,13	
. CEMIG		30.000	47.831.843,01	1,50	1,50
. ECOPISTAS		7.000	3.676.297,73	0,12	0,12
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	10.542.101,86	0,33	0,33
. SABESP		1.265	5.401.243,56	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		Z	12.931.457,26	0,41	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	17.223.679,34	0,54	0,54
. 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			331.659.923,52	10,43	
B1. Mercado de Ações			92.215.413,56	2,90	
Companhias Abertas		2.205.041,00	77.240.942,67	2,43	
. AMBEV	ON	120.607	2.164.895,65	0,07	
. ASSAI ATACADISTA	ON	64.000	5.724.800	0,18	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	86.578	2.230.249,28	0,07	
. COSAN	ON	259.200	6.057.504,00	0,19	
. ECORODOVIAS	ON	149.200	1.863.508,00	0,06	
. GERDAU - GGBR	PN	147.388	4.852.012,96	0,15	
. ITAUSA	ON	216	2.529,36	0,00	
. ITAUSA	PN	491.509	5.337.788	0,17	
. LOGG COMERCIAL	ON	7.386	218.994,90	0,01	
. MRVE	ON	104.800	1.822.472	0,06	
. PÃO DE AÇUCAR	PN	64.000	2.523.520,00	0,08	
. PETROBRÁS	PN	258.894	6.956.481,78	0,22	
. RENT	ON	189.378	11.864.531,70	0,37	
. SUZANO PAPEL	PNA	82.100	4.985.933,00	0,16	
. VALE R. DOCE	PNA	179.785	20.635.722,30	0,65	
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00	
Instituições Financeiras		523.858	14.648.299,10	0,46	
. BRADESCO	PN	270.087	7.151.903,76	0,22	
. ITAU	PN	253.771	7.496.395,34	0,24	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER (inst. Fin. + Companhia Aberta)			326.171,79	0,01	
B2. Fundos		49.522.521,13	239.444.509,96	7,53	
. VELT INST FICFIA		6.293.092,63	26.618.603,75	0,84	
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		15.690.874,77	54.943.762,40	1,73	
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.096.544,16	31.080.781,39	0,98	
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	22.753.865,78	0,72	
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		87.042,25	17.424.260,80	0,55	
. MOAT CAPITAL FIA		10.351.340,47	43.118.843,09	1,36	
. SPX APACHE FIA		13.940.893,93	43.504.392,75	1,37	
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		105.742.414	273.494.406,22	8,60	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP		10.858,75	-133.322,91	0,00	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.587,21	2.296.876,96	0,07	
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.676,93	26.292.881,91	0,83	
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.354,00	11.242.970,30	0,35	
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		5.000,00	4.506.440,94	0,14	
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		9.229.551,01	2.493.282,35	0,08	
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.907.807,84	2.856.086,54	0,09	
. HAMILTON LANE FIC FIP		21.069,97	31.310.703,49	0,98	
. MULTINER FIP		10,17	-11.550,83	0,00	
. STRATUS SCP BR FIP		10.000.000,00	17.954.980,00	0,56	
. P2BR INFR III FIQFIP		10.635,00	19.601.706,77	0,62	
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	7.554.030,10	0,24	
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		9.097.590,07	20.488.676,21	0,64	
. KINEA CHRONOS FIM		19.486.337,47	36.215.993,45	1,14	
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		15.860.872,32	29.695.343,66	0,93	
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		29.971.798,56	34.682.451,16	1,09	
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		121.264,39	26.446.856,16	0,83	
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		182.000.000	127.743.189,42	4,02	
. SCHRODER PLAN II FIM		70.000.000	71.504.401,50	2,25	
. SCHRODER METRUS FIM		112.000.000,00	56.238.787,92	1,77	
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00	

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

CONSOLIDADO

E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			74.974.853,94	2,36	
E1 - Investimentos em Shopping Center			51.613.277,33	1,62	
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			30.781.649,44	0,97	
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			20.760.904,47	0,65	
. VALORES A RECEBER			70.723,42	0,00	
E2 - Investimento Imobiliário			13.454.230,20	0,42	
. PANAMBY			13.454.230,20	0,42	
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00	
E3 - Investimento Fundo Imobiliário	784,45	9.907.346,41	0,31		
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	784,45	9.907.346,41	0,31		
. VALORES A RECEBER		0,00	0,00		
. VALORES A PAGAR		0,00	0,00		
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES	3.462	66.980.243,86	2,11		
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	3.462	68.433.492,64	2,15		
. VALORES A PAGAR (-)		-22.135,89	0,00		
. VALORES A RECEBER		-1.431.112,89	-0,04		
G - OUTROS		175.141.609,08	5,51		
. DISPONIVEL		1.243.702,62	0,04		
. DEPOSITOS JUDICIAIS		1.942.281,14	0,06		
. OUTROS REALIZAVEIS		160.281.512,27	5,04		
. OUTROS DIREITOS A RECEBER		174.951.412,09	5,50		
. OUTRAS EXIGIBILIDADES		-5.332.902,88	-0,17		
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL		-157.944.396,16	-4,97		
GESTÃO TERCEIRIZADA		DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO TERCEIRIZADA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES	
FUNDOS					
- SANT FIC FI ISN RF D		63.742,35	0,01%	0,00%	
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		1.317,81	0,00%	0,00%	
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		87.579,06	0,01%	0,00%	
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		66.182.373,08	5,92%	2,08%	
- VELT INST FICFIA		26.618.603,75	2,38%	0,84%	
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		54.943.762,40	4,92%	1,73%	
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		17.424.260,80	1,56%	0,55%	
- MOAT CAPITAL FIA		43.118.843,09	3,86%	1,36%	
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		7.143.579,04	0,64%	0,22%	
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		17.063.889,70	1,53%	0,54%	
- SPX APACHE FIA		43.504.392,75	3,89%	1,37%	
- IBIUNA EQ. FIC FIA		22.753.865,78	2,04%	0,72%	
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		87.730,10	0,01%	0,00%	
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		44.743,60	0,00%	0,00%	
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		99.812,56	0,01%	0,00%	
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		1.466.614,50	0,13%	0,05%	
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		17.557.586,24	1,57%	0,55%	
- SAN FC EXTRA RF REF		14.346,49	0,00%	0,00%	
- BRADESCO DED. SAUDE ANS		21.314.352,43	1,91%	0,67%	
- BBM SMID CAPS FICFIA		31.080.781,39	2,78%	0,98%	
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		44.870.844,23	4,02%	1,41%	
- VINCI VALOREM FIM		42.750.949,79	3,83%	1,34%	
- BRAD RF DI FED EXTRA		214.228.429,24	19,17%	6,73%	
- BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO		33.944.672,92	3,04%	1,07%	
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP		(133.322,91)	-0,01%	0,00%	
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		2.296.876,96	0,21%	0,07%	
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		26.292.881,91	2,35%	0,83%	
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		11.242.970,30	1,01%	0,35%	
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVPE PLAZA		4.506.440,94	0,40%	0,14%	
- INDUSTRIAL PARKS BRASIL FIP MULTIESTRATÉGIA		2.493.282,35	0,22%	0,08%	
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		2.856.086,54	0,26%	0,09%	
- HAMILTON LANE FIC FIP		31.310.703,49	2,80%	0,98%	

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

CONSOLIDADO

- MULTINER FIP			-11.550,83	0,00%	0,00%
- STRATUS SCP BR FIP			17.954.980,00	1,61%	0,56%
- P2BR INFR III FIQFIP			19.601.706,77	1,75%	0,62%
- COPA FLORESTAL III			7.554.030,10	0,68%	0,24%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			20.488.676,21	1,83%	0,64%
- KINEA CHRONOS FIM			36.215.993,45	3,24%	1,14%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM			29.695.343,66	2,66%	0,93%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM			34.682.451,16	3,10%	1,09%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM			26.446.856,16	2,37%	0,83%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			9.907.346,41	0,89%	0,31%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- SCHRODER PLAN II FIM			71.504.401,50	6,40%	2,25%
- SCHRODER METRUS FIM			56.238.787,92	5,03%	1,77%
TOTAL			1.117.512.015,15	100,00%	35,13%

GESTÃO PRÓPRIA	DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENTA FIXA	1.664.178.332,34	80,65%	52,31%
RENTA VARIÁVEL	92.215.413,56	4,47%	2,90%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	65.067.507,53	3,15%	2,05%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	66.980.243,86	3,25%	2,11%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	175.141.609,08	8,49%	5,51%
TOTAL	2.063.583.106,37	100,00%	64,87%