

RESUMO DOS INVESTIMENTOS
PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO

CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.03.2021

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			3.128.941.753,57		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			2.086.620.469,59	66,69	
<u>TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOURO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOURO NACIONAL</u>					
Nota do Tesouro Nacional		371.343	1.413.474.234	45,17	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			593.610.684,59	18,97	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		5.072,00	12.042.972,35	0,38	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	4	44.627.825,93	1,43	1,43
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.453.009,07	0,17	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.431.276,56	0,17	0,35
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	5.000	11.971.701,61	0,38	0,38
. CDB 362 DIAS - PARANÁ BANCO	PÓS	70	71.270,74	0,00	0,00
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-3	-44.627.825,93	-1,43	-1,43
- BANCO MORADA		-3	-10.884.285,63	-0,35	-0,35
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		1.087	199.784.840,93	6,39	
. ABC		621	44.580.025	1,42	1,42
. PARANÁ BANCO		340	48.996.453	1,57	1,57
. BRADESCO		126	52.330.574,39	1,67	1,67
. DAYCOVAL		300	14.982.778	0,48	0,48
. SAFRA		90	38.895.010,40	1,24	1,24
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		39.843.452,63	381.782.871,31	12,20	
. SANT FIC FI ISN RF D		337,13	63.345,41	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		1.147,83	2.099,04	0,00	0,00
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		28.363,88	87.008,33	0,00	0,00
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		451.528,50	61.104.080,34	1,95	1,95
. SAN FC EXTRA RF REF		11,56	14.310,79	0,00	0,00
. BRADESCO DED. SAUDE ANS		6.891.627,03	21.225.825,33	0,68	0,68
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		32.212.974,20	44.513.856,27	1,42	1,42
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		75.416,68	7.237.747,77	0,23	0,23
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		137.075,37	14.565.443,05	0,47	0,47
. FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER		8.673,97	99.138,04	0,00	0,00
. FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER II		14.724,00	52.446,85	0,00	0,00
. FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER III		8.925,14	85.767,96	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		39,04	1.435.305,30	0,05	0,05
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		12.608,30	17.210.824,99	0,55	0,55
. VINCI VALOREM FIM		183.841,95	42.301.534,39	1,35	1,35
. BRAD RF DI FED EXTRA		11.317.743,06	137.979.003,72	4,41	4,41
. BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO		7.819.958,17	33.805.133,73	1,08	1,08
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00	0,00
<u>Debêntures</u>		47.057	66.943.767,98	2,15	
. CEMIG		30.000	46.962.639,32	1,50	1,50
. ECOPISTAS		7.000	4.361.499,73	0,14	0,14
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	10.324.748,85	0,33	0,33
. SABESP		1.265	5.294.880,08	0,17	0,17
. VALORES A RECEBER					
. COMANCHE PART.			9.349.383,12	0,30	0,30

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

CONSOLIDADO

. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS					
. COMANCHE PART.			-9.349.383,12	-0,30	-0,30
<u>Outros Títulos</u>		<u>7</u>	<u>12.591.782,82</u>	<u>0,40</u>	
. Cedula de Credito Bancario		7	16.884.004,90	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			307.175.674,04	9,82	
<u>B1. Mercado de Ações</u>			<u>84.808.755,90</u>	<u>2,71</u>	
<u>Companhias Abertas</u>		<u>2.010.641,00</u>	<u>70.989.613,86</u>	<u>2,27</u>	
. AMBEV	ON	120.607	1.844.081,03	0,06	
. ASSAI ATACADISTA	ON	64.000	4.725.760	0,15	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	86.578	2.183.497,16	0,07	
. COSAN	ON	64.800	5.924.016,00	0,19	
. ECORODOVIAS	ON	149.200	1.748.624,00	0,06	
. GERDAU - GGBR	PN	147.388	4.454.065,36	0,14	
. ITAUSA	ON	216	2.397,60	0,00	
. ITAUSA	PN	491.509	5.072.373	0,16	
. LOGG COMERCIAL	ON	7.386	211.535,04	0,01	
. MRVE	ON	104.800	1.907.360	0,06	
. PÃO DE AÇUCAR	PN	64.000	2.123.520,00	0,07	
. PETROBRÁS	PN	258.894	6.239.345,40	0,20	
. RENT	ON	189.378	11.311.547,94	0,36	
. SUZANO PAPEL	PNA	82.100	5.627.955,00	0,18	
. VALE R. DOCE	PNA	179.785	17.613.536,45	0,56	
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00	
<u>Instituições Financeiras</u>		<u>499.306</u>	<u>13.670.946,82</u>	<u>0,44</u>	
. BRADESCO	PN	245.535	6.572.971,95	0,21	
. ITAU	PN	253.771	7.097.974,87	0,23	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER (inst. Fin. + Companhia Aberta)			148.195,22	0,00	
<u>B2. Fundos</u>		<u>49.522.521,13</u>	<u>222.366.918,14</u>	<u>7,11</u>	
. VELT INST FICFIA		6.293.092,63	24.934.320,18	0,80	
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		15.690.874,77	52.230.516,73	1,67	
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.096.544,16	28.740.722,96	0,92	
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	20.551.707,35	0,66	
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		87.042,25	15.741.498,94	0,50	
. MOAT CAPITAL FIA		10.351.340,47	40.682.240,02	1,30	
. SPX APACHE FIA		13.940.893,93	39.485.911,96	1,26	
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		105.742.414	273.345.815,31	8,74	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP		10.858,75	-115.424,08	0,00	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.587,21	2.412.500,29	0,08	
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.676,93	26.357.546,96	0,84	
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.354,00	10.605.309,20	0,34	
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		5.000,00	4.509.894,90	0,14	
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		9.229.551,01	7.975.541,69	0,25	
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.907.807,84	2.850.502,21	0,09	
. HAMILTON LANE FIC FIP		21.069,97	30.900.633,92	0,99	
. MULTINER FIP		10,17	-20.117,71	0,00	
.STRATUS SCP BR FIP		10.000.000,00	17.923.260,00	0,57	
. P2BR INFR III FIQFIP		10.635,00	19.029.645,36	0,61	
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	7.443.912,40	0,24	
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		9.097.590,07	20.032.771,42	0,64	
. KINEA CHRONOS FIM		19.486.337,47	35.839.458,95	1,15	
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		15.860.872,32	29.883.650,65	0,96	
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		29.971.798,56	34.424.753,62	1,10	
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		121.264,39	23.291.975,57	0,74	

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

CONSOLIDADO

D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		182.000.000	134.299.071,48	4,29	
. SCHRODER PLAN II FIM		70.000.000	74.531.843,40	2,38	
. SCHRODER METRUS FIM		112.000.000,00	59.767.228,08	1,91	
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00	
E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			81.357.308,56	2,60	
E1 - Investimentos em Shopping Center			52.017.380,72	1,66	
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			30.975.855,43	0,99	
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			20.919.384,65	0,67	
. VALORES A RECEBER			122.140,64	0,00	
E2 - Investimento Imobiliário			12.542.250,42	0,40	
. PANAMBY			12.542.250,42	0,40	
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00	
E3 - Investimento Fundo Imobiliário		71.235,45	13.008.419,79	0,42	
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		70.451,00	3.070.982,00	0,10	
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		784,45	9.919.461,31	0,32	
. VALORES A RECEBER			17.976,48	0,00	
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00	
E3 - Outros Investimentos Imobiliário		44	3.789.257,63	0,12	
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		44	3.789.257,63	0,12	
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		3.559	69.277.512,98	2,21	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		3.559	70.747.222,57	2,26	
. VALORES A PAGAR (-)			-38.641,73	0,00	
. VALORES A RECEBER			-1.431.067,86	-0,05	
G - OUTROS			176.865.901,61	5,65	
. DISPONIVEL			1.829.749,76	0,06	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			1.927.667,86	0,06	
. OUTROS REALIZAVEIS			160.281.882,61	5,12	
. OUTROS DIREITOS A RECEBER			176.058.373,79	5,63	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-5.288.280,70	-0,17	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-157.943.491,71	-5,05	
GESTÃO TERCEIRIZADA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO TERCEIRIZADA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS					
- SANT FIC FI ISN RF D			63.345,41	0,01%	0,00%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO			2.099,04	0,00%	0,00%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES			87.008,33	0,01%	0,00%
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP			61.104.080,34	5,96%	1,95%
- VELT INST FICFIA			24.934.320,18	2,43%	0,80%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA			52.230.516,73	5,10%	1,67%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA			15.741.498,94	1,54%	0,50%
- MOAT CAPITAL FIA			40.682.240,02	3,97%	1,30%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP			7.237.747,77	0,71%	0,23%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II			14.565.443,05	1,42%	0,47%
- SPX APACHE FIA			39.485.911,96	3,85%	1,26%
- IBIUNA EQ. FIC FIA			20.551.707,35	2,01%	0,66%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER			99.138,04	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER II			52.446,85	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER III			85.767,96	0,01%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.			1.435.305,30	0,14%	0,05%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL			17.210.824,99	1,68%	0,55%
- SAN FC EXTRA RF REF			14.310,79	0,00%	0,00%
- BRADESCO DED. SAUDE ANS			21.225.825,33	2,07%	0,68%
- BBM SMID CAPS FICFIA			28.740.722,96	2,80%	0,92%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM			44.513.856,27	4,34%	1,42%
- VINCI VALOREM FIM			42.301.534,39	4,13%	1,35%
- BRAD RF DI FED EXTRA			137.979.003,72	13,46%	4,41%
- BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO			33.805.133,73	3,30%	1,08%

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

CONSOLIDADO

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP			(115.424,08)	-0,01%	0,00%
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP			2.412.500,29	0,24%	0,08%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			26.357.546,96	2,57%	0,84%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP			10.605.309,20	1,03%	0,34%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVPE PLAZA			4.509.894,90	0,44%	0,14%
- INDUSTRIAL PARKS BRASIL FIP MULTIESTRATÉGIA			7.975.541,69	0,78%	0,25%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			2.850.502,21	0,28%	0,09%
- HAMILTON LANE FIC FIP			30.900.633,92	3,02%	0,99%
- MULTINER FIP			-20.117,71	0,00%	0,00%
- STRATUS SCP BR FIP			17.923.260,00	1,75%	0,57%
- P2BR INFR III FIQFIP			19.029.645,36	1,86%	0,61%
- COPA FLORESTAL III			7.443.912,40	0,73%	0,24%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			20.032.771,42	1,95%	0,64%
- KINEA CHRONOS FIM			35.839.458,95	3,50%	1,15%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM			29.883.650,65	2,92%	0,96%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM			34.424.753,62	3,36%	1,10%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM			23.291.975,57	2,27%	0,74%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO			3.088.958,48	0,30%	0,10%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			9.919.461,31	0,97%	0,32%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- SCHRODER PLAN II FIM			74.531.843,40	7,27%	2,38%
- SCHRODER METRUS FIM			59.767.228,08	5,83%	1,91%
TOTAL			1.024.803.096,03	100,00%	32,75%

GESTÃO PRÓPRIA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENDA FIXA			1.704.837.598,28	81,02%	54,50%
RENDA VARIÁVEL			84.808.755,90	4,03%	2,71%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			68.348.888,77	3,25%	2,18%
EMPRÉSTIMO PESSOAL			69.277.512,98	3,29%	2,21%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)			176.865.901,61	8,41%	5,65%
TOTAL			2.104.138.657,54	100,00%	67,26%