

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO

CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 29.10.2021

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCACÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			3.191.457.056,95		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			2.201.064.973,42	68,97	
<u>TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOIRO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOIRO NACIONAL</u>					
Nota do Tesouro Nacional		361.508	1.451.901.702	45,49	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			666.777.087,70	20,89	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		73,00	73.745,75	0,00	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	4	44.627.825,93	1,40	1,40
. CDB 362 DIAS - PARANÁ BANCO	PÓS	70	73.745,75	0,00	0,00
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS - BANCO CRUZEIRO DO SUL		-3	-44.627.825,93	-1,40	-1,40
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		1.857	242.146.119,96	7,59	
. ABC		621	44.563.797	1,40	1,40
. PARANÁ BANCO		340	53.535.042	1,68	1,68
. BRADESCO		896	73.185.308,51	2,29	2,29
. DAYCOVAL		600	28.442.121	0,89	0,89
. SAFRA		90	42.419.851,22	1,33	1,33
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		40.106.959,00	424.557.221,99	13,30	
. SANT FIC FI ISN RF D		337,13	65.216,67	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		148.178,24	281.685,52	0,01	0,01
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		28.363,88	90.085,70	0,00	0,00
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		504.189,50	70.473.835,44	2,21	2,21
. SAN FC EXTRA RF REF		11,56	14.568,12	0,00	0,00
. BRADESCO DED. SAUDE ANS		6.891.627,03	20.738.732,64	0,65	0,65
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		32.254.317,79	44.948.144,24	1,41	1,41
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		75.416,68	6.708.216,03	0,21	0,21
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		159.546,74	16.872.478,60	0,53	0,53
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		8.673,97	2.590,19	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		14.724,00	25.437,53	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		8.925,14	41.219,11	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		39,04	1.585.676,63	0,05	0,05
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		12.608,30	17.396.089,28	0,55	0,55
. VINCI VALOREM FIM		183.841,95	43.113.050,78	1,35	1,35
. BRAD RF DI FED EXTRA		10.976.668,13	138.162.764,39	4,33	4,33
. BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO		7.819.958,17	34.646.752,42	1,09	1,09
. ARX METRUS 2		30.000.000,00	29.390.678,70	0,92	0,92
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00	0,00
<u>Debêntures</u>		47.057	69.480.165,72	2,19	
. CEMIG		30.000	51.085.598,38	1,60	1,60
. ECOPISTAS		7.000	2.321.982,13	0,07	0,07
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	10.280.764,14	0,32	0,32
. SABESP		1.265	5.791.821,07	0,18	0,18
<u>Outros Títulos</u>		7	12.906.018,11	0,40	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	17.198.240,19	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

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO

CONSOLIDADO

B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			259.959.866,06	8,15
B1. Mercado de Ações			72.271.220,24	2,26
Companhias Abertas		2.461.041,00	59.730.137,33	1,87
. AMBEV	ON	120.607	2.049.112,93	0,06
. ASSAI ATACADISTA	ON	320.000	4.892.800	0,15
. BRF - BRASIL FOODS	ON	86.578	2.011.206,94	0,06
. COSAN	ON	259.200	5.129.568,00	0,16
. ECORODOVIAS	ON	149.200	1.221.948,00	0,04
. GERDAU - GGBR	PN	147.388	3.964.737,20	0,12
. ITAUSA	ON	216	2.231,28	0,00
. ITAUSA	PN	491.509	5.037.967	0,16
. LOGG COMERCIAL	ON	7.386	173.053,98	0,01
. MRVE	ON	104.800	1.063.720	0,03
. PÃO DE AÇUCAR	PN	64.000	1.633.920,00	0,05
. PETROBRÁS	PN	258.894	7.054.861,50	0,22
. RENT	ON	189.378	8.578.823,40	0,27
. SUZANO PAPEL	PNA	82.100	4.041.783,00	0,13
. VALE R. DOCE	PNA	179.785	12.874.403,85	0,40
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00
Instituições Financeiras		528.153	12.373.863,31	0,39
. BRADESCO	PN	270.087	5.374.731,30	0,17
. ITAU	PN	253.771	5.915.402,01	0,19
. XP	DIR	4.295	1.083.730,00	0,03
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER (inst. Fin. + Companhia Aberta)			167.219,60	0,01
B2. Fundos		49.522.521,13	187.688.645,82	5,88
. VELT INST FICFIA		6.293.092,63	20.618.096,31	0,65
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		15.690.874,77	43.607.166,42	1,37
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.096.544,16	22.184.472,87	0,70
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	18.742.524,30	0,59
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		87.042,25	14.369.008,95	0,45
. MOAT CAPITAL FIA		10.351.340,47	33.057.062,73	1,04
. SPX APACHE FIA		13.940.893,93	35.110.314,24	1,10
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		82.845.469	252.920.894,29	7,08
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP		10.858,75	-157.467,29	0,00
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.587,21	2.339.315,96	0,07
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.676,93	26.184.736,22	0,82
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.354,00	8.402.716,52	0,26
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVPE PLAZA		5.000,00	4.499.670,39	0,14
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		9.229.551,01	2.448.016,02	0,08
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.907.807,84	2.842.793,79	0,09
. HAMILTON LANE FIC FIP		21.069,97	21.695.028,71	0,68
. MULTINER FIP		10,17	-24.846,15	0,00
. STRATUS SCP BR FIP		10.000.000,00	16.599.640,00	0,52
. P2BR INFR III FIQFIP		10.974,00	20.805.376,99	0,65
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	1.055.520,10	0,03
. CLARITAS LONG SHORT		782.203,92	8.755.948,71	0,27
. GIANT ZARATHUSTRA II		16.312.586,08	28.577.232,13	0,90
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		15.860.872,32	30.504.189,74	0,96
. IBIUNA LONG SHORT		117.416,75	26.089.308,96	0,82
. NEO PROVECTUS I		18.426.365,05	25.440.716,55	0,80
. SAFRA KEPLER		141.134,58	26.862.996,98	0,84
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		182.000.000	141.338.371,58	4,43
. SCHRODER PLAN II FIM		70.000.000	80.463.054,70	2,52
. SCHRODER METRUS FIM		112.000.000,00	60.875.316,88	1,91
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO

CONSOLIDADO

E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			68.487.790,22	2,15	
E1 - Investimentos em Shopping Center			50.723.945,27	1,59	
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			30.296.134,46	0,95	
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			20.364.704,01	0,64	
. VALORES A RECEBER			63.106,80	0,00	
E2 - Investimento Imobiliário			16.789.541,71	0,53	
. PANAMBY			16.789.541,71	0,53	
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00	
E3 - Investimento Fundo Imobiliário		784,45	974.303,24	0,03	
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		784,45	974.303,24	0,03	
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00	
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00	
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		3.231	60.265.075,49	1,89	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		3.231	62.415.035,13	1,96	
. VALORES A PAGAR (-)			-29.805,61	0,00	
. VALORES A RECEBER			-2.120.154,03	-0,07	
G - OUTROS			207.420.085,89	6,50	
. DISPONIVEL			21.724.378,54	0,68	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			1.942.281,14	0,06	
. OUTROS REALIZAVEIS			160.285.778,05	5,02	
. OUTROS DIREITOS A RECEBER			186.851.403,13	5,85	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-5.299.195,86	-0,17	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-158.084.559,11	-4,95	
GESTÃO TERCEIRIZADA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO TERCEIRIZADA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS					
- SANT FIC FI ISN RF D			65.216,67	0,01%	0,00%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO			281.685,52	0,03%	0,01%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES			90.085,70	0,01%	0,00%
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP			70.473.835,44	7,19%	2,21%
- VELT INST FICFIA			20.618.096,31	2,10%	0,65%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA			43.607.166,42	4,45%	1,37%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA			14.369.008,95	1,47%	0,45%
- MOAT CAPITAL FIA			33.057.062,73	3,37%	1,04%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP			6.708.216,03	0,68%	0,21%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II			16.872.478,60	1,72%	0,53%
- SPX APACHE FIA			35.110.314,24	3,58%	1,10%
- IBIUNA EQ. FIC FIA			18.742.524,30	1,91%	0,59%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER			2.590,19	0,00%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II			25.437,53	0,00%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III			41.219,11	0,00%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.			1.585.676,63	0,16%	0,05%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL			17.396.089,28	1,77%	0,55%
- SAN FC EXTRA RF REF			14.568,12	0,00%	0,00%
- BRADESCO DED. SAUDE ANS			20.738.732,64	2,11%	0,65%
- BBM SMID CAPS FICFIA			22.184.472,87	2,26%	0,70%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM			44.948.144,24	4,58%	1,41%
- VINCI VALOREM FIM			43.113.050,78	4,40%	1,35%
- BRAD RF DI FED EXTRA			138.162.764,39	14,09%	4,33%
- BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO			34.646.752,42	3,53%	1,09%
- ARX METRUS 2			29.390.678,70	3,00%	0,92%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP			(157.467,29)	-0,02%	0,00%
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP			2.339.315,96	0,24%	0,07%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			26.184.736,22	2,67%	0,82%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP			8.402.716,52	0,86%	0,26%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVPE PLAZA			4.499.670,39	0,46%	0,14%

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO

CONSOLIDADO

- INDUSTRIAL PARKS BRASIL FIP MULTISTRATÉGIA			2.448.016,02	0,25%	0,08%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			2.842.793,79	0,29%	0,09%
- HAMILTON LANE FIC FIP			21.695.028,71	2,21%	0,68%
- MULTINER FIP			-24.846,15	0,00%	0,00%
- STRATUS SCP BR FIP			16.599.640,00	1,69%	0,52%
- P2BR INFR III FIQFIP			20.805.376,99	2,12%	0,65%
- COPA FLORESTAL III			1.055.520,10	0,11%	0,03%
- CLARITAS LONG SHORT			8.755.948,71	0,89%	0,27%
- GIANT ZARATHUSTRA II			28.577.232,13	2,91%	0,90%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM			30.504.189,74	3,11%	0,96%
- IBIUNA LONG SHORT			26.089.308,96	2,66%	0,82%
- NEO PROVECTUS I			25.440.716,55	2,59%	0,80%
- SAFRA KEPLER			0,00	0,00%	0,00%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			974.303,24	0,10%	0,03%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- SCHRODER PLAN II FIM			80.463.054,70	8,21%	2,52%
- SCHRODER METRUS FIM			60.875.316,88	6,21%	1,91%
TOTAL			980.616.439,94	100,00%	30,73%

GESTÃO PRÓPRIA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENTA FIXA			1.776.507.751,43	81,34%	55,66%
RENTA VARIÁVEL			72.271.220,24	3,31%	2,26%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			67.513.486,98	3,09%	2,12%
EMPRÉSTIMO PESSOAL			60.265.075,49	2,76%	1,89%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)			207.420.085,89	9,50%	6,50%
TOTAL			2.183.977.620,03	100,00%	68,43%