

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

CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 30.06.2021

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			3.180.755.655,38		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			2.136.461.574,10	67,17	
<u>TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOURE NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOURE NACIONAL</u>					
Nota do Tesouro Nacional		353.433	1.377.459.614	43,31	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>					
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>					
		5.072,00	12.460.833,84	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	12.388.792,73	0,39	0,39
. CDB 362 DIAS - PARANÁ BANCO	PÓS	70	72.041,11	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	213.901.424,82	6,72	
. ABC		621	45.846.072	1,44	1,44
. PARANÁ BANCO		340	50.652.303	1,59	1,59
. BRADESCO		106	46.589.094,97	1,46	1,46
. DAYCOVAL		600	30.629.745	0,96	0,96
. SAFRA		90	40.184.210,44	1,26	1,26
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>					
		39.935.931,61	451.150.548,26	14,18	
. SANT FIC FI ISN RF D		337,13	63.955,02	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		1.626,62	3.019,46	0,00	0,00
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		28.363,88	87.965,19	0,00	0,00
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		479.713,73	66.648.878,67	2,10	2,10
. SAN FC EXTRA RF REF		11,56	14.378,51	0,00	0,00
. BRADESCO DED. SAUDE ANS		6.891.627,03	21.374.226,17	0,67	0,67
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		32.254.317,79	44.809.571,63	1,41	1,41
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		75.416,68	7.117.454,39	0,22	0,22
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		159.546,74	17.216.736,08	0,54	0,54
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		8.673,97	85.863,68	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		14.724,00	41.288,48	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		8.925,14	70.407,66	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		39,04	1.488.650,50	0,05	0,05
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		12.608,30	17.782.346,71	0,56	0,56
. VINCI VALOREM FIM		183.841,95	42.706.310,93	1,34	1,34
. BRAD RF DI FED EXTRA		16.089.107,73	197.592.553,18	6,21	6,21
. BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO		7.819.958,17	34.046.942,00	1,07	1,07
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00	0,00
<u>Debêntures</u>					
		47.057	68.247.446,98	2,16	
. CEMIG		30.000	48.397.912,27	1,52	1,52
. ECOPISTAS		7.000	3.729.024,76	0,12	0,12
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	10.651.005,34	0,33	0,33
. SABESP		1.265	5.469.504,61	0,17	0,17
. VALORES A RECEBER					
. COMANCHE PART.			9.349.383,12	0,29	0,29

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

CONSOLIDADO

. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS					
. COMANCHE PART.			-9.349.383,12	-0,29	-0,29
Outros Títulos		Z	13.241.705,73	0,42	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	17.533.927,81	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			334.002.423,49	10,50	
B1. Mercado de Ações			91.927.593,11	2,89	
Companhias Abertas		2.205.041,00	77.221.234,41	2,43	
. AMBEV	ON	120.607	2.058.761,49	0,06	
. ASSAI ATACADISTA	ON	64.000	5.538.560	0,17	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	86.578	2.366.176,74	0,07	
. COSAN	ON	259.200	6.210.432,00	0,20	
. ECORODOVIAS	ON	149.200	1.769.512,00	0,06	
. GERDAU - GGBR	PN	147.388	4.364.158,68	0,14	
. ITAUSA	ON	216	2.462,40	0,00	
. ITAUSA	PN	491.509	5.480.325	0,17	
. LOGG COMERCIAL	ON	7.386	234.727,08	0,01	
. MRVE	ON	104.800	1.711.384	0,05	
. PÃO DE AÇUCAR	PN	64.000	2.474.240,00	0,08	
. PETROBRÁS	PN	258.894	7.619.250,42	0,24	
. RENT	ON	189.378	12.120.192,00	0,38	
. SUZANO PAPEL	PNA	82.100	4.910.401,00	0,15	
. VALE R. DOCE	PNA	179.785	20.360.651,25	0,64	
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00	
Instituições Financeiras		523.858	14.511.714,31	0,46	
. BRADESCO	PN	270.087	6.949.338,51	0,22	
. ITAU	PN	253.771	7.562.375,80	0,24	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER (inst. Fin. + Companhia Aberta)			194.644,39	0,01	
B2. Fundos		49.522.521,13	242.074.830,38	7,61	
. VELT INST FICFIA		6.293.092,63	26.645.106,92	0,84	
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		15.690.874,77	55.794.912,34	1,75	
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.096.544,16	30.546.294,02	0,96	
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	23.307.392,01	0,73	
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		87.042,25	17.843.871,34	0,56	
. MOAT CAPITAL FIA		10.351.340,47	43.776.081,79	1,38	
. SPX APACHE FIA		13.940.893,93	44.161.171,96	1,39	
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		105.742.753	267.554.500,18	8,41	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP		10.858,75	-138.782,92	0,00	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.587,21	2.291.248,72	0,07	
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.676,93	26.265.302,35	0,83	
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.354,00	10.299.641,28	0,32	
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		5.000,00	4.504.668,45	0,14	
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		9.229.551,01	2.461.686,92	0,08	
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.907.807,84	2.856.914,25	0,09	
. HAMILTON LANE FIC FIP		21.069,97	31.737.211,45	1,00	
. MULTINER FIP		10,17	-7.516,40	0,00	
. STRATUS SCP BR FIP		10.000.000,00	18.078.340,00	0,57	
. P2BR INFR III FIQFIP		10.974,00	19.989.604,31	0,63	
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	1.014.857,50	0,03	
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		9.097.590,07	20.603.129,36	0,65	
. KINEA CHRONOS FIM		19.486.337,47	36.399.233,23	1,14	
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		15.860.872,32	29.784.943,49	0,94	
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		29.971.798,56	34.651.643,14	1,09	
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		121.264,39	26.762.375,09	0,84	

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

CONSOLIDADO

D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		182.000.000	122.448.270,70	3,85	
. SCHRODER PLAN II FIM		70.000.000	69.307.955,50	2,18	
. SCHRODER METRUS FIM		112.000.000,00	53.140.315,20	1,67	
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00	
E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			75.406.376,82	2,37	
E1 - Investimentos em Shopping Center			51.452.667,16	1,62	
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			30.684.546,44	0,96	
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			20.681.664,39	0,65	
. VALORES A RECEBER			86.456,33	0,00	
E2 - Investimento Imobiliário			14.039.957,80	0,44	
. PANAMBY			14.039.957,80	0,44	
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00	
E3 - Investimento Fundo Imobiliário		784,45	9.913.751,86	0,31	
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	784,45		9.913.751,86	0,31	
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00	
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00	
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		3.421	65.498.296,58	2,06	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		3.421	67.002.160,16	2,11	
. VALORES A PAGAR (-)			-10.691,95	0,00	
. VALORES A RECEBER			-1.493.171,63	-0,05	
G - OUTROS			179.384.213,51	5,64	
. DISPONIVEL			3.136.098,45	0,10	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			1.942.281,14	0,06	
. OUTROS REALIZAVEIS			160.281.882,61	5,04	
. OUTROS DIREITOS A RECEBER			177.318.691,68	5,57	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-5.363.940,75	-0,17	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-157.930.799,62	-4,97	
GESTÃO TERCEIRIZADA		DISTRIBUIÇÃO		% EM RELAÇÃO À GESTÃO TERCEIRIZADA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS					
- SANT FIC FI ISN RF D			63.955,02	0,01%	0,00%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO			3.019,46	0,00%	0,00%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES			87.965,19	0,01%	0,00%
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP			66.648.878,67	6,10%	2,10%
- VELT INST FICFIA			26.645.106,92	2,44%	0,84%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA			55.794.912,34	5,10%	1,75%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA			17.843.871,34	1,63%	0,56%
- MOAT CAPITAL FIA			43.776.081,79	4,00%	1,38%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP			7.117.454,39	0,65%	0,22%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II			17.216.736,08	1,57%	0,54%
- SPX APACHE FIA			44.161.171,96	4,04%	1,39%
- IBIUNA EQ. FIC FIA			23.307.392,01	2,13%	0,73%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER			85.863,68	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II			41.288,48	0,00%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III			70.407,66	0,01%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.			1.488.650,50	0,14%	0,05%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL			17.782.346,71	1,63%	0,56%
- SAN FC EXTRA RF REF			14.378,51	0,00%	0,00%
- BRADESCO DED. SAUDE ANS			21.374.226,17	1,96%	0,67%
- BBM SMID CAPS FICFIA			30.546.294,02	2,79%	0,96%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM			44.809.571,63	4,10%	1,41%
- VINCI VALOREM FIM			42.706.310,93	3,91%	1,34%
- BRAD RF DI FED EXTRA			197.592.553,18	18,08%	6,21%
- BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO			34.046.942,00	3,11%	1,07%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					

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

CONSOLIDADO

- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP			(138.782,92)	-0,01%	0,00%
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP			2.291.248,72	0,21%	0,07%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			26.265.302,35	2,40%	0,83%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP			10.299.641,28	0,94%	0,32%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVPE PLAZA			4.504.668,45	0,41%	0,14%
- INDUSTRIAL PARKS BRASIL FIP MULTIESTRATÉGIA			2.461.686,92	0,23%	0,08%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			2.856.914,25	0,26%	0,09%
- HAMILTON LANE FIC FIP			31.737.211,45	2,90%	1,00%
- MULTINER FIP			-7.516,40	0,00%	0,00%
- STRATUS SCP BR FIP			18.078.340,00	1,65%	0,57%
- P2BR INFR III FIQFIP			19.989.604,31	1,83%	0,63%
- COPA FLORESTAL III			1.014.857,50	0,09%	0,03%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			20.603.129,36	1,88%	0,65%
- KINEA CHRONOS FIM			36.399.233,23	3,33%	1,14%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM			29.784.943,49	2,72%	0,94%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM			34.651.643,14	3,17%	1,09%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM			26.762.375,09	2,45%	0,84%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			9.913.751,86	0,91%	0,31%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- SCHRODER PLAN II FIM			69.307.955,50	6,34%	2,18%
- SCHRODER METRUS FIM			53.140.315,20	4,86%	1,67%
TOTAL			1.093.141.901,38	100,00%	34,37%

GESTÃO PRÓPRIA		DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENDA FIXA		1.685.311.025,84	80,73%	52,98%
RENDA VARIÁVEL		91.927.593,11	4,40%	2,89%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS		65.492.624,96	3,14%	2,06%
EMPRÉSTIMO PESSOAL		65.498.296,58	3,14%	2,06%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)		179.384.213,51	8,59%	5,64%
TOTAL		2.087.613.754,00	100,00%	65,63%