

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

CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.05.2022

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCAÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			3.494.609.408,94		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			2.553.099.934,33	82,01	
<u>TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOURE NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOURE NACIONAL</u>					
Nota do Tesouro Nacional		389.948	1.688.409.415	48,31	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			794.709.276,47	31,69	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		71,00	79.898,78	0,00	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	4	30.061.729,53	0,86	0,86
. CDB 362 DIAS - PARANÁ BANCO	PÓS	70	79.898,78	0,00	0,00
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS - BANCO CRUZEIRO DO SUL		-3	-30.061.729,53	-0,86	-0,86
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		2.502	250.270.171,76	16,11	
. ABC		621	49.439.431	1,41	1,41
. PARANÁ BANCO		340	59.384.777	1,70	1,70
. BRADESCO		846	62.794.343,18	1,80	1,80
. DAYCOVAL		603	31.513.324,72	0,90	0,90
. SAFRA		90	46.973.831,17	1,34	1,34
. BANCO PANAMERICANO		2	164.465,60	8,95	8,95
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		115.858.422,07	544.359.205,93	15,58	
. SANT FIC FI ISN RF D		337,13	69.192,43	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		285.610,51	576.436,90	0,02	0,02
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		80.522,57	273.337,44	0,01	0,01
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		504.189,50	76.709.589,21	2,20	2,20
. SAN FC EXTRA RF REF		11,56	15.290,89	0,00	0,00
. BRADESCO DED. SAUDE ANS		1.219.990,97	22.939.096,90	0,66	0,66
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		32.145.768,54	49.220.358,03	1,41	1,41
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		75.416,68	5.788.255,13	0,17	0,17
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		253.774,68	28.526.344,63	0,82	0,82
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		8.673,97	0,00	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		14.724,00	0,00	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		8.925,14	7.793,44	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		39,04	1.340.710,61	0,04	0,04
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		12.608,30	18.370.708,88	0,53	0,53
. VINCI VALOREM FIM		183.841,95	46.644.364,77	1,33	1,33
. BRAD RF DI FED EXTRA		14.683.052,63	193.666.692,05	5,54	5,54
. BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO		7.819.958,17	36.605.071,32	1,05	1,05
. ARX METRUS 2		58.560.976,73	63.605.963,30	1,82	1,82
<u>Debêntures</u>		45.307	57.018.720,77	1,63	
. CEMIG		30.000	40.202.045,12	1,15	1,15
. ECOPISTAS		5.250	1.265.658,76	0,04	0,04
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	11.093.003,99	0,32	0,32
. SABESP		1.265	4.458.012,90	0,13	0,13
<u>Outros Títulos</u>		7	12.962.521,60	0,37	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	17.254.743,68	0,49	0,49
. VALORES A RECEBER			3.274.905,95	0,09	0,09
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS			-7.567.128,03	-0,22	-0,22

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

CONSOLIDADO

B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			263.924.741,65	7,55
B1. Mercado de Ações			79.657.551,88	2,28
Companhias Abertas		2.491.484,00	65.753.588,86	1,88
. AMBEV	ON	120.607	1.711.413,33	0,05
. ASSAI ATACADISTA	ON	320.000	5.068.800	0,15
. BRF - BRASIL FOODS	ON	86.578	1.354.945,70	0,04
. COSAN	ON	259.200	5.601.312,00	0,16
. ECORODOVIAS	ON	149.200	1.099.604,00	0,03
. GERDAU - GGBR	PN	147.388	4.299.307,96	0,12
. ITAUSA	ON	226	2.183,16	0,00
. ITAUSA	PN	516.084	4.949.246	0,14
. LOGG COMERCIAL	ON	7.386	166.185,00	0,00
. MRVE	ON	104.800	1.012.368	0,03
. PÃO DE AÇUCAR	PN	64.000	1.294.720,00	0,04
. PETROBRÁS	PN	258.894	7.782.353,64	0,22
. RENT	ON	189.378	10.893.022,56	0,31
. SUZANO PAPEL	PNA	82.100	4.392.350,00	0,13
. VALE R. DOCE	PNA	179.785	15.499.264,85	0,44
. XP	BDR	5.858	626.513	0,02
Instituições Financeiras		550.866	12.729.096,86	0,36
. BRADESCO	PN	297.095	6.090.447,50	0,17
. ITAU	PN	253.771	6.638.649,36	0,19
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER (inst. Fin. + Companhia Aberta)			1.174.866,16	0,03
B2. Fundos		49.522.220,03	184.267.189,77	5,27
. VELT INST FICFIA		6.292.791,52	16.729.334,60	0,48
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		15.690.874,77	36.619.744,82	1,05
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.096.544,16	21.366.772,17	0,61
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	21.281.289,61	0,61
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		87.042,25	16.331.492,60	0,47
. MOAT CAPITAL FIA		10.351.340,47	35.227.902,38	1,01
. SPX APACHE FIA		13.940.893,93	36.710.653,59	1,05
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		75.992.921	219.118.362,28	6,27
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP		10.858,75	-215.630,42	-0,01
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.660,33	1.865.988,78	0,05
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.676,93	21.642.760,56	0,62
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.459,66	6.609.992,66	0,19
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVPE PLAZA		5.000,00	3.973.292,93	0,11
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		9.229.551,01	1.256.946,71	0,04
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.907.807,84	2.938.482,26	0,08
. HAMILTON LANE FIC FIP		21.069,97	21.295.368,66	0,61
. MULTINER FIP		10,17	-33.339,47	0,00
.STRATUS SCP BR FIP		10.000.000,00	12.534.440,00	0,36
. P2BR INFR III FIQFIP		11.390,40	22.764.370,59	0,65
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	886.511,60	0,03
. CLARITAS LONG SHORT		983.361,11	11.852.836,49	0,34
. GIANT ZARATHUSTRA II		20.278.690,71	38.218.391,00	1,09
. IBIUNA LONG SHORT		147.742,28	37.434.906,85	1,07
. NEO PROVECTUS I		23.377.642,04	36.093.043,11	1,03
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		126.000.000	110.957.608,16	3,18
. SCHRODER PLAN II FIM		70.000.000	61.017.583,20	1,75
. SCHRODER METRUS FIM		56.000.000,00	49.940.024,96	1,43
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00
E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			98.227.232,08	2,81
E1 - Investimentos em Shopping Center			67.162.612,74	1,92
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			46.942.451,62	1,34
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			20.133.333,32	0,58

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

CONSOLIDADO

. VALORES A RECEBER			86.827,80	0,00	
E2 - Investimento Imobiliário			30.067.405,48	0,86	
. PANAMBY			30.067.405,48	0,86	
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00	
E3 - Investimento Fundo Imobiliário	784,45		997.213,86	0,03	
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	784,45		997.213,86	0,03	
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00	
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00	
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES	3.076		56.119.670,61	1,61	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	3.076		57.954.253,48	1,66	
. VALORES A PAGAR (-)			-35.404,43	0,00	
. VALORES A RECEBER			-1.799.178,44	-0,05	
G - OUTROS			193.161.859,83	5,53	
. DISPONIVEL			967.859,61	0,03	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			2.010.391,69	0,06	
. OUTROS REALIZAVEIS			160.285.778,05	4,59	
. OUTROS DIREITOS A RECEBER			193.710.150,68	5,54	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-5.299.603,35	-0,15	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-158.512.716,85	-4,54	
GESTÃO TERCEIRIZADA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO TERCEIRIZADA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS					
- SANT FIC FI ISN RF D			69.192,43	0,01%	0,00%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO			576.436,90	0,05%	0,02%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES			273.337,44	0,03%	0,01%
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP			76.709.589,21	7,24%	2,20%
- VELT INST FICFIA			16.729.334,60	1,58%	0,48%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA			36.619.744,82	3,46%	1,05%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA			16.331.492,60	1,54%	0,47%
- MOAT CAPITAL FIA			35.227.902,38	3,32%	1,01%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP			5.788.255,13	0,55%	0,17%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II			28.526.344,63	2,69%	0,82%
- SPX APACHE FIA			36.710.653,59	3,46%	1,05%
- IBIUNA EQ. FIC FIA			21.281.289,61	2,01%	0,61%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER			-	0,00%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II			-	0,00%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III			7.793,44	0,00%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.			1.340.710,61	0,13%	0,04%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL			18.370.708,88	1,73%	0,53%
- SAN FC EXTRA RF REF			15.290,89	0,00%	0,00%
- BRADESCO DED. SAUDE ANS			22.939.096,90	2,16%	0,66%
- BBM SMID CAPS FICFIA			21.366.772,17	2,02%	0,61%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM			49.220.358,03	4,64%	1,41%
- VINCI VALOREM FIM			46.644.364,77	4,40%	1,33%
- BRAD RF DI FED EXTRA			193.666.692,05	18,28%	5,54%
- BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO			36.605.071,32	3,45%	1,05%
- ARX METRUS 2			63.605.963,30	6,00%	1,82%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP			(215.630,42)	-0,02%	-0,01%
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP			1.865.988,78	0,18%	0,05%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			21.642.760,56	2,04%	0,62%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP			6.609.992,66	0,62%	0,19%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA			3.973.292,93	0,37%	0,11%
- INDUSTRIAL PARKS BRASIL FIP MULTISTRATÉGIA			1.256.946,71	0,12%	0,04%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			2.938.482,26	0,28%	0,08%
- HAMILTON LANE FIC FIP			21.295.368,66	2,01%	0,61%
- MULTINER FIP			-33.339,47	0,00%	0,00%
- STRATUS SCP BR FIP			12.534.440,00	1,18%	0,36%
- P2BR INFR III FIOFIP			22.764.370,59	2,15%	0,65%

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

CONSOLIDADO

- COPA FLORESTAL III			886.511,60	0,08%	0,03%
- CLARITAS LONG SHORT			11.852.836,49	1,12%	0,34%
- GIANT ZARATHUSTRA II			38.218.391,00	3,61%	1,09%
- IBIUNA LONG SHORT			37.434.906,85	3,53%	1,07%
- NEO PROVECTUS I			36.093.043,11	3,41%	1,03%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			997.213,86	0,09%	0,03%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- SCHRODER PLAN II FIM			61.017.583,20	5,76%	1,75%
- SCHRODER METRUS FIM			49.940.024,96	4,71%	1,43%
TOTAL			1.059.699.579,99	100,00%	30,32%

GESTÃO PRÓPRIA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENDA FIXA			2.008.740.728,40	82,50%	57,48%
RENDA VARIÁVEL			79.657.551,88	3,27%	2,28%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			97.230.018,22	3,99%	2,78%
EMPRÉSTIMO PESSOAL			56.119.670,61	2,30%	1,61%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)			193.161.859,83	7,93%	5,53%
TOTAL			2.434.909.828,94	100,00%	69,68%