

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO

CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.05.2023

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			3.640.634.351,77		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			2.953.373.571,88	81,12	
TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOURE NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOURE NACIONAL	PÓS				
Títulos Públicos					
. VALORES A PAGAR					
APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS			1.734.636.516		
Certificado de Depósito Bancário		388.214	4.249.991,32	47,65	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL				-0,12	
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS			1.167.677.282,02	32,07	
- BANCO CRUZEIRO DO SUL					
			0,00	0,00	
Letra Financeira Subordinada		1,00	30.061.729,53	0,83	0,83
. ABC		4			
. PARANÁ BANCO			-30.061.729,53	-0,83	-0,83
		-3			
BRADESCO			360.303.932,82	9,90	
		4.009	55.662.685,11	1,53	1,53
DAYCOVAL		622	65.668.023,02	1,80	1,80
. SAFRA		342	123.483.360,05	3,39	3,39
. BANCO		1.846	35.628.484,02	0,98	0,98
PANAMERICANO		603	51.642.423,71	1,42	1,42
BANCO BTG PACTUAL		90	189.962,39	0,01	0,01
		2	28.028.994,52	0,77	0,77
Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.		504			
. SANT FIC FI ISN RF D			807.373.349,20	22,18	
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		133.787.113,14	78.532,39	0,00	0,00
. SAN FC EXTRA RF REF		337,13	107.423.242,38	2,95	2,95
. BRADESCO DED. SAUDE ANS		653.053,18	16.913,23	0,00	0,00
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		11,56	25.667.435,56	0,71	0,71
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		6.891.627,03	54.886.827,98	1,51	1,51
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		32.496.465,93	2.852.699,67	0,08	0,08
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		75.416,68	37.050.712,53	1,02	1,02
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		300.000,00	18.550,97	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		8.673,97	185.733,05	0,01	0,01
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		14.723,99	3.801,05	0,00	0,00
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		8.925,14	841.343,41	0,02	0,02
. VINCI VALOREM FIM		39,04	17.820.813,70	0,49	0,49
. BRAD RF DI FED EXTRA		12.608,30	51.093.424,76	1,40	1,40
. BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO		183.841,95	399.211.156,26	10,97	10,97
PRAZO . ARX METRUS 2		26.760.454,33	41.346.286,71	1,14	1,14
		7.819.958,17	68.875.875,55	1,89	1,89
		58.560.976,73			
Debêntures			40.116.784,28	1,10	
. CEMIG			27.890.146,85	0,77	0,77
. ROTA DAS		39.644	11.056.894,92	0,30	0,30
BANDEIRAS		30.000	1.169.742,51	0,03	0,03
SABESP		8.792			
		852			
Outros Títulos			10.942.989,97	0,30	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		6,6	10.736.639,42	0,29	0,29
B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			97.494.247,92	2,68	

B1. Mercado de Ações			<u>107.105,70</u>	<u>0,00</u>	
Companhias Abertas			<u>0,00</u>	<u>0,00</u>	
Instituições Financeiras		<u>0,00</u>	<u>0,00</u>	<u>0,00</u>	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER (inst. Fin. + Companhia Aberta)		<u>0</u>	107.105,70	0,00	
B2. Fundos			<u>97.387.142,22</u>	<u>2,68</u>	
. VELT INST FICFIA			16.428.087,87	0,45	
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		<u>25.080.718,29</u>	15.739.421,20	0,43	
. BBM SMID CAPS FICFIA	4.	264.768,817.229.148,51	12.135.799,06	0,33	
. IBIUNA EQ. FIC FIA		1.934.321,29	13.877.906,19	0,38	
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		40.164,86	5.307.504,96	0,15	
. MOAT CAPITAL FIA		27.930,50	15.004.246,01	0,41	
. SPX APACHE FIA	5.	134.370,55	18.894.176,93	0,52	
	6.	450.013,78			
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		<u>76.601.622</u>	<u>219.652.419,09</u>	<u>6,03</u>	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP		10.858,75	-234.249,76	-0,01	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.660,33	2.434.986,22	0,07	
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.676,93	5.906.816,26	0,16	
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.508,03	6.896.404,76	0,19	
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		5.000,00	3.729.115,27	0,10	
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		9.229.551,01	1.230.380,55	0,03	
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.907.807,84	2.242.868,60	0,06	
. HAMILTON LANE FIC FIP		21.069,97	16.982.571,65	0,47	
. MULTINER FIP		10,17	-11.615,68	0,00	
. STRATUS SCP BR FIP		10.000.000,00	8.806.170,00	0,24	
. P2BR INFR III FIQFIP		11.430,72	8.570.247,46	0,24	
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	844.332,70	0,02	
. CLARITAS LONG SHORT		983.361,11	13.245.161,65	0,36	
. GIANT ZARATHUSTRA II		20.278.690,71	38.883.699,36	1,07	
. IBIUNA LONG SHORT		147.742,28	44.929.540,29	1,23	
. NEO PROVECTUS I		23.377.642,04	43.707.433,35	1,20	
. ITAU HEDGE PLUS MULTIMERCADO FIC DE FI		608.612,32	21.488.556,41	0,59	
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		<u>70.000.000</u>	<u>63.174.293,00</u>	<u>1,74</u>	
. SCHRODER PLAN II FIM		70.000.000	63.174.293,00	1,74	
E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			<u>84.738.028,29</u>	<u>2,33</u>	
E1 - Investimentos em Shopping Center			<u>60.688.228,29</u>	<u>1,67</u>	
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			34.837.719,66	0,96	
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			25.829.900,04	0,71	
. VALORES A RECEBER			20.608,59	0,00	
E2 - Investimento Imobiliário			<u>24.049.800,00</u>	<u>0,66</u>	
. PANAMBY			24.049.800,00	0,66	
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00	
E3 - Investimento Fundo Imobiliário		<u>0,00</u>	<u>0,00</u>	<u>0,00</u>	
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00	
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		<u>3.027</u>	<u>58.307.964,67</u>	<u>1,60</u>	

. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		3.027	59.159.441,00	1,62	
. VALORES A PAGAR (-)			-22.825,46	0,00	
. VALORES A RECEBER			-828.650,87	-0,02	
G - OUTROS			<u>163.893.826,92</u>	<u>4,50</u>	
. DISPONIVEL			5.424.482,60	0,15	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			2.234.500,75	0,06	
. OUTROS REALIZAVEIS			160.285.310,97	4,40	
. OUTROS DIREITOS A RECEBER			160.148.484,10	4,40	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-5.455.527,90	-0,15	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-158.743.423,60	-4,36	
GESTÃO TERCEIRIZADA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO TERCEIRIZADA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES

FUNDOS					
- SANT FIC FI ISN RF D			78.532,39	0,01%	0,00%
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP			107.423.242,38	9,05%	2,95%
- VELT INST FICFIA			16.428.087,87	1,38%	0,45%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA			15.739.421,20	1,33%	0,43%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA			5.307.504,96	0,45%	0,15%
- MOAT CAPITAL FIA			15.004.246,01	1,26%	0,41%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP			2.852.699,67	0,24%	0,08%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II			37.050.712,53	3,12%	1,02%
- SPX APACHE FIA			18.894.176,93	1,59%	0,52%
- IBIUNA EQ. FIC FIA			13.877.906,19	1,17%	0,38%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER			18.550,97	0,00%	0,00%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER II			185.733,05	0,02%	0,01%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER III			3.801,05	0,00%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.			841.343,41	0,07%	0,02%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL			17.820.813,70	1,50%	0,49%
- SAN FC EXTRA RF REF			16.913,23	0,00%	0,00%
- BRADESCO DED. SAUDE ANS			25.667.435,56	2,16%	0,71%
- BBM SMID CAPS FICFIA			12.135.799,06	1,02%	0,33%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM			54.886.827,98	4,62%	1,51%
- VINCI VALOREM FIM			51.093.424,76	4,30%	1,40%
- BRAD RF DI FED EXTRA			399.211.156,26	33,62%	10,97%
- BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO			41.346.286,71	3,48%	1,14%
- ARX METRUS 2			68.875.875,55	5,80%	1,89%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP			(234.249,76)	-0,02%	-0,01%
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP			2.434.986,22	0,21%	0,07%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			5.906.816,26	0,50%	0,16%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP			6.896.404,76	0,58%	0,19%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA			3.729.115,27	0,31%	0,10%

- INDUSTRIAL PARKS BRASIL FIP MULTISTRATÉGIA			1.230.380,55	0,10%	0,03%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			2.242.868,60	0,19%	0,06%
- HAMILTON LANE FIC FIP			16.982.571,65	1,43%	0,47%
- MULTINER FIP			-11.615,68	0,00%	0,00%
- STRATUS SCP BR FIP			8.806.170,00	0,74%	0,24%
- P2BR INFR III FIQFIP			8.570.247,46	0,72%	0,24%
- COPA FLORESTAL III			844.332,70	0,07%	0,02%
- CLARITAS LONG SHORT			13.245.161,65	1,12%	0,36%
- GIANT ZARATHUSTRA II			38.883.699,36	3,27%	1,07%
- IBIUNA LONG SHORT			44.929.540,29	3,78%	1,23%
- NEO PROVECTUS I			43.707.433,35	3,68%	1,20%
- ITAU HEDGE PLUS MULTIMERCADO FIC DE FI			21.488.556,41	1,81%	0,59%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- SCHRODER PLAN II FIM			63.174.293,00	5,32%	1,74%
TOTAL			1.187.587.203,47	100,00%	32,62%

GESTÃO PRÓPRIA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENTA FIXA			2.146.000.222,68	87,48%	58,95%
RENTA VARIÁVEL			107.105,70	0,00%	0,00%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			84.738.028,29	3,45%	2,33%
EMPRÉSTIMO PESSOAL			58.307.964,67	2,38%	1,60%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)			163.893.826,92	6,68%	4,50%
TOTAL			2.453.047.148,26	100,00%	67,38%