

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.07.2023

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.894.182.671,43		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			1.449.784.466,78	76,54	
TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOUREIRO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOUREIRO NACIONAL					
Títulos Públicos		181.698	760.518.943,40	40,15	
. VALORES A PAGAR			-1.468.247,67		
APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS			667.459.192,51	35,24	
Certificado de Depósito Bancário		0,00	0,00	0,00	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	1	8.852.570,64	0,47	0,47
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-1	-8.852.570,64	-0,47	-0,47
Letra Financeira Subordinada		3.183	273.344.737,18	14,43	
. BRADESCO		1.433	94.896.018,38	5,01	5,01
. DAYCOVAL		500	30.696.936,11	1,62	1,62
. SAFRA		90	52.153.111,33	2,75	2,75
. PARANÁ BANCO		250	32.191.364,80	1,70	1,70
. ABC		410	35.006.793,55	1,85	1,85
. BANCO BTG PACTUAL		500	28.400.513,01	1,50	1,50
Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.		102.988.716,31	394.114.455,33	20,81	
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		30.166,67	1.012.730,49	0,05	0,05
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		200.000,05	25.237.909,68	1,33	1,33
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		30.680.789,24	52.904.571,11	2,79	2,79
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		2.474,99	7.034,82	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		3.000,00	29.029,35	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		1.976,00	2.853,24	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		19,52	419.188,17	0,02	0,02
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		8.405,53	11.884.742,20	0,63	0,63
. BRAD RF DI FED EXTRA		10.987.492,29	167.528.771,48	8,84	8,84
. BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO		2.331.237,14	12.629.249,16	0,67	0,67
. VINCI VALOREM FIM		182.178,14	51.797.393,44	2,73	2,73
. ARX METRUS 2		58.560.976,73	70.660.982,19	3,73	3,73
Debêntures		19.644	21.806.330,87	1,15	
. CEMIG		10.000	9.373.337,79	0,49	0,49
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	11.251.932,46	0,59	0,59
. SABESP		852	1.181.060,62	0,06	0,06
B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			104.116.145,57	5,50	
B1. Mercado de Ações			52.695,93	0,00	
Companhias Abertas		0	0,00	0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER (inst. Fin. + Companhia Aberta)			52.695,93	0,00	
B2. Fundos		25.080.718,29	104.063.449,64	5,49	
. VELT INST FICFIA		4.264.768,81	12.318.117,13	0,65	
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		7.229.148,51	17.935.442,77	0,95	
. MOAT CAPITAL FIA		5.134.370,55	17.399.378,01	0,92	

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

. SPX APACHE FIA	6.450.013,78	21.431.958,71	1,13	
. BBM SMID CAPS FICFIA	1.934.321,29	13.574.847,83	0,72	
. IBIUNA EQ. FIC FIA	40.164,86	15.481.105,84	0,82	
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA	27.930,50	5.922.599,35	0,31	
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	46.304.222,38	134.722.223,75	7,11	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II- FIP	10.858,75	-238.444,01	-0,01	
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	395,93	1.285.647,85	0,07	
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP	9.508,03	5.834.318,15	0,31	
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVPE PLAZA	2.000,00	1.490.511,66	0,08	
. INDUSTRIAL PARKS BRASIL FIP MULTIESTRATÉGIA	2.768.765,30	362.465,93	0,02	
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE	763.123,24	896.880,50	0,05	
. HAMILTON LANE FIC FIP	7.163,79	5.732.126,69	0,30	
. STRATUS SCP BR FIP	5.000.000,00	4.372.655,00	0,23	
. P2 BR INFRAESTRUTURA III FIC DE FIP	3.811,41	2.982.286,94	0,16	
. COPA FLORESTAL III	10.000.000,00	824.339,50	0,04	
. CLARITAS LONG SHORT	595.945,95	8.301.813,52	0,44	
. GIANT ZARATHUSTRA II	12.290.755,78	25.018.035,58	1,32	
. IBIUNA LONG SHORT	89.535,58	29.654.401,13	1,57	
. NEO PROVECTUS I	14.166.322,01	26.874.412,41	1,42	
. ITAU HEDGE PLUS MULTIMERCADO FIC DE FI	596.036,61	21.330.772,90	1,13	
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	70.000.000	60.436.838,70	3,19	
. SCHRODER PLAN II FIM	70.000.000,00	60.436.838,70	3,19	
E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS		25.641.662,57	1,35	
E1 - Investimentos em Shopping Center		25.641.662,57	1,35	
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA		25.612.842,06	1,35	
. VALORES A RECEBER		28.820,51	0,00	
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES	2.155	47.257.550,97	2,49	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	2.155	47.539.002,80	2,51	
. VALORES A PAGAR (-)		-63.116,27	0,00	
. VALORES A RECEBER		-218.335,56	-0,01	
G - OUTROS		72.223.783,09	3,81	
. DISPONIVEL		1.736.618,54	0,09	
. DEPOSITOS JUDICIAIS		0,00	0,00	
. OUTROS REALIZAVEIS		72.228.313,59	3,81	
. OUTROS DIREITOS A RECEBER		71.337.527,92	3,77	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES		-849.446,36	-0,04	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL		-72.229.230,60	-3,81	
GESTÃO TERCEIRIZADA		DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO TERCEIRIZADA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS				
- VELT INST FICFIA		12.318.117,13	1,78%	0,65%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		17.935.442,77	2,59%	0,95%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		5.922.599,35	0,85%	0,31%
- MOAT CAPITAL FIA		17.399.378,01	2,51%	0,92%
- BBM SMID CAPS FICFIA		13.574.847,83	1,96%	0,72%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		1.012.730,49	0,15%	0,05%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		25.237.909,68	3,64%	1,33%
- IBIUNA EQ. FIC FIA		15.481.105,84	2,23%	0,82%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		7.034,82	0,00%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		29.029,35	0,00%	0,00%

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III			2.853,24	0,00%	0,00%
- SPX APACHE FIA			21.431.958,71	3,09%	1,13%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.			419.188,17	0,06%	0,02%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL			11.884.742,20	1,71%	0,63%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM			52.904.571,11	7,63%	2,79%
- BRAD RF DI FED EXTRA			167.528.771,48	24,16%	8,84%
- BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO			12.629.249,16	1,82%	0,67%
- VINCI VALOREM FIM			51.797.393,44	7,47%	2,73%
- ARX METRUS 2			70.660.982,19	10,19%	3,73%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP			(238.444,01)	-0,03%	-0,01%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			1.285.647,85	0,19%	0,07%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP			5.834.318,15	0,84%	0,31%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVPE PLAZA			1.490.511,66	0,21%	0,08%
- INDUSTRIAL PARKS BRASIL FIP MULTISTRATÉGIA			362.465,93	0,05%	0,02%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			896.880,50	0,13%	0,05%
- HAMILTON LANE FIC FIP			5.732.126,69	0,83%	0,30%
- STRATUS SCP BR FIP			4.372.655,00	0,63%	0,23%
- P2BR INFR III FIQFIP			2.982.286,94	0,43%	0,16%
- COPA FLORESTAL III			824.339,50	0,12%	0,04%
- CLARITAS LONG SHORT			8.301.813,52	1,20%	0,44%
- GIANT ZARATHUSTRA II			25.018.035,58	3,61%	1,32%
- IBIUNA LONG SHORT			29.654.401,13	4,28%	1,57%
- NEO PROVECTUS I			26.874.412,41	3,88%	1,42%
- ITAU HEDGE PLUS MULTIMERCADO FIC DE FI			21.330.772,90	3,08%	1,13%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- SCHRODER PLAN II FIM			60.436.838,70	8,72%	3,19%
TOTAL			693.336.967,42	100,00%	36,60%

GESTÃO PRÓPRIA	DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENTA FIXA	1.055.670.011,45	87,91%	55,73%
RENTA VARIÁVEL	52.695,93	0,00%	0,00%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	25.641.662,57	2,14%	1,35%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	47.257.550,97	3,94%	2,49%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	72.223.783,09	6,01%	3,81%
TOTAL	1.200.845.704,01	100,00%	63,40%