

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO

CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.01.2023

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			3.563.306.107,94		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			2.703.831.241,63	75,88	
<u>TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOIRO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOIRO NACIONAL</u>					
<u>Nota do Tesouro Nacional</u>		383.416	1.695.716.538	47,59	
. VALORES A PAGAR			(4.667.187,65)	-0,13	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			943.038.855,50	26,47	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		1,00	0,00	0,00	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	4	30.061.729,53	0,84	0,84
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-3	-30.061.729,53	-0,84	-0,84
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		4.007	335.855.000,06	9,43	
. ABC		622	51.096.386,35	1,43	1,43
. PARANÁ BANCO		340	62.633.819,49	1,76	1,76
. BRADESCO		1.846	114.542.740,22	3,21	3,21
. DAYCOVAL		603	31.960.203,77	0,90	0,90
. SAFRA		90	49.418.895,87	1,39	1,39
. BANCO PANAMERICANO		2	181.509,32	0,01	0,01
. BANCO BTG PACTUAL		504	26.021.445,04	0,73	0,73
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		121.936.134,89	607.183.855,44	17,04	
. SANT FIC FI ISN RF D		337,13	75.459,38	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		131.245,29	287.520,29	0,01	0,01
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		653.053,18	102.954.206,66	2,89	2,89
. SAN FC EXTRA RF REF		11,56	16.507,40	0,00	0,00
. BRADESCO DED. SAUDE ANS		6.891.627,03	24.937.036,78	0,70	0,70
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		32.257.369,73	51.996.227,46	1,46	1,46
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		75.416,68	5.429.733,50	0,15	0,15
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		300.000,00	34.152.781,91	0,96	0,96
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		8.673,97	9.895,69	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		14.724,00	227.931,41	0,01	0,01
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		8.925,14	9.571,95	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		39,04	835.518,09	0,02	0,02
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		12.608,30	16.947.893,01	0,48	0,48
. VINCI VALOREM FIM		183.841,95	48.507.736,00	1,36	1,36
. BRAD RF DI FED EXTRA		15.017.326,98	215.074.673,17	6,04	6,04
. BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO		7.819.958,17	39.838.617,46	1,12	1,12
. ARX METRUS 2		58.560.976,73	65.882.545,28	1,85	1,85
<u>Debêntures</u>		39.644	53.559.263,38	1,50	
. CEMIG		30.000	42.161.722,04	1,18	1,18
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	10.211.823,88	0,29	0,29
. SABESP		852	1.185.717,46	0,03	0,03
<u>Outros Títulos</u>		6	11.516.584,87	0,32	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		6	11.516.584,87	0,32	0,32
B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			182.527.598,95	5,12	
B1. Mercado de Ações			107.105,70	0,00	

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO

CONSOLIDADO

Companhias Abertas	<u>0,00</u>	<u>0,00</u>	<u>0,00</u>
Instituições Financeiras	<u>0</u>	<u>0,00</u>	<u>0,00</u>
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER (inst. Fin. + Companhia Aberta)		107.105,70	0,00
B2. Fundos	<u>49.522.220,03</u>	<u>182.420.493,25</u>	<u>5,12</u>
. VELT INST FICFIA	6.292.791,52	16.135.318,55	0,45
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	15.690.874,77	35.434.153,62	0,99
. BBM SMID CAPS FICFIA	3.096.544,16	21.604.203,72	0,61
. IBIUNA EQ. FIC FIA	62.732,91	22.828.274,82	0,64
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA	87.042,25	17.429.168,34	0,49
. MOAT CAPITAL FIA	10.351.340,47	29.215.808,64	0,82
. SPX APACHE FIA	13.940.893,93	39.773.565,56	1,12
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	<u>76.589.047</u>	<u>239.417.162,14</u>	<u>6,72</u>
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP	10.858,75	-268.550,44	-0,01
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP	8.660,33	1.840.040,31	0,05
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	1.676,93	7.560.659,20	0,21
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP	9.508,03	6.450.848,94	0,18
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVPE PLAZA	5.000,00	3.961.224,18	0,11
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES	9.229.551,01	1.234.689,65	0,03
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE	1.907.807,84	2.941.822,88	0,08
. HAMILTON LANE FIC FIP	21.069,97	17.340.661,83	0,49
. MULTINER FIP	10,17	-7.465,26	0,00
. STRATUS SCP BR FIP	10.000.000,00	9.587.710,00	0,27
. P2BR INFR III FIQFIP	11.430,72	28.378.820,57	0,80
. COPA FLORESTAL III	10.000.000,00	796.618,50	0,02
. CLARITAS LONG SHORT	983.361,11	12.944.055,57	0,36
. GIANT ZARATHUSTRA II	20.278.690,71	38.878.529,91	1,09
. IBIUNA LONG SHORT	147.742,28	45.423.367,91	1,27
. NEO PROPECTUS I	23.377.642,04	41.669.978,35	1,17
. ITAU HEDGE PLUS MULTIMERCADO FIC DE FI	596.036,61	20.684.150,07	0,58
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	<u>126.000.000</u>	<u>117.171.143,74</u>	<u>3,29</u>
. SCHRODER PLAN II FIM	70.000.000	62.939.685,90	1,77
. SCHRODER METRUS FIM	56.000.000,00	54.231.457,84	1,52
E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS		<u>86.446.662,47</u>	<u>2,43</u>
E1 - Investimentos em Shopping Center		<u>61.651.686,58</u>	<u>1,73</u>
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ		35.313.319,93	0,99
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA		26.264.015,99	0,74
. VALORES A RECEBER		74.350,66	0,00
E2 - Investimento Imobiliário		<u>24.049.800,00</u>	<u>0,67</u>
. PANAMBY		24.049.800,00	0,67
. VALORES A PAGAR (-)		0,00	0,00
E3 - Investimento Fundo Imobiliário	<u>0,00</u>	<u>745.175,89</u>	<u>0,02</u>
. VALORES A RECEBER		745.175,89	0,02
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES	<u>2.994</u>	<u>56.961.155,71</u>	<u>1,60</u>
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	2.994	58.412.340,87	1,64
. VALORES A PAGAR (-)		-34.777,96	0,00
. VALORES A RECEBER		-1.416.407,20	-0,04
G - OUTROS		<u>176.951.143,30</u>	<u>4,97</u>
. DISPONIVEL		7.274.071,44	0,20
. DEPOSITOS JUDICIAIS		2.060.557,75	0,06
. OUTROS REALIZAVEIS		160.285.778,05	4,50
. OUTROS DIREITOS A RECEBER		171.361.303,20	4,81
. OUTRAS EXIGIBILIDADES		-5.401.589,05	-0,15
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL		-158.628.978,09	-4,45

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

CONSOLIDADO

GESTÃO TERCEIRIZADA	DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO TERCEIRIZADA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS			
- SANT FIC FI ISN RF D	75.459,38	0,01%	0,00%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO	287.520,29	0,03%	0,01%
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP	102.954.206,66	8,98%	2,89%
- VELT INST FICFIA	16.135.318,55	1,41%	0,45%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	35.434.153,62	3,09%	0,99%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA	17.429.168,34	1,52%	0,49%
- MOAT CAPITAL FIA	29.215.808,64	2,55%	0,82%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP	5.429.733,50	0,47%	0,15%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II	34.152.781,91	2,98%	0,96%
- SPX APACHE FIA	39.773.565,56	3,47%	1,12%
- IBIUNA EQ. FIC FIA	22.828.274,82	1,99%	0,64%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	9.895,69	0,00%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	227.931,41	0,02%	0,01%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	9.571,95	0,00%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.	835.518,09	0,07%	0,02%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL	16.947.893,01	1,48%	0,48%
- SAN FC EXTRA RF REF	16.507,40	0,00%	0,00%
- BRADESCO DED. SAUDE ANS	24.937.036,78	2,18%	0,70%
- BBM SMID CAPS FICFIA	21.604.203,72	1,88%	0,61%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM	51.996.227,46	4,54%	1,46%
- VINCI VALOREM FIM	48.507.736,00	4,23%	1,36%
- BRAD RF DI FED EXTRA	215.074.673,17	18,76%	6,04%
- BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO	39.838.617,46	3,48%	1,12%
- ARX METRUS 2	65.882.545,28	5,75%	1,85%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP	(268.550,44)	-0,02%	-0,01%
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP	1.840.040,31	0,16%	0,05%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	7.560.659,20	0,66%	0,21%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP	6.450.848,94	0,56%	0,18%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA	3.961.224,18	0,35%	0,11%
- INDUSTRIAL PARKS BRASIL FIP MULTISTRATÉGIA	1.234.689,65	0,11%	0,03%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE	2.941.822,88	0,26%	0,08%
- HAMILTON LANE FIC FIP	17.340.661,83	1,51%	0,49%
- MULTINER FIP	-7.465,26	0,00%	0,00%
- STRATUS SCP BR FIP	9.587.710,00	0,84%	0,27%
- P2BR INFR III FIQFIP	28.378.820,57	2,48%	0,80%
- COPA FLORESTAL III	796.618,50	0,07%	0,02%
- CLARITAS LONG SHORT	12.944.055,57	1,13%	0,36%
- GIANT ZARATHUSTRA II	38.878.529,91	3,39%	1,09%
- IBIUNA LONG SHORT	45.423.367,91	3,96%	1,27%
- NEO PROVECTUS I	41.669.978,35	3,64%	1,17%
- ITAU HEDGE PLUS MULTIMERCADO FIC DE FI	20.684.150,07	1,80%	0,58%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			
- SCHRODER PLAN II FIM	62.939.685,90	5,49%	1,77%
- SCHRODER METRUS FIM	54.231.457,84	4,73%	1,52%
TOTAL	1.146.192.654,56	100,00%	32,17%

GESTÃO PRÓPRIA	DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENDA FIXA	2.096.647.386,19	86,77%	58,84%
RENDA VARIÁVEL	107.105,70	0,00%	0,00%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	85.701.486,58	3,55%	2,41%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	56.961.155,71	2,36%	1,60%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	176.951.143,30	7,32%	4,97%
TOTAL	2.416.368.277,48	100,00%	67,81%