

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

CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 29.07.2022

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			3.482.925.049,56		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			2.547.265.307,69	73,14	
<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>		391.239	1.713.045.782	49,18	
. VALORES A PAGAR			-4.719.768	-0,14	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			764.712.933,02	21,96	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		1,00	0,00	0,00	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	4	30.061.729,53	0,86	0,86
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
. BANCO CRUZEIRO DO SUL		-3	-30.061.729,53	-0,86	-0,86
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		3.008	276.584.665,19	7,94	
. ABC		623	49.497.084,70	1,42	1,42
. PARANÁ BANCO		340	60.469.874,41	1,74	1,74
. BRADESCO		846	62.452.274,48	1,79	1,79
. DAYCOVAL		603	31.072.798,58	0,89	0,89
. SAFRA		90	47.832.938,43	1,37	1,37
. BANCO PANAMERICANO		2	168.267,12	0,00	0,00
. BANCO BTG PACTUAL		504	25.091.427,47	0,72	0,72
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		110.739.944,90	488.128.267,83	14,01	
. SANT FIC FI ISN RF D		337,13	70.657,62	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		204.403,66	421.366,38	0,01	0,01
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		107.104,76	371.416,90	0,01	0,01
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		550.043,39	84.618.653,01	2,43	2,43
. SAN FC EXTRA RF REF		11,56	15.573,01	0,00	0,00
. BRADESCO DED. SAUDE ANS		1.219.990,97	23.402.198,41	0,67	0,67
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		32.145.768,54	49.496.174,97	1,42	1,42
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		75.416,68	5.577.277,33	0,16	0,16
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		253.774,68	28.516.665,06	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	70.629,18	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		8.925,14	7.904,74	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		39,04	1.337.486,14	0,04	0,04
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		12.608,30	17.715.876,86	0,51	0,51
. VINCI VALOREM FIM		183.841,95	46.861.658,08	1,35	1,35
. BRAD RF DI FED EXTRA		9.573.346,23	128.822.773,34	3,70	3,70
. BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO		7.819.958,17	37.353.895,82	1,07	1,07
. ARX METRUS 2		58.560.976,73	63.468.060,98	1,82	1,82
<u>Debêntures</u>		45.307	56.722.212,83	1,63	
. CEMIG		30.000	40.750.994,78	1,17	1,17
. ECOISTAS		5.250	850.875,15	0,02	0,02
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	10.594.338,92	0,30	0,30
. SABESP		1.265	4.526.003,98	0,13	0,13
<u>Outros Títulos</u>		7	12.784.379,72	0,37	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	17.076.601,80	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			247.305.616,06	7,10
B1. Mercado de Ações			72.411.941,30	2,08
Companhias Abertas		2.491.484,00	61.056.124,68	1,75
. AMBEV	ON	120.607	1.800.662,51	0,05
. ASSAI ATACADISTA	ON	320.000	5.072.000	0,15
. BRF - BRASIL FOODS	ON	86.578	1.381.784,88	0,04
. COSAN	ON	259.200	4.839.264,00	0,14
. ECORODOVIAS	ON	149.200	848.948,00	0,02
. GERDAU - GGBR	PN	147.388	3.605.110,48	0,10
. ITAUSA	ON	226	2.088,24	0,00
. ITAUSA	PN	516.084	4.453.805	0,13
. LOGG COMERCIAL	ON	7.386	154.515,12	0,00
. MRVE	ON	104.800	959.968	0,03
. PÃO DE AÇUCAR	PN	64.000	1.043.840,00	0,03
. PETROBRÁS	PN	258.894	8.841.230,10	0,25
. RENT	ON	189.378	10.910.066,58	0,31
. SUZANO PAPEL	PNA	82.100	3.964.609,00	0,11
. VALE R. DOCE	PNA	179.785	12.540.003,75	0,36
. XP	BDR	5.858	638.229	0,02
Instituições Financeiras		550.866	11.172.436,87	0,32
. BRADESCO	PN	297.095	5.178.365,85	0,15
. ITAU	PN	253.771	5.994.071,02	0,17
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER (inst. Fin. + Companhia Aberta)			183.379,75	0,01
B2. Fundos		49.522.220,03	174.893.674,76	5,02
. VELT INST FICFIA		6.292.791,52	15.879.767,47	0,46
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		15.690.874,77	35.104.142,05	1,01
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.096.544,16	19.554.318,73	0,56
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	20.553.174,52	0,59
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		87.042,25	15.784.164,19	0,45
. MOAT CAPITAL FIA		10.351.340,47	33.012.647,21	0,95
. SPX APACHE FIA		13.940.893,93	35.005.460,59	1,01
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		75.992.921	223.083.345,60	6,41
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP		10.858,75	-226.068,12	-0,01
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.660,33	1.859.182,34	0,05
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.676,93	21.635.423,93	0,62
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.459,66	6.434.702,87	0,18
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVPE PLAZA		5.000,00	3.970.313,57	0,11
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		9.229.551,01	1.252.003,92	0,04
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.907.807,84	2.933.753,91	0,08
. HAMILTON LANE FIC FIP		21.069,97	20.816.219,66	0,60
. MULTINER FIP		10,17	-13.858,15	0,00
. STRATUS SCP BR FIP		10.000.000,00	11.671.010,00	0,34
. P2BR INFR III FIQFIP		11.390,40	26.591.930,50	0,76
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	891.081,60	0,03
. CLARITAS LONG SHORT		983.361,11	11.843.442,57	0,34
. GIANT ZARATHUSTRA II		20.278.690,71	38.061.197,68	1,09
. IBIUNA LONG SHORT		147.742,28	38.861.783,25	1,12
. NEO PROPECTUS I		23.377.642,04	36.501.226,10	1,05
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		126.000.000	120.143.067,80	3,45
. SCHRODER PLAN II FIM		70.000.000	65.743.295,80	1,89
. SCHRODER METRUS FIM		56.000.000,00	54.399.772,00	1,56
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00
E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			98.003.855,76	2,81
E1 - Investimentos em Shopping Center			66.636.968,06	1,91
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			46.634.632,29	1,34

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO

CONSOLIDADO

. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			19.972.266,67	0,57	
. VALORES A RECEBER			30.069,10	0,00	
E2 - Investimento Imobiliário			30.360.738,82	0,87	
. PANAMBY			30.360.738,82	0,87	
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00	
E3 - Investimento Fundo Imobiliário		784,45	1.006.148,88	0,03	
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		784,45	1.006.148,88	0,03	
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00	
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00	
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		3.045	54.712.018,77	1,57	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		3.045	56.971.173,32	1,64	
. VALORES A PAGAR (-)			-40.267,35	0,00	
. VALORES A RECEBER			-2.218.887,20	-0,06	
G - OUTROS			192.411.837,88	5,52	
. DISPONIVEL			5.827.554,93	0,17	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			2.019.040,73	0,06	
. OUTROS REALIZAVEIS			160.285.778,05	4,60	
. OUTROS DIREITOS A RECEBER			188.180.993,53	5,40	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-5.319.062,82	-0,15	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-158.582.466,54	-4,55	
GESTÃO TERCEIRIZADA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO TERCEIRIZADA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS					
- SANT FIC FI ISN RF D			70.657,62	0,01%	0,00%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO			421.366,38	0,04%	0,01%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES			371.416,90	0,04%	0,01%
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP			84.618.653,01	8,40%	2,43%
- VELT INST FICFIA			15.879.767,47	1,58%	0,46%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA			35.104.142,05	3,49%	1,01%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA			15.784.164,19	1,57%	0,45%
- MOAT CAPITAL FIA			33.012.647,21	3,28%	0,95%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP			5.577.277,33	0,55%	0,16%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II			28.516.665,06	2,83%	0,82%
- SPX APACHE FIA			35.005.460,59	3,48%	1,01%
- IBIUNA EQ. FIC FIA			20.553.174,52	2,04%	0,59%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER			-	0,00%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II			70.629,18	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III			7.904,74	0,00%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.			1.337.486,14	0,13%	0,04%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL			17.715.876,86	1,76%	0,51%
- SAN FC EXTRA RF REF			15.573,01	0,00%	0,00%
- BRADESCO DED. SAUDE ANS			23.402.198,41	2,32%	0,67%
- BBM SMID CAPS FICFIA			19.554.318,73	1,94%	0,56%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM			49.496.174,97	4,91%	1,42%
- VINCI VALOREM FIM			46.861.658,08	4,65%	1,35%
- BRAD RF DI FED EXTRA			128.822.773,34	12,79%	3,70%
- BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO			37.353.895,82	3,71%	1,07%
- ARX METRUS 2			63.468.060,98	6,30%	1,82%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP			(226.068,12)	-0,02%	-0,01%
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP			1.859.182,34	0,18%	0,05%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			21.635.423,93	2,15%	0,62%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP			6.434.702,87	0,64%	0,18%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA			3.970.313,57	0,39%	0,11%
- INDUSTRIAL PARKS BRASIL FIP MULTISTRATÉGIA			1.252.003,92	0,12%	0,04%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			2.933.753,91	0,29%	0,08%
- HAMILTON LANE FIC FIP			20.816.219,66	2,07%	0,60%

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

CONSOLIDADO

- MULTINER FIP			-13.858,15	0,00%	0,00%
- STRATUS SCP BR FIP			11.671.010,00	1,16%	0,34%
- P2BR INFR III FIQFIP			26.591.930,50	2,64%	0,76%
- COPA FLORESTAL III			891.081,60	0,09%	0,03%
- CLARITAS LONG SHORT			11.843.442,57	1,18%	0,34%
- GIANT ZARATHUSTRA II			38.061.197,68	3,78%	1,09%
- IBIUNA LONG SHORT			38.861.783,25	3,86%	1,12%
- NEO PROVECTUS I			36.501.226,10	3,62%	1,05%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			1.006.148,88	0,10%	0,03%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- SCHRODER PLAN II FIM			65.743.295,80	6,53%	1,89%
- SCHRODER METRUS FIM			54.399.772,00	5,40%	1,56%
TOTAL			1.007.254.504,86	100,00%	28,92%

GESTÃO PRÓPRIA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO A GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENTA FIXA			2.059.137.039,86	83,17%	59,12%
RENTA VARIÁVEL			72.411.941,30	2,92%	2,08%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			96.997.706,88	3,92%	2,78%
EMPRÉSTIMO PESSOAL			54.712.018,77	2,21%	1,57%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)			192.411.837,88	7,77%	5,52%
TOTAL			2.475.670.544,69	100,00%	71,08%