

RESUMO DOS INVESTIMENTOS
PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO

CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 30.06.2023

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			3.676.282.725,91		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			2.967.665.489,09	80,72	
<u>TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOIRO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOIRO NACIONAL</u>					
<u>Títulos Públicos</u>		400.238	1.791.389.774	48,73	
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			1.125.306.796,54	30,61	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		1,00	0,00	0,00	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	4	30.061.729,53	0,82	0,82
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-3	-30.061.729,53	-0,82	-0,82
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		4.009	364.567.103,96	9,92	
. ABC		622	56.915.845,31	1,55	1,55
. PARANÁ BANCO		342	66.066.106,45	1,80	1,80
. BRADESCO		1.846	124.343.255,16	3,38	3,38
. DAYCOVAL		603	36.758.410,17	1,00	1,00
. SAFRA		90	51.942.436,23	1,41	1,41
. BANCO PANAMERICANO		2	192.218,35	0,01	0,01
. BANCO BTG PACTUAL		504	28.348.832,29	0,77	0,77
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		130.052.586,60	760.739.692,58	20,69	
. SANT FIC FI ISN RF D		337,13	79.434,36	0,00	0,00
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		653.053,18	108.488.694,91	2,95	2,95
. SAN FC EXTRA RF REF		11,56	17.263,13	0,00	0,00
. BRADESCO DED. SAUDE ANS		6.891.627,03	26.222.534,04	0,71	0,71
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		32.496.465,93	55.512.835,02	1,51	1,51
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		75.416,68	2.509.445,68	0,07	0,07
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		300.000,00	37.822.607,38	1,03	1,03
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		8.673,97	21.522,74	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		14.723,99	138.597,04	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		8.925,14	6.880,86	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		39,04	839.015,35	0,02	0,02
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		12.608,30	18.165.004,27	0,49	0,49
. VINCI VALOREM FIM		183.841,95	51.744.392,00	1,41	1,41
. BRAD RF DI FED EXTRA		23.025.927,80	347.484.769,13	9,45	9,45
. BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO		7.819.958,17	41.927.304,05	1,14	1,14
. ARX METRUS 2		58.560.976,73	69.759.392,62	1,90	1,90
<u>Debêntures</u>		39.644	40.594.170,81	1,10	
. CEMIG		30.000	28.002.833,14	0,76	0,76
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	11.416.034,14	0,31	0,31
. SABESP		852	1.175.303,53	0,03	0,03
<u>Outros Títulos</u>		6	10.374.747,26	0,28	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		6	10.374.747,26	0,28	0,28
B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			100.951.544,54	2,75	
<u>B1. Mercado de Ações</u>			107.105,70	0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER (inst. Fin. + Companhia Aberta)			107.105,70	0,00	

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

CONSOLIDADO

B2. Fundos		<u>25.080.718,29</u>	<u>100.844.438,84</u>	<u>2,74</u>
. VELT INST FICFIA		4.264.768,81	11.904.869,82	0,32
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		7.229.148,51	17.201.347,32	0,47
. BBM SMID CAPS FICFIA		1.934.321,29	13.173.093,55	0,36
. IBIUNA EQ. FIC FIA		40.164,86	15.197.337,57	0,41
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		27.930,50	5.809.446,50	0,16
. MOAT CAPITAL FIA		5.134.370,55	16.695.412,68	0,45
. SPX APACHE FIA		6.450.013,78	20.862.931,40	0,57
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		<u>76.601.622</u>	<u>224.355.081,82</u>	<u>6,10</u>
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP		10.858,75	-242.027,14	-0,01
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.660,33	2.431.937,61	0,07
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.676,93	5.436.501,86	0,15
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.508,03	6.707.026,33	0,18
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		5.000,00	3.727.696,97	0,10
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		9.229.551,01	1.211.350,51	0,03
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.907.807,84	2.244.488,25	0,06
. HAMILTON LANE FIC FIP		21.069,97	16.847.398,63	0,46
. MULTINER FIP		10,17	-14.121,66	0,00
. STRATUS SCP BR FIP		10.000.000,00	8.756.420,00	0,24
. P2BR INFR III FIQFIP		11.430,72	8.957.369,90	0,24
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	845.082,60	0,02
. CLARITAS LONG SHORT		983.361,11	13.485.871,98	0,37
. GIANT ZARATHUSTRA II		20.278.690,71	41.075.356,78	1,12
. IBIUNA LONG SHORT		147.742,28	47.726.965,98	1,30
. NEO PROVECTUS I		23.377.642,04	43.510.792,32	1,18
. ITAU HEDGE PLUS MULTIMERCADO FIC DE FI		608.612,32	21.646.970,90	0,59
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		<u>70.000.000</u>	<u>60.183.935,70</u>	<u>1,64</u>
. SCHRODER PLAN II FIM		70.000.000	60.183.935,70	1,64
E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			<u>84.519.717,74</u>	<u>2,30</u>
E1 - Investimentos em Shopping Center			<u>60.469.917,74</u>	<u>1,64</u>
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			34.718.819,58	0,94
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			25.721.371,06	0,70
. VALORES A RECEBER			29.727,10	0,00
E2 - Investimento Imobiliário			<u>24.049.800,00</u>	<u>0,65</u>
. PANAMBY			24.049.800,00	0,65
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00
E3 - Investimento Fundo Imobiliário		<u>0,00</u>	<u>0,00</u>	<u>0,00</u>
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		<u>3.036</u>	<u>59.577.806,70</u>	<u>1,62</u>
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		3.036	60.307.419,56	1,64
. VALORES A PAGAR (-)			-85.658,81	0,00
. VALORES A RECEBER			-643.954,05	-0,02
G - OUTROS			<u>179.029.150,32</u>	<u>4,87</u>
. DISPONIVEL			23.585.600,66	0,64
. DEPOSITOS JUDICIAIS			2.252.660,51	0,06
. OUTROS REALIZAVEIS			160.283.710,49	4,36
. OUTROS DIREITOS A RECEBER			157.345.202,38	4,28
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-5.544.632,60	-0,15
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-158.893.391,12	-4,32

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			79.434,36	0,01%	0,00%
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP			108.488.694,91	9,47%	2,95%
- VELT INST FICFIA			11.904.869,82	1,04%	0,32%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA			17.201.347,32	1,50%	0,47%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA			5.809.446,50	0,51%	0,16%
- MOAT CAPITAL FIA			16.695.412,68	1,46%	0,45%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP			2.509.445,68	0,22%	0,07%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II			37.822.607,38	3,30%	1,03%
- SPX APACHE FIA			20.862.931,40	1,82%	0,57%
- IBIUNA EQ. FIC FIA			15.197.337,57	1,33%	0,41%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER			21.522,74	0,00%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II			138.597,04	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III			6.880,86	0,00%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.			839.015,35	0,07%	0,02%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL			18.165.004,27	1,58%	0,49%
- SAN FC EXTRA RF REF			17.263,13	0,00%	0,00%
- BRADESCO DED. SAUDE ANS			26.222.534,04	2,29%	0,71%
- BBM SMID CAPS FICFIA			13.173.093,55	1,15%	0,36%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM			55.512.835,02	4,84%	1,51%
- VINCI VALOREM FIM			51.744.392,00	4,51%	1,41%
- BRAD RF DI FED EXTRA			347.484.769,13	30,32%	9,45%
- BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO			41.927.304,05	3,66%	1,14%
- ARX METRUS 2			69.759.392,62	6,09%	1,90%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP			(242.027,14)	-0,02%	-0,01%
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP			2.431.937,61	0,21%	0,07%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			5.436.501,86	0,47%	0,15%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP			6.707.026,33	0,59%	0,18%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA			3.727.696,97	0,33%	0,10%
- INDUSTRIAL PARKS BRASIL FIP MULTISTRATÉGIA			1.211.350,51	0,11%	0,03%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			2.244.488,25	0,20%	0,06%
- HAMILTON LANE FIC FIP			16.847.398,63	1,47%	0,46%
- MULTINER FIP			-14.121,66	0,00%	0,00%
- STRATUS SCP BR FIP			8.756.420,00	0,76%	0,24%
- P2BR INFR III FIQFIP			8.957.369,90	0,78%	0,24%
- COPA FLORESTAL III			845.082,60	0,07%	0,02%
- CLARITAS LONG SHORT			13.485.871,98	1,18%	0,37%
- GIANT ZARATHUSTRA II			41.075.356,78	3,58%	1,12%
- IBIUNA LONG SHORT			47.726.965,98	4,16%	1,30%
- NEO PROPECTUS I			43.510.792,32	3,80%	1,18%
- ITAU HEDGE PLUS MULTIMERCADO FIC DE FI			21.646.970,90	1,89%	0,59%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- SCHRODER PLAN II FIM			60.183.935,70	5,25%	1,64%
TOTAL			1.146.123.148,90	100,00%	31,18%

GESTÃO PRÓPRIA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENDA FIXA			2.206.925.796,51	87,22%	60,03%
RENDA VARIÁVEL			107.105,70	0,00%	0,00%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			84.519.717,74	3,34%	2,30%
EMPRÉSTIMO PESSOAL			59.577.806,70	2,35%	1,62%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)			179.029.150,32	7,08%	4,87%
TOTAL			2.530.159.576,97	100,00%	68,82%