

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

CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 30.11.2022

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			3.727.966.281,35		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			2.682.391.753,87	71,95	
<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>		373.733	1.625.624.698	43,61	
. VALORES A PAGAR			-4.340.814	-0,12	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			987.909.789,65	26,50	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		1,00	0,00	0,00	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	4	30.061.729,53	0,81	0,81
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-3	-30.061.729,53	-0,81	-0,81
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		4.008	332.169.803,35	8,91	
. ABC		623	50.712.100,55	1,36	1,36
. PARANÁ BANCO		340	61.366.933,86	1,65	1,65
. BRADESCO		1.846	113.819.308,48	3,05	3,05
. DAYCOVAL		603	32.034.073,48	0,86	0,86
. SAFRA		90	48.448.919,47	1,30	1,30
. BANCO PANAMERICANO		2	177.049,20	0,00	0,00
. BANCO BTG PACTUAL		504	25.611.418,31	0,69	0,69
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		120.394.932,64	655.739.986,30	17,59	
. SANT FIC FI ISN RF D		337,13	73.835,57	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		135.798,70	292.904,68	0,01	0,01
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		210.189,77	762.828,46	0,02	0,02
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		653.053,18	103.716.381,60	2,78	2,78
. SAN FC EXTRA RF REF		11,56	16.187,61	0,00	0,00
. BRADESCO DED. SAUDE ANS		1.219.990,97	24.399.879,26	0,65	0,65
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		32.132.710,53	50.542.437,53	1,36	1,36
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		75.416,68	5.517.308,37	0,15	0,15
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		276.246,05	31.576.218,36	0,85	0,85
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		8.673,97	0,00	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		14.724,00	194.554,03	0,01	0,01
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		8.925,14	8.672,85	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		39,04	1.329.430,67	0,04	0,04
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		12.608,30	17.569.853,92	0,47	0,47
. VINCI VALOREM FIM		183.841,95	47.903.217,28	1,28	1,28
. BRAD RF DI FED EXTRA		19.081.430,77	267.738.271,84	7,18	7,18
. BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO		7.819.958,17	38.969.912,94	1,05	1,05
. ARX METRUS 2		58.560.976,73	65.128.091,33	1,75	1,75
<u>Debêntures</u>		41.807	57.024.290,15	1,53	
. CEMIG		30.000	41.362.506,23	1,11	1,11
. ECOISTAS		1.750	431.873,03	0,01	0,01
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	10.621.505,78	0,28	0,28
. SABESP		1.265	4.608.405,11	0,12	0,12
<u>Outros Títulos</u>		6	11.832.976,51	0,32	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		6	11.832.976,51	0,32	0,32

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO

CONSOLIDADO

B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			183.940.002,03	4,93
B1. Mercado de Ações			107.105,70	0,00
Companhias Abertas	0,00		0,00	0,00
Instituições Financeiras	0		0,00	0,00
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER (inst. Fin. + Companhia Aberta)			107.105,70	0,00
B2. Fundos	49.522.220,03		183.832.896,33	4,93
. VELT INST FICFIA	6.292.791,52		16.164.461,60	0,43
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	15.690.874,77		35.985.522,02	0,97
. BBM SMID CAPS FICFIA	3.096.544,16		22.001.917,97	0,59
. IBIUNA EQ. FIC FIA	62.732,91		22.328.267,76	0,60
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA	87.042,25		17.053.613,88	0,46
. MOAT CAPITAL FIA	10.351.340,47		31.504.768,47	0,85
. SPX APACHE FIA	13.940.893,93		38.794.344,63	1,04
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	76.589,047		239.343.519,31	6,42
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP	10.858,75		-246.792,33	-0,01
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP	8.660,33		1.847.239,47	0,05
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	1.676,93		7.385.329,50	0,20
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP	9.508,03		6.895.228,77	0,18
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVPE PLAZA	5.000,00		3.964.341,29	0,11
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES	9.229.551,01		1.240.105,64	0,03
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE	1.907.807,84		2.945.066,10	0,08
. HAMILTON LANE FIC FIP	21.069,97		19.723.438,04	0,53
. MULTINER FIP	10,17		-12.792,60	0,00
. STRATUS SCP BR FIP	10.000.000,00		10.374.700,00	0,28
. P2BR INFR III FICFIP	11.430,72		28.154.955,51	0,76
. COPA FLORESTAL III	10.000.000,00		835.583,90	0,02
. CLARITAS LONG SHORT	983.361,11		12.617.142,52	0,34
. GIANT ZARATHUSTRA II	20.278.690,71		38.854.405,36	1,04
. IBIUNA LONG SHORT	147.742,28		44.114.190,37	1,18
. NEO PROPECTUS I	23.377.642,04		40.063.225,99	1,07
. ITAU HEDGE PLUS MULTIMERCADO FIC DE FI	596.036,61		20.588.151,81	0,55
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	126.000.000		117.708.965,64	3,16
. SCHRODER PLAN II FIM	70.000.000		63.085.723,40	1,69
. SCHRODER METRUS FIM	56.000.000,00		54.623.242,24	1,47
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00
E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			96.976.430,76	2,60
E1 - Investimentos em Shopping Center			65.727.950,19	1,76
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			46.018.993,54	1,23
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			19.650.133,33	0,53
. VALORES A RECEBER			58.823,32	0,00
E2 - Investimento Imobiliário			30.507.405,60	0,82
. PANAMBY			30.507.405,60	0,82
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00
E3 - Investimento Fundo Imobiliário	784,45		741.074,97	0,02
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	784,45		741.074,97	0,02
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES	3.010		56.107.263,33	1,51
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	3.010		57.710.327,68	1,55
. VALORES A PAGAR (-)			-17.132,79	0,00
. VALORES A RECEBER			-1.585.931,56	-0,04

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

CONSOLIDADO

G - OUTROS			351.498.346,41	9,43	
. DISPONIVEL			5.431.405,75	0,15	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			2.060.557,75	0,06	
. OUTROS REALIZAVEIS			160.285.778,05	4,30	
. OUTROS DIREITOS A RECEBER			176.967.866,65	4,75	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-5.362.192,18	-0,14	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			12.114.930,39	0,32	
GESTÃO TERCEIRIZADA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO A GESTÃO TERCEIRIZADA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS					
- SANT FIC FI ISN RF D			73.835,57	0,01%	0,00%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO			292.904,68	0,02%	0,01%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES			762.828,46	0,06%	0,02%
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP			103.716.381,60	8,66%	2,78%
- VELT INST FICFIA			16.164.461,60	1,35%	0,43%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA			35.985.522,02	3,01%	0,97%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA			17.053.613,88	1,42%	0,46%
- MOAT CAPITAL FIA			31.504.768,47	2,63%	0,85%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP			5.517.308,37	0,46%	0,15%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II			31.576.218,36	2,64%	0,85%
- SPX APACHE FIA			38.794.344,63	3,24%	1,04%
- IBIUNA EQ. FIC FIA			22.328.267,76	1,86%	0,60%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER			-	0,00%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II			194.554,03	0,02%	0,01%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III			8.672,85	0,00%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.			1.329.430,67	0,11%	0,04%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL			17.569.853,92	1,47%	0,47%
- SAN FC EXTRA RF REF			16.187,61	0,00%	0,00%
- BRADESCO DED. SAUDE ANS			24.399.879,26	2,04%	0,65%
- BBM SMID CAPS FICFIA			22.001.917,97	1,84%	0,59%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM			50.542.437,53	4,22%	1,36%
- VINCI VALOREM FIM			47.903.217,28	4,00%	1,28%
- BRAD RF DI FED EXTRA			267.738.271,84	22,36%	7,18%
- BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO			38.969.912,94	3,25%	1,05%
- ARX METRUS 2			65.128.091,33	5,44%	1,75%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP			(246.792,33)	-0,02%	-0,01%
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP			1.847.239,47	0,15%	0,05%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			7.385.329,50	0,62%	0,20%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP			6.895.228,77	0,58%	0,18%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA			3.964.341,29	0,33%	0,11%
- INDUSTRIAL PARKS BRASIL FIP MULTISTRATÉGIA			1.240.105,64	0,10%	0,03%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			2.945.066,10	0,25%	0,08%
- HAMILTON LANE FIC FIP			19.723.438,04	1,65%	0,53%
- MULTINER FIP			-12.792,60	0,00%	0,00%
- STRATUS SCP BR FIP			10.374.700,00	0,87%	0,28%
- P2BR INFR III FIQFIP			28.154.955,51	2,35%	0,76%
- COPA FLORESTAL III			835.583,90	0,07%	0,02%
- CLARITAS LONG SHORT			12.617.142,52	1,05%	0,34%
- GIANT ZARATHUSTRA II			38.854.405,36	3,24%	1,04%
- IBIUNA LONG SHORT			44.114.190,37	3,68%	1,18%
- NEO PROVECTUS I			40.063.225,99	3,35%	1,07%
- ITAU HEDGE PLUS MULTIMERCADO FIC DE FI			20.588.151,81	1,72%	0,55%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			741.074,97	0,06%	0,02%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- SCHRODER PLAN II FIM			63.085.723,40	5,27%	1,69%
- SCHRODER METRUS FIM			54.623.242,24	4,56%	1,47%
TOTAL			1.197.366.442,54	100,00%	32,12%

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

CONSOLIDADO

GESTÃO PRÓPRIA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENDA FIXA			2.026.651.767,57	80,09%	54,36%
RENDA VARIÁVEL			107.105,70	0,00%	0,00%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			96.235.355,79	3,80%	2,58%
EMPRÉSTIMO PESSOAL			56.107.263,33	2,22%	1,51%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)			351.498.346,41	13,89%	9,43%
TOTAL			2.530.599.838,80	100,00%	67,88%