

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO

CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 30.09.2022

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			3.540.769.749,13		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			2.584.343.585,67	72,99	
<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>		367.890	1.599.175.774	45,16	
. VALORES A PAGAR			0	0,00	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			915.931.107,89	25,87	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		1,00	0,00	0,00	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	4	30.061.729,53	0,85	0,85
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
. BANCO CRUZEIRO DO SUL		-3	-30.061.729,53	-0,85	-0,85
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		4.008	330.556.956,06	9,34	
. ABC		623	50.542.241,54	1,43	1,43
. PARANÁ BANCO		340	60.521.447,09	1,71	1,71
. BRADESCO		1.846	113.948.389,90	3,22	3,22
. DAYCOVAL		603	32.145.239,54	0,91	0,91
. SAFRA		90	47.806.981,74	1,35	1,35
. BANCO PANAMERICANO		2	173.069,96	0,00	0,00
. BANCO BTG PACTUAL		504	25.419.586,29	0,72	0,72
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		116.627.064,40	585.374.151,83	16,53	
. SANT FIC FI ISN RF D		337,13	72.311,72	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		193.132,78	407.628,07	0,01	0,01
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		148.704,90	528.077,29	0,01	0,01
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		653.045,12	102.447.252,94	2,89	2,89
. SAN FC EXTRA RF REF		11,56	15.891,38	0,00	0,00
. BRADESCO DED. SAUDE ANS		1.219.990,97	23.923.135,80	0,68	0,68
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		32.132.710,53	49.823.700,46	1,41	1,41
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		75.416,68	5.443.027,91	0,15	0,15
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		268.755,59	31.394.052,71	0,89	0,89
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		8.673,97	0,00	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		14.724,00	57.633,00	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		8.925,14	8.573,27	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		39,04	1.328.653,57	0,04	0,04
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		12.608,30	17.669.260,81	0,50	0,50
. VINCI VALOREM FIM		183.841,95	47.212.597,73	1,33	1,33
. BRAD RF DI FED EXTRA		15.325.211,84	202.613.636,94	5,72	5,72
. BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO		7.819.958,17	38.195.434,52	1,08	1,08
. ARX METRUS 2		58.560.976,73	64.233.283,71	1,81	1,81
<u>Debêntures</u>		45.307	56.860.945,20	1,61	
. CEMIG		30.000	40.739.985,56	1,15	1,15
. ECOISTAS		5.250	855.068,93	0,02	0,02
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	10.733.642,58	0,30	0,30
. SABESP		1.265	4.532.248,13	0,13	0,13
<u>Outros Títulos</u>		7	12.375.758,65	0,35	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	16.667.980,73	0,47	0,47
. VALORES A RECEBER			3.274.905,95	0,09	0,09
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS			-7.567.128,03	-0,21	-0,21

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO

CONSOLIDADO

B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			261.788.217,61	7,39
B1. Mercado de Ações			74.933.422,78	2,12
Companhias Abertas		2.492.064,00	61.700.934,60	1,74
. AMBEV	ON	120.607	1.874.232,78	0,05
. ASSAI ATACADISTA	ON	320.000	5.616.000	0,16
. BRF - BRASIL FOODS	ON	86.578	1.115.124,64	0,03
. COSAN	ON	259.200	4.504.896,00	0,13
. ECORODOVIAS	ON	149.200	741.524,00	0,02
. GERDAU - GGBR	PN	147.388	3.602.162,72	0,10
. ITAUSA	ON	226	2.230,62	0,00
. ITAUSA	PN	516.084	5.021.497	0,14
. LOGG COMERCIAL	ON	7.386	182.803,50	0,01
. MRVE	ON	104.800	1.301.616	0,04
. PÃO DE AÇUCAR	PN	64.000	1.240.960,00	0,04
. PETROBRÁS	PN	258.894	7.715.041,20	0,22
. RENT	ON	189.378	11.569.102,02	0,33
. RENT	DIR	580	6.380,00	0,00
. SUZANO PAPEL	PNA	82.100	3.653.450,00	0,10
. VALE R. DOCE	PNA	179.785	12.951.711,40	0,37
. XP	BDR	5.858	602.202	0,02
Instituições Financeiras		550.866	13.015.179,06	0,37
. BRADESCO	PN	297.095	5.894.364,80	0,17
. ITAU	PN	253.771	7.120.814,26	0,20
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER (inst. Fin. + Companhia Aberta)			217.309,12	0,01
B2. Fundos		49.522.220,03	186.854.794,83	5,28
. VOLT INST FICFIA		6.292.791,52	17.382.527,99	0,49
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		15.690.874,77	36.419.471,83	1,03
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.096.544,16	20.589.239,22	0,58
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	21.870.341,90	0,62
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		87.042,25	16.733.518,43	0,47
. MOAT CAPITAL FIA		10.351.340,47	35.541.230,21	1,00
. SPX APACHE FIA		13.940.893,93	38.318.465,25	1,08
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		76.589.047	237.970.268,86	6,72
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP		10.858,75	-229.105,27	-0,01
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.660,33	1.853.534,55	0,05
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.676,93	7.706.022,87	0,22
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.508,03	6.718.171,56	0,19
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVPE PLAZA		5.000,00	3.967.193,97	0,11
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		9.229.551,01	1.247.097,67	0,04
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.907.807,84	2.949.814,06	0,08
. HAMILTON LANE FIC FIP		21.069,97	20.699.710,51	0,58
. MULTINER FIP		10,17	-20.075,87	0,00
. STRATUS SCP BR FIP		10.000.000,00	10.400.460,00	0,29
. P2BR INFR III FIQFIP		11.430,72	28.380.338,59	0,80
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	819.449,50	0,02
. CLARITAS LONG SHORT		983.361,11	12.341.748,11	0,35
. GIANT ZARATHUSTRA II		20.278.690,71	39.164.167,64	1,11
. IBIUNA LONG SHORT		147.742,28	42.381.371,28	1,20
. NEO PROPECTUS I		23.377.642,04	38.602.986,00	1,09
. ITAU HEDGE PLUS MULTIMERCADO FIC DE FI		596.036,61	20.987.383,69	0,59
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		126.000.000	117.185.592,44	3,31
. SCHRODER PLAN II FIM		70.000.000	61.944.594,60	1,75
. SCHRODER METRUS FIM		56.000.000,00	55.240.997,84	1,56
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO

CONSOLIDADO

E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			97.361.591,94	2,75	
E1 - Investimentos em Shopping Center			66.191.456,33	1,87	
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			46.326.812,90	1,31	
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			19.811.200,00	0,56	
. VALORES A RECEBER			53.443,43	0,00	
E2 - Investimento Imobiliário			30.434.072,21	0,86	
. PANAMBY			30.434.072,21	0,86	
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00	
E3 - Investimento Fundo Imobiliário		784,45	736.063,40	0,02	
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		784,45	736.063,40	0,02	
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00	
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00	
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		3.028	55.961.245,62	1,58	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		3.028	57.729.970,87	1,63	
. VALORES A PAGAR (-)			-40.228,18	0,00	
. VALORES A RECEBER			-1.728.497,07	-0,05	
G - OUTROS			186.159.246,99	5,26	
. DISPONIVEL			5.408.077,27	0,15	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			2.067.133,86	0,06	
. OUTROS REALIZAVEIS			160.285.778,05	4,53	
. OUTROS DIREITOS A RECEBER			182.298.249,81	5,15	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-5.351.691,81	-0,15	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-158.548.300,19	-4,48	
GESTÃO TERCEIRIZADA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO TERCEIRIZADA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS					
- SANT FIC FI ISN RF D			72.311,72	0,01%	0,00%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO			407.628,07	0,04%	0,01%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES			528.077,29	0,05%	0,01%
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP			102.447.252,94	9,08%	2,89%
- VELT INST FICFIA			17.382.527,99	1,54%	0,49%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA			36.419.471,83	3,23%	1,03%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA			16.733.518,43	1,48%	0,47%
- MOAT CAPITAL FIA			35.541.230,21	3,15%	1,00%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP			5.443.027,91	0,48%	0,15%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II			31.394.052,71	2,78%	0,89%
- SPX APACHE FIA			38.318.465,25	3,40%	1,08%
- IBIUNA EQ. FIC FIA			21.870.341,90	1,94%	0,62%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER			-	0,00%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II			57.633,00	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III			8.573,27	0,00%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.			1.328.653,57	0,12%	0,04%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL			17.669.260,81	1,57%	0,50%
- SAN FC EXTRA RF REF			15.891,38	0,00%	0,00%
- BRADESCO DED. SAUDE ANS			23.923.135,80	2,12%	0,68%
- BBM SMID CAPS FICFIA			20.589.239,22	1,83%	0,58%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM			49.823.700,46	4,42%	1,41%
- VINCI VALOREM FIM			47.212.597,73	4,19%	1,33%
- BRAD RF DI FED EXTRA			202.613.636,94	17,96%	5,72%
- BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO			38.195.434,52	3,39%	1,08%
- ARX METRUS 2			64.233.283,71	5,69%	1,81%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP			(229.105,27)	-0,02%	-0,01%
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP			1.853.534,55	0,16%	0,05%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			7.706.022,87	0,68%	0,22%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP			6.718.171,56	0,60%	0,19%

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO

CONSOLIDADO

- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVPE PLAZA			3.967.193,97	0,35%	0,11%
- INDUSTRIAL PARKS BRASIL FIP MULTISTRATÉGIA			1.247.097,67	0,11%	0,04%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			2.949.814,06	0,26%	0,08%
- HAMILTON LANE FIC FIP			20.699.710,51	1,83%	0,58%
- MULTINER FIP			-20.075,87	0,00%	0,00%
- STRATUS SCP BR FIP			10.400.460,00	0,92%	0,29%
- P2BR INFR III FIQFIP			28.380.338,59	2,52%	0,80%
- COPA FLORESTAL III			819.449,50	0,07%	0,02%
- CLARITAS LONG SHORT			12.341.748,11	1,09%	0,35%
- GIANT ZARATHUSTRA II			39.164.167,64	3,47%	1,11%
- IBIUNA LONG SHORT			42.381.371,28	3,76%	1,20%
- NEO PROVECTUS I			38.602.986,00	3,42%	1,09%
- ITAU HEDGE PLUS MULTIMERCADO FIC DE FI			20.987.383,69	1,86%	0,59%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			736.063,40	0,07%	0,02%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- SCHRODER PLAN II FIM			61.944.594,60	5,49%	1,75%
- SCHRODER METRUS FIM			55.240.997,84	4,90%	1,56%
TOTAL			1.128.120.871,32	100,00%	31,86%

GESTÃO PRÓPRIA	DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENTA FIXA	1.998.969.433,84	82,85%	56,46%
RENTA VARIÁVEL	74.933.422,78	3,11%	2,12%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	96.625.528,54	4,00%	2,73%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	55.961.245,62	2,32%	1,58%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	186.159.246,99	7,72%	5,26%
TOTAL	2.412.648.877,77	100,00%	68,14%