

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO

CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.08.2023

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			3.701.176.981,04		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			3.081.293.037,68	83,25	
<u>TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOIRO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOIRO NACIONAL</u>					
<u>Títulos Públicos</u>		402.582	1.799.369.887	48,62	
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			1.231.303.589,83	33,27	
<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>		4.009	367.234.861,43	9,92	
. ABC		622	57.316.525,31	1,55	1,55
. PARANÁ BANCO		342	66.832.840,56	1,81	1,81
. BRADESCO		1.846	124.754.183,14	3,37	3,37
. DAYCOVAL		603	36.877.469,61	1,00	1,00
. SAFRA		90	52.501.466,73	1,42	1,42
. BANCO PANAMERICANO		2	196.365,38	0,01	0,01
. BANCO BTG PACTUAL		504	28.756.010,70	0,78	0,78
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		135.434.821,80	864.068.728,40	23,35	
. SANT FIC FI ISN RF D		337,13	81.401,79	0,00	0,00
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		653.053,18	111.190.757,30	3,00	3,00
. SANT CENTRUM FICFIRF		1.331,53	17.631,62	0,00	0,00
. BRADESCO DED. SAUDE ANS		6.891.627,03	26.790.291,08	0,72	0,72
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		32.496.465,93	56.494.385,89	1,53	1,53
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		75.416,68	2.539.777,17	0,07	0,07
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		300.000,00	37.479.481,44	1,01	1,01
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		8.673,97	27.905,05	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		14.723,99	141.511,83	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		8.925,14	14.996,24	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		39,04	839.525,21	0,02	0,02
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		12.608,30	17.845.659,15	0,48	0,48
. VINCI VALOREM FIM		183.841,95	52.528.835,75	1,42	1,42
. BRAD RF DI FED EXTRA		28.406.843,03	438.015.441,36	11,83	11,83
. BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO		7.819.958,17	48.648.457,80	1,31	1,31
. ARX METRUS 2		58.560.976,73	71.412.669,72	1,93	1,93
<u>Debêntures</u>		39.644	40.804.315,08	1,10	
. CEMIG		30.000	28.311.167,11	0,76	0,76
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	11.303.133,01	0,31	0,31
. SABESP		852	1.190.014,96	0,03	0,03
<u>Outros Títulos</u>		6	9.815.246,26	0,27	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		6	9.815.246,26	0,27	0,27
B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			96.720.870,77	2,61	
<u>B1. Mercado de Ações</u>			107.105,70	0,00	

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO

CONSOLIDADO

. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER (inst. Fin. + Companhia Aberta)			107.105,70	0,00
B2. Fundos		<u>25.080.718,29</u>	<u>96.613.765,07</u>	<u>2,61</u>
. VELT INST FICFIA		4.264.768,81	11.540.825,70	0,31
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		7.229.148,51	17.128.024,67	0,46
. BBM SMID CAPS FICFIA		1.934.321,29	12.504.749,76	0,34
. IBIUNA EQ. FIC FIA		40.164,86	14.382.315,80	0,39
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		27.930,50	5.503.744,84	0,15
. MOAT CAPITAL FIA		5.134.370,55	15.352.591,49	0,41
. SPX APACHE FIA		6.450.013,78	20.201.512,81	0,55
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		<u>58.956.745</u>	<u>164.845.174,99</u>	<u>4,45</u>
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP		10.858,75	-242.474,22	-0,01
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.660,33	2.196.089,98	0,06
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.676,93	4.577.023,77	0,12
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.508,03	5.811.425,05	0,16
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		5.000,00	3.724.824,37	0,10
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		9.229.551,01	1.203.656,57	0,03
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.907.807,84	2.239.643,73	0,06
. HAMILTON LANE FIC FIP		21.069,97	16.880.456,71	0,46
. MULTINER FIP		10,17	-10.378,12	0,00
. STRATUS SCP BR FIP		10.000.000,00	8.732.420,00	0,24
. P2BR INFR III FIQFIP		11.430,72	8.926.577,50	0,24
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	364.771,90	0,01
. CLARITAS LONG SHORT		595.945,95	8.368.457,30	0,23
. GIANT ZARATHUSTRA II		12.290.755,78	24.372.521,03	0,66
. IBIUNA LONG SHORT		89.535,58	29.535.939,21	0,80
. NEO PROVECTUS I		14.166.322,01	26.935.807,84	0,73
. ITAU HEDGE PLUS MULTIMERCADO FIC DE FI		608.612,32	21.228.412,37	0,57
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		<u>70.000.000</u>	<u>62.406.402,10</u>	<u>1,69</u>
. SCHRODER PLAN II FIM		70.000.000	62.406.402,10	1,69
E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			<u>84.074.343,55</u>	<u>2,27</u>
E1 - Investimentos em Shopping Center			<u>60.024.543,55</u>	<u>1,62</u>
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			34.481.019,48	0,93
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			25.504.313,06	0,69
. VALORES A RECEBER			39.211,01	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>2.987</u>	<u>59.897.044,36</u>	<u>1,62</u>
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		2.987	59.451.613,86	1,61
. VALORES A PAGAR (-)			-56.128,16	0,00
. VALORES A RECEBER			501.558,66	0,01
G - OUTROS			<u>151.940.107,59</u>	<u>4,11</u>
. DISPONIVEL			2.031.001,90	0,05
. DEPOSITOS JUDICIAIS			2.329.097,38	0,06
. OUTROS REALIZAVEIS			160.283.710,49	4,33
. OUTROS DIREITOS A RECEBER			151.738.638,93	4,10
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-5.541.357,44	-0,15
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-158.900.983,67	-4,29

**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			81.401,79	0,01%	0,00%
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP			111.190.757,30	9,36%	3,00%
- VELT INST FICFIA			11.540.825,70	0,97%	0,31%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA			17.128.024,67	1,44%	0,46%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA			5.503.744,84	0,46%	0,15%
- MOAT CAPITAL FIA			15.352.591,49	1,29%	0,41%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP			2.539.777,17	0,21%	0,07%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II			37.479.481,44	3,16%	1,01%
- SPX APACHE FIA			20.201.512,81	1,70%	0,55%
- IBIUNA EQ. FIC FIA			14.382.315,80	1,21%	0,39%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER			27.905,05	0,00%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II			141.511,83	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III			14.996,24	0,00%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.			839.525,21	0,07%	0,02%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL			17.845.659,15	1,50%	0,48%
- SANT CENTRUM FICFIRF			17.631,62	0,00%	0,00%
- BRADESCO DED. SAUDE ANS			26.790.291,08	2,26%	0,72%
- BBM SMID CAPS FICFIA			12.504.749,76	1,05%	0,34%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM			56.494.385,89	4,76%	1,53%
- VINCI VALOREM FIM			52.528.835,75	4,42%	1,42%
- BRAD RF DI FED EXTRA			438.015.441,36	36,87%	11,83%
- BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO			48.648.457,80	4,10%	1,31%
- ARX METRUS 2			71.412.669,72	6,01%	1,93%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP			(242.474,22)	-0,02%	-0,01%
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP			2.196.089,98	0,18%	0,06%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			4.577.023,77	0,39%	0,12%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP			5.811.425,05	0,49%	0,16%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA			3.724.824,37	0,31%	0,10%
- INDUSTRIAL PARKS BRASIL FIP MULTIESTRATÉGIA			1.203.656,57	0,10%	0,03%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			2.239.643,73	0,19%	0,06%
- HAMILTON LANE FIC FIP			16.880.456,71	1,42%	0,46%
- MULTINER FIP			-10.378,12	0,00%	0,00%
- STRATUS SCP BR FIP			8.732.420,00	0,74%	0,24%
- P2BR INFR III FIQFIP			8.926.577,50	0,75%	0,24%
- COPA FLORESTAL III			364.771,90	0,03%	0,01%
- CLARITAS LONG SHORT			8.368.457,30	0,70%	0,23%
- GIANT ZARATHUSTRA II			24.372.521,03	2,05%	0,66%
- IBIUNA LONG SHORT			29.535.939,21	2,49%	0,80%
- NEO PROVECTUS I			26.935.807,84	2,27%	0,73%
- ITAU HEDGE PLUS MULTIMERCADO FIC DE FI			21.228.412,37	1,79%	0,57%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- SCHRODER PLAN II FIM			62.406.402,10	5,25%	1,69%
TOTAL			1.187.934.070,52	100,00%	32,10%

GESTÃO PRÓPRIA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENDA FIXA			2.217.224.309,28	88,22%	59,91%
RENDA VARIÁVEL			107.105,70	0,00%	0,00%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			84.074.343,55	3,35%	2,27%
EMPRESTIMO PESSOAL			59.897.044,36	2,38%	1,62%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)			151.940.107,59	6,05%	4,11%
TOTAL			2.513.242.910,48	100,00%	67,90%