

**RESUMO DOS INVESTIMENTOS
PREVIDENCIAL**

PLANO II

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 29.02.2024

| DISCRIMINAÇÃO | ESPÉCIE TIPO | QUANTIDADE | VALOR EM R\$ | ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%) | DIVERSIFICAÇÃO (%) |
|--|--------------|----------------------|-------------------------|---------------------------|--------------------|
| INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO | | | 1.981.362.333,11 | | |
| A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA | | | 1.491.056.305,66 | 75,25 | |
| TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOURO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOURO NACIONAL | | | | | |
| <u>Títulos Públicos</u> | | <u>197.631</u> | <u>831.908.456,18</u> | <u>41,99</u> | |
| . VALORES A PAGAR | | | -1.887.864,06 | | |
| <u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u> | | | <u>642.010.220,82</u> | <u>32,40</u> | |
| <u>Certificado de Depósito Bancário</u> | | <u>0,00</u> | <u>0,00</u> | <u>0,00</u> | |
| . CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL | PÓS | 1 | 8.852.570,64 | 0,45 | 0,45 |
| . PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS | | | | | |
| . BANCO CRUZEIRO DO SUL | | -1 | -8.852.570,64 | -0,45 | -0,45 |
| <u>Letra Financeira Subordinada</u> | | <u>3.183</u> | <u>286.196.907,69</u> | <u>14,44</u> | |
| . BRADESCO | | 1.433 | 98.834.901,67 | 4,99 | 4,99 |
| . DAYCOVAL | | 500 | 31.967.519,34 | 1,61 | 1,61 |
| . SAFRA | | 90 | 55.044.781,47 | 2,78 | 2,78 |
| . PARANÁ BANCO | | 250 | 33.993.494,77 | 1,72 | 1,72 |
| . ABC | | 410 | 36.552.442,82 | 1,84 | 1,84 |
| . BANCO BTG PACTUAL | | 500 | 29.803.767,62 | 1,50 | 1,50 |
| <u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u> | | <u>99.438.670,61</u> | <u>355.813.313,13</u> | <u>17,96</u> | |
| . VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II | | 200.000,05 | 24.519.553,74 | 1,24 | 1,24 |
| . KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM | | 30.680.789,24 | 56.003.076,79 | 2,83 | 2,83 |
| . FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER | | 2.474,99 | 19.631,70 | 0,00 | 0,00 |
| . FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II | | 3.000,00 | 27.709,96 | 0,00 | 0,00 |
| . FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III | | 1.976,00 | 10.218,09 | 0,00 | 0,00 |
| . FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF. | | 19,52 | 421.503,40 | 0,02 | 0,02 |
| . FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL | | 8.405,53 | 11.796.283,07 | 0,60 | 0,60 |
| . BRAD RF DI FED EXTRA | | 7.467.613,26 | 121.511.399,75 | 6,13 | 6,13 |
| . BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO | | 2.331.237,14 | 13.485.306,57 | 0,68 | 0,68 |
| . VINCI VALOREM FIM | | 182.178,14 | 53.604.141,07 | 2,71 | 2,71 |
| . ARX METRUS 2 | | 58.560.976,73 | 74.414.488,99 | 3,76 | 3,76 |
| <u>Debêntures</u> | | <u>19.644</u> | <u>17.137.628,66</u> | <u>0,86</u> | |
| . CEMIG | | 10.000 | 4.708.021,24 | 0,24 | 0,24 |
| . ROTA DAS BANDEIRAS | | 8.792 | 11.838.550,61 | 0,60 | 0,60 |
| . SABESP | | 852 | 591.056,81 | 0,03 | 0,03 |
| B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL | | | 105.131.898,45 | 5,31 | |
| <u>B1. Mercado de Ações</u> | | | <u>33.970,08</u> | <u>0,00</u> | |
| <u>Companhias Abertas</u> | | <u>0</u> | <u>0,00</u> | <u>0,00</u> | |
| . DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER (inst. Fin. + Companhia Aberta) | | | 33.970,08 | 0,00 | |
| <u>B2. Fundos</u> | | <u>25.080.718,29</u> | <u>105.097.928,37</u> | <u>5,30</u> | |
| . VELT INST FICFIA | | 4.264.768,81 | 11.974.571,37 | 0,60 | |
| . CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA | | 7.229.148,51 | 18.260.431,82 | 0,92 | |
| . MOAT CAPITAL FIA | | 5.134.370,55 | 16.736.869,13 | 0,84 | |
| . SPX APACHE FIA | | 6.450.013,78 | 22.100.709,69 | 1,12 | |
| . BBM SMID CAPS FICFIA | | 1.934.321,29 | 13.923.684,10 | 0,70 | |
| . IBIUNA EQ. FIC FIA | | 40.164,86 | 15.985.635,88 | 0,81 | |
| . IBIUNA EQ. 30 FIC FIA | | 27.930,50 | 6.116.026,38 | 0,31 | |

**RESUMO DOS INVESTIMENTOS
PREVIDENCIAL**

PLANO II

| C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS | 54.416.788,60 | 176.337.932,11 | 8,90 | |
|--|-------------------|----------------------|---|---|
| . INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II- FIP | 10.858,75 | -408.822,02 | -0,02 | |
| . FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES | 395,93 | 1.234.313,52 | 0,06 | |
| . P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP | 9.508,03 | 5.770.506,31 | 0,29 | |
| . FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVPE PLAZA | 2.000,00 | 1.439.909,21 | 0,07 | |
| . INDUSTRIAL PARKS BRASIL FIP MULTISTRATÉGIA | 2.768.765,30 | 360.168,24 | 0,02 | |
| . FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE | 763.123,24 | 1.063.704,39 | 0,05 | |
| . HAMILTON LANE FIC FIP | 7.163,79 | 5.114.043,16 | 0,26 | |
| . STRATUS SCP BR FIP | 5.000.000,00 | 4.053.255,00 | 0,20 | |
| . P2 BR INFRAESTRUTURA III FIC DE FIP | 3.811,41 | 2.825.189,81 | 0,14 | |
| . COPA FLORESTAL III | 10.000.000,00 | 453.252,70 | 0,02 | |
| . CLARITAS LONG SHORT | 1.594.954,54 | 23.883.292,23 | 1,21 | |
| . GIANT ZARATHUSTRA II | 18.647.083,20 | 37.242.229,24 | 1,88 | |
| . IBIUNA LONG SHORT | 89.535,58 | 30.853.461,43 | 1,56 | |
| . NEO PROVECTUS I | 14.813.598,05 | 29.476.506,26 | 1,49 | |
| . ITAU HEDGE PLUS MULTIMERCADO FIC DE FI | 596.036,61 | 20.919.914,14 | 1,06 | |
| . IBIUNA LS FP FICM | 109.954,17 | 12.057.008,49 | 0,61 | |
| D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR | 70.000.000 | 66.879.583,40 | 3,38 | |
| . SCHRODER PLAN II FIM | 70.000.000,00 | 66.879.583,40 | 3,38 | |
| E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS | | 30.861.984,73 | 1,56 | |
| E1 - Investimentos em Shopping Center | | 30.861.984,73 | 1,56 | |
| . SHOPPING METRÔ ITAQUERA | | 30.819.627,94 | 1,56 | |
| . VALORES A RECEBER | | 42.356,79 | 0,00 | |
| F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES | 2.111 | 46.721.729,26 | 2,36 | |
| . OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES | 2.111 | 45.627.406,45 | 2,30 | |
| . VALORES A PAGAR (-) | | -34.642,33 | 0,00 | |
| . VALORES A RECEBER | | 1.128.965,14 | 0,06 | |
| G - OUTROS | | 64.372.899,50 | 3,25 | |
| . DISPONIVEL | | 2.679.426,59 | 0,14 | |
| . DEPOSITOS JUDICIAIS | | 0,00 | 0,00 | |
| . OUTROS REALIZAVEIS | | 72.228.216,79 | 3,65 | |
| . OUTROS DIREITOS A RECEBER | | 62.493.166,61 | 3,15 | |
| . OUTRAS EXIGIBILIDADES | | -798.679,89 | -0,04 | |
| . EXIGIVEL CONTINGENCIAL | | -72.229.230,60 | -3,65 | |
| GESTÃO TERCEIRIZADA | | DISTRIBUIÇÃO | % EM RELAÇÃO À GESTÃO TERCEIRIZADA | % EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES |
| FUNDOS | | | | |
| - VOLT INST FICFIA | | 11.974.571,37 | 1,70% | 0,60% |
| - CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA | | 18.260.431,82 | 2,59% | 0,92% |
| - IBIUNA EQ. 30 FIC FIA | | 6.116.026,38 | 0,87% | 0,31% |
| - MOAT CAPITAL FIA | | 16.736.869,13 | 2,38% | 0,84% |
| - BBM SMID CAPS FICFIA | | 13.923.684,10 | 1,98% | 0,70% |
| - VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP | | - | 0,00% | 0,00% |
| - VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II | | 24.519.553,74 | 3,48% | 1,24% |
| - IBIUNA EQ. FIC FIA | | 15.985.635,88 | 2,27% | 0,81% |
| - FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER | | 19.631,70 | 0,00% | 0,00% |
| - FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II | | 27.709,96 | 0,00% | 0,00% |
| - FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III | | 10.218,09 | 0,00% | 0,00% |
| - SPX APACHE FIA | | 22.100.709,69 | 3,14% | 1,12% |
| - FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF. | | 421.503,40 | 0,06% | 0,02% |
| - FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL | | 11.796.283,07 | 1,68% | 0,60% |
| - KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM | | 56.003.076,79 | 7,95% | 2,83% |
| - BRAD RF DI FED EXTRA | | 121.511.399,75 | 17,26% | 6,13% |
| - BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO | | 13.485.306,57 | 1,92% | 0,68% |
| - VINCI VALOREM FIM | | 53.604.141,07 | 7,61% | 2,71% |
| - ARX METRUS 2 | | 74.414.488,99 | 10,57% | 3,76% |

**RESUMO DOS INVESTIMENTOS
PREVIDENCIAL**

PLANO II

| INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS | | | | |
|---|--|-----------------------|----------------|---------------|
| - INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP | | (408.822,02) | -0,06% | -0,02% |
| - FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES | | 1.234.313,52 | 0,18% | 0,06% |
| - P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP | | 5.770.506,31 | 0,82% | 0,29% |
| - FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA | | 1.439.909,21 | 0,20% | 0,07% |
| - INDUSTRIAL PARKS BRASIL FIP MULTISTRATÉGIA | | 360.168,24 | 0,05% | 0,02% |
| - FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE | | 1.063.704,39 | 0,15% | 0,05% |
| - HAMILTON LANE FIC FIP | | 5.114.043,16 | 0,73% | 0,26% |
| - STRATUS SCP BR FIP | | 4.053.255,00 | 0,58% | 0,20% |
| - P2BR INFR III FIQFIP | | 2.825.189,81 | 0,40% | 0,14% |
| - COPA FLORESTAL III | | 453.252,70 | 0,06% | 0,02% |
| - CLARITAS LONG SHORT | | 23.883.292,23 | 3,39% | 1,21% |
| - GIANT ZARATHUSTRA II | | 37.242.229,24 | 5,29% | 1,88% |
| - IBIUNA LONG SHORT | | 30.853.461,43 | 4,38% | 1,56% |
| - NEO PROVECTUS I | | 29.476.506,26 | 4,19% | 1,49% |
| - ITAU HEDGE PLUS MULTIMERCADO FIC DE FI | | 20.919.914,14 | 2,97% | 1,06% |
| - IBIUNA LS FP FICM | | 12.057.008,49 | 1,71% | 0,61% |
| INVESTIMENTOS NO EXTERIOR | | | | |
| - SCHRODER PLAN II FIM | | 66.879.583,40 | 9,50% | 3,38% |
| TOTAL | | 704.128.757,01 | 100,00% | 35,54% |

| GESTÃO PRÓPRIA | DISTRIBUIÇÃO | % EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA | % EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES |
|--|-------------------------|--|---|
| RENDA FIXA | 1.135.242.992,53 | 88,88% | 57,30% |
| RENDA VARIÁVEL | 33.970,08 | 0,00% | 0,00% |
| INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS | 30.861.984,73 | 2,42% | 1,56% |
| EMPRÉSTIMO PESSOAL | 46.721.729,26 | 3,66% | 2,36% |
| OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis) | 64.372.899,50 | 5,04% | 3,25% |
| TOTAL | 1.277.233.576,10 | 100,00% | 64,46% |