

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.12.2020

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.483.370.387,07		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			875.172.627,08	59,00	
TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOIRO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOIRO NACIONAL					
<u>Nota do Tesouro Nacional</u>		159.578	550.133.255,65	37,09	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			295.386.482,12	19,91	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		1.500,00	3.455.013,87	0,23	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	1	13.141.991,09	0,89	0,89
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	1	3.403.988,49	0,23	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	1	2.047.692,08	0,14	0,37
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	1.500	3.455.013,87	0,23	0,23
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-1	-13.141.991,09	-0,89	-0,89
- BANCO MORADA		-2	-5.451.680,57	-0,37	-0,37
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		531	117.928.856,54	7,95	
. BRADESCO		71	26.223.675,39	1,77	
. SAFRA		90	37.471.643,08	2,53	
. PARANÁ BANCO		260,00	25.376.551,30	1,71	
. ABC		110,00	28.856.986,77	1,95	
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		38.050.117,42	174.002.611,71	11,73	
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		30.166,67	3.038.746,82	0,20	0,20
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		76.402,72	8.305.817,94	0,56	0,56
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		30.800.317,47	42.368.202,46	2,86	2,86
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		2.474,99	30.674,17	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		3.000,00	13.234,77	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		1.976,00	16.036,02	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		19,52	688.648,62	0,05	0,05
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		8.405,53	11.749.188,06	0,79	0,79
. BRAD RF DI FED EXTRA		4.613.939,24	56.012.804,83	3,78	3,78
. BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO		2.331.237,14	10.037.388,31	0,68	0,68
. VINCI VALOREM FIM		182.178,14	41.741.869,71	2,81	2,81
. VALORES A RECEBER				0,00	0,00
<u>Debêntures</u>		19.782	29.652.889,31	2,00	
. CEMIG		10.000	15.863.736,78	1,07	1,07
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	10.603.867,77	0,71	0,71
. SABESP		990	3.185.284,76	0,21	0,21
. VALORES A RECEBER			3.127.765,40	0,21	
. COMANCHE PART.			3.127.765,40	0,21	0,21
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		0,00	-3.127.765,40	-0,21	
. COMANCHE PART.			-3.127.765,40	-0,21	-0,21
B - INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			244.878.210,57	16,51	
<u>B1. Mercado de Ações</u>			59.959.550,47	4,04	
<u>Companhias Abertas</u>		1.405.529	49.077.138,18	3,31	
. AMBEV	ON	87.539	1.369.985,35	0,09	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	64.254	1.416.158,16	0,10	
. COSAN	ON	48.600	3.680.478,00	0,25	
. ECORODOVIAS	ON	109.500	1.464.015,00	0,10	
. GERDAU - GGBR	PN	96.424	2.357.566,80	0,16	
. ITAUSA	ON	216	2.665,44	0,00	
. ITAUSA	PN	360.800	4.232.184,00	0,29	
. LOGG COMERCIAL	ON	5.656	193.491,76	0,01	

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

. MRVE	ON	78.400	1.485.680,00	0,10
. PÃO DE AÇUCAR	PN	42.600	3.197.130,00	0,22
. PETROBRÁS	PN	183.377	5.196.904,18	0,35
. RENT	ON	136.467	9.409.399,65	0,63
. SUZANO PAPEL	PNA	62.200	3.641.188,00	0,25
. VALE R. DOCE	PNA	129.496	11.324.425,20	0,76
. VALORES A RECEBER				0,00
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			105.866,64	0,01
Instituições Financeiras		366.759	10.882.412,29	0,73
. BRADESCO	PN	180.698	4.904.143,72	0,33
. ITAU	PN	186.061	5.885.109,43	0,40
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			93.159,14	0,01
B2. Fundos		39.225.067,92	184.918.660,10	12,47
. M. SQUARE INST. FIC FIA		6.293.092,63	25.375.463,84	1,71
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		11.421.519,84	39.792.542,90	2,68
. MOAT CAPITAL FIA		8.220.647,61	34.500.262,63	2,33
. SPX APACHE FIA		10.085.636,57	27.691.994,17	1,87
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.096.544,16	28.733.028,05	1,94
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	20.662.254,50	1,39
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		44.894,19	8.163.114,01	0,55
C - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		63.662.325,14	140.561.433,46	9,48
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II- FIP		10.858,75	-89.612,98	-0,01
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		395,93	6.284.100,83	0,42
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.269,00	10.604.787,73	0,71
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		2.000,00	1.993.633,81	0,13
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		2.768.765,30	2.017.712,32	0,14
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		750.401,73	807.279,53	0,05
. HAMILTON LANE FIC FIP		7.104,85	10.637.540,06	0,72
. STRATUS SCP BR FIP		5.000.000,00	8.120.660,00	0,55
. P2 BR INFRAESTRUTURA III FIC DE FIP		3.433,17	5.870.129,00	0,40
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	7.672.973,70	0,52
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		5.509.985,26	12.185.409,00	0,82
. KINEA CHRONOS FIM		11.925.565,78	21.870.377,37	1,47
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		9.523.673,63	16.704.989,73	1,13
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		18.077.115,65	20.714.391,47	1,40
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		73.756,10	15.167.061,93	1,02
D - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		12.671.023	61.237.179,20	4,13
. BB MM SCH INV EXTE FI		5.128.757,86	22.705.119,18	1,53
. VOT ALLIANZGI FIM		3.790.730,70	14.124.205,34	0,95
. WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI		3.465,71	6.210.594,30	0,42
. GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE		46.431,13	6.183.403,22	0,42
. PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR		3.701.637,15	6.332.416,66	0,43
. VALORES A RECEBER			5.681.440,50	0,38
E - INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			29.334.016,85	1,98
E1 - Investimentos em Shopping Center			21.222.898,49	1,43
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			21.157.104,94	1,43
. VALORES A RECEBER			65.793,55	0,00
E3 - Investimento Fundo Imobiliário		13.543,78	5.148.869,51	0,35
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		13.230,00	1.174.030,20	0,08
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		313,78	3.968.236,37	0,27
. VALORES A RECEBER			6.602,94	0,00
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00
E3 - Outros Investimentos Imobiliário		18,00	2.962.248,85	0,20
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		18	2.962.248,85	0,20
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		2.441	54.337.810,78	3,66
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		2.441	52.120.618,75	3,51
. VALORES A PAGAR (-)			-946,01	0,00
. VALORES A RECEBER			2.218.138,04	0,15

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

G - OUTROS			77.849.109,13	5,25	
. DISPONIVEL			214.515,77	0,01	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			0,00	0,00	
. OUTROS REALIZAVEIS			72.229.230,60	4,87	
. OUTROS DIREITOS A RECEBER			78.262.683,49	5,28	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-614.000,60	-0,04	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-72.243.320,13	-4,87	
GESTÃO TERCEIRIZADA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO TERCEIRIZADA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS					
- M. SQUARE INST. FIC FIA			25.375.463,84	4,53%	1,71%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA			39.792.542,90	7,10%	2,68%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA			8.163.114,01	1,46%	0,55%
- MOAT CAPITAL FIA			34.500.262,63	6,16%	2,33%
- BBM SMID CAPS FICFIA			28.733.028,05	5,13%	1,94%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP			3.038.746,82	0,54%	0,20%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II			8.305.817,94	1,48%	0,56%
- IBIUNA EQ. FIC FIA			20.662.254,50	3,69%	1,39%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER			30.674,17	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II			13.234,77	0,00%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III			16.036,02	0,00%	0,00%
- SPX APACHE FIA			27.691.994,17	4,94%	1,87%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.			688.648,62	0,12%	0,05%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL			11.749.188,06	2,10%	0,79%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM			42.368.202,46	7,56%	2,86%
- BRAD RF DI FED EXTRA			56.012.804,83	10,00%	3,78%
- BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO			10.037.388,31	1,79%	0,68%
- VINCI VALOREM FIM			41.741.869,71	7,45%	2,81%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP			(89.612,98)	-0,02%	-0,01%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			6.284.100,83	1,12%	0,42%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP			10.604.787,73	1,89%	0,71%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVPE PLAZA			1.993.633,81	0,36%	0,13%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES			2.017.712,32	0,36%	0,14%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			807.279,53	0,14%	0,05%
- HAMILTON LANE FIC FIP			10.637.540,06	1,90%	0,72%
- STRATUS SCP BR FIP			8.120.660,00	1,45%	0,55%
- P2BR INFR III FIQFIP			5.870.129,00	1,05%	0,40%
- COPA FLORESTAL III			7.672.973,70	1,37%	0,52%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			12.185.409,00	2,18%	0,82%
- KINEA CHRONOS FIM			21.870.377,37	3,90%	1,47%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM			16.704.989,73	2,98%	1,13%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM			20.714.391,47	3,70%	1,40%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM			15.167.061,93	2,71%	1,02%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			3.968.236,37	0,71%	0,27%
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO			1.180.633,14	0,21%	0,08%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- BB MM SCH INV EXTE FI			22.705.119,18	4,05%	1,53%
- VOT ALLIANZGI FIM			14.124.205,34	2,52%	0,95%
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI			6.210.594,30	1,11%	0,42%
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE			6.183.403,22	1,10%	0,42%
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR			6.332.416,66	1,13%	0,43%
TOTAL			560.187.313,48	100,00%	37,76%
GESTÃO PRÓPRIA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENDA FIXA			701.170.015,37	76,42%	47,27%
RENDA VARIÁVEL			59.959.550,47	6,53%	4,04%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			24.185.147,34	2,64%	1,63%
EMPRÉSTIMO PESSOAL			54.337.810,78	5,92%	3,66%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)			77.849.109,13	8,48%	5,25%
TOTAL			917.501.633,09	100,00%	61,85%