

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 26.02.2021

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.486.865.347,91		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			883.182.908,83	59,40	
<u>TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOURO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOURO NACIONAL</u>					
<u>Nota do Tesouro Nacional</u>		159.578	550.369.537,45	37,02	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			304.742.832,83	20,50	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		1.500,00	3.535.761,69	0,24	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	1	13.141.991,09	0,88	0,88
. 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	3.535.761,69	0,24	0,24
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-1	-13.141.991,09	-0,88	-0,88
- BANCO MORADA		-2	-5.451.680,57	-0,37	-0,37
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		831	116.702.983,20	7,85	
. BRADESCO		71	27.043.752,18	1,82	
. SAFRA		90	38.307.755,12	2,58	
. PARANÁ BANCO		260,00	23.580.026,02	1,59	
. ABC		410,00	27.771.449,88	1,87	
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		38.840.060,69	184.504.087,94	12,41	
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		30.166,67	2.888.489,37	0,19	0,19
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		76.402,72	8.225.477,35	0,55	0,55
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		30.680.789,24	42.194.501,87	2,84	2,84
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		2.474,99	28.245,35	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		3.000,00	11.306,55	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		1.976,00	17.582,36	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		19,52	707.575,87	0,05	0,05
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		8.405,53	11.492.406,68	0,77	0,77
. BRAD RF DI FED EXTRA		5.523.410,73	67.213.480,50	4,52	4,52
. BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO		2.331.237,14	10.060.653,29	0,68	0,68
. VINCI VALOREM FIM		182.178,14	41.664.368,75	2,80	2,80
. VALORES A RECEBER				0,00	0,00
<u>Debêntures</u>		19.782	28.070.538,55	1,89	
. CEMIG		10.000	15.402.836,88	1,04	1,04
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	10.284.530,02	0,69	0,69
. SABESP		990	2.383.171,65	0,16	0,16
. 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			233.732.703,56	15,72	
<u>B1. Mercado de Ações</u>			56.750.473,78	3,82	
<u>Companhias Abertas</u>		1.405.529	47.687.248,18	3,21	
. AMBEV	ON	87.539	1.227.296,78	0,08	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	64.254	1.390.456,56	0,09	
. COSAN	ON	48.600	3.956.040,00	0,27	
. ECORODOVIAS	ON	109.500	1.207.785,00	0,08	
. GERDAU - GGBR	PN	96.424	2.494.488,88	0,17	
. ITAUSA	ON	216	2.345,76	0,00	
. ITAUSA	PN	360.800	3.589.960,00	0,24	
. LOGG COMERCIAL	ON	5.656	179.860,80	0,01	
. MRVE	ON	78.400	1.318.688,00	0,09	

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

. PÃO DE AÇUCAR	PN	42.600	3.535.800,00	0,24
. PETROBRÁS	PN	183.377	4.078.304,48	0,27
. RENT	ON	136.467	7.915.086,00	0,53
. SUZANO PAPEL	PNA	62.200	4.551.174,00	0,31
. VALE R. DOCE	PNA	129.496	12.239.961,92	0,82
Instituições Financeiras		366.759	8.909.912,55	0,60
. BRADESCO	PN	180.698	4.156.054,00	0,28
. ITAU	PN	186.061	4.753.858,55	0,32
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER (inst. Fin. + Companhia Aberta)			153.313,05	0,01
B2. Fundos		39.225.067,92	176.982.229,78	11,90
. VELT INST FICFIA		6.293.092,63	24.972.701,63	1,68
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		11.421.519,84	39.756.521,71	2,67
. MOAT CAPITAL FIA		8.220.647,61	30.413.595,38	2,05
. SPX APACHE FIA		10.085.636,57	26.950.244,01	1,81
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.096.544,16	28.190.062,66	1,90
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	19.137.045,58	1,29
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		44.894,19	7.562.058,81	0,51
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		63.675.303,59	141.062.325,47	9,49
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II- FIP		10.858,75	-106.442,20	-0,01
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		395,93	6.448.005,75	0,43
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.354,00	10.412.347,84	0,70
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		2.000,00	1.804.742,72	0,12
. INDUSTRIAL PARKS BRASIL FIP MULTISTRATÉGIA		2.768.765,30	2.301.944,99	0,15
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		763.123,24	1.134.798,98	0,08
. HAMILTON LANE FIC FIP		7.163,79	10.597.815,17	0,71
.STRATUS SCP BR FIP		5.000.000,00	8.105.055,00	0,55
. P2 BR INFRAESTRUTURA III FIC DE FIP		3.546,17	6.065.954,83	0,41
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	7.449.953,80	0,50
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		5.509.985,26	12.194.455,29	0,82
. KINEA CHRONOS FIM		11.925.565,78	21.983.432,93	1,48
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		9.523.673,63	17.494.245,44	1,18
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		18.077.115,65	20.729.241,82	1,39
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		73.756,10	14.446.773,15	0,97
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		70.000.000	73.027.758,30	4,91
. SCHRODER PLAN II FIM		70.000.000,00	73.027.758,30	4,91
E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			26.459.085,56	1,78
E1 - Investimentos em Shopping Center			21.003.184,06	1,41
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			20.998.624,77	1,41
. VALORES A RECEBER			4.559,29	0,00
E3 - Investimento Fundo Imobiliário		313,78	3.969.741,57	0,27
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		313,78	3.969.741,57	0,27
. VALORES A RECEBER				0,00
. VALORES A PAGAR				0,00
E3 - Outros Investimentos Imobiliário		18,00	1.486.159,93	0,10
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		18	1.486.159,93	0,10
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		2.392	50.296.537,66	3,38
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		2.392	50.726.058,13	3,41
. VALORES A PAGAR (-)			-17.005,85	0,00
. VALORES A RECEBER			-412.514,62	-0,03
G - OUTROS			79.104.028,53	5,32
. DISPONIVEL			71.063,90	0,00
. DEPOSITOS JUDICIAIS			0,00	0,00
. OUTROS REALIZAVEIS			72.229.230,60	4,86
. OUTROS DIREITOS A RECEBER			80.251.948,08	5,40
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-1.204.464,67	-0,08
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-72.243.749,38	-4,86

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

GESTÃO TERCEIRIZADA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO TERCEIRIZADA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS					
- VOLT INST FICFIA			24.972.701,63	4,31%	1,68%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA			39.756.521,71	6,86%	2,67%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA			7.562.058,81	1,30%	0,51%
- MOAT CAPITAL FIA			30.413.595,38	5,25%	2,05%
- BBM SMID CAPS FICFIA			28.190.062,66	4,86%	1,90%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP			2.888.489,37	0,50%	0,19%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II			8.225.477,35	1,42%	0,55%
- IBIUNA EQ. FIC FIA			19.137.045,58	3,30%	1,29%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER			28.245,35	0,00%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II			11.306,55	0,00%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III			17.582,36	0,00%	0,00%
- SPX APACHE FIA			26.950.244,01	4,65%	1,81%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.			707.575,87	0,12%	0,05%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL			11.492.406,68	1,98%	0,77%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM			42.194.501,87	7,28%	2,84%
- BRAD RF DI FED EXTRA			67.213.480,50	11,60%	4,52%
- BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO			10.060.653,29	1,74%	0,68%
- VINCI VALOREM FIM			41.664.368,75	7,19%	2,80%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP			(106.442,20)	-0,02%	-0,01%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			6.448.005,75	1,11%	0,43%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP			10.412.347,84	1,80%	0,70%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA			1.804.742,72	0,31%	0,12%
- INDUSTRIAL PARKS BRASIL FIP MULTISTRATÉGIA			2.301.944,99	0,40%	0,15%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			1.134.798,98	0,20%	0,08%
- HAMILTON LANE FIC FIP			10.597.815,17	1,83%	0,71%
- STRATUS SCP BR FIP			8.105.055,00	1,40%	0,55%
- P2BR INFR III FIQFIP			6.065.954,83	1,05%	0,41%
- COPA FLORESTAL III			7.449.953,80	1,29%	0,50%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			12.194.455,29	2,10%	0,82%
- KINEA CHRONOS FIM			21.983.432,93	3,79%	1,48%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM			17.494.245,44	3,02%	1,18%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM			20.729.241,82	3,58%	1,39%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM			14.446.773,15	2,49%	0,97%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			3.969.741,57	0,68%	0,27%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- SCHRODER PLAN II FIM			73.027.758,30	12,60%	4,91%
TOTAL			579.546.143,06	100,00%	38,98%

GESTÃO PRÓPRIA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENDA FIXA			698.678.820,89	77,00%	46,99%
RENDA VARIÁVEL			56.750.473,78	6,25%	3,82%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			22.489.343,99	2,48%	1,51%
EMPRÉSTIMO PESSOAL			50.296.537,66	5,54%	3,38%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)			79.104.028,53	8,72%	5,32%
TOTAL			907.319.204,85	100,00%	61,02%