

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 30.07.2021

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.564.073.761,45		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			951.002.496,61	60,80	
TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOIRO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOIRO NACIONAL					
Nota do Tesouro Nacional		157.028	568.952.900,65	36,38	
APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS			352.623.886,76	22,55	
Certificado de Depósito Bancário		0,00	0,00	0,00	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	1	13.141.991,09	0,84	0,84
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	1	3.403.988,49	0,22	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	1	2.047.692,08	0,13	0,35
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-1	-13.141.991,09	-0,84	-0,84
- BANCO MORADA		-2	-5.451.680,57	-0,35	-0,35
Letra Financeira Subordinada		1.708	160.434.506,03	10,26	
. BRADESCO		458	41.496.109,72	2,65	
. DAYCOVAL		500	25.227.001,78	1,61	
. SAFRA		90	40.620.423,23	2,60	
. PARANÁ BANCO		250,00	25.008.153,47	1,60	
. ABC		410,00	28.082.817,83	1,80	
Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.		39.027.426,43	192.189.380,73	12,29	
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		30.166,67	2.817.705,11	0,18	0,18
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		106.364,55	11.451.150,08	0,73	0,73
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		30.680.789,24	42.594.302,93	2,72	2,72
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		2.474,99	23.138,71	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		3.000,00	7.768,35	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		1.976,00	15.051,28	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		19,52	753.637,19	0,05	0,05
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		8.405,53	11.843.117,47	0,76	0,76
. BRAD RF DI FED EXTRA		5.680.814,65	70.020.645,40	4,48	4,48
. BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO		2.331.237,14	10.187.560,50	0,65	0,65
. VINCI VALOREM FIM		182.178,14	42.475.303,71	2,72	2,72
. VALORES A RECEBER				0,00	0,00
Debêntures		19.782	29.425.709,20	1,88	
. CEMIG		10.000	16.317.038,06	1,04	1,04
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	10.574.110,84	0,68	0,68
. SABESP		990	2.534.560,30	0,16	0,16
. VALORES A RECEBER			3.127.765,40	0,20	
. COMANCHE PART.			3.127.765,40	0,20	0,20
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		0,00	-3.127.765,40	-0,20	
. COMANCHE PART.			-3.127.765,40	-0,20	-0,20
B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			252.727.995,66	16,16	
B1. Mercado de Ações			63.998.396,50	4,09	
Companhias Abertas		1.593.929	53.431.185,04	3,42	
. AMBEV	ON	87.539	1.456.648,96	0,09	
. ASSAI ATACADISTA	ON	42.600	3.692.568,00	0,24	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	64.254	1.646.187,48	0,11	
. COSAN	ON	194.400	4.966.920,00	0,32	
. ECORODOVIAS	ON	109.500	1.194.645,00	0,08	

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

. GERDAU - GGBR	PN	96.424	2.969.859,20	0,19
. ITAUSA	ON	216	2.464,56	0,00
. ITAUSA	PN	360.800	4.030.136,00	0,26
. LOGG COMERCIAL	ON	5.656	162.383,76	0,01
. MRVE	ON	78.400	1.124.256,00	0,07
. PÃO DE AÇUCAR	PN	42.600	1.321.878,00	0,08
. PETROBRÁS	PN	183.377	4.934.675,07	0,32
. RENT	ON	136.467	8.481.424,05	0,54
. SUZANO PAPEL	PNA	62.200	3.363.154,00	0,22
. VALE R. DOCE	PNA	129.496	14.083.984,96	0,90
<u>Instituições Financeiras</u>		<u>384.828</u>	<u>10.457.748,05</u>	<u>0,67</u>
. BRADESCO	PN	198.767	4.820.099,75	0,31
. ITAU	PN	186.061	5.637.648,30	0,36
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER (inst. Fin. + Companhia Aberta)			109.463,41	0,01
<u>B2. Fundos</u>		<u>39.225.067,92</u>	<u>188.729.599,16</u>	<u>12,07</u>
. VELT INST FICFIA		6.293.092,63	25.854.366,61	1,65
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		11.421.519,84	39.696.967,74	2,54
. MOAT CAPITAL FIA		8.220.647,61	31.876.079,01	2,04
. SPX APACHE FIA		10.085.636,57	30.443.826,82	1,95
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.096.544,16	29.479.566,76	1,88
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	22.495.406,04	1,44
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		44.894,19	8.883.386,18	0,57
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		<u>63.675.416,59</u>	<u>133.416.074,71</u>	<u>8,53</u>
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II- FIP		10.858,75	-143.208,82	-0,01
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		395,93	6.195.323,98	0,40
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.354,00	9.695.254,86	0,62
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		2.000,00	1.801.135,26	0,12
. INDUSTRIAL PARKS BRASIL FIP MULTIESTRATÉGIA		2.768.765,30	737.794,05	0,05
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		763.123,24	1.140.431,30	0,07
. HAMILTON LANE FIC FIP		7.163,79	9.007.844,53	0,58
.STRATUS SCP BR FIP		5.000.000,00	9.046.125,00	0,58
. P2 BR INFRAESTRUTURA III FIC DE FIP		3.659,17	6.685.227,97	0,43
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	1.023.567,30	0,07
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		5.509.985,26	12.398.852,61	0,79
. KINEA CHRONOS FIM		11.925.565,78	22.090.308,66	1,41
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		9.523.673,63	17.362.839,16	1,11
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		18.077.115,65	20.628.664,37	1,32
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		73.756,10	15.745.914,52	1,01
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		<u>70.000.000</u>	<u>72.889.534,20</u>	<u>4,66</u>
. SCHRODER PLAN II FIM		70.000.000,00	72.889.534,20	4,66
E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			<u>25.299.563,35</u>	<u>1,62</u>
<u>E1 - Investimentos em Shopping Center</u>			<u>20.666.694,70</u>	<u>1,32</u>
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			20.602.424,28	1,32
. VALORES A RECEBER			64.270,42	0,00
<u>E3 - Investimento Fundo Imobiliário</u>		<u>313,78</u>	<u>4.632.868,65</u>	<u>0,30</u>
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		313,78	4.632.868,65	0,30
. VALORES A RECEBER				<u>0,00</u>
. VALORES A PAGAR				<u>0,00</u>
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		<u>2.272</u>	<u>46.568.245,67</u>	<u>2,98</u>
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		2.272	47.206.731,58	3,02
. VALORES A PAGAR (-)			-13.376,83	0,00
. VALORES A RECEBER			-625.109,08	-0,04
G - OUTROS			<u>82.169.851,25</u>	<u>5,25</u>
. DISPONIVEL			222.112,46	0,01

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

. DEPOSITOS JUDICIAIS			0,00	0,00
. OUTROS REALIZAVEIS			72.229.230,60	4,62
. OUTROS DIREITOS A RECEBER			82.640.434,91	5,28
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-692.696,12	-0,04
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-72.229.230,60	-4,62

GESTÃO TERCEIRIZADA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO TERCEIRIZADA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS					
- VELT INST FICFIA			25.854.366,61	4,37%	1,65%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA			39.696.967,74	6,71%	2,54%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA			8.883.386,18	1,50%	0,57%
- MOAT CAPITAL FIA			31.876.079,01	5,39%	2,04%
- BBM SMID CAPS FICFIA			29.479.566,76	4,98%	1,88%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP			2.817.705,11	0,48%	0,18%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II			11.451.150,08	1,93%	0,73%
- IBIUNA EQ. FIC FIA			22.495.406,04	3,80%	1,44%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER			23.138,71	0,00%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II			7.768,35	0,00%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III			15.051,28	0,00%	0,00%
- SPX APACHE FIA			30.443.826,82	5,14%	1,95%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.			753.637,19	0,13%	0,05%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL			11.843.117,47	2,00%	0,76%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM			42.594.302,93	7,20%	2,72%
- BRAD RF DI FED EXTRA			70.020.645,40	11,83%	4,48%
- BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO			10.187.560,50	1,72%	0,65%
- VINCI VALOREM FIM			42.475.303,71	7,18%	2,72%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP			(143.208,82)	-0,02%	-0,01%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			6.195.323,98	1,05%	0,40%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP			9.695.254,86	1,64%	0,62%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA			1.801.135,26	0,30%	0,12%
- INDUSTRIAL PARKS BRASIL FIP MULTIESTRATÉGIA			737.794,05	0,12%	0,05%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			1.140.431,30	0,19%	0,07%
- HAMILTON LANE FIC FIP			9.007.844,53	1,52%	0,58%
- STRATUS SCP BR FIP			9.046.125,00	1,53%	0,58%
- P2BR INFR III FIQFIP			6.685.227,97	1,13%	0,43%
- COPA FLORESTAL III			1.023.567,30	0,17%	0,07%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			12.398.852,61	2,09%	0,79%
- KINEA CHRONOS FIM			22.090.308,66	3,73%	1,41%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM			17.362.839,16	2,93%	1,11%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM			20.628.664,37	3,49%	1,32%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM			15.745.914,52	2,66%	1,01%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			4.632.868,65	0,78%	0,30%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- SCHRODER PLAN II FIM			72.889.534,20	12,32%	4,66%
TOTAL			591.857.457,45	100,00%	37,84%

GESTÃO PRÓPRIA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENDA FIXA			758.813.115,88	78,05%	48,52%
RENDA VARIÁVEL			63.998.396,50	6,58%	4,09%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			20.666.694,70	2,13%	1,32%
EMPRÉSTIMO PESSOAL			46.568.245,67	4,79%	2,98%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)			82.169.851,25	8,45%	5,25%
TOTAL			972.216.304,00	100,00%	62,16%