

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.05.2021

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.552.727.708,63		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			922.130.682,70	59,39	
TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOIRO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOIRO NACIONAL					
<u>Nota do Tesouro Nacional</u>		157.028	555.497.084,89	35,78	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			337.674.849,11	21,75	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		1.500,00	3.669.173,97	0,24	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	1	13.141.991,09	0,85	0,85
. 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
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	1.500	3.669.173,97	0,24	0,24
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-1	-13.141.991,09	-0,85	-0,85
- BANCO MORADA		-2	-5.451.680,57	-0,35	-0,35
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		1.311	141.764.243,23	9,13	
. BRADESCO		61	24.407.235,65	1,57	
. DAYCOVAL		500	25.288.916,71	1,63	
. SAFRA		90	39.679.299,72	2,56	
. PARANÁ BANCO		250,00	24.434.379,78	1,57	
. ABC		410,00	27.954.411,37	1,80	
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		39.091.722,10	192.241.431,91	12,38	
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		30.166,67	2.857.431,61	0,18	0,18
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		106.364,55	11.375.932,21	0,73	0,73
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		30.680.789,24	42.698.989,16	2,75	2,75
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		2.474,99	25.032,51	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		3.000,00	9.116,46	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		1.976,00	22.098,21	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		19,52	733.284,94	0,05	0,05
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		8.405,53	11.705.057,59	0,75	0,75
. BRAD RF DI FED EXTRA		5.745.110,32	70.331.070,65	4,53	4,53
. BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO		2.331.237,14	10.119.374,10	0,65	0,65
. VINCI VALOREM FIM		182.178,14	42.364.044,47	2,73	2,73
. VALORES A RECEBER				0,00	0,00
<u>Debêntures</u>		19.782	28.958.748,70	1,87	
. CEMIG		10.000	15.943.947,65	1,03	1,03
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	10.542.101,86	0,68	0,68
. SABESP		990	2.472.699,19	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	-0,20
. COMANCHE PART.			-3.127.765,40	-0,20	-0,20
B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			261.485.052,95	16,84	
<u>B1. Mercado de Ações</u>			66.333.853,26	4,27	
<u>Companhias Abertas</u>		1.593.929	55.371.705,35	3,57	
. AMBEV	ON	87.539	1.571.325,05	0,10	
. ASSAI ATACADISTA	ON	42.600	3.810.570,00	0,25	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	64.254	1.655.183,04	0,11	
. COSAN	ON	194.400	4.543.128,00	0,29	
. ECORODOVIAS	ON	109.500	1.367.655,00	0,09	
. GERDAU - GGBR	PN	96.424	3.174.278,08	0,20	

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

. ITAUSA	ON	216	2.529,36	0,00
. ITAUSA	PN	360.800	3.918.288,00	0,25
. LOGG COMERCIAL	ON	5.656	167.700,40	0,01
. MRVE	ON	78.400	1.363.376,00	0,09
. PÃO DE AÇUCAR	PN	42.600	1.679.718,00	0,11
. PETROBRÁS	PN	183.377	4.927.339,99	0,32
. RENT	ON	136.467	8.549.657,55	0,55
. SUZANO PAPEL	PNA	62.200	3.777.406,00	0,24
. VALE R. DOCE	PNA	129.496	14.863.550,88	0,96
Instituições Financeiras		384.828	10.759.592,10	0,69
. BRADESCO	PN	198.767	5.263.350,16	0,34
. ITAU	PN	186.061	5.496.241,94	0,35
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER (inst. Fin. + Companhia Aberta)			202.555,81	0,01
B2. Fundos		39.225.067,92	195.151.199,69	12,57
. VELT INST FICFIA		6.293.092,63	26.618.603,75	1,71
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		11.421.519,84	39.994.027,19	2,58
. MOAT CAPITAL FIA		8.220.647,61	34.243.373,14	2,21
. SPX APACHE FIA		10.085.636,57	31.473.555,19	2,03
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.096.544,16	31.080.781,39	2,00
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	22.753.865,78	1,47
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		44.894,19	8.986.993,25	0,58
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		63.675.303,59	144.130.719,98	9,28
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II- FIP		10.858,75	-133.322,91	-0,01
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		395,93	6.207.880,82	0,40
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.354,00	11.242.970,30	0,72
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		2.000,00	1.802.576,38	0,12
. INDUSTRIAL PARKS BRASIL FIP MULTIESTRATÉGIA		2.768.765,30	747.957,69	0,05
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		763.123,24	1.142.434,77	0,07
. HAMILTON LANE FIC FIP		7.163,79	10.645.639,21	0,69
. STRATUS SCP BR FIP		5.000.000,00	8.977.490,00	0,58
. P2 BR INFRAESTRUTURA III FIC DE FIP		3.546,17	6.535.983,83	0,42
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	7.554.030,10	0,49
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		5.509.985,26	12.409.033,95	0,80
. KINEA CHRONOS FIM		11.925.565,78	22.164.052,78	1,43
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		9.523.673,63	17.830.052,41	1,15
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		18.077.115,65	20.918.286,88	1,35
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		73.756,10	16.085.653,81	1,04
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		70.000.000	71.504.401,50	4,61
. SCHRODER PLAN II FIM		70.000.000,00	71.504.401,50	4,61
E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			24.794.566,48	1,60
E1 - Investimentos em Shopping Center			20.831.627,89	1,34
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			20.760.904,47	1,34
. VALORES A RECEBER			70.723,42	0,00
E3 - Investimento Fundo Imobiliário		313,78	3.962.938,59	0,26
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		313,78	3.962.938,59	0,26
. VALORES A RECEBER				0,00
. VALORES A PAGAR				0,00
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		2.333	48.421.109,97	3,12
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		2.333	48.879.246,43	3,15
. VALORES A PAGAR (-)			-20.827,32	0,00
. VALORES A RECEBER			-437.309,14	-0,03
G - OUTROS			80.261.175,05	5,17
. DISPONIVEL			216.411,78	0,01
. DEPOSITOS JUDICIAIS			0,00	0,00

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

. OUTROS REALIZAVEIS			72.229.230,60	4,65	
. OUTROS DIREITOS A RECEBER			80.725.416,77	5,20	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-680.653,50	-0,04	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-72.229.230,60	-4,65	

GESTÃO TERCEIRIZADA	DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO TERCEIRIZADA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS			
- VELT INST FICFIA	26.618.603,75	4,39%	1,71%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	39.994.027,19	6,59%	2,58%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA	8.986.993,25	1,48%	0,58%
- MOAT CAPITAL FIA	34.243.373,14	5,64%	2,21%
- BBM SMID CAPS FICFIA	31.080.781,39	5,12%	2,00%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP	2.857.431,61	0,47%	0,18%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II	11.375.932,21	1,87%	0,73%
- IBIUNA EQ. FIC FIA	22.753.865,78	3,75%	1,47%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	25.032,51	0,00%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	9.116,46	0,00%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	22.098,21	0,00%	0,00%
- SPX APACHE FIA	31.473.555,19	5,19%	2,03%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.	733.284,94	0,12%	0,05%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL	11.705.057,59	1,93%	0,75%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM	42.698.989,16	7,03%	2,75%
- BRAD RF DI FED EXTRA	70.331.070,65	11,59%	4,53%
- BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO	10.119.374,10	1,67%	0,65%
- VINCI VALOREM FIM	42.364.044,47	6,98%	2,73%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP	(133.322,91)	-0,02%	-0,01%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	6.207.880,82	1,02%	0,40%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP	11.242.970,30	1,85%	0,72%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA	1.802.576,38	0,30%	0,12%
- INDUSTRIAL PARKS BRASIL FIP MULTISTRATÉGIA	747.957,69	0,12%	0,05%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE	1.142.434,77	0,19%	0,07%
- HAMILTON LANE FIC FIP	10.645.639,21	1,75%	0,69%
- STRATUS SCP BR FIP	8.977.490,00	1,48%	0,58%
- P2BR INFR III FIQFIP	6.535.983,83	1,08%	0,42%
- COPA FLORESTAL III	7.554.030,10	1,24%	0,49%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS	12.409.033,95	2,04%	0,80%
- KINEA CHRONOS FIM	22.164.052,78	3,65%	1,43%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM	17.830.052,41	2,94%	1,15%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM	20.918.286,88	3,45%	1,35%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM	16.085.653,81	2,65%	1,04%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	3.962.938,59	0,65%	0,26%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			
- SCHRODER PLAN II FIM	71.504.401,50	11,78%	4,61%
TOTAL	606.990.691,67	100,00%	39,09%

GESTÃO PRÓPRIA	DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENDA FIXA	729.889.250,79	77,18%	47,01%
RENDA VARIÁVEL	66.333.853,26	7,01%	4,27%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	20.831.627,89	2,20%	1,34%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	48.421.109,97	5,12%	3,12%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	80.261.175,05	8,49%	5,17%
TOTAL	945.737.016,96	100,00%	60,91%