

RESUMO DOS INVESTIMENTOS
PREVIDENCIAL

PLANO II

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.03.2021

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.513.645.636,58		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			897.375.872,61	59,29	
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	559.366.531,98	36,95	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			309.606.266,57	20,45	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		1.500,00	3.591.510,48	0,24	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	1	13.141.991,09	0,87	0,87
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	1	3.403.988,49	0,22	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	1	2.047.692,08	0,14	0,36
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	1.500	3.591.510,48	0,24	0,24
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-1	-13.141.991,09	-0,87	-0,87
- BANCO MORADA		-2	-5.451.680,57	-0,36	-0,36
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		1.021	128.004.443,63	8,46	
. BRADESCO		71	27.721.467,28	1,83	
. DAYCOVAL		200	9.988.518,93	0,66	
. SAFRA		90	38.895.010,40	2,57	
. PARANÁ BANCO		250,00	23.929.549,51	1,58	
. ABC		410,00	27.469.897,51	1,81	
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		38.151.621,13	178.010.312,46	11,76	
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		30.166,67	2.895.099,11	0,19	0,19
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		91.383,63	9.710.301,09	0,64	0,64
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		30.680.789,24	42.396.589,48	2,80	2,80
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		2.474,99	28.287,60	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		3.000,00	10.685,99	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		1.976,00	18.988,77	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		19,52	717.630,81	0,05	0,05
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		8.405,53	11.473.883,36	0,76	0,76
. BRAD RF DI FED EXTRA		4.819.990,26	58.762.374,32	3,88	3,88
. BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO		2.331.237,14	10.077.775,55	0,67	0,67
. VINCI VALOREM FIM		182.178,14	41.918.696,38	2,77	2,77
. VALORES A RECEBER				0,00	0,00
<u>Debêntures</u>		19.782	28.403.074,06	1,88	
. CEMIG		10.000	15.654.213,09	1,03	1,03
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	10.324.748,85	0,68	0,68
. SABESP		990	2.424.112,12	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			242.357.754,85	16,01	
<u>B1. Mercado de Ações</u>			61.118.232,89	4,04	
<u>Companhias Abertas</u>		1.448.129	50.994.108,64	3,37	
. AMBEV	ON	87.539	1.338.471,31	0,09	
. ASSAI ATACADISTA	ON	42.600	3.145.584,00	0,21	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	64.254	1.620.485,88	0,11	
. COSAN	ON	48.600	4.443.012,00	0,29	
. ECORODOVIAS	ON	109.500	1.283.340,00	0,08	

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

. GERDAU - GGBR	PN	96.424	2.913.933,28	0,19
. ITAUSA	ON	216	2.397,60	0,00
. ITAUSA	PN	360.800	3.723.456,00	0,25
. LOGG COMERCIAL	ON	5.656	161.987,84	0,01
. MRVE	ON	78.400	1.426.880,00	0,09
. PÃO DE AÇÚCAR	PN	42.600	1.413.468,00	0,09
. PETROBRÁS	PN	183.377	4.419.385,70	0,29
. RENT	ON	136.467	8.151.173,91	0,54
. SUZANO PAPEL	PNA	62.200	4.263.810,00	0,28
. VALE R. DOCE	PNA	129.496	12.686.723,12	0,84
<u>Instituições Financeiras</u>		<u>366.759</u>	<u>10.041.411,63</u>	<u>0,66</u>
. BRADESCO	PN	180.698	4.837.285,46	0,32
. ITAU	PN	186.061	5.204.126,17	0,34
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER (inst. Fin. + Companhia Aberta)			82.712,62	0,01
<u>B2. Fundos</u>		<u>39.225.067,92</u>	<u>181.239.521,96</u>	<u>11,97</u>
. VELT INST FICFIA		6.293.092,63	24.934.320,18	1,65
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		11.421.519,84	38.019.032,83	2,51
. MOAT CAPITAL FIA		8.220.647,61	32.308.314,08	2,13
. SPX APACHE FIA		10.085.636,57	28.566.357,34	1,89
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.096.544,16	28.740.722,96	1,90
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	20.551.707,35	1,36
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		44.894,19	8.119.067,22	0,54
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		<u>63.675.303,59</u>	<u>142.246.108,55</u>	<u>9,40</u>
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II- FIP		10.858,75	-115.424,08	-0,01
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		395,93	6.223.148,56	0,41
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.354,00	10.605.309,20	0,70
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		2.000,00	1.803.957,96	0,12
. INDUSTRIAL PARKS BRASIL FIP MULTISTRATÉGIA		2.768.765,30	2.392.576,09	0,16
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		763.123,24	1.140.201,04	0,08
. HAMILTON LANE FIC FIP		7.163,79	10.506.215,56	0,69
.STRATUS SCP BR FIP		5.000.000,00	8.961.630,00	0,59
. P2 BR INFRAESTRUTURA III FIC DE FIP		3.546,17	6.345.300,36	0,42
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	7.443.912,40	0,49
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		5.509.985,26	12.132.913,72	0,80
. KINEA CHRONOS FIM		11.925.565,78	21.933.615,07	1,45
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		9.523.673,63	17.943.118,07	1,19
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		18.077.115,65	20.762.859,83	1,37
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		73.756,10	14.166.774,81	0,94
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		<u>70.000.000</u>	<u>74.531.843,40</u>	<u>4,92</u>
. SCHRODER PLAN II FIM		70.000.000,00	74.531.843,40	4,92
E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			<u>26.559.467,62</u>	<u>1,75</u>
<u>E1 - Investimentos em Shopping Center</u>			<u>21.041.525,29</u>	<u>1,39</u>
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			20.919.384,65	1,38
. VALORES A RECEBER			122.140,64	0,01
<u>E3 - Investimento Fundo Imobiliário</u>		<u>313,78</u>	<u>3.967.784,55</u>	<u>0,26</u>
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		313,78	3.967.784,55	0,26
. VALORES A RECEBER				<u>0,00</u>
. VALORES A PAGAR				<u>0,00</u>
<u>E3 - Outros Investimentos Imobiliário</u>		<u>18,00</u>	<u>1.550.157,78</u>	<u>0,10</u>
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		18	1.550.157,78	0,10
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		<u>2.386</u>	<u>49.835.465,41</u>	<u>3,29</u>
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		2.386	50.273.963,87	3,32
. VALORES A PAGAR (-)			-22.373,30	0,00
. VALORES A RECEBER			-416.125,16	-0,03

**RESUMO DOS INVESTIMENTOS
PREVIDENCIAL**

PLANO II

G - OUTROS			80.739.124,14	5,33	
. DISPONIVEL			170.440,31	0,01	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			0,00	0,00	
. OUTROS REALIZAVEIS			72.229.230,60	4,77	
. OUTROS DIREITOS A RECEBER			81.230.619,32	5,37	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-647.204,51	-0,04	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-72.243.961,58	-4,77	

GESTÃO TERCEIRIZADA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO TERCEIRIZADA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS					
- VELT INST FICFIA			24.934.320,18	4,30%	1,65%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA			38.019.032,83	6,56%	2,51%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA			8.119.067,22	1,40%	0,54%
- MOAT CAPITAL FIA			32.308.314,08	5,57%	2,13%
- BBM SMID CAPS FICFIA			28.740.722,96	4,96%	1,90%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP			2.895.099,11	0,50%	0,19%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II			9.710.301,09	1,67%	0,64%
- IBIUNA EQ. FIC FIA			20.551.707,35	3,54%	1,36%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER			28.287,60	0,00%	0,00%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER II			10.685,99	0,00%	0,00%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER III			18.988,77	0,00%	0,00%
- SPX APACHE FIA			28.566.357,34	4,93%	1,89%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.			717.630,81	0,12%	0,05%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL			11.473.883,36	1,98%	0,76%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM			42.396.589,48	7,31%	2,80%
- BRAD RF DI FED EXTRA			58.762.374,32	10,13%	3,88%
- BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO			10.077.775,55	1,74%	0,67%
- VINCI VALOREM FIM			41.918.696,38	7,23%	2,77%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP			(115.424,08)	-0,02%	-0,01%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			6.223.148,56	1,07%	0,41%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP			10.605.309,20	1,83%	0,70%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVPE PLAZA			1.803.957,96	0,31%	0,12%
- INDUSTRIAL PARKS BRASIL FIP MULTISTRATÉGIA			2.392.576,09	0,41%	0,16%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			1.140.201,04	0,20%	0,08%
- HAMILTON LANE FIC FIP			10.506.215,56	1,81%	0,69%
- STRATUS SCP BR FIP			8.961.630,00	1,55%	0,59%
- P2BR INFR III FIQFIP			6.345.300,36	1,09%	0,42%
- COPA FLORESTAL III			7.443.912,40	1,28%	0,49%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			12.132.913,72	2,09%	0,80%
- KINEA CHRONOS FIM			21.933.615,07	3,78%	1,45%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM			17.943.118,07	3,09%	1,19%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM			20.762.859,83	3,58%	1,37%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM			14.166.774,81	2,44%	0,94%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			3.967.784,55	0,68%	0,26%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- SCHRODER PLAN II FIM			74.531.843,40	12,85%	4,92%
TOTAL			579.995.570,92	100,00%	38,32%

GESTÃO PRÓPRIA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENDA FIXA			719.365.560,15	77,05%	47,53%
RENDA VARIÁVEL			61.118.232,89	6,55%	4,04%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			22.591.683,07	2,42%	1,49%
EMPRÉSTIMO PESSOAL			49.835.465,41	5,34%	3,29%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)			80.739.124,14	8,65%	5,33%
TOTAL			933.650.065,66	100,00%	61,68%