

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 30.09.2021

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCACÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			<u>1.566.288.502,91</u>		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			<u>980.480.201,87</u>	<u>62,60</u>	
<u>TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOIRO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOIRO NACIONAL</u>					
<u>Nota do Tesouro Nacional</u>		<u>157.028</u>	<u>574.520.739,47</u>	<u>36,68</u>	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			<u>376.119.227,42</u>	<u>24,01</u>	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		<u>2,00</u>	<u>0,00</u>	<u>0,00</u>	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	1	13.141.991,09	0,84	0,84
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-1	-13.141.991,09	-0,84	-0,84
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		<u>1.708</u>	<u>161.376.825,02</u>	<u>10,30</u>	
. BRADESCO		458	41.540.114,35	2,65	
. DAYCOVAL		500	24.551.569,35	1,57	
. SAFRA		90	41.780.509,28	2,67	
. PARANÁ BANCO		250,00	25.721.245,84	1,64	
. ABC		410,00	27.783.386,20	1,77	
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		<u>40.681.049,01</u>	<u>214.742.402,40</u>	<u>13,71</u>	
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		30.166,67	2.756.049,57	0,18	0,18
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		106.364,55	11.399.797,56	0,73	0,73
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		30.680.789,24	43.369.689,93	2,77	2,77
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		2.474,99	23.670,01	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		3.000,00	5.604,31	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		1.976,00	8.799,26	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		19,52	778.898,94	0,05	0,05
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		8.405,53	11.817.432,37	0,75	0,75
. BRAD RF DI FED EXTRA		7.334.437,23	91.188.020,97	5,82	5,82
. BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO		2.331.237,14	10.276.309,44	0,66	0,66
. VINCI VALOREM FIM		182.178,14	43.118.130,04	2,75	2,75
. VALORES A RECEBER				0,00	0,00
<u>Debêntures</u>		<u>19.782</u>	<u>29.840.234,98</u>	<u>1,91</u>	
. CEMIG		10.000	16.788.417,48	1,07	1,07
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	10.439.915,15	0,67	0,67
. SABESP		990	2.611.902,35	0,17	0,17
B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			<u>227.814.308,90</u>	<u>14,54</u>	
<u>B1. Mercado de Ações</u>			<u>56.740.624,38</u>	<u>3,62</u>	
<u>Companhias Abertas</u>		<u>1.764.329</u>	<u>47.118.266,36</u>	<u>3,01</u>	
. AMBEV	ON	87.539	1.339.346,70	0,09	
. ASSAI ATACADISTA	ON	213.000	4.055.520,00	0,26	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	64.254	1.740.640,86	0,11	
. COSAN	ON	194.400	4.467.312,00	0,29	
. ECORODOVIAS	ON	109.500	983.310,00	0,06	
. GERDAU - GGBR	PN	96.424	2.613.090,40	0,17	
. ITAUSA	ON	216	2.438,64	0,00	
. ITAUSA	PN	360.800	4.019.312,00	0,26	
. LOGG COMERCIAL	ON	5.656	146.603,52	0,01	
. MRVE	ON	78.400	963.536,00	0,06	
. PÃO DE AÇUCAR	PN	42.600	1.096.524,00	0,07	
. PETROBRÁS	PN	183.377	4.993.355,71	0,32	
. RENT	ON	136.467	7.433.357,49	0,47	

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

. SUZANO PAPEL	PNA	62.200	3.391.144,00	0,22
. VALE R. DOCE	PNA	129.496	9.872.775,04	0,63
<u>Instituições Financeiras</u>		<u>384.828</u>	<u>9.523.061,34</u>	<u>0,61</u>
. BRADESCO	PN	198.767	4.140.316,61	0,26
. ITAU	PN	186.061	5.382.744,73	0,34
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER (inst. Fin. + Companhia Aberta)			99.296,68	0,01
<u>B2. Fundos</u>		<u>39.225.067,92</u>	<u>171.073.684,52</u>	<u>10,92</u>
. VELT INST FICFIA		6.293.092,63	23.012.361,87	1,47
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		11.421.519,84	36.408.843,07	2,32
. MOAT CAPITAL FIA		8.220.647,61	29.258.043,61	1,87
. SPX APACHE FIA		10.085.636,57	27.788.143,57	1,77
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.096.544,16	25.898.097,59	1,65
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	20.576.146,65	1,31
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		44.894,19	8.132.048,16	0,52
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		<u>63.675.416,59</u>	<u>131.585.156,93</u>	<u>8,40</u>
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II- FIP		10.858,75	-153.317,75	-0,01
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		395,93	6.186.447,58	0,39
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.354,00	8.945.681,31	0,57
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVPE PLAZA		2.000,00	1.800.515,81	0,11
. INDUSTRIAL PARKS BRASIL FIP MULTISTRATÉGIA		2.768.765,30	735.426,84	0,05
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		763.123,24	1.138.148,49	0,07
. HAMILTON LANE FIC FIP		7.163,79	7.429.192,33	0,47
. STRATUS SCP BR FIP		5.000.000,00	8.306.575,00	0,53
. P2 BR INFRAESTRUTURA III FIC DE FIP		3.659,17	7.151.597,29	0,46
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	1.045.034,80	0,07
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		5.509.985,26	12.353.631,61	0,79
. KINEA CHRONOS FIM		11.925.565,78	22.582.421,90	1,44
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		9.523.673,63	18.009.352,44	1,15
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		18.077.115,65	20.827.713,30	1,33
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		73.756,10	15.226.736,02	0,97
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		<u>70.000.000</u>	<u>75.952.254,70</u>	<u>4,85</u>
. SCHRODER PLAN II FIM		70.000.000,00	75.952.254,70	4,85
E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			<u>20.911.938,21</u>	<u>1,34</u>
<u>E1 - Investimentos em Shopping Center</u>			<u>20.522.265,22</u>	<u>1,31</u>
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			20.443.944,11	1,31
. VALORES A RECEBER			78.321,11	0,01
<u>E3 - Investimento Fundo Imobiliário</u>		<u>313,78</u>	<u>389.672,99</u>	<u>0,02</u>
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		313,78	389.672,99	0,02
. VALORES A RECEBER				<u>0,00</u>
. VALORES A PAGAR				<u>0,00</u>
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		<u>2.215</u>	<u>45.167.566,82</u>	<u>2,88</u>
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		2.215	45.991.563,85	2,94
. VALORES A PAGAR (-)			-11.448,74	0,00
. VALORES A RECEBER			-812.548,29	-0,05
G - OUTROS			<u>84.377.075,48</u>	<u>5,39</u>
. DISPONIVEL			164.387,06	0,01
. DEPOSITOS JUDICIAIS			0,00	0,00
. OUTROS REALIZAVEIS			72.229.230,60	4,61
. OUTROS DIREITOS A RECEBER			84.886.769,74	5,42
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-674.081,32	-0,04
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-72.229.230,60	-4,61

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

GESTÃO TERCEIRIZADA	DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO TERCEIRIZADA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS			
- VELT INST FICFIA	23.012.361,87	3,88%	1,47%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	36.408.843,07	6,13%	2,32%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA	8.132.048,16	1,37%	0,52%
- MOAT CAPITAL FIA	29.258.043,61	4,93%	1,87%
- BBM SMID CAPS FICFIA	25.898.097,59	4,36%	1,65%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP	2.756.049,57	0,46%	0,18%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II	11.399.797,56	1,92%	0,73%
- IBIUNA EQ. FIC FIA	20.576.146,65	3,47%	1,31%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	23.670,01	0,00%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	5.604,31	0,00%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	8.799,26	0,00%	0,00%
- SPX APACHE FIA	27.788.143,57	4,68%	1,77%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.	778.898,94	0,13%	0,05%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL	11.817.432,37	1,99%	0,75%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM	43.369.689,93	7,30%	2,77%
- BRAD RF DI FED EXTRA	91.188.020,97	15,36%	5,82%
- BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO	10.276.309,44	1,73%	0,66%
- VINCI VALOREM FIM	43.118.130,04	7,26%	2,75%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP	(153.317,75)	-0,03%	-0,01%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	6.186.447,58	1,04%	0,39%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP	8.945.681,31	1,51%	0,57%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA	1.800.515,81	0,30%	0,11%
- INDUSTRIAL PARKS BRASIL FIP MULTIESTRATÉGIA	735.426,84	0,12%	0,05%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE	1.138.148,49	0,19%	0,07%
- HAMILTON LANE FIC FIP	7.429.192,33	1,25%	0,47%
- STRATUS SCP BR FIP	8.306.575,00	1,40%	0,53%
- P2BR INFR III FIQFIP	7.151.597,29	1,20%	0,46%
- COPA FLORESTAL III	1.045.034,80	0,18%	0,07%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS	12.353.631,61	2,08%	0,79%
- KINEA CHRONOS FIM	22.582.421,90	3,80%	1,44%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM	18.009.352,44	3,03%	1,15%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM	20.827.713,30	3,51%	1,33%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM	15.226.736,02	2,56%	0,97%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	389.672,99	0,07%	0,02%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			
- SCHRODER PLAN II FIM	75.952.254,70	12,79%	4,85%
TOTAL	593.743.171,54	100,00%	37,91%

GESTÃO PRÓPRIA	DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENDA FIXA	765.737.799,47	78,74%	48,89%
RENDA VARIÁVEL	56.740.624,38	5,83%	3,62%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	20.522.265,22	2,11%	1,31%
EMPRESTIMO PESSOAL	45.167.566,82	4,64%	2,88%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	84.377.075,48	8,68%	5,39%
TOTAL	972.545.331,37	100,00%	62,09%