

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 30.10.2020

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.468.409.524,27		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			840.259.994,42	57,22	
TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOUREIRO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOUREIRO NACIONAL					
<u>Nota do Tesouro Nacional</u>		159.578	539.167.964,62	36,72	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			269.311.590,21	18,34	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		1.500,00	3.360.595,31	0,23	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	1	13.141.991,09	0,89	0,89
. 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	3.360.595,31	0,23	0,23
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-1	-13.141.991,09	-0,89	-0,89
- BANCO MORADA		-2	-5.451.680,57	-0,37	-0,37
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		531	112.458.266,18	7,66	
. BRADESCO		71	24.978.025,38	1,70	
. SAFRA		90	36.452.692,64	2,48	
. PARANÁ BANCO		260,00	24.743.818,62	1,69	
. ABC		110,00	26.283.729,54	1,79	
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		36.719.781,49	153.492.728,72	10,45	
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		30.166,67	3.355.892,99	0,23	0,23
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		76.402,72	7.826.808,08	0,53	0,53
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		30.800.317,47	40.901.643,49	2,79	2,79
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		2.474,99	31.087,07	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		3.000,00	12.882,17	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		1.976,00	17.410,42	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		19,52	722.493,09	0,05	0,05
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		7.529,02	9.779.677,58	0,67	0,67
. BRAD RF DI FED EXTRA		3.284.479,83	39.745.248,97	2,71	2,71
. BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO		2.331.237,14	10.004.016,12	0,68	0,68
. VINCI VALOREM FIM		182.178,14	41.095.568,74	2,80	2,80
. VALORES A RECEBER				0,00	0,00
<u>Debêntures</u>		20.070	31.780.439,59	2,16	
. LOJAS AMERICANAS		288	3.611.132,71	0,25	0,25
. CEMIG		10.000	15.428.976,03	1,05	1,05
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	9.647.174,39	0,66	0,66
. SABESP		990	3.093.156,46	0,21	0,21
. VALORES A RECEBER			3.127.765,40	0,21	
. COMANCHE PART.			3.127.765,40	0,21	0,21
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS		0,00	-3.127.765,40	-0,21	
. COMANCHE PART.			-3.127.765,40	-0,21	-0,21
B - INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			201.747.969,99	13,74	
<u>B1. Mercado de Ações</u>			46.691.008,24	3,18	
<u>Companhias Abertas</u>		1.405.529	38.673.204,65	2,63	
. AMBEV	ON	87.539	1.066.225,02	0,07	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	64.254	1.078.182,12	0,07	
. COSAN	ON	48.600	3.158.514,00	0,22	
. ECOMODVIAS	ON	109.500	1.093.905,00	0,07	
. GERDAU - GGBR	PN	96.424	2.103.007,44	0,14	
. ITAUSA	ON	216	2.229,12	0,00	
. ITAUSA	PN	360.800	3.279.672,00	0,22	
. LOGG COMERCIAL	ON	5.656	177.315,60	0,01	
. MRVE	ON	78.400	1.321.040,00	0,09	
. PÃO DE AÇÚCAR	PN	42.600	2.639.070,00	0,18	
. PETROBRÁS	PN	183.377	3.473.160,38	0,24	
. RENT	ON	136.467	8.280.817,56	0,56	

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

. SUZANO PAPEL	PNA	62.200	3.113.110,00	0,21
. VALE R. DOCE	PNA	129.496	7.840.982,80	0,53
. VALORES A RECEBER				0,00
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			45.973,61	0,00
Instituições Financeiras		366.759	8.017.803,59	0,55
. BRADESCO	PN	180.698	3.642.871,68	0,25
. ITAU	PN	186.061	4.368.712,28	0,30
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			6.219,63	0,00
B2. Fundos		39.225.067,92	155.056.961,75	10,56
. M. SQUARE INST. FIC FIA		6.293.092,63	21.555.446,99	1,47
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		11.421.519,84	34.622.100,14	2,36
. MOAT CAPITAL FIA		8.220.647,61	27.755.498,30	1,89
. SPX APACHE FIA		10.085.636,57	22.380.039,66	1,52
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.096.544,16	23.697.246,79	1,61
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	17.951.176,80	1,22
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		44.894,19	7.095.453,07	0,48
C - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		63.622.910,29	132.657.705,93	9,03
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II- FIP		10.858,75	-195.652,20	-0,01
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		395,93	6.474.850,84	0,44
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.269,00	10.021.876,44	0,68
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVFP PLAZA		2.000,00	1.995.159,34	0,14
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		2.729.365,78	1.983.643,99	0,14
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		750.401,73	810.633,51	0,06
. HAMILTON LANE FIC FIP		7.104,85	10.071.681,17	0,69
. STRATUS SCP BR FIP		5.000.000,00	7.126.880,00	0,49
. P2 BR INFRAESTRUTURA III FIC DE FIP		3.417,83	5.450.670,96	0,37
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	7.163.756,80	0,49
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		5.509.985,26	11.733.403,98	0,80
. KINEA CHRONOS FIM		11.925.565,78	21.128.320,97	1,44
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		9.523.673,63	16.584.043,55	1,13
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		18.077.115,65	19.761.830,51	1,35
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		73.756,10	12.546.606,11	0,85
D - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		17.603.704	58.168.909,88	3,96
. BB MM SCH INV EXTE FI		5.128.757,86	22.140.515,71	1,51
. VOT ALLIANZGI FIM		3.790.730,70	13.167.867,55	0,90
. WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI		3.465,71	5.800.161,94	0,39
. GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE		46.431,13	5.694.611,68	0,39
. PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR		3.701.637,15	6.041.749,41	0,41
. ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR		4.932.681,62	5.324.003,59	0,36
E - INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			31.227.146,76	2,13
E1 - Investimentos em Shopping Center			23.620.083,46	1,61
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			23.591.907,43	1,61
. VALORES A RECEBER			28.176,03	0,00
E3 - Investimento Fundo Imobiliário		13.543,78	4.837.242,29	0,33
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		13.230,00	1.144.395,00	0,08
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		313,78	3.686.926,01	0,25
. VALORES A RECEBER			5.921,28	0,00
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00
E3 - Outros Investimentos Imobiliário		18,00	2.769.821,01	0,19
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		18	2.769.821,01	0,19
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		2.506	56.427.286,22	3,84
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		2.506	53.910.483,19	3,67
. VALORES A PAGAR (-)			-901,33	0,00
. VALORES A RECEBER			2.517.704,36	0,17
G - OUTROS			147.920.511,07	10,07
. DISPONIVEL			97.957,90	0,01
. DEPOSITOS JUDICIAIS			0,00	0,00
. OUTROS REALIZAVEIS			72.229.230,60	4,92
. OUTROS DIREITOS A RECEBER			76.189.760,02	5,19
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-596.437,45	-0,04
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			0,00	0,00

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

GESTÃO TERCEIRIZADA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO TERCEIRIZADA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS					
- M. SQUARE INST. FIC FIA			21.555.446,99	4,28%	1,47%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA			34.622.100,14	6,87%	2,36%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA			7.095.453,07	1,41%	0,48%
- MOAT CAPITAL FIA			27.755.498,30	5,50%	1,89%
- BBM SMID CAPS FICFIA			23.697.246,79	4,70%	1,61%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP			3.355.892,99	0,67%	0,23%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II			7.826.808,08	1,55%	0,53%
- IBIUNA EQ. FIC FIA			17.951.176,80	3,56%	1,22%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER			31.087,07	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II			12.882,17	0,00%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III			17.410,42	0,00%	0,00%
- SPX APACHE FIA			22.380.039,66	4,44%	1,52%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.			722.493,09	0,14%	0,05%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL			9.779.677,58	1,94%	0,67%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM			40.901.643,49	8,11%	2,79%
- BRAD RF DI FED EXTRA			39.745.248,97	7,88%	2,71%
- BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO			10.004.016,12	1,98%	0,68%
- VINCI VALOREM FIM			41.095.568,74	8,15%	2,80%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP			(195.652,20)	-0,04%	-0,01%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			6.474.850,84	1,28%	0,44%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP			10.021.876,44	1,99%	0,68%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVPE PLAZA			1.995.159,34	0,40%	0,14%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES			1.983.643,99	0,39%	0,14%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			810.633,51	0,16%	0,06%
- HAMILTON LANE FIC FIP			10.071.681,17	2,00%	0,69%
- STRATUS SCP BR FIP			7.126.880,00	1,41%	0,49%
- P2BR INFR III FIQFIP			5.450.670,96	1,08%	0,37%
- COPA FLORESTAL III			7.163.756,80	1,42%	0,49%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			11.733.403,98	2,33%	0,80%
- KINEA CHRONOS FIM			21.128.320,97	4,19%	1,44%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM			16.584.043,55	3,29%	1,13%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM			19.761.830,51	3,92%	1,35%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM			12.546.606,11	2,49%	0,85%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			3.686.926,01	0,73%	0,25%
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO			1.150.316,28	0,23%	0,08%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- BB MM SCH INV EXTE FI			22.140.515,71	4,39%	1,51%
- VOT ALLIANZGI FIM			13.167.867,55	2,61%	0,90%
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI			5.800.161,94	1,15%	0,39%
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE			5.694.611,68	1,13%	0,39%
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR			6.041.749,41	1,20%	0,41%
- ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR			5.324.003,59	1,06%	0,36%
TOTAL			504.213.548,57	100,00%	34,34%

GESTÃO PRÓPRIA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENDA FIXA			686.767.265,70	71,23%	46,77%
RENDA VARIÁVEL			46.691.008,24	4,84%	3,18%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			26.389.904,47	2,74%	1,80%
EMPRÉSTIMO PESSOAL			56.427.286,22	5,85%	3,84%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)			147.920.511,07	15,34%	10,07%
TOTAL			964.195.975,70	100,00%	65,66%