

**RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL
PLANO II**

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 28.06.2019

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCACÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.233.251.679,91		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			732.526.899,95	59,40	
<u>TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOURO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOURO NACIONAL</u>					
<u>Nota do Tesouro Nacional</u>		152.793	493.523.854,99	40,02	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			202.532.904,59	16,42	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		1.500,00	2.994.473,75	0,24	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	1	13.141.991,09	1,07	1,07
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	1	3.403.988,49	0,28	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	1	2.047.692,08	0,17	0,44
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	1.500	2.994.473,75	0,24	0,24
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-1	-13.141.991,09	-1,07	-1,07
- BANCO MORADA		-2	-5.451.680,57	-0,44	-0,44
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		141	39.253.357,03	3,18	
. BRADESCO		71	20.973.625,29	1,70	
. PARANÁ BANCO		60,00	12.764.378,87	1,04	
. ABC		10,00	5.515.352,87	0,45	
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		76.012.400,15	160.285.073,81	13,00	
. AF GERAES 30		18.245.311,87	20.153.769,66	1,63	1,63
. BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP		3.024.304,06	329.231,18	0,03	0,03
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		11.796.453,84	20.413.650,13	1,66	1,66
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		8.222.676,59	24.738.620,63	2,01	2,01
. BNP PARIBAS MATCH DI FI RENDA FIXA		82,69	23.787,20	0,00	0,00
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		30.166,67	4.313.270,46	0,35	0,35
. AZ QUEST LUCE		14.435.322,56	20.405.300,21	1,65	1,65
. CA INDOSUEZ VITESSE FI RENDA FIXA CP		1.421.238,82	31.924.417,81	2,59	2,59
. ARX VINSON FI RF CP		18.828.698,84	20.036.831,01	1,62	1,62
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		2.474,99	73.515,67	0,01	0,01
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		3.000,00	9.725,50	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		1.976,00	2.069,65	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		19,52	1.950.223,25	0,16	0,16
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		673,71	3.021.161,45	0,24	0,24
. VALORES A RECEBER			12.889.500,00	1,05	1,05
<u>Debêntures</u>		13.170	33.294.844,06	2,70	
. LOJAS AMERICANAS		288	3.522.331,72	0,29	0,29
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		700	763.596,23	0,06	0,06
. CEMIG		10.000	14.604.820,92	1,18	1,18
. ROTA DAS BANDEIRAS		500	7.595.454,17	0,62	0,62
. SABESP		1.477	5.534.845,88	0,45	0,45
. ESPÍRITO SANTO CENTRAIS ELÉTRICAS		205	1.273.795,14	0,10	0,10
. VALORES A RECEBER			3.127.765,40	0,25	
. COMANCHE PART.			3.127.765,40	0,25	0,25
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		0,00	-3.127.765,40	-0,25	
. COMANCHE PART.			-3.127.765,40	-0,25	-0,25
<u>Outros Títulos</u>		18	3.175.296,31	0,26	
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		18	3.175.296,31	0,26	0,26

B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			193.614.208,39	15,70
B1. Mercado de Ações			49.941.457,97	4,05
Companhias Abertas		1.504.431	36.989.390,65	3,00
. AMBEV	ON	87.539	1.566.072,71	0,13
. BRF - BRASIL FOODS	ON	64.254	1.896.778,08	0,15
. COSAN	ON	48.600	2.242.890,00	0,18
. ECORODOVIAS	ON	109.500	1.178.220,00	0,10
. FLEURY	ON	148.000	3.159.800,00	0,26
. GERDAU - GGBR	PN	96.424	1.465.644,80	0,12
. ITAUSA	ON	216,00	2.842,56	0,00
. ITAUSA	PN	360.800	4.650.712,00	0,38
. LOGG COMERCIAL	ON	5.656	112.724,08	0,01
. MRVE	ON	78.400	1.534.288,00	0,12
. PETROBRÁS	PN	183.377	5.026.363,57	0,41
. RENT	ON	129.969	5.326.129,62	0,43
. SUZANO PAPEL	PNA	62.200	2.043.270,00	0,17
. VALE R. DOCE	PNA	129.496	6.710.482,72	0,54
. VALORES A RECEBER				0,00
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			73.172,51	0,01
Instituições Financeiras		350.332	12.952.067,32	1,05
. BRADESCO	PN	164.271	6.199.587,54	0,50
. ITAU	PN	186.061	6.746.571,86	0,55
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			5.907,92	0,00
B2. Fundos		39.225.067,92	143.672.750,42	11,65
. M. SQUARE INST. FIC FIA		6.293.092,63	18.073.127,12	1,47
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		11.421.519,84	27.245.213,34	2,21
. MOAT CAPITAL FIA		8.220.647,61	25.868.236,55	2,10
. SPX APACHE FIA		10.085.636,57	25.393.330,34	2,06
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.096.544,16	22.346.106,90	1,81
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	17.716.388,70	1,44
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		44.894,19	7.030.347,47	0,57
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		52.950.655,20	150.619.603,68	12,21
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II- FIP		10.778,33	-43.339,31	0,00
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		395,93	6.053.053,68	0,49
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.090,00	17.222.547,21	1,40
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVPE PLAZA		2.000,00	2.020.747,22	0,16
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		2.675,37	1.820.204,68	0,15
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		744.560,57	647.713,34	0,05
. HAMILTON LANE FIC FIP		6.562,57	8.714.333,94	0,71
. STRATUS SCP BR FIP		4.643.471,00	6.347.183,73	0,51
. P2 BR INFRAESTRUTURA III FIC DE FIP		2.926,79	6.019.234,43	0,49
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	16.184.802,10	1,31
. MAUÁ MACRO II FIC DE FIM		15.405,41	11.152.791,14	0,90
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		5.509.985,26	11.056.281,34	0,90
. KINEA CHRONOS FIM		4.328.258,59	7.404.862,28	0,60
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		9.523.673,63	15.176.740,48	1,23
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		18.077.115,65	19.797.588,86	1,61
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		73.756,10	21.044.858,60	1,71
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		20.946.555	52.047.214,72	4,22
. BB MM SCH INV EXTE FI		5.128.757,86	12.833.162,33	1,04
. MSQUARE GL EQ FICFIM		3.342.850,69	9.292.693,43	0,75
. VOT ALLIANZGI FIM		3.790.730,70	7.836.824,42	0,64
. WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI		3.465,71	5.464.338,37	0,44
. GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE		46.431,13	5.726.093,01	0,46
. PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR		3.701.637,15	5.684.581,44	0,46
. ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR		4.932.681,62	5.209.521,72	0,42

E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			39.304.479,74	3,19	
E1 - Investimentos em Shopping Center			21.528.019,50	1,75	
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			21.487.146,16	1,74	
. VALORES A RECEBER			40.873,34	0,00	
E3 - Investimento Fundo Imobiliário		111.065,78	17.776.460,24	1,44	
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		67.752,00	1.911.091,02	0,15	
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		313,78	4.165.428,72	0,34	
. GGR COVEPI RENDA FII		43.000,00	9.607.911,12	0,78	
. VALORES A RECEBER			2.094.262,92	0,17	
. VALORES A PAGAR			-2.233,54	0,00	
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		2.837	65.434.401,95	5,31	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		2.837	63.047.702,76	5,11	
. VALORES A PAGAR (-)			-30.576,36	0,00	
. VALORES A RECEBER			2.417.275,55	0,20	
G - OUTROS			-295.128,52	-0,02	
. DISPONIVEL			225.339,29	0,02	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			54.561,85	0,00	
. OUTROS REALIZAVEIS			11.034,41	0,00	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-586.064,07	-0,05	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			0,00	0,00	
GESTÃO TERCEIRIZADA			DISTRIBUIÇÃO	(%) EM RELAÇÃO A GESTÃO TERCEIRIZADA	(%) EM RELAÇÃO AO RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS					
- BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP			329.231,18	0,06%	0,03%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO			20.413.650,13	4,01%	1,66%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES			24.738.620,63	4,86%	2,01%
- M. SQUARE INST. FIC FIA			18.073.127,12	3,55%	1,47%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA			27.245.213,34	5,35%	2,21%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA			7.030.347,47	1,38%	0,57%
- MOAT CAPITAL FIA			25.868.236,55	5,08%	2,10%
- BBM SMID CAPS FICFIA			22.346.106,90	4,39%	1,81%
- BNP PARIBAS MATCH DI FI RENDA FIXA			23.787,20	0,00%	0,00%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP			4.313.270,46	0,85%	0,35%
- CA INDOSUEZ VITESSE FI RENDA FIXA CP			31.924.417,81	6,27%	2,59%
- AZ QUEST LUCE			20.405.300,21	4,01%	1,65%
- IBIUNA EQ. FIC FIA			17.716.388,70	3,48%	1,44%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER			73.515,67	0,01%	0,01%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II			9.725,50	0,00%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III			2.069,65	0,00%	0,00%
- SPX APACHE FIA			25.393.330,34	4,98%	2,06%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.			1.950.223,25	0,38%	0,16%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL			3.021.161,45	0,59%	0,24%
- ARX VINSON FI RF			20.036.831,01	3,93%	1,62%
- AF GERAES 30			20.153.769,66	3,96%	1,63%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP			(43.339,31)	-0,01%	0,00%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			6.053.053,68	1,19%	0,49%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP			17.222.547,21	3,38%	1,40%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA			2.020.747,22	0,40%	0,16%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES			1.820.204,68	0,36%	0,15%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			647.713,34	0,13%	0,05%
- HAMILTON LANE FIC FIP			8.714.333,94	1,71%	0,71%
- STRATUS SCP BR FIP			6.347.183,73	1,25%	0,51%
- P2BR INFR III FIQFIP			6.019.234,43	1,18%	0,49%
- COPA FLORESTAL III			16.184.802,10	3,18%	1,31%
- MAUÁ MACRO II FIC DE FIM			11.152.791,14	2,19%	0,90%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			11.056.281,34	2,17%	0,90%
- KINEA CHRONOS FIM			7.404.862,28	1,45%	0,60%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM			15.176.740,48	2,98%	1,23%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM			19.797.588,86	3,89%	1,61%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM			21.044.858,60	4,13%	1,71%

INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	4.165.428,72	0,82%	0,34%
- GGR COVEPI RENDA FII	9.607.911,12	1,89%	0,78%
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO	1.920.001,92	0,38%	0,16%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			
- BB MM SCH INV EXTE FI	12.833.162,33	2,52%	1,04%
- MSQUARE GL EQ FICFIM	9.292.693,43	1,82%	0,75%
- VOT ALLIANZGI FIM	7.836.824,42	1,54%	0,64%
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI	5.464.338,37	1,07%	0,44%
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE	5.726.093,01	1,12%	0,46%
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR	5.684.581,44	1,12%	0,46%
- ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR	5.209.521,72	1,02%	0,42%
TOTAL	509.428.484,43	100,00%	41,48%
GESTÃO PRÓPRIA	DISTRIBUIÇÃO	(%) EM RELAÇÃO A GESTÃO PRÓPRIA	(%) EM RELAÇÃO AO RECURSOS GARANTIDORES
RENTA FIXA	569.066.529,83	80,28%	46,14%
RENTA VARIÁVEL	49.941.457,97	7,04%	4,05%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	24.703.315,81	3,48%	2,00%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	65.434.401,95	9,23%	5,31%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	-295.128,52	-0,04%	-0,02%
TOTAL	708.850.577,04	100,00%	57,48%