

**RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL
PLANO I**

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.12.2019

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCACÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			<u>1.374.594.749,65</u>		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			<u>1.023.715.777,79</u>	<u>74,47</u>	
<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>		<u>197.414</u>	<u>698.725.233,90</u>	<u>50,83</u>	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			<u>257.997.136,33</u>	<u>18,77</u>	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		<u>3.502,00</u>	<u>7.280.202,84</u>	<u>0,53</u>	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	1	24.254.454,66	1,76	1,76
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	1	2.049.020,58	0,15	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	1	3.383.584,48	0,25	0,40
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	3.500	7.280.202,84	0,53	0,53
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-1	-24.254.454,66	-1,76	-1,76
- BANCO MORADA		-1	-5.432.605,06	-0,40	-0,40
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		<u>219</u>	<u>68.984.809,18</u>	<u>5,02</u>	
. PARANÁ BANCO		100	24.031.528,82	1,75	1,75
. ABC		10	5.784.682,09	0,42	0,42
. BRADESCO		105	35.667.234,13	2,59	2,59
. SAFRA		4	3.501.364,14	0,25	0,25
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		<u>68.994.957,93</u>	<u>181.732.124,31</u>	<u>13,22</u>	
. SANT FIC FI ISN RF D		337,13	61.712,54	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		4.262.615,91	7.549.997,28	0,55	0,55
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		9.604.401,24	29.660.863,22	2,16	2,16
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		388.393,04	50.424.274,14	3,67	3,67
. AF GERAES 30		730.445,00	828.431,49	0,06	0,06
. BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO		16.704,95	7.598.381,40	0,55	0,55
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		45.250,01	5.230.813,90	0,38	0,38
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		26.216,55	2.629.991,38	0,19	0,19
. AZ QUEST LUCE		20.884.194,16	30.182.384,99	2,20	2,20
. ARX VINSON FI RF CP		736.169,54	804.294,09	0,06	0,06
. CA AG VITESSE		33.975,19	777.891,22	0,06	0,06
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		32.246.298,44	41.228.280,11	3,00	3,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		4.713,99	130.900,73	0,01	0,01
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		7.000,00	31.655,18	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		4.958,18	30.621,87	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		9,76	447.406,03	0,03	0,03
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		3.274,84	4.114.224,74	0,30	0,30
. VALORES A RECEBER				0,00	0,00
<u>Debêntures</u>		<u>29.167</u>	<u>51.309.082,09</u>	<u>3,73</u>	
. LOJAS AMERICANAS		432	5.654.451,65	0,41	0,41
. ECOPISTAS		7.000	6.557.739,57	0,48	0,48
. CEMIG		20.000	30.395.436,27	2,21	2,21
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		849	410.060,93	0,03	0,03
. SABESP		746	7.715.437,05	0,56	0,56
. ESPÍRITO SANTO CENTRAIS ELÉTRICAS		140	575.956,62	0,04	0,04
. VALORES A RECEBER			<u>4.599.655,00</u>	0,33	0,33
. COMANCHE PART.			4.599.655,00	0,33	0,33
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		<u>0,00</u>	<u>-4.599.655,00</u>	<u>-0,33</u>	-0,33
. COMANCHE PART.			-4.599.655,00	-0,33	-0,33

Outros Títulos		33	15.684.325,47	1,14	
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		26	4.944.168,66	0,36	0,36
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	15.032.378,89	1,09	1,09
. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCARIO				0,00	0,00
. DEPOSITO A PRAZO COM GARANTIA ESPECIAL			0,00	0,00	0,00
. VALORES A RECEBER		1	3.274.905,95	0,24	0,24
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		-1,00	-7.567.128,03	-0,55	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO - ALOÉS		-1	-7.567.128,03	-0,55	-0,55
				0,00	0,00
B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			61.567.135,44	4,48	
B1. Mercado de Ações			21.619.415,33	1,57	
Companhias Abertas		541.112	16.970.728,76	1,23	
. AMBEV	ON	33.068	617.379,56	0,04	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	22.324	785.804,80	0,06	
. COSAN	ON	16.200	1.127.034,00	0,08	
. ECORODOVIAS	ON	39.700	647.110,00	0,05	
. GERDAU - GGBR	PN	50.964	1.019.280,00	0,07	
. ITAUSA	PN	130.709	1.841.689,81	0,13	
. LOGG COMERCIAL	ON	1.730	56.155,80	0,00	
. MRVE	ON	26.400	568.920,00	0,04	
. PÃO DE AÇUCAR	PN	21.400	1.875.710,00	0,14	
. PETROBRÁS	PN	75.517	2.279.103,06	0,17	
. RENT	ON	52.911	2.508.510,51	0,18	
. SUZANO PAPEL	PNA	19.900	789.632,00	0,06	
. VALE R. DOCE	PNA	50.289	2.680.403,70	0,19	
. VALORES A RECEBER				0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			173.995,52	0,01	
Instituições Financeiras		126.653	4.648.686,57	0,34	
. BRADESCO	PN	58.943	2.131.968,31	0,16	
. ITAU	PN	67.710	2.512.041,00	0,18	
. VALORES A PAGAR				0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			4.677,26	0,00	
B2. Fundos		10.297.453,22	39.947.720,11	2,91	
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		4.269.354,93	12.663.129,76	0,92	
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		42.148,06	8.074.721,01	0,59	
. MOAT CAPITAL FIA		2.130.692,87	8.271.099,35	0,60	
. SPX APACHE FIA		3.855.257,36	10.938.769,99	0,80	
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA				0,00	
. GUEPARDO INSTITUCIONAL 60 FIC FIA				0,00	
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		17.312.438	132.604.422,48	9,65	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.506,93	2.260.249,94	0,16	
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.281,00	20.903.265,28	1,52	
. FIP BVEP PLAZA		3.000,00	3.023.949,30	0,22	
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		6.329,65	4.307.147,81	0,31	
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.125.602,34	979.210,05	0,07	
. HAMILTON LANE FIC FIP		13.002,27	20.810.642,75	1,51	
. MULTINER FIP		10,17	-4.503,28	0,00	
. STRATUS SCP BR FIP		5.000.000,00	7.269.910,00	0,53	
. P2BR INFR III FIQFIP		6.329,21	14.543.593,18	1,06	
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		3.587.604,80	7.599.635,09	0,55	
. KINEA CHRONOS FIM		7.560.771,69	13.599.493,50	0,99	
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		6.337.198,69	10.347.088,47	0,75	
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		11.894.682,91	13.556.671,05	0,99	
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		47.508,29	13.408.069,34	0,98	
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		20.322.975	55.556.026,11	4,04	
. BB MM SCH INV EXTE FI		4.519.272,85	12.825.881,19	0,93	
. MSQUARE GL EQ FICFIM		3.305.204,08	10.278.014,64	0,75	
. VOT ALLIANZGI FIM		3.814.282,63	9.103.087,10	0,66	
. WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI		3.465,71	5.887.389,78	0,43	
. GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE		46.431,13	6.038.346,63	0,44	
. PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR		3.701.637,15	5.893.444,28	0,43	
. ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR		4.932.681,62	5.529.862,49	0,40	

E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			74.372.097,67	5,41	
E1 - Investimentos em Shopping Center			37.215.945,00	2,71	
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			37.215.945,00	2,71	
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00	
E2 - Investimento Imobiliário			8.778.000,00	0,64	
. PANAMBY			8.778.000,00	0,64	
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00	
E3 - Investimento Fundo Imobiliário		169.488,67	28.378.152,67	2,06	
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		79.208,00	9.322.781,60	0,68	
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		470,67	5.521.552,59	0,40	
. GGR COVEPI RENDA FII		89.810,00	13.489.462,00	0,98	
. VALORES A RECEBER			44.356,48	0,00	
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		1.364	27.219.571,71	1,98	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		1.364	26.246.149,44	1,91	
. VALORES A PAGAR (-)			-4.010,12	0,00	
. VALORES A RECEBER			977.432,39	0,07	
G - OUTROS			-440.281,55	-0,03	
. DISPONIVEL			442.894,55	0,03	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			0,00	0,00	
. OUTROS REALIZAVEIS			0,00	0,00	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-883.176,10	-0,06	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			0,00	0,00	
GESTÃO TERCEIRIZADA			DISTRIBUIÇÃO	(%) EM RELAÇÃO A GESTÃO TERCEIRIZADA	(%) EM RELAÇÃO AO RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS					
- SANT FIC FI ISN RF D			61.712,54	0,01%	0,00%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO			7.549.997,28	1,72%	0,55%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES			29.660.863,22	6,77%	2,16%
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP			50.424.274,14	11,51%	3,67%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA			12.663.129,76	2,89%	0,92%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA			8.074.721,01	1,84%	0,59%
- MOAT CAPITAL FIA			8.271.099,35	1,89%	0,60%
- SPX APACHE FIA			10.938.769,99	2,50%	0,80%
- BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO			7.598.381,40	1,73%	0,55%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP			5.230.813,90	1,19%	0,38%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II			2.629.991,38	0,60%	0,19%
- CA INDOSUEZ VITESSE FI RENDA FIXA CP			777.891,22	0,18%	0,06%
- AZ QUEST LUCE			30.182.384,99	6,89%	2,20%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER			130.900,73	0,03%	0,01%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER II			31.655,18	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER III			30.621,87	0,01%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.			447.406,03	0,10%	0,03%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL			4.114.224,74	0,94%	0,30%
- AF GERAES 30			828.431,49	0,19%	0,06%
- ARX VINSON FI RF CP			804.294,09	0,18%	0,06%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM			41.228.280,11	9,41%	3,00%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP			2.260.249,94	0,52%	0,16%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			20.903.265,28	4,77%	1,52%
- FIP BVEP PLAZA			3.023.949,30	0,69%	0,22%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES			4.307.147,81	0,98%	0,31%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			979.210,05	0,22%	0,07%
- HAMILTON LANE FIC FIP			20.810.642,75	4,75%	1,51%
- MULTINER FIP			(4.503,28)	0,00%	0,00%
- STRATUS SCP BR FIP			7.269.910,00	1,66%	0,53%
- P2BR INFR III FIQFIP			14.543.593,18	3,32%	1,06%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			7.599.635,09	1,73%	0,55%
- KINEA CHRONOS FIM			13.599.493,50	3,10%	0,99%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM			10.347.088,47	2,36%	0,75%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM			13.556.671,05	3,09%	0,99%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM			13.408.069,34	3,06%	0,98%

INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO			9.367.138,08	2,14%	0,68%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			5.521.552,59	1,26%	0,40%
- GGR COVEPI RENDA FII			13.489.462,00	3,08%	0,98%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- BB MM SCH INV EXTE FI			12.825.881,19	2,93%	0,93%
- MSQUARE GL EQ FICFIM			10.278.014,64	2,35%	0,75%
- VOT ALLIANZGI FIM			9.103.087,10	2,08%	0,66%
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI			5.887.389,78	1,34%	0,43%
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE			6.038.346,63	1,38%	0,44%
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR			5.893.444,28	1,34%	0,43%
- ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR			5.529.862,49	1,26%	0,40%
TOTAL			438.218.445,68	100,00%	31,88%
GESTÃO PRÓPRIA			DISTRIBUIÇÃO	(%) EM RELAÇÃO A GESTÃO PRÓPRIA	(%) EM RELAÇÃO AO RECURSOS GARANTIDORES
RENTA FIXA			837.039.484,82	89,39%	60,89%
RENTA VARIÁVEL			21.619.415,33	2,31%	1,57%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			50.938.113,66	5,44%	3,71%
EMPRÉSTIMO PESSOAL			27.219.571,71	2,91%	1,98%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)			-440.281,55	-0,05%	-0,03%
TOTAL			936.376.303,97	100,00%	68,12%