

**RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL
PLANO II**

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.12.2019

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			<u>1.335.230.922,77</u>		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			<u>793.946.343,43</u>	<u>59,46</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>152.793</u>	<u>501.584.349,37</u>	<u>37,57</u>	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			<u>253.877.430,54</u>	<u>19,01</u>	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		<u>1.500,00</u>	<u>3.120.086,93</u>	<u>0,23</u>	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	1	13.141.991,09	0,98	0,98
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	1	3.403.988,49	0,25	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	1	2.047.692,08	0,15	0,41
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	1.500	3.120.086,93	0,23	0,23
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-1	-13.141.991,09	-0,98	-0,98
- BANCO MORADA		-2	-5.451.680,57	-0,41	-0,41
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		<u>141</u>	<u>41.062.692,44</u>	<u>3,08</u>	
. BRADESCO		71	21.949.489,69	1,64	
. PARANÁ BANCO		60,00	13.328.520,66	1,00	
. ABC		10,00	5.784.682,09	0,43	
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		<u>109.302.994,38</u>	<u>209.694.651,17</u>	<u>15,70</u>	
. AF GERAES 30		9.341.039,94	10.594.105,88	0,79	0,79
. BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP		3.024.304,06	341,44	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		11.531.185,15	14.919.381,56	1,12	1,12
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		15.003.601,27	47.248.842,13	3,54	3,54
. BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO		44.917,80	14.926.373,23	1,12	1,12
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		26.216,55	3.487.209,26	0,26	0,26
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		52.433,09	5.259.982,77	0,39	0,39
. AZ QUEST LUCE		32.036.900,73	47.078.031,30	3,53	3,53
. CA INDOSUEZ VITESSE FI RENDA FIXA CP		457.476,00	10.474.307,72	0,78	0,78
. ARX VINSON FI RF CP		9.694.932,15	10.592.093,41	0,79	0,79
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		28.075.967,46	35.896.332,51	2,69	2,69
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		2.474,99	68.727,05	0,01	0,01
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		3.000,00	13.566,50	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		1.976,00	12.203,83	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		19,52	894.703,13	0,07	0,07
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		6.549,68	8.228.449,45	0,62	0,62
. VALORES A RECEBER				0,00	0,00
<u>Debêntures</u>		<u>21.341</u>	<u>35.061.867,01</u>	<u>2,63</u>	
. LOJAS AMERICANAS		288	3.769.634,43	0,28	0,28
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		700	338.095,00	0,03	0,03
. CEMIG		10.000	15.197.718,10	1,14	1,14
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	9.089.941,55	0,68	0,68
. SABESP		1.356	5.823.112,85	0,44	0,44
. ESPÍRITO SANTO CENTRAIS ELÉTRICAS		205	843.365,08	0,06	0,06
. VALORES A RECEBER			<u>3.127.765,40</u>	<u>0,23</u>	
. COMANCHE PART.			3.127.765,40	0,23	0,23
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		<u>0,00</u>	<u>-3.127.765,40</u>	<u>-0,23</u>	
. COMANCHE PART.			-3.127.765,40	-0,23	-0,23
<u>Outros Títulos</u>		<u>18</u>	<u>3.422.696,51</u>	<u>0,26</u>	
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		18	3.422.696,51	0,26	0,26

B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			232.451.121,07	17,41	
B1. Mercado de Ações			56.269.279,27	4,21	
Companhias Abertas		1.405.529	43.411.837,73	3,25	
. AMBEV	ON	87.539	1.634.353,13	0,12	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	64.254	2.261.740,80	0,17	
. COSAN	ON	48.600	3.381.102,00	0,25	
. ECORODOVIAS	ON	109.500	1.784.850,00	0,13	
. GERDAU - GGBR	PN	96.424	1.928.480,00	0,14	
. ITAUSA	ON	216	3.034,80	0,00	
. ITAUSA	PN	360.800	5.083.672,00	0,38	
. LOGG COMERCIAL	ON	5.656	183.593,76	0,01	
. MRVE	ON	78.400	1.689.520,00	0,13	
. PÃO DE AÇUCAR	PN	42.600	3.733.890,00	0,28	
. PETROBRÁS	PN	183.377	5.534.317,86	0,41	
. RENT	ON	136.467	6.469.900,47	0,48	
. SUZANO PAPEL	PNA	62.200	2.468.096,00	0,18	
. VALE R. DOCE	PNA	129.496	6.902.136,80	0,52	
. VALORES A RECEBER				0,00	
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			353.150,11	0,03	
Instituições Financeiras		350.332	12.857.441,54	0,96	
. BRADESCO	PN	164.271	5.941.682,07	0,44	
. ITAU	PN	186.061	6.902.863,10	0,52	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			12.896,37	0,00	
B2. Fundos		39.225.067,92	176.181.841,80	13,19	
. M. SQUARE INST. FIC FIA		6.293.092,63	23.873.007,80	1,79	
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		11.421.519,84	33.876.824,50	2,54	
. MOAT CAPITAL FIA		8.220.647,61	31.911.588,09	2,39	
. SPX APACHE FIA		10.085.636,57	28.616.626,17	2,14	
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.096.544,16	27.503.980,88	2,06	
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	21.798.989,17	1,63	
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		44.894,19	8.600.825,19	0,64	
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		60.532.556,97	150.012.037,08	11,23	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II- FIP		10.778,33	-129.146,55	-0,01	
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		395,93	6.460.790,26	0,48	
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.090,00	17.150.065,64	1,28	
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		2.000,00	2.015.966,20	0,15	
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		2.675,37	1.845.823,28	0,14	
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		744.560,57	652.806,85	0,05	
. HAMILTON LANE FIC FIP		6.562,57	10.720.634,18	0,80	
.STRATUS SCP BR FIP		4.643.471,00	7.269.910,00	0,54	
. P2 BR INFRAESTRUTURA III FIC DE FIP		2.926,79	7.279.117,93	0,55	
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	6.656.372,50	0,50	
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		5.509.985,26	11.671.819,96	0,87	
. KINEA CHRONOS FIM		11.925.565,78	21.450.410,23	1,61	
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		9.523.673,63	15.548.638,96	1,16	
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		18.077.115,65	20.602.946,05	1,54	
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		73.756,10	20.815.881,63	1,56	
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		20.946.555	57.346.628,59	4,29	
. BB MM SCH INV EXTE FI		5.128.757,86	14.555.624,58	1,09	
. MSQUARE GL EQ FICFIM		3.342.850,69	10.395.082,29	0,78	
. VOT ALLIANZGI FIM		3.790.730,70	9.046.878,54	0,68	
. WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI		3.465,71	5.887.389,78	0,44	
. GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE		46.431,13	6.038.346,63	0,45	
. PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR		3.701.637,15	5.893.444,28	0,44	
. ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR		4.932.681,62	5.529.862,49	0,41	
E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			40.734.819,66	3,05	
E1 - Investimentos em Shopping Center			24.535.649,63	1,84	
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			24.468.930,00	1,83	
. VALORES A RECEBER			66.719,63	0,00	

E3 - Investimento Fundo Imobiliário		111.065,78	16.199.170,03	1,21	
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		67.752,00	2.330.695,40	0,17	
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		313,78	3.681.035,11	0,28	
. GGR COVEPI RENDA FII		43.000,00	10.176.350,40	0,76	
. VALORES A RECEBER			11.089,12	0,00	
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00	
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		2.720	61.454.253,92	4,60	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		2.720	58.845.794,36	4,41	
. VALORES A PAGAR (-)			-19.315,04	0,00	
. VALORES A RECEBER			2.627.774,60	0,20	
G - OUTROS			-714.280,98	-0,05	
. DISPONIVEL			325.148,62	0,02	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			0,00	0,00	
. OUTROS REALIZAVEIS			0,00	0,00	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-1.039.429,60	-0,08	
. 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			341,44	0,00%	0,00%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO			14.919.381,56	2,45%	1,12%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES			47.248.842,13	7,75%	3,54%
- M. SQUARE INST. FIC FIA			23.873.007,80	3,92%	1,79%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA			33.876.824,50	5,56%	2,54%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA			8.600.825,19	1,41%	0,64%
- MOAT CAPITAL FIA			31.911.588,09	5,24%	2,39%
- BBM SMID CAPS FICFIA			27.503.980,88	4,51%	2,06%
- BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO			14.926.373,23	2,45%	1,12%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP			3.487.209,26	0,57%	0,26%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II			5.259.982,77	0,86%	0,39%
- CA INDOSUEZ VITESSE FI RENDA FIXA CP			10.474.307,72	1,72%	0,78%
- AZ QUEST LUCE			47.078.031,30	7,72%	3,53%
- IBIUNA EQ. FIC FIA			21.798.989,17	3,58%	1,63%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER			68.727,05	0,01%	0,01%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II			13.566,50	0,00%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III			12.203,83	0,00%	0,00%
- SPX APACHE FIA			28.616.626,17	4,70%	2,14%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.			894.703,13	0,15%	0,07%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL			8.228.449,45	1,35%	0,62%
- ARX VINSON FI RF			10.592.093,41	1,74%	0,79%
- AF GERAES 30			10.594.105,88	1,74%	0,79%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM			35.896.332,51	5,89%	2,69%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP			(129.146,55)	-0,02%	-0,01%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			6.460.790,26	1,06%	0,48%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP			17.150.065,64	2,81%	1,28%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA			2.015.966,20	0,33%	0,15%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES			1.845.823,28	0,30%	0,14%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			652.806,85	0,11%	0,05%
- HAMILTON LANE FIC FIP			10.720.634,18	1,76%	0,80%
- STRATUS SCP BR FIP			7.269.910,00	1,19%	0,54%
- P2BR INFR III FIQFIP			7.279.117,93	1,19%	0,55%
- COPA FLORESTAL III			6.656.372,50	1,09%	0,50%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			11.671.819,96	1,92%	0,87%
- KINEA CHRONOS FIM			21.450.410,23	3,52%	1,61%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM			15.548.638,96	2,55%	1,16%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM			20.602.946,05	3,38%	1,54%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM			20.815.881,63	3,42%	1,56%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			3.681.035,11	0,60%	0,28%
- GGR COVEPI RENDA FII			10.176.350,40	1,67%	0,76%
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO			2.341.784,52	0,38%	0,18%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- BB MM SCH INV EXTE FI			14.555.624,58	2,39%	1,09%
- MSQUARE GL EQ FICFIM			10.395.082,29	1,71%	0,78%
- VOT ALLIANZGI FIM			9.046.878,54	1,48%	0,68%
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI 8			5.887.389,78	0,97%	0,44%
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE			6.038.346,63	0,99%	0,45%
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR			5.893.444,28	0,97%	0,44%
- ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR			5.529.862,49	0,91%	0,41%
TOTAL			609.434.328,71	100,00%	45,64%
GESTÃO PRÓPRIA			DISTRIBUIÇÃO	(%) EM RELAÇÃO A GESTÃO PRÓPRIA	(%) EM RELAÇÃO AO RECURSOS GARANTIDORES
RENDA FIXA			580.828.995,75	80,03%	43,50%
RENDA VARIÁVEL			56.269.279,27	7,75%	4,21%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			27.958.346,14	3,85%	2,09%
EMPRÉSTIMO PESSOAL			61.454.253,92	8,47%	4,60%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)			-714.280,98	-0,10%	-0,05%
TOTAL			725.796.594,10	100,00%	54,36%