

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 28.02.2020

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.407.397.042,28		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			742.126.718,39	52,73	
TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOIRO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOIRO NACIONAL					
Nota do Tesouro Nacional		152.793	501.539.755,77	35,64	
APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS			208.929.808,27	14,85	
Certificado de Depósito Bancário		1.500,00	3.188.393,25	0,23	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	1	13.141.991,09	0,93	0,93
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	1	3.403.988,49	0,24	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	1	2.047.692,08	0,15	0,39
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	1.500	3.188.393,25	0,23	0,23
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-1	-13.141.991,09	-0,93	-0,93
- BANCO MORADA		-2	-5.451.680,57	-0,39	-0,39
Letra Financeira Subordinada		141	52.036.310,58	3,70	
. BRADESCO		71	22.510.303,32	1,60	
. PARANÁ BANCO		60,00	23.610.311,69	1,68	
. ABC		10,00	5.915.695,57	0,42	
Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.		81.153.865,39	153.705.104,44	10,92	
. AF GERAES 30		9.341.039,94	10.675.237,48	0,76	
. BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMÁRIAS II FIRF CP		3.024.304,06	255,55	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		4.651.846,29	8.295.344,41	0,59	0,59
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		8.225.151,04	25.582.491,48	1,82	1,82
. BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO		18.101,55	8.290.075,77	0,59	0,59
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		30.166,67	3.315.560,30	0,24	0,24
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		52.433,09	5.356.395,18	0,38	0,38
. AZ QUEST LUCE		17.568.426,97	25.572.976,84	1,82	1,82
. CA INDOSUEZ VITESSE FI RENDA FIXA CP		457.476,00	10.531.628,10	0,75	0,75
. ARX VINSON FI RF CP		9.694.932,15	10.670.020,61	0,76	0,76
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		28.075.967,46	36.257.047,49	2,58	2,58
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		2.474,99	68.018,24	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		3.000,00	14.351,76	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		1.976,00	8.380,81	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		19,52	678.055,90	0,05	0,05
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		6.549,68	8.389.264,52	0,60	0,60
. VALORES A RECEBER				0,00	0,00
Debêntures		20.975	31.657.154,35	2,25	
. LOJAS AMERICANAS		288	3.826.297,12	0,27	0,27
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		700	190.263,86	0,01	0,01
. CEMIG		10.000	14.702.156,33	1,04	1,04
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	9.597.183,80	0,68	0,68
. SABESP		990	2.928.989,32	0,21	0,21
. ESPÍRITO SANTO CENTRAIS ELÉTRICAS		205	412.263,92	0,03	0,03
. VALORES A RECEBER			3.127.765,40	0,22	
. COMANCHE PART.			3.127.765,40	0,22	0,22
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS		0,00	-3.127.765,40	-0,22	
. COMANCHE PART.			-3.127.765,40	-0,22	-0,22

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

B - INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			215.899.679,36	15,34
B1. Mercado de Ações			50.084.850,70	3,56
Companhias Abertas		1.405.529	38.915.501,10	2,77
. AMBEV	ON	87.539	1.272.817,06	0,09
. BRF - BRASIL FOODS	ON	64.254	1.737.428,16	0,12
. COSAN	ON	48.600	3.556.062,00	0,25
. ECORODOVIAS	ON	109.500	1.727.910,00	0,12
. GERDAU - GGBR	PN	96.424	1.632.458,32	0,12
. ITAUSA	ON	216	2.751,84	0,00
. ITAUSA	PN	360.800	4.333.208,00	0,31
. LOGG COMERCIAL	ON	5.656	155.992,48	0,01
. MRVE	ON	78.400	1.528.016,00	0,11
. PÃO DE AÇUCAR	PN	42.600	3.071.886,00	0,22
. PETROBRÁS	PN	183.377	4.646.773,18	0,33
. RENT	ON	136.467	6.760.575,18	0,48
. SUZANO PAPEL	PNA	62.200	2.372.308,00	0,17
. VALE R. DOCE	PNA	129.496	5.737.967,76	0,41
. VALORES A RECEBER				0,00
. VALORES A PAGAR				0,00
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			379.347,12	0,03
Instituições Financeiras		350.332	11.169.349,60	0,79
. BRADESCO	PN	164.271	5.015.193,63	0,36
. ITAU	PN	186.061	5.953.952,00	0,42
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			200.203,97	0,01
B2. Fundos		39.225.067,92	165.814.828,66	11,78
. M. SQUARE INST. FIC FIA		6.293.092,63	22.745.798,17	1,62
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		11.421.519,84	33.290.252,59	2,37
. MOAT CAPITAL FIA		8.220.647,61	28.925.742,01	2,06
. SPX APACHE FIA		10.085.636,57	26.609.740,81	1,89
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.096.544,16	25.488.149,51	1,81
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	20.633.059,69	1,47
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		44.894,19	8.122.085,88	0,58
C - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		60.895.674,57	147.140.016,73	10,45
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II- FIP		10.858,75	-100.216,13	-0,01
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		395,93	6.463.335,29	0,46
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.220,00	17.323.867,33	1,23
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		2.000,00	2.014.577,70	0,14
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		2.719,77	1.991.708,79	0,14
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		750.401,73	650.385,51	0,05
. HAMILTON LANE FIC FIP		6.698,14	9.963.156,27	0,71
. STRATUS SCP BR FIP		5.000.000,00	7.252.960,00	0,52
. P2 BR INFRAESTRUTURA III FIC DE FIP		3.283,83	7.462.685,75	0,53
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	6.652.905,40	0,47
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		5.509.985,26	11.522.763,30	0,82
. KINEA CHRONOS FIM		11.925.565,78	21.235.751,23	1,51
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		9.523.673,63	15.747.480,02	1,12
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		18.077.115,65	20.369.288,48	1,45
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		73.756,10	18.589.367,83	1,32
D - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		20.946.555	57.480.695,81	4,08
. BB MM SCH INV EXTE FI		5.128.757,86	14.698.901,20	1,04
. MSQUARE GL EQ FICFIM		3.342.850,69	10.782.461,39	0,77
. VOT ALLIANZGI FIM		3.790.730,70	9.128.459,69	0,65
. WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI		3.465,71	5.711.999,10	0,41
. GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE		46.431,13	5.865.380,93	0,42
. PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR		3.701.637,15	5.890.736,94	0,42
. ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR		4.932.681,62	5.402.756,56	0,38

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

E - INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			40.614.647,18	2,89
E1 - Investimentos em Shopping Center			24.322.346,22	1,73
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			24.293.525,49	1,73
. VALORES A RECEBER			28.820,73	0,00
E3 - Investimento Fundo Imobiliário		80.431,78	14.063.306,38	1,00
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		19.802,00	2.158.418,00	0,15
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		313,78	3.682.298,39	0,26
. GGR COVEPI RENDA FII		60.316,00	8.210.817,08	0,58
. VALORES A RECEBER			11.772,91	0,00
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00
E3 - Outros Investimentos Imobiliário		18,00	2.228.994,58	0,16
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		18	2.228.994,58	0,16
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		2.690	59.886.849,05	4,26
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		2.690	57.328.342,46	4,07
. VALORES A PAGAR (-)			-22.858,81	0,00
. VALORES A RECEBER			2.581.365,40	0,18
G - OUTROS			144.248.435,76	10,25
. DISPONIVEL			316.347,31	0,02
. DEPOSITOS JUDICIAIS			0,00	0,00
. OUTROS REALIZAVEIS			72.229.230,60	5,13
. OUTROS DIREITOS A RECEBER			72.296.950,84	5,14
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-594.092,99	-0,04
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			0,00	0,00

GESTÃO TERCEIRIZADA	DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO TERCEIRIZADA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS			
- BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP	255,55	0,00%	0,00%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO	8.295.344,41	1,54%	0,59%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES	25.582.491,48	4,75%	1,82%
- M. SQUARE INST. FIC FIA	22.745.798,17	4,23%	1,62%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	33.290.252,59	6,19%	2,37%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA	8.122.085,88	1,51%	0,58%
- MOAT CAPITAL FIA	28.925.742,01	5,37%	2,06%
- BBM SMID CAPS FICFIA	25.488.149,51	4,74%	1,81%
- BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	8.290.075,77	1,54%	0,59%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP	3.315.560,30	0,62%	0,24%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II	5.356.395,18	1,00%	0,38%
- CA INDOSUEZ VITESSE FI RENDA FIXA CP	10.531.628,10	1,96%	0,75%
- AZ QUEST LUCE	25.572.976,84	4,75%	1,82%
- IBIUNA EQ. FIC FIA	20.633.059,69	3,83%	1,47%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	68.018,24	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	14.351,76	0,00%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	8.380,81	0,00%	0,00%
- SPX APACHE FIA	26.609.740,81	4,94%	1,89%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.	678.055,90	0,13%	0,05%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL	8.389.264,52	1,56%	0,60%
- ARX VINSON FI RF	10.670.020,61	1,98%	0,76%
- AF GERAES 30	10.675.237,48	1,98%	0,76%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM	36.257.047,49	6,74%	2,58%
- BRAD RF DI FED EXTRA	-	0,00%	0,00%

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP			(100.216,13)	-0,02%	-0,01%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			6.463.335,29	1,20%	0,46%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP			17.323.867,33	3,22%	1,23%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVPE PLAZA			2.014.577,70	0,37%	0,14%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES			1.991.708,79	0,37%	0,14%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			650.385,51	0,12%	0,05%
- HAMILTON LANE FIC FIP			9.963.156,27	1,85%	0,71%
- STRATUS SCP BR FIP			7.252.960,00	1,35%	0,52%
- P2BR INFR III FIQFIP			7.462.685,75	1,39%	0,53%
- COPA FLORESTAL III			6.652.905,40	1,24%	0,47%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			11.522.763,30	2,14%	0,82%
- KINEA CHRONOS FIM			21.235.751,23	3,95%	1,51%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM			15.747.480,02	2,93%	1,12%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM			20.369.288,48	3,78%	1,45%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM			18.589.367,83	3,45%	1,32%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			3.682.298,39	0,68%	0,26%
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO			2.170.190,91	0,40%	0,15%
- GGR COVEPI RENDA FII			8.210.817,08	1,53%	0,58%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- BB MM SCH INV EXTE FI			14.698.901,20	2,73%	1,04%
- MSQUARE GL EQ FICFIM			10.782.461,39	2,00%	0,77%
- VOT ALLIANZGI FIM			9.128.459,69	1,70%	0,65%
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI			5.711.999,10	1,06%	0,41%
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE			5.865.380,93	1,09%	0,42%
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR			5.890.736,94	1,09%	0,42%
- ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR			5.402.756,56	1,00%	0,38%
TOTAL			538.203.952,02	100,00%	38,24%

GESTÃO PRÓPRIA	DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENTA FIXA	588.421.613,95	67,70%	41,81%
RENTA VARIÁVEL	50.084.850,70	5,76%	3,56%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	26.551.340,80	3,05%	1,89%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	59.886.849,05	6,89%	4,26%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	144.248.435,76	16,60%	10,25%
TOTAL	869.193.090,26	100,00%	61,76%