

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.01.2020

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.350.619.263,89		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			805.180.204,26	59,62	
TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOIRO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOIRO NACIONAL					
<u>Nota do Tesouro Nacional</u>		152.793	508.145.598,98	37,62	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			264.263.292,75	19,57	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		1.500,00	3.169.749,19	0,23	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	1	13.141.991,09	0,97	0,97
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	1	3.403.988,49	0,25	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	1	2.047.692,08	0,15	0,40
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	1.500	3.169.749,19	0,23	0,23
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-1	-13.141.991,09	-0,97	-0,97
- BANCO MORADA		-2	-5.451.680,57	-0,40	-0,40
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		141	41.726.582,56	3,09	
. BRADESCO		71	22.360.756,40	1,66	
. PARANÁ BANCO		60,00	13.488.018,74	1,00	
. ABC		10,00	5.877.807,42	0,44	
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		109.237.787,60	219.366.961,00	16,24	
. AF GERAES 30		9.341.039,94	10.641.568,64	0,79	
. BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP		3.024.304,06	285,79	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		11.294.133,62	20.079.653,82	1,49	1,49
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		15.057.426,28	46.697.123,28	3,46	3,46
. BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO		44.014,42	20.099.883,84	1,49	1,49
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		30.166,67	3.376.055,29	0,25	0,25
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		52.433,09	5.315.995,67	0,39	0,39
. AZ QUEST LUCE		32.151.873,73	46.682.621,12	3,46	3,46
. CA INDOSUEZ VITESSE FI RENDA FIXA CP		457.476,00	10.518.342,99	0,78	0,78
. ARX VINSON FI RF CP		9.694.932,15	10.638.083,94	0,79	0,79
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		28.075.967,46	35.990.057,95	2,66	2,66
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		2.474,99	68.528,75	0,01	0,01
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		3.000,00	14.275,38	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		1.976,00	7.667,87	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		19,52	910.798,27	0,07	0,07
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		6.549,68	8.326.018,40	0,62	0,62
. VALORES A RECEBER				0,00	0,00
<u>Debêntures</u>		20.975	32.771.312,53	2,43	
. LOJAS AMERICANAS		288	3.796.761,87	0,28	0,28
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		700	264.687,18	0,02	0,02
. CEMIG		10.000	15.384.592,23	1,14	1,14
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	9.508.715,73	0,70	0,70
. SABESP		990	2.969.435,79	0,22	0,22
. ESPÍRITO SANTO CENTRAIS ELÉTRICAS		205	847.119,73	0,06	0,06
. VALORES A RECEBER			3.127.765,40	0,23	
. COMANCHE PART.			3.127.765,40	0,23	0,23
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS		0,00	-3.127.765,40	-0,23	
. COMANCHE PART.			-3.127.765,40	-0,23	-0,23

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

B - INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			233.685.410,53	17,30
B1. Mercado de Ações			54.737.014,72	4,05
Companhias Abertas		1.405.529	43.214.723,14	3,20
. AMBEV	ON	87.539	1.562.571,15	0,12
. BRF - BRASIL FOODS	ON	64.254	1.962.959,70	0,15
. COSAN	ON	48.600	3.873.420,00	0,29
. ECORODOVIAS	ON	109.500	1.941.435,00	0,14
. GERDAU - GGBR	PN	96.424	1.933.301,20	0,14
. ITAUSA	ON	216	2.833,92	0,00
. ITAUSA	PN	360.800	4.639.888,00	0,34
. LOGG COMERCIAL	ON	5.656	178.729,60	0,01
. MRVE	ON	78.400	1.636.208,00	0,12
. PÃO DE AÇUCAR	PN	42.600	3.624.408,00	0,27
. PETROBRÁS	PN	183.377	5.217.075,65	0,39
. RENT	ON	136.467	7.318.725,21	0,54
. SUZANO PAPEL	PNA	62.200	2.467.474,00	0,18
. VALE R. DOCE	PNA	129.496	6.509.763,92	0,48
. VALORES A RECEBER				0,00
. VALORES A PAGAR				0,00
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			345.929,79	0,03
Instituições Financeiras		366.759	11.522.291,58	0,85
. BRADESCO	PN	180.698	5.402.873,19	0,40
. ITAU	PN	186.061	6.106.522,02	0,45
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			12.896,37	0,00
B2. Fundos		39.225.067,92	178.948.395,81	13,25
. M. SQUARE INST. FIC FIA		6.293.092,63	24.278.123,24	1,80
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		11.421.519,84	35.212.060,13	2,61
. MOAT CAPITAL FIA		8.220.647,61	31.698.014,02	2,35
. SPX APACHE FIA		10.085.636,57	28.872.450,35	2,14
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.096.544,16	27.721.429,81	2,05
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	22.369.158,72	1,66
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		44.894,19	8.797.159,54	0,65
C - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		60.895.674,57	150.382.873,04	11,13
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II- FIP		10.858,75	-111.239,79	-0,01
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		395,93	6.463.652,35	0,48
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.220,00	17.322.369,06	1,28
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		2.000,00	2.015.203,49	0,15
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		2.719,77	1.848.322,92	0,14
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		750.401,73	651.429,45	0,05
. HAMILTON LANE FIC FIP		6.698,14	11.071.162,66	0,82
. STRATUS SCP BR FIP		5.000.000,00	7.262.390,00	0,54
. P2 BR INFRAESTRUTURA III FIC DE FIP		3.283,83	7.460.664,39	0,55
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	6.653.184,60	0,49
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		5.509.985,26	11.654.376,46	0,86
. KINEA CHRONOS FIM		11.925.565,78	21.568.620,01	1,60
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		9.523.673,63	15.570.026,22	1,15
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		18.077.115,65	20.565.078,12	1,52
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		73.756,10	20.387.633,14	1,51
D - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		20.946.555	59.454.961,02	4,40
. BB MM SCH INV EXTE FI		5.128.757,86	15.440.042,97	1,14
. MSQUARE GL EQ FICFIM		3.342.850,69	11.162.105,63	0,83
. VOT ALLIANZGI FIM		3.790.730,70	9.412.368,21	0,70
. WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI		3.465,71	5.873.433,82	0,43
. GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE		46.431,13	6.071.769,18	0,45
. PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR		3.701.637,15	5.923.840,46	0,44
. ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR		4.932.681,62	5.571.400,75	0,41

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

E - INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			41.559.992,54	3,08	
E1 - Investimentos em Shopping Center			24.406.215,30	1,81	
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			24.381.227,74	1,81	
. VALORES A RECEBER			24.987,56	0,00	
E3 - Investimento Fundo Imobiliário		84.361,78	14.944.289,45	1,11	
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		19.802,00	2.276.437,92	0,17	
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		313,78	3.681.596,21	0,27	
. GGR COVEPI RENDA FII		64.246,00	8.975.166,20	0,66	
. VALORES A RECEBER			11.089,12	0,00	
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00	
E3 - Outros Investimentos Imobiliário		18,00	2.209.487,79	0,16	
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		18	2.209.487,79	0,16	
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		2.711	60.808.727,17	4,50	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		2.711	58.225.068,93	4,31	
. VALORES A PAGAR (-)			-27.930,07	0,00	
. VALORES A RECEBER			2.611.588,31	0,19	
G - OUTROS			-452.904,67	-0,03	
. DISPONIVEL			196.855,12	0,01	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			0,00	0,00	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-649.759,79	-0,05	
. 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			285,79	0,00%	0,00%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO			20.079.653,82	3,22%	1,49%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES			46.697.123,28	7,49%	3,46%
- M. SQUARE INST. FIC FIA			24.278.123,24	3,90%	1,80%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA			35.212.060,13	5,65%	2,61%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA			8.797.159,54	1,41%	0,65%
- MOAT CAPITAL FIA			31.698.014,02	5,09%	2,35%
- BBM SMID CAPS FICFIA			27.721.429,81	4,45%	2,05%
- BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO			20.099.883,84	3,23%	1,49%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP			3.376.055,29	0,54%	0,25%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II			5.315.995,67	0,85%	0,39%
- CA INDOSUEZ VITESSE FI RENDA FIXA CP			10.518.342,99	1,69%	0,78%
- AZ QUEST LUCE			46.682.621,12	7,49%	3,46%
- IBIUNA EQ. FIC FIA			22.369.158,72	3,59%	1,66%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER			68.528,75	0,01%	0,01%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II			14.275,38	0,00%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III			7.667,87	0,00%	0,00%
- SPX APACHE FIA			28.872.450,35	4,63%	2,14%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.			910.798,27	0,15%	0,07%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL			8.326.018,40	1,34%	0,62%
- ARX VINSON FI RF			10.638.083,94	1,71%	0,79%
- AF GERAES 30			10.641.568,64	1,71%	0,79%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM			35.990.057,95	5,78%	2,66%
- BRAD RF DI FED EXTRA			-	0,00%	0,00%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP			(111.239,79)	-0,02%	-0,01%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			6.463.652,35	1,04%	0,48%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP			17.322.369,06	2,78%	1,28%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVPE PLAZA			2.015.203,49	0,32%	0,15%

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES			1.848.322,92	0,30%	0,14%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			651.429,45	0,10%	0,05%
- HAMILTON LANE FIC FIP			11.071.162,66	1,78%	0,82%
- STRATUS SCP BR FIP			7.262.390,00	1,17%	0,54%
- P2BR INFR III FIQFIP			7.460.664,39	1,20%	0,55%
- COPA FLORESTAL III			6.653.184,60	1,07%	0,49%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			11.654.376,46	1,87%	0,86%
- KINEA CHRONOS FIM			21.568.620,01	3,46%	1,60%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM			15.570.026,22	2,50%	1,15%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM			20.565.078,12	3,30%	1,52%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM			20.387.633,14	3,27%	1,51%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			3.681.596,21	0,59%	0,27%
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO			2.287.527,04	0,37%	0,17%
- GGR COVEPI RENDA FII			8.975.166,20	1,44%	0,66%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- BB MM SCH INV EXTE FI			15.440.042,97	2,48%	1,14%
- MSQUARE GL EQ FICFIM			11.162.105,63	1,79%	0,83%
- VOT ALLIANZGI FIM			9.412.368,21	1,51%	0,70%
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI			5.873.433,82	0,94%	0,43%
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE			6.071.769,18	0,97%	0,45%
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR			5.923.840,46	0,95%	0,44%
- ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR			5.571.400,75	0,89%	0,41%
TOTAL			623.097.480,32	100,00%	46,13%

GESTÃO PRÓPRIA	DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENTA FIXA	585.813.243,26	80,52%	43,37%
RENTA VARIÁVEL	54.737.014,72	7,52%	4,05%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	26.615.703,09	3,66%	1,97%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	60.808.727,17	8,36%	4,50%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	-452.904,67	-0,06%	-0,03%
TOTAL	727.521.783,57	100,00%	53,87%