

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO I

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 28.02.2020

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.457.340.752,14		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			944.672.792,79	64,82	
TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOIRO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOIRO NACIONAL					
Nota do Tesouro Nacional		197.414	698.924.244,71	47,96	
APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS			189.128.824,41	12,98	
Certificado de Depósito Bancário		3.502,00	7.439.584,25	0,51	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	1	24.254.454,66	1,66	1,66
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	1	2.049.020,58	0,14	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	1	3.383.584,48	0,23	0,37
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	3.500	7.439.584,25	0,51	0,51
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-1	-24.254.454,66	-1,66	-1,66
- BANCO MORADA		-1	-5.432.605,06	-0,37	-0,37
Letra Financeira Subordinada		219	70.478.908,05	4,84	
. PARANÁ BANCO		100	24.499.022,74	1,68	1,68
. ABC		10	5.915.695,57	0,41	0,41
. BRADESCO		105	36.488.131,54	2,50	2,50
. SAFRA		4	3.576.058,20	0,25	0,25
Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.		31.017.652,87	111.210.332,11	7,63	
. SANT FIC FI ISN RF D		337,13	62.117,51	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		1.231.357,46	2.195.802,18	0,15	0,15
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		2.211.553,90	6.878.543,46	0,47	0,47
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		388.393,09	51.263.122,94	3,52	3,52
. AF GERAES 30		730.445,00	834.775,77	0,06	0,06
. BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO		4.788,15	2.192.858,82	0,15	0,15
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		45.250,01	4.973.340,46	0,34	0,34
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		26.216,55	2.678.197,60	0,18	0,18
. AZ QUEST LUCE		4.723.686,71	6.875.899,08	0,47	0,47
. ARX VINSON FI RF CP		736.169,54	810.211,37	0,06	0,06
. CA AG VITESSE		33.975,19	782.148,21	0,05	0,05
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		20.865.523,37	26.945.545,96	1,85	1,85
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		4.713,99	129.550,70	0,01	0,01
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		7.000,00	33.487,44	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		4.958,18	21.029,13	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		9,76	339.069,21	0,02	0,02
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		3.274,84	4.194.632,27	0,29	0,29
. VALORES A RECEBER				0,00	0,00
Debêntures		28.696	45.800.880,87	3,14	
. LOJAS AMERICANAS		432	5.739.445,68	0,39	0,39
. ECOPISTAS		7.000	6.146.467,25	0,42	0,42
. CEMIG		20.000	29.404.312,74	2,02	2,02
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		849	230.762,87	0,02	0,02
. SABESP		275	3.998.346,26	0,27	0,27
. ESPÍRITO SANTO CENTRAIS ELÉTRICAS		140	281.546,07	0,02	0,02
. VALORES A RECEBER			4.599.655,00	0,32	0,32
. COMANCHE PART.			4.599.655,00	0,32	0,32
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		0,00	-4.599.655,00	-0,32	-0,32
. COMANCHE PART.			-4.599.655,00	-0,32	-0,32

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO I

Outros Títulos		<u>7</u>	<u>10.818.842,80</u>	<u>0,74</u>	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	15.111.064,88	1,04	1,04
. VALORES A RECEBER		1	3.274.905,95	0,22	0,22
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		<u>-1,00</u>	<u>-7.567.128,03</u>	<u>-0,52</u>	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO - ALOÉS		-1	-7.567.128,03	-0,52	-0,52
				0,00	0,00
B - INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			56.910.966,56	3,91	
B1. Mercado de Ações			<u>19.172.993,65</u>	<u>1,32</u>	
Companhias Abertas		<u>541.112</u>	<u>15.133.902,95</u>	<u>1,04</u>	
. AMBEV	ON	33.068	480.808,72	0,03	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	22.324	603.640,96	0,04	
. COSAN	ON	16.200	1.185.354,00	0,08	
. ECORODOVIAS	ON	39.700	626.466,00	0,04	
. GERDAU - GGBR	PN	50.964	862.820,52	0,06	
. ITAUSA	PN	130.709	1.569.815,09	0,11	
. LOGG COMERCIAL	ON	1.730	47.713,40	0,00	
. MRVE	ON	26.400	514.536,00	0,04	
. PÃO DE AÇUCAR	PN	21.400	1.543.154,00	0,11	
. PETROBRÁS	PN	75.517	1.913.600,78	0,13	
. RENT	ON	52.911	2.621.210,94	0,18	
. SUZANO PAPEL	PNA	19.900	758.986,00	0,05	
. VALE R. DOCE	PNA	50.289	2.228.305,59	0,15	
. VALORES A PAGAR				0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			177.490,95	0,01	
Instituições Financeiras		<u>126.653</u>	<u>4.039.090,70</u>	<u>0,28</u>	
. BRADESCO	PN	58.943	1.799.529,79	0,12	
. ITAU	PN	67.710	2.166.720,00	0,15	
. VALORES A PAGAR				0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			72.840,91	0,00	
B2. Fundos		<u>10.297.453,22</u>	<u>37.737.972,91</u>	<u>2,59</u>	
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		4.269.354,93	12.443.869,65	0,85	
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		42.148,06	7.625.265,73	0,52	
. MOAT CAPITAL FIA		2.130.692,87	7.497.204,00	0,51	
. SPX APACHE FIA		3.855.257,36	10.171.633,53	0,70	
C - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		35.592.080	130.126.396,38	8,93	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.506,93	2.248.652,71	0,15	
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.281,00	20.911.499,47	1,43	
. FIP BVEP PLAZA		3.000,00	3.021.866,55	0,21	
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		6.346,45	4.647.564,62	0,32	
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.125.602,34	975.578,04	0,07	
. HAMILTON LANE FIC FIP		13.002,27	19.340.244,47	1,33	
. MULTINER FIP		10,17	-11.626,55	0,00	
. STRATUS SCP BR FIP		5.000.000,00	7.252.960,00	0,50	
. P2BR INFR III FIQFIP		6.564,17	14.917.426,41	1,02	
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		3.587.604,80	7.502.582,85	0,51	
. KINEA CHRONOS FIM		7.560.771,69	13.463.400,37	0,92	
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		6.337.198,69	10.479.410,40	0,72	
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		11.894.682,91	13.402.925,14	0,92	
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		47.508,29	11.973.911,90	0,82	
D - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		20.322.975	55.669.211,06	3,82	
. BB MM SCH INV EXTE FI		4.519.272,85	12.952.131,28	0,89	
. MSQUARE GL EQ FICFIM		3.305.204,08	10.661.031,14	0,73	
. VOT ALLIANZGI FIM		3.814.282,63	9.185.175,11	0,63	
. WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI		3.465,71	5.711.999,10	0,39	
. GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE		46.431,13	5.865.380,93	0,40	
. PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR		3.701.637,15	5.890.736,94	0,40	
. ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR		4.932.681,62	5.402.756,56	0,37	

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO I

E - INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			74.731.916,60	5,13
E1 - Investimentos em Shopping Center			36.993.095,03	2,54
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			36.993.095,03	2,54
			0,00	0,00
. VALORES A RECEBER				0,00
E2 - Investimento Imobiliário			9.100.989,70	0,62
. PANAMBY			9.100.989,70	0,62
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00
E3 - Investimento Fundo Imobiliário		162.051,67	25.417.647,69	1,74
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		79.208,00	8.633.672,00	0,59
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		470,67	5.523.447,54	0,38
. GGR COVEPI RENDA FII		82.373,00	11.213.436,49	0,77
. VALORES A RECEBER			47.091,66	0,00
E3 - Outros Investimentos Imobiliário		26,00	3.220.184,18	0,22
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		26	3.220.184,18	0,22
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		1.341	26.428.801,08	1,81
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		1.341	25.643.241,40	1,76
. VALORES A PAGAR (-)			-20.967,58	0,00
. VALORES A RECEBER			806.527,26	0,06
G - OUTROS			168.800.667,67	11,58
. DISPONIVEL			506.621,88	0,03
. DEPOSITOS JUDICIAIS			0,00	0,00
. OUTROS REALIZAVEIS			84.586.293,95	5,80
. OUTROS DIREITOS A RECEBER			84.665.599,86	5,81
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-957.848,02	-0,07
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			0,00	0,00

GESTÃO TERCEIRIZADA	DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO TERCEIRIZADA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS			
- SANT FIC FI ISN RF D	62.117,51	0,02%	0,00%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO	2.195.802,18	0,61%	0,15%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES	6.878.543,46	1,91%	0,47%
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP	51.263.122,94	14,23%	3,52%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	12.443.869,65	3,46%	0,85%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA	7.625.265,73	2,12%	0,52%
- MOAT CAPITAL FIA	7.497.204,00	2,08%	0,51%
- SPX APACHE FIA	10.171.633,53	2,82%	0,70%
- BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2.192.858,82	0,61%	0,15%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP	4.973.340,46	1,38%	0,34%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II	2.678.197,60	0,74%	0,18%
- CA INDOSUEZ VITESSE FI RENDA FIXA CP	782.148,21	0,22%	0,05%
- AZ QUEST LUCE	6.875.899,08	1,91%	0,47%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	129.550,70	0,04%	0,01%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	33.487,44	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	21.029,13	0,01%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.	339.069,21	0,09%	0,02%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL	4.194.632,27	1,16%	0,29%
- AF GERAES 30	834.775,77	0,23%	0,06%
- ARX VINSON FI RF CP	810.211,37		
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM	26.945.545,96	7,48%	1,85%

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO I

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP			2.248.652,71	0,62%	0,15%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			20.911.499,47	5,81%	1,43%
- FIP BVEP PLAZA			3.021.866,55	0,84%	0,21%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES			4.647.564,62	1,29%	0,32%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			975.578,04	0,27%	0,07%
- HAMILTON LANE FIC FIP			19.340.244,47	5,37%	1,33%
- MULTINER FIP			(11.626,55)	0,00%	0,00%
- STRATUS SCP BR FIP			7.252.960,00	2,01%	0,50%
- P2BR INFR III FIQFIP			14.917.426,41	4,14%	1,02%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			7.502.582,85	2,08%	0,51%
- KINEA CHRONOS FIM			13.463.400,37	3,74%	0,92%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM			10.479.410,40	2,91%	0,72%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM			13.402.925,14	3,72%	0,92%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM			11.973.911,90	3,32%	0,82%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO			8.680.763,66	2,41%	0,60%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			5.523.447,54	1,53%	0,38%
- GGR COVEPI RENDA FII			11.213.436,49	3,11%	0,77%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- BB MM SCH INV EXTE FI			12.952.131,28	3,60%	0,89%
- MSQUARE GL EQ FICFIM			10.661.031,14	2,96%	0,73%
- VOT ALLIANZGI FIM			9.185.175,11	2,55%	0,63%
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI			5.711.999,10	1,59%	0,39%
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE			5.865.380,93	1,63%	0,40%
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR			5.890.736,94	1,64%	0,40%
- ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR			5.402.756,56	1,50%	0,37%
TOTAL			360.161.560,15	99,78%	24,66%

GESTÃO PRÓPRIA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENDA FIXA			833.462.460,68	75,96%	57,19%
RENDA VARIÁVEL			19.172.993,65	1,75%	1,32%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			49.314.268,91	4,49%	3,38%
EMPRÉSTIMO PESSOAL			26.428.801,08	2,41%	1,81%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)			168.800.667,67	15,38%	11,58%
TOTAL			1.097.179.191,99	100,00%	75,29%