

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO I

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.01.2020

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.382.886.152,05		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			1.028.045.312,18	74,34	
TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOIRO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOIRO NACIONAL					
<u>Nota do Tesouro Nacional</u>		197.414	705.676.379,28	51,03	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			264.055.856,84	19,09	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		3.502,00	7.396.081,43	0,53	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	1	24.254.454,66	1,75	1,75
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	1	2.049.020,58	0,15	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	1	3.383.584,48	0,24	0,39
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	3.500	7.396.081,43	0,53	0,53
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-1	-24.254.454,66	-1,75	-1,75
- BANCO MORADA		-1	-5.432.605,06	-0,39	-0,39
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		219	70.057.748,59	5,07	
. PARANÁ BANCO		100	24.366.421,54	1,76	1,76
. ABC		10	5.877.807,42	0,43	0,43
. BRADESCO		105	36.260.669,56	2,62	2,62
. SAFRA		4	3.552.850,07	0,26	0,26
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		71.221.014,57	186.602.026,82	13,49	
. SANT FIC FI ISN RF D		337,13	61.943,83	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		4.045.513,40	7.192.451,51	0,52	0,52
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		10.383.631,43	32.202.430,11	2,33	2,33
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		388.393,09	50.884.691,42	3,68	3,68
. AF GERAES 30		730.445,00	832.142,95	0,06	0,06
. BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO		15.854,25	7.240.097,06	0,52	0,52
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		45.250,01	5.064.082,94	0,37	0,37
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		26.216,55	2.657.997,84	0,19	0,19
. AZ QUEST LUCE		22.548.973,76	32.739.777,71	2,37	2,37
. ARX VINSON FI RF CP		736.169,54	807.786,31	0,06	0,06
. CA AG VITESSE		33.975,19	781.161,57	0,06	0,06
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		32.246.298,44	41.335.927,29	2,99	2,99
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		4.713,99	130.523,05	0,01	0,01
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		7.000,00	33.309,22	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		4.958,18	19.240,23	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		9,76	455.454,58	0,03	0,03
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		3.274,84	4.163.009,20	0,30	0,30
. VALORES A RECEBER				0,00	0,00
<u>Debêntures</u>		28.696	47.446.721,88	3,43	
. LOJAS AMERICANAS		432	5.695.142,80	0,41	0,41
. ECOPISTAS		7.000	6.105.489,40	0,44	0,44
. CEMIG		20.000	30.769.184,54	2,22	2,22
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		849	321.027,74	0,02	0,02
. SABESP		275	3.977.356,62	0,29	0,29
. ESPÍRITO SANTO CENTRAIS ELÉTRICAS		140	578.520,78	0,04	0,04
. VALORES A RECEBER			4.599.655,00	0,33	0,33
. COMANCHE PART.			4.599.655,00	0,33	0,33
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		0,00	-4.599.655,00	-0,33	-0,33
. COMANCHE PART.			-4.599.655,00	-0,33	-0,33

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO I

Outros Títulos		<u>7</u>	<u>10.866.354,18</u>	<u>0,79</u>	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	15.158.576,26	1,10	1,10
. VALORES A RECEBER		1	3.274.905,95	0,24	0,24
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		<u>-1,00</u>	<u>-7.567.128,03</u>	<u>-0,55</u>	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO - ALOÉS		-1	-7.567.128,03	-0,55	-0,55
				0,00	0,00
B - INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			61.710.438,04	4,46	
B1. Mercado de Ações			<u>21.036.849,62</u>	<u>1,52</u>	
Companhias Abertas		<u>541.112</u>	<u>16.871.294,89</u>	<u>1,22</u>	
. AMBEV	ON	33.068	590.263,80	0,04	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	22.324	681.998,20	0,05	
. COSAN	ON	16.200	1.291.140,00	0,09	
. ECORODOVIAS	ON	39.700	703.881,00	0,05	
. GERDAU - GGBR	PN	50.964	1.021.828,20	0,07	
. ITAUSA	PN	130.709	1.680.917,74	0,12	
. LOGG COMERCIAL	ON	1.730	54.668,00	0,00	
. MRVE	ON	26.400	550.968,00	0,04	
. PÃO DE AÇUCAR	PN	21.400	1.820.712,00	0,13	
. PETROBRÁS	PN	75.517	2.148.458,65	0,16	
. RENT	ON	52.911	2.837.616,93	0,21	
. SUZANO PAPEL	PNA	19.900	789.433,00	0,06	
. VALE R. DOCE	PNA	50.289	2.528.028,03	0,18	
. VALORES A PAGAR				0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			171.381,34	0,01	
Instituições Financeiras		<u>126.653</u>	<u>4.165.554,73</u>	<u>0,30</u>	
. BRADESCO	PN	58.943	1.938.635,27	0,14	
. ITAU	PN	67.710	2.222.242,20	0,16	
. VALORES A PAGAR				0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			4.677,26	0,00	
B2. Fundos		<u>10.297.453,22</u>	<u>40.673.588,42</u>	<u>2,94</u>	
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		4.269.354,93	13.162.239,76	0,95	
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		42.148,06	8.259.045,78	0,60	
. MOAT CAPITAL FIA		2.130.692,87	8.215.743,52	0,59	
. SPX APACHE FIA		3.855.257,36	11.036.559,36	0,80	
C - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		<u>35.592.080</u>	<u>133.426.169,27</u>	<u>9,65</u>	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.506,93	2.253.812,81	0,16	
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.281,00	20.912.525,26	1,51	
. FIP BVEP PLAZA		3.000,00	3.022.805,23	0,22	
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		6.346,45	4.312.980,01	0,31	
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.125.602,34	977.143,96	0,07	
. HAMILTON LANE FIC FIP		13.002,27	21.491.080,40	1,55	
. MULTINER FIP		10,17	-7.967,82	0,00	
. STRATUS SCP BR FIP		5.000.000,00	7.262.390,00	0,53	
. P2BR INFR III FIQFIP		6.564,17	14.913.385,83	1,08	
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		3.587.604,80	7.588.277,45	0,55	
. KINEA CHRONOS FIM		7.560.771,69	13.674.438,14	0,99	
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		6.337.198,69	10.361.320,96	0,75	
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		11.894.682,91	13.531.754,07	0,98	
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		47.508,29	13.132.222,97	0,95	
D - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		<u>20.322.975</u>	<u>57.552.889,81</u>	<u>4,16</u>	
. BB MM SCH INV EXTE FI		4.519.272,85	13.605.198,15	0,98	
. MSQUARE GL EQ FICFIM		3.305.204,08	11.036.399,89	0,80	
. VOT ALLIANZGI FIM		3.814.282,63	9.470.847,56	0,68	
. WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI		3.465,71	5.873.433,82	0,42	
. GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE		46.431,13	6.071.769,18	0,44	
. PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR		3.701.637,15	5.923.840,46	0,43	
. ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR		4.932.681,62	5.571.400,75	0,40	

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO I

E - INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			75.965.420,97	5,49	
E1 - Investimentos em Shopping Center			37.104.520,01	2,68	
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			37.113.783,24	2,68	
. VALORES A RECEBER			-9.263,23	0,00	
E2 - Investimento Imobiliário			8.939.494,85	0,65	
. PANAMBY			8.939.494,85	0,65	
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00	
E3 - Investimento Fundo Imobiliário	165.982,67	26.729.171,23	1,93		
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO	79.208,00	9.105.751,68	0,66		
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	470,67	5.522.394,27	0,40		
. GGR COVEPI RENDA FII	86.304,00	12.056.668,80	0,87		
. VALORES A RECEBER		44.356,48	0,00		
E3 - Outros Investimentos Imobiliário	26,00	3.192.234,88	0,23		
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS	26	3.192.234,88	0,23		
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES	1.345	26.705.751,24	1,93		
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	1.345	25.806.417,76	1,87		
. VALORES A PAGAR (-)		-12.083,58	0,00		
. VALORES A RECEBER		911.417,06	0,07		
G - OUTROS		-519.829,46	-0,04		
. DISPONIVEL		475.963,85	0,03		
. DEPOSITOS JUDICIAIS		0,00	0,00		
. OUTROS REALIZAVEIS		0,00	0,00		
. OUTROS DIREITOS A RECEBER		0,00	0,00		
. OUTRAS EXIGIBILIDADES		-995.793,31	-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		61.943,83	0,01%	0,00%	
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		7.192.451,51	1,62%	0,52%	
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		32.202.430,11	7,24%	2,33%	
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		50.884.691,42	11,44%	3,68%	
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		13.162.239,76	2,96%	0,95%	
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		8.259.045,78	1,86%	0,60%	
- MOAT CAPITAL FIA		8.215.743,52	1,85%	0,59%	
- SPX APACHE FIA		11.036.559,36	2,48%	0,80%	
- BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO		7.240.097,06	1,63%	0,52%	
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		5.064.082,94	1,14%	0,37%	
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		2.657.997,84	0,60%	0,19%	
- CA INDOSUEZ VITESSE FI RENDA FIXA CP		781.161,57	0,18%	0,06%	
- AZ QUEST LUCE		32.739.777,71	7,36%	2,37%	
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		130.523,05	0,03%	0,01%	
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		33.309,22	0,01%	0,00%	
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		19.240,23	0,00%	0,00%	
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.		455.454,58	0,10%	0,03%	
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		4.163.009,20	0,94%	0,30%	
- AF GERAES 30		832.142,95	0,19%	0,06%	
- ARX VINSON FI RF CP		807.786,31			
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		41.335.927,29	9,29%	2,99%	
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		2.253.812,81	0,51%	0,16%	
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		20.912.525,26	4,70%	1,51%	
- FIP BVPE PLAZA		3.022.805,23	0,68%	0,22%	
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		4.312.980,01	0,97%	0,31%	
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		977.143,96	0,22%	0,07%	

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO I

- HAMILTON LANE FIC FIP			21.491.080,40	4,83%	1,55%
- MULTINER FIP			(7.967,82)	0,00%	0,00%
- STRATUS SCP BR FIP			7.262.390,00	1,63%	0,53%
- P2BR INFR III FIQFIP			14.913.385,83	3,35%	1,08%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			7.588.277,45	1,71%	0,55%
- KINEA CHRONOS FIM			13.674.438,14	3,07%	0,99%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM			10.361.320,96	2,33%	0,75%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM			13.531.754,07	3,04%	0,98%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM			13.132.222,97	2,95%	0,95%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO			9.150.108,16	2,06%	0,66%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			5.522.394,27	1,24%	0,40%
- GGR COVEPI RENDA FII			12.056.668,80	2,71%	0,87%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- BB MM SCH INV EXTE FI			13.605.198,15	3,06%	0,98%
- MSQUARE GL EQ FICFIM			11.036.399,89	2,48%	0,80%
- VOT ALLIANZGI FIM			9.470.847,56	2,13%	0,68%
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI			5.873.433,82	1,32%	0,42%
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE			6.071.769,18	1,36%	0,44%
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR			5.923.840,46	1,33%	0,43%
- ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR			5.571.400,75	1,25%	0,40%
TOTAL			444.983.845,55	99,82%	32,12%

GESTÃO PRÓPRIA	DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENDA FIXA	841.443.285,36	89,72%	60,85%
RENDA VARIÁVEL	21.036.849,62	2,24%	1,52%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	49.236.249,74	5,25%	3,56%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	26.705.751,24	2,85%	1,93%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	-519.829,46	-0,06%	-0,04%
TOTAL	937.902.306,50	100,00%	67,82%