

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO I

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.03.2020

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.423.214.127,45		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			943.605.484,57	66,30	
TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOIRO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOIRO NACIONAL					
Nota do Tesouro Nacional		202.614	721.931.269,83	50,73	
APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS			165.303.254,20	11,61	
Certificado de Depósito Bancário		3.502,00	7.497.311,05	0,53	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	1	24.254.454,66	1,70	1,70
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	1	2.049.020,58	0,14	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	1	3.383.584,48	0,24	0,38
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	3.500	7.497.311,05	0,53	0,53
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-1	-24.254.454,66	-1,70	-1,70
- BANCO MORADA		-1	-5.432.605,06	-0,38	-0,38
Letra Financeira Subordinada		219	71.034.382,61	4,99	
. PARANÁ BANCO		100	24.680.967,06	1,73	1,73
. ABC		10	5.967.958,71	0,42	0,42
. BRADESCO		105	36.776.315,78	2,58	2,58
. SAFRA		4	3.609.141,06	0,25	0,25
Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.		24.979.703,89	86.771.560,54	6,10	
. SANT FIC FI ISN RF D		337,13	62.072,37	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		1.134.160,46	1.983.076,14	0,14	0,14
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		297.347,80	907.741,15	0,06	0,06
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		441.190,25	55.502.517,51	3,90	3,90
. AF GERAES 30		730.445,00	810.185,27	0,06	0,06
. BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO		14.340,92	6.479.808,56	0,46	0,46
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		45.250,01	4.854.506,01	0,34	0,34
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		26.216,55	2.545.099,38	0,18	0,18
. AZ QUEST LUCE		634.790,92	872.306,89	0,06	0,06
. ARX VINSON FI RF CP		736.169,54	795.414,32	0,06	0,06
. CA AG VITESSE		33.975,19	753.077,55	0,05	0,05
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		20.865.523,37	6.678.009,74	0,47	0,47
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		4.713,99	126.152,82	0,01	0,01
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		7.000,00	26.740,10	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		4.958,18	19.670,94	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		9,76	342.487,15	0,02	0,02
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		3.274,84	4.012.694,64	0,28	0,28
. VALORES A RECEBER				0,00	0,00
Debêntures		28.696	45.605.054,99	3,20	
. LOJAS AMERICANAS		432	5.344.804,35	0,38	0,38
. ECOPISTAS		7.000	6.204.680,78	0,44	0,44
. CEMIG		20.000	29.605.903,29	2,08	2,08
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		849	139.425,65	0,01	0,01
. SABESP		275	4.029.187,21	0,28	0,28
. ESPÍRITO SANTO CENTRAIS ELÉTRICAS		140	281.053,71	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/CRÉDITOS		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>10.765.905,55</u>	<u>0,76</u>	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	15.058.127,63	1,06	1,06
. VALORES A RECEBER		1	3.274.905,95	0,23	0,23
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		<u>-1,00</u>	<u>-7.567.128,03</u>	<u>-0,53</u>	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO - ALOÉS		-1	-7.567.128,03	-0,53	-0,53
				0,00	0,00
B - INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			39.274.012,81	2,76	
B1. Mercado de Ações			<u>13.665.960,14</u>	<u>0,96</u>	
Companhias Abertas		<u>541.112</u>	<u>10.876.156,05</u>	<u>0,76</u>	
. AMBEV	ON	33.068	394.170,56	0,03	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	22.324	336.869,16	0,02	
. COSAN	ON	16.200	870.912,00	0,06	
. ECORODOVIAS	ON	39.700	375.165,00	0,03	
. GERDAU - GGBR	PN	50.964	512.188,20	0,04	
. ITAUSA	PN	130.709	1.146.317,93	0,08	
. LOGG COMERCIAL	ON	1.730	37.887,00	0,00	
. MRVE	ON	26.400	323.136,00	0,02	
. PÃO DE AÇUCAR	PN	21.400	1.419.676,00	0,10	
. PETROBRÁS	PN	75.517	1.056.482,83	0,07	
. RENT	ON	52.911	1.391.559,30	0,10	
. SUZANO PAPEL	PNA	19.900	712.221,00	0,05	
. VALE R. DOCE	PNA	50.289	2.173.490,58	0,15	
. VALORES A PAGAR				0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			126.080,49	0,01	
Instituições Financeiras		<u>126.653</u>	<u>2.789.804,09</u>	<u>0,20</u>	
. BRADESCO	PN	58.943	1.224.246,11	0,09	
. ITAU	PN	67.710	1.563.423,90	0,11	
. VALORES A PAGAR				0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			2.134,08	0,00	
B2. Fundos		<u>10.297.453,22</u>	<u>25.608.052,67</u>	<u>1,80</u>	
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		4.269.354,93	8.569.503,05	0,60	
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		42.148,06	4.999.300,19	0,35	
. MOAT CAPITAL FIA		2.130.692,87	4.760.895,56	0,33	
. SPX APACHE FIA		3.855.257,36	7.278.353,87	0,51	
C - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		35.592.080	119.374.552,88	8,39	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.506,93	2.232.781,46	0,16	
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.281,00	20.915.831,95	1,47	
. FIP BVEP PLAZA		3.000,00	3.020.720,59	0,21	
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		6.346,45	4.642.399,24	0,33	
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.125.602,34	972.312,48	0,07	
. HAMILTON LANE FIC FIP		13.002,27	19.125.642,38	1,34	
. MULTINER FIP		10,17	-14.324,92	0,00	
. STRATUS SCP BR FIP		5.000.000,00	7.145.395,00	0,50	
. P2BR INFR III FIQFIP		6.564,17	10.533.804,54	0,74	
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		3.587.604,80	7.271.258,39	0,51	
. KINEA CHRONOS FIM		7.560.771,69	13.021.991,93	0,91	
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		6.337.198,69	10.499.934,68	0,74	
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		11.894.682,91	12.526.912,67	0,88	
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		47.508,29	7.479.892,49	0,53	
D - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		20.322.975	53.847.695,52	3,78	
. BB MM SCH INV EXTE FI		4.519.272,85	13.464.774,95	0,95	
. MSQUARE GL EQ FICFIM		3.305.204,08	10.540.034,09	0,74	
. VOT ALLIANZGI FIM		3.814.282,63	9.440.158,46	0,66	
. WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI		3.465,71	5.109.225,53	0,36	
. GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE		46.431,13	5.115.023,27	0,36	
. PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR		3.701.637,15	5.391.666,41	0,38	
. ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR		4.932.681,62	4.786.812,81	0,34	

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO I

E - INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			71.855.051,49	5,05
E1 - Investimentos em Shopping Center			36.881.670,04	2,59
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			36.881.670,04	2,59
. VALORES A RECEBER				0,00
E2 - Investimento Imobiliário			9.262.484,55	0,65
. PANAMBY			9.262.484,55	0,65
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00
E3 - Investimento Fundo Imobiliário	162.051,67	22.438.170,09	1,58	
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO	79.208,00	7.074.066,48	0,50	
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	470,67	5.524.068,89	0,39	
. GGR COVEPI RENDA FII	82.373,00	9.795.678,24	0,69	
. VALORES A RECEBER		44.356,48	0,00	
E3 - Outros Investimentos Imobiliário	26,00	3.272.726,81	0,23	
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS	26	3.272.726,81	0,23	
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES	1.330	25.999.236,87	1,83	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	1.330	25.183.934,06	1,77	
. VALORES A PAGAR (-)		-15.552,23	0,00	
. VALORES A RECEBER		830.855,04	0,06	
G - OUTROS		169.258.093,31	11,89	
. DISPONIVEL		666.560,47	0,05	
. DEPOSITOS JUDICIAIS		0,00	0,00	
. OUTROS REALIZAVEIS		84.586.293,95	5,94	
. OUTROS DIREITOS A RECEBER		85.148.294,62	5,98	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES		-1.143.055,73	-0,08	
. 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	62.072,37	0,02%	0,00%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO	1.983.076,14	0,64%	0,14%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES	907.741,15	0,29%	0,06%
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP	55.502.517,51	18,02%	3,90%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	8.569.503,05	2,78%	0,60%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA	4.999.300,19	1,62%	0,35%
- MOAT CAPITAL FIA	4.760.895,56	1,55%	0,33%
- SPX APACHE FIA	7.278.353,87	2,36%	0,51%
- BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	6.479.808,56	2,10%	0,46%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP	4.854.506,01	1,58%	0,34%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II	2.545.099,38	0,83%	0,18%
- CA INDOSUEZ VITESSE FI RENDA FIXA CP	753.077,55	0,24%	0,05%
- AZ QUEST LUCE	872.306,89	0,28%	0,06%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	126.152,82	0,04%	0,01%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	26.740,10	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	19.670,94	0,01%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.	342.487,15	0,11%	0,02%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL	4.012.694,64	1,30%	0,28%
- AF GERAES 30	810.185,27	0,26%	0,06%
- ARX VINSON FI RF CP	795.414,32		
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM	6.678.009,74	2,17%	0,47%

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO I

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP			2.232.781,46	0,72%	0,16%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			20.915.831,95	6,79%	1,47%
- FIP BVEP PLAZA			3.020.720,59	0,98%	0,21%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES			4.642.399,24	1,51%	0,33%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			972.312,48	0,32%	0,07%
- HAMILTON LANE FIC FIP			19.125.642,38	6,21%	1,34%
- MULTINER FIP			(14.324,92)	0,00%	0,00%
- STRATUS SCP BR FIP			7.145.395,00	2,32%	0,50%
- P2BR INFR III FIQFIP			10.533.804,54	3,42%	0,74%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			7.271.258,39	2,36%	0,51%
- KINEA CHRONOS FIM			13.021.991,93	4,23%	0,91%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM			10.499.934,68	3,41%	0,74%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM			12.526.912,67	4,07%	0,88%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM			7.479.892,49	2,43%	0,53%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO			7.118.422,96	2,31%	0,50%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			5.524.068,89	1,79%	0,39%
- GGR COVEPI RENDA FII			9.795.678,24	3,18%	0,69%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- BB MM SCH INV EXTE FI			13.464.774,95	4,37%	0,95%
- MSQUARE GL EQ FICFIM			10.540.034,09	3,42%	0,74%
- VOT ALLIANZGI FIM			9.440.158,46	3,06%	0,66%
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI			5.109.225,53	1,66%	0,36%
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE			5.115.023,27	1,66%	0,36%
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR			5.391.666,41	1,75%	0,38%
- ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR			4.786.812,81	1,55%	0,34%
TOTAL			308.040.031,70	99,74%	21,59%

GESTÃO PRÓPRIA	DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENTA FIXA	856.833.924,03	76,83%	60,20%
RENTA VARIÁVEL	13.665.960,14	1,23%	0,96%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	49.416.881,40	4,43%	3,47%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	25.999.236,87	2,33%	1,83%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	169.258.093,31	15,18%	11,89%
TOTAL	1.115.174.095,75	100,00%	78,36%