

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO I

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 30.04.2020

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.433.223.763,70		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			942.223.070,50	65,74	
TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOIRO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOIRO NACIONAL					
<u>Nota do Tesouro Nacional</u>		202.614	725.149.672,53	50,60	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			161.525.486,75	11,27	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		3.502,00	7.534.561,89	0,53	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	1	24.254.454,66	1,69	1,69
. 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	7.534.561,89	0,53	0,53
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-1	-24.254.454,66	-1,69	-1,69
- BANCO MORADA		-1	-5.432.605,06	-0,38	-0,38
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		219	71.425.418,32	4,98	
. PARANÁ BANCO		100	24.791.544,62	1,73	1,73
. ABC		10	6.000.733,74	0,42	0,42
. BRADESCO		105	37.005.252,16	2,58	2,58
. SAFRA		4	3.627.887,80	0,25	0,25
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		23.403.627,55	82.565.506,54	5,76	
. SANT FIC FI ISN RF D		337,13	62.110,81	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		681.989,09	1.177.200,43	0,08	0,08
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		297.347,80	892.875,27	0,06	0,06
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		441.190,25	54.548.847,85	3,81	3,81
. BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO		15.453,37	6.991.721,67	0,49	0,49
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		45.250,01	4.846.126,38	0,34	0,34
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		26.216,55	2.578.094,46	0,18	0,18
. AZ QUEST LUCE		634.790,92	871.316,68	0,06	0,06
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		20.865.523,37	976.290,32	0,07	0,07
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		4.713,99	61.795,73	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		7.000,00	28.736,16	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		4.958,18	19.249,17	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		9,76	344.446,93	0,02	0,02
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		3.764,51	4.665.219,02	0,33	0,33
. BRAD RF DI FED EXTRA		375.082,63	4.501.475,66	0,31	0,31
. VALORES A RECEBER				0,00	0,00
<u>Debêntures</u>		28.696	44.747.136,08	3,12	
. LOJAS AMERICANAS		432	5.027.558,36	0,35	0,35
. ECOPISTAS		7.000	5.618.387,50	0,39	0,39
. CEMIG		20.000	29.695.464,91	2,07	2,07
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		849	79.398,48	0,01	0,01
. SABESP		275	4.044.505,27	0,28	0,28
. ESPÍRITO SANTO CENTRAIS ELÉTRICAS		140	281.821,56	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>10.800.775,14</u>	<u>0,75</u>	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	15.092.997,22	1,05	1,05
. 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			44.202.539,27	3,08	
B1. Mercado de Ações			<u>14.954.481,36</u>	<u>1,04</u>	
Companhias Abertas		<u>541.112</u>	<u>12.168.962,03</u>	<u>0,85</u>	
. AMBEV	ON	33.068	374.991,12	0,03	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	22.324	432.862,36	0,03	
. COSAN	ON	16.200	977.508,00	0,07	
. ECORODOVIAS	ON	39.700	416.453,00	0,03	
. GERDAU - GGBR	PN	50.964	598.317,36	0,04	
. ITAUSA	PN	130.709	1.176.381,00	0,08	
. LOGG COMERCIAL	ON	1.730	39.582,40	0,00	
. MRVE	ON	26.400	399.960,00	0,03	
. PÃO DE AÇUCAR	PN	21.400	1.417.108,00	0,10	
. PETROBRÁS	PN	75.517	1.363.081,85	0,10	
. RENT	ON	52.911	1.809.027,09	0,13	
. SUZANO PAPEL	PNA	19.900	784.259,00	0,05	
. VALE R. DOCE	PNA	50.289	2.255.964,54	0,16	
. VALORES A PAGAR				0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			123.466,31	0,01	
Instituições Financeiras		<u>132.547</u>	<u>2.785.519,33</u>	<u>0,19</u>	
. BRADESCO	PN	64.837	1.241.628,55	0,09	
. ITAU	PN	67.710	1.541.756,70	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>29.248.057,91</u>	<u>2,04</u>	
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		4.269.354,93	9.790.974,17	0,68	
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		42.148,06	5.807.675,94	0,41	
. MOAT CAPITAL FIA		2.130.692,87	5.785.446,90	0,40	
. SPX APACHE FIA		3.855.257,36	7.863.960,90	0,55	
C - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		35.592.080	120.446.644,65	8,40	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.506,93	2.226.963,26	0,16	
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.281,00	20.903.323,35	1,46	
. FIP BVEP PLAZA		3.000,00	3.019.248,58	0,21	
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		6.346,45	4.635.962,00	0,32	
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.125.602,34	878.683,36	0,06	
. HAMILTON LANE FIC FIP		13.002,27	19.670.820,50	1,37	
. MULTINER FIP		10,17	-8.402,50	0,00	
. STRATUS SCP BR FIP		5.000.000,00	7.137.605,00	0,50	
. P2BR INFR III FIQFIP		6.564,17	10.483.397,16	0,73	
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		3.587.604,80	7.407.715,45	0,52	
. KINEA CHRONOS FIM		7.560.771,69	13.170.242,79	0,92	
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		6.337.198,69	10.623.477,22	0,74	
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		11.894.682,91	12.531.035,37	0,87	
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		47.508,29	7.766.573,11	0,54	
D - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		20.322.975	59.630.833,99	4,16	
. BB MM SCH INV EXTE FI		4.519.272,85	15.664.294,38	1,09	
. MSQUARE GL EQ FICFIM		3.305.204,08	12.233.758,99	0,85	
. VOT ALLIANZGI FIM		3.814.282,63	10.460.422,30	0,73	
. WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI		3.465,71	5.366.645,34	0,37	
. GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE		46.431,13	5.364.136,95	0,37	
. PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR		3.701.637,15	5.571.629,43	0,39	
. ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR		4.932.681,62	4.969.946,60	0,35	

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO I

E - INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			71.288.252,76	4,97
E1 - Investimentos em Shopping Center			36.770.245,06	2,57
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			36.770.245,06	2,57
. VALORES A RECEBER				0,00
E2 - Investimento Imobiliário			9.588.736,78	0,67
. PANAMBY			9.588.736,78	0,67
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00
E3 - Investimento Fundo Imobiliário	149.147,67	21.597.817,63	1,51	
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO	79.208,00	7.315.650,88	0,51	
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	470,67	5.525.647,01	0,39	
. GGR COVEPI RENDA FII	69.469,00	8.475.218,00	0,59	
. VALORES A RECEBER		281.301,74	0,02	
E3 - Outros Investimentos Imobiliário	26,00	3.331.453,29	0,23	
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS	26	3.331.453,29	0,23	
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES	1.319	25.733.199,75	1,80	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	1.319	25.038.685,25	1,75	
. VALORES A PAGAR (-)		-14.361,99	0,00	
. VALORES A RECEBER		708.876,49	0,05	
G - OUTROS		169.699.222,78	11,84	
. DISPONIVEL		523.091,84	0,04	
. DEPOSITOS JUDICIAIS		0,00	0,00	
. OUTROS REALIZAVEIS		84.586.293,95	5,90	
. OUTROS DIREITOS A RECEBER		85.642.290,16	5,98	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES		-1.052.453,17	-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	62.110,81	0,02%	0,00%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO	1.177.200,43	0,38%	0,08%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES	892.875,27	0,28%	0,06%
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP	54.548.847,85	17,40%	3,81%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	9.790.974,17	3,12%	0,68%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA	5.807.675,94	1,85%	0,41%
- MOAT CAPITAL FIA	5.785.446,90	1,85%	0,40%
- SPX APACHE FIA	7.863.960,90	2,51%	0,55%
- BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	6.991.721,67	2,23%	0,49%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP	4.846.126,38	1,55%	0,34%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II	2.578.094,46	0,82%	0,18%
- AZ QUEST LUCE	871.316,68	0,28%	0,06%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	61.795,73	0,02%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	28.736,16	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	19.249,17	0,01%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.	344.446,93	0,11%	0,02%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL	4.665.219,02	1,49%	0,33%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM	976.290,32	0,31%	0,07%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP	2.226.963,26	0,71%	0,16%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	20.903.323,35	6,67%	1,46%
- FIP BVPE PLAZA	3.019.248,58	0,96%	0,21%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES	4.635.962,00	1,48%	0,32%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE	878.683,36	0,28%	0,06%
- HAMILTON LANE FIC FIP	19.670.820,50	6,27%	1,37%
- MULTINER FIP	(8.402,50)	0,00%	0,00%
- STRATUS SCP BR FIP	7.137.605,00	2,28%	0,50%

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO I

- P2BR INFR III FIQFIP			10.483.397,16	3,34%	0,73%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			7.407.715,45	2,36%	0,52%
- KINEA CHRONOS FIM			13.170.242,79	4,20%	0,92%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM			10.623.477,22	3,39%	0,74%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM			12.531.035,37	4,00%	0,87%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM			7.766.573,11	2,48%	0,54%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO			7.596.952,62	2,42%	0,53%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			5.525.647,01	1,76%	0,39%
- GGR COVEPI RENDA FII			8.475.218,00	2,70%	0,59%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- BB MM SCH INV EXTE FI			15.664.294,38	5,00%	1,09%
- MSQUARE GL EQ FICFIM			12.233.758,99	3,90%	0,85%
- VOT ALLIANZGI FIM			10.460.422,30	3,34%	0,73%
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI			5.366.645,34	1,71%	0,37%
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE			5.364.136,95	1,71%	0,37%
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR			5.571.629,43	1,78%	0,39%
- ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR			4.969.946,60	1,59%	0,35%
TOTAL			313.488.860,72	100,00%	21,87%

GESTÃO PRÓPRIA	DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENDA FIXA	859.657.563,96	76,77%	59,98%
RENDA VARIÁVEL	14.954.481,36	1,34%	1,04%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	49.690.435,13	4,44%	3,47%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	25.733.199,75	2,30%	1,80%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	169.699.222,78	15,16%	11,84%
TOTAL	1.119.734.902,98	100,00%	78,13%