

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO I

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.08.2020

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.462.574.730,77		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			999.035.680,65	68,31	
TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOUREIRO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOUREIRO NACIONAL					
Nota do Tesouro Nacional		202.614	724.399.819,09	49,53	
APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS			218.662.367,90	14,95	
Certificado de Depósito Bancário		3.502,00	7.686.852,18	0,53	
. 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	7.686.852,18	0,53	0,53
. 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	73.153.185,06	5,00	
. PARANÁ BANCO		100	25.277.379,29	1,73	1,73
. ABC		10	6.146.762,66	0,42	0,42
. BRADESCO		105	38.000.611,01	2,60	2,60
. SAFRA		4	3.728.432,10	0,25	0,25
Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.		15.303.883,93	137.822.330,66	9,42	
. SANT FIC FI ISN RF D		337,13	62.588,73	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		90.700,35	161.207,08	0,01	0,01
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		441.190,25	56.992.564,09	3,90	3,90
. BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO		389,36	179.008,16	0,01	0,01
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		45.250,01	4.994.305,41	0,34	0,34
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		38.201,28	3.928.875,46	0,27	0,27
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		11.600.106,61	15.336.507,34	1,05	1,05
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		4.713,99	60.578,99	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		7.000,00	39.381,03	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		4.958,18	31.996,32	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		9,76	353.047,16	0,02	0,02
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		3.764,51	4.937.105,25	0,34	0,34
. VINCI VALOREM FIM		64.274,34	14.435.433,05	0,99	0,99
. BRAD RF DI FED EXTRA		3.002.988,16	36.309.732,59	2,48	2,48
. VALORES A RECEBER				0,00	0,00
Debêntures		28.178	44.951.508,72	3,07	
. LOJAS AMERICANAS		432	5.425.959,28	0,37	0,37
. ECOPISTAS		7.000	5.153.824,13	0,35	0,35
. CEMIG		20.000	30.239.545,94	2,07	2,07
. SABESP		746	4.132.179,37	0,28	0,28
. VALORES A RECEBER			4.599.655,00	0,31	0,31
. COMANCHE PART.			4.599.655,00	0,31	0,31
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		0,00	-4.599.655,00	-0,31	-0,31
. COMANCHE PART.			-4.599.655,00	-0,31	-0,31
Outros Títulos		2	11.021.984,94	0,75	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	15.314.207,02	1,05	1,05
. VALORES A RECEBER		1	3.274.905,95	0,22	0,22
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		-1,00	-7.567.128,03	-0,52	-0,52
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO - ALOÉS		-1	-7.567.128,03	-0,52	-0,52
				0,00	0,00
B - INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			55.730.973,65	3,81	
B1. Mercado de Ações			18.002.237,94	1,23	
Companhias Abertas		541.112	15.060.702,15	1,03	
. AMBEV	ON	33.068	407.067,08	0,03	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	22.324	437.327,16	0,03	
. COSAN	ON	16.200	1.348.650,00	0,09	

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO I

. ECORODOVIAS	ON	39.700	512.924,00	0,04
. GERDAU - GGBR	PN	50.964	972.902,76	0,07
. ITAUSA	PN	130.709	1.232.585,87	0,08
. LOGG COMERCIAL	ON	1.730	53.595,40	0,00
. MRVE	ON	26.400	474.408,00	0,03
. PÃO DE AÇÚCAR	PN	21.400	1.359.114,00	0,09
. PETROBRÁS	PN	75.517	1.653.067,13	0,11
. RENT	ON	52.911	2.551.897,53	0,17
. SUZANO PAPEL	PNA	19.900	998.980,00	0,07
. VALE R. DOCE	PNA	50.289	3.001.247,52	0,21
. VALORES A PAGAR				0,00
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			56.935,70	0,00
Instituições Financeiras		132.547	2.941.535,79	0,20
. BRADESCO	PN	64.837	1.344.719,38	0,09
. ITAU	PN	67.710	1.594.570,50	0,11
. VALORES A PAGAR				0,00
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			2.245,91	0,00
B2. Fundos		10.297.453,22	37.728.735,71	2,58
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		4.269.354,93	13.476.082,43	0,92
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		42.148,06	7.028.840,15	0,48
. MOAT CAPITAL FIA		2.130.692,87	7.943.862,85	0,54
. SPX APACHE FIA		3.855.257,36	9.279.950,28	0,63
C - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		17.313.551	126.499.976,68	8,65
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.517,01	2.382.437,09	0,16
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.281,00	20.900.838,05	1,43
. FIP BVPE PLAZA		3.000,00	2.994.998,81	0,20
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		6.368,85	4.638.850,58	0,32
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.125.602,34	1.222.182,20	0,08
. HAMILTON LANE FIC FIP		13.562,92	23.050.919,09	1,58
. MULTINER FIP		10,17	-8.114,86	0,00
. STRATUS SCP BR FIP		5.000.000,00	6.651.870,00	0,45
. P2BR INFR III FIQFIP		6.832,17	10.571.520,16	0,72
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		3.587.604,80	7.831.518,49	0,54
. KINEA CHRONOS FIM		7.560.771,69	13.539.129,81	0,93
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		6.337.198,69	10.893.118,44	0,74
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		11.894.682,91	13.054.425,20	0,89
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		47.508,29	8.776.283,62	0,60
D - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		8.684.216	23.151.558,68	1,58
. WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI		3.465,71	5.955.324,15	0,41
. GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE		46.431,13	5.806.182,90	0,40
. PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR		3.701.637,15	6.027.601,24	0,41
. ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR		4.932.681,62	5.362.450,39	0,37
E - INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			62.436.235,51	4,27
E1 - Investimentos em Shopping Center			36.324.545,12	2,48
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			36.324.545,12	2,48
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00
E2 - Investimento Imobiliário			9.992.474,25	0,68
. PANAMBY			9.992.474,25	0,68
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00
E3 - Investimento Fundo Imobiliário		79.678,67	12.462.855,11	0,85
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		79.208,00	6.897.432,64	0,47
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		470,67	5.528.865,63	0,38
. VALORES A RECEBER			36.556,84	0,00
E3 - Outros Investimentos Imobiliário		26,00	3.656.361,03	0,25
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		26	3.656.361,03	0,25
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		1.263	24.572.597,48	1,68
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		1.263	23.841.928,67	1,63
. VALORES A PAGAR (-)			-8.806,55	0,00
. VALORES A RECEBER			739.475,36	0,05

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO I

G - OUTROS			171.147.708,12	11,70	
. DISPONIVEL			375.044,74	0,03	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			0,00	0,00	
. OUTROS REALIZAVEIS			84.586.293,95	5,78	
. OUTROS DIREITOS A RECEBER			87.243.674,47	5,97	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-1.057.305,04	-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			62.588,73	0,02%	0,00%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO			161.207,08	0,05%	0,01%
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP			56.992.564,09	16,88%	3,90%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA			13.476.082,43	3,99%	0,92%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA			7.028.840,15	2,08%	0,48%
- MOAT CAPITAL FIA			7.943.862,85	2,35%	0,54%
- SPX APACHE FIA			9.279.950,28	2,75%	0,63%
- BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO			179.008,16	0,05%	0,01%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP			4.994.305,41	1,48%	0,34%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II			3.928.875,46	1,16%	0,27%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER			60.578,99	0,02%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II			39.381,03	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III			31.996,32	0,01%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.			353.047,16	0,10%	0,02%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL			4.937.105,25	1,46%	0,34%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM			15.336.507,34	4,54%	1,05%
- VINCI VALOREM FIM			14.435.433,05	4,28%	0,99%
- BRAD RF DI FED EXTRA			36.309.732,59	10,75%	2,48%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP			2.382.437,09	0,71%	0,16%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			20.900.838,05	6,19%	1,43%
- FIP BVEP PLAZA			2.994.998,81	0,89%	0,20%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES			4.638.850,58	1,37%	0,32%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			1.222.182,20	0,36%	0,08%
- HAMILTON LANE FIC FIP			23.050.919,09	6,83%	1,58%
- MULTINER FIP			(8.114,86)	0,00%	0,00%
- STRATUS SCP BR FIP			6.651.870,00	1,97%	0,45%
- P2BR INFR III FIQFIP			10.571.520,16	3,13%	0,72%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			7.831.518,49	2,32%	0,54%
- KINEA CHRONOS FIM			13.539.129,81	4,01%	0,93%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM			10.893.118,44	3,23%	0,74%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM			13.054.425,20	3,87%	0,89%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM			8.776.283,62	2,60%	0,60%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO			6.933.989,48	2,05%	0,47%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			5.528.865,63	1,64%	0,38%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI			5.955.324,15	1,76%	0,41%
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE			5.806.182,90	1,72%	0,40%
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR			6.027.601,24	1,79%	0,41%
- ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR			5.362.450,39	1,59%	0,37%
TOTAL			337.665.456,84	100,00%	23,09%

GESTÃO PRÓPRIA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENDA FIXA			861.213.349,99	76,56%	58,88%
RENDA VARIÁVEL			18.002.237,94	1,60%	1,23%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			49.973.380,40	4,44%	3,42%
EMPRÉSTIMO PESSOAL			24.572.597,48	2,18%	1,68%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)			171.147.708,12	15,21%	11,70%
TOTAL			1.124.909.273,93	100,00%	76,91%