

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO I

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.07.2020

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.459.038.083,48		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			982.860.612,55	67,36	
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	730.919.498,10	50,10	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			196.177.521,48	13,45	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		3.502,00	7.624.217,27	0,52	
. 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	7.624.217,27	0,52	0,52
. 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
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		219	72.495.096,42	4,97	
. PARANÁ BANCO		100	25.090.663,49	1,72	1,72
. ABC		10	6.091.951,88	0,42	0,42
. BRADESCO		105	37.617.930,84	2,58	2,58
. SAFRA		4	3.694.550,21	0,25	0,25
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		13.586.746,56	116.058.207,79	7,95	
. SANT FIC FI ISN RF D		337,13	62.435,21	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		90.700,35	160.236,57	0,01	0,01
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		101.334,34	306.628,23	0,02	0,02
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		441.190,25	57.054.078,88	3,91	3,91
. BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO		389,36	178.457,87	0,01	0,01
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		45.250,01	4.971.915,57	0,34	0,34
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		38.201,28	3.978.693,88	0,27	0,27
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		11.600.106,61	15.251.513,93	1,05	1,05
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		4.713,99	60.972,43	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		7.000,00	34.505,80	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		4.958,18	15.085,08	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		9,76	349.618,14	0,02	0,02
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		3.764,51	5.009.772,61	0,34	0,34
. VINCI VALOREM FIM		64.274,34	14.322.923,90	0,98	0,98
. BRAD RF DI FED EXTRA		1.184.516,45	14.301.369,69	0,98	0,98
. VALORES A RECEBER				0,00	0,00
<u>Debêntures</u>		28.318	44.901.016,21	3,08	
. LOJAS AMERICANAS		432	5.375.842,84	0,37	0,37
. ECOPISTAS		7.000	5.105.928,12	0,35	0,35
. CEMIG		20.000	30.032.790,49	2,06	2,06
. SABESP		746	4.100.592,68	0,28	0,28
. ESPÍRITO SANTO CENTRAIS ELÉTRICAS		140	285.862,08	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
<u>Outros Títulos</u>		7	10.862.576,76	0,74	
. Cedula de Credito Bancario		7	15.154.798,84	1,04	1,04
. 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	
. Cedula de Credito Bancario - ALOÉS		-1	-7.567.128,03	-0,52	-0,52
				0,00	0,00
B - INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			57.374.390,87	3,93	
<u>B1. Mercado de Ações</u>			19.000.546,29	1,30	
<u>Companhias Abertas</u>		541.112	15.722.636,20	1,08	
. AMBEV	ON	33.068	459.645,20	0,03	

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO I

. BRF - BRASIL FOODS	ON	22.324	462.106,80	0,03
. COSAN	ON	16.200	1.464.480,00	0,10
. ECORODOVIAS	ON	39.700	576.444,00	0,04
. GERDAU - GGBR	PN	50.964	889.321,80	0,06
. ITAUSA	PN	130.709	1.394.665,03	0,10
. LOGG COMERCIAL	ON	1.730	63.664,00	0,00
. MRVE	ON	26.400	505.296,00	0,03
. PÃO DE AÇUCAR	PN	21.400	1.519.400,00	0,10
. PETROBRÁS	PN	75.517	1.676.477,40	0,11
. RENT	ON	52.911	2.694.228,12	0,18
. SUZANO PAPEL	PNA	19.900	835.800,00	0,06
. VALE R. DOCE	PNA	50.289	3.053.045,19	0,21
. VALORES A PAGAR				0,00
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			128.062,66	0,01
Instituições Financeiras		132.547	3.277.910,09	0,22
. BRADESCO	PN	64.837	1.454.942,28	0,10
. ITAU	PN	67.710	1.820.721,90	0,12
. VALORES A PAGAR				0,00
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			2.245,91	0,00
B2. Fundos		10.297.453,22	38.373.844,58	2,63
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		4.269.354,93	13.367.108,56	0,92
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		42.148,06	7.200.430,59	0,49
. MOAT CAPITAL FIA		2.130.692,87	8.247.744,18	0,57
. SPX APACHE FIA		3.855.257,36	9.558.561,25	0,66
C - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		17.313.261	124.427.693,77	8,53
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.517,01	2.385.845,29	0,16
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.281,00	20.896.440,56	1,43
. FIP BVEP PLAZA		3.000,00	3.015.817,94	0,21
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		6.346,45	4.621.143,34	0,32
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.125.602,34	872.783,05	0,06
. HAMILTON LANE FIC FIP		13.562,92	21.638.302,21	1,48
. MULTINER FIP		10,17	-19.469,54	0,00
. STRATUS SCP BR FIP		5.000.000,00	6.594.790,00	0,45
. P2BR INFR III FIQFIP		6.564,17	10.168.656,84	0,70
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		3.587.604,80	7.877.826,94	0,54
. KINEA CHRONOS FIM		7.560.771,69	13.524.317,51	0,93
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		6.337.198,69	10.741.021,03	0,74
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		11.894.682,91	12.997.300,99	0,89
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		47.508,29	9.112.917,61	0,62
D - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		11.989.420	36.631.383,20	2,51
. MSQUARE GL EQ FICFIM		3.305.204,08	13.745.398,63	0,94
. WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI		3.465,71	5.930.880,85	0,41
. GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE		46.431,13	5.737.149,75	0,39
. PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR		3.701.637,15	5.949.873,67	0,41
. ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR		4.932.681,62	5.268.080,30	0,36
E - INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			62.580.630,89	4,29
E1 - Investimentos em Shopping Center			36.435.970,10	2,50
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			36.435.970,10	2,50
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00
E2 - Investimento Imobiliário			9.830.979,40	0,67
. PANAMBY			9.830.979,40	0,67
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00
E3 - Investimento Fundo Imobiliário		79.678,67	12.773.298,74	0,88
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		79.208,00	7.207.928,00	0,49
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		470,67	5.531.311,30	0,38
. VALORES A RECEBER			34.059,44	0,00
E3 - Outros Investimentos Imobiliário		26,00	3.540.382,65	0,24
. CERTIFICADO DE RECEBÍVEIS IMOBILIARIOS		26	3.540.382,65	0,24
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		1.285	24.744.527,10	1,70
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		1.273	24.039.893,84	1,65
. VALORES A PAGAR (-)			-9.433,60	0,00
. VALORES A RECEBER			714.066,86	0,05

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO I

G - OUTROS			170.418.845,10	11,68	
. DISPONIVEL			368.961,35	0,03	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			0,00	0,00	
. OUTROS REALIZAVEIS			84.586.293,95	5,80	
. OUTROS DIREITOS A RECEBER			86.515.904,76	5,93	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-1.052.314,96	-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			62.435,21	0,02%	0,00%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO			160.236,57	0,05%	0,01%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES			306.628,23	0,09%	0,02%
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP			57.054.078,88	17,38%	3,91%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA			13.367.108,56	4,07%	0,92%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA			7.200.430,59	2,19%	0,49%
- MOAT CAPITAL FIA			8.247.744,18	2,51%	0,57%
- SPX APACHE FIA			9.558.561,25	2,91%	0,66%
- BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO			178.457,87	0,05%	0,01%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP			4.971.915,57	1,51%	0,34%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II			3.978.693,88	1,21%	0,27%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER			60.972,43	0,02%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II			34.505,80	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III			15.085,08	0,00%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.			349.618,14	0,11%	0,02%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL			5.009.772,61	1,53%	0,34%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM			15.251.513,93	4,65%	1,05%
- VINCI VALOREM FIM			14.322.923,90	4,36%	0,98%
- BRAD RF DI FED EXTRA			14.301.369,69	4,36%	0,98%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP			2.385.845,29	0,73%	0,16%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			20.896.440,56	6,37%	1,43%
- FIP BVEP PLAZA			3.015.817,94	0,92%	0,21%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES			4.621.143,34	1,41%	0,32%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			872.783,05	0,27%	0,06%
- HAMILTON LANE FIC FIP			21.638.302,21	6,59%	1,48%
- MULTINER FIP			(19.469,54)	-0,01%	0,00%
- STRATUS SCP BR FIP			6.594.790,00	2,01%	0,45%
- P2BR INFR III FIOFIP			10.168.656,84	3,10%	0,70%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			7.877.826,94	2,40%	0,54%
- KINEA CHRONOS FIM			13.524.317,51	4,12%	0,93%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM			10.741.021,03	3,27%	0,74%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM			12.997.300,99	3,96%	0,89%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM			9.112.917,61	2,78%	0,62%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO			7.241.987,44	2,21%	0,50%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			5.531.311,30	1,69%	0,38%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- MSQUARE GL EQ FICFIM			13.745.398,63	4,19%	0,94%
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI			5.930.880,85	1,81%	0,41%
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE			5.737.149,75	1,75%	0,39%
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR			5.949.873,67	1,81%	0,41%
- ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR			5.268.080,30	1,60%	0,36%
TOTAL			328.264.428,08	100,00%	22,50%

GESTÃO PRÓPRIA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENDA FIXA			866.802.404,76	76,66%	59,41%
RENDA VARIÁVEL			19.000.546,29	1,68%	1,30%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			49.807.332,15	4,40%	3,41%
EMPRÉSTIMO PESSOAL			24.744.527,10	2,19%	1,70%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)			170.418.845,10	15,07%	11,68%
TOTAL			1.130.773.655,40	100,00%	77,50%