

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO I

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 30.06.2020

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.444.646.688,70		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			977.581.921,56	67,67	
TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOIRO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOIRO NACIONAL					
Nota do Tesouro Nacional		202.614	724.968.562,92	50,18	
APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS			196.755.981,48	13,62	
Certificado de Depósito Bancário		3.502,00	7.559.999,23	0,52	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	1	24.254.454,66	1,68	1,68
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	1	2.049.020,58	0,14	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	1	3.383.584,48	0,23	0,38
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	3.500	7.559.999,23	0,52	0,52
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-1	-24.254.454,66	-1,68	-1,68
- BANCO MORADA		-1	-5.432.605,06	-0,38	-0,38
Letra Financeira Subordinada		219	71.819.824,77	4,97	
. PARANÁ BANCO		100	24.893.723,64	1,72	1,72
. ABC		10	6.034.824,73	0,42	0,42
. BRADESCO		105	37.234.217,40	2,58	2,58
. SAFRA		4	3.657.059,00	0,25	0,25
Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.		14.574.729,74	117.376.157,48	8,12	
. SANT FIC FI ISN RF D		337,13	62.269,96	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		534.784,56	935.389,18	0,06	0,06
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		297.347,80	894.691,77	0,06	0,06
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		441.190,25	55.463.375,22	3,84	3,84
. BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO		705,98	321.817,11	0,02	0,02
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		45.250,01	4.988.744,40	0,35	0,35
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		34.456,05	3.484.814,40	0,24	0,24
. AZ QUEST LUCE		181.944,91	253.869,60	0,02	0,02
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		11.600.106,61	15.161.855,77	1,05	1,05
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		4.713,99	60.771,39	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		7.000,00	26.431,77	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		4.958,18	17.464,86	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		9,76	346.139,40	0,02	0,02
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		3.764,51	4.842.919,88	0,34	0,34
. VINCI VALOREM FIM		64.274,34	14.198.453,28	0,98	0,98
. BRAD RF DI FED EXTRA		1.353.885,67	16.317.149,49	1,13	1,13
. VALORES A RECEBER				0,00	0,00
Debêntures		28.318	45.100.957,22	3,12	
. LOJAS AMERICANAS		432	5.283.301,80	0,37	0,37
. ECOPISTAS		7.000	5.665.859,38	0,39	0,39
. CEMIG		20.000	29.801.970,82	2,06	2,06
. SABESP		746	4.065.456,92	0,28	0,28
. ESPÍRITO SANTO CENTRAIS ELÉTRICAS		140	284.368,30	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
Outros Títulos		2	10.756.419,94	0,74	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	15.048.642,02	1,04	1,04
. VALORES A RECEBER		1	3.274.905,95	0,23	0,23

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO I

. 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			52.531.764,34	3,64	
B1. Mercado de Ações			17.248.611,94	1,19	
Companhias Abertas		551.825	14.181.020,63	0,98	
. AMBEV	ON	33.068	467.581,52	0,03	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	22.324	474.608,24	0,03	
. BRCR12/DIR	DIR	10.713	59.320,28	0,00	
. COSAN	ON	16.200	1.148.904,00	0,08	
. ECORODOVIAS	ON	39.700	514.909,00	0,04	
. GERDAU - GGBR	PN	50.964	815.933,64	0,06	
. ITAUSA	PN	130.709	1.253.499,31	0,09	
. LOGG COMERCIAL	ON	1.730	57.003,50	0,00	
. MRVE	ON	26.400	475.200,00	0,03	
. PÃO DE AÇUCAR	PN	21.400	1.518.972,00	0,11	
. PETROBRÁS	PN	75.517	1.627.391,35	0,11	
. RENT	ON	52.911	2.164.589,01	0,15	
. SUZANO PAPEL	PNA	19.900	732.121,00	0,05	
. VALE R. DOCE	PNA	50.289	2.812.160,88	0,19	
. VALORES A PAGAR			-71.815,44	0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			130.642,34	0,01	
Instituições Financeiras		132.547	3.067.591,31	0,21	
. BRADESCO	PN	64.837	1.342.125,90	0,09	
. ITAU	PN	67.710	1.723.219,50	0,12	
. VALORES A PAGAR				0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			2.245,91	0,00	
B2. Fundos		10.297.453,22	35.283.152,40	2,44	
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		4.269.354,93	12.419.702,02	0,86	
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		42.148,06	6.685.503,86	0,46	
. MOAT CAPITAL FIA		2.130.692,87	7.326.516,96	0,51	
. SPX APACHE FIA		3.855.257,36	8.851.429,56	0,61	
C - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		17.312.690	121.426.417,95	8,41	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.506,93	2.385.110,14	0,17	
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.281,00	20.889.086,79	1,45	
. FIP BVEP PLAZA		3.000,00	3.017.045,48	0,21	
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		6.346,45	4.627.050,71	0,32	
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.125.602,34	874.638,53	0,06	
. HAMILTON LANE FIC FIP		13.002,27	19.777.322,83	1,37	
. MULTINER FIP		10,17	-16.286,51	0,00	
. STRATUS SCP BR FIP		5.000.000,00	6.603.090,00	0,46	
. P2BR INFR III FIQFIP		6.564,17	10.151.257,47	0,70	
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		3.587.604,80	7.674.958,65	0,53	
. KINEA CHRONOS FIM		7.560.771,69	13.366.180,19	0,93	
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		6.337.198,69	10.646.230,84	0,74	
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		11.894.682,91	12.774.303,04	0,88	
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		47.508,29	8.656.429,79	0,60	
D - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		11.989.420	35.667.512,09	2,47	
. MSQUARE GL EQ FICFIM		3.305.204,08	13.398.250,30	0,93	
. WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI		3.465,71	5.688.666,96	0,39	
. GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE		46.431,13	5.548.685,08	0,38	
. PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR		3.701.637,15	5.833.323,84	0,40	
. ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR		4.932.681,62	5.198.585,91	0,36	
E - INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			62.607.732,07	4,33	
E1 - Investimentos em Shopping Center			36.538.131,85	2,53	
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			36.547.395,08	2,53	
. VALORES A RECEBER			-9.263,23	0,00	

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO I

E2 - Investimento Imobiliário			<u>9.750.231,86</u>	<u>0,67</u>
. PANAMBY			9.750.231,86	0,67
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00
E3 - Investimento Fundo Imobiliário	<u>79.678,67</u>	<u>12.883.210,47</u>	<u>0,89</u>	
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO	79.208,00	7.319.611,28	0,51	
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	470,67	5.529.539,75	0,38	
. VALORES A RECEBER		34.059,44	0,00	
E3 - Outros Investimentos Imobiliário	<u>26,00</u>	<u>3.436.157,89</u>	<u>0,24</u>	
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS	26	3.436.157,89	0,24	
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES	<u>1.285</u>	<u>25.134.650,12</u>	<u>1,74</u>	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	1.285	24.455.610,92	1,69	
. VALORES A PAGAR (-)		-11.410,72	0,00	
. VALORES A RECEBER		690.449,92	0,05	
G - OUTROS		<u>169.696.690,57</u>	<u>11,75</u>	
. DISPONIVEL		244.672,96	0,02	
. DEPOSITOS JUDICIAIS		0,00	0,00	
. OUTROS REALIZAVEIS		84.586.293,95	5,86	
. OUTROS DIREITOS A RECEBER		85.913.958,60	5,95	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES		-1.048.234,94	-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	62.269,96	0,02%	0,00%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO	935.389,18	0,29%	0,06%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES	894.691,77	0,28%	0,06%
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP	55.463.375,22	17,19%	3,84%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	12.419.702,02	3,85%	0,86%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA	6.685.503,86	2,07%	0,46%
- MOAT CAPITAL FIA	7.326.516,96	2,27%	0,51%
- SPX APACHE FIA	8.851.429,56	2,74%	0,61%
- BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	321.817,11	0,10%	0,02%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP	4.988.744,40	1,55%	0,35%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II	3.484.814,40	1,08%	0,24%
- AZ QUEST LUCE	253.869,60	0,08%	0,02%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	60.771,39	0,02%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	26.431,77	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	17.464,86	0,01%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.	346.139,40	0,11%	0,02%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL	4.842.919,88	1,50%	0,34%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM	15.161.855,77	4,70%	1,05%
- VINCI VALOREM FIM	14.198.453,28	4,40%	0,98%
- BRAD RF DI FED EXTRA	16.317.149,49	5,06%	1,13%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP	2.385.110,14	0,74%	0,17%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	20.889.086,79	6,47%	1,45%
- FIP BVEP PLAZA	3.017.045,48	0,94%	0,21%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES	4.627.050,71	1,43%	0,32%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE	874.638,53	0,27%	0,06%
- HAMILTON LANE FIC FIP	19.777.322,83	6,13%	1,37%
- MULTINER FIP	(16.286,51)	-0,01%	0,00%
- STRATUS SCP BR FIP	6.603.090,00	2,05%	0,46%
- P2BR INFR III FIQFIP	10.151.257,47	3,15%	0,70%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS	7.674.958,65	2,38%	0,53%
- KINEA CHRONOS FIM	13.366.180,19	4,14%	0,93%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM	10.646.230,84	3,30%	0,74%

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO I

- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM			12.774.303,04	3,96%	0,88%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM			8.656.429,79	2,68%	0,60%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO			7.353.670,72	2,28%	0,51%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			5.529.539,75	1,71%	0,38%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- MSQUARE GL EQ FICFIM			13.398.250,30	4,15%	0,93%
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI			5.688.666,96	1,76%	0,39%
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE			5.548.685,08	1,72%	0,38%
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR			5.833.323,84	1,81%	0,40%
- ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR			5.198.585,91	1,61%	0,36%
TOTAL			322.636.450,39	100,00%	22,33%

GESTÃO PRÓPRIA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENTA FIXA			860.205.764,08	76,67%	59,54%
RENTA VARIÁVEL			17.248.611,94	1,54%	1,19%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			49.724.521,60	4,43%	3,44%
EMPRÉSTIMO PESSOAL			25.134.650,12	2,24%	1,74%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)			169.696.690,57	15,12%	11,75%
TOTAL			1.122.010.238,31	100,00%	77,67%