

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO I

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 29.05.2020

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.437.093.384,63		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			971.208.552,56	67,58	
TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOIRO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOIRO NACIONAL					
Nota do Tesouro Nacional		202.614	719.184.143,01	50,04	
APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS			196.438.045,53	13,67	
Certificado de Depósito Bancário		3.502,00	7.544.606,45	0,52	
. 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	7.544.606,45	0,52	0,52
. 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
Letra Financeira Subordinada		219	71.571.709,25	4,98	
. PARANÁ BANCO		100	24.823.181,23	1,73	1,73
. ABC		10	6.013.262,42	0,42	0,42
. BRADESCO		105	37.100.844,53	2,58	2,58
. SAFRA		4	3.634.421,07	0,25	0,25
Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.		15.075.807,63	117.321.729,83	8,16	
. SANT FIC FI ISN RF D		337,13	62.245,64	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		536.849,04	932.958,31	0,06	0,06
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		297.347,80	892.104,88	0,06	0,06
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		441.190,25	55.163.768,36	3,84	3,84
. BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO		705,98	320.825,55	0,02	0,02
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		45.250,01	4.954.022,99	0,34	0,34
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		29.983,86	2.981.810,48	0,21	0,21
. AZ QUEST LUCE		634.790,92	877.167,85	0,06	0,06
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		11.600.106,61	15.007.805,78	1,04	1,04
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		4.713,99	61.546,09	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		7.000,00	25.451,31	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		4.958,18	18.464,97	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		9,76	345.136,44	0,02	0,02
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		3.764,51	4.760.687,88	0,33	0,33
. VINCI VALOREM FIM		64.274,34	14.024.006,32	0,98	0,98
. BRAD RF DI FED EXTRA		1.404.525,26	16.893.726,98	1,18	1,18
. VALORES A RECEBER				0,00	0,00
Debêntures		28.696	44.788.104,33	3,12	
. LOJAS AMERICANAS		432	5.113.495,42	0,36	0,36
. ECOPISTAS		7.000	5.629.618,03	0,39	0,39
. CEMIG		20.000	29.684.746,66	2,07	2,07
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		849	30.978,96	0,00	0,00
. SABESP		275	4.046.176,00	0,28	0,28
. ESPÍRITO SANTO CENTRAIS ELÉTRICAS		140	283.089,26	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>10.798.259,69</u>	<u>0,75</u>	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	15.090.481,77	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			47.832.706,67	3,33	
B1. Mercado de Ações			<u>16.066.767,16</u>	<u>1,12</u>	
Companhias Abertas		<u>541.112</u>	<u>13.275.821,70</u>	<u>0,92</u>	
. AMBEV	ON	33.068	412.688,64	0,03	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	22.324	516.354,12	0,04	
. COSAN	ON	16.200	1.066.770,00	0,07	
. ECORODOVIAS	ON	39.700	522.055,00	0,04	
. GERDAU - GGBR	PN	50.964	684.446,52	0,05	
. ITAUSA	PN	130.709	1.158.081,74	0,08	
. LOGG COMERCIAL	ON	1.730	40.482,00	0,00	
. MRVE	ON	26.400	400.488,00	0,03	
. PÃO DE AÇUCAR	PN	21.400	1.347.772,00	0,09	
. PETROBRÁS	PN	75.517	1.536.015,78	0,11	
. RENT	ON	52.911	2.036.015,28	0,14	
. SUZANO PAPEL	PNA	19.900	753.414,00	0,05	
. VALE R. DOCE	PNA	50.289	2.665.317,00	0,19	
. VALORES A PAGAR				0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			135.921,62	0,01	
Instituições Financeiras		<u>132.547</u>	<u>2.790.945,46</u>	<u>0,19</u>	
. BRADESCO	PN	64.837	1.228.661,15	0,09	
. ITAU	PN	67.710	1.560.038,40	0,11	
. VALORES A PAGAR				0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			2.245,91	0,00	
B2. Fundos		<u>10.297.453,22</u>	<u>31.765.939,51</u>	<u>2,21</u>	
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		4.269.354,93	10.875.892,91	0,76	
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		42.148,06	6.102.131,08	0,42	
. MOAT CAPITAL FIA		2.130.692,87	6.499.607,21	0,45	
. SPX APACHE FIA		3.855.257,36	8.288.308,31	0,58	
C - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		35.592.080	120.822.029,10	8,41	
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.506,93	2.393.368,42	0,17	
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.281,00	20.880.327,96	1,45	
. FIP BVEP PLAZA		3.000,00	3.018.177,22	0,21	
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		6.346,45	4.631.603,29	0,32	
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.125.602,34	877.054,86	0,06	
. HAMILTON LANE FIC FIP		13.002,27	19.360.372,25	1,35	
. MULTINER FIP		10,17	-11.106,06	0,00	
. STRATUS SCP BR FIP		5.000.000,00	7.129.850,00	0,50	
. P2BR INFR III FIQFIP		6.564,17	10.478.733,85	0,73	
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		3.587.604,80	7.488.502,93	0,52	
. KINEA CHRONOS FIM		7.560.771,69	13.258.758,26	0,92	
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		6.337.198,69	10.525.696,84	0,73	
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		11.894.682,91	12.639.426,86	0,88	
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		47.508,29	8.151.262,42	0,57	
D - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		11.989.420	34.595.450,68	2,41	
. MSQUARE GL EQ FICFIM		3.305.204,08	12.703.644,91	0,88	
. WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI		3.465,71	5.603.582,74	0,39	
. GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE		46.431,13	5.485.615,30	0,38	
. PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR		3.701.637,15	5.724.855,10	0,40	
. ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR		4.932.681,62	5.077.752,63	0,35	

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO I

E - INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			67.579.751,29	4,70
E1 - Investimentos em Shopping Center			36.661.319,91	2,55
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			36.658.820,07	2,55
. VALORES A RECEBER			2.499,84	0,00
E2 - Investimento Imobiliário			9.669.484,32	0,67
. PANAMBY			9.669.484,32	0,67
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00
E3 - Investimento Fundo Imobiliário		122.131,67	17.875.476,54	1,24
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		79.208,00	7.176.244,80	0,50
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		470,67	5.528.783,83	0,38
. GGR COVEPI RENDA FII		42.453,00	5.136.388,47	0,36
. VALORES A RECEBER			34.059,44	0,00
E3 - Outros Investimentos Imobiliário		26,00	3.373.470,52	0,23
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		26	3.373.470,52	0,23
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		1.298	25.485.807,37	1,77
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		1.298	24.810.448,35	1,73
. VALORES A PAGAR (-)			-10.942,89	0,00
. VALORES A RECEBER			686.301,91	0,05
G - OUTROS			169.569.086,96	11,80
. DISPONIVEL			237.158,67	0,02
. DEPOSITOS JUDICIAIS			0,00	0,00
. OUTROS REALIZAVEIS			84.586.293,95	5,89
. OUTROS DIREITOS A RECEBER			85.786.615,70	5,97
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-1.040.981,36	-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	62.245,64	0,02%	0,00%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO	932.958,31	0,29%	0,06%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES	892.104,88	0,28%	0,06%
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP	55.163.768,36	17,11%	3,84%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	10.875.892,91	3,37%	0,76%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA	6.102.131,08	1,89%	0,42%
- MOAT CAPITAL FIA	6.499.607,21	2,02%	0,45%
- SPX APACHE FIA	8.288.308,31	2,57%	0,58%
- BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	320.825,55	0,10%	0,02%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP	4.954.022,99	1,54%	0,34%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II	2.981.810,48	0,92%	0,21%
- AZ QUEST LUCE	877.167,85	0,27%	0,06%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	61.546,09	0,02%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	25.451,31	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	18.464,97	0,01%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.	345.136,44	0,11%	0,02%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL	4.760.687,88	1,48%	0,33%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM	15.007.805,78	4,66%	1,04%
- VINCI VALOREM FIM	14.024.006,32	4,35%	0,98%
- BRAD RF DI FED EXTRA	16.893.726,98	5,24%	1,18%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP	2.393.368,42	0,74%	0,17%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	20.880.327,96	6,48%	1,45%
- FIP BVPE PLAZA	3.018.177,22	0,94%	0,21%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES	4.631.603,29	1,44%	0,32%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE	877.054,86	0,27%	0,06%

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO I

- HAMILTON LANE FIC FIP			19.360.372,25	6,01%	1,35%
- MULTINER FIP			(11.106,06)	0,00%	0,00%
- STRATUS SCP BR FIP			7.129.850,00	2,21%	0,50%
- P2BR INFR III FIQFIP			10.478.733,85	3,25%	0,73%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			7.488.502,93	2,32%	0,52%
- KINEA CHRONOS FIM			13.258.758,26	4,11%	0,92%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM			10.525.696,84	3,26%	0,73%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM			12.639.426,86	3,92%	0,88%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM			8.151.262,42	2,53%	0,57%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO			7.210.304,24	2,24%	0,50%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			5.528.783,83	1,71%	0,38%
- GGR COVEPI RENDA FII			5.136.388,47	1,59%	0,36%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- MSQUARE GL EQ FICFIM			12.703.644,91	3,94%	0,88%
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI			5.603.582,74	1,74%	0,39%
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE			5.485.615,30	1,70%	0,38%
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR			5.724.855,10	1,78%	0,40%
- ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR			5.077.752,63	1,58%	0,35%
TOTAL			322.380.625,66	100,00%	22,43%

GESTÃO PRÓPRIA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENTA FIXA			853.886.822,73	76,60%	59,42%
RENTA VARIÁVEL			16.066.767,16	1,44%	1,12%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			49.704.274,75	4,46%	3,46%
EMPRÉSTIMO PESSOAL			25.485.807,37	2,29%	1,77%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)			169.569.086,96	15,21%	11,80%
TOTAL			1.114.712.758,97	100,00%	77,57%