

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO I

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 30.09.2020

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.466.956.528,80		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			1.005.678.774,72	68,56	
TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOURE NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOURE NACIONAL					
<u>Nota do Tesouro Nacional</u>		<u>202.614</u>	<u>733.586.216,37</u>	<u>50,01</u>	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			<u>215.575.287,96</u>	<u>14,70</u>	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		<u>3.502,00</u>	<u>7.745.488,45</u>	<u>0,53</u>	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	1	24.254.454,66	1,65	1,65
. 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	7.745.488,45	0,53	0,53
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-1	-24.254.454,66	-1,65	-1,65
- BANCO MORADA		-1	-5.432.605,06	-0,37	-0,37
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		<u>219</u>	<u>73.860.043,29</u>	<u>5,03</u>	
. PARANÁ BANCO		100	25.469.708,54	1,74	1,74
. ABC		10	6.201.921,05	0,42	0,42
. BRADESCO		105	38.421.297,23	2,62	2,62
. SAFRA		4	3.767.116,47	0,26	0,26
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		<u>14.988.115,75</u>	<u>133.969.756,22</u>	<u>9,13</u>	
. SANT FIC FI ISN RF D		337,13	62.616,59	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		85.422,58	152.315,10	0,01	0,01
. METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP		441.190,25	56.962.206,53	3,88	3,88
. BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO		389,36	179.224,41	0,01	0,01
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		45.250,01	5.018.121,77	0,34	0,34
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		38.201,28	3.902.013,23	0,27	0,27
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		11.600.106,61	15.357.940,97	1,05	1,05
. FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER		4.713,99	59.533,73	0,00	0,00
. FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER II		7.000,00	28.694,61	0,00	0,00
. FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER III		4.958,18	44.190,41	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		9,76	356.256,70	0,02	0,02
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		3.764,51	4.877.868,69	0,33	0,33
. VINCI VALOREM FIM		64.274,34	14.422.409,35	0,98	0,98
. BRAD RF DI FED EXTRA		2.692.497,76	32.546.364,13	2,22	2,22
. VALORES A RECEBER				0,00	0,00
<u>Debêntures</u>		<u>28.178</u>	<u>45.274.198,92</u>	<u>3,09</u>	
. LOJAS AMERICANAS		432	5.412.766,34	0,37	0,37
. ECOPISTAS		7.000	5.208.379,65	0,36	0,36
. CEMIG		20.000	30.484.072,64	2,08	2,08
. SABESP		746	4.168.980,29	0,28	0,28
. VALORES A RECEBER			<u>4.599.655,00</u>	0,31	0,31
. COMANCHE PART.			4.599.655,00	0,31	0,31
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		<u>0,00</u>	<u>-4.599.655,00</u>	<u>-0,31</u>	<u>-0,31</u>
. COMANCHE PART.			-4.599.655,00	-0,31	-0,31
<u>Outros Títulos</u>		<u>2</u>	<u>11.243.071,47</u>	<u>0,77</u>	
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		7	15.535.293,55	1,06	1,06
. VALORES A RECEBER		1	3.274.905,95	0,22	0,22
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		<u>-1,00</u>	<u>-7.567.128,03</u>	<u>-0,52</u>	<u>-0,52</u>
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO - ALOÉS		-1	-7.567.128,03	-0,52	-0,52
				0,00	0,00
B - INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			53.718.644,49	3,66	
<u>B1. Mercado de Ações</u>			<u>17.783.556,91</u>	<u>1,21</u>	
<u>Companhias Abertas</u>		<u>541.112</u>	<u>14.999.349,83</u>	<u>1,02</u>	
. AMBEV	ON	33.068	414.672,72	0,03	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	22.324	410.315,12	0,03	
. COSAN	ON	16.200	1.106.946,00	0,08	

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO I

. ECORODOVIAS	ON	39.700	470.048,00	0,03
. GERDAU - GGBR	PN	50.964	1.060.051,20	0,07
. ITAUSA	PN	130.709	1.150.239,20	0,08
. LOGG COMERCIAL	ON	1.730	52.021,10	0,00
. MRVE	ON	26.400	424.776,00	0,03
. PÃO DE AÇÚCAR	PN	21.400	1.492.436,00	0,10
. PETROBRÁS	PN	75.517	1.480.888,37	0,10
. RENT	ON	52.911	2.998.466,37	0,20
. SUZANO PAPEL	PNA	19.900	906.445,00	0,06
. VALE R. DOCE	PNA	50.289	2.972.582,79	0,20
. VALORES A PAGAR				0,00
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			59.461,96	0,00
Instituições Financeiras		132.547	2.784.207,08	0,19
. BRADESCO	PN	64.837	1.258.486,17	0,09
. ITAU	PN	67.710	1.523.475,00	0,10
. VALORES A PAGAR				0,00
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			2.245,91	0,00
B2. Fundos		10.297.453,22	35.935.087,58	2,45
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		4.269.354,93	12.977.628,58	0,88
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		42.148,06	6.763.044,98	0,46
. MOAT CAPITAL FIA		2.130.692,87	7.333.777,72	0,50
. SPX APACHE FIA		3.855.257,36	8.860.636,30	0,60
C - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		17.313.780	126.145.042,15	8,60
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP		8.517,01	2.376.204,31	0,16
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.281,00	20.916.602,13	1,43
. FIP BVEP PLAZA		3.000,00	2.993.862,77	0,20
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		6.368,85	4.634.205,89	0,32
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		1.125.602,34	1.218.421,79	0,08
. HAMILTON LANE FIC FIP		13.791,76	23.462.452,66	1,60
. MULTINER FIP		10,17	-9.015,97	0,00
. STRATUS SCP BR FIP		5.000.000,00	6.651.870,00	0,45
. P2BR INFR III FIQFIP		6.832,17	10.848.490,42	0,74
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		3.587.604,80	7.584.549,93	0,52
. KINEA CHRONOS FIM		7.560.771,69	13.424.684,69	0,92
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		6.337.198,69	10.879.579,68	0,74
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		11.894.682,91	12.951.224,55	0,88
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		47.508,29	8.211.909,30	0,56
D - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		8.684.216	22.974.843,15	1,57
. WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI		3.465,71	5.874.519,29	0,40
. GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE		46.431,13	5.749.261,87	0,39
. PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR		3.701.637,15	6.012.363,45	0,41
. ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR		4.932.681,62	5.338.698,54	0,36
E - INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			62.499.631,66	4,26
E1 - Investimentos em Shopping Center			36.213.120,13	2,47
. SHOPPING METRÔ BOULEVARD TATUAPÉ			36.213.120,13	2,47
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00
E2 - Investimento Imobiliário			10.153.969,10	0,69
. PANAMBY			10.153.969,10	0,69
. VALORES A PAGAR (-)			0,00	0,00
E3 - Investimento Fundo Imobiliário		79.678,67	12.307.812,94	0,84
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		79.208,00	6.742.463,00	0,46
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		470,67	5.528.710,88	0,38
. VALORES A RECEBER			36.639,06	0,00
E3 - Outros Investimentos Imobiliário		26,00	3.824.729,49	0,26
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		26	3.824.729,49	0,26
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		1.245	24.118.150,52	1,64
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		1.245	23.345.218,30	1,59
. VALORES A PAGAR (-)			-9.358,75	0,00
. VALORES A RECEBER			782.290,97	0,05
G - OUTROS			171.821.442,11	11,71
. DISPONIVEL			397.042,46	0,03
. DEPOSITOS JUDICIAIS			0,00	0,00

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO I

. OUTROS REALIZAVEIS			84.586.293,95	5,77	
. OUTROS DIREITOS A RECEBER			87.901.954,99	5,99	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-1.063.849,29	-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			62.616,59	0,02%	0,00%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO			152.315,10	0,05%	0,01%
- METRUS 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CP			56.962.206,53	17,19%	3,88%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA			12.977.628,58	3,92%	0,88%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA			6.763.044,98	2,04%	0,46%
- MOAT CAPITAL FIA			7.333.777,72	2,21%	0,50%
- SPX APACHE FIA			8.860.636,30	2,67%	0,60%
- BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO			179.224,41	0,05%	0,01%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP			5.018.121,77	1,51%	0,34%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II			3.902.013,23	1,18%	0,27%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER			59.533,73	0,02%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II			28.694,61	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III			44.190,41	0,01%	0,00%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.			356.256,70	0,11%	0,02%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL			4.877.868,69	1,47%	0,33%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM			15.357.940,97	4,64%	1,05%
- VINCI VALOREM FIM			14.422.409,35	4,35%	0,98%
- BRAD RF DI FED EXTRA			32.546.364,13	9,82%	2,22%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS III - FIP			2.376.204,31	0,72%	0,16%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			20.916.602,13	6,31%	1,43%
- FIP BVEP PLAZA			2.993.862,77	0,90%	0,20%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES			4.634.205,89	1,40%	0,32%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			1.218.421,79	0,37%	0,08%
- HAMILTON LANE FIC FIP			23.462.452,66	7,08%	1,60%
- MULTINER FIP			(9.015,97)	0,00%	0,00%
- STRATUS SCP BR FIP			6.651.870,00	2,01%	0,45%
- P2BR INFR III FIQFIP			10.848.490,42	3,27%	0,74%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			7.584.549,93	2,29%	0,52%
- KINEA CHRONOS FIM			13.424.684,69	4,05%	0,92%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM			10.879.579,68	3,28%	0,74%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM			12.951.224,55	3,91%	0,88%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM			8.211.909,30	2,48%	0,56%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO			6.779.102,06	2,05%	0,46%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			5.528.710,88	1,67%	0,38%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI			5.874.519,29	1,77%	0,40%
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE			5.749.261,87	1,74%	0,39%
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR			6.012.363,45	1,81%	0,41%
- ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR			5.338.698,54	1,61%	0,36%
TOTAL			331.332.542,04	100,00%	22,59%

GESTÃO PRÓPRIA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENDA FIXA			871.709.018,50	76,76%	59,42%
RENDA VARIÁVEL			17.783.556,91	1,57%	1,21%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			50.191.818,72	4,42%	3,42%
EMPRÉSTIMO PESSOAL			24.118.150,52	2,12%	1,64%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)			171.821.442,11	15,13%	11,71%
TOTAL			1.135.623.986,76	100,00%	77,41%