

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.08.2020

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.453.923.314,69		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			803.329.588,54	55,25	
TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOURE NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOURE NACIONAL					
<u>Nota do Tesouro Nacional</u>		159.578	528.184.708,06	36,33	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			243.732.177,01	16,76	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		1.500,00	3.294.365,22	0,23	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	1	13.141.991,09	0,90	0,90
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	1	3.403.988,49	0,23	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	1	2.047.692,08	0,14	0,37
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	1.500	3.294.365,22	0,23	0,23
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-1	-13.141.991,09	-0,90	-0,90
- BANCO MORADA		-2	-5.451.680,57	-0,37	-0,37
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		431	90.046.562,96	6,19	
. BRADESCO		71	23.831.809,39	1,64	
. SAFRA		90	35.760.778,18	2,46	
. PARANÁ BANCO		260,00	24.307.212,73	1,67	
. ABC		10,00	6.146.762,66	0,42	
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		38.811.373,25	150.391.248,83	10,34	
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		2.656.825,23	4.722.132,76	0,32	0,32
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		806.384,41	2.447.781,34	0,17	0,17
. BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO		24.619,55	11.318.829,38	0,78	0,78
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		30.166,67	3.329.536,94	0,23	0,23
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		76.402,72	7.857.767,46	0,54	0,54
. AZ QUEST LUCE		1.238.588,48	1.768.327,91	0,12	0,12
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		28.075.967,46	37.119.252,03	2,55	2,55
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		2.474,99	31.805,90	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		3.000,00	16.877,58	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		1.976,00	12.751,59	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		19,52	706.008,34	0,05	0,05
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		7.529,02	9.874.210,52	0,68	0,68
. BRAD RF DI FED EXTRA		5.887.419,19	71.185.967,08	4,90	4,90
. VALORES A RECEBER				0,00	0,00
<u>Debêntures</u>		20.070	31.412.703,47	2,16	
. LOJAS AMERICANAS		288	3.617.306,19	0,25	0,25
. CEMIG		10.000	15.119.772,94	1,04	1,04
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	9.649.184,29	0,66	0,66
. SABESP		990	3.026.440,05	0,21	0,21
. VALORES A RECEBER			3.127.765,40	0,22	
. COMANCHE PART.			3.127.765,40	0,22	0,22
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		0,00	-3.127.765,40	-0,22	
. COMANCHE PART.			-3.127.765,40	-0,22	-0,22
B - INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			211.829.080,42	14,57	
<u>B1. Mercado de Ações</u>			46.972.320,57	3,23	
<u>Companhias Abertas</u>		1.405.529	38.836.687,88	2,67	
. AMBEV	ON	87.539	1.077.605,09	0,07	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	64.254	1.258.735,86	0,09	
. COSAN	ON	48.600	4.045.950,00	0,28	
. ECORODOVIAS	ON	109.500	1.414.740,00	0,10	
. GERDAU - GGBR	PN	96.424	1.840.734,16	0,13	
. ITAUSA	ON	216	2.328,48	0,00	
. ITAUSA	PN	360.800	3.402.344,00	0,23	
. LOGG COMERCIAL	ON	5.656	175.222,88	0,01	
. MRVE	ON	78.400	1.408.848,00	0,10	

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

. PÃO DE AÇÚCAR	PN	42.600	2.705.526,00	0,19
. PETROBRÁS	PN	183.377	4.014.122,53	0,28
. RENT	ON	136.467	6.581.803,41	0,45
. SUZANO PAPEL	PNA	62.200	3.122.440,00	0,21
. VALE R. DOCE	PNA	129.496	7.728.321,28	0,53
. VALORES A RECEBER				0,00
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			57.966,19	0,00
Instituições Financeiras		366.759	8.135.632,69	0,56
. BRADESCO	PN	180.698	3.747.676,52	0,26
. ITAU	PN	186.061	4.381.736,55	0,30
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			6.219,62	0,00
B2. Fundos		39.225.067,92	164.856.759,85	11,34
. M. SQUARE INST. FIC FIA		6.293.092,63	22.838.172,65	1,57
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		11.421.519,84	36.051.662,45	2,48
. MOAT CAPITAL FIA		8.220.647,61	30.649.042,95	2,11
. SPX APACHE FIA		10.085.636,57	24.277.031,91	1,67
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.096.544,16	24.619.432,32	1,69
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	18.934.617,06	1,30
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		44.894,19	7.486.800,51	0,51
C - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		60.896.155,99	144.045.242,54	9,91
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II- FIP		10.858,75	-177.874,67	-0,01
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		395,93	6.460.040,06	0,44
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.269,00	18.752.399,32	1,29
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVPE PLAZA		2.000,00	1.996.665,88	0,14
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		2.729,37	1.987.974,77	0,14
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		750.401,73	814.788,32	0,06
. HAMILTON LANE FIC FIP		6.986,96	11.874.715,93	0,82
. STRATUS SCP BR FIP		5.000.000,00	6.651.870,00	0,46
. P2 BR INFRAESTRUTURA III FIC DE FIP		3.417,83	5.288.464,86	0,36
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	7.179.146,30	0,49
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		5.509.985,26	12.027.955,66	0,83
. KINEA CHRONOS FIM		11.925.565,78	21.355.198,89	1,47
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		9.523.673,63	16.369.161,83	1,13
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		18.077.115,65	19.839.650,69	1,36
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		73.756,10	13.625.084,74	0,94
D - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		17.603.704	58.539.573,87	4,03
. BB MM SCH INV EXTE FI		5.128.757,86	21.968.851,31	1,51
. VOT ALLIANZGI FIM		3.790.730,70	13.419.163,88	0,92
. 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			31.728.538,97	2,18
E1 - Investimentos em Shopping Center			23.777.791,97	1,64
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			23.767.311,94	1,63
. VALORES A RECEBER			10.480,03	0,00
E3 - Investimento Fundo Imobiliário		20.115,78	5.419.410,34	0,37
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		19.802,00	1.724.358,16	0,12
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		313,78	3.685.910,47	0,25
. VALORES A RECEBER			9.141,71	0,00
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00
E3 - Outros Investimentos Imobiliário		18,00	2.531.336,66	0,17
. CERTIFICADO DE RECEBÍVEIS IMOBILIARIOS		18	2.531.336,66	0,17
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		2.550	57.901.694,56	3,98
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		2.550	55.736.411,25	3,83
. VALORES A PAGAR (-)			-1.801,02	0,00
. VALORES A RECEBER			2.167.084,33	0,15
G - OUTROS			146.549.595,79	10,08
. DISPONÍVEL			287.757,80	0,02
. DEPOSITOS JUDICIAIS			0,00	0,00
. OUTROS REALIZÁVEIS			72.229.230,60	4,97
. OUTROS DIREITOS A RECEBER			74.622.577,91	5,13
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-589.970,52	-0,04
. EXIGÍVEL CONTINGENCIAL			0,00	0,00

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

GESTÃO TERCEIRIZADA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO TERCEIRIZADA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS					
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO			4.722.132,76	0,90%	0,32%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES			2.447.781,34	0,47%	0,17%
- M. SQUARE INST. FIC FIA			22.838.172,65	4,36%	1,57%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA			36.051.662,45	6,89%	2,48%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA			7.486.800,51	1,43%	0,51%
- MOAT CAPITAL FIA			30.649.042,95	5,86%	2,11%
- BBM SMID CAPS FICFIA			24.619.432,32	4,71%	1,69%
- BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO			11.318.829,38	2,16%	0,78%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP			3.329.536,94	0,64%	0,23%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II			7.857.767,46	1,50%	0,54%
- AZ QUEST LUCE			1.768.327,91	0,34%	0,12%
- IBIUNA EQ. FIC FIA			18.934.617,06	3,62%	1,30%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER			31.805,90	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II			16.877,58	0,00%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III			12.751,59	0,00%	0,00%
- SPX APACHE FIA			24.277.031,91	4,64%	1,67%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.			706.008,34	0,13%	0,05%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL			9.874.210,52	1,89%	0,68%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM			37.119.252,03	7,09%	2,55%
- BRAD RF DI FED EXTRA			71.185.967,08	13,60%	4,90%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP			(177.874,67)	-0,03%	-0,01%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			6.460.040,06	1,23%	0,44%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP			18.752.399,32	3,58%	1,29%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVPE PLAZA			1.996.665,88	0,38%	0,14%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES			1.987.974,77	0,38%	0,14%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			814.788,32	0,16%	0,06%
- HAMILTON LANE FIC FIP			11.874.715,93	2,27%	0,82%
- STRATUS SCP BR FIP			6.651.870,00	1,27%	0,46%
- P2BR INFR III FIQFIP			5.288.464,86	1,01%	0,36%
- COPA FLORESTAL III			7.179.146,30	1,37%	0,49%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			12.027.955,66	2,30%	0,83%
- KINEA CHRONOS FIM			21.355.198,89	4,08%	1,47%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM			16.369.161,83	3,13%	1,13%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM			19.839.650,69	3,79%	1,36%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM			13.625.084,74	2,60%	0,94%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			3.685.910,47	0,70%	0,25%
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO			1.733.499,87	0,33%	0,12%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- BB MM SCH INV EXTE FI			21.968.851,31	4,20%	1,51%
- VOT ALLIANZGI FIM			13.419.163,88	2,56%	0,92%
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI			5.955.324,15	1,14%	0,41%
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE			5.806.182,90	1,11%	0,40%
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR			6.027.601,24	1,15%	0,41%
- ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR			5.362.450,39	1,02%	0,37%
TOTAL			523.252.235,43	100,00%	35,99%

GESTÃO PRÓPRIA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENDA FIXA			652.938.339,71	70,16%	44,91%
RENDA VARIÁVEL			46.972.320,57	5,05%	3,23%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			26.309.128,63	2,83%	1,81%
EMPRÉSTIMO PESSOAL			57.901.694,56	6,22%	3,98%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)			146.549.595,79	15,75%	10,08%
TOTAL			930.671.079,26	100,00%	64,01%