

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.07.2020

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.448.156.588,85		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			783.397.228,63	54,10	
TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOIRO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOIRO NACIONAL					
<u>Nota do Tesouro Nacional</u>		159.578	534.508.944,27	36,91	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			<u>217.057.042,95</u>	<u>14,99</u>	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		1.500,00	3.267.521,68	0,23	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	1	13.141.991,09	0,91	0,91
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	1	3.403.988,49	0,24	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	1	2.047.692,08	0,14	0,38
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	1.500	3.267.521,68	0,23	0,23
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-1	-13.141.991,09	-0,91	-0,91
- BANCO MORADA		-2	-5.451.680,57	-0,38	-0,38
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		431	89.192.658,12	6,16	
. BRADESCO		71	23.475.379,12	1,62	
. SAFRA		90	35.489.176,62	2,45	
. PARANÁ BANCO		260,00	24.136.150,50	1,67	
. ABC		10,00	6.091.951,88	0,42	
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		38.841.940,64	124.596.863,15	8,60	
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		2.656.825,23	4.693.704,21	0,32	0,32
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		1.541.375,87	4.664.059,26	0,32	0,32
. BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO		24.619,55	11.284.034,34	0,78	0,78
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		30.166,67	3.314.610,38	0,23	0,23
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		76.402,72	7.957.404,52	0,55	0,55
. AZ QUEST LUCE		3.052.977,17	4.326.817,27	0,30	0,30
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		28.075.967,46	36.913.540,82	2,55	2,55
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		2.474,99	32.012,46	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		3.000,00	14.788,20	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		1.976,00	6.011,91	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		19,52	699.151,16	0,05	0,05
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		7.529,02	10.019.545,19	0,69	0,69
. BRAD RF DI FED EXTRA		3.368.606,44	40.671.183,43	2,81	2,81
. VALORES A RECEBER				0,00	0,00
<u>Debêntures</u>		20.275	31.831.241,41	2,20	
. LOJAS AMERICANAS		288	3.583.895,22	0,25	0,25
. CEMIG		10.000	15.016.395,20	1,04	1,04
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	9.808.964,92	0,68	0,68
. SABESP		990	3.003.402,30	0,21	0,21
. ESPÍRITO SANTO CENTRAIS ELÉTRICAS		205	418.583,77	0,03	0,03
. 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			217.440.904,81	15,02	
<u>B1. Mercado de Ações</u>			<u>49.597.860,84</u>	<u>3,42</u>	
<u>Companhias Abertas</u>		1.405.529	40.533.597,81	2,80	
. AMBEV	ON	87.539	1.216.792,10	0,08	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	64.254	1.330.057,80	0,09	

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

. COSAN	ON	48.600	4.393.440,00	0,30
. ECORODOVIAS	ON	109.500	1.589.940,00	0,11
. GERDAU - GGBR	PN	96.424	1.682.598,80	0,12
. ITAUSA	ON	216	2.624,40	0,00
. ITAUSA	PN	360.800	3.849.736,00	0,27
. LOGG COMERCIAL	ON	5.656	208.140,80	0,01
. MRVE	ON	78.400	1.500.576,00	0,10
. PÃO DE AÇUCAR	PN	42.600	3.024.600,00	0,21
. PETROBRÁS	PN	183.377	4.070.969,40	0,28
. RENT	ON	136.467	6.948.899,64	0,48
. SUZANO PAPEL	PNA	62.200	2.612.400,00	0,18
. VALE R. DOCE	PNA	129.496	7.861.702,16	0,54
. VALORES A RECEBER			0,00	0,00
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			241.120,71	0,02
Instituições Financeiras		366.759	9.064.263,03	0,63
. BRADESCO	PN	180.698	4.054.863,12	0,28
. ITAU	PN	186.061	5.003.180,29	0,35
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			6.219,62	0,00
B2. Fundos		39.225.067,92	167.843.043,97	11,59
. M. SQUARE INST. FIC FIA		6.293.092,63	23.134.309,10	1,60
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		11.421.519,84	35.760.131,92	2,47
. MOAT CAPITAL FIA		8.220.647,61	31.821.479,11	2,20
. SPX APACHE FIA		10.085.636,57	25.005.898,68	1,73
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.096.544,16	25.050.989,01	1,73
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	19.400.665,31	1,34
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		44.894,19	7.669.570,84	0,53
C - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		60.895.963,39	143.013.499,57	9,88
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II- FIP		10.858,75	-167.390,02	-0,01
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		395,93	6.458.680,88	0,45
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.220,00	18.661.823,46	1,29
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		2.000,00	2.010.545,30	0,14
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		2.719,77	1.980.385,98	0,14
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		750.401,73	581.855,50	0,04
. HAMILTON LANE FIC FIP		6.986,96	11.147.004,20	0,77
. STRATUS SCP BR FIP		5.000.000,00	6.594.790,00	0,46
. P2 BR INFRAESTRUTURA III FIC DE FIP		3.283,83	5.087.036,36	0,35
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	7.186.709,70	0,50
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		5.509.985,26	12.099.078,00	0,84
. KINEA CHRONOS FIM		11.925.565,78	21.331.835,52	1,47
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		9.523.673,63	16.140.604,05	1,11
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		18.077.115,65	19.752.835,34	1,36
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		73.756,10	14.147.705,34	0,98
D - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		20.946.555	68.570.217,65	4,74
. BB MM SCH INV EXTE FI		5.128.757,86	19.628.848,05	1,36
. MSQUARE GL EQ FICFIM		3.342.850,69	13.901.960,15	0,96
. VOT ALLIANZGI FIM		3.790.730,70	12.153.424,88	0,84
. 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	0,40
. 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			31.792.487,46	2,20
E1 - Investimentos em Shopping Center			23.843.657,70	1,65
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			23.855.014,19	1,65
. VALORES A RECEBER			-11.356,49	0,00
E3 - Investimento Fundo Imobiliário		20.115,78	5.498.037,75	0,38
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		19.802,00	1.801.982,00	0,12
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		313,78	3.687.540,89	0,25
. VALORES A RECEBER			8.514,86	0,00
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00
E3 - Outros Investimentos Imobiliário		18,00	2.450.792,01	0,17
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		18	2.450.792,01	0,17

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		2.603	58.112.958,09	4,01	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		2.583	56.028.305,29	3,87	
. VALORES A PAGAR (-)			-1.597,86	0,00	
. VALORES A RECEBER			2.086.250,66	0,14	
G - OUTROS			145.829.292,64	10,07	
. DISPONIVEL			197.786,49	0,01	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			0,00	0,00	
. OUTROS REALIZAVEIS			72.229.230,60	4,99	
. OUTROS DIREITOS A RECEBER			73.979.552,85	5,11	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-577.277,30	-0,04	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			0,00	0,00	
GESTÃO TERCEIRIZADA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO TERCEIRIZADA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS					
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO			4.693.704,21	0,92%	0,32%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES			4.664.059,26	0,92%	0,32%
- M. SQUARE INST. FIC FIA			23.134.309,10	4,54%	1,60%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA			35.760.131,92	7,02%	2,47%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA			7.669.570,84	1,51%	0,53%
- MOAT CAPITAL FIA			31.821.479,11	6,25%	2,20%
- BBM SMID CAPS FICFIA			25.050.989,01	4,92%	1,73%
- BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO			11.284.034,34	2,21%	0,78%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP			3.314.610,38	0,65%	0,23%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II			7.957.404,52	1,56%	0,55%
- AZ QUEST LUCE			4.326.817,27	0,85%	0,30%
- IBIUNA EQ. FIC FIA			19.400.665,31	3,81%	1,34%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER			32.012,46	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II			14.788,20	0,00%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III			6.011,91	0,00%	0,00%
- SPX APACHE FIA			25.005.898,68	4,91%	1,73%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.			699.151,16	0,14%	0,05%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL			10.019.545,19	1,97%	0,69%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM			36.913.540,82	7,24%	2,55%
- BRAD RF DI FED EXTRA			40.671.183,43	7,98%	2,81%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP			(167.390,02)	-0,03%	-0,01%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			6.458.680,88	1,27%	0,45%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP			18.661.823,46	3,66%	1,29%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVPE PLAZA			2.010.545,30	0,39%	0,14%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES			1.980.385,98	0,39%	0,14%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			581.855,50	0,11%	0,04%
- HAMILTON LANE FIC FIP			11.147.004,20	2,19%	0,77%
- STRATUS SCP BR FIP			6.594.790,00	1,29%	0,46%
- P2BR INFR III FIQFIP			5.087.036,36	1,00%	0,35%
- COPA FLORESTAL III			7.186.709,70	1,41%	0,50%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			12.099.078,00	2,37%	0,84%
- KINEA CHRONOS FIM			21.331.835,52	4,19%	1,47%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM			16.140.604,05	3,17%	1,11%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM			19.752.835,34	3,88%	1,36%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM			14.147.705,34	2,78%	0,98%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			3.687.540,89	0,72%	0,25%
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO			1.810.496,86	0,36%	0,13%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- BB MM SCH INV EXTE FI			19.628.848,05	3,85%	1,36%
- MSQUARE GL EQ FICFIM			13.901.960,15	2,73%	0,96%
- VOT ALLIANZGI FIM			12.153.424,88	2,39%	0,84%
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI			5.930.880,85	1,16%	0,41%
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE			5.737.149,75	1,13%	0,40%
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR			5.949.873,67	1,17%	0,41%
- ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR			5.268.080,30	1,03%	0,36%
TOTAL			509.521.662,09	100,00%	35,18%

**RESUMO DOS INVESTIMENTOS
PREVIDENCIAL**

PLANO II

GESTÃO PRÓPRIA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENTA FIXA			658.800.365,48	70,19%	45,49%
RENTA VARIÁVEL			49.597.860,84	5,28%	3,42%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			26.294.449,71	2,80%	1,82%
EMPRÉSTIMO PESSOAL			58.112.958,09	6,19%	4,01%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)			145.829.292,64	15,54%	10,07%
TOTAL			938.634.926,76	100,00%	64,82%