

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 29.05.2020

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.389.133.557,21		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			760.329.539,33	54,73	
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	526.568.829,93	37,91	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			203.247.289,32	14,63	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		1.500,00	3.233.402,76	0,23	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	1	13.141.991,09	0,95	0,95
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	1	3.403.988,49	0,25	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	1	2.047.692,08	0,15	0,39
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	1.500	3.233.402,76	0,23	0,23
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-1	-13.141.991,09	-0,95	-0,95
- BANCO MORADA		-2	-5.451.680,57	-0,39	-0,39
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		431	88.068.980,58	6,34	
. BRADESCO		71	23.005.119,68	1,66	
. SAFRA		90	35.138.610,61	2,53	
. PARANÁ BANCO		260,00	23.911.987,87	1,72	
. ABC		10,00	6.013.262,42	0,43	
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		46.779.064,62	111.944.905,98	8,06	
. BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP		3.024.304,06	171,78	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		2.660.004,57	4.622.665,25	0,33	0,33
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		1.541.375,87	4.624.446,36	0,33	0,33
. BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO		24.619,55	11.188.181,89	0,81	0,81
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		30.166,67	3.302.681,99	0,24	0,24
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		59.967,71	5.963.620,96	0,43	0,43
. AZ QUEST LUCE		9.471.236,31	13.087.559,50	0,94	0,94
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		28.075.967,46	36.323.689,16	2,61	2,61
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		2.474,99	32.313,65	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		3.000,00	10.907,70	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		1.976,00	7.358,90	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		19,52	690.188,82	0,05	0,05
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		7.529,02	9.521.375,73	0,69	0,69
. BRAD RF DI FED EXTRA		1.876.422,88	22.569.744,29	1,62	1,62
. VALORES A RECEBER				0,00	0,00
<u>Debêntures</u>		20.975	30.513.420,08	2,20	
. LOJAS AMERICANAS		288	3.408.996,95	0,25	0,25
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		700	25.542,14	0,00	0,00
. CEMIG		10.000	14.842.373,29	1,07	1,07
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	8.858.238,64	0,64	0,64
. SABESP		990	2.963.745,53	0,21	0,21
. ESPÍRITO SANTO CENTRAIS ELÉTRICAS		205	414.523,53	0,03	0,03
. VALORES A RECEBER			3.127.765,40	0,23	
. COMANCHE PART.			3.127.765,40	0,23	0,23
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		0,00	-3.127.765,40	-0,23	
. COMANCHE PART.			-3.127.765,40	-0,23	-0,23
B - INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			180.976.961,11	13,03	
<u>B1. Mercado de Ações</u>			41.888.134,14	3,02	
<u>Companhias Abertas</u>		1.405.529	34.170.841,98	2,46	
. AMBEV	ON	87.539	1.092.486,72	0,08	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	64.254	1.486.195,02	0,11	

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

. COSAN	ON	48.600	3.200.310,00	0,23
. ECORODOVIAS	ON	109.500	1.439.925,00	0,10
. GERDAU - GGBR	PN	96.424	1.294.974,32	0,09
. ITAUSA	ON	216	2.252,88	0,00
. ITAUSA	PN	360.800	3.196.688,00	0,23
. LOGG COMERCIAL	ON	5.656	132.350,40	0,01
. MRVE	ON	78.400	1.189.328,00	0,09
. PÃO DE AÇUCAR	PN	42.600	2.682.948,00	0,19
. PETROBRÁS	PN	183.377	3.729.888,18	0,27
. RENT	ON	136.467	5.251.250,16	0,38
. SUZANO PAPEL	PNA	62.200	2.354.892,00	0,17
. VALE R. DOCE	PNA	129.496	6.863.288,00	0,49
. VALORES A RECEBER				0,00
. VALORES A PAGAR				0,00
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			254.065,30	0,02
Instituições Financeiras		366.759	7.717.292,16	0,56
. BRADESCO	PN	180.698	3.424.227,10	0,25
. ITAU	PN	186.061	4.286.845,44	0,31
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			6.219,62	0,00
B2. Fundos		39.225.067,92	139.088.826,97	10,01
. M. SQUARE INST. FIC FIA		6.293.092,63	19.614.501,03	1,41
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		11.421.519,84	29.095.549,23	2,09
. MOAT CAPITAL FIA		8.220.647,61	25.076.810,14	1,81
. SPX APACHE FIA		10.085.636,57	21.682.823,64	1,56
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.096.544,16	20.693.074,70	1,49
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	16.426.356,03	1,18
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		44.894,19	6.499.712,20	0,47
C - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		60.895.674,57	140.151.100,35	10,09
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II- FIP		10.858,75	-129.003,45	-0,01
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		395,93	6.453.700,79	0,46
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.220,00	19.601.870,21	1,41
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		2.000,00	2.012.118,15	0,14
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		2.719,77	1.984.868,58	0,14
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		750.401,73	584.703,37	0,04
. HAMILTON LANE FIC FIP		6.698,14	9.973.525,13	0,72
. STRATUS SCP BR FIP		5.000.000,00	7.129.850,00	0,51
. P2 BR INFRAESTRUTURA III FIC DE FIP		3.283,83	5.242.157,44	0,38
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	7.202.469,00	0,52
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		5.509.985,26	11.501.138,81	0,83
. KINEA CHRONOS FIM		11.925.565,78	20.912.970,30	1,51
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		9.523.673,63	15.817.034,95	1,14
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		18.077.115,65	19.208.950,97	1,38
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		73.756,10	12.654.746,14	0,91
D - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		20.946.555	64.376.513,19	4,63
. BB MM SCH INV EXTE FI		5.128.757,86	18.325.599,70	1,32
. MSQUARE GL EQ FICFIM		3.342.850,69	12.848.340,74	0,92
. VOT ALLIANZGI FIM		3.790.730,70	11.310.766,98	0,81
. WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI		3.465,71	5.603.582,74	0,40
. GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE		46.431,13	5.485.615,30	0,39
. PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR		3.701.637,15	5.724.855,10	0,41
. ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR		4.932.681,62	5.077.752,63	0,37
E - INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			39.144.570,28	2,82
E1 - Investimentos em Shopping Center			24.022.754,51	1,73
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			24.030.418,71	1,73
. VALORES A RECEBER			-7.664,20	0,00
E3 - Investimento Fundo Imobiliário		80.432,78	12.786.185,81	0,92
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		19.802,00	1.794.061,20	0,13
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		313,78	3.685.855,92	0,27

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

. GGR COVEPI RENDA FII		60.317,00	7.297.753,83	0,53
. VALORES A RECEBER			8.514,86	<u>0,00</u>
. VALORES A PAGAR			0,00	<u>0,00</u>
E3 - Outros Investimentos Imobiliário		18,00	2.335.629,96	0,17
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		18	2.335.629,96	0,17
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		3.934	58.968.136,48	4,24
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		3.934	56.921.281,67	4,10
. VALORES A PAGAR (-)			-12.582,27	0,00
. VALORES A RECEBER			2.059.437,08	0,15
G - OUTROS			145.186.736,47	10,45
. DISPONIVEL			200.550,54	0,01
. DEPOSITOS JUDICIAIS			0,00	0,00
. OUTROS REALIZAVEIS			72.229.230,60	5,20
. OUTROS DIREITOS A RECEBER			73.315.226,49	5,28
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-558.271,16	-0,04
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			0,00	0,00

GESTÃO TERCEIRIZADA	DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO TERCEIRIZADA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS			
- BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP	171,78	0,00%	0,00%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO	4.622.665,25	0,99%	0,33%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES	4.624.446,36	0,99%	0,33%
- M. SQUARE INST. FIC FIA	19.614.501,03	4,19%	1,41%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	29.095.549,23	6,21%	2,09%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA	6.499.712,20	1,39%	0,47%
- MOAT CAPITAL FIA	25.076.810,14	5,35%	1,81%
- BBM SMID CAPS FICFIA	20.693.074,70	4,42%	1,49%
- BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	11.188.181,89	2,39%	0,81%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP	3.302.681,99	0,71%	0,24%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II	5.963.620,96	1,27%	0,43%
- AZ QUEST LUCE	13.087.559,50	2,79%	0,94%
- IBIUNA EQ. FIC FIA	16.426.356,03	3,51%	1,18%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	32.313,65	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	10.907,70	0,00%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	7.358,90	0,00%	0,00%
- SPX APACHE FIA	21.682.823,64	4,63%	1,56%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.	690.188,82	0,15%	0,05%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL	9.521.375,73	2,03%	0,69%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM	36.323.689,16	7,76%	2,61%
- BRAD RF DI FED EXTRA	22.569.744,29	4,82%	1,62%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP	(129.003,45)	-0,03%	-0,01%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	6.453.700,79	1,38%	0,46%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP	19.601.870,21	4,19%	1,41%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA	2.012.118,15	0,43%	0,14%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES	1.984.868,58	0,42%	0,14%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE	584.703,37	0,12%	0,04%
- HAMILTON LANE FIC FIP	9.973.525,13	2,13%	0,72%
- STRATUS SCP BR FIP	7.129.850,00	1,52%	0,51%
- P2BR INFR III FIQFIP	5.242.157,44	1,12%	0,38%
- COPA FLORESTAL III	7.202.469,00	1,54%	0,52%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS	11.501.138,81	2,46%	0,83%
- KINEA CHRONOS FIM	20.912.970,30	4,47%	1,51%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM	15.817.034,95	3,38%	1,14%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM	19.208.950,97	4,10%	1,38%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM	12.654.746,14	2,70%	0,91%

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			3.685.855,92	0,79%	0,27%
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO			1.802.576,06	0,38%	0,13%
- GGR COVEPI RENDA FII			7.297.753,83	1,56%	0,53%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- BB MM SCH INV EXTE FI			18.325.599,70	3,91%	1,32%
- MSQUARE GL EQ FICFIM			12.848.340,74	2,74%	0,92%
- VOT ALLIANZGI FIM			11.310.766,98	2,42%	0,81%
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI			5.603.582,74	1,20%	0,40%
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE			5.485.615,30	1,17%	0,39%
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR			5.724.855,10	1,22%	0,41%
- ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR			5.077.752,63	1,08%	0,37%
TOTAL			468.347.532,30	100,00%	33,72%

GESTÃO PRÓPRIA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENTA FIXA			648.384.633,35	70,42%	46,68%
RENTA VARIÁVEL			41.888.134,14	4,55%	3,02%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			26.358.384,47	2,86%	1,90%
EMPRÉSTIMO PESSOAL			58.968.136,48	6,40%	4,24%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)			145.186.736,47	15,77%	10,45%
TOTAL			920.786.024,91	100,00%	66,28%