

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 30.09.2020

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.455.712.061,05		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			820.302.113,97	56,35	
TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOUREIRO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOUREIRO NACIONAL					
Nota do Tesouro Nacional		159.578	532.436.978,16	36,58	
APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS			256.484.598,73	17,62	
Certificado de Depósito Bancário		1.500,00	3.319.495,05	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	3.319.495,05	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
Letra Financeira Subordinada		431	91.014.300,80	6,25	
. BRADESCO		71	24.296.873,28	1,67	
. SAFRA		90	36.030.949,77	2,48	
. PARANÁ BANCO		260,00	24.484.556,70	1,68	
. ABC		10,00	6.201.921,05	0,43	
Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.		39.185.833,44	162.150.802,88	11,14	
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		2.656.825,23	4.737.326,34	0,33	0,33
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		80.866,28	245.934,84	0,02	0,02
. BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO		24.619,55	11.332.503,50	0,78	0,78
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		30.166,67	3.345.414,51	0,23	0,23
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		76.402,72	7.804.042,85	0,54	0,54
. AZ QUEST LUCE		1.168.488,91	1.675.535,92	0,12	0,12
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		28.075.967,46	37.171.128,27	2,55	2,55
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		2.474,99	31.257,10	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		3.000,00	12.297,69	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		1.976,00	17.611,35	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		19,52	712.426,68	0,05	0,05
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		7.529,02	9.755.737,38	0,67	0,67
. BRAD RF DI FED EXTRA		7.057.497,09	85.309.586,45	5,86	5,86
. VALORES A RECEBER				0,00	0,00
Debêntures		20.070	31.380.537,08	2,16	
. LOJAS AMERICANAS		288	3.608.510,89	0,25	0,25
. CEMIG		10.000	15.242.036,28	1,05	1,05
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	9.476.694,77	0,65	0,65
. SABESP		990	3.053.295,14	0,21	0,21
. VALORES A RECEBER			3.127.765,40	0,21	
. COMANCHE PART.			3.127.765,40	0,21	0,21
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		0,00	-3.127.765,40	-0,21	
. COMANCHE PART.			-3.127.765,40	-0,21	-0,21
B - INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			202.817.512,18	13,93	
B1. Mercado de Ações			46.063.581,73	3,16	
Companhias Abertas		1.405.529	38.363.641,43	2,64	
. AMBEV	ON	87.539	1.097.739,06	0,08	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	64.254	1.180.988,52	0,08	
. COSAN	ON	48.600	3.320.838,00	0,23	
. ECOMODOVIA	ON	109.500	1.296.480,00	0,09	
. GERDAU - GGBR	PN	96.424	2.005.619,20	0,14	
. ITAUSA	ON	216	2.194,56	0,00	
. ITAUSA	PN	360.800	3.175.040,00	0,22	
. LOGG COMERCIAL	ON	5.656	170.075,92	0,01	

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

. MRVE	ON	78.400	1.261.456,00	0,09
. PÃO DE AÇÚCAR	PN	42.600	2.970.924,00	0,20
. PETROBRÁS	PN	183.377	3.596.022,97	0,25
. RENT	ON	136.467	7.733.584,89	0,53
. SUZANO PAPEL	PNA	62.200	2.833.210,00	0,19
. VALE R. DOCE	PNA	129.496	7.654.508,56	0,53
. VALORES A RECEBER				0,00
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			64.959,75	0,00
Instituições Financeiras		366.759	7.699.940,30	0,53
. BRADESCO	PN	180.698	3.507.348,18	0,24
. ITAU	PN	186.061	4.186.372,50	0,29
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			6.219,62	0,00
B2. Fundos		39.225.067,92	156.753.930,45	10,77
. M. SQUARE INST. FIC FIA		6.293.092,63	21.660.858,11	1,49
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		11.421.519,84	34.718.182,19	2,38
. MOAT CAPITAL FIA		8.220.647,61	28.295.210,12	1,94
. SPX APACHE FIA		10.085.636,57	23.180.075,72	1,59
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.096.544,16	23.465.659,96	1,61
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	18.230.256,75	1,25
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		44.894,19	7.203.687,60	0,49
C - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		60.896.273,88	138.763.373,08	9,53
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II- FIP		10.858,75	-186.885,75	-0,01
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		395,93	6.464.912,43	0,44
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.269,00	14.930.713,32	1,03
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		2.000,00	1.995.908,52	0,14
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		2.729,37	1.985.984,29	0,14
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		750.401,73	812.281,37	0,06
. HAMILTON LANE FIC FIP		7.104,85	12.086.718,07	0,83
. STRATUS SCP BR FIP		5.000.000,00	6.651.870,00	0,46
. P2 BR INFRAESTRUTURA III FIC DE FIP		3.417,83	5.427.020,86	0,37
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	6.990.986,40	0,48
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		5.509.985,26	11.648.651,58	0,80
. KINEA CHRONOS FIM		11.925.565,78	21.174.685,18	1,45
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		9.523.673,63	16.348.817,07	1,12
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		18.077.115,65	19.682.810,02	1,35
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		73.756,10	12.748.899,76	0,88
D - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		17.603.704	58.378.236,47	4,01
. BB MM SCH INV EXTE FI		5.128.757,86	21.822.303,98	1,50
. VOT ALLIANZGI FIM		3.790.730,70	13.581.089,34	0,93
. 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	0,37
E - INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			31.382.815,63	2,16
E1 - Investimentos em Shopping Center			23.703.514,19	1,63
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			23.679.609,69	1,63
. VALORES A RECEBER			23.904,50	0,00
E3 - Investimento Fundo Imobiliário		20.115,78	5.031.484,06	0,35
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		19.802,00	1.336.517,00	0,09
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		313,78	3.685.807,30	0,25
. VALORES A RECEBER			9.159,76	0,00
. VALORES A PAGAR			0,00	0,00
E3 - Outros Investimentos Imobiliário		18,00	2.647.817,38	0,18
. CERTIFICADO DE RECEBÍVEIS IMOBILIARIOS		18	2.647.817,38	0,18
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		2.532	57.140.528,98	3,93
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		2.532	54.851.384,68	3,77
. VALORES A PAGAR (-)			-1.196,68	0,00
. VALORES A RECEBER			2.290.340,98	0,16
G - OUTROS			146.927.480,74	10,09
. DISPONIVEL			85.868,69	0,01
. DEPOSITOS JUDICIAIS			0,00	0,00
. OUTROS REALIZAVEIS			72.229.230,60	4,96

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

. OUTROS DIREITOS A RECEBER			75.206.166,43	5,17
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-593.784,98	-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	4.737.326,34	0,91%	0,33%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES	245.934,84	0,05%	0,02%
- M. SQUARE INST. FIC FIA	21.660.858,11	4,16%	1,49%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	34.718.182,19	6,66%	2,38%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA	7.203.687,60	1,38%	0,49%
- MOAT CAPITAL FIA	28.295.210,12	5,43%	1,94%
- BBM SMID CAPS FICFIA	23.465.659,96	4,50%	1,61%
- BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	11.332.503,50	2,17%	0,78%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP	3.345.414,51	0,64%	0,23%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II	7.804.042,85	1,50%	0,54%
- AZ QUEST LUCE	1.675.535,92	0,32%	0,12%
- IBIUNA EQ. FIC FIA	18.230.256,75	3,50%	1,25%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	31.257,10	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	12.297,69	0,00%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	17.611,35	0,00%	0,00%
- SPX APACHE FIA	23.180.075,72	4,45%	1,59%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.	712.426,68	0,14%	0,05%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL	9.755.737,38	1,87%	0,67%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM	37.171.128,27	7,13%	2,55%
- BRAD RF DI FED EXTRA	85.309.586,45	16,37%	5,86%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP	(186.885,75)	-0,04%	-0,01%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	6.464.912,43	1,24%	0,44%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP	14.930.713,32	2,87%	1,03%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVPE PLAZA	1.995.908,52	0,38%	0,14%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES	1.985.984,29	0,38%	0,14%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE	812.281,37	0,16%	0,06%
- HAMILTON LANE FIC FIP	12.086.718,07	2,32%	0,83%
- STRATUS SCP BR FIP	6.651.870,00	1,28%	0,46%
- P2BR INFR III FIQFIP	5.427.020,86	1,04%	0,37%
- COPA FLORESTAL III	6.990.986,40	1,34%	0,48%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS	11.648.651,58	2,24%	0,80%
- KINEA CHRONOS FIM	21.174.685,18	4,06%	1,45%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM	16.348.817,07	3,14%	1,12%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM	19.682.810,02	3,78%	1,35%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM	12.748.899,76	2,45%	0,88%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	3.685.807,30	0,71%	0,25%
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO	1.345.676,76	0,26%	0,09%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			
- BB MM SCH INV EXTE FI	21.822.303,98	4,19%	1,50%
- VOT ALLIANZGI FIM	13.581.089,34	2,61%	0,93%
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI	5.874.519,29	1,13%	0,40%
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE	5.749.261,87	1,10%	0,39%
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR	6.012.363,45	1,15%	0,41%
- ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR	5.338.698,54	1,02%	0,37%
TOTAL	521.077.826,94	100,00%	35,80%

GESTÃO PRÓPRIA	DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENDA FIXA	658.151.311,09	70,42%	45,21%
RENDA VARIÁVEL	46.063.581,73	4,93%	3,16%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	26.351.331,57	2,82%	1,81%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	57.140.528,98	6,11%	3,93%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	146.927.480,74	15,72%	10,09%
TOTAL	934.634.234,11	100,00%	64,20%