

**RESUMO DOS INVESTIMENTOS  
PREVIDENCIAL**

**PLANO II**

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 30.06.2020

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
<b>INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO</b>			<b><u>1.414.950.065,61</u></b>		
<b>A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA</b>			<b><u>774.340.918,92</u></b>	<b><u>54,73</u></b>	
<b><u>TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOIRO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOIRO NACIONAL</u></b>					
<b>Nota do Tesouro Nacional</b>		<u>159.578</u>	<u>529.450.014,09</u>	<u>37,42</u>	
<b><u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u></b>			<u>213.911.044,27</u>	<u>15,12</u>	
<b><u>Certificado de Depósito Bancário</u></b>					
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	1	13.141.991,09	0,93	0,93
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	1	3.403.988,49	0,24	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	1	2.047.692,08	0,14	0,39
. CDB 2924 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	1.500	3.239.999,67	0,23	0,23
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-1	-13.141.991,09	-0,93	-0,93
- BANCO MORADA		-2	-5.451.680,57	-0,39	-0,39
<b><u>Letra Financeira Subordinada</u></b>					
. BRADESCO		71	23.141.674,29	1,64	
. SAFRA		90	35.209.043,06	2,49	
. PARANÁ BANCO		60,00	23.973.204,79	1,69	
. ABC		10,00	6.034.824,73	0,43	
<b><u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u></b>					
. BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP		3.024.304,06	3.611,02	0,00	0,00
. PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO		2.660.004,57	4.652.601,75	0,33	0,33
. AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES		1.541.375,87	4.637.856,18	0,33	0,33
. BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO		24.619,55	11.222.760,38	0,79	0,79
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		30.166,67	3.325.829,59	0,24	0,24
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		68.912,26	6.969.645,01	0,49	0,49
. AZ QUEST LUCE		6.319.413,81	8.817.542,75	0,62	0,62
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		28.075.967,46	36.696.539,42	2,59	2,59
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		2.474,99	31.906,91	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		3.000,00	11.327,90	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		1.976,00	6.960,32	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		19,52	692.194,53	0,05	0,05
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		7.529,02	9.685.839,73	0,68	0,68
. BRAD RF DI FED EXTRA		2.950.333,72	35.557.682,24	2,51	2,51
. VALORES A RECEBER				0,00	0,00
<b><u>Debêntures</u></b>					
. LOJAS AMERICANAS		288	3.522.201,20	0,25	0,25
. CEMIG		10.000	14.900.985,37	1,05	1,05
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	9.162.504,89	0,65	0,65
. SABESP		1.356	2.977.772,65	0,21	0,21
. ESPÍRITO SANTO CENTRAIS ELÉTRICAS		205	416.396,45	0,03	0,03
. VALORES A RECEBER			<u>3.127.765,40</u>	<u>0,22</u>	
. COMANCHE PART.			3.127.765,40	0,22	0,22
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS		<u>0,00</u>	<u>-3.127.765,40</u>	<u>-0,22</u>	
. COMANCHE PART.			-3.127.765,40	-0,22	-0,22
<b>B - INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL</b>			<b><u>198.357.662,92</u></b>	<b><u>14,02</u></b>	
<b><u>B1. Mercado de Ações</u></b>					
<b><u>Companhias Abertas</u></b>			<u>44.889.717,35</u>	<u>3,17</u>	
. AMBEV	ON	87.539	1.237.801,46	0,09	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	64.254	1.366.040,04	0,10	

**RESUMO DOS INVESTIMENTOS  
PREVIDENCIAL**

**PLANO II**

. BRCR12/DIR	DIR	2.678	14.828,69	0,00
. COSAN	ON	48.600	3.446.712,00	0,24
. ECORODOVIAS	ON	109.500	1.420.215,00	0,10
. GERDAU - GGBR	PN	96.424	1.543.748,24	0,11
. ITAUSA	ON	216	2.367,36	0,00
. ITAUSA	PN	360.800	3.460.072,00	0,24
. LOGG COMERCIAL	ON	5.656	186.365,20	0,01
. MRVE	ON	78.400	1.411.200,00	0,10
. PÃO DE AÇUCAR	PN	42.600	3.023.748,00	0,21
. PETROBRÁS	PN	183.377	3.951.774,35	0,28
. RENT	ON	136.467	5.582.864,97	0,39
. SUZANO PAPEL	PNA	62.200	2.288.338,00	0,16
. VALE R. DOCE	PNA	129.496	7.241.416,32	0,51
. VALORES A RECEBER				0,00
. VALORES A PAGAR			-17.952,19	0,00
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			248.257,24	0,02
<b>Instituições Financeiras</b>		<b>366.759</b>	<b>8.481.920,67</b>	<b>0,60</b>
. BRADESCO	PN	180.698	3.740.448,60	0,26
. ITAU	PN	186.061	4.735.252,45	0,33
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			6.219,62	0,00
<b>B2. Fundos</b>		<b>39.225.067,92</b>	<b>153.467.945,57</b>	<b>10,85</b>
. M. SQUARE INST. FIC FIA		6.293.092,63	21.406.551,97	1,51
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		11.421.519,84	33.225.598,56	2,35
. MOAT CAPITAL FIA		8.220.647,61	28.267.196,62	2,00
. SPX APACHE FIA		10.085.636,57	23.155.990,21	1,64
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.096.544,16	22.279.124,93	1,57
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	18.012.388,96	1,27
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		44.894,19	7.121.094,32	0,50
<b>C - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS</b>		<b>60.533.304,41</b>	<b>140.169.192,78</b>	<b>9,91</b>
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II- FIP		10.858,75	-135.780,47	-0,01
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		395,93	6.456.407,98	0,46
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.220,00	18.657.296,31	1,32
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		2.000,00	2.011.363,65	0,14
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		2.719,77	1.982.917,58	0,14
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		744.560,57	583.092,48	0,04
. HAMILTON LANE FIC FIP		6.698,14	10.188.317,85	0,72
. STRATUS SCP BR FIP		4.643.471,00	6.603.090,00	0,47
. P2 BR INFRAESTRUTURA III FIC DE FIP		3.283,83	5.078.332,04	0,36
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	7.023.138,00	0,50
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		5.509.985,26	11.787.504,87	0,83
. KINEA CHRONOS FIM		11.925.565,78	21.082.406,35	1,49
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		9.523.673,63	15.998.162,20	1,13
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		18.077.115,65	19.413.931,00	1,37
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		73.756,10	13.439.012,98	0,95
<b>D - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>		<b>20.946.555</b>	<b>66.517.694,46</b>	<b>4,70</b>
. BB MM SCH INV EXTE FI		5.128.757,86	18.897.369,83	1,34
. MSQUARE GL EQ FICFIM		3.342.850,69	13.550.857,76	0,96
. VOT ALLIANZGI FIM		3.790.730,70	11.800.205,08	0,83
. WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI		3.465,71	5.688.666,96	0,40
. GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE		46.431,13	5.548.685,08	0,39
. PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR		3.701.637,15	5.833.323,84	0,41
. ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR		4.932.681,62	5.198.585,91	0,37
<b>E - INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS</b>			<b>31.837.386,93</b>	<b>2,25</b>
<b>E1 - Investimentos em Shopping Center</b>			<b>23.933.741,07</b>	<b>1,69</b>
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			23.942.716,45	1,69
. VALORES A RECEBER			-8.975,38	0,00
<b>E3 - Investimento Fundo Imobiliário</b>		<b>68.065,78</b>	<b>5.524.777,56</b>	<b>0,39</b>
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		67.752,00	1.829.902,82	0,13

**RESUMO DOS INVESTIMENTOS  
PREVIDENCIAL**

**PLANO II**

. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	313,78	3.686.359,88	0,26
. VALORES A RECEBER		8.514,86	0,00
. VALORES A PAGAR		0,00	0,00
<b>E3 - Outros Investimentos Imobiliário</b>	<b>18,00</b>	<b>2.378.868,30</b>	<b>0,17</b>
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS	18	2.378.868,30	0,17
<b>F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES</b>	<b>2.603</b>	<b>58.428.546,05</b>	<b>4,13</b>
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	2.603	56.359.872,26	3,98
. VALORES A PAGAR (-)		-1.230,52	0,00
. VALORES A RECEBER		2.069.904,31	0,15
<b>G - OUTROS</b>		<b>145.298.663,55</b>	<b>10,27</b>
. DISPONIVEL		201.881,40	0,01
. DEPOSITOS JUDICIAIS		0,00	0,00
. OUTROS REALIZAVEIS		72.229.230,60	5,10
. OUTROS DIREITOS A RECEBER		73.444.440,54	5,19
. OUTRAS EXIGIBILIDADES		-576.888,99	-0,04
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL		0,00	0,00

GESTÃO TERCEIRIZADA	DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO TERCEIRIZADA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
<b>FUNDOS</b>			
- BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP	3.611,02	0,00%	0,00%
- PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REF. DI CRÉDITO	4.652.601,75	0,95%	0,33%
- AF INVEST FI RF CRÉDITO PRIVADO GERAES	4.637.856,18	0,95%	0,33%
- M. SQUARE INST. FIC FIA	21.406.551,97	4,39%	1,51%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA	33.225.598,56	6,81%	2,35%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA	7.121.094,32	1,46%	0,50%
- MOAT CAPITAL FIA	28.267.196,62	5,79%	2,00%
- BBM SMID CAPS FIC FIA	22.279.124,93	4,57%	1,57%
- BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI DI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	11.222.760,38	2,30%	0,79%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP	3.325.829,59	0,68%	0,24%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II	6.969.645,01	1,43%	0,49%
- AZ QUEST LUCE	8.817.542,75	1,81%	0,62%
- IBIUNA EQ. FIC FIA	18.012.388,96	3,69%	1,27%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	31.906,91	0,01%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	11.327,90	0,00%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	6.960,32	0,00%	0,00%
- SPX APACHE FIA	23.155.990,21	4,75%	1,64%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.	692.194,53	0,14%	0,05%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL	9.685.839,73	1,98%	0,68%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM	36.696.539,42	7,52%	2,59%
- BRAD RF DI FED EXTRA	35.557.682,24	7,29%	2,51%
<b>INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS</b>			
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP	(135.780,47)	-0,03%	-0,01%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	6.456.407,98	1,32%	0,46%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP	18.657.296,31	3,82%	1,32%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVPE PLAZA	2.011.363,65	0,41%	0,14%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES	1.982.917,58	0,41%	0,14%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE	583.092,48	0,12%	0,04%
- HAMILTON LANE FIC FIP	10.188.317,85	2,09%	0,72%
- STRATUS SCP BR FIP	6.603.090,00	1,35%	0,47%
- P2BR INFR III FIC FIP	5.078.332,04	1,04%	0,36%
- COPA FLORESTAL III	7.023.138,00	1,44%	0,50%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS	11.787.504,87	2,42%	0,83%
- KINEA CHRONOS FIM	21.082.406,35	4,32%	1,49%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM	15.998.162,20	3,28%	1,13%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM	19.413.931,00	3,98%	1,37%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM	13.439.012,98	2,75%	0,95%
<b>INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS</b>			
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	3.686.359,88	0,76%	0,26%
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO	1.838.417,68	0,38%	0,13%

**RESUMO DOS INVESTIMENTOS  
PREVIDENCIAL**

**PLANO II**

<b>INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>					
- BB MM SCH INV EXTE FI			18.897.369,83	3,87%	1,34%
- MSQUARE GL EQ FICFIM			13.550.857,76	2,78%	0,96%
- VOT ALLIANZGI FIM			11.800.205,08	2,42%	0,83%
- WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FI MUTI			5.688.666,96	1,17%	0,40%
- GLOBAL INCOME MASTER FUNDO DE INV MULT CP - IE			5.548.685,08	1,14%	0,39%
- PIMCO INCOME FI NO EXTERIOR			5.833.323,84	1,20%	0,41%
- ABERDEEN MULTI ASSET G ADV FIM INV NO EXTERIOR			5.198.585,91	1,07%	0,37%
<b>TOTAL</b>			<b>487.991.908,10</b>	<b>100,00%</b>	<b>34,49%</b>

<b>GESTÃO PRÓPRIA</b>	<b>DISTRIBUIÇÃO</b>	<b>% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA</b>	<b>% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES</b>
RENDA FIXA	652.028.621,19	70,34%	46,08%
RENDA VARIÁVEL	44.889.717,35	4,84%	3,17%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	26.312.609,37	2,84%	1,86%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	58.428.546,05	6,30%	4,13%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	145.298.663,55	15,67%	10,27%
<b>TOTAL</b>	<b>926.958.157,51</b>	<b>100,00%</b>	<b>65,51%</b>