



Relatório de Enquadramentos Legais da Carteira de Investimentos da EMBRAER PREV

Relatório de Política de Investimento - EMBRAER PREV

Referência: 28/02/2020

Renda Fixa	2.469.811.140,66
Renda Variável	702.569.073,06
Estruturado	-
Exterior	-
Imóveis	160.098.448,31
Empréstimos e Financiamentos	36.144.723,62
Contas Receber e Pagar	(14.497.634,95)
Derivativos	(2.573,80)
Patrimônio Líquido da Fundação	3.354.123.176,91

Segmento	Aplicação	% PL da Fundação	% Mínimo	% Máximo	Status
Renda Fixa	2.469.811.140,66	73,64%	35,00%	100,00%	Enquadrado
Renda Variável	702.569.073,06	20,95%	0,00%	50,00%	Enquadrado
Estruturado	-	0,00%	0,00%	20,00%	Enquadrado
Exterior	-	0,00%	0,00%	10,00%	Enquadrado
Imobiliário	160.098.448,31	4,77%	0,00%	20,00%	Enquadrado
Operações com Participantes	36.144.723,62	1,08%	0,00%	15,00%	Enquadrado
Contas Receber e Pagar	(14.497.634,95)	-0,43%	N/A	N/A	N/A
Derivativos	(2.573,80)	0,00%	N/A	N/A	N/A

Relatório de Enquadramento dos Investimentos - EMBRAER PREV

Referencia 28/02/2020
 Patrimônio Líquido: 3.354.123.176,91

Renda Fixa	Valor Aplicado	Aplicado (%)	Limite 4.661 (%)	Enquadramento
Renda Fixa - Títulos Públicos - Federais				
LFT	217.524.308,78	6,49%		
NTN_B	1.547.847.331,79	46,15%		
NTN_F	196.815.215,75	5,87%		
Total :	1.962.186.856,32	58,50%	100,00%	Enquadrado

Renda Fixa - Títulos Públicos	1.962.186.856,32	58,50%	100,00%	Enquadrado
--------------------------------------	-------------------------	---------------	----------------	-------------------

Renda Fixa - Títulos Privados - TVM de Instituição Financeira / Poupança				
CDB	5.332.929,77	0,16%		
LF252	124.171.572,23	3,70%		
Total :	129.504.502,00			

Renda Fixa - FIDC / FIC				
Cotas FIDC	26.236.613,10	0,78%		
Total :	26.236.613,10	0,78%	20,00%	Enquadrado

Renda Fixa - Títulos Privados - TVM de Companhias Abertas / Securitizadoras				
Debentures	351.883.169,23	10,49%		
Total :	351.883.169,23			

Renda Fixa - Títulos Privados	507.624.284,34	15,13%	80,00%	Enquadrado
--------------------------------------	-----------------------	---------------	---------------	-------------------

Renda Fixa	2.469.811.140,66	73,64%	100,00%	Enquadrado
-------------------	-------------------------	---------------	----------------	-------------------

Renda Variável	Valor Aplicado	Aplicado (%)	Limite 4.661 (%)	Enquadramento
----------------	----------------	--------------	------------------	---------------

AÇÕES DE MERCADO

Ações / FI de Segmento Especial				
BOVESPA NIVEL 1	134.911.535,32	4,02%		
BOVESPA NIVEL 2	108.318.957,06	3,23%		
NOVO MERCADO	422.220.883,99	12,59%		
Total :	665.451.376,36	19,84%	70,00%	Enquadrado

Ações / FI sem Segmento Especial				
OUTROS	37.117.696,70	1,11%		
Total :	37.117.696,70	1,11%	50,00%	Enquadrado

Renda Variável	702.569.073,06	20,95%	70,00%	Enquadrado
-----------------------	-----------------------	---------------	---------------	-------------------

Imobiliário	Valor Aplicado	Aplicado (%)	Limite 4.661 (%)	Enquadramento
-------------	----------------	--------------	------------------	---------------

Imobiliário				
--------------------	--	--	--	--

Imobiliário - Aluguéis e Renda*	2.159.752,98	0,06%		
Imobiliário				
Imobiliário - FI / FIC Imobiliário	122.191.795,03	3,64%		
Imobiliário				
Imobiliário - CRI	35.746.900,30	1,07%		
Imobiliário				
Imobiliário	160.098.448,31	4,77%	20,00%	Enquadrado
Empréstimos e Financiamento				
Empréstimos e Fin. Imobiliários				
Empréstimos	36.144.723,62	1,08%		
Empréstimos e Financiamentos Imobiliários				
Empréstimos e Financiamentos Imobiliários	36.144.723,62	1,08%	15,00%	Enquadrado
Derivativos				
Derivativos				
Futuros	68.439.148,01	2,04%		
Opções	-2.573,80	0,00%		
Derivativos				
Derivativos	-2.573,80	2,04%	100,00%	Enquadrado
Receitas e Despesas				
Contas Receber / Pagar				
Contas Receber / Pagar	-14.551.784,62	-0,43%		
Caixa				
Caixa	54.149,67	0,00%		
Contas Receber e Pagar				
Contas Receber e Pagar	-14.497.634,95			
Total Geral dos Ativos	3.354.123.176,91	100,00%		

* Conforme a Resolução 4.661, Art. 37, § 4º, o estoque de imóveis e terrenos pertencentes à carteira própria será considerado para o cômputo do limite disposto do art. 24 em relação aos recursos de cada plano, entretanto, no § 5º, fica explícito que em até doze anos, a contar da entrada em vigor de tal Resolução, as EFPC deverão alienar o estoque de imóveis e terrenos pertencentes à sua carteira própria ou constituir FII para abrigá-los, não se aplicando, neste caso, o limite estabelecido na alínea "e" do inciso II do art. 28.

Relatório Resumo de Enquadramento

Patrimônio Líquido da Fundação **3.354.123.176,91**

Tópico do Enquadramento	Limite	Aplicação Atual	Valor Limite	% Aplicado	Status
% do Segmento RF/PL PLANO	100,00%	2.469.811.140,66	3.354.123.176,91	73,64%	Enquadrado
% do PL em Títulos de Emissão do Tesouro Nacional e/ou do BACEN	100,00%	1.962.186.856,32	3.354.123.176,91	58,50%	Enquadrado
% do PL em Títulos RF1, exceto títulos do Tesouro Nacional	80,00%	507.624.284,34	2.683.298.581,51	15,13%	Enquadrado
% do PL em FIDC	20,00%	Verificar Rel. de Diversificação de FIDC's	670.824.645,38	0,00%	Enquadrado
% do PL em uma mesma pessoa jurídica não-financeira	10,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Não Financ.	335.412.322,69	0,00%	Enquadrado
% do PL em Instituições Financeiras	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Financ.	838.530.794,23	0,00%	Enquadrado
% de uma mesma Série de Debêntures	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Debêntures	838.530.794,23	0,00%	Enquadrado
% do PL em RV	70,00%	702.569.073,06	2.347.886.183,85	20,95%	Enquadrado
% do capital votante de uma empresa	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação RV	838.530.794,23	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Imobiliários	20,00%	160.098.448,31	670.824.645,38	4,77%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Empréstimos	15,00%	36.144.723,62	503.118.496,53	1,08%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Estruturados	20,00%	0,00	670.824.645,38	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos no Exterior	10,00%	0,00	335.412.322,69	0,00%	Enquadrado

Relatório de Diversificação - Debêntures

Referencia 28/02/2020

Limite Resolução 4.661 %

Máximo do Total da Emissão 25%

Código	Empresa	QT em Carteira	Total da Série	% da Série	Status
AEGP23	AEGEA SANEAMENTO E PARTICIPACOES S/A	1.051,00	6.650	15,8045%	Enquadrado
ALUP17	ALUPAR INVESTIMENTO S/A	2.500,00	648.500	0,3855%	Enquadrado
AMPL19	AMPLA ENERGIA E SERVICOS S/A	1.220,00	600.000	0,2033%	Enquadrado
CART22	CONCESSIONARIA AUTO RAPOSO TAVARES S/A	14.616,00	370.000	3,9503%	Enquadrado
CCRDD1	CCR S/A	4.500,00	176.796	2,5453%	Enquadrado
CMDT23	CEMIG DISTRIBUICAO S/A	17.239,00	1.095.458	1,5737%	Enquadrado
CMDT33	CEMIG DISTRIBUICAO S/A	1.473,00	653.675	0,2253%	Enquadrado
CMTR33	CEMIG GERACAO E TRANSMISSAO S/A	8.609,00	670.000	1,2849%	Enquadrado
CPT11	CACHOEIRA PAULISTA TRANSMISSORA DE ENERGIA S.A.	18.560,00	220.000	8,4364%	Enquadrado
CSMGC3	COMPANHIA DE SANEAMENTO DE MINAS GERAIS COPASA MG	11.800,00	67.400	17,5074%	Enquadrado
DASAB0	DIAGNOSTICOS DA AMERICA S/A	200,00	30.000	0,6667%	Enquadrado
ECCR32	ECORODOVIAS CONCESSOES E SERVICOS S/A	525,00	40.000	1,3125%	Enquadrado
ECPT11	CONCESSIONARIA DAS RODOVIAS AYRTON SENNA E CARVALHO PINTO S/A - ECOPISTAS	4.388,00	92.500	4,7438%	Enquadrado
ECPT21	CONCESSIONARIA DAS RODOVIAS AYRTON SENNA E CARVALHO PINTO S/A - ECOPISTAS	1.978,00	92.500	2,1384%	Enquadrado
ECPT31	CONCESSIONARIA DAS RODOVIAS AYRTON SENNA E CARVALHO PINTO S/A - ECOPISTAS	2.658,00	92.500	2,8735%	Enquadrado
ECPT41	CONCESSIONARIA DAS RODOVIAS AYRTON SENNA E CARVALHO PINTO S/A - ECOPISTAS	4.472,00	92.500	4,8346%	Enquadrado
ENJG21	COMPANHIA ENERGETICA JAGUARA..	1.549,00	634.000	0,2443%	Enquadrado
ENMA24	COMPANHIA ENERGETICA DO MARANHAO - CEMAR	776,00	17.862	4,3444%	Enquadrado
ENMI21	COMPANHIA ENERGETICA MIRANDA	916,00	386.000	0,2373%	Enquadrado
ENTV12	ENTREVIAS CONCESSIONARIA DE RODOVIAS S.A	12.620,00	1.000.000	1,2620%	Enquadrado
EQTL12	EQUATORIAL ENERGIA S.A.	660,00	695.500	0,0949%	Enquadrado
ERDV17	ECORODOVIAS CONCESSOES E SERVICOS S/A	9.000,00	350.000	2,5714%	Enquadrado
ERDV36	ECORODOVIAS CONCESSOES E SERVICOS S/A	3.000,00	30.000	10,0000%	Enquadrado
ESUL18	ENERGISA MATO GROSSO DO SUL - DISTRIBUIDORA DE ENERGIA S.A.	80,00	30.000	0,2667%	Enquadrado
GASP17	COMPANHIA DE GAS DE SAO PAULO - COMGAS	35.000,00	215.000	16,2791%	Enquadrado
GEPA24	RIO PARANAPANEMA ENERGIA S/A	12.500,00	250.000	5,0000%	Enquadrado
GEPA25	RIO PARANAPANEMA ENERGIA S/A	496,00	24.000	2,0667%	Enquadrado
GUAR11	GUARARAPES CONFECÇÕES S.A..	133,00	80.000	0,1663%	Enquadrado
IGTA24	IGUATEMI EMPRESA DE SHOPPING CENTERS S.A	550,00	5.000	11,0000%	Enquadrado
JSML36	JSL S.A	1.115,00	185.099	0,6024%	Enquadrado
LAME38	LOJAS AMERICANAS S/A	1.477,00	20.000	7,3850%	Enquadrado
LAMEA1	LOJAS AMERICANAS S/A	91,00	126.335	0,0720%	Enquadrado
LAMEB1	LOJAS AMERICANAS S/A	690,00	23.665	2,9157%	Enquadrado
LIGHC2	LIGHT SERVICOS DE ELETRICIDADE S/A	13.200,00	53.333	24,7502%	Enquadrado
LORTA1	LOCALIZA RENT A CAR S/A	113,00	50.000	0,2260%	Enquadrado
LSVE29	LIGHT SERVICOS DE ELETRICIDADE S/A	340,00	60.000	0,5667%	Enquadrado
MOVI33	MOVIDA PARTICIPACOES S/A	1.147,00	247.410	0,4636%	Enquadrado
NATU27	NATURA COSMETICOS S/A	172,00	182.727	0,0941%	Enquadrado
NCFP13	NCF PARTICIPACOES S.A.	300,00	560.000	0,0536%	Enquadrado
PETR45	PETROLEO BRASILEIRO S/A - PETROBRAS	13.000,00	251.690	5,1651%	Enquadrado
RDCO24	RODOVIAS DAS COLINAS S.A	584,00	12.368	4,7219%	Enquadrado
RDCO34	RODOVIAS DAS COLINAS S.A	902,00	25.500	3,5373%	Enquadrado
RESA31	RAIZEN ENERGIA S/A	900,00	304.025	0,2960%	Enquadrado
SAPR23	COMPANHIA DE SANEAMENTO DO PARANA - SANEPAR	150,00	10.033	1,4951%	Enquadrado
SBESC7	CIA SANEAMENTO BASICO EST. SP - SABESP	880,00	17.999	4,8892%	Enquadrado
SBSPC2	CIA SANEAMENTO BASICO EST. SP - SABESP	12.119,00	250.000	4,8476%	Enquadrado
SSBR22	ALIANSCE SONAE SHOPPING CENTER S/A	1.000,00	125.000	0,8000%	Enquadrado
SSED11	SABER SERVICOS EDUCACIONAIS S.A.	104,00	112.966	0,0921%	Enquadrado
SULM15	SUL AMERICA S/A	1.297,00	500.000	0,2594%	Enquadrado
SULM23	SUL AMERICA S/A	300,00	13.000	2,3077%	Enquadrado
TAE23	TRANSMISSORA ALIANCA DE ENERGIA ELETRICA S/A	6.527,00	793.000	0,8231%	Enquadrado
TAE33	TRANSMISSORA ALIANCA DE ENERGIA ELETRICA S/A	8.659,00	702.000	1,2335%	Enquadrado
TIET19	AES TIETE ENERGIA S/A	2.000,00	1.380.000	0,1449%	Enquadrado
TSAE22	TRIANGULO DO SOL AUTO - ESTRADAS S/A	164,00	36.705	0,4468%	Enquadrado
USIM27	USINAS SIDERURGICAS DE MG S/A - USIMINAS	5.000,00	1.300.000	0,3846%	Enquadrado
VIVT15	TELEFONICA BRASIL S/A	522,00	200.000	0,2610%	Enquadrado

Relatório de Diversificação - FIDC's

Referencia 28/02/2020

Límite Resolução 4.661	%
Máximo Aplicado em FIDC - % do PL da Fundação	20%
Máximo Aplicado por FIDC - % do PL do Fundo	25%
Máximo Aplicado por FIDC - % do PL Emissor	10%

Fundo	Instituição Proprietária	Valor Aplicado R\$	PL do Fundo R\$	% PL do Fundo	Status
CELG DISTRIBUICAO FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS	OLIVEIRA TRUST	9.677.948,64	111.400.847,68	8,6875%	Enquadrado
CHEMICAL IX FIDC INDUSTRIA PETROQUIMICA	BEM DTVM	1.310.535,38	560.423.607,07	0,2338%	Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	OLIVEIRA TRUST	6.995.639,68	121.663.298,72	5,7500%	Enquadrado
FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS SANEAMENTO GOIAS SA - INFRAESTRUTURA IV	OLIVEIRA TRUST	8.252.489,41	305.082.787,74	2,7050%	Enquadrado

Fundo	Instituição Proprietária	Valor Aplicado R\$	PL da Fundação R\$	% PL da Fundação	Status
CHEMICAL IX FIDC INDUSTRIA PETROQUIMICA	BEM DTVM	1.310.535,38	3.354.123.176,91	0,0391%	Enquadrado
CELG DISTRIBUICAO FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS	OLIVEIRA TRUST	9.677.948,64	3.354.123.176,91	0,2885%	Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	OLIVEIRA TRUST	6.995.639,68	3.354.123.176,91	0,2086%	Enquadrado
FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS SANEAMENTO GOIAS SA - INFRAESTRUTURA IV	OLIVEIRA TRUST	8.252.489,41	3.354.123.176,91	0,2460%	Enquadrado

Fundação	PL Total da Fundação - R\$	Total Aplicado em FIDC R\$	% PL da Fundação	Status
Fundação	3.354.123.176,91	26.236.613,10	0,7822%	Enquadrado

Relatório de Diversificação de Renda Fixa - Instituição não Financeira

Referencia 28/02/2020

Limite Resolução 4.661	%
Máximo de Emissão por Instit. não Financeira	10%
Patrimônio Líquido da Fundação	3.354.123.176,91
Total de Instituição não Financeira	387.630.069,53
% Pl da Fundação	11,56%

Papel	Aplicação Atual	% Aplicado	Status
CRI	35.746.900,30	1,07%	
HABITASEC SECURITIZADORA SA	25.432.244,88	0,76%	Enquadrado
RB CAPITAL COMPANHIA SECURITIZACAO	10.314.655,42	0,31%	Enquadrado
Debentures	351.883.169,23	10,49%	
AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	11.590.832,79	0,35%	Enquadrado
AES TIETE ENERGIA SA	2.015.336,61	0,06%	Enquadrado
ALUPAR INVESTIMENTO S.A	2.533.828,37	0,08%	Enquadrado
AMPLA ENERGIA SERVICOS SA	1.231.771,96	0,04%	Enquadrado
CACHOEIRA PAULISTA TRANSMISSORA ENERGIA SA	7.300.480,31	0,22%	Enquadrado
CCR SA	4.986.156,15	0,15%	Enquadrado
CEMIG GERACAO TRANSMISSAO SA	8.859.270,40	0,26%	Enquadrado
CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	4.104.977,54	0,12%	Enquadrado
CIA GAS SAO PAULO COMGAS	40.267.973,10	1,20%	Enquadrado
CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	12.557.389,87	0,37%	Enquadrado
COMPANHIA ENERGETICA JAGUARA	1.670.565,99	0,05%	Enquadrado
COMPANHIA ENERGETICA MIRANDA	987.887,96	0,03%	Enquadrado
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	25.612.908,32	0,76%	Enquadrado
COMPANHIA SANEAMENTO PARANA SANEPAR	1.081.006,66	0,03%	Enquadrado
CONCESSIONARIA AUTO RAPOSO TAVARES SA	19.360.401,72	0,58%	Enquadrado
CONCESSIONARIA RODOVIAS AYRTON SENNA CARVALHO PINTO SA ECOPISTAS	11.737.683,93	0,35%	Enquadrado
DIAGNOSTICOS AMERICA SA	1.973.889,40	0,06%	Enquadrado
DUKE ENERGY INTERNATIONAL GERACAO PARANAPANEMA SA	22.883.402,00	0,68%	Enquadrado
ECORODOVIAS CONCESSIONARIAS SERVICOS SA	13.383.738,52	0,40%	Enquadrado
ENERGISA MATO GROSSO SUL - DISTRIBUIDORA ENERGIA S.A	811.245,72	0,02%	Enquadrado
ENTREVIAS CONCESSIONARIA RODOVIAS S.A	12.696.882,22	0,38%	Enquadrado
EQUATORIAL ENERGIA SA	679.023,13	0,02%	Enquadrado
ERDV	7.898.162,31	0,24%	Enquadrado
GRUPO CEMIG	10.346.176,10	0,31%	Enquadrado
GUARARAPES CONFECÇÕES SA (EX CONFECÇÕES GUARARAPES SA)	1.352.429,94	0,04%	Enquadrado
IGUATEMI EMPRESA SHOPPING CENTERS SA	7.852.081,03	0,23%	Enquadrado
JSL SA	836.290,53	0,02%	Enquadrado
LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	19.765.604,32	0,59%	Enquadrado
LOCALIZA RENT A CAR SA	1.135.900,62	0,03%	Enquadrado
LOJAS AMERICANAS SA	23.588.936,64	0,70%	Enquadrado
MOVIDA PARTICIPACOES	1.184.399,95	0,04%	Enquadrado
NATURA COSMETICOS SA	1.790.755,33	0,05%	Enquadrado
NCF PARTICIPACOES SA	3.025.297,76	0,09%	Enquadrado
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	14.751.875,98	0,44%	Enquadrado
RAIZEN ENERGIA SA	657.647,79	0,02%	Enquadrado
RODOVIAS COLINAS SA	15.201.743,27	0,45%	Enquadrado
SABER SERVICOS EDUCACIONAIS SA	1.041.272,42	0,03%	Enquadrado

SONAE SIERRA BRASIL SA	1.127.748,45	0,03% Enquadrado
SUL AMERICA SA	5.631.409,38	0,17% Enquadrado
TELEFONICA BRASIL SA	5.210.498,12	0,16% Enquadrado
TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA SA	15.635.816,18	0,47% Enquadrado
TRIANGULO SOL AUTO ESTRADAS SA	355.064,22	0,01% Enquadrado
USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMINAS	5.167.406,23	0,15% Enquadrado

Resumo do Relatório de Diversificação de Renda Variável

Limite Resolução 4.661	%
Máximo Aplicado em Ações	70,00%
Ações Segmento Especial	70,00%
Ações s/ Segmento Especial	50,00%

Patrimônio Líquido da Fundação	3.354.123.176,91
---------------------------------------	-------------------------

Mercado	Cód. Bovespa	Valor Aplicado	% PL Fundação	Status
Ações Segmento Especial	NM, N2, N1, Mais, Mais2 ...	665.451.376,36	19,84%	Enquadrado
Ações s/ Segmento Especial		37.117.696,70	1,11%	Enquadrado
Total		702.569.073,06	20,95%	Enquadrado

Relatório de Diversificação de Renda Variável

Limite Resolução 4.661	%
Máximo Aplicado em Ações Mesma Companhia - Capital Votante da Companhia	25,00%
Máximo Aplicado em Ações Mesma Companhia - Capital Total da Companhia	25,00%
Máximo Aplicado em Ações Mesma Companhia - PL Fundação	10,00%

Patrimônio Líquido da Fundação	3.354.123.176,91
---------------------------------------	-------------------------

Cód Ação	Empresa	Mercado	Valor Aplicado	% PL Fundação	Status	Quantidade de Ações na Carteira			% Capital Social		Status
						ON	PN	Total	ON	Total	
ABEV	AMBEV S.A.	BOLSA	18.944.238,70	0,56%	Enquadrado	1.302.905	0	1.302.905	0,01%	0,01%	Enquadrado
AZUL	AZUL S.A.	BOVESPA NIVEL 2	7.105.956,00	0,21%	Enquadrado	0	159.900	159.900	0,00%	0,00%	Enquadrado
B3SA	B3 S.A. - BRASIL, BOLSA, BALCÃO	NOVO MERCADO	28.792.464,00	0,86%	Enquadrado	599.843	0	599.843	0,03%	0,03%	Enquadrado
BBAS	BCO BRASIL S.A.	NOVO MERCADO	19.057.962,00	0,57%	Enquadrado	406.700	0	406.700	0,01%	0,01%	Enquadrado
BBDC	BCO BRADESCO S.A.	BOVESPA NIVEL 1	51.328.379,32	1,53%	Enquadrado	0	1.681.244	1.681.244	0,00%	0,00%	Enquadrado
BPAC	BCO BTG PACTUAL S.A.	BOVESPA NIVEL 2	30.793.848,00	0,92%	Enquadrado	455.800	911.600	1.367.400	0,00%	0,02%	Enquadrado
BRPR	BR PROPERTIES S.A.	NOVO MERCADO	15.102.880,00	0,45%	Enquadrado	1.096.000	0	1.096.000	0,22%	0,22%	Enquadrado
BTOW	B2W - COMPANHIA DIGITAL	NOVO MERCADO	29.123.800,75	0,87%	Enquadrado	468.605	0	468.605	0,09%	0,09%	Enquadrado
CCRO	CCR S.A.	NOVO MERCADO	25.747.511,00	0,77%	Enquadrado	1.576.700	0	1.576.700	0,08%	0,08%	Enquadrado
CMIG	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS - CEMIG	BOVESPA NIVEL 1	7.338.772,00	0,22%	Enquadrado	0	525.700	525.700	0,00%	0,00%	Enquadrado
COGN	COGNA EDUCAÇÃO S.A.	NOVO MERCADO	23.062.107,60	0,69%	Enquadrado	2.285.640	0	2.285.640	0,12%	0,12%	Enquadrado
CPFE	CPFL ENERGIA S.A.	NOVO MERCADO	14.471.369,00	0,43%	Enquadrado	407.300	0	407.300	0,04%	0,04%	Enquadrado
CRFB	ATACADÃO S.A.	NOVO MERCADO	3.858.685,00	0,12%	Enquadrado	186.500	0	186.500	0,01%	0,01%	Enquadrado
CSNA	CIA SIDERURGICA NACIONAL	BOLSA	11.266.086,00	0,34%	Enquadrado	1.007.700	0	1.007.700	0,07%	0,07%	Enquadrado
ENGI	ENERGISA S.A.	BOVESPA NIVEL 2	4.941.000,00	0,15%	Enquadrado	91.500	366.000	457.500	0,00%	0,01%	Enquadrado
EVEN	EVEN CONSTRUTORA E INCORPORADORA S.A.	NOVO MERCADO	13.431.991,20	0,40%	Enquadrado	936.680	0	936.680	0,43%	0,43%	Enquadrado
EZTC	EZ TEC EMPREEND. E PARTICIPACOES S.A.	NOVO MERCADO	7.063.350,00	0,21%	Enquadrado	151.900	0	151.900	0,07%	0,07%	Enquadrado
HAPV	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	NOVO MERCADO	20.236.596,00	0,60%	Enquadrado	366.605	0	366.605	0,05%	0,05%	Enquadrado
IRBR	IRB - BRASIL RESSEGUROS S.A.	NOVO MERCADO	6.104.700,00	0,18%	Enquadrado	183.600	0	183.600	0,02%	0,02%	Enquadrado
ITUB	ITAU UNIBANCO HOLDING S.A.	BOVESPA NIVEL 1	76.244.384,00	2,27%	Enquadrado	0	2.382.637	2.382.637	0,00%	0,00%	Enquadrado
JBSS	JBS S.A.	NOVO MERCADO	12.607.580,00	0,38%	Enquadrado	555.400	0	555.400	0,02%	0,02%	Enquadrado
LREN	LOJAS RENNEN S.A.	NOVO MERCADO	16.475.030,00	0,49%	Enquadrado	309.100	0	309.100	0,04%	0,04%	Enquadrado
MGLU	MAGAZINE LUIZA S.A.	NOVO MERCADO	3.501.036,00	0,10%	Enquadrado	69.300	0	69.300	0,00%	0,00%	Enquadrado
NEOE	NEOENERGIA S.A.	NOVO MERCADO	14.546.115,00	0,43%	Enquadrado	609.900	0	609.900	0,05%	0,05%	Enquadrado
NTCO	NATURA & CO HOLDING S.A.	NOVO MERCADO	14.071.692,00	0,42%	Enquadrado	309.200	0	309.200	0,03%	0,03%	Enquadrado
PCAR	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO	NOVO MERCADO	13.585.524,00	0,41%	Enquadrado	0	188.400	188.400	0,00%	0,00%	Enquadrado
PETR	PETROLEO BRASILEIRO S.A. PETROBRAS	BOVESPA NIVEL 2	48.503.703,06	1,45%	Enquadrado	495.000	1.383.759	1.878.759	0,01%	0,01%	Enquadrado
RAIL	RUMO S.A.	NOVO MERCADO	24.395.712,00	0,73%	Enquadrado	1.155.100	0	1.155.100	0,07%	0,07%	Enquadrado
RENT	LOCALIZA RENT A CAR S.A.	NOVO MERCADO	28.948.699,00	0,86%	Enquadrado	584.350	0	584.350	0,08%	0,08%	Enquadrado
SAPR	CIA SANEAMENTO DO PARANA - SANEPAR	BOVESPA NIVEL 2	16.974.450,00	0,51%	Enquadrado	168.900	675.600	844.500	0,00%	0,03%	Enquadrado
TIMP	TIM PARTICIPACOES S.A.	NOVO MERCADO	7.460.125,00	0,22%	Enquadrado	462.500	0	462.500	0,02%	0,02%	Enquadrado
TOTS	TOTVS S.A.	NOVO MERCADO	34.723.890,00	1,04%	Enquadrado	489.000	0	489.000	0,25%	0,25%	Enquadrado
VALE	VALE S.A.	NOVO MERCADO	36.143.445,45	1,08%	Enquadrado	815.695	0	815.695	0,02%	0,02%	Enquadrado
VIVT	TELEFÔNICA BRASIL S.A	BOLSA	6.907.372,00	0,21%	Enquadrado	0	129.400	129.400	0,00%	0,00%	Enquadrado
YDUQ	ESTACIO PARTICIPACOES S.A.	NOVO MERCADO	9.708.619,00	0,29%	Enquadrado	187.100	0	187.100	0,06%	0,06%	Enquadrado

Relatório de Diversificação de Renda Fixa - Instituição Financeira

Referencia 28/02/2020

Limite Resolução 4.661	%
Máximo de Emissão por Inst. Financeira	20%
Máximo de Emissão por PL Inst. Financeira	25%

Patrimônio Líquido da Fundação **3.354.123.176,91**

Papel	Aplicação Atual	PL da Instituição	% Instituição	Status	% Fundação	Status
BANCO ABC BRASIL S/A						
LF252	1.805.152,36					
Total	1.805.152,36	3.956.286.000,00	0,05%	Enquadrado	0,05%	Enquadrado
BANCO BRADESCO S.A						
LF252	32.514.131,30					
Total	32.514.131,30	139.403.014.000,00	0,02%	Enquadrado	0,97%	Enquadrado
BANCO ITAÚ S.A.						
LF252	31.212.211,11					
Total	31.212.211,11	138.588.384.000,00	0,02%	Enquadrado	0,93%	Enquadrado
BANCO VOTORANTIM						
LF252	39.104.848,64					
Total	39.104.848,64	10.146.659.000,00	0,39%	Enquadrado	1,17%	Enquadrado
BCO BRASIL SA						
LF252	10.360.041,06					
Total	10.360.041,06	94.812.626.000,00	0,01%	Enquadrado	0,31%	Enquadrado
BCO ITAU SA						
LF252	7.348.661,88					
Total	7.348.661,88	138.588.384.000,00	0,01%	Enquadrado	0,22%	Enquadrado
BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA						
CDB	5.332.929,77					
Total	5.332.929,77	1.855.549.000,00	0,29%	Enquadrado	0,16%	Enquadrado
CAIXA ECONOMICA FEDERAL						
LF252	1.826.525,88					
Total	1.826.525,88	48.542.507.000,00	0,00%	Enquadrado	0,05%	Enquadrado

Relatório de Diversificação de Fundos de Investimentos

Referencia 28/02/2020

Limite Resolução 4.661	%
Máximo Aplicado em FUNDO - % do PL da Fundação	10%
Máximo Aplicado por FUNDO - % do PL do Fundo	25%
Máximo Aplicado por FUNDO - % do PL Emissor	10%

Fundo	Instituição Proprietária	Valor Aplicado R\$	PL do Fundo R\$	% PL do Fundo	Status
CASTELLO BRANCO OFFICE PARK FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		2.048.902,00	121.084.978,09	1,6921%	Enquadrado
CSHG GR LOUVEIRA FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		3.943.128,63	141.176.542,01	2,7930%	Enquadrado
FII BB VOTORANTIM CIDADE JARDIM CONTINENTAL TOWER		5.168.008,69	156.006.766,67	3,3127%	Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - VBI LOGÍSTICO		4.791.708,60	775.079.736,08	0,6182%	Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO BTG PACTUAL SHOPPINGS		2.949.000,00	436.084.538,81	0,6762%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM BRASCAN LAJES CORPORATIVAS FII		2.034.147,00	93.932.333,05	2,1655%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM CENESP FII		2.060.696,50	282.008.377,32	0,7307%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII CEO CYRELA COMMERCIAL PROPERTIES		1.494.794,46	178.531.937,77	0,8373%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO GENERAL SHOPPING ATIVO RENDA FII		4.536.874,29	280.593.437,38	1,6169%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO MAX RETAIL		2.332.600,00	132.603.485,49	1,7591%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA		7.948.855,99	590.336.361,17	1,3465%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO NEGRO FII		977.013,12	274.464.965,11	0,3560%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO VIA PARQUE SHOPPING		5.860.057,72	600.578.628,62	0,9757%	Enquadrado
FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII SHOPPING JARDIM SUL		3.347.982,00	228.341.214,20	1,4662%	Enquadrado
HSI MALLS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO		18.477.605,24	1.517.517.090,72	1,2176%	Enquadrado
MALLS BRASIL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO		17.188.235,99	797.888.721,82	2,1542%	Enquadrado
RB CAPITAL GENERAL SHOPPING SULACAP FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		3.363.552,00	92.851.179,50	3,6225%	Enquadrado
RENDA ESCRITORIOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII		1.752.320,30	65.915.339,15	2,6584%	Enquadrado
SDI LOGISTICA RIO FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		950.323,20	455.081.776,13	0,2088%	Enquadrado
SDI PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO		5.624.736,34	349.575.038,35	1,6090%	Enquadrado
TRX REAL ESTATE FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO		2.806.479,00	189.120.355,46	1,4840%	Enquadrado
TRX REALTY LOGISTICA RENDA I FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		10.194.772,19	204.152.551,22	4,9937%	Enquadrado
VINCI SHOPPING CENTERS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII		10.358.428,01	1.737.659.655,20	0,5961%	Enquadrado
XP INDUSTRIAL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO		1.579.266,00	247.878.643,78	0,6371%	Enquadrado
XP MALLS FUNDO INVESTIMENTOS IMOBILIARIOS		402.307,80	1.980.202.598,44	0,0203%	Enquadrado

Fundo	Administrador	Valor Aplicado R\$	PL da Fundação R\$	% PL da Fundação	Status
CASTELLO BRANCO OFFICE PARK FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		2.048.902,00	3.354.123.176,91	0,0611%	Enquadrado
CSHG GR LOUVEIRA FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		3.943.128,63	3.354.123.176,91	0,1176%	Enquadrado
FII BB VOTORANTIM CIDADE JARDIM CONTINENTAL TOWER		5.168.008,69	3.354.123.176,91	0,1541%	Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - VBI LOGÍSTICO		4.791.708,60	3.354.123.176,91	0,1429%	Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO BTG PACTUAL SHOPPINGS		2.949.000,00	3.354.123.176,91	0,0879%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM BRASCAN LAJES CORPORATIVAS FII		2.034.147,00	3.354.123.176,91	0,0606%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM CENESP FII		2.060.696,50	3.354.123.176,91	0,0614%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII CEO CYRELA COMMERCIAL PROPERTIES		1.494.794,46	3.354.123.176,91	0,0446%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO GENERAL SHOPPING ATIVO RENDA FII		4.536.874,29	3.354.123.176,91	0,1353%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO MAX RETAIL		2.332.600,00	3.354.123.176,91	0,0695%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA		7.948.855,99	3.354.123.176,91	0,2370%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO NEGRO FII		977.013,12	3.354.123.176,91	0,0291%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO VIA PARQUE SHOPPING		5.860.057,72	3.354.123.176,91	0,1747%	Enquadrado
FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII SHOPPING JARDIM SUL		3.347.982,00	3.354.123.176,91	0,0998%	Enquadrado
HSI MALLS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO		18.477.605,24	3.354.123.176,91	0,5509%	Enquadrado
MALLS BRASIL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO		17.188.235,99	3.354.123.176,91	0,5125%	Enquadrado
RB CAPITAL GENERAL SHOPPING SULACAP FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		3.363.552,00	3.354.123.176,91	0,1003%	Enquadrado
RENDA ESCRITORIOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII		1.752.320,30	3.354.123.176,91	0,0522%	Enquadrado
SDI LOGISTICA RIO FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		950.323,20	3.354.123.176,91	0,0283%	Enquadrado
SDI PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO		5.624.736,34	3.354.123.176,91	0,1677%	Enquadrado
TRX REAL ESTATE FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO		2.806.479,00	3.354.123.176,91	0,0837%	Enquadrado
TRX REALTY LOGISTICA RENDA I FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		10.194.772,19	3.354.123.176,91	0,3039%	Enquadrado
VINCI SHOPPING CENTERS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII		10.358.428,01	3.354.123.176,91	0,3088%	Enquadrado
XP INDUSTRIAL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO		1.579.266,00	3.354.123.176,91	0,0471%	Enquadrado
XP MALLS FUNDO INVESTIMENTOS IMOBILIARIOS		402.307,80	3.354.123.176,91	0,0120%	Enquadrado

Relatório de Alocação por Grupo Econômico

Referencia

28/02/2020

Limite Resolução 4.661	%
Máximo de Alocação por Grupo Econômico	10%
Máximo de Alocação por Grupo Financeiro	20%

Patrimônio Líquido da Fundação	3.354.123.176,91
---------------------------------------	-------------------------

Grupo Econômico	Aplicação Atual	% Fundação	Status
Grupo Banco do Brasil			
LF252 - BANCO VOTORANTIM	39.104.848,64		
Ações - BANCO DO BRASIL S.A.	19.057.962,00		
Total	58.162.810,64	1,73%	Enquadrado
Grupo Bradesco			
LF252 - BANCO BRADESCO S.A	32.514.131,30		
Ações - BANCO BRADESCO S.A	51.328.379,32		
Total	83.842.510,62	2,50%	Enquadrado
Grupo BTG Pactual			
Ações - BANCO BTG PACTUAL	30.793.848,00		
Total	30.793.848,00	0,92%	Enquadrado
Grupo Cemig			
Debentures - CEMIG GERAÇÃO E TRANSMISSÃO SA	8.859.270,40		
Debentures - GRUPO CEMIG	10.346.176,10		
Ações - GRUPO CEMIG	7.338.772,00		
Total	26.544.218,50	0,79%	Enquadrado
Grupo Itaú			
LF252 - BANCO ITAÚ S.A.	31.212.211,11		
Ações - BANCO ITAÚ S.A.	76.244.384,00		
Total	107.456.595,11	3,20%	Enquadrado
Grupo Vale do Rio Doce			
Ações - VALE SA	36.143.445,45		
Total	36.143.445,45	1,08%	Enquadrado