Relatório de Enquadramentos Legais da Carteira de Investimentos da EMBRAER PREV

Relatório de Política de Investimento - EMBRAER PREV

Referência: 31/01/2020

Renda Fixa	**2.451.460.507,72**
Renda Variável	**753.019.511,80**
Estruturado	**-**
Exterior	**-**
Imóveis	**171.269.238,72**
Empréstimos e Financiamentos	**36.179.737,54**
Contas Receber e Pagar	**(4.790.415,71)**
Derivativos	**(161.414,41)**
Patrimônio Líquido da Fundação	**3.406.977.165,66**

Segmento	Aplicação	% PL da Fundação	% Mínimo	% Máximo	Status
Renda Fixa	2.451.460.507,72	71,95%	35,00%	100,00%	Enquadrado
Renda Variável	753.019.511,80	22,10%	0,00%	50,00%	Enquadrado
Estruturado	-	0,00%	0,00%	20,00%	Enquadrado
Exterior	-	0,00%	0,00%	10,00%	Enquadrado
Imobiliário	171.269.238,72	5,03%	0,00%	20,00%	Enquadrado
Operações com Participantes	36.179.737,54	1,06%	0,00%	15,00%	Enquadrado
Contas Receber e Pagar	(4.790.415,71)	-0,14%	N/A	N/A	N/A
Derivativos	(161.414,41)	0,00%	N/A	N/A	N/A

Relatório de Enquadramento dos Investimentos - EMBRAER PREV

Referencia 31/01/2020
Patrimônio Líquido .....: 3.406.977.165,66

Renda Fixa	Valor Aplicado	Aplicado (%)	Limite 4.661 (%)	Enquadramento
Renda Fixa - Títulos Públicos - Federais				
LFT	290.494.829,67	8,53%		
LTN	15.127.252,77	0,44%		
NTN_B	1.472.788.469,59	43,23%		
NTN_F	148.723.557,27	4,37%		
Total ..... :	1.927.134.109,30	56,56%	100,00%	Enquadrado
Renda Fixa - Títulos Públicos	1.927.134.109,30	56,56%	100,00%	Enquadrado
Renda Fixa - Títulos Privados - TVM de Instituição Financeira / Poupança				
CDB	7.378.483,22	0,22%		
LF252	126.911.440,25	3,73%		
Total ..... :	134.289.923,47			
Renda Fixa - FIDC / FIC				
Cotas FIDC	26.690.963,63	0,78%		
Total ..... :	26.690.963,63	0,78%	20,00%	Enquadrado
Renda Fixa - Títulos Privados - TVM de Companhias Abertas / Securitizadoras				
Debentures	363.345.511,32	10,66%		
Total ..... :	363.345.511,32			
Renda Fixa - Títulos Privados	524.326.398,42	15,39%	80,00%	Enquadrado
Renda Fixa	2.451.460.507,72	71,95%	100,00%	Enquadrado

Renda Variável	Valor Aplicado	Aplicado (%)	Limite 4.661 (%)	Enquadramento
AÇÕES DE MERCADO				
Ações / FI de Segmento Especial				
BOVESPA NIVEL 1	163.787.423,50	4,81%		
BOVESPA NIVEL 2	119.265.400,55	3,50%		
NOVO MERCADO	427.242.250,50	12,54%		
Total ..... :	710.295.074,55	20,85%	70,00%	Enquadrado
Ações / FI sem Segmento Especial				
OUTROS	42.724.437,25	1,25%		

Total ..... :	**42.724.437,25**	**1,25%**	**50,00%**	**Enquadrado**

Renda Variável	**753.019.511,80**	**22,10%**	**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	**126.008.320,95**	**3,70%**		
Imobiliário				
Imobiliário - CRI	**43.101.164,79**	**1,27%**		
Imobiliário	**171.269.238,72**	**5,03%**	**20,00%**	**Enquadrado**

Empréstimos e Financiamento	Valor Aplicado	Aplicado (%)	Limite 4.661 (%)	Enquadramento
Empréstimos e Fin. Imobiliários				
Empréstimos	**36.179.737,54**	**1,06%**		
Empréstimos e Financiamentos Imobiliários	**36.179.737,54**	**1,06%**	**15,00%**	**Enquadrado**

Derivativos	Valor Aplicado	Aplicado (%)	Limite 4.661 (%)	Enquadramento
Derivativos				
Futuros	**17.091.266,11**	**0,50%**		
Opções	**-161.414,41**	**0,00%**		
Derivativos	**-161.414,41**	**0,50%**	**100,00%**	**Enquadrado**

Receitas e Despesas	Valor Aplicado	Aplicado (%)	Limite 4.661 (%)	Enquadramento
Contas Receber / Pagar				
Contas Receber / Pagar	**-4.851.840,71**	**-0,14%**		
Caixa				

Caixa	**61.425,00**	**0,00%**
Contas Receber e Pagar	**-4.790.415,71**	
Total Geral dos Ativos	**3.406.977.165,66**	**100,00%**

*** Conforme a Resolução 4.661, Art. 37, § 4 º, 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 § 5 º, fica explicito 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	3.406.977.165,66

Tópico do Enquadramento	Limite	Aplicação Atual	Valor Limite	% Aplicado	Status
% do Segmento RF/PL PLANO	100,00%	2.451.460.507,72	3.406.977.165,66	71,95%	Enquadrado
% do PL em Títulos de Emissão do Tesouro Nacional e/ou do BACEN	100,00%	1.927.134.109,30	3.406.977.165,66	56,56%	Enquadrado
% do PL em Títulos RF1, exceto títulos do Tesouro Nacional	80,00%	524.326.398,42	2.725.581.773,14	15,39%	Enquadrado
% do PL em FIDC	20,00%	Verificar Rel. de Diversificação de FIDC´s	681.395.443,29	0,00%	Enquadrado
% do PL em uma mesma pessoa jurídica não-financeira	10,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Não Financ.	340.697.721,64	0,00%	Enquadrado
% do PL em Instituições Financeiras	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Financ.	851.744.291,42	0,00%	Enquadrado
% de uma mesma Série de Debêntures	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Debêntures	851.744.291,42	0,00%	Enquadrado
% do PL em RV	70,00%	753.019.511,80	2.384.883.975,35	22,10%	Enquadrado
% do capital votante de uma empresa	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação RV	851.744.291,42	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Imobiliários	20,00%	171.269.238,72	681.395.443,29	5,03%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Empréstimos	15,00%	36.179.737,54	511.046.595,16	1,06%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Estruturados	20,00%	0,00	681.395.443,29	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos no Exterior	10,00%	0,00	340.697.721,64	0,00%	Enquadrado

Relatório de Diversificação - Debêntures

Referencia 31/01/2020

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
CPTE11	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 CONFECCOES 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	105,00	60.000	0,1750%	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	2.097,00	500.000	0,4194%	Enquadrado
SULM23	SUL AMERICA S/A	300,00	13.000	2,3077%	Enquadrado
TAEE23	TRANSMISSORA ALIANCA DE ENERGIA ELETRICA S/A	6.527,00	793.000	0,8231%	Enquadrado
TAEE33	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 31/01/2020

Limite 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	9.966.376,65	114.720.882,33	8,6875%	Enquadrado
CHEMICAL IX FIDC INDUSTRIA PETROQUIMICA	BEM DTVM	1.305.774,91	558.387.889,71	0,2338%	Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	OLIVEIRA TRUST	6.910.573,81	120.183.892,38	5,7500%	Enquadrado
FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS SANEAMENTO GOIAS SA - INFRAESTRUTURA IV	OLIVEIRA TRUST	8.508.238,26	314.537.458,83	2,7050%	Enquadrado

Fundo	Instituição Proprietária	Valor Aplicado R$	PL da Fundação R$	% PL da Fundação	Status
CELG DISTRIBUICAO FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS	OLIVEIRA TRUST	9.966.376,65	3.406.977.165,66	0,2925%	Enquadrado
CHEMICAL IX FIDC INDUSTRIA PETROQUIMICA	BEM DTVM	1.305.774,91	3.406.977.165,66	0,0383%	Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	OLIVEIRA TRUST	6.910.573,81	3.406.977.165,66	0,2028%	Enquadrado
FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS SANEAMENTO GOIAS SA - INFRAESTRUTURA IV	OLIVEIRA TRUST	8.508.238,26	3.406.977.165,66	0,2497%	Enquadrado

Fundação	PL Total da Fundação - R$	Total Aplicado em FIDC R$	% PL da Fundação	Status
Fundação	3.406.977.165,66	26.690.963,63	0,7834%	Enquadrado

Relatório de Diversificação de Renda Fixa - Instituição não Financeira

Referencia 31/01/2020

Limite Resolução 4.661	%
Máximo de Emissão por Instit. não Financeira	10%

Patrimônio Líquido da Fundação	3.406.977.165,66
Total de Instituição não Financeira	406.446.676,11
% Pl da Fundação	11,93%

Papel	Aplicação Atual	% Aplicado	Status
CRI	43.101.164,79	1,27%	
HABITASEC SECURITIZADORA SA	32.729.528,32	0,96%	Enquadrado
RB CAPITAL COMPANHIA SECURITIZACAO	10.371.636,47	0,30%	Enquadrado
Debentures	363.345.511,32	10,66%	
AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	11.522.635,15	0,34%	Enquadrado
AES TIETE ENERGIA SA	2.011.315,64	0,06%	Enquadrado
ALUPAR INVESTIMENTO S.A	2.527.795,75	0,07%	Enquadrado
AMPLA ENERGIA SERVICOS SA	1.228.471,08	0,04%	Enquadrado
CACHOEIRA PAULISTA TRANSMISSORA ENERGIA SA	7.676.111,79	0,23%	Enquadrado
CCR SA	4.960.417,52	0,15%	Enquadrado
CEMIG GERACAO TRANSMISSAO SA	14.046.538,79	0,41%	Enquadrado
CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	4.078.421,26	0,12%	Enquadrado
CIA GAS SAO PAULO COMGAS	40.013.191,76	1,17%	Enquadrado
CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	12.488.361,13	0,37%	Enquadrado
COMPANHIA ENERGETICA JAGUARA	1.661.388,19	0,05%	Enquadrado
COMPANHIA ENERGETICA MIRANDA	982.460,67	0,03%	Enquadrado
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	26.254.471,84	0,77%	Enquadrado
COMPANHIA SANEAMENTO PARANA SANEPAR	1.074.392,47	0,03%	Enquadrado
CONCESSIONARIA AUTO RAPOSO TAVARES SA	19.239.043,06	0,56%	Enquadrado
CONCESSIONARIA RODOVIAS AYRTON SENNA CARVALHO PINTO SA ECOPISTAS	11.658.335,31	0,34%	Enquadrado
DIAGNOSTICOS AMERICA SA	1.966.712,64	0,06%	Enquadrado
DUKE ENERGY INTERNATIONAL GERACAO PARANAPANEMA SA	22.743.294,89	0,67%	Enquadrado
ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	13.304.984,36	0,39%	Enquadrado
ENERGISA MATO GROSSO SUL - DISTRIBUIDORA ENERGIA S.A	807.819,24	0,02%	Enquadrado
ENTREVIAS CONCESSIONARIA RODOVIAS S.A	12.616.410,75	0,37%	Enquadrado
EQUATORIAL ENERGIA SA	676.460,88	0,02%	Enquadrado
ERDV	7.852.479,30	0,23%	Enquadrado
GRUPO CEMIG	19.504.597,63	0,57%	Enquadrado
GUARARAPES CONFECCOES SA (EX CONFECCOES GUARARAPES SA)	1.348.626,56	0,04%	Enquadrado
IGUATEMI EMPRESA SHOPPING CENTERS SA	8.151.559,81	0,24%	Enquadrado
JSL SA	830.869,76	0,02%	Enquadrado
LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	16.185.521,15	0,48%	Enquadrado
LOCALIZA RENT A CAR SA	1.131.606,82	0,03%	Enquadrado
LOJAS AMERICANAS SA	23.446.692,27	0,69%	Enquadrado

MOVIDA PARTICIPACOES	1.179.073,74	0,03%	Enquadrado
NATURA COSMETICOS SA	1.784.917,54	0,05%	Enquadrado
NCF PARTICIPACOES SA	3.015.114,24	0,09%	Enquadrado
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	14.677.323,48	0,43%	Enquadrado
RAIZEN ENERGIA SA	654.176,13	0,02%	Enquadrado
RODOVIAS COLINAS SA	15.108.594,58	0,44%	Enquadrado
SABER SERVICOS EDUCACIONAIS SA	1.068.270,79	0,03%	Enquadrado
SONAE SIERRA BRASIL SA	1.121.375,66	0,03%	Enquadrado
SUL AMERICA SA	6.399.401,92	0,19%	Enquadrado
TELEFONICA BRASIL SA	5.346.939,67	0,16%	Enquadrado
TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA SA	15.536.753,95	0,46%	Enquadrado
TRIANGULO SOL AUTO ESTRADAS SA	352.865,90	0,01%	Enquadrado
USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMINAS	5.109.716,25	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	**3.406.977.165,66**

Mercado	Cód. Bovespa	Valor Aplicado	% PL Fundação	Status
Ações Segmento Especial	NM, N2, N1, Mais, Mais2 ...	710.295.074,55	20,85%	Enquadrado
Ações s/ Segmento Especial		42.724.437,25	1,25%	Enquadrado
Total		**753.019.511,80**	**22,10%**	**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	3.406.977.165,66

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	26.125.349,25	0,77%	Enquadrado	1.463.605	0	1.463.605	0,01%	0,01%	Enquadrado
AZUL	AZUL S.A.	BOVESPA NIVEL 2	7.686.022,00	0,23%	Enquadrado	0	129.700	129.700	0,00%	0,00%	Enquadrado
B3SA	B3 S.A. - BRASIL, BOLSA, BALCÃO	NOVO MERCADO	27.365.212,60	0,80%	Enquadrado	567.743	0	567.743	0,03%	0,03%	Enquadrado
BBAS	BCO BRASIL S.A.	NOVO MERCADO	14.751.306,00	0,43%	Enquadrado	303.900	0	303.900	0,01%	0,01%	Enquadrado
BBDC	BCO BRADESCO S.A.	BOVESPA NIVEL 1	50.303.413,16	1,48%	Enquadrado	0	1.529.444	1.529.444	0,00%	0,00%	Enquadrado
BPAC	BCO BTG PACTUAL S.A.	BOVESPA NIVEL 2	31.492.500,00	0,92%	Enquadrado	419.900	839.800	1.259.700	0,00%	0,02%	Enquadrado
BRFS	BRF S.A.	NOVO MERCADO	5.132.400,00	0,15%	Enquadrado	168.000	0	168.000	0,02%	0,02%	Enquadrado
BRPR	BR PROPERTIES S.A.	NOVO MERCADO	11.422.152,00	0,34%	Enquadrado	733.600	0	733.600	0,15%	0,15%	Enquadrado
BTOW	B2W - COMPANHIA DIGITAL	NOVO MERCADO	42.022.596,00	1,23%	Enquadrado	590.205	0	590.205	0,11%	0,11%	Enquadrado
CCRO	CCR S.A.	NOVO MERCADO	22.723.392,00	0,67%	Enquadrado	1.245.800	0	1.245.800	0,06%	0,06%	Enquadrado
CMIG	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS - CEMIG	BOVESPA NIVEL 1	2.439.225,00	0,07%	Enquadrado	146.500	0	146.500	0,03%	0,01%	Enquadrado
COGN	COGNA EDUCAÇÃO S.A.	NOVO MERCADO	16.452.758,00	0,48%	Enquadrado	1.415.900	0	1.415.900	0,09%	0,09%	Enquadrado
CPFE	CPFL ENERGIA S.A.	NOVO MERCADO	9.253.686,00	0,27%	Enquadrado	241.800	0	241.800	0,02%	0,02%	Enquadrado
CSNA	CIA SIDERURGICA NACIONAL	BOLSA	9.994.920,00	0,29%	Enquadrado	774.800	0	774.800	0,06%	0,06%	Enquadrado
ENGI	ENERGISA S.A.	BOVESPA NIVEL 2	5.048.055,00	0,15%	Enquadrado	91.500	366.000	457.500	0,00%	0,01%	Enquadrado
EVEN	EVEN CONSTRUTORA E INCORPORADORA S.A.	NOVO MERCADO	12.972.107,40	0,38%	Enquadrado	775.380	0	775.380	0,36%	0,36%	Enquadrado
EZTC	EZ TEC EMPREEND. E PARTICIPACOES S.A.	NOVO MERCADO	9.040.560,00	0,27%	Enquadrado	162.600	0	162.600	0,07%	0,07%	Enquadrado
GGBR	GERDAU S.A.	BOVESPA NIVEL 1	7.987.920,00	0,23%	Enquadrado	0	398.400	398.400	0,00%	0,00%	Enquadrado
HAPV	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	NOVO MERCADO	27.380.206,35	0,80%	Enquadrado	455.805	0	455.805	0,06%	0,06%	Enquadrado
IRBR	IRB - BRASIL RESSEGUROS S.A.	NOVO MERCADO	14.892.526,00	0,44%	Enquadrado	332.200	0	332.200	0,04%	0,04%	Enquadrado
ITUB	ITAU UNIBANCO HOLDING S.A.	BOVESPA NIVEL 1	81.348.866,34	2,39%	Enquadrado	0	2.478.637	2.478.637	0,00%	0,00%	Enquadrado
JBSS	JBS S.A.	NOVO MERCADO	26.093.438,00	0,77%	Enquadrado	946.100	0	946.100	0,03%	0,03%	Enquadrado
LAME	LOJAS AMERICANAS S.A.	BOVESPA NIVEL 1	3.815.675,00	0,11%	Enquadrado	0	138.500	138.500	0,00%	0,00%	Enquadrado
LREN	LOJAS RENNER S.A.	NOVO MERCADO	12.047.265,00	0,35%	Enquadrado	209.700	0	209.700	0,03%	0,03%	Enquadrado
NEOE	NEOENERGIA S.A.	NOVO MERCADO	15.054.623,00	0,44%	Enquadrado	585.100	0	585.100	0,05%	0,05%	Enquadrado
NTCO	NATURA &CO HOLDING S.A.	NOVO MERCADO	4.344.054,00	0,13%	Enquadrado	91.300	0	91.300	0,01%	0,01%	Enquadrado
PCAR	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO	BOVESPA NIVEL 1	17.892.324,00	0,53%	Enquadrado	0	210.300	210.300	0,00%	0,00%	Enquadrado
PETR	PETROLEO BRASILEIRO S.A. PETROBRAS	BOVESPA NIVEL 2	58.368.663,55	1,71%	Enquadrado	258.500	1.775.859	2.034.359	0,00%	0,02%	Enquadrado
RAIL	RUMO S.A.	NOVO MERCADO	25.874.960,00	0,76%	Enquadrado	1.115.300	0	1.115.300	0,07%	0,07%	Enquadrado
RENT	LOCALIZA RENT A CAR S.A.	NOVO MERCADO	24.731.474,50	0,73%	Enquadrado	461.150	0	461.150	0,06%	0,06%	Enquadrado
SAPR	CIA SANEAMENTO DO PARANA - SANEPAR	BOVESPA NIVEL 2	16.670.160,00	0,49%	Enquadrado	164.400	657.600	822.000	0,00%	0,03%	Enquadrado
SUZB	SUZANO S.A.	NOVO MERCADO	21.715.358,00	0,64%	Enquadrado	547.400	0	547.400	0,04%	0,04%	Enquadrado
TOTS	TOTVS S.A.	NOVO MERCADO	34.652.530,00	1,02%	Enquadrado	464.200	0	464.200	0,24%	0,24%	Enquadrado
VALE	VALE S.A.	NOVO MERCADO	49.319.645,65	1,45%	Enquadrado	981.095	0	981.095	0,02%	0,02%	Enquadrado
VIVT	TELEFÔNICA BRASIL S.A	BOLSA	6.604.168,00	0,19%	Enquadrado	0	111.200	111.200	0,00%	0,00%	Enquadrado

Relatório de Diversificação de Renda Fixa - Instituição Financeira

Referencia 31/01/2020

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

Patrimônio Líquido da Fundação	3.406.977.165,66

Papel	Aplicação Atual	PL da Instituição	% Instituição	Status	% Fundação	Status
BANCO ABC BRASIL S/A						
LF252	1.799.646,93					
Total	**1.799.646,93**	**3.956.286.000,00**	**0,05%**	**Enquadrado**	**0,05%**	**Enquadrado**
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S/A						
LF252	3.543.748,31					
Total	**3.543.748,31**	**2.831.114.000,00**	**0,13%**	**Enquadrado**	**0,10%**	**Enquadrado**
BANCO BRADESCO S.A						
LF252	32.319.050,46					
Total	**32.319.050,46**	**139.403.014.000,00**	**0,02%**	**Enquadrado**	**0,95%**	**Enquadrado**
BANCO ITAÚ S.A.						
LF252	30.933.570,92					
Total	**30.933.570,92**	**138.588.384.000,00**	**0,02%**	**Enquadrado**	**0,91%**	**Enquadrado**
BANCO VOTORANTIM						
LF252	38.799.884,59					
Total	**38.799.884,59**	**10.146.659.000,00**	**0,38%**	**Enquadrado**	**1,14%**	**Enquadrado**
BCO BRASIL SA						
LF252	10.303.520,21					
Total	**10.303.520,21**	**94.812.626.000,00**	**0,01%**	**Enquadrado**	**0,30%**	**Enquadrado**
BCO ITAU SA						
LF252	7.378.209,84					
Total	**7.378.209,84**	**138.588.384.000,00**	**0,01%**	**Enquadrado**	**0,22%**	**Enquadrado**
BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA						
CDB	5.302.263,21					
Total	**5.302.263,21**	**1.855.549.000,00**	**0,29%**	**Enquadrado**	**0,16%**	**Enquadrado**
BCO VOLKSWAGEN SA						
CDB	2.076.220,01					
Total	**2.076.220,01**	**2.972.763.000,00**	**0,07%**	**Enquadrado**	**0,06%**	**Enquadrado**
CAIXA ECONOMICA FEDERAL						
LF252	1.833.808,99					
Total	**1.833.808,99**	**48.542.507.000,00**	**0,00%**	**Enquadrado**	**0,05%**	**Enquadrado**

Relatório de Diversificação de Fundos de Investimentos

Referencia 31/01/2020

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		2.161.727,00	120.906.277,63	1,7879%	Enquadrado
CSHG GR LOUVEIRA FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		4.000.408,60	141.138.493,29	2,8344%	Enquadrado
FII BB VOTORANTIM CIDADE JARDIM CONTINENTAL TOWER		5.393.179,61	156.413.408,78	3,4480%	Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - VBI LOGÍSTICO		5.219.443,04	775.079.736,08	0,6734%	Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO BTG PACTUAL SHOPPINGS		2.912.137,50	436.084.538,81	0,6678%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM BRASCAN LAJES CORPORATIVAS FII		2.035.726,92	93.932.333,05	2,1672%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM CENESP FII		2.186.559,40	282.008.377,32	0,7754%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII CEO CYRELA COMMERCIAL PROPERTIES		1.583.497,62	178.531.937,77	0,8870%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO GENERAL SHOPPING ATIVO RENDA FII		4.846.818,60	280.758.413,48	1,7263%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO MAX RETAIL		2.538.620,90	132.603.485,49	1,9144%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA		7.624.124,00	590.336.361,17	1,2915%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO NEGRO FII		1.061.752,00	274.464.965,11	0,3868%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO VIA PARQUE SHOPPING		6.197.276,56	600.578.628,62	1,0319%	Enquadrado
FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII SHOPPING JARDIM SUL		3.453.274,80	228.341.214,20	1,5123%	Enquadrado
HSI MALLS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO		19.593.810,00	1.540.466.017,15	1,2719%	Enquadrado
MALLS BRASIL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO		17.813.948,10	799.507.436,64	2,2281%	Enquadrado
RB CAPITAL GENERAL SHOPPING SULACAP FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		3.608.124,00	92.773.146,14	3,8892%	Enquadrado
RENDA ESCRITORIOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII		1.583.696,50	65.936.361,37	2,4019%	Enquadrado
SDI LOGISTICA RIO FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		1.022.544,32	455.081.776,13	0,2247%	Enquadrado
SDI PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO		6.022.836,00	349.727.794,06	1,7221%	Enquadrado
TRX REAL ESTATE FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO		2.638.570,00	187.228.584,62	1,4093%	Enquadrado
TRX REALTY LOGISTICA RENDA I FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		5.570.944,10	204.152.551,22	2,7288%	Enquadrado
VINCI SHOPPING CENTERS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII		11.187.951,38	1.256.112.354,50	0,8907%	Enquadrado
XP MALLS FUNDO INVESTIMENTOS IMOBILIARIOS		5.751.350,00	1.980.202.598,44	0,2904%	Enquadrado

Fundo	Administrador	Valor Aplicado R$	PL da Fundação R$	% PL da Fundação	Status
CASTELLO BRANCO OFFICE PARK FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		2.161.727,00	3.406.977.165,66	0,0634%	Enquadrado
CSHG GR LOUVEIRA FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		4.000.408,60	3.406.977.165,66	0,1174%	Enquadrado
FII BB VOTORANTIM CIDADE JARDIM CONTINENTAL TOWER		5.393.179,61	3.406.977.165,66	0,1583%	Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - VBI LOGÍSTICO		5.219.443,04	3.406.977.165,66	0,1532%	Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO BTG PACTUAL SHOPPINGS		2.912.137,50	3.406.977.165,66	0,0855%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM BRASCAN LAJES CORPORATIVAS FII		2.035.726,92	3.406.977.165,66	0,0598%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM CENESP FII		2.186.559,40	3.406.977.165,66	0,0642%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII CEO CYRELA COMMERCIAL PROPERTIES		1.583.497,62	3.406.977.165,66	0,0465%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO GENERAL SHOPPING ATIVO RENDA FII		4.846.818,60	3.406.977.165,66	0,1423%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO MAX RETAIL		2.538.620,90	3.406.977.165,66	0,0745%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA		7.624.124,00	3.406.977.165,66	0,2238%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO NEGRO FII		1.061.752,00	3.406.977.165,66	0,0312%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO VIA PARQUE SHOPPING		6.197.276,56	3.406.977.165,66	0,1819%	Enquadrado
FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII SHOPPING JARDIM SUL		3.453.274,80	3.406.977.165,66	0,1014%	Enquadrado
HSI MALLS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO		19.593.810,00	3.406.977.165,66	0,5751%	Enquadrado
MALLS BRASIL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO		17.813.948,10	3.406.977.165,66	0,5229%	Enquadrado
RB CAPITAL GENERAL SHOPPING SULACAP FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		3.608.124,00	3.406.977.165,66	0,1059%	Enquadrado
RENDA ESCRITORIOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII		1.583.696,50	3.406.977.165,66	0,0465%	Enquadrado
SDI LOGISTICA RIO FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		1.022.544,32	3.406.977.165,66	0,0300%	Enquadrado
SDI PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO		6.022.836,00	3.406.977.165,66	0,1768%	Enquadrado
TRX REAL ESTATE FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO		2.638.570,00	3.406.977.165,66	0,0774%	Enquadrado
TRX REALTY LOGISTICA RENDA I FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		5.570.944,10	3.406.977.165,66	0,1635%	Enquadrado
VINCI SHOPPING CENTERS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII		11.187.951,38	3.406.977.165,66	0,3284%	Enquadrado
XP MALLS FUNDO INVESTIMENTOS IMOBILIARIOS		5.751.350,00	3.406.977.165,66	0,1688%	Enquadrado

Relatório de Alocação por Grupo Econômico

Referencia 31/01/2020

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

Patrimônio Líquido da Fundação	3.406.977.165,66

Grupo Econômico	Aplicação Atual	% Fundação	Status
Grupo Banco do Brasil			
LF252 - BANCO VOTORANTIM	38.799.884,59		
Ações - BANCO DO BRASIL S.A.	14.751.306,00		
Total	**53.551.190,59**	**1,57%**	**Enquadrado**
Grupo BNP Paribas Brasil			
LF252 - BANCO BNP PARIBAS BRASIL S/A	3.543.748,31		
Total	**3.543.748,31**	**0,10%**	**Enquadrado**
Grupo BR Foods			
Ações - BRF BRASIL FOODS SA	5.132.400,00		
Total	**5.132.400,00**	**0,15%**	**Enquadrado**
Grupo Bradesco			
LF252 - BANCO BRADESCO S.A	32.319.050,46		
Ações - BANCO BRADESCO S.A	50.303.413,16		
Total	**82.622.463,62**	**2,43%**	**Enquadrado**
Grupo BTG Pactual			
Ações - BANCO BTG PACTUAL	31.492.500,00		
Total	**31.492.500,00**	**0,92%**	**Enquadrado**
Grupo Cemig			
Debentures - CEMIG GERAÇÃO E TRANSMISSÃO SA	14.046.538,79		
Debentures - GRUPO CEMIG	19.504.597,63		
Ações - GRUPO CEMIG	2.439.225,00		
Total	**35.990.361,42**	**1,06%**	**Enquadrado**
Grupo Itaú			
LF252 - BANCO ITAÚ S.A.	30.933.570,92		
Ações - BANCO ITAÚ S.A.	81.348.866,34		
Total	**112.282.437,26**	**3,30%**	**Enquadrado**
Grupo Vale do Rio Doce			
Ações - VALE SA	49.319.645,65		
Total	**49.319.645,65**	**1,45%**	**Enquadrado**