



Relatório de Enquadramentos Legais da Carteira de Investimentos da EMBRAER PREV

Relatório de Política de Investimento - EMBRAER PREV

Referência: 31/03/2020

Renda Fixa	2.521.648.946,99
Renda Variável	491.084.000,46
Estruturado	-
Exterior	-
Imóveis	62.709.510,45
Empréstimos e Financiamentos	36.687.785,42
Contas Receber e Pagar	4.264.349,10
Derivativos	(882.919,50)
Patrimônio Líquido da Fundação	3.115.511.672,91

Segmento	Aplicação	% PL da Fundação	% Mínimo	% Máximo	Status
Renda Fixa	2.521.648.946,99	80,94%	35,00%	100,00%	Enquadrado
Renda Variável	491.084.000,46	15,76%	0,00%	50,00%	Enquadrado
Estruturado	-	0,00%	0,00%	20,00%	Enquadrado
Exterior	-	0,00%	0,00%	10,00%	Enquadrado
Imobiliário	62.709.510,45	2,01%	0,00%	20,00%	Enquadrado
Operações com Participantes	36.687.785,42	1,18%	0,00%	15,00%	Enquadrado
Contas Receber e Pagar	4.264.349,10	0,14%	N/A	N/A	N/A
Derivativos	(882.919,50)	-0,03%	N/A	N/A	N/A

Relatório de Enquadramento dos Investimentos - EMBRAER PREV

Referencia **31/03/2020**
 Patrimônio Líquido: **3.115.511.672,91**

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

Renda Fixa - Títulos Públicos - Federais

LFT	279.359.012,14	8,97%		
LTN	65.579.934,69	2,10%		
NTN_B	1.376.358.171,65	44,18%		
NTN_F	268.643.671,45	8,62%		
Total :	1.989.940.789,93	63,87%	100,00%	Enquadrado

Renda Fixa - Títulos Públicos	1.989.940.789,93	63,87%	100,00%	Enquadrado
--------------------------------------	-------------------------	---------------	----------------	-------------------

Renda Fixa - Títulos Privados - TVM de Instituição Financeira / Poupança

CDB	5.388.180,37	0,17%		
LF252	123.155.214,61	3,95%		
Total :	128.543.394,98			

Renda Fixa - FIDC / FIC

Cotas FIDC	25.683.638,07	0,82%		
Total :	25.683.638,07	0,82%	20,00%	Enquadrado

Renda Fixa - Títulos Privados - TVM de Companhias Abertas / Securitizadoras

Debentures	377.481.124,02	12,12%		
Total :	377.481.124,02			

Renda Fixa - Títulos Privados	531.708.157,06	17,07%	80,00%	Enquadrado
--------------------------------------	-----------------------	---------------	---------------	-------------------

Renda Fixa	2.521.648.946,99	80,94%	100,00%	Enquadrado
-------------------	-------------------------	---------------	----------------	-------------------

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

AÇÕES DE MERCADO

Ações / FI de Segmento Especial

BOVESPA NIVEL 1	78.021.421,18	2,50%		
BOVESPA NIVEL 2	49.831.249,39	1,60%		
NOVO MERCADO	325.863.054,29	10,46%		
Total :	453.715.724,87	14,56%	70,00%	Enquadrado

Ações / FI sem Segmento Especial

OUTROS	37.368.275,59	1,20%		
Total :	37.368.275,59	1,20%	50,00%	Enquadrado

Renda Variável	491.084.000,46	15,76%	70,00%	Enquadrado
-----------------------	-----------------------	---------------	---------------	-------------------

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

Imobiliário

Imobiliário - Aluguéis e Renda*	2.159.752,98	0,07%		
Imobiliário				
Imobiliário - FI / FIC Imobiliário	25.071.374,09	0,80%		
Imobiliário				
Imobiliário - CRI	35.478.383,37	1,14%		
Imobiliário				
Imobiliário	62.709.510,45	2,01%	20,00%	Enquadrado
Empréstimos e Financiamento				
Empréstimos e Fin. Imobiliários				
Empréstimos	36.687.785,42	1,18%		
Empréstimos e Financiamentos Imobiliários				
Empréstimos e Financiamentos Imobiliários	36.687.785,42	1,18%	15,00%	Enquadrado
Derivativos				
Derivativos				
Futuros	4.308.322,86	0,14%		
Opções	-882.919,50	-0,03%		
Derivativos				
Derivativos	-882.919,50	0,11%	100,00%	Enquadrado
Receitas e Despesas				
Contas Receber / Pagar				
Contas Receber / Pagar	4.210.243,81	0,14%		
Caixa				
Caixa	54.105,29	0,00%		
Contas Receber e Pagar				
Contas Receber e Pagar	4.264.349,10			
Total Geral dos Ativos	3.115.511.672,91	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	3.115.511.672,91
---------------------------------------	-------------------------

Tópico do Enquadramento	Limite	Aplicação Atual	Valor Limite	% Aplicado	Status
% do Segmento RF/PL PLANO	100,00%	2.521.648.946,99	3.115.511.672,91	80,94%	Enquadrado
% do PL em Títulos de Emissão do Tesouro Nacional e/ou do BACEN	100,00%	1.989.940.789,93	3.115.511.672,91	63,87%	Enquadrado
% do PL em Títulos RF1, exceto títulos do Tesouro Nacional	80,00%	531.708.157,06	2.492.409.375,47	17,07%	Enquadrado
% do PL em FIDC	20,00%	Verificar Rel. de Diversificação de FIDC's	623.102.343,87	0,00%	Enquadrado
% do PL em uma mesma pessoa jurídica não-financeira	10,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Não Financ.	311.551.171,93	0,00%	Enquadrado
% do PL em Instituições Financeiras	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Financ.	778.877.918,23	0,00%	Enquadrado
% de uma mesma Série de Debêntures	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Debêntures	778.877.918,23	0,00%	Enquadrado
% do PL em RV	70,00%	491.084.000,46	2.180.858.133,90	15,76%	Enquadrado
% do capital votante de uma empresa	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação RV	778.877.918,23	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Imobiliários	20,00%	62.709.510,45	623.102.343,87	2,01%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Empréstimos	15,00%	36.687.785,42	467.326.769,51	1,18%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Estruturados	20,00%	0,00	623.102.343,87	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos no Exterior	10,00%	0,00	311.551.171,93	0,00%	Enquadrado

Relatório de Diversificação - Debêntures

Referencia

31/03/2020

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
ELET42	CENTRAIS ELETRICAS BRAS.S/A - ELETROBRAS	10.800,00	700.000	1,5429%	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	22.220,00	1.000.000	2,2220%	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
GEP24	RIO PARANAPANEMA ENERGIA S/A	12.500,00	250.000	5,0000%	Enquadrado
GEP25	RIO PARANAPANEMA ENERGIA S/A	496,00	24.000	2,0667%	Enquadrado
GUAR11	GUARARAPES CONFECÇÕES S.A..	133,00	80.000	0,1662%	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
NEOE16	NEOENERGIA S/A	5.700,00	802.746	0,7101%	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 31/03/2020

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	9.484.117,93	109.169.702,83	8,6875%	Enquadrado
CHEMICAL IX FIDC INDUSTRIA PETROQUIMICA	BEM DTVM	1.279.168,14	547.010.048,22	0,2338%	Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	OLIVEIRA TRUST	6.902.714,50	120.047.208,69	5,7500%	Enquadrado
FIDC SANEAMENTO GOIAS SA - INFRAESTRUTURA IV	OLIVEIRA TRUST	8.017.637,50	296.400.647,04	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	9.484.117,93	3.115.511.672,91	0,3044%	Enquadrado
CHEMICAL IX FIDC INDUSTRIA PETROQUIMICA	BEM DTVM	1.279.168,14	3.115.511.672,91	0,0411%	Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	OLIVEIRA TRUST	6.902.714,50	3.115.511.672,91	0,2216%	Enquadrado
FIDC SANEAMENTO GOIAS SA - INFRAESTRUTURA IV	OLIVEIRA TRUST	8.017.637,50	3.115.511.672,91	0,2573%	Enquadrado

Fundação	PL Total da Fundação - R\$	Total Aplicado em FIDC R\$	% PL da Fundação	Status
Fundação	3.115.511.672,91	25.683.638,07	0,8244%	Enquadrado

Relatório de Diversificação de Renda Fixa - Instituição não Financeira

Referencia

31/03/2020

Limite Resolução 4.661	%
Máximo de Emissão por Instit. não Financeira	10%
Patrimônio Líquido da Fundação	3.115.511.672,91
Total de Instituição não Financeira % Pl da Fundação	412.959.507,39 13,25%

Papel	Aplicação Atua	% Aplicado	Status
CRI	35.478.383,37	1,14%	
HABITASEC SECURITIZADORA SA	25.221.402,11	0,81%	Enquadrado
RB CAPITAL COMPANHIA SECURITIZACAO	10.256.981,27	0,33%	Enquadrado
Debentures	377.481.124,02	12,12%	
AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	11.689.355,38	0,38%	Enquadrado
AES TIETE ENERGIA SA	1.705.692,34	0,05%	Enquadrado
ALUPAR INVESTIMENTO S.A	2.292.175,16	0,07%	Enquadrado
AMPLA ENERGIA SERVICOS SA	1.225.680,36	0,04%	Enquadrado
CACHOEIRA PAULISTA TRANSMISSORA ENERGIA SA	7.366.855,95	0,24%	Enquadrado
CCR SA	5.024.080,23	0,16%	Enquadrado
CEMIG GERACAO TRANSMISSAO SA	8.936.954,04	0,29%	Enquadrado
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	10.045.177,69	0,32%	Enquadrado
CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	4.142.207,22	0,13%	Enquadrado
CIA GAS SAO PAULO COMGAS	40.729.538,57	1,31%	Enquadrado
CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	12.658.109,05	0,41%	Enquadrado
COMPANHIA ENERGETICA JAGUARA	1.683.958,54	0,05%	Enquadrado
COMPANHIA ENERGETICA MIRANDA	995.807,63	0,03%	Enquadrado
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	25.823.918,00	0,83%	Enquadrado
COMPANHIA SANEAMENTO PARANA SANEPAR	1.090.510,05	0,04%	Enquadrado
CONCESSIONARIA AUTO RAPOSO TAVARES SA	19.534.204,19	0,63%	Enquadrado
CONCESSIONARIA RODOVIAS AYRTON SENNA CARVALHO PINTO SA ECOPISTAS	11.850.236,20	0,38%	Enquadrado
DIAGNOSTICOS AMERICA SA	1.771.858,61	0,06%	Enquadrado
DUKE ENERGY INTERNATIONAL GERACAO PARANAPANEMA SA	23.082.154,14	0,74%	Enquadrado
ECORODOVIAS CONCESSIONARIAS SERVICOS SA	13.497.513,38	0,43%	Enquadrado
ENERGISA MATO GROSSO SUL - DISTRIBUIDORA ENERGIA S.A	780.286,25	0,03%	Enquadrado
ENTREVIAS CONCESSIONARIA RODOVIAS S.A	22.949.550,93	0,74%	Enquadrado
ERDV	7.964.320,31	0,26%	Enquadrado
GRUPO CEMIG	10.440.168,39	0,34%	Enquadrado
GUARARAPES CONFECÇÕES SA (EX CONFECÇÕES GUARARAPES SA)	1.334.118,82	0,04%	Enquadrado
IGUATEMI EMPRESA SHOPPING CENTERS SA	7.921.683,22	0,25%	Enquadrado
JSL SA	844.019,67	0,03%	Enquadrado
LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	19.869.928,51	0,64%	Enquadrado
LOCALIZA RENT A CAR SA	1.115.742,58	0,04%	Enquadrado
LOJAS AMERICANAS SA	23.761.332,94	0,76%	Enquadrado
MOVIDA PARTICIPACOES	1.148.707,90	0,04%	Enquadrado
NATURA COSMETICOS SA	1.676.986,01	0,05%	Enquadrado
NCF PARTICIPACOES SA	3.014.516,50	0,10%	Enquadrado
NEOENERGIA S.A.	5.073.490,58	0,16%	Enquadrado
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	14.862.099,17	0,48%	Enquadrado
RAIZEN ENERGIA SA	662.744,94	0,02%	Enquadrado
RODOVIAS COLINAS SA	15.335.555,89	0,49%	Enquadrado
SABER SERVICOS EDUCACIONAIS SA	1.022.183,40	0,03%	Enquadrado
SONAE SIERRA BRASIL SA	1.137.008,83	0,04%	Enquadrado
SUL AMERICA SA	5.624.516,64	0,18%	Enquadrado
TELEFONICA BRASIL SA	5.137.718,36	0,16%	Enquadrado

TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA SA
TRIANGULO SOL AUTO ESTRADAS SA
USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMINAS

15.777.490,37	0,51% Enquadrado
358.217,72	0,01% Enquadrado
4.522.749,39	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	3.115.511.672,91
---------------------------------------	-------------------------

Mercado	Cód. Bovespa	Valor Aplicado	% PL Fundação	Status
Ações Segmento Especial	NM, N2, N1, Mais, Mais2 ...	453.715.724,87	14,56%	Enquadrado
Ações s/ Segmento Especial		37.368.275,59	1,20%	Enquadrado
Total		491.084.000,46	15,76%	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 **3.115.511.672,91**

Cód Ação	Empresa	Mercado	Valor Aplicado	Fundação	Status	Quantidade de Ações na Carteira			% Capital Social		Status
						ON	PN	Total	ON	Total	
ABEV	AMBEV S.A.	BOLSA	21.789.819,59	0,70%	Enquadrado	1.828.005	0	1.828.005	0,01%	0,01%	Enquadrado
B3SA	B3 S.A. - BRASIL, BOLSA, BALCÃO	NOVO MERCADO	21.534.363,69	0,69%	Enquadrado	599.843	0	599.843	0,03%	0,03%	Enquadrado
BBAS	BCO BRASIL S.A.	NOVO MERCADO	13.389.989,00	0,43%	Enquadrado	480.100	0	480.100	0,02%	0,02%	Enquadrado
BBDC	BCO BRADESCO S.A.	BOVESPA NIVEL 1	34.919.437,87	1,12%	Enquadrado	0	1.681.244	1.681.244	0,00%	0,00%	Enquadrado
BPAC	BCO BTG PACTUAL S.A.	BOVESPA NIVEL 2	9.403.596,00	0,30%	Enquadrado	282.900	565.800	848.700	0,00%	0,01%	Enquadrado
BRPR	BR PROPERTIES S.A.	NOVO MERCADO	10.039.360,00	0,32%	Enquadrado	1.096.000	0	1.096.000	0,22%	0,22%	Enquadrado
BTOW	B2W - COMPANHIA DIGITAL	NOVO MERCADO	20.894.639,99	0,67%	Enquadrado	435.305	0	435.305	0,08%	0,08%	Enquadrado
CCRO	CCR S.A.	NOVO MERCADO	18.494.690,99	0,59%	Enquadrado	1.576.700	0	1.576.700	0,08%	0,08%	Enquadrado
CMIG	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS - CEMIG	BOVESPA NIVEL 1	4.683.987,00	0,15%	Enquadrado	0	525.700	525.700	0,00%	0,00%	Enquadrado
COGN	COGNA EDUCAÇÃO S.A.	NOVO MERCADO	4.443.760,00	0,14%	Enquadrado	1.110.940	0	1.110.940	0,06%	0,06%	Enquadrado
CPFE	CPFL ENERGIA S.A.	NOVO MERCADO	13.214.666,00	0,42%	Enquadrado	491.800	0	491.800	0,04%	0,04%	Enquadrado
CRFB	ATACADÃO S.A.	NOVO MERCADO	7.109.098,00	0,23%	Enquadrado	344.600	0	344.600	0,02%	0,02%	Enquadrado
CSNA	CIA SIDERURGICA NACIONAL	BOLSA	5.065.386,00	0,16%	Enquadrado	725.700	0	725.700	0,05%	0,05%	Enquadrado
ENGI	ENERGISA S.A.	BOVESPA NIVEL 2	3.458.700,00	0,11%	Enquadrado	91.500	366.000	457.500	0,00%	0,01%	Enquadrado
EVEN	EVEN CONSTRUTORA E INCORPORADORA S.A.	NOVO MERCADO	5.364.457,80	0,17%	Enquadrado	877.980	0	877.980	0,40%	0,40%	Enquadrado
EZTC	EZ TEC EMPREEND. E PARTICIPACOES S.A.	NOVO MERCADO	4.511.430,00	0,14%	Enquadrado	151.900	0	151.900	0,07%	0,07%	Enquadrado
HAPV	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS S	NOVO MERCADO	17.460.531,99	0,56%	Enquadrado	411.805	0	411.805	0,06%	0,06%	Enquadrado
IRBR	IRB - BRASIL RESSEGUROS S.A.	NOVO MERCADO	4.459.576,00	0,14%	Enquadrado	460.700	0	460.700	0,05%	0,05%	Enquadrado
ITUB	ITAU UNIBANCO HOLDING S.A.	BOVESPA NIVEL 1	38.417.996,32	1,23%	Enquadrado	0	1.663.837	1.663.837	0,00%	0,00%	Enquadrado
JBSS	JBS S.A.	NOVO MERCADO	17.813.771,99	0,57%	Enquadrado	875.800	0	875.800	0,03%	0,03%	Enquadrado
LREN	LOJAS RENNER S.A.	NOVO MERCADO	10.373.396,00	0,33%	Enquadrado	309.100	0	309.100	0,04%	0,04%	Enquadrado
MDIA	M.DIAS BRANCO S.A. IND COM DE ALIMENTOS	NOVO MERCADO	1.943.880,00	0,06%	Enquadrado	66.800	0	66.800	0,02%	0,02%	Enquadrado
MGLU	MAGAZINE LUIZA S.A.	NOVO MERCADO	5.497.590,00	0,18%	Enquadrado	141.000	0	141.000	0,01%	0,01%	Enquadrado
NEOE	NEOENERGIA S.A.	NOVO MERCADO	10.484.181,00	0,34%	Enquadrado	609.900	0	609.900	0,05%	0,05%	Enquadrado
NTCO	NATURA & CO HOLDING S.A.	NOVO MERCADO	4.844.268,00	0,16%	Enquadrado	188.200	0	188.200	0,02%	0,02%	Enquadrado
PCAR	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO	NOVO MERCADO	9.493.254,00	0,30%	Enquadrado	143.100	0	143.100	0,05%	0,05%	Enquadrado
PETR	PETROLEO BRASILEIRO S.A. PETROBRAS	BOVESPA NIVEL 2	26.358.088,40	0,85%	Enquadrado	495.000	1.383.759	1.878.759	0,01%	0,01%	Enquadrado
RADL	RAIA DROGASIL S.A.	NOVO MERCADO	4.674.915,00	0,15%	Enquadrado	45.900	0	45.900	0,01%	0,01%	Enquadrado
RAIL	RUMO S.A.	NOVO MERCADO	22.697.714,99	0,73%	Enquadrado	1.155.100	0	1.155.100	0,07%	0,07%	Enquadrado
RENT	LOCALIZA RENT A CAR S.A.	NOVO MERCADO	7.052.345,00	0,23%	Enquadrado	268.150	0	268.150	0,04%	0,04%	Enquadrado
SAPR	CIA SANEAMENTO DO PARANA - SANEPAR	BOVESPA NIVEL 2	10.610.865,00	0,34%	Enquadrado	444.900	1.779.600	2.224.500	0,00%	0,03%	Enquadrado
TIMP	TIM PARTICIPACOES S.A.	NOVO MERCADO	5.753.500,00	0,18%	Enquadrado	462.500	0	462.500	0,02%	0,02%	Enquadrado
TOTS	TOTVS S.A.	NOVO MERCADO	19.166.807,99	0,62%	Enquadrado	410.600	0	410.600	0,21%	0,21%	Enquadrado
VALE	VALE S.A.	NOVO MERCADO	54.072.325,88	1,74%	Enquadrado	1.251.095	0	1.251.095	0,02%	0,02%	Enquadrado
VIVT	TELEFÔNICA BRASIL S.A	BOLSA	10.513.070,00	0,34%	Enquadrado	0	212.600	212.600	0,00%	0,00%	Enquadrado
WEGE	WEG S.A.	NOVO MERCADO	6.163.452,00	0,20%	Enquadrado	183.600	0	183.600	0,01%	0,01%	Enquadrado
YDUQ	ESTACIO PARTICIPACOES S.A.	NOVO MERCADO	4.915.089,00	0,16%	Enquadrado	221.700	0	221.700	0,07%	0,07%	Enquadrado

Relatório de Diversificação de Renda Fixa - Instituição Financeira

Referencia

31/03/2020

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

Patrimônio Líquido da Fundação	3.115.511.672,91
---------------------------------------	-------------------------

Papel	Aplicação Atual	PL da Instituição	% Instituição	Status	% Fundação	Status
BANCO BRADESCO S.A						
LF252	32.611.149,29					
Total	32.611.149,29	139.403.014.000,00	0,02%	Enquadrado	1,05%	Enquadrado
BANCO ITAÚ S.A.						
LF252	31.484.200,03					
Total	31.484.200,03	138.588.384.000,00	0,02%	Enquadrado	1,01%	Enquadrado
BANCO VOTORANTIM						
LF252	39.450.093,32					
Total	39.450.093,32	10.146.659.000,00	0,39%	Enquadrado	1,27%	Enquadrado
BCO BRASIL SA						
LF252	10.445.875,85					
Total	10.445.875,85	94.812.626.000,00	0,01%	Enquadrado	0,34%	Enquadrado
BCO ITAU SA						
LF252	7.345.334,14					
Total	7.345.334,14	138.588.384.000,00	0,01%	Enquadrado	0,24%	Enquadrado
BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA						
CDB	5.388.180,37					
Total	5.388.180,37	1.855.549.000,00	0,29%	Enquadrado	0,17%	Enquadrado
CAIXA ECONOMICA FEDERAL						
LF252	1.818.561,98					
Total	1.818.561,98	48.542.507.000,00	0,00%	Enquadrado	0,06%	Enquadrado

Relatório de Diversificação de Fundos de Investimentos

Referencia

31/03/2020

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
CSHG GR LOUVEIRA FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		1.862.183,57	141.174.242,67	1,3191%	Enquadrado
FII BB VOTORANTIM CIDADE JARDIM CONTINENTAL TOWER		2.875.622,01	156.913.697,56	1,8326%	Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - VBI LOGÍSTICO		43.243,76	775.061.197,16	0,0056%	Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO BTG PACTUAL SHOPPINGS		1.235.380,00	436.293.999,25	0,2832%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM BRASCAN LAJES CORPORATIVAS FII		829.857,60	93.906.205,50	0,8837%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM CENESP FII		968.814,00	282.487.658,88	0,3430%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII CEO CYRELA COMMERCIAL PROPERTIES		300.321,00	178.455.907,79	0,1683%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO GENERAL SHOPPING ATIVO RENDA FII		1.758.005,11	281.374.287,93	0,6248%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO MAX RETAIL		952.729,00	132.617.302,88	0,7184%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA		1.964.700,01	590.033.702,67	0,3330%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO NEGRO FII		387.669,10	274.428.577,05	0,1413%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO VIA PARQUE SHOPPING		1.877.122,51	600.578.628,62	0,3126%	Enquadrado
FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII SHOPPING JARDIM SUL		1.244.886,50	228.341.214,20	0,5452%	Enquadrado
HSI MALLS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO		86.392,85	1.515.648.680,24	0,0057%	Enquadrado
MALLS BRASIL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO		395.751,16	799.105.520,96	0,0495%	Enquadrado
NEWPORT RENDA URBANA FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO		663.135,00	65.514.984,43	1,0122%	Enquadrado
RB CAPITAL GENERAL SHOPPING SULACAP FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		1.529.317,99	93.284.753,48	1,6394%	Enquadrado
SDI LOGISTICA RIO FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		419.480,10	455.237.326,55	0,0921%	Enquadrado
SDI PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO		1.820.025,47	349.136.649,98	0,5213%	Enquadrado
TRX REAL ESTATE FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO		1.269.984,00	189.249.901,68	0,6711%	Enquadrado
TRX REALTY LOGISTICA RENDA I FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		2.143.815,13	341.058.328,99	0,6286%	Enquadrado
VINCI SHOPPING CENTERS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII		332.112,40	1.740.581.862,06	0,0191%	Enquadrado
XP INDUSTRIAL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO		110.825,82	717.274.539,29	0,0155%	Enquadrado

Fundo	Administrador	Valor Aplicado R\$	PL da Fundação R\$	% PL da Fundação	Status
CSHG GR LOUVEIRA FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		1.862.183,57	3.115.511.672,91	0,0598%	Enquadrado
FII BB VOTORANTIM CIDADE JARDIM CONTINENTAL TOWER		2.875.622,01	3.115.511.672,91	0,0923%	Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - VBI LOGÍSTICO		43.243,76	3.115.511.672,91	0,0014%	Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO BTG PACTUAL SHOPPINGS		1.235.380,00	3.115.511.672,91	0,0397%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM BRASCAN LAJES CORPORATIVAS FII		829.857,60	3.115.511.672,91	0,0266%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM CENESP FII		968.814,00	3.115.511.672,91	0,0311%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII CEO CYRELA COMMERCIAL PROPERTIES		300.321,00	3.115.511.672,91	0,0096%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO GENERAL SHOPPING ATIVO RENDA FII		1.758.005,11	3.115.511.672,91	0,0564%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO MAX RETAIL		952.729,00	3.115.511.672,91	0,0306%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA		1.964.700,01	3.115.511.672,91	0,0631%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO NEGRO FII		387.669,10	3.115.511.672,91	0,0124%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO VIA PARQUE SHOPPING		1.877.122,51	3.115.511.672,91	0,0603%	Enquadrado
FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII SHOPPING JARDIM SUL		1.244.886,50	3.115.511.672,91	0,0400%	Enquadrado
HSI MALLS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO		86.392,85	3.115.511.672,91	0,0028%	Enquadrado
MALLS BRASIL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO		395.751,16	3.115.511.672,91	0,0127%	Enquadrado
NEWPORT RENDA URBANA FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO		663.135,00	3.115.511.672,91	0,0213%	Enquadrado
RB CAPITAL GENERAL SHOPPING SULACAP FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		1.529.317,99	3.115.511.672,91	0,0491%	Enquadrado
SDI LOGISTICA RIO FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		419.480,10	3.115.511.672,91	0,0135%	Enquadrado
SDI PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO		1.820.025,47	3.115.511.672,91	0,0584%	Enquadrado
TRX REAL ESTATE FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO		1.269.984,00	3.115.511.672,91	0,0408%	Enquadrado
TRX REALTY LOGISTICA RENDA I FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		2.143.815,13	3.115.511.672,91	0,0688%	Enquadrado
VINCI SHOPPING CENTERS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII		332.112,40	3.115.511.672,91	0,0107%	Enquadrado
XP INDUSTRIAL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO		110.825,82	3.115.511.672,91	0,0036%	Enquadrado

Relatório de Alocação por Grupo Econômico

Referencia

31/03/2020

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

Patrimônio Líquido da Fundação	3.115.511.672,91
---------------------------------------	-------------------------

Grupo Econômico	Aplicação Atual	% Fundação	Status
Grupo Banco do Brasil			
LF252 - BANCO VOTORANTIM	39.450.093,32		
Ações - BANCO DO BRASIL S.A.	13.389.989,00		
Total	52.840.082,32	1,70%	Enquadrado
Grupo Bradesco			
LF252 - BANCO BRADESCO S.A	32.611.149,29		
Ações - BANCO BRADESCO S.A	34.919.437,87		
Total	67.530.587,16	2,17%	Enquadrado
Grupo BTG Pactual			
Ações - BANCO BTG PACTUAL	9.403.596,00		
Total	9.403.596,00	0,30%	Enquadrado
Grupo Cemig			
Debentures - CEMIG GERAÇÃO E TRANSMISSÃO SA	8.936.954,04		
Debentures - GRUPO CEMIG	10.440.168,39		
Ações - GRUPO CEMIG	4.683.987,00		
Total	24.061.109,43	0,77%	Enquadrado
Grupo Itaú			
LF252 - BANCO ITAÚ S.A.	31.484.200,03		
Ações - BANCO ITAÚ S.A.	38.417.996,32		
Total	69.902.196,35	2,24%	Enquadrado
Grupo Vale do Rio Doce			
Ações - VALE SA	54.072.325,88		
Total	54.072.325,88	1,74%	Enquadrado