Relatório de Enquadramentos Legais da Carteira de Investimentos da EMBRAER PREV

Relatório de Política de Investimento - EMBRAER PREV

Referência: 31/12/2019

Renda Fixa	**2.435.666.826,87**
Renda Variável	**748.617.164,46**
Estruturado	**-**
Exterior	**-**
Imóveis	**153.938.857,24**
Empréstimos e Financiamentos	**36.275.302,37**
Contas Receber e Pagar	**21.639.930,54**
Derivativos	**649.983,77**
Patrimônio Líquido da Fundação	**3.396.788.065,25**

Segmento	Aplicação	% PL da Fundação	% Mínimo	% Máximo	Status
Renda Fixa	2.435.666.826,87	71,70%	35,00%	100,00%	Enquadrado
Renda Variável	748.617.164,46	22,04%	0,00%	50,00%	Enquadrado
Estruturado	-	0,00%	0,00%	20,00%	Enquadrado
Exterior	-	0,00%	0,00%	10,00%	Enquadrado
Imobiliário	153.938.857,24	4,53%	0,00%	20,00%	Enquadrado
Operações com Participantes	36.275.302,37	1,07%	0,00%	15,00%	Enquadrado
Contas Receber e Pagar	21.639.930,54	0,64%	N/A	N/A	N/A
Derivativos	649.983,77	0,02%	N/A	N/A	N/A

Relatório de Enquadramento dos Investimentos - EMBRAER PREV

Referencia	31/12/2019
Patrimônio Líquido .....:	3.396.788.065,25

Renda Fixa	Valor Aplicado	Aplicado (%)	Limite 4.661 (%)	Enquadramento
Renda Fixa - Títulos Públicos - Federais				
LFT	342.876.647,33	10,09%		
LTN	142.552.471,88	4,20%		
NTN_B	1.365.125.006,91	40,19%		
NTN_F	46.978.665,59	1,38%		
Total ..... :	1.897.532.791,71	55,86%	100,00%	Enquadrado
Renda Fixa - Títulos Públicos	1.897.532.791,71	55,86%	100,00%	Enquadrado
Renda Fixa - Títulos Privados - TVM de Instituição Financeira / Poupança				
CDB	20.744.160,45	0,61%		
LF252	125.466.403,94	3,69%		
Total ..... :	146.210.564,39			
Renda Fixa - FIDC / FIC				
Cotas FIDC	26.993.048,85	0,79%		
Total ..... :	26.993.048,85	0,79%	20,00%	Enquadrado
Renda Fixa - Títulos Privados - TVM de Companhias Abertas / Securitizadoras				
Debentures	364.930.421,92	10,74%		
Total ..... :	364.930.421,92			
Renda Fixa - Títulos Privados	538.134.035,16	15,84%	80,00%	Enquadrado
Renda Fixa	2.435.666.826,87	71,70%	100,00%	Enquadrado

Renda Variável	Valor Aplicado	Aplicado (%)	Limite 4.661 (%)	Enquadramento
AÇÕES DE MERCADO				
Ações / FI de Segmento Especial				
BOVESPA NIVEL 1	157.561.244,18	4,64%		
BOVESPA NIVEL 2	144.444.695,62	4,25%		
NOVO MERCADO	401.592.550,31	11,82%		
Total ..... :	703.598.490,11	20,71%	70,00%	Enquadrado
Ações / FI sem Segmento Especial				
OUTROS	45.018.674,35	1,33%		
Total ..... :	45.018.674,35	1,33%	50,00%	Enquadrado

Renda Variável	748.617.164,46	22,04%	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	108.770.688,40	3,20%		
Imobiliário				
Imobiliário - CRI	43.008.415,86	1,27%		

Imobiliário	153.938.857,24	4,53%	20,00%	Enquadrado

Empréstimos e Financiamento	Valor Aplicado	Aplicado (%)	Limite 4.661 (%)	Enquadramento
Empréstimos e Fin. Imobiliários				
Empréstimos	36.275.302,37	1,07%		

Empréstimos e Financiamentos Imobiliários	36.275.302,37	1,07%	15,00%	Enquadrado

Derivativos	Valor Aplicado	Aplicado (%)	Limite 4.661 (%)	Enquadramento
Derivativos				
Futuros	19.845.162,94	0,58%		
Opções	649.983,77	0,02%		

Derivativos	649.983,77	0,60%	100,00%	Enquadrado

Receitas e Despesas	Valor Aplicado	Aplicado (%)	Limite 4.661 (%)	Enquadramento
Contas Receber / Pagar				
Contas Receber / Pagar	4.995.316,87	0,15%		
Caixa				
Caixa	16.644.613,67	0,49%		

Contas Receber e Pagar	21.639.930,54

Total Geral dos Ativos	**3.396.788.065,25**	**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	3.396.788.065,25

Tópico do Enquadramento	Limite	Aplicação Atual	Valor Limite	% Aplicado	Status
% do Segmento RF/PL PLANO	100,00%	2.435.666.826,87	3.396.788.065,25	71,70%	Enquadrado
% do PL em Títulos de Emissão do Tesouro Nacional e/ou do BACEN	100,00%	1.897.532.791,71	3.396.788.065,25	55,86%	Enquadrado
% do PL em Títulos RF1, exceto títulos do Tesouro Nacional	80,00%	538.134.035,16	2.717.430.492,69	15,84%	Enquadrado
% do PL em FIDC	20,00%	Verificar Rel. de Diversificação de FIDC´s	679.357.623,17	0,00%	Enquadrado
% do PL em uma mesma pessoa jurídica não-financeira	10,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Não Financ.	339.678.811,59	0,00%	Enquadrado
% do PL em Instituições Financeiras	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Financ.	849.197.016,31	0,00%	Enquadrado
% de uma mesma Série de Debêntures	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Debêntures	849.197.016,31	0,00%	Enquadrado
% do PL em RV	70,00%	748.617.164,46	2.377.751.605,18	22,04%	Enquadrado
% do capital votante de uma empresa	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação RV	849.197.016,31	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Imobiliários	20,00%	153.938.857,24	679.357.623,17	4,53%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Empréstimos	15,00%	36.275.302,37	509.518.230,03	1,07%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Estruturados	20,00%	0,00	679.357.623,17	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos no Exterior	10,00%	0,00	339.678.811,59	0,00%	Enquadrado

Relatório de Diversificação - Debêntures

Referencia 31/12/2019

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
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
SBESB7	CIA SANEAMENTO BASICO EST. SP - SABESP	659,00	39.523	1,6674%	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 31/12/2019

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
CHEMICAL IX FIDC INDUSTRIA PETROQUIMICA	BEM DTVM	1.299.768,42	555.819.338,91	0,2338%	Enquadrado
CELG DISTRIBUICAO FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS	OLIVEIRA TRUST	10.043.378,55	115.607.235,05	8,6875%	Enquadrado
FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS SANEAMENTO GOIAS SA - INFRAESTRUTURA IV	OLIVEIRA TRUST	8.746.200,98	323.334.601,73	2,7050%	Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	OLIVEIRA TRUST	6.903.700,90	120.064.363,43	5,7500%	Enquadrado

Fundo	Instituição Proprietária	Valor Aplicado R$	PL da Fundação R$	% PL da Fundação	Status
CHEMICAL IX FIDC INDUSTRIA PETROQUIMICA	BEM DTVM	1.299.768,42	3.396.788.065,25	0,0383%	Enquadrado
CELG DISTRIBUICAO FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS	OLIVEIRA TRUST	10.043.378,55	3.396.788.065,25	0,2957%	Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	OLIVEIRA TRUST	6.903.700,90	3.396.788.065,25	0,2032%	Enquadrado
FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS SANEAMENTO GOIAS SA - INFRAESTRUTURA IV	OLIVEIRA TRUST	8.746.200,98	3.396.788.065,25	0,2575%	Enquadrado

Fundação	PL Total da Fundação - R$	Total Aplicado em FIDC R$	% PL da Fundação	Status
Fundação	3.396.788.065,25	26.993.048,85	0,7947%	Enquadrado

Relatório de Diversificação de Renda Fixa - Instituição não Financeira

Referencia 31/12/2019

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

Patrimônio Líquido da Fundação	3.396.788.065,25
Total de Instituição não Financeira	407.938.837,78
% Pl da Fundação	12,01%

Papel	Aplicação Atual	% Aplicado	Status
CRI	43.008.415,86	1,27%	
HABITASEC SECURITIZADORA SA	32.660.535,99	0,96%	Enquadrado
RB CAPITAL COMPANHIA SECURITIZACAO	10.347.879,87	0,30%	Enquadrado
Debentures	364.930.421,92	10,74%	
AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	11.364.110,80	0,33%	Enquadrado
AES TIETE ENERGIA SA	1.996.831,88	0,06%	Enquadrado
ALUPAR INVESTIMENTO S.A	2.510.130,60	0,07%	Enquadrado
AMPLA ENERGIA SERVICOS SA	1.222.307,77	0,04%	Enquadrado
CACHOEIRA PAULISTA TRANSMISSORA ENERGIA SA	7.570.756,05	0,22%	Enquadrado
CCR SA	4.896.515,26	0,14%	Enquadrado
CEMIG GERACAO TRANSMISSAO SA	13.849.599,83	0,41%	Enquadrado
CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	4.012.740,65	0,12%	Enquadrado
CIA GAS SAO PAULO COMGAS	39.299.265,24	1,16%	Enquadrado
CIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	5.038.190,83	0,15%	Enquadrado
CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	12.726.179,13	0,37%	Enquadrado
COMPANHIA ENERGETICA JAGUARA	1.639.316,95	0,05%	Enquadrado
COMPANHIA ENERGETICA MIRANDA	969.408,86	0,03%	Enquadrado
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	26.514.706,87	0,78%	Enquadrado
COMPANHIA SANEAMENTO PARANA SANEPAR	1.059.305,49	0,03%	Enquadrado
CONCESSIONARIA AUTO RAPOSO TAVARES SA	18.965.387,44	0,56%	Enquadrado
CONCESSIONARIA RODOVIAS AYRTON SENNA CARVALHO PINTO SA ECOPISTAS	12.844.415,45	0,38%	Enquadrado
DIAGNOSTICOS AMERICA SA	1.946.867,92	0,06%	Enquadrado
DUKE ENERGY INTERNATIONAL GERACAO PARANAPANEMA SA	22.416.002,74	0,66%	Enquadrado
ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	13.121.933,16	0,39%	Enquadrado
ENERGISA MATO GROSSO SUL - DISTRIBUIDORA ENERGIA S.A	803.138,72	0,02%	Enquadrado
ENTREVIAS CONCESSIONARIA RODOVIAS S.A	12.435.891,67	0,37%	Enquadrado
EQUATORIAL ENERGIA SA	672.853,66	0,02%	Enquadrado
ERDV	7.745.397,47	0,23%	Enquadrado
GRUPO CEMIG	19.226.257,72	0,57%	Enquadrado
GUARARAPES CONFECCOES SA (EX CONFECCOES GUARARAPES SA)	1.341.447,83	0,04%	Enquadrado
IGUATEMI EMPRESA SHOPPING CENTERS SA	8.036.511,87	0,24%	Enquadrado
JSL SA	818.836,39	0,02%	Enquadrado
LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	15.087.405,42	0,44%	Enquadrado
LOCALIZA RENT A CAR SA	1.127.055,07	0,03%	Enquadrado

LOJAS AMERICANAS SA	23.124.451,53	0,68%	Enquadrado
MOVIDA PARTICIPACOES	1.174.761,52	0,03%	Enquadrado
NATURA COSMETICOS SA	1.775.859,11	0,05%	Enquadrado
NCF PARTICIPACOES SA	3.002.152,29	0,09%	Enquadrado
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	14.490.171,29	0,43%	Enquadrado
RAIZEN ENERGIA SA	645.656,02	0,02%	Enquadrado
RODOVIAS COLINAS SA	14.896.272,25	0,44%	Enquadrado
SABER SERVICOS EDUCACIONAIS SA	1.064.067,10	0,03%	Enquadrado
SONAE SIERRA BRASIL SA	1.106.264,83	0,03%	Enquadrado
SUL AMERICA SA	6.330.564,95	0,19%	Enquadrado
TELEFONICA BRASIL SA	5.332.593,00	0,16%	Enquadrado
TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA SA	15.314.497,84	0,45%	Enquadrado
TRIANGULO SOL AUTO ESTRADAS SA	347.879,71	0,01%	Enquadrado
USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMINAS	5.066.461,74	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	**3.396.788.065,25**

Mercado	Cód. Bovespa	Valor Aplicado	% PL Fundação	Status
Ações Segmento Especial	NM, N2, N1, Mais, Mais2 ...	703.598.490,11	20,71%	Enquadrado
Ações s/ Segmento Especial		45.018.674,35	1,33%	Enquadrado
Total		**748.617.164,46**	**22,04%**	**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	3.396.788.065,25

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	27.325.505,35	0,80%	Enquadrado	1.463.605	0	1.463.605	0,01%	0,01%	Enquadrado
AZUL	AZUL S.A.	BOVESPA NIVEL 2	7.488.980,00	0,22%	Enquadrado	0	128.500	128.500	0,00%	0,00%	Enquadrado
B3SA	B3 S.A. - BRASIL, BOLSA, BALCÃO	NOVO MERCADO	24.395.916,71	0,72%	Enquadrado	567.743	0	567.743	0,03%	0,03%	Enquadrado
BBAS	BCO BRASIL S.A.	NOVO MERCADO	16.051.998,00	0,47%	Enquadrado	303.900	0	303.900	0,01%	0,01%	Enquadrado
BBDC	BCO BRADESCO S.A.	BOVESPA NIVEL 1	48.523.646,48	1,43%	Enquadrado	0	1.341.544	1.341.544	0,00%	0,00%	Enquadrado
BPAC	BCO BTG PACTUAL S.A.	BOVESPA NIVEL 2	31.510.207,00	0,93%	Enquadrado	413.900	827.800	1.241.700	0,00%	0,02%	Enquadrado
BRDT	PETROBRAS DISTRIBUIDORA S/A	NOVO MERCADO	4.483.437,00	0,13%	Enquadrado	149.100	0	149.100	0,01%	0,01%	Enquadrado
BRFS	BRF S.A.	NOVO MERCADO	15.762.560,00	0,46%	Enquadrado	447.800	0	447.800	0,06%	0,06%	Enquadrado
BRPR	BR PROPERTIES S.A.	NOVO MERCADO	9.174.528,00	0,27%	Enquadrado	633.600	0	633.600	0,13%	0,13%	Enquadrado
BTOW	B2W - COMPANHIA DIGITAL	NOVO MERCADO	37.138.002,30	1,09%	Enquadrado	590.805	0	590.805	0,11%	0,11%	Enquadrado
CCRO	CCR S.A.	NOVO MERCADO	23.265.684,00	0,68%	Enquadrado	1.225.800	0	1.225.800	0,06%	0,06%	Enquadrado
CESP	CESP - CIA ENERGETICA DE SAO PAULO	BOVESPA NIVEL 1	3.941.396,00	0,12%	Enquadrado	0	123.400	123.400	0,00%	0,00%	Enquadrado
CMIG	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS - CEMIG	BOVESPA NIVEL 1	2.262.109,00	0,07%	Enquadrado	145.100	0	145.100	0,03%	0,01%	Enquadrado
COGN	COGNA EDUCAÇÃO S.A.	NOVO MERCADO	16.027.146,00	0,47%	Enquadrado	1.402.200	0	1.402.200	0,09%	0,09%	Enquadrado
CPFE	CPFL ENERGIA S.A.	NOVO MERCADO	8.510.670,00	0,25%	Enquadrado	239.400	0	239.400	0,02%	0,02%	Enquadrado
CSNA	CIA SIDERURGICA NACIONAL	BOLSA	7.575.659,00	0,22%	Enquadrado	536.900	0	536.900	0,04%	0,04%	Enquadrado
ENGI	ENERGISA S.A.	BOVESPA NIVEL 2	8.243.620,00	0,24%	Enquadrado	154.000	616.000	770.000	0,00%	0,01%	Enquadrado
EVEN	EVEN CONSTRUTORA E INCORPORADORA S.A.	NOVO MERCADO	11.949.768,80	0,35%	Enquadrado	767.980	0	767.980	0,35%	0,35%	Enquadrado
EZTC	EZ TEC EMPREEND. E PARTICIPACOES S.A.	NOVO MERCADO	8.361.090,00	0,25%	Enquadrado	161.100	0	161.100	0,07%	0,07%	Enquadrado
GGBR	GERDAU S.A.	BOVESPA NIVEL 1	7.890.000,00	0,23%	Enquadrado	0	394.500	394.500	0,00%	0,00%	Enquadrado
HAPV	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	NOVO MERCADO	29.125.939,50	0,86%	Enquadrado	455.805	0	455.805	0,06%	0,06%	Enquadrado
IRBR	IRB - BRASIL RESSEGUROS S.A.	NOVO MERCADO	12.549.690,00	0,37%	Enquadrado	322.200	0	322.200	0,03%	0,03%	Enquadrado
ITUB	ITAU UNIBANCO HOLDING S.A.	BOVESPA NIVEL 1	74.223.632,70	2,19%	Enquadrado	0	2.000.637	2.000.637	0,00%	0,00%	Enquadrado
JBSS	JBS S.A.	NOVO MERCADO	16.927.380,00	0,50%	Enquadrado	656.100	0	656.100	0,02%	0,02%	Enquadrado
LREN	LOJAS RENNER S.A.	NOVO MERCADO	11.783.043,00	0,35%	Enquadrado	209.700	0	209.700	0,03%	0,03%	Enquadrado
NEOE	NEOENERGIA S.A.	NOVO MERCADO	14.417.960,00	0,42%	Enquadrado	579.500	0	579.500	0,05%	0,05%	Enquadrado
PCAR	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO	BOVESPA NIVEL 1	20.720.460,00	0,61%	Enquadrado	0	236.400	236.400	0,00%	0,00%	Enquadrado
PETR	PETROLEO BRASILEIRO S.A. PETROBRAS	BOVESPA NIVEL 2	80.680.570,62	2,38%	Enquadrado	365.700	2.285.559	2.651.259	0,00%	0,02%	Enquadrado
RAIL	RUMO S.A.	NOVO MERCADO	26.376.660,00	0,78%	Enquadrado	1.010.600	0	1.010.600	0,06%	0,06%	Enquadrado
RENT	LOCALIZA RENT A CAR S.A.	NOVO MERCADO	21.654.517,50	0,64%	Enquadrado	456.750	0	456.750	0,06%	0,06%	Enquadrado
SAPR	CIA SANEAMENTO DO PARANA - SANEPAR	BOVESPA NIVEL 2	16.521.318,00	0,49%	Enquadrado	162.900	651.600	814.500	0,00%	0,03%	Enquadrado
SUZB	SUZANO S.A.	NOVO MERCADO	23.022.336,00	0,68%	Enquadrado	580.200	0	580.200	0,04%	0,04%	Enquadrado
TOTS	TOTVS S.A.	NOVO MERCADO	29.680.090,00	0,87%	Enquadrado	459.800	0	459.800	0,24%	0,24%	Enquadrado
VALE	VALE S.A.	NOVO MERCADO	40.934.133,50	1,21%	Enquadrado	767.995	0	767.995	0,01%	0,01%	Enquadrado
VIVT	TELEFÔNICA BRASIL S.A	BOLSA	10.117.510,00	0,30%	Enquadrado	0	174.500	174.500	0,00%	0,00%	Enquadrado

Relatório de Diversificação de Renda Fixa - Instituição Financeira

Referencia 31/12/2019

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

Patrimônio Líquido da Fundação	3.396.788.065,25

Papel	Aplicação Atual	PL da Instituição	% Instituição	Status	% Fundação	Status
BANCO ABC BRASIL S/A						
LF252	1.792.559,63					
Total	**1.792.559,63**	**3.956.286.000,00**	**0,05%**	**Enquadrado**	**0,05%**	**Enquadrado**
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S/A						
LF252	3.530.024,30					
Total	**3.530.024,30**	**2.831.114.000,00**	**0,12%**	**Enquadrado**	**0,10%**	**Enquadrado**
BANCO BRADESCO S.A						
LF252	31.816.603,79					
Total	**31.816.603,79**	**139.403.014.000,00**	**0,02%**	**Enquadrado**	**0,94%**	**Enquadrado**
BANCO ITAÚ S.A.						
LF252	30.446.915,99					
Total	**30.446.915,99**	**138.588.384.000,00**	**0,02%**	**Enquadrado**	**0,90%**	**Enquadrado**
BANCO MERCEDES-BENZ DO BRASIL S/A						
CDB	18.675.722,50					
Total	**18.675.722,50**	**1.855.549.000,00**	**1,01%**	**Enquadrado**	**0,39%**	**Enquadrado**
BANCO VOTORANTIM						
LF252	38.150.963,96					
Total	**38.150.963,96**	**10.146.659.000,00**	**0,38%**	**Enquadrado**	**1,12%**	**Enquadrado**
BCO BRASIL SA						
LF252	10.194.300,90					
Total	**10.194.300,90**	**94.812.626.000,00**	**0,01%**	**Enquadrado**	**0,30%**	**Enquadrado**
BCO ITAU SA						
LF252	7.709.068,16					
Total	**7.709.068,16**	**138.588.384.000,00**	**0,01%**	**Enquadrado**	**0,23%**	**Enquadrado**
BCO VOLKSWAGEN SA						
CDB	2.068.437,95					
Total	**2.068.437,95**	**2.972.763.000,00**	**0,07%**	**Enquadrado**	**0,06%**	**Enquadrado**
CAIXA ECONOMICA FEDERAL						
LF252	1.825.967,21					
Total	**1.825.967,21**	**48.542.507.000,00**	**0,00%**	**Enquadrado**	**0,05%**	**Enquadrado**

Relatório de Diversificação de Fundos de Investimentos

Referencia 31/12/2019

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		2.143.675,00	120.808.134,54	1,7744%	Enquadrado
CSHG GR LOUVEIRA FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		4.040.228,90	141.120.089,57	2,8630%	Enquadrado
FII BB VOTORANTIM CIDADE JARDIM CONTINENTAL TOWER		5.478.030,00	270.777.688,86	2,0231%	Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - VBI LOGÍSTICO		5.186.183,40	775.031.170,95	0,6692%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM BRASCAN LAJES CORPORATIVAS FII		2.031.777,12	141.120.089,57	1,4398%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM CENESP FII		2.344.011,42	281.565.167,58	0,8325%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII CEO CYRELA COMMERCIAL PROPERTIES		1.551.493,00	159.921.673,10	0,9702%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO GENERAL SHOPPING ATIVO RENDA FII		5.155.044,18	263.776.084,90	1,9543%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO MAX RETAIL		2.616.109,00	105.186.564,76	2,4871%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA		10.050.042,21	591.373.429,54	1,6994%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO NEGRO FII		1.029.345,92	274.103.902,08	0,3755%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO VIA PARQUE SHOPPING		5.178.962,70	526.233.317,29	0,9842%	Enquadrado
FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII SHOPPING JARDIM SUL		3.532.244,40	209.086.823,15	1,6894%	Enquadrado
HSI MALLS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO		6.220.776,00	1.024.227.982,09	0,6074%	Enquadrado
MALLS BRASIL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO		17.420.657,10	797.598.787,18	2,1841%	Enquadrado
RB CAPITAL GENERAL SHOPPING SULACAP FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		3.674.076,00	92.742.395,44	3,9616%	Enquadrado
RENDA ESCRITORIOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII		1.497.105,90	56.957.415,25	2,6285%	Enquadrado
SDI LOGISTICA RIO FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		1.844.850,00	456.064.750,33	0,4045%	Enquadrado
SDI PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO		5.244.084,00	349.832.287,64	1,4990%	Enquadrado
TRX REALTY LOGISTICA RENDA I FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		6.143.683,85	54.277.437,57	11,3190%	Enquadrado
VINCI SHOPPING CENTERS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII		5.115.674,30	1.268.833.478,49	0,4032%	Enquadrado
XP MALLS FUNDO INVESTIMENTOS IMOBILIARIOS		11.272.634,00	1.889.981.397,23	0,5964%	Enquadrado

Fundo	Administrador	Valor Aplicado R$	PL da Fundação R$	% PL da Fundação	Status
CASTELLO BRANCO OFFICE PARK FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		2.143.675,00	3.396.788.065,25	0,0631%	Enquadrado
CSHG GR LOUVEIRA FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		4.040.228,90	3.396.788.065,25	0,1189%	Enquadrado
FII BB VOTORANTIM CIDADE JARDIM CONTINENTAL TOWER		5.478.030,00	3.396.788.065,25	0,1613%	Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - VBI LOGÍSTICO		5.186.183,40	3.396.788.065,25	0,1527%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM BRASCAN LAJES CORPORATIVAS FII		2.031.777,12	3.396.788.065,25	0,0598%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM CENESP FII		2.344.011,42	3.396.788.065,25	0,0690%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII CEO CYRELA COMMERCIAL PROPERTIES		1.551.493,00	3.396.788.065,25	0,0457%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO GENERAL SHOPPING ATIVO RENDA FII		5.155.044,18	3.396.788.065,25	0,1518%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO MAX RETAIL		2.616.109,00	3.396.788.065,25	0,0770%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA		10.050.042,21	3.396.788.065,25	0,2959%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO NEGRO FII		1.029.345,92	3.396.788.065,25	0,0303%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO VIA PARQUE SHOPPING		5.178.962,70	3.396.788.065,25	0,1525%	Enquadrado
FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII SHOPPING JARDIM SUL		3.532.244,40	3.396.788.065,25	0,1040%	Enquadrado
HSI MALLS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO		6.220.776,00	3.396.788.065,25	0,1831%	Enquadrado
MALLS BRASIL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO		17.420.657,10	3.396.788.065,25	0,5129%	Enquadrado
RB CAPITAL GENERAL SHOPPING SULACAP FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		3.674.076,00	3.396.788.065,25	0,1082%	Enquadrado
RENDA ESCRITORIOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII		1.497.105,90	3.396.788.065,25	0,0441%	Enquadrado
SDI LOGISTICA RIO FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		1.844.850,00	3.396.788.065,25	0,0543%	Enquadrado
SDI PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO		5.244.084,00	3.396.788.065,25	0,1544%	Enquadrado
TRX REALTY LOGISTICA RENDA I FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		6.143.683,85	3.396.788.065,25	0,1809%	Enquadrado
VINCI SHOPPING CENTERS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII		5.115.674,30	3.396.788.065,25	0,1506%	Enquadrado
XP MALLS FUNDO INVESTIMENTOS IMOBILIARIOS		11.272.634,00	3.396.788.065,25	0,3319%	Enquadrado

Relatório de Alocação por Grupo Econômico

Referencia 31/12/2019

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

Patrimônio Líquido da Fundação	3.396.788.065,25

Grupo Econômico	Aplicação Atual	% Fundação	Status
Grupo Banco do Brasil			
LF252 - BANCO VOTORANTIM	38.150.963,96		
Ações - BANCO DO BRASIL S.A.	16.051.998,00		
Total	**54.202.961,96**	**1,60%**	**Enquadrado**
Grupo BNP Paribas Brasil			
LF252 - BANCO BNP PARIBAS BRASIL S/A	3.530.024,30		
Total	**3.530.024,30**	**0,10%**	**Enquadrado**
Grupo BR Foods			
Ações - BRF BRASIL FOODS SA	15.762.560,00		
Total	**15.762.560,00**	**0,46%**	**Enquadrado**
Grupo Bradesco			
LF252 - BANCO BRADESCO S.A	31.816.603,79		
Ações - BANCO BRADESCO S.A	48.523.646,48		
Total	**80.340.250,27**	**2,37%**	**Enquadrado**
Grupo BTG Pactual			
Ações - BANCO BTG PACTUAL	31.510.207,00		
Total	**31.510.207,00**	**0,93%**	**Enquadrado**
Grupo Cemig			
Debentures - CEMIG GERAÇÃO E TRANSMISSÃO SA	13.849.599,83		
Debentures - GRUPO CEMIG	19.226.257,72		
Ações - GRUPO CEMIG	2.262.109,00		
Total	**35.337.966,55**	**1,04%**	**Enquadrado**
Grupo Itaú			
LF252 - BANCO ITAÚ S.A.	30.446.915,99		
Ações - BANCO ITAÚ S.A.	74.223.632,70		
Total	**104.670.548,69**	**3,08%**	**Enquadrado**
Grupo Vale do Rio Doce			
Ações - VALE SA	40.934.133,50		
Total	**40.934.133,50**	**1,21%**	**Enquadrado**